博时基金
BOSERA FUNDS

博时中证可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金
2024 年中期报告
2024 年 6 月 30 日

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年八月三十日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 1
1.1 重要提示 1
1.2 目录 2
§2 基金简介 4
2.1 基金基本情况 4
2.2 基金产品说明 4
2.3 基金管理人和基金托管人 4
2.4 信息披露方式 5
2.5 其他相关资料 5
§3 主要财务指标和基金净值表现 5
3.1 主要会计数据和财务指标 5
3.2 基金净值表现 5
§4 管理人报告 6
4.1 基金管理人及基金经理情况 6
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 11
§5 托管人报告 11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 11
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 11
6.1 资产负债表 11
6.2 利润表 13
6.3 净资产变动表 14
6.4 报表附注 15
§7 投资组合报告 31
7.1 期末基金资产组合情况 32
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 32
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 32
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 32
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 33
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 33
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 33
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 33
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 34
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 34
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 34
7.12 投资组合报告附注 34
§8 基金份额持有人信息 45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 45
8.2 期末上市基金前十名持有人 45
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 46
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 46
§9 开放式基金份额变动 46

§10 重大事件揭示 46
10.1 基金份额持有人大会决议 46
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 46
10.4 基金投资策略的改变 46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 47
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 47
10.8 其他重大事件 48
§11 影响投资者决策的其他重要信息 49
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 49
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 49
§12 备查文件目录 49
12.1 备查文件目录 49
12.2 存放地点 49
12.3 查阅方式 49

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博时中证可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	博时可转债 ETF
场内简称	可转债 ETF
基金主代码	511380
交易代码	511380
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020 年 3 月 6 日
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,093,186,670.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2020 年 4 月 7 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。本基金将采用抽样复制法，主要以标的指数的成份券构成为基础，综合考虑跟踪效果、流动性、操作风险等因素构建组合，并根据本基金资产规模、日常申购赎回情况、市场流动性等情况，进行抽样优化调整，达到复制标的指数、降低交易成本的目的。 本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.3%，年跟踪误差不超过 4%。对于出现市场流动性不足、因法律法规原因被限制投资等情况，导致本基金无法获得对个别成份债足够数量的投资时，基金管理人将通过投资其他成份券、非成份券、成份券个券衍生品等方式进行替代。其他投资策略包括固定收益品种投资策略，含利率策略、骑乘策略、放大策略、其他金融工具投资策略以及国债期货投资策略等。
业绩比较基准	中证可转债及可交换债券指数收益率
风险收益特征	本基金属于债券型基金，其预期收益及风险水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。本基金采用优化抽样复制策略，跟踪中证可转债及可交换债券指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		博时基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孙麒清	张姗
	联系电话	0755-83169999	400-61-95555
	电子邮箱	service@bosera.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		95105568	400-61-95555
传真		0755-83195140	0755-83195201
注册地址		深圳市福田区莲花街道福新社区益田路5999号基金大厦21层	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址		广东省深圳市福田区益田路5999号基金大厦21层	深圳市深南大道7088号招商银行大厦

邮政编码	518040	518040
法定代表人	江向阳	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.bosera.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	51,054,564.67
本期利润	36,551,728.10
加权平均基金份额本期利润	0.0503
本期加权平均净值利润率	0.46%
本期基金份额净值增长率	0.32%
3.1.2 期末数据和指标	**报告期末(2024 年 6 月 30 日)**
期末可供分配利润	1,086,093,530.32
期末可供分配基金份额利润	0.9935
期末基金资产净值	12,017,960,863.42
期末基金份额净值	10.9935
3.1.3 累计期末指标	**报告期末(2024 年 6 月 30 日)**
基金份额累计净值增长率	9.94%

注：本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

期末可供分配利润是指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

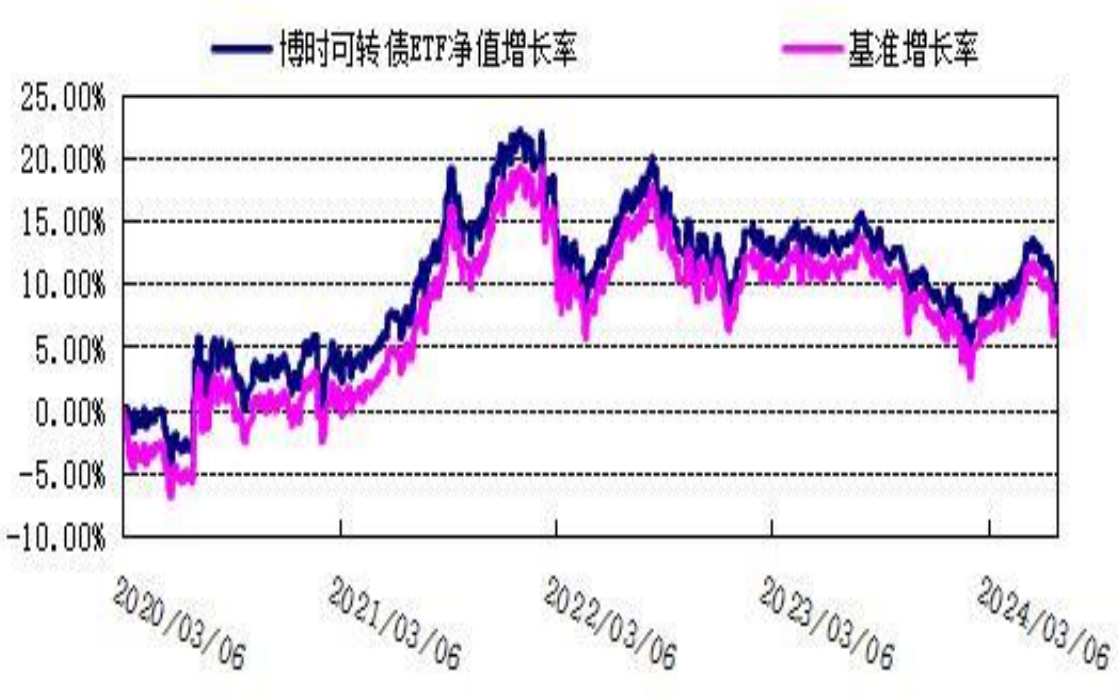
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	-2.56%	0.57%	-2.59%	0.59%	0.03%	-0.02%
过去三个月	0.92%	0.44%	0.89%	0.45%	0.03%	-0.01%
过去六个月	0.32%	0.45%	0.36%	0.46%	-0.04%	-0.01%

过去一年	-2.94%	0.40%	-2.95%	0.41%	0.01%	-0.01%
过去三年	2.02%	0.51%	3.02%	0.51%	-1.00%	0.00%
自基金合同生效起至今	9.94%	0.52%	8.11%	0.52%	1.83%	0.00%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。“为国民创造财富”是博时的使命。博时的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 2024 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理 385 只公募基金，并受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金，以及多个企业年金、职业年金及特定专户，管理资产总规模逾 16037 亿元人民币，剔除货币基金后，博时基金公募资产管理总规模逾 5965 亿元人民币，累计分红逾 2009 亿元人民币，是目前我国资产管理规模领先的基金公司之一。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
高晖	基金经理	2023-10-20	-	13.2	高晖先生，硕士。2011 年加入博时基金管理有限公司。现任博时转债增强债券型证券投资基金(2023 年

