

工银瑞信可转债优选债券型证券投资基金 2025 年第 2 季度报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2025 年 7 月 21 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 7 月 17 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 2025 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	工银可转债优选债券
基金主代码	005945
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 7 月 2 日
报告期末基金份额总额	137,926,281.86 份
投资目标	本基金主要通过优选可转债进行积极投资，在严格控制风险和保持良好流动性的基础上，追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金将在充分的宏观形势判断和策略分析的基础上，通过“自上而下”的资产配置及动态调整策略，将基金资产在股票、可转债及可交换债、普通债券、现金和衍生品等资产间进行配置并动态调整比例。对于可转债及可交换债投资，本基金将综合研究此类含权债券的债券价值和权益价值，债券价值方面综合考虑票面利率、久期、信用资质、发行主体财务状况及公司治理等因素；权益价值方面仔细开展对含权债券所对应个股的价值分

	析，包括估值水平、盈利能力及未来盈利预期，此外还需结合对含权条款的研究综合判断内含期权的价值。本基金力争在市场低估该类债券价值时买入并持有，以期在未来获取超额收益。	
业绩比较基准	80%×中证可转换债券指数收益率+10%×中债综合财富（1 年以下）指数收益率+10%×沪深 300 指数收益率。	
风险收益特征	本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金及混合型基金，高于货币市场基金。	
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	工银可转债优选债券 A	工银可转债优选债券 C
下属分级基金的交易代码	005945	005946
报告期末下属分级基金的份额总额	99,764,303.87 份	38,161,977.99 份

§ 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（2025 年 4 月 1 日-2025 年 6 月 30 日）	
	工银可转债优选债券 A	工银可转债优选债券 C
1. 本期已实现收益	3,669,626.34	1,375,123.07
2. 本期利润	4,637,154.92	1,222,664.07
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0463	0.0330
4. 期末基金资产净值	121,458,193.75	45,122,864.17
5. 期末基金份额净值	1.2175	1.1824

注：1、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。

2、本期已实现收益是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。

3、所列数据截止到报告期最后一日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

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

工银可转债优选债券 A

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	3.94%	0.73%	3.21%	0.63%	0.73%	0.10%
过去六个月	5.92%	0.67%	5.70%	0.55%	0.22%	0.12%
过去一年	10.98%	0.83%	12.55%	0.66%	-1.57%	0.17%
过去三年	-18.40%	0.85%	4.40%	0.52%	-22.80%	0.33%
过去五年	3.40%	0.87%	24.24%	0.57%	-20.84%	0.30%
自基金合同生效起至今	21.75%	0.79%	51.65%	0.59%	-29.90%	0.20%

工银可转债优选债券 C

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	3.84%	0.73%	3.21%	0.63%	0.63%	0.10%
过去六个月	5.71%	0.67%	5.70%	0.55%	0.01%	0.12%
过去一年	10.54%	0.83%	12.55%	0.66%	-2.01%	0.17%
过去三年	-19.38%	0.85%	4.40%	0.52%	-23.78%	0.33%
过去五年	1.34%	0.87%	24.24%	0.57%	-22.90%	0.30%
自基金合同生效起至今	18.24%	0.79%	51.65%	0.59%	-33.41%	0.20%

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

工银可转债优选债券A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



工银可转债优选债券C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2018 年 7 月 2 日生效。

2、根据基金合同规定，本基金建仓期为 6 个月。截至本报告期末，本基金的投资符合基金合同关于投资范围及投资限制的规定。

3.3 其他指标

无。

§ 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	说明
----	----	-------------	------	----

		任职日期	离任日期	年限	
陈涵	固定收益部投资总监、本基金的基金经理	2023 年 1 月 13 日	-	13 年	硕士研究生。2011 年加入工银瑞信，现任固定收益部投资总监、基金经理。2019 年 6 月 20 日至 2022 年 11 月 2 日，担任工银瑞信中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金基金经理；2019 年 6 月 20 日至 2022 年 12 月 28 日，担任工银瑞信中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金基金经理；2019 年 8 月 14 日至 2022 年 12 月 28 日，担任工银瑞信中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金基金经理；2019 年 10 月 22 日至 2021 年 4 月 2 日，担任工银瑞信中债-国债(7-10 年)总指数证券投资基金基金经理；2019 年 12 月 23 日至 2022 年 11 月 2 日，担任工银瑞信中债 1-5 年进出口行债券指数证券投资基金基金经理；2020 年 2 月 17 日至今，担任工银瑞信全球美元债债券型证券投资基金(QDII)基金经理；2020 年 6 月 23 日至 2022 年 12 月 28 日，担任工银瑞信彭博巴克莱国开行债券 1-3 年指数证券投资基金(自 2021 年 8 月 24 日起，更名为工银瑞信彭博国开行债券 1-3 年指数证券投资基金)基金经理；2020 年 10 月 9 日至今，担任工银瑞信添慧债券型证券投资基金基金经理；2021 年 5 月 26 日至今，担任工银瑞信稳健回报 60 天持有期短债债券型发起式证券投资基金基金经理；2022 年 9 月 27 日至今，担任工银瑞信瑞诚一年定期开放债券型证券投资基金基金经理；2023 年 1 月 13 日至今，担任工银瑞信可转债优选债券型证券投资基金基金经理；2023 年 2 月 28 日至今，担任工银瑞信稳润一年持有期混合型证券投资基金基金经理；2024 年 7 月 19 日至今，担任工银瑞信增强收益债券型证券投资基金基金经理。

