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 年年度报告
2024 年 12 月 31 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：二〇二五年三月三十一日

§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。本年度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 2025 年 3 月 27 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。

本报告中财务资料已经审计。容诚会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况 5
3.1 主要会计数据和财务指标 5
3.2 基金净值表现 6
3.3 过去三年基金的利润分配情况 7
§4 管理人报告 7
4.1 基金管理人及基金经理情况 7
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 10
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 11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 14
4.9 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 14
§5 托管人报告 14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 14
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 14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 14
§6 审计报告 14
6.1 审计意见 15
6.2 形成审计意见的基础 15
6.3 管理层和治理层对财务报表的责任 15
6.4 注册会计师对财务报表审计的责任 15
§7 年度财务报表 16
7.1 资产负债表 16
7.2 利润表 18
7.3 净资产变动表 19
7.4 报表附注 21
§8 投资组合报告 45
8.1 期末基金资产组合情况 45
8.2 期末按行业分类的股票投资组合 46
8.3 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 46
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 46
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 47

8.6 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 48
8.7 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 48
8.8 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 48
8.9 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 48
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 48
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 48
8.12 投资组合报告附注 48
§9 基金份额持有人信息 60
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 60
9.2 期末上市基金前十名持有人 60
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 61
9.4 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 61
§10 开放式基金份额变动 61
§11 重大事件揭示 61
11.1 基金份额持有人大会决议 61
11.2 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 61
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 62
11.4 基金投资策略的改变 62
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 62
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 62
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 62
11.8 其他重大事件 64
§12 影响投资者决策的其他重要信息 66
12.1 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 66
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 66
§13 备查文件目录 66
13.1 备查文件目录 67
13.2 存放地点 67
13.3 查阅方式 67

§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	3,320,886,670.00 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	吴曼	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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.bosera.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	容诚会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢 10 层 1001-1 至 1001-26
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2024 年	2023 年	2022 年
本期已实现收益	541,243,803.84	11,096,517.08	19,519,754.33
本期利润	2,100,993,767.18	-113,436,437.54	-123,540,874.78
加权平均基金份额本期利润	1.4274	-0.3355	-1.3649
本期加权平均净值利润率	12.93%	-3.00%	-11.97%
本期基金份额净值增长率	5.85%	-0.02%	-10.11%
3.1.2 期末数据和指标	**2024 年末**	**2023 年末**	**2022 年末**
期末可供分配利润	5,309,331,563.88	549,380,924.19	193,379,802.71
期末可供分配基金份额利润	1.5988	0.9580	0.9602
期末基金资产净值	38,518,200,187.60	6,284,247,955.46	2,207,246,619.02
期末基金份额净值	11.5988	10.9580	10.9602
3.1.3 累计期末指标	**2024 年末**	**2023 年末**	**2022 年末**
基金份额累计净值增长率	15.99%	9.58%	9.60%

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

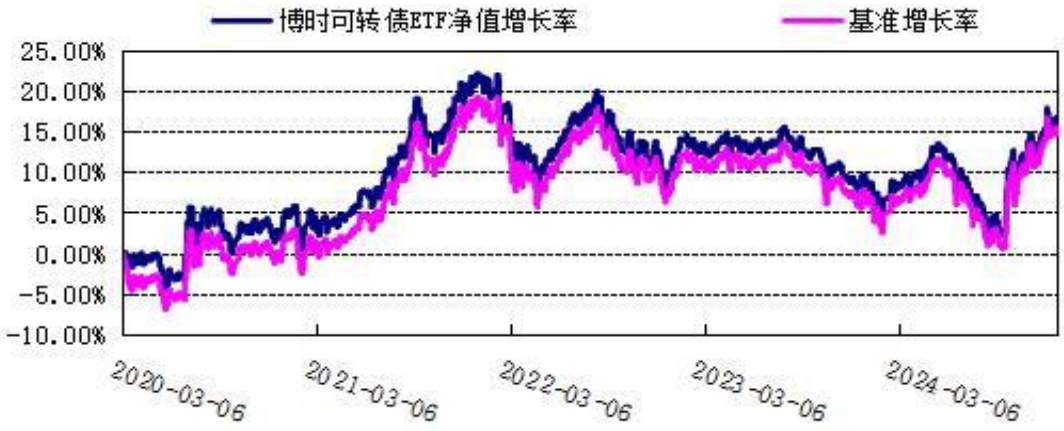
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	5.02%	0.79%	5.55%	0.80%	-0.53%	-0.01%
过去六个月	5.51%	0.73%	6.14%	0.74%	-0.63%	-0.01%
过去一年	5.85%	0.61%	6.53%	0.62%	-0.68%	-0.01%
过去三年	-4.88%	0.54%	-3.52%	0.54%	-1.36%	0.00%
自基金合同生效起至今	15.99%	0.55%	14.75%	0.55%	1.24%	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

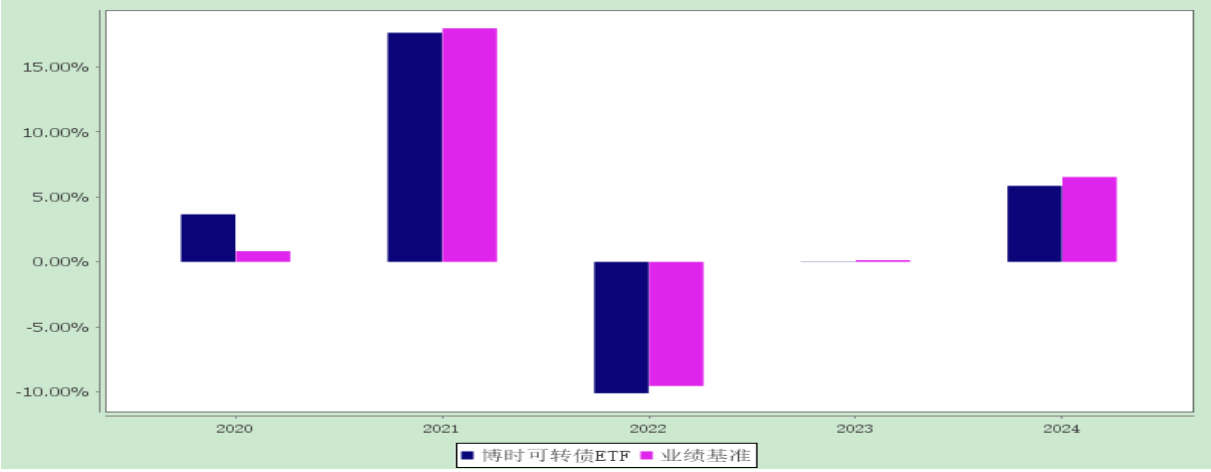
自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2020 年 3 月 6 日至 2024 年 12 月 31 日)



3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金的基金合同于 2020 年 3 月 6 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

§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 12 月 31 日，博时基金管理有限公司共管理 386 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 16089 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 6647 亿元人民币，累计分红逾 2085 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。

其他大事件

12 月，国家开发银行授予博时基金“优秀投资机构合作奖”，表彰公司在国家开发银行 2024 年银行间市场金融债券投资工作中表现突出。

11 月，深证投资者服务中心联合全景投教基地召开《股东来了》（2024）投资者权益知识竞赛深圳片区总结交流会，授予博时基金《股东来了》（2024）深圳片区突出贡献团体奖。