					10 月 20 日—至今)、博时中证可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金(2023 年 10 月 20 日—至今)、博时稳健回报债券型证券投资基金（LOF）(2023 年 10 月 20 日—至今)的基金经理。
过钧	首席基金经理/基金经理	2023-09-15	-	22.9	过钧先生，硕士。1995 年起先后在上海工艺品进出口公司、德国德累斯顿银行上海分行、美国 Lowes 食品有限公司、美国通用电气公司、华夏基金固定收益部工作。2005 年加入博时基金管理有限公司。历任博时稳定价值债券投资基金(2005 年 8 月 24 日-2010 年 8 月 4 日)基金经理、固定收益部副总经理、博时转债增强债券型证券投资基金(2010 年 11 月 24 日-2013 年 9 月 25 日)、博时亚洲票息收益债券型证券投资基金(2013 年 2 月 1 日-2014 年 4 月 2 日)、博时裕祥分级债券型证券投资基金(2014 年 1 月 8 日-2014 年 6 月 10 日)、博时双债增强债券型证券投资基金(2013 年 9 月 13 日-2015 年 7 月 16 日)、博时新财富混合型证券投资基金(2015 年 6 月 24 日-2016 年 7 月 4 日)、博时新机遇混合型证券投资基金(2016 年 3 月 29 日-2018 年 2 月 6 日)、博时新策略灵活配置混合型证券投资基金(2016 年 8 月 1 日-2018 年 2 月 6 日)、博时稳健回报债券型证券投资基金（LOF）(2014 年 6 月 10 日-2018 年 4 月 23 日)、博时双债增强债券型证券投资基金(2016 年 10 月 24 日-2018 年 5 月 5 日)、博时鑫润灵活配置混合型证券投资基金(2017 年 2 月 10 日-2018 年 5 月 21 日)、博时鑫和灵活配置混合型证券投资基金(2017 年 12 月 13 日-2018 年 6 月 16 日)、博时鑫惠灵活配置混合型证券投资基金(2017 年 1 月 10 日-2018 年 7 月 30 日)的基金经理、固定收益总部公募基金组负责人、博时新价值灵活配置混合型证券投资基金(2016 年 3 月 29 日-2019 年 4 月 30 日)、博时乐臻定期开放混合型证券投资基金(2016 年 9 月 29 日-2019 年 10 月 14 日)、博时转债增强债券型证券投资基金(2019 年 1 月 28 日-2020 年 4 月 3 日)、博时鑫源灵活配置混合型证券投资基金(2016 年 9

					月 6 日-2020 年 7 月 20 日)、博时新起点灵活配置混合型证券投资基金(2016 年 10 月 17 日-2020 年 7 月 20 日)、博时鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金(2017 年 2 月 10 日-2020 年 7 月 20 日)、博时中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金(2019 年 7 月 19 日-2020 年 10 月 26 日)的基金经理、固定收益总部指数与创新组负责人、公司董事总经理、博时中债 3-5 年进出口行债券指数证券投资基金(2018 年 12 月 25 日-2021 年 8 月 17 日)基金经理。现任首席基金经理兼博时信用债券投资基金(2009 年 6 月 10 日—至今)、博时新收益灵活配置混合型证券投资基金(2016 年 2 月 29 日—至今)、博时双季鑫 6 个月持有期混合型证券投资基金(2021 年 1 月 20 日—至今)、博时浦惠一年持有期混合型证券投资基金(2022 年 2 月 17 日—至今)、博时恒耀债券型证券投资基金(2022 年 11 月 10 日—至今)、博时信享一年持有期混合型证券投资基金(2023 年 3 月 8 日—至今)、博时中证可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金(2023 年 9 月 15 日—至今)、博时转债增强债券型证券投资基金(2023 年 9 月 15 日—至今)、博时匠心优选混合型证券投资基金(2024 年 4 月 25 日—至今)的基金经理。
李泽南	基金经理助理	2023-09-26	2024-06-26	4.9	李泽南先生，硕士。2019 年毕业后加入博时基金，历任研究员、基金经理助理。

注：上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，由于证券市场波动等原因，本基金曾出现个别投资监控指标超标的情况，基金管理人在规定期限内进行了调整，对基金份额持有人利益未造成损害。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共 81 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年，国内经济实现温和增长，在总体信贷需求偏弱、政府债发行节奏偏慢的影响下，金融数据不及预期，企业盈利也仍处于寻底阶段。外部的积极因素在于全球制造业 PMI 的拐头向上，带动出口方向超预期表现，但在房地产疲弱的背景下内需不足仍是隐忧，CPI 和 PPI 均表现偏弱。聚焦于房地产需求侧和供给侧的政策陆续出台，但销售价格、销售面积等指标仍未见底，产业链景气低迷拖累宏观整体表现。在此背景下，债市收益率总体震荡走低，期间经历两次回调，利率曲线呈现牛陡状态，其中 30 年期国债收益率突破 2.5%，资产荒格局进一步加剧，期间中债总财富指数上涨 3.83%。权益市场在风格分化的结构性特征下市场赚钱效应偏弱，市场围绕红利价值为主线，行业轮动速度较快，期间沪深 300 指数上涨 0.89%，万得全 A 指数下跌 8.01%，风格上表现出明显的大盘特征，并且持续演绎对小微盘和退市风险的担忧。

转债方面，年初权益市场延续四季度偏弱走势而调整剧烈，转债市场整体跟跌，杀平价的同时并未被动提升转股溢价率，下跌出清较为彻底，中位数价格最低跌至 106 元附近，纯债溢价率压缩至历史极低水平；因此 2 月以来的反弹中转债表现出较强的跟涨能力，不过上行的幅度和结构仍取决于权益，资金表现较为理性、并未过度抬升估值；4 月底后，资产荒背景下可转债 ETF 规模显著扩张，增量资金加速流入，新“国九条”出炉后市场估值分化明显，大盘权重类个券出现溢价率提升，而低价弱资质品种则被抛弃；6 月以来，权益行情再度转弱，叠加评级调整密集发生、正股跌破面值数量增加，低价转债演绎信用和退市风险，债底信仰坍塌，出现大量跌破债底的个券。

上半年，本基金跟踪的中证转债及可交换债指数上涨 0.36%。本基金为交易型开放式指数证券投资基金，为被动跟踪指数的基金。其投资目的是尽量减少和标的指数的跟踪误差，取得标的指数所代表的市场平均回报。在本报告期内我们严格按照基金合同要求，力求组合成份券紧密跟踪指数，并结合主动研究分析，在控制跟踪误差有效范围内对价格极度虚高的少数个券进行有效替代，及时剔除存在退市、信用风险的个券，并在最小化交易成本的同时适时调仓，尽可能地减少跟踪误差。同时，在本报告期我们严格按照基金合同要求，尽量降低成本、减少市场冲击，调整组合与目标指数的结构基本一致。上半年可转债 ETF 规模大幅增长，二级成交额继续提升，交易活跃度保持良好发展态势。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 06 月 30 日，本基金基金份额净值为 10.9935 元，份额累计净值为 1.0994 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为 0.32%，同期业绩基准增长率 0.36%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，中央政府加杠杆的力度决定了后续宽信用向上的弹性，而美联储降息的节奏也决定了中国央行宽货币的空间，国内房价能否企稳则对风险偏好和市场信心影响巨大。在宏观经济温和复苏的格局下，权益市场在当前估值水平较低的背景下预计向下风险有限，指数维持宽幅震荡，仍以结构性机会为主。债券市场目前处于收益率相对偏低的水平，央行前期也在公开场合反复提示警惕收益率过低的风险，但是经济基本面仍然处于复苏的过程当中，资金面还是会保持总体宽松，因此对于债券而言还是会以区间震荡为主，下行空间有限，大幅上行的风险也不大。

当前转债绝对价格水平处于历史较低分位，考虑到债牛背景下债底抬升较快，纯债溢价率已是历史极端底部位置，但较高的转股溢价率则制约了转债相对股票的弹性。近期低价转债大幅下跌，与年内信用风险相关因素密集释放有关，如年报后的 ST、退市、问询以及密集的评级调整等。伴随着权益市场行情震荡走弱，转债转股退出比例呈现逐年下降趋势，到期兑付及退市违约比例有所上升，转债定价中将开始计入无法转股和退市、违约的预期。若权益市场能够走出向上行情，更多转债将通过转股形式退出，则转债信用风险也将周期性地下降。综合评估来看转债信用风险偏低的实质不会发生大的变化。同时，由于供给明显下滑，转债市场面临着持续缩容的风险，需求端公募、年金持有转债规模较年初有所下降，主要受制于偏弱的权益市场环境，负债端相对稳定的保险机构则连续增持。中长期来看，当前权益市场估值水平处于历史底部区间，同时不断上行的债底也给予转债绝对价格充分保护，上市公司积极的下修转股价也将不断推升整体平价水平，后续权益资产可预期的整体性回暖也将使得信用风险得到一定程度的缓释。综上，以超越纯债收益率为目标，转债具备较高的长期确定性。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，设立了博时基金管理有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），制定了估值政策和估值程序。估值委员会成员由主管运营的公司领导、督察长、投资总监、研究部负责人、运作部负责人等成员组成，基金经理原则上不参与估值委员会的工作，其估值建议经估值委员会成员评估后审慎采用。估值委员会成员均具有 5 年以上专业工作经历，具备良好的专业经验和专业胜任能力，具有绝对的独立性。估值委员会的职责主要包括有：保证基金估值的公平、合理；制订健全、有效的估值政策和程序；确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性；定期对估值政策和程序进行评价等。