注：1、任职日期为基金合同生效日或本基金管理人对外披露的任职日期；离任日期为本基金管理人对外披露的离任日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《基金从业人员管理规则》的相关规定。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待各类投资人，保护各类投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行，公司根据《证券投资基金法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部规章，制定了《公平交易管理办法》、《异常交易监控管理办法》，对公司管理的各类资产的公平对待做了明确具体的规定，并规定对买卖股票、债券时候的价格和市场价格差距较大，可能存在操纵股价、利益输送等违法违规情况进行监控。本报告期，按照时间优先、价格优先的原则，本公司对满足限价条件且对同一证券有相同交易需求的基金等投资组合，均采用了系统中的公平交易模块进行操作，实现了公平交易；未出现清算不到位的情况，且本基金及本基金与本基金管理人管理的其他投资组合之间未发生法律法规禁止的反向交易及交叉交易。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价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%的情况有 4 次。投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易，未导致不公平交易和利益输送。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

季初，海外经济因关税政策对消费者及企业信心产生不利影响，边际上有所走弱；进入 5 月之后，随着关税政策的缓和、减税法案顺利通过的预期升温，经济活动有所企稳。在库存的缓冲下，美国 CPI 保持平稳，并未因关税出现显著的上行压力。2 季度海外市场大幅波动，前期在关税冲击下风险偏好大幅回落，此后随着关税政策的调整、经济数据的企稳，风险情绪显著修复；美债收益率整体变化不大，结构上因降息临近、长端需求的减弱，曲线进一步陡峭化。

国内经济在 4 月份有所回落，5 月开始伴随稳增长政策的持续落地，经济企稳回升。通胀在大宗商品整体走弱的背景下，依旧保持在低位。2 季度央行实施了降准降息，资金面保持宽松，回购利率整体下行。

债券收益率在 4 月初受外部因素影响一度大幅下行，此后因市场对多空因素预期较为充分，利率债收益率在较窄的区间内波动，信用债在宽松资金的带动下表现更佳。分期限看，各品种差异不大，曲线保持相对平坦的状态。在上述背景下，权益市场在 2 季度小幅上涨，结构上大金融和成长风格较好。可转债在债券收益率处于低位、正股出现结构性行情的推动下，配置需求依旧较高，估值继续上升。

本季度组合的转债仓位保持稳定，优化了银行转债的结构。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金 A 份额净值增长率为 3.94%，本基金 A 份额业绩比较基准收益率为 3.21%；本基金 C 份额净值增长率为 3.84%，本基金 C 份额业绩比较基准收益率为 3.21%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金在报告期内没有触及 2014 年 8 月 8 日生效的《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条规定的条件。

§ 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	53,985,464.62	25.04
	其中：股票	53,985,464.62	25.04
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	150,876,622.54	69.99
	其中：债券	150,876,622.54	69.99
	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	1,000,000.00	0.46
	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	6,784,159.91	3.15
8	其他资产	2,929,993.94	1.36
9	合计	215,576,241.01	100.00

注：由于四舍五入的原因金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

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

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	37,986,796.00	22.80
C	制造业	15,281,590.62	9.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	475,491.00	0.29
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	241,587.00	0.15
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	53,985,464.62	32.41

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600547	山东黄金	431,000	13,761,830.00	8.26
2	000975	山金国际	605,500	11,468,170.00	6.88
3	601899	紫金矿业	486,300	9,482,850.00	5.69
4	300750	宁德时代	16,651	4,199,715.22	2.52
5	603112	华翔股份	216,538	3,581,538.52	2.15
6	600961	株冶集团	231,400	2,587,052.00	1.55
7	600988	赤峰黄金	76,800	1,910,784.00	1.15
8	000831	中国稀土	37,200	1,343,664.00	0.81
9	002379	宏创控股	88,700	1,177,936.00	0.71
10	300450	先导智能	30,900	767,865.00	0.46