10 月，中国人民银行 2023 年度金融科技发展奖获奖项目名单出炉，博时基金“新一代资管业务

资金清算系统”荣获三等奖。

4 月，深圳市人工智能学会公布 2023 年度第三届“深圳人工智能奖”获奖名单，博时基金“智能量化因子投研系统”荣获人工智能行业应用奖。

1 月，中国人民银行公布 2022 年度金融科技发展奖获奖项目名单，博时基金“陪伴服务平台项目”荣获三等奖。

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	-	13.7	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	-	23.4	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	5.4	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 公平交易制度和控制方法

报告期内，根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关要求，公司进一步完善了公平交易管理机制，通过系统及人工相结合的方式，分别对一级市场及二级市场的权益类及固

定收益类投资的公平交易原则、流程，按照境内及境外业务进行了详细规范，同时也通过强化事后分析评估监督机制来确保公司公平对待管理的不同投资组合。

4.3.2 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。

4.3.3 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 132 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

国内经济实现温和增长，上半年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。9 月末三部委宣布了一揽子逆周期政策，从宽货币、托地产、稳股市等方面提出措施，此后召开的政治局会议也为宽财政托底经济释放出更为积极的信号，大幅提振投资者信心。为经济高质量发展营造了良好的货币金融环境，助力完成国内全年经济工作目标。债券市场总体仍然处于牛市行情当中，10 年期国债收益率下行幅度达到 88bp，30 年期国债收益率下行幅度达到 91bp。权益市场先抑后扬，在三季度末走出凌厉的上涨行情，万得全 A 全年上涨 10%，沪深 300 上涨 14.68%，红利策略全年占优，主题投资跑赢景气度投资。

转债方面，年度行情主要分为三个阶段：1-4 月的深 V 反弹行情，主要由于年初量化交易导致的微盘风格下跌带动转债快速下行，后随市场流动性修复反弹；5-8 月低价券信用风险释放期，在部分个券信用风险暴露之下，转债一度跌至纯债溢价率负值区间；9 月末政治局会议积极表态，并出台一揽子经济政策，权益市场走强，转债大幅修复估值，低价券弹性显著。回顾全年，转债贡献不错的年度正回报，中证转债及可交换债指数上涨 6.53%，万得可转债等权指数上涨 4.01%，AAA 转债领跑全年，银行转债表现亮眼。

2024 年，本基金跟踪的中证转债及可交换债指数上涨 6.53%。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。全年可转债 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 12 月 31 日，本基金基金份额净值为 11.5988 元，份额累计净值为 1.1599 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为 5.85%，同期业绩基准增长率 6.53%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，经济基本面仍处于温和复苏过程中，宏观数据和 PMI 数据逐步向好，稳增长政策将持续发力，央行货币政策保持宽松。24 年大量转债下修转股价，叠加 9 月后平价快速上涨，转债内嵌的期权价值由深度虚值期权变为实值期权，同时转股能力的恢复使得转债信用风险系统性下降，转债定价已恢复至常态化水平。预计 25 年转债信用风险或呈现零星状态，对市场冲击有限。当前各类型转债估值均回到历史中性以上水平，在债券配置资产稀缺、权益市场下行有底的背景之下，转债市场可能维持结构性估值中性偏高状态，尤其是偏债型转债，偏股型转股溢价率由于剩余期限缩短的制约，难以回到 22 年高点水平。考虑到新券发行数量减少、老券强赎、到期等退出数量增加，预计 25 年底转债市场余额大概率持续回落，供给端的确定性下行及资产稀缺带来的增量需求，有望为转债估值估值维持在中高水平提供有利条件。总体而言，转债市场处于可为阶段，在市场震荡上行期重视小盘转债的超额收益机会。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人的经营运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，进一步健全内控体系，完善内控制度、机制和流程，夯实内控管理基础；强化对基金投资运作和公司经营管理的合规性监察，通过实时监控、预警提示、定期检查、专项审计等方式，及时发现情况，提出改进建议并跟踪改进落实情况。公司风险管理部牵头开展内控管理工作，推动内控机制完善与执行；公司法律合规部对公司遵守各项法规和管理制度及旗下各基金履行合同义务的情况进行核查，发现违规隐患及时与有关业务人员沟通并向管理层报告；公司审计部针对基金投研交、市场销售、后台运

营、信息技术等开展内部审计项目，作出审计独立、客观的监督、评价和建议。

报告期内，内控制度方面，公司根据法律、法规的规定及公司内部管理需求，进一步健全内控管理机制，新建或修订了《制度管理规范》、《合规管理制度》、《全面风险管理制度》、《内部稽核审计制度》、《投资者适当性管理制度》、《公募基金证券交易佣金分配管理办法》、《货币市场基金投资管理制度》、《对外信息发布管理制度》、《公募基金法定信息披露管理制度》等制度文件。系统建设方面，持续对“新一代决策支持系统”、“指标中心”、“博时产品管理系统”、“统一风险管理平台”等管理平台系统功能进行迭代更新，完善“博时合规管理及审计系统”中制度库应用、合规报告生成等模块的数智化功能，进一步提升公司市场体系、投研体系、后台运作、风险合规管理的系统支持能力。基金销售方面，在新基金发行和老基金持续营销的过程中，严格规范基金销售业务，按照《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》及内部制度的规定，审查宣传推介材料，选择有代销资格的代销机构销售基金，并努力做好投资者教育工作。

4.7 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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金收益分配原则为：每一基金份额享有同等分配权；本基金基金份额的收益分配方式采用现金分红；当收益评价日核定的基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 0.01%以上时，可进行收益分配；本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。

本报告期内本基金未进行收益分配。

4.9 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。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本年度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 审计报告

容诚审字[2025]200Z1057 号

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全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

我们审计了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（以下简称“博时可转债 ETF”）财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了博时可转债 ETF2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于博时可转债 ETF，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 管理层和治理层对财务报表的责任

博时可转债 ETF 的基金管理人博时基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估博时可转债 ETF 的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算博时可转债 ETF、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督博时可转债 ETF 的财务报告过程。

6.4 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在

某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

（3）评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

（4）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对博时可转债 ETF 持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致博时可转债 ETF 不能持续经营。

（5）评价财务报表的总体列报、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

容诚会计师事务所(特殊普通合伙)　　中国注册会计师

薛竞　吴琳杰

北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢 10 层 1001-1 至 1001-26

2025 年 3 月 27 日

§7 年度财务报表

7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	253,703,240.90	122,235,261.21
结算备付金		104,011,115.88	6,651,368.80
存出保证金		1,229,394.44	172,324.24
交易性金融资产	7.4.7.2	38,036,843,597.25	6,040,843,741.98
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		38,036,843,597.25	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	474,953,408.76	133,983,790.71
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		59,235.14	4,893.00
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		38,870,799,992.37	6,303,891,379.94
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2024 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		342,544,560.84	17,330,611.42
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		4,456,669.74	766,086.42
应付托管费		1,485,556.59	255,362.16
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		655,137.90	81,041.48
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-

其他负债	7.4.7.6	3,457,879.70	1,210,323.00
负债合计		352,599,804.77	19,643,424.48
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	33,208,868,623.72	5,734,867,031.27
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	5,309,331,563.88	549,380,924.19
净资产合计		38,518,200,187.60	6,284,247,955.46
负债和净资产总计		38,870,799,992.37	6,303,891,379.94

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额净值 11.5988 元，基金份额总额 3,320,886,670.00 份。