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管银行有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出

具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明:

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：博时中证可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资　产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
资产：			
货币资金	6.4.3.1	219,312,934.08	122,235,261.21
结算备付金		16,405,097.62	6,651,368.80
存出保证金		244,499.76	172,324.24
交易性金融资产	6.4.3.2	11,836,351,563.65	6,040,843,741.98
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		11,836,351,563.65	6,040,843,741.98
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	162,000,000.00	133,983,790.71
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资	6.4.3.5	-	-
应收清算款		8,241.06	4,893.00
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	75,409.12	-
资产总计		12,234,397,745.29	6,303,891,379.94
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2024年6月30日**	**上年度末 2023年12月31日**
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		213,623,770.60	17,330,611.42
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,264,038.45	766,086.42
应付托管费		421,346.13	255,362.16
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		151,530.06	81,041.48
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.7	976,196.63	1,210,323.00
负债合计		216,436,881.87	19,643,424.48
净资产：			
实收基金	6.4.3.8	10,931,867,333.10	5,734,867,031.27
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.3.9	1,086,093,530.32	549,380,924.19

净资产合计		12,017,960,863.42	6,284,247,955.46
负债和净资产总计		12,234,397,745.29	6,303,891,379.94

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值 10.9935 元，基金份额总额 1,093,186,670.00 份。

6.2 利润表

会计主体：博时中证可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日
一、营业总收入		45,547,981.57	80,831,357.53
1.利息收入		1,369,189.20	512,350.85
其中：存款利息收入	6.4.3.10	374,363.19	87,282.42
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		994,826.01	425,068.43
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		46,414,544.21	5,610,358.07
其中：股票投资收益	6.4.3.11	1,564,378.44	342,073.82
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.12	44,850,165.77	5,268,284.25
资产支持证券投资收益	6.4.3.13	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.3.14	-	-
股利收益	6.4.3.15	-	-
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益（若有）		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.16	-14,502,836.57	73,565,393.15
4.汇兑收益（损失以“－”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	12,267,084.73	1,143,255.46
减：二、营业总支出		8,996,253.47	2,931,840.80
1．管理人报酬		5,939,681.33	1,853,629.11
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2．托管费		1,979,893.76	617,876.33
3．销售服务费		-	-
4．投资顾问费		-	-
5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6．信用减值损失	6.4.3.18	-	-
7．税金及附加		74,272.54	15,645.31
8．其他费用	6.4.3.19	1,002,405.84	444,690.05

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		36,551,728.10	77,899,516.73
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		36,551,728.10	77,899,516.73
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		36,551,728.10	77,899,516.73

6.3 净资产变动表

会计主体：博时中证可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日			
	实收基金	其他综合收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	5,734,867,031.27	-	549,380,924.19	6,284,247,955.46
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	5,734,867,031.27	-	549,380,924.19	6,284,247,955.46
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	5,197,000,301.83	-	536,712,606.13	5,733,712,907.96
（一）、综合收益总额	-	-	36,551,728.10	36,551,728.10
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	5,197,000,301.83	-	500,160,878.03	5,697,161,179.86
其中：1.基金申购款	5,859,000,340.17	-	561,438,960.72	6,420,439,300.89
2.基金赎回款	-662,000,038.34	-	-61,278,082.69	-723,278,121.03
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	10,931,867,333.10	-	1,086,093,530.32	12,017,960,863.42
项目	**上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日**			
	实收基金	**其他综合收益（若有）**	**未分配利润**	**净资产合计**
一、上期期末净资产	2,013,866,816.31	-	193,379,802.71	2,207,246,619.02

加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	2,013,866,816.31	-	193,379,802.71	2,207,246,619.02
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	764,000,044.35	-	175,080,804.23	939,080,848.58
（一）、综合收益总额	-	-	77,899,516.73	77,899,516.73
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	764,000,044.35	-	97,181,287.50	861,181,331.85
其中：1.基金申购款	1,087,000,062.98	-	140,741,424.59	1,227,741,487.57
2.基金赎回款	-323,000,018.63	-	-43,560,137.09	-366,560,155.72
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	2,777,866,860.66	-	368,460,606.94	3,146,327,467.60

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：江向阳，主管会计工作负责人：王德英，会计机构负责人：陈子成

6.4 报表附注

6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：(1)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资

管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。(4)基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.3 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
活期存款	219,312,934.08
等于：本金	219,255,032.47
加：应计利息	57,901.61
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	219,312,934.08

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日

		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		-	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	11,996,025,005.96	60,562,358.59	11,836,351,563.65	-220,235,800.90
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	11,996,025,005.96	60,562,358.59	11,836,351,563.65	-220,235,800.90
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		11,996,025,005.96	60,562,358.59	11,836,351,563.65	-220,235,800.90

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

6.4.3.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无余额。

6.4.3.4 买入返售金融资产

6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	162,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	162,000,000.00	-

6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.3.5 其他权益工具投资

6.4.3.5.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.3.5.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.3.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	75,409.12
合计	75,409.12

6.4.3.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	39,922.23
其中：交易所市场	39,922.23
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	114,372.44
应付指数使用费	791,957.48
应付 IOPV 计算与发布费	29,944.48
合计	976,196.63

6.4.3.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	573,486,670.00	5,734,867,031.27
本期申购	585,900,000.00	5,859,000,340.17
本期赎回（以“-”号填列）	-66,200,000.00	-662,000,038.34
本期末	1,093,186,670.00	10,931,867,333.10

注：申购含红利再投、转换入、级别调整入份额；赎回含转换出、级别调整出份额(如适用)。

6.4.3.9 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	817,897,177.92	-268,516,253.73	549,380,924.19
加：会计政策变更（若有）	-	-	-
前期差错更正（若有）	-	-	-
其他（若有）	-	-	-
本期期初	817,897,177.92	-268,516,253.73	549,380,924.19
本期利润	51,054,564.67	-14,502,836.57	36,551,728.10
本期基金份额交易产生的变动数	774,846,612.95	-274,685,734.92	500,160,878.03
其中：基金申购款	870,476,546.46	-309,037,585.74	561,438,960.72

基金赎回款	-95,629,933.51	34,351,850.82	-61,278,082.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,643,798,355.54	-557,704,825.22	1,086,093,530.32

6.4.3.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	265,009.66
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	107,783.18
其他	1,570.35
合计	374,363.19

6.4.3.11 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	71,812,927.67
减：卖出股票成本总额	70,154,470.80
减：交易费用	94,078.43
买卖股票差价收入	1,564,378.44

6.4.3.12 债券投资收益

6.4.3.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	40,966,354.59
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	3,883,811.18
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	44,850,165.77

6.4.3.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,042,854,354.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,028,232,497.47
减：应计利息总额	10,364,039.77
减：交易费用	374,005.58
买卖债券差价收入	3,883,811.18

6.4.3.12.3 债券投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
赎回基金份额对价总额	723,278,121.03
减：现金支付赎回款总额	723,278,121.03
减：赎回债券成本总额	-
减：赎回债券应计利息总额	-
减：交易费用	-
赎回差价收入	-

6.4.3.13 资产支持证券投资收益

6.4.3.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

无发生额。

6.4.3.13.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无发生额。

6.4.3.14 衍生工具收益

6.4.3.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无发生额。

6.4.3.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

无发生额。

6.4.3.15 股利收益

无发生额。

6.4.3.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1.交易性金融资产	-14,502,836.57
——股票投资	-
——债券投资	-14,502,836.57
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-14,502,836.57

