

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  
2024年9月30日

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年十月二十五日

## §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 2024 年 10 月 23 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 7 月 1 日起至 9 月 30 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	2,411,486,670.00 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 7 月 1 日-2024 年 9 月 30 日)
1.本期已实现收益	72,887,121.13
2.本期利润	578,808,460.35
3.加权平均基金份额本期利润	0.3764
4.期末基金资产净值	26,633,032,044.19
5.期末基金份额净值	11.0442

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。

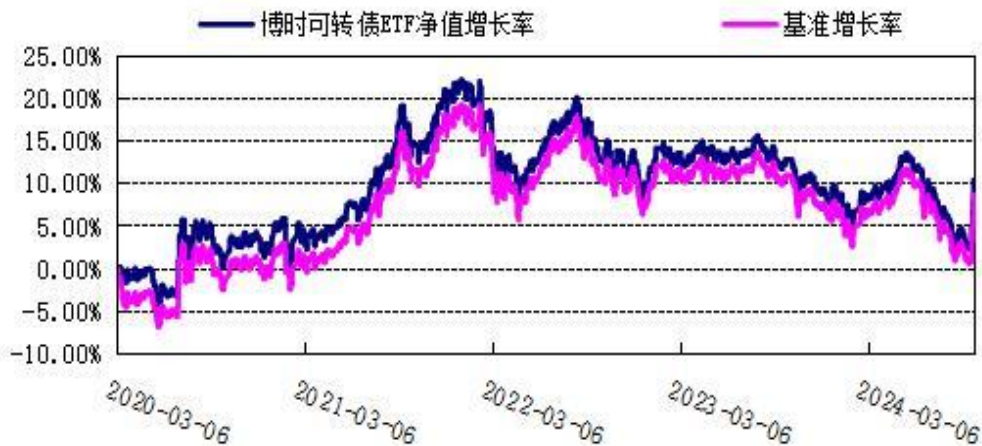
所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 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	0.46%	0.67%	0.56%	0.67%	-0.10%	0.00%
过去六个月	1.39%	0.57%	1.46%	0.57%	-0.07%	0.00%
过去一年	-2.14%	0.50%	-2.03%	0.51%	-0.11%	-0.01%
过去三年	-3.63%	0.51%	-2.61%	0.51%	-1.02%	0.00%
自基金合同生 效起至今	10.44%	0.53%	8.72%	0.53%	1.72%	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	-	13.4	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	-	23.2	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，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，没有损害基金持有人利益的行为。

## 4.3 公平交易专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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 38 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

三季度，国内经济仍处于新旧动能转换阶段，面临有效需求不足的挑战，通胀水平保持低位。海外美联储宣布降息 50BP，正式开启降息周期，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。股债收益差在持续多月沿着-2X 标准差下沿运行后，权益市场出现快速反弹修复行情。期间中债总财富指数上涨 1.05%，沪深 300 指数上涨 16.07%，万得全 A 指数上涨 17.68%，权益市场表现显著占优。中证转债及可交换债指数上涨 0.56%，总体表现弱于债券和股票。

转债市场在经历了信用风险发酵和负债端导致的流动性冲击后，整体估值在 8 月中下旬达到历史极值水平，超过 30% 的转债跌破面值，YTM 中枢也触及历史最高水平，半数以上转债 YTM 为正。估值极致压缩行情导致转债市场在此轮权益市场探底阶段防守性一般，但同时也提供了不少错误定价的机会。随着政策转向，权益市场放量大涨，波动率急速放大，平价拉升迅速消化转股溢价率水平，而转债 9 月下旬的涨幅远不足以反应其应有的长期投资价值，各平价段转股溢价率水平远低于历史相似位置水平。一些转债仍处于高 YTM、转股溢价率适中的攻守兼备状态，而转债信用风险伴随转股价值上升迅速下降。总的来说，转债市场目前仍处于估值从低估转向正常化的过程之中。长期来看获取平价上升、估值修复、信用风险溢价修复、条款博弈等带来的绝对收益水平较为可观，当前应当积极重视转债在泛固收资产中的投资机会。



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。三季度可转债 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 09 月 30 日，本基金基金份额净值为 11.0442 元，份额累计净值为 1.1044 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为 0.46%，同期业绩基准增长率为 0.56%。