7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		**2,137,322,595.64**	**-104,705,769.20**
1.利息收入		7,003,031.51	1,394,420.33
其中：存款利息收入	7.4.7.9	1,906,728.68	264,278.60
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		5,096,302.83	1,130,141.73
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		519,698,176.98	15,882,768.23
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-4,131,999.95	-8,540.53
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	523,830,176.93	15,891,308.76
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	-	-
股利收益	7.4.7.14	-	-
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）	7.4.7.15	1,559,749,963.34	-124,532,954.62
4.汇兑收益（损失以“－”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	50,871,423.81	2,549,996.86
减：二、营业总支出		**36,328,828.46**	**8,730,668.34**
1．管理人报酬		24,215,532.28	5,645,346.17

其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2．托管费		8,071,844.10	1,881,782.02
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	7.4.7.17	-	-
7．税金及附加		402,124.17	54,624.82
8．其他费用	7.4.7.18	3,639,327.91	1,148,915.33
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**2,100,993,767.18**	**-113,436,437.54**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**2,100,993,767.18**	**-113,436,437.54**
五、其他综合收益的税后净额		**-**	**-**
六、综合收益总额		**2,100,993,767.18**	**-113,436,437.54**

7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	实收基金	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）	27,474,001,592.45	4,759,950,639.69	32,233,952,232.14
（一）、综合收益总额	-	2,100,993,767.18	2,100,993,767.18
（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）	27,474,001,592.45	2,658,956,872.51	30,132,958,464.96

其中：1.基金申购款	31,128,001,805.16	3,061,003,172.92	34,189,004,978.08
2.基金赎回款	-3,654,000,212.71	-402,046,300.41	-4,056,046,513.12
（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	33,208,868,623.72	5,309,331,563.88	38,518,200,187.60
项目	**上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日**		
	实收基金	**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）	3,721,000,214.96	356,001,121.48	4,077,001,336.44
（一）、综合收益总额	-	-113,436,437.54	-113,436,437.54
（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）	3,721,000,214.96	469,437,559.02	4,190,437,773.98
其中：1.基金申购款	4,335,000,250.35	543,243,051.75	4,878,243,302.10
2.基金赎回款	-614,000,035.39	-73,805,492.73	-687,805,528.12
（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	5,734,867,031.27	549,380,924.19	6,284,247,955.46

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

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（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2019]2354 号《关于准予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注册的批复》准予注册，由博时基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《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》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 601,864,335.00 元（含所募集债券市值），业经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）普华永道中天验字（2020）第 0146 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《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》于 2020 年 3 月 6 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 601,866,735.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 2,400.00 份基金份额。本基金的基金管理人为博时基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

经上海证券交易所（以下简称“上交所”）自律监管决定书[2020]86 号核准，本基金于 2020 年 4 月 7 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《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》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份债券和备选成份债券。本基金不直接从二级市场买入股票，也不参与一级市场新股或增发新股的申购。但可持有因可转债转股所形成的股票、因可交换债换股所形成的股票，不过须在其可交易之日起 10 个交易日内卖出。本基金投资于标的指数成份债券和备选成份债券的资产比例不低于基金资产净值的 80%，且不低于非现金基金资产的 80%。本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。本

基金的业绩比较基准为：中证可转债及可交换债券指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人博时基金管理有限公司于 2025 年 3 月 27 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则－基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《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》和在财务报表附注“重要会计政策和会计估计”所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金本报告期财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本期末的财务状况以及本报告期的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

（1）金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方

式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

（2）金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

（3）衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑在资产负债表日无须付出不必要的额外成本和努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：（1）收取该金融资产现金流量的合同权利终止；（2）该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者（3）该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果

该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

（2）当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

（3）如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1）具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2）交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：（1）赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；（2）该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；（3）该工具所属的类别中（该类别次于其他所有工具类别），所有工具具有相同的特征（例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同）；（4）除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；（5）该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动（不包括本基金的任何影响）。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：（1）现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动（不包括该基金或合同的任何影响）；（2）实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/（累计亏损）。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率（对于贴现债为按发行价计算的利率）或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率（对于贴现债为按发行价计算的利率）或合同利率计算的利息及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。当收益评价日核定的基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 0.01%以上时，可进行收益分配。本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，

本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、可交换债券除外）及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566 号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、可交换债券除外），按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

（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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	253,703,240.90	122,235,261.21
等于：本金	253,662,728.23	122,227,161.81
加：应计利息	40,512.67	8,099.40
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
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	-	-
合计	253,703,240.90	122,235,261.21

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024 年 12 月 31 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	36,499,326,878.44	183,499,719.80	38,036,843,597.25	1,354,016,999.01
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	36,499,326,878.44	183,499,719.80	38,036,843,597.25	1,354,016,999.01
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		36,499,326,878.44	183,499,719.80	38,036,843,597.25	1,354,016,999.01
项目		上年度末 2023 年 12 月 31 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	6,221,416,989.87	25,159,716.44	6,040,843,741.98	-205,732,964.33

	银行间市场	-	-	-	-
	合计	6,221,416,989.87	25,159,716.44	6,040,843,741.98	-205,732,964.33
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		6,221,416,989.87	25,159,716.44	6,040,843,741.98	-205,732,964.33

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	474,953,408.76	-
银行间市场	-	-
合计	474,953,408.76	-
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	133,983,790.71	-
银行间市场	-	-
合计	133,983,790.71	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

7.4.7.5 其他资产

无余额。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 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	119,142.06	25,331.04
其中：交易所市场	119,142.06	25,331.04
银行间市场	-	-
应付利息	-	-

预提费用	90,000.00	209,000.00
应付指数使用费	3,228,737.64	955,991.96
应付 IOPV 计算与发布费	20,000.00	20,000.00
合计	3,457,879.70	1,210,323.00

7.4.7.7 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 12 月 31 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	3,112,800,000.00	31,128,001,805.16
本期赎回（以“-”号填列）	-365,400,000.00	-3,654,000,212.71
本期末	3,320,886,670.00	33,208,868,623.72

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)。

7.4.7.8 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	541,243,803.84	1,559,749,963.34	2,100,993,767.18
本期基金份额交易产生的变动数	4,259,468,992.22	-1,600,512,119.71	2,658,956,872.51
其中：基金申购款	4,829,936,311.29	-1,768,933,138.37	3,061,003,172.92
基金赎回款	-570,467,319.07	168,421,018.66	-402,046,300.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,618,609,973.98	-309,278,410.10	5,309,331,563.88

7.4.7.9 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	1,337,776.62	159,702.21
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	561,486.69	102,799.80
其他	7,465.37	1,776.59
合计	1,906,728.68	264,278.60

7.4.7.10 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	650,453,616.03	86,490,742.71
减：卖出股票成本总额	654,045,962.66	86,359,712.16
减：交易费用	539,653.32	139,571.08
买卖股票差价收入	-4,131,999.95	-8,540.53

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	199,285,432.84	30,278,797.57
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	324,544,744.09	-14,387,488.81
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	523,830,176.93	15,891,308.76

7.4.7.11.2 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	8,329,554,404.58	1,798,275,602.70
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	7,954,959,192.20	1,802,778,219.84
减：应计利息总额	48,259,350.11	9,595,793.63
减：交易费用	1,791,118.18	289,078.04
买卖债券差价收入	324,544,744.09	-14,387,488.81

7.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间

	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	4,056,046,513.12	687,805,528.12
减：现金支付赎回款总额	4,056,046,513.12	687,805,528.12
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	-	-

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

7.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

无发生额。

7.4.7.12.2 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。

7.4.7.13 衍生工具收益

7.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无发生额。

7.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

无发生额。

7.4.7.14 股利收益

无发生额。

7.4.7.15 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	1,559,749,963.34	-124,532,954.62
——股票投资	-	-
——债券投资	1,559,749,963.34	-124,532,954.62
——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	1,559,749,963.34	-124,532,954.62