6.4.3.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日

基金赎回费收入	-
替代损益	12,267,084.73
合计	12,267,084.73

6.4.3.18 信用减值损失

无发生额。

6.4.3.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	54,700.10
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行汇划费	11,540.56
中登注册登记费	74,590.88
指数使用费	791,957.48
IOPV 计算与发布费	9,944.48
合计	1,002,405.84

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.4.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无须披露的资产负债表日后事项。

6.4.5 关联方关系

6.4.5.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
博时基金管理有限公司(“博时基金”)	基金管理人
招商银行股份有限公司(“招商银行”)	基金托管人
招商证券股份有限公司(“招商证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
博时财富基金销售有限公司（“博时财富”）	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.6.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的	成交金额	占当期股票成交总额的比例

		比例		
招商证券	-	-	11,468,621.40	30.72%

6.4.6.1.2 权证交易

无。

6.4.6.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
招商证券	-	-	1,032,769,961.26	44.65%

6.4.6.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
招商证券	-	-	1,146,700,000.00	27.88%

6.4.6.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
-	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券	8,387.00	30.72%	3,458.21	20.79%

注：1.上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2.该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

6.4.6.2 关联方报酬

6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,939,681.33	1,853,629.11
其中：应支付销售机构的客户维护费	268.97	-
应支付基金管理人的净管理费	5,939,412.36	1,853,629.11

注：支付基金管理人博时基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬＝前一日基金资产净值 × 0.15% / 当年天数。

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,979,893.76	617,876.33

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.05%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费＝前一日基金资产净值 × 0.05% / 当年天数。

6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.6.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.6.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.6.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.6.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.6.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
招商证券	638,261.00	0.06%	629,049.00	0.11%

注：1.除基金管理人之外的其他关联方投资本基金适用的交易费率与本基金法律文件规定一致。

2.持有的基金份额占基金总份额的比例为四舍五入后的结果。

6.4.6.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行-活期存款	219,312,934.08	265,009.66	44,007,857.44	47,348.72

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行活期利率/银行同业利率/约定利率计息。

6.4.6.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

6.4.6.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.7 利润分配情况

无。

6.4.8 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.8.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.9 金融工具风险及管理

6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于债券型基金，其预期收益及风险水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。本基金采用优化抽样复制策略，跟踪中证可转债及可交换债券指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金的基金管理人建立了董事会领导，以风险管理委员会为核心的，由总经理、督察长、监察法律部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，董事会负责制定公司的风险管理政策，对风险管理负完全的和最终的责任；在董事会下设立风险管理委员会，负责批准公司风险管理系统文件和批准每一个部门的风险级别，以及负责解决重大的突发的风险；督察长独立行使督察权利，直接对董事会负责，向风险管理委员会提交独立的风险管理报告和风险管理建议；监察法律部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；风险管理部负责建立和完善公司投资风险管理制度与流程，组织实施公司投资风险管理与绩效分析工作，确保公司各类投资风险得到良好监督与控制。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析

的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.9.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人，定期存款存放在具有证券投资基金托管资格、基金销售业务资格或合格境外机构投资者托管人资格的银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易主要以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，本基金的基金管理人管理的基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

6.4.9.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.9.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.9.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.9.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年末 2023年12月31日
AAA	5,227,574,254.54	2,754,233,765.66
AAA 以下	6,608,774,233.19	3,286,609,976.32
未评级	-	-
合计	11,836,348,487.73	6,040,843,741.98

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。2.未评级债券为国债、政策性金融债、央票及无第三方机构评级的债券。

6.4.9.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.9.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.9.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险来自调整基金投资组合时，由于组合资产流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击

成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

于本期末，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息。本基金赎回基金份额采用组合证券形式，流动性风险相对较低。

6.4.9.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

除附注“期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。在本基金开放日，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于本期末，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.9.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.9.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2024年6月30	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

日					
资产					
货币资金	219,312,934.08	-	-	-	219,312,934.08
结算备付金	16,405,097.62	-	-	-	16,405,097.62
存出保证金	244,499.76	-	-	-	244,499.76
交易性金融资产	638,674,017.99	10,068,947,096.11	1,128,730,449.55	-	11,836,351,563.65
应收清算款	-	-	-	8,241.06	8,241.06
买入返售金融资产	162,000,000.00	-	-	-	162,000,000.00
应收申购款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	75,409.12	75,409.12
资产总计	**1,036,636,549.45**	**10,068,947,096.11**	**1,128,730,449.55**	**83,650.18**	**12,234,397,745.29**
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	213,623,770.60	213,623,770.60
应付管理人报酬	-	-	-	1,264,038.45	1,264,038.45
应付	-	-	-	421,346.13	421,346.13

托管费					
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	151,530.06	151,530.06
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	976,196.63	976,196.63
负债总计	-	-	-	**216,436,881.87**	**216,436,881.87**
利率敏感度缺口	**1,036,636,549.45**	**10,068,947,096.11**	**1,128,730,449.55**	**-216,353,231.69**	**12,017,960,863.42**
上年度末2023年12月31日	**1年以内**	**1-5年**	**5年以上**	**不计息**	**合计**
资产					
货币资金	122,235,261.21	-	-	-	122,235,261.21
结算备付金	6,651,368.80	-	-	-	6,651,368.80
存出保证金	172,324.24	-	-	-	172,324.24
交易性金融资产	496,833,799.19	4,682,176,899.68	861,833,043.11	-	6,040,843,741.98
应收清算款	-	-	-	4,893.00	4,893.00
买入	133,983,790.71	-	-	-	133,983,790.71

返售金融资产					
应收申购款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	**759,876,544.15**	**4,682,176,899.68**	**861,833,043.11**	**4,893.00**	**6,303,891,379.94**
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	17,330,611.42	17,330,611.42
应付管理人报酬	-	-	-	766,086.42	766,086.42
应付托管费	-	-	-	255,362.16	255,362.16
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	81,041.48	81,041.48
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,210,323.00	1,210,323.00
负债总计	**-**	**-**	**-**	**19,643,424.48**	**19,643,424.48**

利率敏感度缺口	759,876,544.15	4,682,176,899.68	861,833,043.11	-19,638,531.48	6,284,247,955.46

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本期末本基金未持有交易性债券投资和资产支持证券投资(不包括可转债和可交换债），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上期：同）。

6.4.9.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.9.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	-	-	-	-
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	11,836,351,563.65	98.49	6,040,843,741.98	96.13
交易性金融资产－贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	11,836,351,563.65	98.49	6,040,843,741.98	96.13

注：1、债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

2、其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注“衍生金融资产/负债”)。在当日无负债结算制度下，期货投资于相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵扣后的净额为 0。

6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的

		影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 60,029	增加约 30,567
	业绩比较基准下降 5%	减少约 60,029	减少约 30,567

6.4.10 公允价值

6.4.10.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.10.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.10.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年6月30日
第一层次	11,832,065,435.98
第二层次	4,286,127.67
第三层次	-
合计	11,836,351,563.65

6.4.10.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.10.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.10.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	11,836,351,563.65	96.75
	其中：债券	11,836,351,563.65	96.75
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	162,000,000.00	1.32
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	235,718,031.70	1.93
8	其他各项资产	328,149.94	0.00
9	合计	12,234,397,745.29	100.00

注：债券投资项包含可退替代款估值增值。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内股票。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600900	长江电力	52,049,085.92	0.83
2	000623	吉林敖东	18,105,384.88	0.29

注：本项“买入金额”均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）

1	600900	长江电力	53,522,308.08	0.85
2	000623	吉林敖东	18,290,619.59	0.29

注：本项“卖出金额”均按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	70,154,470.80
卖出股票的收入（成交）总额	71,812,927.67

注：本项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	11,836,351,563.65	98.49
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	11,836,351,563.65	98.49

注：上述可转债（可交换债）投资项包含可退替代款估值增值。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110059	浦发转债	6,559,460	723,355,683.46	6.02
2	113052	兴业转债	6,644,220	719,034,757.89	5.98
3	113042	上银转债	2,635,920	299,636,581.11	2.49
4	113050	南银转债	2,197,890	275,643,105.44	2.29
5	110079	杭银转债	2,004,010	242,022,366.05	2.01