#### 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	24,343,398,058.94	87.49
	其中：债券	24,343,398,058.94	87.49
	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	323,800,128.84	1.16
	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	3,157,560,081.05	11.35
8	其他各项资产	591,531.53	0.00
9	合计	27,825,349,800.36	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）	24,343,398,058.94	91.40
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	24,343,398,058.94	91.40

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	110059	浦发转债	13,612,780	1,508,476,906.13	5.66
2	113052	兴业转债	13,769,820	1,507,267,132.58	5.66
3	113042	上银转债	5,482,730	622,180,951.48	2.34
4	113050	南银转债	4,580,130	575,745,555.34	2.16
5	110079	杭银转债	4,178,370	508,096,088.18	1.91

## 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金融监督管理总局浙江监管局、国家外汇管理局北京市分局的处罚。南京银行股份有限公司在报告编制前一年受到国家金融监督管理总局淮安监管分局和宿迁监管分局的处罚。上海浦东发展银行股份有限公司在报告编制前一年受到国家金融监督管理总局宁波监管局、国家外汇管理局湖州市分局、中国人民银行浙江省分行、中国银保监会无锡监管分局的处罚。上海银行股份有限公司在报告编制前一年受到国家金融监督管理总局上海监管局和深圳监管局、国家外汇管理局上海市分局的处罚。兴业银行股份有限公司在报告编制前一年受到国家金融监督管理总局福建监管局、北京监管局和泉州监管分局、天津市市场监督管理委员会、国家外汇管理局绵阳市分局的处罚。中信银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国人民银行四川省分行、国家外汇管理局湖州市分局、国家金融监督管理总局和吉林监管局的处罚。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和陕西监管局的处罚。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	474,589.32
2	应收证券清算款	79,238.37
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	37,703.84
8	其他	-
9	合计	591,531.53

### 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	110059	浦发转债	1,508,476,906.13	5.66
2	113052	兴业转债	1,507,267,132.58	5.66
3	113042	上银转债	622,180,951.48	2.34
4	113050	南银转债	575,745,555.34	2.16
5	110079	杭银转债	508,096,088.18	1.91
6	113044	大秦转债	494,791,805.31	1.86
7	113021	中信转债	404,957,921.04	1.52
8	113056	重银转债	383,220,910.35	1.44
9	132026	G 三峡 EB2	359,781,724.80	1.35
10	110085	通 22 转债	341,835,931.20	1.28
11	127045	牧原转债	306,203,846.64	1.15
12	113060	浙 22 转债	290,792,005.79	1.09
13	123107	温氏转债	269,044,193.69	1.01
14	118034	晶能转债	255,244,307.28	0.96
15	110073	国投转债	254,618,514.82	0.96
16	110081	闻泰转债	228,511,690.14	0.86
17	127049	希望转 2	225,376,244.12	0.85
18	127089	晶澳转债	218,519,293.95	0.82
19	113641	华友转债	211,917,045.60	0.80
20	118031	天 23 转债	209,110,524.03	0.79
21	113065	齐鲁转债	204,298,301.78	0.77
22	113053	隆 22 转债	200,563,558.57	0.75
23	110075	南航转债	193,745,589.95	0.73
24	113062	常银转债	188,015,109.40	0.71
25	127018	本钢转债	183,348,131.01	0.69
26	113055	成银转债	182,945,512.06	0.69
27	127032	苏行转债	169,050,369.03	0.63
28	127056	中特转债	144,736,727.57	0.54