7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	50,871,423.81	2,549,996.86
合计	50,871,423.81	2,549,996.86

7.4.7.17 信用减值损失

无发生额。

7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	90,000.00	89,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	30,590.27	17,202.45
中登注册登记费	150,000.00	150,000.00
指数使用费	3,228,737.64	752,712.88
IOPV 计算与发布费	20,000.00	20,000.00
合计	3,639,327.91	1,148,915.33

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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
中国长城资产管理股份有限公司	基金管理人的股东
浙江省国际贸易集团有限公司	基金管理人的股东
浙江省国贸集团资产经营有限公司	基金管理人的原股东

广厦建设集团有限责任公司	基金管理人的原股东
天津港（集团）有限公司	基金管理人的股东
上海汇华实业有限公司	基金管理人的股东
上海盛业股权投资基金有限公司	基金管理人的股东
博时资本管理有限公司（“博时资本”）	基金管理人的子公司
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
博时基金（国际）有限公司（“博时国际”）	基金管理人的子公司
海南博时创新管理有限公司（“博时创新”）	基金管理人的子公司

注：1.经基金管理人 2024 年第五次临时股东会议决议通过，基金管理人原全资控股的孙公司海南博时创新管理有限公司于 2024 年 3 月 27 日完成工商变更登记，变更为基金管理人的全资子公司。

2.经基金管理人 2023 年第三次临时股东会议决议，股东广厦建设集团有限责任公司将其持有的基金管理人 2%的股权转让给浙江省国贸集团资产经营有限公司。经基金管理人 2024 年第二次临时股东会议决议，股东浙江省国贸集团资产经营有限公司将其持有的基金管理人 2%的股权转让给浙江省国际贸易集团有限公司。于 2024 年 12 月 24 日，基金管理人已完成前述股东变更事项的工商变更登记，上述股东变更完成后，基金管理人股权结构为：招商证券股份有限公司 49%，中国长城资产管理股份有限公司 25%，上海汇华实业有限公司 12%，天津港(集团)有限公司 6%，上海盛业股权投资基金有限公司 6%和浙江省国际贸易集团有限公司 2%。

3.下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
招商证券	-	-	23,942,262.42	27.68%

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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	2,753,055,047.73	6.02%	1,162,687,306.70	15.54%

7.4.10.1.4 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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	-	-	1,930,700,000.00	17.22%

7.4.10.1.5 基金交易

无。

7.4.10.1.6 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 12 月 31 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 12 月 31 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	17,508.92	27.47%	-	-

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。根据证监会公告[2024]3 号《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，针对被动股票型基金，不再通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；针对其他类型基金，不再通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	24,215,532.28	5,645,346.17
其中：应支付销售机构的客户维护费	6,609.67	-
应支付基金管理人的净管理费	24,208,922.61	5,645,346.17

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	8,071,844.10	1,881,782.02

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。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 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 12 月 31 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	288,750.00	0.01%	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。

7.4.10.6 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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	253,703,240.90	1,337,776.62	122,235,261.21	159,702.21

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。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末（2024 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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、法律合规部、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；法律合规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。

7.4.13.2 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。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.2.4 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 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
AAA	16,265,037,786.22	2,754,233,765.66
AAA 以下	21,771,806,980.75	3,286,609,976.32
未评级	-	-
合计	38,036,844,766.97	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。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.3 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。

7.4.13.3.1 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 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	253,703,240.90	-	-	-	253,703,240.90
结算备付金	104,011,115.88	-	-	-	104,011,115.88
存出保证金	1,229,394.44	-	-	-	1,229,394.44
交易性金融资产	5,521,653,745.22	30,735,252,023.67	1,779,937,828.36	-	38,036,843,597.25
应收清算款	-	-	-	59,235.14	59,235.14
买入返售金融资产	474,953,408.76	-	-	-	474,953,408.76

应收申购款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	**6,355,550,905.20**	**30,735,252,023.67**	**1,779,937,828.36**	**59,235.14**	**38,870,799,992.37**
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	342,544,560.84	342,544,560.84
应付管理人报酬	-	-	-	4,456,669.74	4,456,669.74
应付托管费	-	-	-	1,485,556.59	1,485,556.59
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	655,137.90	655,137.90
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	3,457,879.70	3,457,879.70
负债总计	-	-	-	**352,599,804.77**	**352,599,804.77**
利率敏感度缺口	**6,355,550,905.20**	**30,735,252,023.67**	**1,779,937,828.36**	**-352,540,569.63**	**38,518,200,187.60**
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
买入返售金融资产	133,983,790.71	-	-	-	133,983,790.71
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。

7.4.13.4.1.2 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）。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 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	38,036,843,597.25	98.75	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	38,036,843,597.25	98.75	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。

7.4.13.4.3.2 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 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 193,113	增加约 30,567
	业绩比较基准下降 5%	减少约 193,113	减少约 30,567

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	38,036,843,597.25	6,040,843,741.98
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	38,036,843,597.25	6,040,843,741.98

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.3 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（上年度末：同）。

7.4.14.4 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。

7.4.15 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。

§8 投资组合报告

8.1 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	38,036,843,597.25	97.85

	其中：债券	38,036,843,597.25	97.85
	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	474,953,408.76	1.22
	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	357,714,356.78	0.92
8	其他各项资产	1,288,629.58	0.00
9	合计	38,870,799,992.37	100.00

注：债券投资项包含可退替代款估值增值。

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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。

8.2.2 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。

8.3 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。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	601998	中信银行	124,436,489.19	1.98
2	601838	成都银行	113,850,340.63	1.81
3	301078	孩子王	60,777,962.36	0.97
4	601878	浙商证券	55,970,137.50	0.89
5	600900	长江电力	52,049,085.92	0.83
6	300346	南大光电	46,662,812.22	0.74
7	300863	卡倍亿	43,002,309.14	0.68
8	300296	利亚德	42,700,700.36	0.68
9	600483	福能股份	37,105,921.97	0.59
10	603920	世运电路	33,452,473.05	0.53
11	000623	吉林敖东	18,105,384.88	0.29
12	300984	金沃股份	17,537,184.84	0.28
13	300879	大叶股份	8,395,160.60	0.13

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。

8.4.2 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	601998	中信银行	122,588,478.97	1.95
2	601838	成都银行	113,221,416.14	1.80
3	301078	孩子王	56,666,783.55	0.90
4	601878	浙商证券	56,306,731.71	0.90
5	600900	长江电力	53,522,308.08	0.85
6	300863	卡倍亿	46,806,916.18	0.74
7	300346	南大光电	46,631,656.32	0.74
8	300296	利亚德	42,188,745.46	0.67
9	600483	福能股份	37,198,531.93	0.59
10	603920	世运电路	31,008,933.55	0.49
11	000623	吉林敖东	18,290,619.59	0.29
12	300984	金沃股份	17,678,131.03	0.28
13	300879	大叶股份	8,344,363.52	0.13

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。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	654,045,962.66
卖出股票的收入（成交）总额	650,453,616.03

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。

8.5 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）	38,036,843,597.25	98.75
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	38,036,843,597.25	98.75

注：上述可转债（可交换债）投资项包含可退替代款估值增值。

8.6 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	113052	兴业转债	21981100	2,480,798,990.54	6.44
2	110059	浦发转债	21997580	2,397,787,447.30	6.23
3	113042	上银转债	8884160	1,066,506,897.74	2.77
4	113050	南银转债	6622640	860,463,285.43	2.23
5	110079	杭银转债	6598730	851,856,269.81	2.21