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	9,340,988.79	5.61
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）	141,535,633.75	84.97
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	150,876,622.54	90.57

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

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	110077	洪城转债	162,930	31,688,769.04	19.02
2	113052	兴业转债	182,580	22,729,659.32	13.64
3	113042	上银转债	175,000	22,346,517.12	13.41
4	113065	齐鲁转债	82,400	10,674,016.99	6.41
5	019766	25 国债 01	93,000	9,340,988.79	5.61

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国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

5.9.2 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投资，也无期间损益。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体中，兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监管局派出机构的处罚；上海银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监管局派出机构、央行的处罚。

上述情形对发行主体的财务和经营状况无重大影响，投资决策流程符合基金管理人的制度要求。

5.10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	78,307.40
2	应收证券清算款	649,004.17
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	2,202,682.37
6	其他应收款	—
7	其他	—
8	合计	2,929,993.94

5.10.4 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	110077	洪城转债	31,688,769.04	19.02
2	113052	兴业转债	22,729,659.32	13.64
3	113042	上银转债	22,346,517.12	13.41
4	113065	齐鲁转债	10,674,016.99	6.41
5	127066	科利转债	8,948,050.62	5.37
6	127084	柳工转 2	4,880,713.56	2.93
7	132026	G 三峡 EB2	2,818,966.85	1.69
8	123239	锋工转债	2,777,475.18	1.67
9	127041	弘亚转债	2,521,492.57	1.51
10	113056	重银转债	2,393,099.45	1.44

11	110082	宏发转债	2,260,379.44	1.36
12	110059	浦发转债	2,257,189.18	1.36
13	127077	华宏转债	2,018,915.26	1.21
14	113664	大元转债	1,968,838.36	1.18
15	123231	信测转债	1,959,950.14	1.18
16	123107	温氏转债	1,823,761.79	1.09
17	113037	紫银转债	1,711,253.42	1.03
18	113062	常银转债	1,285,833.97	0.77
19	127045	牧原转债	1,092,141.12	0.66
20	127089	晶澳转债	1,050,850.96	0.63
21	127064	杭氧转债	719,348.22	0.43
22	110073	国投转债	650,352.55	0.39
23	127092	运机转债	581,434.03	0.35
24	110075	南航转债	524,544.33	0.31
25	113054	绿动转债	356,082.74	0.21
26	127069	小熊转债	220,058.92	0.13
27	123169	正海转债	156,959.18	0.09
28	113661	福 22 转债	136,960.24	0.08
29	123176	精测转 2	124,265.85	0.07
30	113675	新 23 转债	94,388.25	0.06
31	113623	凤 21 转债	87,638.55	0.05
32	113676	荣 23 转债	87,143.92	0.05
33	123121	帝尔转债	84,238.60	0.05
34	113685	升 24 转债	82,239.24	0.05
35	123158	宙邦转债	80,453.55	0.05
36	123178	花园转债	77,511.86	0.05
37	113677	华懋转债	77,068.06	0.05
38	118042	奥维转债	75,465.40	0.05
39	123150	九强转债	74,129.24	0.04
40	111019	宏柏转债	73,918.54	0.04
41	113053	隆 22 转债	72,243.32	0.04
42	118022	锂科转债	66,622.99	0.04
43	118038	金宏转债	66,410.53	0.04
44	113636	甬金转债	63,853.67	0.04
45	118043	福立转债	63,009.15	0.04
46	111018	华康转债	62,102.41	0.04
47	118024	冠宇转债	61,990.89	0.04
48	123114	三角转债	60,418.34	0.04
49	113663	新化转债	58,532.13	0.04
50	118005	天奈转债	55,588.60	0.03
51	113640	苏利转债	55,080.35	0.03
52	113682	益丰转债	53,523.18	0.03