29	127083	山路转债	141,334,361.33	0.53
30	128129	青农转债	141,137,834.68	0.53
31	127030	盛虹转债	138,338,203.27	0.52
32	127084	柳工转 2	130,515,126.88	0.49
33	132020	19 蓝星 EB	128,116,418.76	0.48
34	113043	财通转债	127,196,438.18	0.48
35	127040	国泰转债	125,349,777.09	0.47
36	113037	紫银转债	124,506,260.82	0.47
37	113059	福莱转债	113,749,166.11	0.43
38	127020	中金转债	105,511,712.79	0.40
39	113045	环旭转债	105,307,343.86	0.40
40	127086	恒邦转债	105,257,885.63	0.40
41	113067	燃 23 转债	105,057,406.28	0.39
42	113049	长汽转债	103,533,905.06	0.39
43	128136	立讯转债	100,124,998.24	0.38
44	113051	节能转债	99,959,008.51	0.38
45	110093	神马转债	99,048,063.44	0.37
46	110062	烽火转债	98,545,666.68	0.37
47	118024	冠宇转债	96,354,378.29	0.36
48	111010	立昂转债	94,456,629.31	0.35
49	127073	天赐转债	94,445,366.61	0.35
50	113024	核建转债	92,916,435.30	0.35
51	113661	福 22 转债	92,706,153.29	0.35
52	127061	美锦转债	91,983,561.94	0.35
53	118022	锂科转债	89,052,514.41	0.33
54	127050	麒麟转债	88,538,618.46	0.33
55	110087	天业转债	86,708,621.19	0.33
56	110067	华安转债	85,971,400.87	0.32
57	127067	恒逸转 2	83,292,701.91	0.31
58	113061	拓普转债	82,311,583.20	0.31
59	110089	兴发转债	78,455,483.00	0.29
60	128081	海亮转债	77,694,480.75	0.29
61	113623	凤 21 转债	76,759,503.09	0.29
62	128048	张行转债	74,747,547.12	0.28
63	113616	韦尔转债	74,687,008.98	0.28
64	127085	韵达转债	73,465,253.29	0.28
65	113632	鹤 21 转债	72,681,192.99	0.27
66	113615	金诚转债	71,986,092.85	0.27
67	113054	绿动转债	69,031,777.11	0.26
68	123190	道氏转 02	68,538,305.34	0.26
69	110048	福能转债	63,596,851.03	0.24
70	110068	龙净转债	63,455,268.25	0.24
71	123216	科顺转债	63,095,111.93	0.24

72	113048	晶科转债	62,957,021.54	0.24
73	123118	惠城转债	61,317,156.21	0.23
74	113066	平煤转债	59,765,809.23	0.22
75	113058	友发转债	58,526,796.89	0.22
76	113666	爱玛转债	57,960,848.88	0.22
77	127027	能化转债	57,014,186.75	0.21
78	128109	楚江转债	56,334,690.27	0.21
79	123158	宙邦转债	56,333,905.01	0.21
80	110095	双良转债	56,270,726.11	0.21
81	113069	博 23 转债	56,063,668.55	0.21
82	123119	康泰转 2	56,009,478.26	0.21
83	127039	北港转债	55,587,682.89	0.21
84	110082	宏发转债	53,744,361.08	0.20
85	118030	睿创转债	52,231,966.48	0.20
86	113033	利群转债	52,073,239.14	0.20
87	113655	欧 22 转债	51,697,708.65	0.19
88	123176	精测转 2	51,452,512.52	0.19
89	113682	益丰转债	51,296,570.78	0.19
90	110076	华海转债	50,634,501.30	0.19
91	110090	爱迪转债	50,549,418.69	0.19
92	127100	神码转债	50,148,444.44	0.19
93	127070	大中转债	49,378,677.50	0.19
94	110094	众和转债	49,257,785.55	0.18
95	127038	国微转债	49,119,679.01	0.18
96	127091	科数转债	48,862,328.49	0.18
97	123228	震裕转债	48,570,323.72	0.18
98	128141	旺能转债	48,335,245.61	0.18
99	118013	道通转债	48,114,778.85	0.18
100	127066	科利转债	48,112,731.51	0.18
101	127074	麦米转 2	48,083,287.45	0.18
102	127022	恒逸转债	47,939,973.42	0.18
103	118025	奕瑞转债	47,774,751.22	0.18
104	127025	冀东转债	47,686,015.22	0.18
105	123108	乐普转 2	47,030,471.96	0.18
106	128135	洽洽转债	47,022,590.47	0.18
107	113652	伟 22 转债	46,978,934.55	0.18
108	127016	鲁泰转债	46,859,158.47	0.18
109	127103	东南转债	46,846,453.20	0.18
110	113068	金铜转债	46,144,092.27	0.17
111	127024	盈峰转债	45,978,925.04	0.17
112	128134	鸿路转债	45,838,812.60	0.17
113	128131	崇达转 2	45,758,109.17	0.17
114	113047	旗滨转债	45,750,681.27	0.17

