

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4季度报告  
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：二〇二五年一月二十二日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 1 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## §2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	3,320,886,670.00 份
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	<p>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。</p> <p>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。</p>
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。
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

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期
	(2024 年 10 月 1 日-2024 年 12 月 31 日)
1.本期已实现收益	417,302,118.04
2.本期利润	1,485,633,578.73
3.加权平均基金份额本期利润	0.5200
4.期末基金资产净值	38,518,200,187.60
5.期末基金份额净值	11.5988

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（不包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。

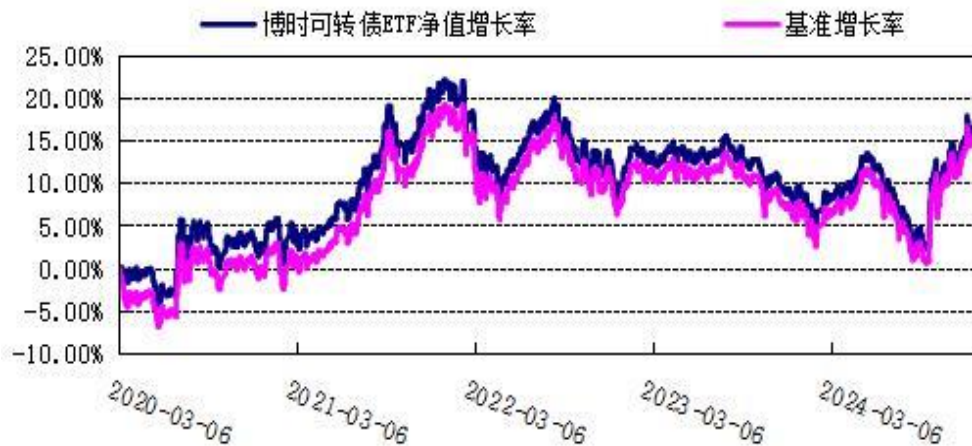
所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 本报告期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	净值增长率 ①	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 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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
--	--	--	--	--

				<p>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。</p>
--	--	--	--	---

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合规守信情况的说明

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 公平交易专项说明

### 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 13 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 报告期内基金投资策略和运作分析

四季度，超预期政策组合拳聚焦于货币、房地产、资本市场、隐债化解等多个领域，为经济高质量发展营造了良好的货币金融环境，市场信心和流动性都有较为明显的改善，助力完成国内全年经济工作目标。海外仍处于美元降息周期中，地缘政治不确定性有所增加。国内市场整体呈现股债双牛的格局，债券市场表现强势，各期限品种在央行宽松的货币政策之下收益率有较大幅度下行，其中长久期利率品种的表现最好。权益市场处于大幅反弹后的整固阶段，大小盘表现分化，沪深 300 下跌 2.06%，万得全 A 上涨 1.62%，国证 2000、万得微盘股指数表现更为突出。总体而言，政策预期和国内流动性，依然是近期影响大类资产的核心因素。

转债方面，受益于平价、估值双升行情，中证转债及可交换债指数四季度上涨 5.55%，绝对价格中位数上升至 117.5 元，处于历史中等偏上分位数。偏债、平衡型转债估值已经处于历史中等偏高位置，偏股型转债估值接近历史中位。低价转债估值修复行情演绎较为充分。

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。四季度可转债 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。

#### 4.5 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 5.02%，同期业绩基准增长率 5.55%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

## §5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	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。

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 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。



### 5.2.2 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。

### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	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。

### 5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113052	兴业转债	21,981,100	2,480,798,990.54	6.44
2	110059	浦发转债	21,997,580	2,397,787,447.30	6.23
3	113042	上银转债	8,884,160	1,066,506,897.74	2.77
4	113050	南银转债	6,622,640	860,463,285.43	2.23
5	110079	杭银转债	6,598,730	851,856,269.81	2.21

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

### 5.7 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。

### 5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 5.9.2 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。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 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。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1 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。

### 5.11.2 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。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,229,394.44
2	应收证券清算款	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

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	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

#### 5.11.5 报告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。

#### 5.11.6 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。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	2,411,486,670.00
报告期期间基金总申购份额	1,157,800,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	248,400,000.00
报告期期间基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3,320,886,670.00

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人未持有本基金。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内基金管理人未发生运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的情况。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 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。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

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。

## §9 备查文件目录

## 9.1 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

## 9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

## 9.3 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  
二〇二五年一月二十二日