53	111000	起帆转债	51,426.53	0.03
54	128134	鸿路转债	51,401.47	0.03
55	123179	立高转债	51,098.69	0.03
56	127101	豪鹏转债	50,425.74	0.03
57	128074	游族转债	47,842.68	0.03
58	123215	铭利转债	47,509.06	0.03
59	123113	仙乐转债	46,968.00	0.03
60	113644	艾迪转债	46,235.73	0.03
61	118028	会通转债	45,445.52	0.03
62	113681	镇洋转债	45,373.59	0.03
63	110090	爱迪转债	44,912.12	0.03
64	111010	立昂转债	43,886.93	0.03
65	123071	天能转债	42,943.07	0.03
66	113653	永 22 转债	42,174.30	0.03
67	123188	水羊转债	41,217.44	0.02
68	123076	强力转债	41,032.19	0.02
69	113679	芯能转债	40,792.24	0.02
70	113658	密卫转债	40,616.81	0.02
71	113650	博 22 转债	40,302.50	0.02
72	111001	山玻转债	40,178.68	0.02
73	123247	万凯转债	39,539.12	0.02
74	123212	立中转债	39,494.88	0.02
75	128137	洁美转债	39,197.73	0.02
76	113656	嘉诚转债	38,936.40	0.02
77	123151	康医转债	38,084.37	0.02
78	128131	崇达转 2	37,091.50	0.02
79	123235	亿田转债	36,360.07	0.02
80	127095	广泰转债	36,181.20	0.02
81	113606	荣泰转债	35,793.09	0.02
82	111021	奥锐转债	35,737.07	0.02
83	123192	科思转债	35,235.91	0.02
84	123195	蓝晓转 02	34,953.82	0.02
85	123194	百洋转债	34,806.08	0.02
86	128135	洽洽转债	33,718.90	0.02
87	127099	盛航转债	33,221.98	0.02
88	123183	海顺转债	32,723.39	0.02
89	118032	建龙转债	32,674.90	0.02
90	118050	航宇转债	32,379.41	0.02
91	118004	博瑞转债	30,879.79	0.02
92	123122	富瀚转债	30,412.63	0.02
93	128097	奥佳转债	30,170.43	0.02
94	128121	宏川转债	30,104.16	0.02

95	118014	高测转债	29,995.25	0.02
96	123144	裕兴转债	29,933.90	0.02
97	113667	春 23 转债	29,773.11	0.02
98	127050	麒麟转债	29,712.66	0.02
99	118025	奕瑞转债	29,438.01	0.02
100	123193	海能转债	29,400.76	0.02
101	128081	海亮转债	27,996.76	0.02
102	127088	赫达转债	27,906.67	0.02
103	123217	富仕转债	27,297.20	0.02
104	110095	双良转债	27,252.77	0.02
105	113618	美诺转债	27,216.81	0.02
106	113657	再 22 转债	26,498.38	0.02
107	111005	富春转债	26,093.82	0.02
108	123119	康泰转 2	25,746.83	0.02
109	111011	冠盛转债	25,304.82	0.02
110	123154	火星转债	25,104.92	0.02
111	123149	通裕转债	24,903.23	0.01
112	123124	晶瑞转 2	24,548.74	0.01
113	118035	国力转债	24,324.11	0.01
114	113069	博 23 转债	23,308.58	0.01
115	127090	兴瑞转债	22,448.47	0.01
116	127098	欧晶转债	21,809.87	0.01
117	118006	阿拉转债	21,601.23	0.01
118	113666	爱玛转债	21,066.49	0.01
119	118010	洁特转债	20,945.57	0.01
120	113605	大参转债	20,737.31	0.01
121	113660	寿 22 转债	19,566.21	0.01
122	123210	信服转债	19,433.58	0.01
123	111007	永和转债	18,637.70	0.01
124	123161	强联转债	18,616.01	0.01
125	128141	旺能转债	18,199.06	0.01
126	111020	合顺转债	18,198.71	0.01
127	113064	东材转债	18,175.13	0.01
128	118029	富淼转债	17,679.06	0.01
129	113655	欧 22 转债	17,455.99	0.01
130	123059	银信转债	16,555.36	0.01
131	118030	睿创转债	16,354.90	0.01
132	110076	华海转债	16,235.91	0.01
133	123199	山河转债	15,858.91	0.01
134	123203	明电转 02	15,775.96	0.01
135	123216	科顺转债	15,713.98	0.01
136	113048	晶科转债	15,489.91	0.01