115	113064	东材转债	45,723,758.96	0.17
116	111018	华康转债	45,666,155.03	0.17
117	123169	正海转债	45,185,460.60	0.17
118	113605	大参转债	44,753,814.58	0.17
119	110077	洪城转债	44,654,822.34	0.17
120	110086	精工转债	44,079,963.17	0.17
121	123149	通裕转债	43,877,515.62	0.16
122	113046	金田转债	43,102,657.64	0.16
123	113647	禾丰转债	42,715,018.01	0.16
124	128108	蓝帆转债	39,634,076.55	0.15
125	127037	银轮转债	36,198,408.57	0.14
126	127092	运机转债	34,885,465.22	0.13
127	111017	蓝天转债	34,796,125.13	0.13
128	113619	世运转债	34,661,269.68	0.13
129	123128	首华转债	34,643,067.61	0.13
130	113669	景 23 转债	33,573,286.66	0.13
131	118023	广大转债	32,475,052.05	0.12
132	123178	花园转债	32,415,334.25	0.12
133	123208	孩王转债	31,689,080.03	0.12
134	123170	南电转债	31,557,902.72	0.12
135	123145	药石转债	31,467,514.93	0.12
136	123213	天源转债	31,351,180.92	0.12
137	113675	新 23 转债	31,280,829.42	0.12
138	123184	天阳转债	31,219,078.69	0.12
139	127043	川恒转债	31,197,935.49	0.12
140	127064	杭氧转债	30,891,613.69	0.12
141	127082	亚科转债	30,827,552.72	0.12
142	113631	皖天转债	30,211,055.28	0.11
143	123115	捷捷转债	30,051,770.10	0.11
144	127052	西子转债	29,954,268.29	0.11
145	123192	科思转债	29,904,648.22	0.11
146	110064	建工转债	29,652,744.72	0.11
147	110074	精达转债	29,515,337.36	0.11
148	128083	新北转债	29,406,398.58	0.11
149	113659	莱克转债	29,369,309.34	0.11
150	123238	卡倍转 02	29,273,581.39	0.11
151	123150	九强转债	29,113,563.77	0.11
152	113634	珀莱转债	29,016,895.47	0.11
153	123237	佳禾转债	28,821,899.72	0.11
154	123194	百洋转债	28,571,588.77	0.11
155	113673	岱美转债	28,489,835.45	0.11
156	127101	豪鹏转债	28,333,350.99	0.11
157	113672	福蓉转债	28,190,590.18	0.11

158	118003	华兴转债	28,177,632.05	0.11
159	118038	金宏转债	28,170,962.74	0.11
160	111000	起帆转债	28,156,443.41	0.11
161	123117	健帆转债	28,043,294.23	0.11
162	113658	密卫转债	28,009,240.96	0.11
163	127104	姚记转债	27,965,453.73	0.11
164	127046	百润转债	27,932,932.49	0.10
165	127095	广泰转债	27,928,385.67	0.10
166	123035	利德转债	27,915,293.53	0.10
167	123210	信服转债	27,896,179.07	0.10
168	128132	交建转债	27,746,653.48	0.10
169	113636	甬金转债	27,703,479.60	0.10
170	123114	三角转债	27,683,574.06	0.10
171	113637	华翔转债	27,646,757.75	0.10
172	127031	洋丰转债	27,410,609.37	0.10
173	127017	万青转债	27,204,767.88	0.10
174	128133	奇正转债	27,158,356.34	0.10
175	113549	白电转债	27,068,289.70	0.10
176	123225	翔丰转债	27,039,165.47	0.10
177	110084	贵燃转债	26,979,021.37	0.10
178	127099	盛航转债	26,729,553.18	0.10
179	123104	卫宁转债	26,710,377.41	0.10
180	123113	仙乐转债	26,628,364.23	0.10
181	127014	北方转债	26,613,730.14	0.10
182	123219	宇瞳转债	26,610,745.59	0.10
183	128144	利民转债	26,607,910.96	0.10
184	123120	隆华转债	26,564,812.48	0.10
185	123222	博俊转债	26,522,082.01	0.10
186	128063	未来转债	26,517,661.40	0.10
187	113644	艾迪转债	26,476,383.35	0.10
188	118042	奥维转债	26,392,889.52	0.10
189	118026	利元转债	26,334,929.56	0.10
190	123076	强力转债	26,323,682.35	0.10
191	123212	立中转债	26,306,967.54	0.10
192	128130	景兴转债	26,295,873.17	0.10
193	123240	楚天转债	26,283,296.29	0.10
194	113663	新化转债	26,202,492.94	0.10
195	128087	孚日转债	26,191,627.61	0.10
196	123188	水羊转债	26,178,995.84	0.10
197	113633	科沃转债	26,074,754.10	0.10
198	127102	浙建转债	26,033,954.73	0.10
199	111007	永和转债	25,950,973.04	0.10
200	113677	华懋转债	25,904,415.34	0.10