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的投资决策程序说明

本基金投资的前十名证券的发行主体中，上海浦东发展银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国人民银行宁波市分行、国家外汇管理局湖州市分局、国家金融监督管理总局莆田监管分局的处罚。南京银行股份有限公司在报告编制前一年受到国家金融监督管理总局淮安监管分局、国家外汇管理局江苏省分局的处罚。重庆银行股份有限公司在报告编制前一年受到国家金融监督管理总局重庆监管局的处罚。兴业银行股份有限公司在报告编制前一年受到国家外汇管理局绵阳市分局、国家金融监督管理总局北京监管局、天津市市场监督管理委员会的处罚。杭州银行股份有限公司在报告编制前一年受到国家外汇管理局北京市分局、国家金融监督管理总局浙江监管局的处罚。上海银行股份有限公司在报告编制前一年受到国家金融监督管理总局上海监管局、国家外汇管理局上海市分局的处罚。中信银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国人民银行济南分行、国家外汇管理局湖州市分局、国家金融监督管理总局的处罚。本基金对上述证券的投资决策程序符合相关法规及公司制度的要求。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 报告期内基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	244,499.76
2	应收清算款	8,241.06
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-

7	待摊费用	75,409.12
8	其他	-
9	合计	328,149.94

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110059	浦发转债	723,355,683.46	6.02
2	113052	兴业转债	719,034,757.89	5.98
3	113042	上银转债	299,636,581.11	2.49
4	113050	南银转债	275,643,105.44	2.29
5	110079	杭银转债	242,022,366.05	2.01
6	113044	大秦转债	239,576,282.74	1.99
7	113021	中信转债	208,560,908.08	1.74
8	113056	重银转债	187,889,970.46	1.56
9	132026	G 三峡 EB2	171,044,082.93	1.42
10	110085	通 22 转债	169,530,410.69	1.41
11	127045	牧原转债	150,781,307.73	1.25
12	123107	温氏转债	131,404,927.51	1.09
13	118034	晶能转债	129,583,238.07	1.08
14	113060	浙 22 转债	117,632,099.84	0.98
15	127089	晶澳转债	116,142,573.36	0.97
16	110073	国投转债	115,336,858.89	0.96
17	110081	闻泰转债	114,332,114.28	0.95
18	127049	希望转 2	112,063,069.99	0.93
19	118031	天 23 转债	109,897,053.54	0.91
20	113641	华友转债	101,992,345.96	0.85
21	110083	苏租转债	101,381,804.11	0.84
22	113065	齐鲁转债	100,022,212.17	0.83
23	113062	常银转债	96,773,147.35	0.81
24	110075	南航转债	96,551,679.34	0.80
25	113053	隆 22 转债	95,606,439.24	0.80
26	127018	本钢转债	86,868,357.65	0.72
27	113055	成银转债	86,161,944.72	0.72
28	127032	苏行转债	83,330,078.97	0.69
29	127056	中特转债	72,457,447.73	0.60
30	127030	盛虹转债	71,054,197.20	0.59
31	128129	青农转债	70,156,517.75	0.58
32	127083	山路转债	69,002,186.03	0.57
33	132020	19 蓝星 EB	64,297,569.64	0.54
34	113037	紫银转债	63,897,119.61	0.53
35	127084	柳工转 2	60,837,106.73	0.51
36	127040	国泰转债	60,401,367.90	0.50
37	113059	福莱转债	57,179,174.31	0.48
38	113043	财通转债	56,953,083.94	0.47
39	113045	环旭转债	53,930,025.49	0.45
40	127086	恒邦转债	52,673,779.23	0.44
41	113049	长汽转债	51,425,182.30	0.43
42	127073	天赐转债	50,433,594.31	0.42

43	113067	燃 23 转债	50,259,854.20	0.42
44	111010	立昂转债	49,557,468.77	0.41
45	127020	中金转债	49,041,705.82	0.41
46	110062	烽火转债	48,629,390.06	0.40
47	113051	节能转债	48,423,337.83	0.40
48	128136	立讯转债	46,188,863.82	0.38
49	118024	冠宇转债	45,578,143.91	0.38
50	127061	美锦转债	45,172,515.49	0.38
51	110093	神马转债	44,959,878.84	0.37
52	113024	核建转债	44,759,919.92	0.37
53	113661	福 22 转债	43,583,967.16	0.36
54	118022	锂科转债	42,920,348.72	0.36
55	127067	恒逸转 2	42,889,736.15	0.36
56	110087	天业转债	41,072,264.52	0.34
57	113623	凤 21 转债	41,046,853.65	0.34
58	110089	兴发转债	40,799,339.98	0.34
59	110067	华安转债	40,258,131.02	0.33
60	127050	麒麟转债	40,144,251.44	0.33
61	113061	拓普转债	39,312,033.53	0.33
62	128081	海亮转债	38,089,778.02	0.32
63	113616	韦尔转债	36,296,979.57	0.30
64	113615	金诚转债	36,087,721.30	0.30
65	128048	张行转债	36,016,555.34	0.30
66	127085	韵达转债	35,948,568.65	0.30
67	110048	福能转债	35,830,700.48	0.30
68	113054	绿动转债	33,449,995.09	0.28
69	110068	龙净转债	32,591,231.19	0.27
70	127027	能化转债	32,123,491.56	0.27
71	113602	景 20 转债	31,992,737.24	0.27
72	113632	鹤 21 转债	31,966,326.16	0.27
73	123190	道氏转 02	31,605,170.66	0.26
74	123119	康泰转 2	29,477,636.53	0.25
75	113066	平煤转债	29,388,586.43	0.24
76	113666	爱玛转债	29,290,552.94	0.24
77	113048	晶科转债	29,275,575.72	0.24
78	123158	宙邦转债	28,769,179.08	0.24
79	110082	宏发转债	28,561,911.37	0.24
80	123216	科顺转债	28,535,509.54	0.24
81	113069	博 23 转债	28,340,733.82	0.24
82	113058	友发转债	28,219,894.94	0.23
83	127039	北港转债	27,787,289.84	0.23
84	113655	欧 22 转债	27,658,646.87	0.23
85	110095	双良转债	27,562,517.19	0.23
86	110077	洪城转债	26,518,926.28	0.22
87	128109	楚江转债	26,365,270.84	0.22
88	127022	恒逸转债	26,090,589.90	0.22
89	110076	华海转债	25,898,152.49	0.22
90	110090	爱迪转债	24,848,713.78	0.21
91	127070	大中转债	24,175,367.59	0.20
92	110047	山鹰转债	24,174,171.90	0.20