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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，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浙江省分局、国家金融监督管理总局浙江监管局的处罚。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。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浙江省分行、中国人民银行广西壮族自治区分行、国家外汇管理局上海市分局、国家外汇管理局黑龙江省分局、国家金融监督管理总局宁波监管局的处罚。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福建监管局、天津市市场监督管理委员会的处罚。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

理总局深圳监管局、国家金融监督管理总局上海监管局的处罚。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四川省分行、国家外汇管理局南通市分局、国家金融监督管理总局、国家金融监督管理总局吉林监管局的处罚。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。

8.12.2 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。本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

8.12.3 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	1,229,394.44
2	应收清算款	59,235.14
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	-
8	其他	-
9	合计	1,288,629.58

8.12.4 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	113052	兴业转债	2,480,798,990.54	6.44
2	110059	浦发转债	2,397,787,447.30	6.23
3	113042	上银转债	1,066,506,897.74	2.77
4	113050	南银转债	860,463,285.43	2.23
5	110079	杭银转债	851,856,269.81	2.21
6	113056	重银转债	668,363,469.08	1.74
7	132026	G 三峡 EB2	592,567,211.03	1.54
8	110085	通 22 转债	581,179,574.02	1.51
9	113044	大秦转债	549,528,018.88	1.43
10	113021	中信转债	526,363,188.22	1.37
11	127045	牧原转债	467,759,240.27	1.21
12	118034	晶能转债	439,653,261.37	1.14
13	110081	闻泰转债	425,058,380.56	1.10
14	123107	温氏转债	406,368,205.07	1.06
15	110073	国投转债	400,843,970.20	1.04

16	118031	天 23 转债	393,367,471.59	1.02
17	127089	晶澳转债	385,989,297.90	1.00
18	113641	华友转债	380,209,360.58	0.99
19	127049	希望转 2	367,275,288.71	0.95
20	113065	齐鲁转债	351,984,496.34	0.91
21	113053	隆 22 转债	325,814,604.92	0.85
22	113062	常银转债	323,860,513.44	0.84
23	110075	南航转债	319,621,213.46	0.83
24	127018	本钢转债	295,094,199.62	0.77
25	127032	苏行转债	285,560,165.57	0.74
26	128129	青农转债	240,591,681.36	0.62
27	127083	山路转债	237,691,597.83	0.62
28	127056	中特转债	236,843,488.54	0.61
29	127030	盛虹转债	235,512,318.09	0.61
30	113037	紫银转债	214,830,460.85	0.56
31	127084	柳工转 2	199,597,481.68	0.52
32	127040	国泰转债	195,435,516.41	0.51
33	113055	成银转债	190,451,127.26	0.49
34	113043	财通转债	189,530,065.74	0.49
35	113059	福莱转债	185,797,672.82	0.48
36	113049	长汽转债	171,928,136.64	0.45
37	113045	环旭转债	167,889,176.80	0.44
38	111010	立昂转债	160,420,326.79	0.42
39	127073	天赐转债	160,062,651.69	0.42
40	127086	恒邦转债	158,641,596.33	0.41
41	127020	中金转债	156,268,058.39	0.41
42	110067	华安转债	155,689,614.79	0.40
43	113067	燃 23 转债	155,655,351.87	0.40
44	113051	节能转债	153,740,650.73	0.40
45	128136	立讯转债	153,405,117.23	0.40
46	127061	美锦转债	153,396,802.51	0.40
47	110062	烽火转债	152,103,416.71	0.39
48	110093	神马转债	151,984,422.57	0.39
49	118024	冠宇转债	149,246,213.14	0.39
50	113661	福 22 转债	145,019,656.97	0.38
51	113685	升 24 转债	144,805,009.81	0.38
52	118022	锂科转债	141,823,733.10	0.37
53	113024	核建转债	141,523,140.01	0.37
54	110089	兴发转债	138,958,652.98	0.36
55	110087	天业转债	138,370,293.15	0.36
56	127067	恒逸转 2	135,017,747.52	0.35
57	128081	海亮转债	134,227,040.41	0.35
58	113061	拓普转债	132,834,314.96	0.34

59	127050	麒麟转债	127,832,927.95	0.33
60	113616	韦尔转债	120,048,857.44	0.31
61	113623	凤 21 转债	119,872,558.76	0.31
62	127085	韵达转债	114,472,100.48	0.30
63	110095	双良转债	113,330,342.30	0.29
64	113666	爱玛转债	111,266,173.96	0.29
65	113632	鹤 21 转债	110,369,764.94	0.29
66	113054	绿动转债	110,171,830.71	0.29
67	128109	楚江转债	109,980,999.98	0.29
68	110082	宏发转债	108,872,395.70	0.28
69	113058	友发转债	106,506,750.99	0.28
70	123190	道氏转 02	105,979,879.20	0.28
71	113048	晶科转债	104,709,585.72	0.27
72	123158	宙邦转债	104,133,882.82	0.27
73	123119	康泰转 2	102,548,643.10	0.27
74	123216	科顺转债	99,713,855.23	0.26
75	113655	欧 22 转债	98,801,189.50	0.26
76	113069	博 23 转债	97,038,145.56	0.25
77	127027	能化转债	93,902,917.68	0.24
78	127039	北港转债	91,890,972.36	0.24
79	127103	东南转债	90,714,639.51	0.24
80	127022	恒逸转债	90,632,736.02	0.24
81	110086	精工转债	89,734,107.42	0.23
82	118030	睿创转债	88,444,699.95	0.23
83	110063	鹰 19 转债	88,152,048.70	0.23
84	110076	华海转债	86,698,805.36	0.23
85	113682	益丰转债	85,186,407.16	0.22
86	113066	平煤转债	83,723,492.86	0.22
87	110090	爱迪转债	82,949,130.20	0.22
88	127091	科数转债	81,039,000.61	0.21
89	113615	金诚转债	79,223,381.61	0.21
90	127025	冀东转债	77,922,470.95	0.20
91	113047	旗滨转债	77,127,403.35	0.20
92	127100	神码转债	75,567,336.05	0.20
93	123149	通裕转债	75,233,128.75	0.20
94	118013	道通转债	74,834,521.14	0.19
95	123108	乐普转 2	74,829,682.37	0.19
96	127066	科利转债	74,734,455.39	0.19
97	127038	国微转债	74,595,406.47	0.19
98	128131	崇达转 2	74,193,183.29	0.19
99	123228	震裕转债	73,756,186.34	0.19
100	128134	鸿路转债	73,690,949.44	0.19
101	123169	正海转债	73,075,647.79	0.19