201	123174	精锻转债	25,889,120.30	0.10
202	123096	思创转债	25,861,521.43	0.10
203	127075	百川转 2	25,800,549.68	0.10
204	127044	蒙娜转债	25,643,951.26	0.10
205	127015	希望转债	25,579,637.32	0.10
206	113545	金能转债	25,572,802.62	0.10
207	113621	彤程转债	25,484,240.20	0.10
208	123161	强联转债	25,427,404.31	0.10
209	113648	巨星转债	25,396,883.45	0.10
210	113651	松霖转债	25,326,268.50	0.10
211	118028	会通转债	25,249,434.11	0.09
212	123204	金丹转债	25,231,504.11	0.09
213	123121	帝尔转债	25,219,739.44	0.09
214	113563	柳药转债	25,215,304.86	0.09
215	127076	中宠转 2	25,179,155.46	0.09
216	123191	智尚转债	25,036,860.38	0.09
217	113596	城地转债	25,011,667.38	0.09
218	128128	齐翔转 2	24,751,715.07	0.09
219	113668	鹿山转债	24,631,503.96	0.09
220	111002	特纸转债	24,623,270.48	0.09
221	123131	奥飞转债	24,401,345.57	0.09
222	113667	春 23 转债	24,378,713.82	0.09
223	123236	家联转债	24,231,734.76	0.09
224	123179	立高转债	24,219,004.10	0.09
225	123101	拓斯转债	24,183,609.25	0.09
226	123133	佩蒂转债	23,992,004.26	0.09
227	127035	濮耐转债	23,958,096.65	0.09
228	127041	弘亚转债	23,823,591.45	0.09
229	123063	大禹转债	23,805,847.30	0.09
230	127019	国城转债	23,791,300.27	0.09
231	123157	科蓝转债	23,788,825.86	0.09
232	128119	龙大转债	23,783,551.35	0.09
233	113679	芯能转债	23,749,343.71	0.09
234	128142	新乳转债	23,702,062.18	0.09
235	118046	诺泰转债	23,645,864.01	0.09
236	127081	中旗转债	23,633,094.72	0.09
237	123229	艾录转债	23,626,025.35	0.09
238	123195	蓝晓转 02	23,595,328.17	0.09
239	123078	飞凯转债	23,539,550.46	0.09
240	127055	精装转债	23,528,502.92	0.09
241	118000	嘉元转债	23,520,740.79	0.09
242	113678	中贝转债	23,506,970.21	0.09
243	123182	广联转债	23,481,156.29	0.09

244	113662	豪能转债	23,438,702.10	0.09
245	111015	东亚转债	23,344,924.32	0.09
246	123203	明电转 02	23,341,067.89	0.09
247	128074	游族转债	23,290,545.31	0.09
248	123239	锋工转债	23,264,674.58	0.09
249	123215	铭利转债	23,253,762.78	0.09
250	123211	阳谷转债	23,250,458.81	0.09
251	118037	上声转债	23,250,181.56	0.09
252	113627	太平转债	23,223,655.41	0.09
253	113629	泉峰转债	23,181,327.66	0.09
254	127051	博杰转债	23,170,774.27	0.09
255	113582	火炬转债	23,169,210.39	0.09
256	123226	中富转债	23,166,030.79	0.09
257	128127	文科转债	23,138,220.76	0.09
258	113530	大丰转债	23,088,491.22	0.09
259	113609	永安转债	23,079,436.90	0.09
260	123071	天能转债	23,032,011.24	0.09
261	128137	洁美转债	22,978,964.00	0.09
262	127088	赫达转债	22,972,941.49	0.09
263	113676	荣 23 转债	22,969,136.36	0.09
264	123221	力诺转债	22,965,109.89	0.09
265	123050	聚飞转债	22,935,459.75	0.09
266	128105	长集转债	22,907,131.55	0.09
267	127042	嘉美转债	22,894,442.09	0.09
268	127026	超声转债	22,890,111.49	0.09
269	123147	中辰转债	22,887,392.67	0.09
270	118041	星球转债	22,853,834.42	0.09
271	127054	双箭转债	22,834,844.48	0.09
272	123092	天壕转债	22,816,631.61	0.09
273	123231	信测转债	22,716,120.65	0.09
274	123146	中环转 2	22,661,217.04	0.09
275	118004	博瑞转债	22,661,023.94	0.09
276	113640	苏利转债	22,639,967.66	0.09
277	113656	嘉诚转债	22,563,653.60	0.08
278	118033	华特转债	22,554,629.24	0.08
279	123090	三诺转债	22,544,861.13	0.08
280	113638	台 21 转债	22,524,473.51	0.08
281	118005	天奈转债	22,486,146.18	0.08
282	123172	漱玉转债	22,428,601.91	0.08
283	113650	博 22 转债	22,375,211.64	0.08
284	127069	小熊转债	22,337,607.91	0.08
285	113670	金 23 转债	22,323,088.86	0.08
286	123048	应急转债	22,296,830.15	0.08