137	127046	百润转债	15,340.53	0.01
138	118021	新致转债	15,324.90	0.01
139	128130	景兴转债	15,275.92	0.01
140	128109	楚江转债	15,095.55	0.01
141	123240	楚天转债	14,615.46	0.01
142	123087	明电转债	14,212.49	0.01
143	127103	东南转债	13,783.40	0.01
144	110084	贵燃转债	13,222.17	0.01
145	127031	洋丰转债	13,180.93	0.01
146	128132	交建转债	12,730.02	0.01
147	123104	卫宁转债	12,342.21	0.01
148	111017	蓝天转债	11,857.56	0.01
149	128144	利民转债	11,755.05	0.01
150	113659	莱克转债	11,732.99	0.01
151	118013	道通转债	11,429.97	0.01
152	128076	金轮转债	11,391.28	0.01
153	123138	丝路转债	11,042.76	0.01
154	123065	宝莱转债	11,016.35	0.01
155	127037	银轮转债	10,791.79	0.01
156	123039	开润转债	10,574.79	0.01
157	113577	春秋转债	10,541.03	0.01
158	113652	伟 22 转债	10,540.19	0.01
159	113669	景 23 转债	10,379.57	0.01
160	113068	金铜转债	10,242.11	0.01
161	110086	精工转债	9,968.41	0.01
162	113647	禾丰转债	9,188.81	0.01
163	113058	友发转债	8,875.00	0.01
164	128108	蓝帆转债	8,329.52	0.01
165	123064	万孚转债	8,282.08	0.00
166	113615	金诚转债	8,240.39	0.00
167	123145	药石转债	7,979.80	0.00
168	113670	金 23 转债	7,969.81	0.00
169	113633	科沃转债	7,944.32	0.00
170	110094	众和转债	7,479.31	0.00
171	127052	西子转债	7,445.48	0.00
172	113673	岱美转债	7,114.88	0.00
173	113638	台 21 转债	6,997.50	0.00
174	123117	健帆转债	6,853.29	0.00
175	113672	福蓉转债	6,722.57	0.00
176	127072	博实转债	6,674.90	0.00
177	113545	金能转债	6,623.98	0.00
178	113563	柳药转债	6,573.46	0.00

179	113030	东风转债	6,523.42	0.00
180	113631	皖天转债	6,478.63	0.00
181	118003	华兴转债	6,406.68	0.00
182	113634	珀莱转债	6,385.20	0.00
183	113687	振华转债	6,211.96	0.00
184	127026	超声转债	6,210.94	0.00
185	128116	瑞达转债	6,125.94	0.00
186	127081	中旗转债	5,980.06	0.00
187	128095	恩捷转债	5,970.18	0.00
188	113651	松霖转债	5,967.93	0.00
189	111002	特纸转债	5,909.70	0.00
190	123090	三诺转债	5,873.87	0.00
191	110070	凌钢转债	5,760.05	0.00
192	113627	太平转债	5,634.70	0.00
193	110096	豫光转债	5,623.23	0.00
194	113621	彤程转债	5,227.42	0.00
195	113588	润达转债	5,138.44	0.00
196	123130	设研转债	4,787.71	0.00
197	123091	长海转债	4,716.38	0.00
198	111014	李子转债	4,715.76	0.00
199	127042	嘉美转债	4,638.07	0.00
200	113584	家悦转债	4,604.96	0.00
201	128071	合兴转债	4,571.93	0.00
202	111009	盛泰转债	4,468.69	0.00
203	113579	健友转债	4,407.70	0.00
204	113683	伟 24 转债	3,980.20	0.00
205	113674	华设转债	3,755.34	0.00
206	127054	双箭转债	3,660.01	0.00
207	127075	百川转 2	3,564.57	0.00
208	113671	武进转债	3,499.50	0.00
209	123225	翔丰转债	2,680.79	0.00
210	123063	大禹转债	2,680.04	0.00
211	123120	隆华转债	2,661.97	0.00
212	127082	亚科转债	2,510.00	0.00
213	113632	鹤 21 转债	2,498.46	0.00

注：上表包含期末持有的处于转股期的可转换债券和可交换债券明细。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	工银可转债优选债券 A	工银可转债优选债券 C
报告期期初基金份额总额	101,964,974.98	27,145,474.79
报告期期间基金总申购份额	6,037,640.07	23,082,042.97
减：报告期期间基金总赎回份额	8,238,311.18	12,065,539.77
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	99,764,303.87	38,161,977.99

注：1、报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额；

2、报告期期间基金总赎回份额含转换出份额。

§ 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

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§ 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

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予工银瑞信可转债优选债券型证券投资基金募集申请的注册文件；
- 2、《工银瑞信可转债优选债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《工银瑞信可转债优选债券型证券投资基金托管协议》；

- 4、《工银瑞信可转债优选债券型证券投资基金招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在规定媒介上披露的各项公告。

9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

9.3 查阅方式

投资者可于营业时间免费查阅，或登录基金管理人网站查阅。也可在支付工本费后，在合理时间内取得上述文件的复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人——工银瑞信基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-811-9999

网址：www.icbcubs.com.cn

工银瑞信基金管理有限公司

2025 年 7 月 21 日