102	123176	精测转 2	72,661,737.53	0.19
103	113652	伟 22 转债	72,441,600.31	0.19
104	127070	大中转债	72,354,090.90	0.19
105	113068	金铜转债	71,827,157.14	0.19
106	113605	大参转债	71,271,644.17	0.19
107	113647	禾丰转债	70,994,504.29	0.18
108	118025	奕瑞转债	70,480,382.44	0.18
109	110092	三房转债	70,182,321.66	0.18
110	113046	金田转债	69,596,450.95	0.18
111	127024	盈峰转债	69,091,951.49	0.18
112	127016	鲁泰转债	68,799,305.49	0.18
113	113033	利群转债	68,783,862.84	0.18
114	128135	洽洽转债	68,455,892.00	0.18
115	128141	旺能转债	68,217,407.13	0.18
116	113064	东材转债	67,518,272.25	0.18
117	118023	广大转债	67,504,113.03	0.18
118	111018	华康转债	67,132,559.97	0.17
119	110094	众和转债	65,323,683.44	0.17
120	128108	蓝帆转债	64,652,227.15	0.17
121	123213	天源转债	64,585,551.14	0.17
122	123161	强联转债	63,768,707.79	0.17
123	113659	莱克转债	62,772,906.30	0.16
124	110064	建工转债	62,679,265.81	0.16
125	123237	佳禾转债	62,076,702.71	0.16
126	123118	惠城转债	61,615,922.50	0.16
127	110077	洪城转债	61,183,796.84	0.16
128	113669	景 23 转债	60,954,064.01	0.16
129	123178	花园转债	59,600,294.26	0.15
130	123210	信服转债	59,270,471.15	0.15
131	127082	亚科转债	58,076,458.75	0.15
132	127101	豪鹏转债	56,905,621.50	0.15
133	123128	首华转债	56,749,153.50	0.15
134	127043	川恒转债	56,704,903.73	0.15
135	123145	药石转债	56,246,113.31	0.15
136	127064	杭氧转债	55,836,513.12	0.14
137	113675	新 23 转债	54,571,687.83	0.14
138	127052	西子转债	53,202,548.67	0.14
139	113677	华懋转债	52,468,289.46	0.14
140	127046	百润转债	51,694,244.77	0.13
141	123150	九强转债	51,589,911.19	0.13
142	127092	运机转债	50,479,525.02	0.13
143	128130	景兴转债	50,423,172.39	0.13
144	118042	奥维转债	49,725,531.15	0.13

145	110074	精达转债	49,391,832.57	0.13
146	118038	金宏转债	49,137,859.81	0.13
147	113631	皖天转债	49,111,702.29	0.13
148	123174	精锻转债	47,485,418.45	0.12
149	123104	卫宁转债	47,371,782.20	0.12
150	128144	利民转债	47,137,157.95	0.12
151	123113	仙乐转债	47,119,645.61	0.12
152	111000	起帆转债	47,046,823.97	0.12
153	127031	洋丰转债	46,790,309.24	0.12
154	113644	艾迪转债	46,604,573.36	0.12
155	110084	贵燃转债	46,476,588.61	0.12
156	123240	楚天转债	46,456,905.10	0.12
157	123117	健帆转债	46,366,069.23	0.12
158	127102	浙建转债	46,111,655.33	0.12
159	127017	万青转债	46,084,610.87	0.12
160	113636	甬金转债	46,075,530.18	0.12
161	113633	科沃转债	46,058,720.88	0.12
162	111019	宏柏转债	45,911,180.66	0.12
163	128132	交建转债	45,606,297.71	0.12
164	113673	岱美转债	44,841,070.96	0.12
165	118028	会通转债	44,640,803.79	0.12
166	123114	三角转债	44,448,632.42	0.12
167	127037	银轮转债	44,442,264.11	0.12
168	127076	中宠转 2	44,385,395.54	0.12
169	111017	蓝天转债	43,844,893.05	0.11
170	113658	密卫转债	43,714,412.43	0.11
171	118000	嘉元转债	43,648,955.27	0.11
172	127075	百川转 2	43,546,484.79	0.11
173	113549	白电转债	43,529,471.84	0.11
174	113640	苏利转债	43,385,488.38	0.11
175	123076	强力转债	43,283,661.12	0.11
176	123120	隆华转债	43,206,950.09	0.11
177	123194	百洋转债	43,187,891.38	0.11
178	128119	龙大转债	43,119,196.85	0.11
179	123179	立高转债	42,870,491.80	0.11
180	128127	文科转债	42,865,296.14	0.11
181	123225	翔丰转债	42,739,067.05	0.11
182	123212	立中转债	42,623,651.75	0.11
183	113545	金能转债	42,395,157.23	0.11
184	118003	华兴转债	42,363,142.20	0.11
185	113637	华翔转债	42,233,258.45	0.11
186	127015	希望转债	42,171,397.99	0.11
187	123121	帝尔转债	41,850,311.03	0.11

188	123215	铭利转债	41,425,984.68	0.11
189	128133	奇正转债	41,314,865.32	0.11
190	123146	中环转 2	41,169,427.15	0.11
191	127019	国城转债	40,787,478.93	0.11
192	111007	永和转债	40,763,416.70	0.11
193	127095	广泰转债	40,042,964.46	0.10
194	123211	阳谷转债	40,034,514.72	0.10
195	123049	维尔转债	39,998,086.83	0.10
196	113679	芯能转债	39,805,236.52	0.10
197	113634	珀莱转债	39,620,207.29	0.10
198	113648	巨星转债	39,577,579.14	0.10
199	123192	科思转债	39,277,254.56	0.10
200	127104	姚记转债	38,507,936.92	0.10
201	123133	佩蒂转债	38,279,674.39	0.10
202	113563	柳药转债	38,225,267.57	0.10
203	123165	回天转债	38,142,086.40	0.10
204	123172	漱玉转债	37,965,154.93	0.10
205	113656	嘉诚转债	37,876,203.81	0.10
206	113672	福蓉转债	37,782,509.59	0.10
207	127105	龙星转债	37,674,646.52	0.10
208	118005	天奈转债	37,495,671.91	0.10
209	123191	智尚转债	37,461,593.44	0.10
210	113627	太平转债	37,408,918.07	0.10
211	118027	宏图转债	37,270,433.05	0.10
212	113663	新化转债	37,234,253.14	0.10
213	113650	博 22 转债	37,192,884.80	0.10
214	118043	福立转债	37,136,543.73	0.10
215	123188	水羊转债	37,001,912.61	0.10
216	123182	广联转债	36,952,518.89	0.10
217	123236	家联转债	36,863,171.42	0.10
218	128142	新乳转债	36,824,135.45	0.10
219	113670	金 23 转债	36,731,363.69	0.10
220	113609	永安转债	36,606,029.80	0.10
221	123131	奥飞转债	35,915,210.50	0.09
222	127035	濮耐转债	35,657,910.31	0.09
223	123204	金丹转债	35,623,527.04	0.09
224	113651	松霖转债	35,527,314.79	0.09
225	127026	超声转债	35,513,471.20	0.09
226	123239	锋工转债	35,415,512.20	0.09
227	127068	顺博转债	35,263,136.87	0.09
228	113653	永 22 转债	35,146,707.54	0.09
229	113684	湘泵转债	35,061,780.65	0.09
230	127042	嘉美转债	34,999,465.87	0.09

231	118041	星球转债	34,877,899.82	0.09
232	123063	大禹转债	34,837,128.78	0.09
233	128128	齐翔转 2	34,550,118.97	0.09
234	123078	飞凯转债	34,547,921.63	0.09
235	111002	特纸转债	34,487,028.13	0.09
236	128074	游族转债	34,370,956.64	0.09
237	123071	天能转债	34,303,282.85	0.09
238	127055	精装转债	34,060,675.75	0.09
239	127014	北方转债	33,979,619.72	0.09
240	123222	博俊转债	33,721,601.04	0.09
241	113584	家悦转债	33,695,765.11	0.09
242	111015	东亚转债	33,635,088.94	0.09
243	113667	春 23 转债	33,520,161.86	0.09
244	123147	中辰转债	33,258,706.71	0.09
245	113621	彤程转债	33,120,475.25	0.09
246	123229	艾录转债	33,107,917.93	0.09
247	127034	绿茵转债	32,810,433.00	0.09
248	113530	大丰转债	32,599,111.84	0.08
249	123151	康医转债	32,544,974.91	0.08
250	123231	信测转债	32,449,067.65	0.08
251	118033	华特转债	32,388,281.73	0.08
252	127041	弘亚转债	32,323,706.55	0.08
253	111011	冠盛转债	32,042,851.15	0.08
254	113676	荣 23 转债	31,999,613.20	0.08
255	111009	盛泰转债	31,996,563.29	0.08
256	123186	志特转债	31,914,222.95	0.08
257	113681	镇洋转债	31,887,655.32	0.08
258	128137	洁美转债	31,815,549.05	0.08
259	118032	建龙转债	31,704,989.08	0.08
260	113629	泉峰转债	31,701,882.36	0.08
261	127051	博杰转债	31,696,948.80	0.08
262	123233	凯盛转债	31,680,585.27	0.08
263	123226	中富转债	31,533,141.52	0.08
264	111004	明新转债	31,432,020.51	0.08
265	113625	江山转债	31,395,220.36	0.08
266	118037	上声转债	31,394,422.77	0.08
267	128116	瑞达转债	31,382,539.14	0.08
268	123064	万孚转债	31,358,568.41	0.08
269	123184	天阳转债	31,281,578.92	0.08
270	123183	海顺转债	31,238,270.26	0.08
271	111016	神通转债	31,168,065.75	0.08
272	111001	山玻转债	31,049,182.36	0.08
273	128121	宏川转债	30,934,063.79	0.08