287	113606	荣泰转债	22,291,322.91	0.08
288	127087	星帅转 2	22,269,122.41	0.08
289	127072	博实转债	22,252,744.03	0.08
290	113664	大元转债	22,208,451.22	0.08
291	127105	龙星转债	22,207,496.39	0.08
292	123091	长海转债	22,193,040.76	0.08
293	123165	回天转债	22,066,788.05	0.08
294	127028	英特转债	22,046,583.37	0.08
295	123198	金埔转债	21,984,365.21	0.08
296	123202	祥源转债	21,943,813.33	0.08
297	111001	山玻转债	21,888,941.02	0.08
298	128116	瑞达转债	21,883,927.92	0.08
299	113584	家悦转债	21,810,265.11	0.08
300	113681	镇洋转债	21,782,006.66	0.08
301	111008	沿浦转债	21,776,771.64	0.08
302	123217	富仕转债	21,774,987.38	0.08
303	127053	豪美转债	21,765,876.54	0.08
304	123064	万孚转债	21,682,381.48	0.08
305	128124	科华转债	21,659,235.25	0.08
306	111005	富春转债	21,646,116.37	0.08
307	128121	宏川转债	21,573,950.21	0.08
308	127078	优彩转债	21,563,983.17	0.08
309	123122	富瀚转债	21,506,976.44	0.08
310	123224	宇邦转债	21,487,628.99	0.08
311	113542	好客转债	21,405,802.53	0.08
312	118043	福立转债	21,404,042.76	0.08
313	123049	维尔转债	21,394,200.75	0.08
314	123183	海顺转债	21,388,986.97	0.08
315	123187	超达转债	21,378,155.95	0.08
316	127090	兴瑞转债	21,311,621.73	0.08
317	127071	天箭转债	21,306,614.08	0.08
318	111016	神通转债	21,263,179.73	0.08
319	113625	江山转债	21,199,702.34	0.08
320	118012	微芯转债	21,194,671.65	0.08
321	127068	顺博转债	21,111,381.20	0.08
322	123235	亿田转债	21,090,528.25	0.08
323	113653	永 22 转债	21,039,509.63	0.08
324	113532	海环转债	20,956,177.79	0.08
325	113639	华正转债	20,949,284.80	0.08
326	123085	万顺转 2	20,939,679.86	0.08
327	113654	永 02 转债	20,934,360.39	0.08
328	113569	科达转债	20,912,498.44	0.08
329	123233	凯盛转债	20,866,015.48	0.08