93	127025	冀东转债	23,979,888.31	0.20
94	113033	利群转债	23,878,627.81	0.20
95	123176	精测转 2	23,336,946.51	0.19
96	118030	睿创转债	23,263,636.22	0.19
97	118025	奕瑞转债	23,199,721.26	0.19
98	123108	乐普转 2	23,136,839.77	0.19
99	110086	精工转债	22,869,432.32	0.19
100	127091	科数转债	22,869,338.94	0.19
101	113652	伟 22 转债	22,691,267.45	0.19
102	127066	科利转债	22,532,289.67	0.19
103	128134	鸿路转债	22,467,986.54	0.19
104	127038	国微转债	22,371,057.41	0.19
105	113047	旗滨转债	22,273,772.28	0.19
106	113068	金铜转债	21,913,456.98	0.18
107	127016	鲁泰转债	21,799,586.67	0.18
108	113064	东材转债	21,647,934.10	0.18
109	127100	神码转债	21,579,344.84	0.18
110	127024	盈峰转债	21,299,876.57	0.18
111	128131	崇达转 2	21,203,767.94	0.18
112	113046	金田转债	21,143,584.31	0.18
113	128135	洽洽转债	21,032,106.93	0.18
114	110094	众和转债	20,859,865.30	0.17
115	113647	禾丰转债	20,831,677.48	0.17
116	123169	正海转债	20,814,866.01	0.17
117	113605	大参转债	20,622,787.61	0.17
118	118013	道通转债	20,501,257.78	0.17
119	127074	麦米转 2	20,414,017.89	0.17
120	128141	旺能转债	20,409,585.69	0.17
121	123149	通裕转债	20,316,387.84	0.17
122	123228	震裕转债	20,164,126.50	0.17
123	113516	苏农转债	19,671,855.85	0.16
124	113669	景 23 转债	19,157,368.93	0.16
125	128108	蓝帆转债	18,734,236.09	0.16
126	123178	花园转债	18,525,968.20	0.15
127	111017	蓝天转债	18,448,488.77	0.15
128	127064	杭氧转债	17,595,755.74	0.15
129	110064	建工转债	17,278,913.76	0.14
130	127082	亚科转债	17,272,903.97	0.14
131	110092	三房转债	17,095,677.58	0.14
132	127101	豪鹏转债	16,953,093.42	0.14
133	123150	九强转债	16,854,511.54	0.14
134	113675	新 23 转债	16,839,454.54	0.14
135	113659	莱克转债	16,760,989.94	0.14
136	110063	鹰 19 转债	16,721,668.53	0.14
137	113619	世运转债	16,616,303.89	0.14
138	123115	捷捷转债	16,518,711.37	0.14
139	127092	运机转债	16,373,448.32	0.14
140	127043	川恒转债	16,349,136.58	0.14
141	123145	药石转债	16,327,233.23	0.14
142	123213	天源转债	15,990,124.65	0.13

143	127052	西子转债	15,787,457.63	0.13
144	123184	天阳转债	15,662,915.94	0.13
145	123210	信服转债	15,647,433.50	0.13
146	123114	三角转债	15,439,499.82	0.13
147	113648	巨星转债	15,334,197.69	0.13
148	127046	百润转债	15,288,061.87	0.13
149	113631	皖天转债	15,276,375.69	0.13
150	123118	惠城转债	15,200,399.71	0.13
151	118042	奥维转债	15,138,454.45	0.13
152	123170	南电转债	15,053,568.00	0.13
153	123192	科思转债	14,888,355.77	0.12
154	123161	强联转债	14,795,716.87	0.12
155	111000	起帆转债	14,739,894.89	0.12
156	113673	岱美转债	14,646,846.60	0.12
157	113636	甬金转债	14,582,547.76	0.12
158	118038	金宏转债	14,487,337.73	0.12
159	123117	健帆转债	14,469,298.60	0.12
160	113677	华懋转债	14,452,308.05	0.12
161	127031	洋丰转债	14,415,651.06	0.12
162	123113	仙乐转债	14,396,470.00	0.12
163	123104	卫宁转债	14,338,053.82	0.12
164	123208	孩王转债	14,333,758.34	0.12
165	127044	蒙娜转债	14,274,111.30	0.12
166	127017	万青转债	14,209,735.91	0.12
167	118023	广大转债	14,172,288.87	0.12
168	113633	科沃转债	14,106,415.64	0.12
169	127037	银轮转债	13,999,873.39	0.12
170	113658	密卫转债	13,956,217.07	0.12
171	110084	贵燃转债	13,845,547.69	0.12
172	123212	立中转债	13,812,198.97	0.11
173	113644	艾迪转债	13,811,618.03	0.11
174	113634	珀莱转债	13,735,819.93	0.11
175	128130	景兴转债	13,714,680.57	0.11
176	113545	金能转债	13,591,718.48	0.11
177	123174	精锻转债	13,562,994.98	0.11
178	123215	铭利转债	13,519,180.70	0.11
179	123128	首华转债	13,415,959.77	0.11
180	123194	百洋转债	13,279,421.36	0.11
181	118003	华兴转债	13,013,042.08	0.11
182	127015	希望转债	12,995,453.17	0.11
183	128132	交建转债	12,973,485.33	0.11
184	128083	新北转债	12,878,146.45	0.11
185	127075	百川转 2	12,832,839.83	0.11
186	113549	白电转债	12,773,748.16	0.11
187	128133	奇正转债	12,739,667.13	0.11
188	118028	会通转债	12,695,025.81	0.11
189	118046	诺泰转债	12,591,379.87	0.10
190	123179	立高转债	12,572,089.41	0.10
191	113637	华翔转债	12,522,231.39	0.10
192	127095	广泰转债	12,504,163.65	0.10

193	123121	帝尔转债	12,454,465.43	0.10
194	123188	水羊转债	12,392,558.38	0.10
195	128144	利民转债	12,390,274.57	0.10
196	123225	翔丰转债	12,290,530.62	0.10
197	113563	柳药转债	12,269,198.87	0.10
198	113679	芯能转债	12,267,790.78	0.10
199	111007	永和转债	12,233,378.47	0.10
200	123035	利德转债	12,216,262.24	0.10
201	123076	强力转债	12,213,218.73	0.10
202	113672	福蓉转债	12,116,365.74	0.10
203	123236	家联转债	12,029,880.96	0.10
204	113656	嘉诚转债	11,929,143.64	0.10
205	123120	隆华转债	11,829,984.03	0.10
206	127076	中宠转 2	11,739,521.18	0.10
207	118000	嘉元转债	11,710,363.12	0.10
208	123191	智尚转债	11,697,127.20	0.10
209	123101	拓斯转债	11,650,801.58	0.10
210	128127	文科转债	11,605,289.96	0.10
211	123165	回天转债	11,565,367.40	0.10
212	128128	齐翔转 2	11,531,692.94	0.10
213	113596	城地转债	11,503,105.76	0.10
214	113627	太平转债	11,491,374.90	0.10
215	127099	盛航转债	11,469,553.78	0.10
216	111015	东亚转债	11,451,896.21	0.10
217	127014	北方转债	11,425,034.79	0.10
218	113640	苏利转债	11,416,615.37	0.09
219	123172	漱玉转债	11,386,038.23	0.09
220	113651	松霖转债	11,330,664.27	0.09
221	128119	龙大转债	11,266,867.00	0.09
222	123204	金丹转债	11,223,473.92	0.09
223	123182	广联转债	11,214,367.28	0.09
224	113670	金 23 转债	11,129,922.15	0.09
225	123133	佩蒂转债	11,101,894.99	0.09
226	127035	濮耐转债	11,009,313.31	0.09
227	118005	天奈转债	10,986,414.44	0.09
228	113650	博 22 转债	10,976,152.00	0.09
229	128105	长集转债	10,968,635.88	0.09
230	111002	特纸转债	10,933,997.08	0.09
231	123219	宇瞳转债	10,811,156.49	0.09
232	127026	超声转债	10,721,473.72	0.09
233	127042	嘉美转债	10,682,030.90	0.09
234	123223	九典转 02	10,672,983.38	0.09
235	113653	永 22 转债	10,665,221.30	0.09
236	123146	中环转 2	10,638,440.45	0.09
237	110060	天路转债	10,618,395.71	0.09
238	111011	冠盛转债	10,611,799.28	0.09
239	118043	福立转债	10,606,574.09	0.09
240	123071	天能转债	10,578,364.78	0.09
241	128142	新乳转债	10,549,342.54	0.09
242	128087	孚日转债	10,479,027.31	0.09