274	113678	中贝转债	30,852,584.77	0.08
275	113654	永 02 转债	30,777,201.28	0.08
276	113638	台 21 转债	30,743,967.89	0.08
277	127088	赫达转债	30,676,731.83	0.08
278	123157	科蓝转债	30,658,553.49	0.08
279	113606	荣泰转债	30,654,475.90	0.08
280	123059	银信转债	30,505,806.51	0.08
281	128105	长集转债	30,501,184.61	0.08
282	127078	优彩转债	30,498,729.12	0.08
283	123217	富仕转债	30,316,311.74	0.08
284	123122	富瀚转债	30,273,097.87	0.08
285	123195	蓝晓转 02	30,178,754.42	0.08
286	111014	李子转债	30,058,623.69	0.08
287	118008	海优转债	30,052,246.00	0.08
288	123193	海能转债	29,991,678.38	0.08
289	113569	科达转债	29,982,797.86	0.08
290	113542	好客转债	29,964,222.25	0.08
291	113582	火炬转债	29,684,941.70	0.08
292	127053	豪美转债	29,597,076.68	0.08
293	123187	超达转债	28,995,808.07	0.08
294	127099	盛航转债	28,976,633.94	0.08
295	127060	湘佳转债	28,810,827.43	0.07
296	123221	力诺转债	28,792,848.26	0.07
297	123085	万顺转 2	28,785,825.20	0.07
298	123203	明电转 02	28,718,370.49	0.07
299	127087	星帅转 2	28,687,954.76	0.07
300	123162	东杰转债	28,673,800.33	0.07
301	118045	盟升转债	28,655,649.54	0.07
302	123224	宇邦转债	28,561,366.13	0.07
303	127072	博实转债	28,535,341.81	0.07
304	127069	小熊转债	28,515,076.22	0.07
305	123056	雪榕转债	28,446,804.85	0.07
306	127054	双箭转债	28,433,966.45	0.07
307	123235	亿田转债	28,428,879.07	0.07
308	113639	华正转债	28,390,246.73	0.07
309	123091	长海转债	28,311,356.96	0.07
310	127081	中旗转债	27,973,254.40	0.07
311	123144	裕兴转债	27,807,003.34	0.07
312	123142	申昊转债	27,615,492.34	0.07
313	123082	北陆转债	27,501,899.64	0.07
314	113657	再 22 转债	27,432,649.73	0.07
315	123090	三诺转债	27,296,990.77	0.07
316	111005	富春转债	27,102,105.48	0.07

317	123154	火星转债	27,095,748.03	0.07
318	123132	回盛转债	27,009,977.17	0.07
319	118004	博瑞转债	26,938,352.37	0.07
320	118012	微芯转债	26,827,286.44	0.07
321	127071	天箭转债	26,635,629.52	0.07
322	113643	风语转债	26,633,007.55	0.07
323	118011	银微转债	26,544,238.12	0.07
324	123127	耐普转债	26,474,219.62	0.07
325	123124	晶瑞转 2	26,394,549.58	0.07
326	113664	大元转债	26,339,468.25	0.07
327	123092	天壕转债	26,091,904.77	0.07
328	123109	昌红转债	26,011,710.33	0.07
329	128066	亚泰转债	26,002,254.06	0.07
330	123048	应急转债	25,940,801.14	0.07
331	113579	健友转债	25,904,586.05	0.07
332	123168	惠云转债	25,890,308.79	0.07
333	118035	国力转债	25,704,076.59	0.07
334	118020	芳源转债	25,632,068.42	0.07
335	113532	海环转债	25,130,111.95	0.07
336	128125	华阳转债	25,095,385.77	0.07
337	113588	润达转债	25,087,495.28	0.07
338	123214	东宝转债	25,032,697.14	0.06
339	113618	美诺转债	25,027,509.08	0.06
340	127077	华宏转债	25,017,283.30	0.06
341	127090	兴瑞转债	24,919,202.25	0.06
342	123227	雅创转债	24,570,792.00	0.06
343	128095	恩捷转债	24,460,678.66	0.06
344	128097	奥佳转债	24,372,273.49	0.06
345	127098	欧晶转债	24,328,625.21	0.06
346	113649	丰山转债	24,070,164.03	0.06
347	123223	九典转 02	23,759,653.25	0.06
348	118014	高测转债	23,730,643.59	0.06
349	118044	赛特转债	23,599,994.48	0.06
350	118029	富淼转债	23,587,951.99	0.06
351	118040	宏微转债	22,773,375.52	0.06
352	118010	洁特转债	22,388,473.41	0.06
353	123087	明电转债	21,941,773.75	0.06
354	118018	瑞科转债	21,296,599.46	0.06
355	113601	塞力转债	20,735,636.16	0.05
356	128138	侨银转债	18,134,203.12	0.05
357	127028	英特转债	17,350,383.78	0.05
358	113608	威派转债	17,125,306.12	0.04
359	111008	沿浦转债	17,122,512.42	0.04

360	113674	华设转债	16,894,182.29	0.04
361	123234	中能转债	16,747,026.83	0.04
362	118039	煜邦转债	16,458,614.06	0.04
363	113593	沪工转债	16,342,786.43	0.04
364	113628	晨丰转债	16,151,337.93	0.04
365	123100	朗科转债	16,141,286.07	0.04
366	113624	正川转债	15,758,913.27	0.04
367	123025	精测转债	15,730,909.77	0.04
368	123160	泰福转债	15,640,811.86	0.04
369	118015	芯海转债	15,532,467.91	0.04
370	110060	天路转债	15,388,699.40	0.04
371	123218	宏昌转债	15,350,793.56	0.04
372	118006	阿拉转债	15,317,952.00	0.04
373	118009	华锐转债	15,284,606.52	0.04
374	123197	光力转债	15,259,265.55	0.04
375	118036	力合转债	15,206,389.10	0.04
376	113660	寿 22 转债	15,199,717.19	0.04
377	111012	福新转债	15,189,438.47	0.04
378	118021	新致转债	15,048,060.25	0.04
379	123207	冠中转债	15,019,609.19	0.04
380	127062	垒知转债	15,005,738.43	0.04
381	123130	设研转债	14,949,875.16	0.04
382	123198	金埔转债	14,775,968.96	0.04
383	123089	九洲转 2	14,586,880.88	0.04
384	123185	能辉转债	14,530,911.83	0.04
385	123201	纽泰转债	14,509,471.03	0.04
386	128117	道恩转债	14,409,495.17	0.04
387	113534	鼎胜转债	14,394,489.55	0.04
388	111013	新港转债	14,392,724.98	0.04
389	127059	永东转 2	14,287,392.88	0.04
390	123156	博汇转债	14,179,828.82	0.04
391	123230	金钟转债	14,122,243.57	0.04
392	123126	瑞丰转债	14,070,398.65	0.04
393	123200	海泰转债	13,992,229.83	0.04
394	113665	汇通转债	13,854,774.65	0.04
395	123175	百畅转债	13,716,575.64	0.04
396	113683	伟 24 转债	13,551,987.62	0.04
397	113030	东风转债	13,533,830.09	0.04
398	127079	华亚转债	13,447,817.54	0.03
399	123171	共同转债	13,403,398.52	0.03
400	123220	易瑞转债	13,358,924.11	0.03
401	123141	宏丰转债	13,225,598.00	0.03
402	123166	蒙泰转债	13,186,773.61	0.03