243	113609	永安转债	10,457,450.00	0.09
244	113667	春 23 转债	10,383,487.90	0.09
245	113621	彤程转债	10,363,855.22	0.09
246	113663	新化转债	10,355,748.90	0.09
247	128074	游族转债	10,354,278.59	0.09
248	128106	华统转债	10,347,156.81	0.09
249	128063	未来转债	10,261,745.39	0.09
250	127068	顺博转债	10,207,585.76	0.08
251	118033	华特转债	10,127,454.88	0.08
252	123211	阳谷转债	10,072,809.41	0.08
253	127019	国城转债	10,027,881.25	0.08
254	128137	洁美转债	9,989,386.47	0.08
255	128121	宏川转债	9,959,247.51	0.08
256	118027	宏图转债	9,951,248.71	0.08
257	110074	精达转债	9,939,116.66	0.08
258	123063	大禹转债	9,927,374.86	0.08
259	111004	明新转债	9,927,257.10	0.08
260	123226	中富转债	9,906,452.89	0.08
261	118041	星球转债	9,898,255.95	0.08
262	123078	飞凯转债	9,895,953.39	0.08
263	123233	凯盛转债	9,867,576.17	0.08
264	127041	弘亚转债	9,823,945.02	0.08
265	123222	博俊转债	9,823,031.37	0.08
266	123151	康医转债	9,798,822.48	0.08
267	113530	大丰转债	9,777,375.46	0.08
268	128124	科华转债	9,768,935.46	0.08
269	123131	奥飞转债	9,767,978.87	0.08
270	123217	富仕转债	9,752,786.96	0.08
271	113676	荣 23 转债	9,691,602.87	0.08
272	123221	力诺转债	9,660,143.57	0.08
273	118032	建龙转债	9,626,090.92	0.08
274	113584	家悦转债	9,616,092.16	0.08
275	113638	台 21 转债	9,584,046.37	0.08
276	123132	回盛转债	9,564,305.14	0.08
277	127078	优彩转债	9,553,569.75	0.08
278	123231	信测转债	9,535,544.80	0.08
279	123147	中辰转债	9,533,139.65	0.08
280	127088	赫达转债	9,529,836.92	0.08
281	127034	绿茵转债	9,522,323.75	0.08
282	113606	荣泰转债	9,496,560.11	0.08
283	128116	瑞达转债	9,469,396.92	0.08
284	123183	海顺转债	9,440,945.77	0.08
285	113662	豪能转债	9,402,421.30	0.08
286	123195	蓝晓转 02	9,383,612.35	0.08
287	123205	大叶转债	9,341,472.35	0.08
288	123064	万孚转债	9,330,372.05	0.08
289	113678	中贝转债	9,273,137.94	0.08
290	113542	好客转债	9,248,513.28	0.08
291	111001	山玻转债	9,244,707.98	0.08
292	118037	上声转债	9,198,906.11	0.08

293	111009	盛泰转债	9,197,878.80	0.08
294	127054	双箭转债	9,192,112.22	0.08
295	127081	中旗转债	9,179,901.39	0.08
296	123235	亿田转债	9,170,418.79	0.08
297	111016	神通转债	9,150,609.00	0.08
298	127069	小熊转债	9,122,239.44	0.08
299	118004	博瑞转债	9,108,450.19	0.08
300	113625	江山转债	9,106,097.11	0.08
301	111014	李子转债	9,084,305.86	0.08
302	123193	海能转债	9,041,684.96	0.08
303	123203	明电转 02	9,041,445.46	0.08
304	123122	富瀚转债	9,015,228.27	0.08
305	123049	维尔转债	9,006,642.52	0.07
306	123229	艾录转债	8,985,618.13	0.07
307	127055	精装转债	8,977,244.66	0.07
308	123091	长海转债	8,972,870.29	0.07
309	113654	永 02 转债	8,839,863.88	0.07
310	113582	火炬转债	8,814,734.93	0.07
311	113639	华正转债	8,814,706.91	0.07
312	111005	富春转债	8,797,204.84	0.07
313	127090	兴瑞转债	8,754,335.84	0.07
314	118026	利元转债	8,746,107.16	0.07
315	123090	三诺转债	8,717,783.05	0.07
316	127053	豪美转债	8,666,176.39	0.07
317	123087	明电转债	8,615,036.44	0.07
318	127071	天箭转债	8,499,062.56	0.07
319	127051	博杰转债	8,469,062.55	0.07
320	113629	泉峰转债	8,462,671.78	0.07
321	118012	微芯转债	8,460,551.84	0.07
322	123224	宇邦转债	8,380,929.78	0.07
323	127072	博实转债	8,324,902.10	0.07
324	123154	火星转债	8,281,991.18	0.07
325	113674	华设转债	8,274,352.19	0.07
326	123187	超达转债	8,234,678.12	0.07
327	113579	健友转债	8,138,308.12	0.07
328	113664	大元转债	8,113,687.10	0.07
329	118011	银微转债	8,109,783.17	0.07
330	113643	风语转债	8,043,314.40	0.07
331	127060	湘佳转债	8,007,892.38	0.07
332	123092	天壕转债	8,004,521.87	0.07
333	123085	万顺转 2	7,988,729.06	0.07
334	123124	晶瑞转 2	7,917,150.11	0.07
335	123144	裕兴转债	7,915,727.64	0.07
336	123109	昌红转债	7,904,903.03	0.07
337	127028	英特转债	7,888,590.33	0.07
338	113532	海环转债	7,854,331.05	0.07
339	123168	惠云转债	7,823,065.26	0.07
340	118008	海优转债	7,791,209.82	0.06
341	127098	欧晶转债	7,760,880.00	0.06
342	128066	亚泰转债	7,740,118.85	0.06

343	123050	聚飞转债	7,730,069.11	0.06
344	118035	国力转债	7,722,125.22	0.06
345	113589	天创转债	7,677,827.07	0.06
346	123162	东杰转债	7,649,763.92	0.06
347	113618	美诺转债	7,625,781.62	0.06
348	123202	祥源转债	7,609,407.61	0.06
349	113668	鹿山转债	7,604,425.84	0.06
350	113657	再 22 转债	7,601,549.20	0.06
351	127087	星帅转 2	7,599,120.57	0.06
352	128095	恩捷转债	7,547,529.43	0.06
353	123082	北陆转债	7,532,009.25	0.06
354	128125	华阳转债	7,527,827.95	0.06
355	128097	奥佳转债	7,486,446.67	0.06
356	123214	东宝转债	7,377,449.09	0.06
357	113569	科达转债	7,350,334.37	0.06
358	118014	高测转债	7,333,847.99	0.06
359	123186	志特转债	7,310,417.75	0.06
360	123048	应急转债	7,305,848.94	0.06
361	123142	申昊转债	7,277,336.50	0.06
362	111008	沿浦转债	7,253,565.41	0.06
363	123157	科蓝转债	7,234,056.58	0.06
364	123056	雪榕转债	7,198,124.48	0.06
365	123130	设研转债	7,100,343.66	0.06
366	127077	华宏转债	7,096,736.43	0.06
367	113610	灵康转债	7,070,140.69	0.06
368	123127	耐普转债	6,927,385.89	0.06
369	113649	丰山转债	6,918,384.38	0.06
370	123197	光力转债	6,910,822.93	0.06
371	113601	塞力转债	6,848,552.42	0.06
372	118020	芳源转债	6,585,679.97	0.05
373	123198	金埔转债	6,556,657.73	0.05
374	123096	思创转债	6,414,267.38	0.05
375	123207	冠中转债	5,494,369.14	0.05
376	111013	新港转债	5,285,295.17	0.04
377	118044	赛特转债	5,217,292.81	0.04
378	128138	侨银转债	5,065,140.60	0.04
379	128042	凯中转债	4,971,175.00	0.04
380	113628	晨丰转债	4,949,464.33	0.04
381	123059	银信转债	4,940,545.36	0.04
382	118040	宏微转债	4,860,831.15	0.04
383	123010	博世转债	4,857,712.31	0.04
384	123227	雅创转债	4,811,744.31	0.04
385	118010	洁特转债	4,783,734.53	0.04
386	123143	胜蓝转债	4,737,222.10	0.04
387	113660	寿 22 转债	4,711,370.57	0.04
388	123218	宏昌转债	4,677,521.64	0.04
389	123201	纽泰转债	4,669,349.62	0.04
390	118015	芯海转债	4,663,504.19	0.04
391	113593	沪工转债	4,640,450.42	0.04
392	123234	中能转债	4,609,521.31	0.04

393	123200	海泰转债	4,596,379.96	0.04
394	113534	鼎胜转债	4,595,363.45	0.04
395	118029	富淼转债	4,595,282.06	0.04
396	118009	华锐转债	4,577,609.88	0.04
397	113600	新星转债	4,564,579.49	0.04
398	118036	力合转债	4,550,070.59	0.04
399	113624	正川转债	4,506,961.52	0.04
400	118006	阿拉转债	4,494,861.57	0.04
401	113588	润达转债	4,487,585.93	0.04
402	123025	精测转债	4,469,730.67	0.04
403	113608	威派转债	4,448,153.42	0.04
404	127062	垒知转债	4,429,510.69	0.04
405	123100	朗科转债	4,407,406.04	0.04
406	123089	九洲转 2	4,374,339.26	0.04
407	118039	煜邦转债	4,373,337.76	0.04
408	127059	永东转 2	4,297,905.43	0.04
409	123099	普利转债	4,286,127.67	0.04
410	123199	山河转债	4,276,208.32	0.04
411	128117	道恩转债	4,189,362.30	0.03
412	123141	宏丰转债	4,097,184.28	0.03
413	118018	瑞科转债	4,068,503.80	0.03
414	127079	华亚转债	4,050,489.77	0.03
415	113671	武进转债	4,026,085.89	0.03
416	123171	共同转债	3,973,424.42	0.03
417	113524	奇精转债	3,961,246.33	0.03
418	123126	瑞丰转债	3,950,665.09	0.03
419	128090	汽模转 2	3,894,666.20	0.03
420	123160	泰福转债	3,841,535.64	0.03
421	118021	新致转债	3,822,186.79	0.03
422	123185	能辉转债	3,813,088.09	0.03
423	118045	盟升转债	3,703,404.80	0.03
424	123175	百畅转债	3,681,579.24	0.03
425	113597	佳力转债	3,657,961.16	0.03
426	113030	东风转债	3,656,393.79	0.03
427	111012	福新转债	3,654,062.43	0.03
428	123163	金沃转债	3,640,916.81	0.03
429	113039	嘉泽转债	3,633,045.70	0.03
430	113598	法兰转债	3,594,192.39	0.03
431	123152	润禾转债	3,585,737.54	0.03
432	113573	纵横转债	3,574,404.15	0.03
433	123088	威唐转债	3,563,901.56	0.03
434	123180	浙矿转债	3,554,796.10	0.03
435	128122	兴森转债	3,529,165.87	0.03
436	123196	正元转 02	3,527,608.99	0.03
437	113527	维格转债	3,525,007.85	0.03
438	127080	声迅转债	3,500,208.63	0.03
439	128118	瀛通转债	3,432,445.45	0.03
440	128101	联创转债	3,428,379.50	0.03
441	123156	博汇转债	3,426,294.87	0.03
442	128071	合兴转债	3,417,651.14	0.03

443	127094	红墙转债	3,400,346.33	0.03
444	123159	崧盛转债	3,396,032.85	0.03
445	123155	中陆转债	3,395,990.19	0.03
446	110055	伊力转债	3,390,770.82	0.03
447	110052	贵广转债	3,378,376.58	0.03
448	128072	翔鹭转债	3,248,490.07	0.03
449	113665	汇通转债	3,234,482.22	0.03
450	123177	测绘转债	3,225,541.59	0.03
451	123206	开能转债	3,192,518.35	0.03
452	110058	永鼎转债	3,176,886.52	0.03
453	113546	迪贝转债	3,176,491.41	0.03
454	123166	蒙泰转债	3,169,105.88	0.03
455	123220	易瑞转债	3,165,291.83	0.03
456	123061	航新转债	3,150,499.96	0.03
457	123189	晓鸣转债	3,122,021.71	0.03
458	123022	长信转债	3,109,468.86	0.03
459	123209	聚隆转债	3,059,375.05	0.03
460	123093	金陵转债	3,040,648.57	0.03
461	123138	丝路转债	2,964,032.55	0.02
462	128070	智能转债	2,948,924.51	0.02
463	127093	章鼓转债	2,937,376.55	0.02
464	123011	德尔转债	2,933,008.35	0.02
465	123112	万讯转债	2,897,645.34	0.02
466	118016	京源转债	2,893,893.55	0.02
467	123173	恒锋转债	2,889,648.23	0.02
468	123067	斯莱转债	2,881,909.14	0.02
469	123135	泰林转债	2,843,969.93	0.02
470	123103	震安转债	2,793,985.59	0.02
471	118007	山石转债	2,761,298.04	0.02
472	123039	开润转债	2,696,285.88	0.02
473	113519	长久转债	2,665,947.99	0.02
474	128076	金轮转债	2,598,034.92	0.02
475	123065	宝莱转债	2,574,636.36	0.02
476	128082	华锋转债	2,557,200.41	0.02
477	113574	华体转债	2,552,305.59	0.02
478	123232	金现转债	2,525,238.39	0.02
479	113565	宏辉转债	2,484,482.17	0.02
480	110070	凌钢转债	2,434,906.92	0.02
481	123129	锦鸡转债	2,401,934.16	0.02
482	128049	华源转债	2,354,359.23	0.02
483	123054	思特转债	2,326,582.83	0.02
484	128143	锋龙转债	2,212,240.81	0.02
485	123080	海波转债	1,976,305.04	0.02

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
7,370	148,329.26	1,058,401,765.00	96.82%	34,784,905.00	3.18%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	国泰金色年华稳定类固定收益型养老金产品－中国农业银行股份有限公司	38,950,000.00	3.56%
2	信泰人寿保险股份有限公司－传统产品	37,304,098.00	3.41%
3	申万宏源证券－和谐健康保险股份有限公司－万能产品－申万宏源和谐 1 号单一资产管	33,399,000.00	3.06%
4	基本养老保险基金一零七组合	30,694,102.00	2.81%
5	中邮理财有限责任公司－邮银财富·债券 2018 年第 244 期（每周定开净值型）	29,641,784.00	2.71%
6	中国工商银行股份有限公司企业年金计划－中国建设银行股份有限公司	24,757,000.00	2.26%
7	国泰金色年华固定收益型养老金产品－中国建设银行股份有限公司	22,369,600.00	2.05%
8	国泰君安证券股份有限公司	21,574,601.00	1.97%
9	中金璀璨人生固定收益型养老金产品－招商银行股份有限公司	19,070,000.00	1.74%
10	华润深国投信托有限公司－华润信托·泰山 1 号单一资金信托	19,000,000.00	1.74%

注：以上数据由中国证券登记结算公司提供，由于系统字数限制可能有持有人名称显示不全的情况，持有人为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

基金管理人从业人员未持有本基金。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。
2、本基金的基金经理未持有本基金。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020 年 3 月 6 日）基金份额总额	601,866,735.00
本报告期期初基金份额总额	573,486,670.00
本报告期基金总申购份额	585,900,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	66,200,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,093,186,670.00

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人于 2024 年 4 月 13 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，徐卫先生离任公司副总经理。

基金管理人于 2024 年 5 月 25 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，张东先生任公司总经理。

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起，聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员没有受到监管部门的稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
德邦证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	4	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	71,812,927.67	100.00%	53,565.30	100.00%	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-

注：本基金根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基字[2007]48 号）的有关规定要求，我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向多家券商租用了基金专用交易席位。

1、基金专用交易席位的选择标准如下：

(1)经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；

(2)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；

(3)具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易席位的选择程序如下

(1)本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构

(2)基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
德邦证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	9,718,556,574.93	100.00%	11,073,470,000.00	100.00%	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	博时中证可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-06-26
2	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-05-25
3	博时基金管理有限公司关于终止北京中期时代基金销售有限公司办理旗下基金销售业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-05-15
4	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增华宝证券为申购、赎回代办券商的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-04-30
5	博时基金管理有限公司关于与通联支付网络服务股份有限公司合作开通北京银行借记卡直销网上交易和费率优惠的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-04-29
6	博时基金管理有限公司关于与上海富友支付服务有限公司合作开通上海银行借记卡直销网上交易和费率优惠的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-04-29
7	博时中证可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-04-22
8	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-04-13
9	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增信达证券为申购、赎回代办券商的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-04-10
10	博时中证可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金 2023 年年度报告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披	2024-03-29

		露网站	
11	博时中证可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-01-22

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、中国证券监督管理委员会批准博时中证可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金设立的文件

2、《博时中证可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

3、《博时中证可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

5、博时中证可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金各年度审计报告正本

6、报告期内博时中证可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查询，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

博时一线通：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司

二〇二四年八月三十日