403	123196	正元转 02	13,167,447.25	0.03
404	123152	润禾转债	13,095,549.36	0.03
405	123088	威唐转债	13,013,159.73	0.03
406	128072	翔鹭转债	12,807,726.06	0.03
407	123199	山河转债	12,805,686.41	0.03
408	128101	联创转债	12,800,905.29	0.03
409	123155	中陆转债	12,655,426.35	0.03
410	113597	佳力转债	12,635,226.30	0.03
411	113671	武进转债	12,598,600.40	0.03
412	127096	泰坦转债	12,597,702.09	0.03
413	127044	蒙娜转债	12,501,709.99	0.03
414	113039	嘉泽转债	12,332,642.57	0.03
415	123061	航新转债	12,245,977.11	0.03
416	110052	贵广转债	12,053,637.15	0.03
417	113598	法兰转债	12,024,470.12	0.03
418	118016	京源转债	11,923,163.73	0.03
419	127094	红墙转债	11,914,862.25	0.03
420	128071	合兴转债	11,853,631.94	0.03
421	123189	晓鸣转债	11,732,096.40	0.03
422	123180	浙矿转债	11,634,910.98	0.03
423	113527	维格转债	11,519,877.25	0.03
424	123159	崧盛转债	11,469,880.87	0.03
425	128122	兴森转债	11,305,259.84	0.03
426	123022	长信转债	11,181,012.56	0.03
427	113680	丽岛转债	11,141,587.07	0.03
428	123206	开能转债	11,112,338.03	0.03
429	123177	测绘转债	10,966,141.16	0.03
430	110055	伊力转债	10,815,260.00	0.03
431	123093	金陵转债	10,706,098.85	0.03
432	113668	鹿山转债	10,683,948.99	0.03
433	118046	诺泰转债	10,646,551.90	0.03
434	123067	斯莱转债	10,636,530.38	0.03
435	128120	联诚转债	10,538,911.31	0.03
436	123209	聚隆转债	10,299,495.22	0.03
437	118007	山石转债	10,247,526.01	0.03
438	123112	万讯转债	10,168,329.45	0.03
439	123173	恒锋转债	10,101,812.73	0.03
440	127093	章鼓转债	10,084,277.79	0.03
441	123138	丝路转债	10,068,875.40	0.03
442	128070	智能转债	9,757,479.17	0.03
443	113546	迪贝转债	9,258,190.89	0.02
444	128082	华锋转债	9,247,102.75	0.02
445	123039	开润转债	9,237,348.49	0.02

446	113565	宏辉转债	9,124,906.30	0.02
447	128076	金轮转债	8,993,103.59	0.02
448	113574	华体转债	8,798,665.98	0.02
449	123065	宝莱转债	8,757,353.86	0.02
450	111003	聚合转债	8,735,004.55	0.02
451	110070	凌钢转债	8,701,561.54	0.02
452	128143	锋龙转债	8,463,599.22	0.02
453	123129	锦鸡转债	8,188,869.58	0.02
454	128124	科华转债	8,081,814.84	0.02
455	123054	思特转债	7,889,406.81	0.02
456	123232	金现转债	7,566,826.49	0.02
457	127080	声迅转债	2,888,414.34	0.01

8.12.5 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。

8.12.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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
11867	279,842.14	3,230,801,711.00	97.29%	90,084,959.00	2.71%

9.2 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	新华人寿保险股份有限公司－分红产品	131,315,826.00	3.95%
2	国投泰康信托有限公司－国投泰康信托福享 2 号集合资金信托计划	117,962,893.00	3.55%
3	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	117,003,116.00	3.52%
4	新华人寿保险股份有限公司－传统产品	86,651,949.00	2.61%

5	易方达颐康绝对收益混合型养老金产品－中国工商银行股份有限公司	63,172,301.00	1.90%
6	信泰人寿保险股份有限公司－传统产品	62,533,648.00	1.88%
7	博时稳健增强固定收益型养老金产品－招商银行股份有限公司	59,101,677.00	1.78%
8	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	57,707,372.00	1.74%
9	国泰君安证券股份有限公司	48,082,996.00	1.45%
10	基本养老保险基金一零六组合	42,897,114.00	1.29%

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。

9.3 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。

9.4 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。

§10 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	3,112,800,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	365,400,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3,320,886,670.00

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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。

基金管理人于 2024 年 12 月 7 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》，吴曼女士任公司督察长，孙麒清女士离任公司督察长。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 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事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自 2024 年起改聘容诚会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。报告期内本基金应付审计费为 90000 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 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。

11.6.2 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，本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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
中金公司	2	650,453,616.03	100.00%	172,707.36	100.00%	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	4	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-

长江证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-

注：根据中国证券监督管理委员会有关规定要求，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。

11.7.2 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
中金公司	37,986,436,750.26	83.05%	67,082,020,000.00	100.00%	-	-
银河证券	4,998,594,489.62	10.93%	-	-	-	-
招商证券	2,753,055,047.73	6.02%	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

11.8 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	博时基金管理有限公司关于旗下 193 只基金改聘会计师事务所的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-12-27
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	2024-12-07
3	博时基金管理有限公司关于终止乾道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	2024-11-18
4	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20241106	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-11-06
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 2024 年第 3 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	2024-10-25
6	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更新招募说明书	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-09-30
7	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20240925	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-09-25
8	博时基金管理有限公司关于董事会成员变更的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-09-21
9	关于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新增万联证券为申购、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	2024-09-04
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 2024 年中期报告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-08-30
11	博时基金管理有限公司关于终止中民财富基金销售（上	上海证券报、基	2024-08-23

	海）有限公司办理旗下基金销售业务的公告	金管理人网站、证监会基金电子披露网站	
12	博时基金管理有限公司旗下基金在兴业银行钱大掌柜开展费率优惠活动的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-08-22
13	博时基金管理有限公司关于直销网上交易平台基金转换等业务费率优惠的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-08-17
14	博时基金管理有限公司关于暂停使用民生银行基金代收付服务办理直销网上交易部分业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-07-20
15	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增爱建证券为申购、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	2024-07-19
16	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 2 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	2024-07-19
17	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增东方财富证券为申购、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	2024-07-17
18	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
19	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
20	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
21	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
22	博时基金管理有限公司关于与通联支付网络服务股份有	上海证券报、基	2024-04-29

	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	金管理人网站、证监会基金电子披露网站	
23	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
24	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
25	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
26	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
27	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、证监会基金电子披露网站	2024-03-29
28	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

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§13 备查文件目录

13.1 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

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

13.3 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

二〇二五年三月三十一日