330	128066	亚泰转债	20,764,266.84	0.08
331	113674	华设转债	20,750,122.48	0.08
332	111014	李子转债	20,718,362.02	0.08
333	113579	健友转债	20,659,891.46	0.08
334	110092	三房转债	20,608,542.49	0.08
335	127034	绿茵转债	20,559,497.02	0.08
336	123132	回盛转债	20,546,410.32	0.08
337	123109	昌红转债	20,451,968.85	0.08
338	123223	九典转 02	20,412,309.21	0.08
339	123082	北陆转债	20,367,639.92	0.08
340	118032	建龙转债	20,310,367.26	0.08
341	123193	海能转债	20,309,996.77	0.08
342	128095	恩捷转债	20,181,150.60	0.08
343	128125	华阳转债	20,175,473.15	0.08
344	123168	惠云转债	20,151,316.76	0.08
345	123151	康医转债	20,092,668.27	0.08
346	123130	设研转债	20,055,619.14	0.08
347	113643	风语转债	19,918,668.30	0.07
348	123056	雪榕转债	19,911,854.75	0.07
349	118011	银微转债	19,852,817.57	0.07
350	113618	美诺转债	19,851,501.87	0.07
351	123154	火星转债	19,850,820.69	0.07
352	111004	明新转债	19,845,817.90	0.07
353	128097	奥佳转债	19,757,491.14	0.07
354	111009	盛泰转债	19,640,091.62	0.07
355	123214	东宝转债	19,496,148.83	0.07
356	110063	鹰 19 转债	19,480,401.20	0.07
357	123205	大叶转债	19,472,861.29	0.07
358	123124	晶瑞转 2	19,423,699.62	0.07
359	127098	欧晶转债	19,147,990.56	0.07
360	113657	再 22 转债	19,014,480.40	0.07
361	123162	东杰转债	19,002,982.83	0.07
362	127060	湘佳转债	18,906,040.98	0.07
363	113649	丰山转债	18,812,468.89	0.07
364	123197	光力转债	18,786,600.00	0.07
365	123144	裕兴转债	18,759,232.38	0.07
366	127077	华宏转债	18,754,865.30	0.07
367	118014	高测转债	18,646,274.27	0.07
368	118035	国力转债	18,574,590.19	0.07
369	123186	志特转债	18,571,366.23	0.07
370	111011	冠盛转债	18,008,524.05	0.07
371	123142	申昊转债	17,970,295.16	0.07
372	118027	宏图转债	17,804,872.54	0.07

373	123127	耐普转债	17,670,772.81	0.07
374	110060	天路转债	17,203,713.38	0.06
375	113610	灵康转债	16,960,090.42	0.06
376	118008	海优转债	16,957,648.48	0.06
377	113601	塞力转债	16,803,338.31	0.06
378	123087	明电转债	16,040,788.19	0.06
379	118020	芳源转债	14,906,431.50	0.06
380	123230	金钟转债	8,025,322.06	0.03
381	128106	华统转债	7,829,276.67	0.03
382	113680	丽岛转债	6,540,251.70	0.02
383	128120	联诚转债	6,269,664.04	0.02
384	113600	新星转债	6,014,113.46	0.02
385	123227	雅创转债	5,906,489.67	0.02
386	123059	银信转债	5,536,483.57	0.02
387	118044	赛特转债	5,281,413.33	0.02
388	111013	新港转债	5,124,574.38	0.02
389	128138	侨银转债	5,071,763.98	0.02
390	113534	鼎胜转债	5,027,086.54	0.02
391	111003	聚合转债	5,004,031.47	0.02
392	118010	洁特转债	4,968,402.71	0.02
393	123143	胜蓝转债	4,962,004.19	0.02
394	123234	中能转债	4,957,915.80	0.02
395	113628	晨丰转债	4,926,659.23	0.02
396	118040	宏微转债	4,918,742.09	0.02
397	118039	煜邦转债	4,795,599.60	0.02
398	113593	沪工转债	4,720,785.60	0.02
399	123207	冠中转债	4,656,965.09	0.02
400	123100	朗科转债	4,648,098.80	0.02
401	113588	润达转债	4,641,365.92	0.02
402	113624	正川转债	4,614,033.77	0.02
403	113660	寿 22 转债	4,563,952.64	0.02
404	123025	精测转债	4,557,284.46	0.02
405	118009	华锐转债	4,550,509.97	0.02
406	118029	富淼转债	4,546,701.21	0.02
407	113608	威派转债	4,536,593.90	0.02
408	118015	芯海转债	4,509,770.02	0.02
409	118006	阿拉转债	4,491,667.94	0.02
410	123218	宏昌转债	4,469,774.87	0.02
411	123200	海泰转债	4,454,353.01	0.02
412	118036	力合转债	4,370,760.74	0.02
413	118018	瑞科转债	4,291,842.87	0.02
414	123201	纽泰转债	4,268,044.99	0.02
415	128118	瀛通转债	4,242,316.36	0.02

416	127059	永东转 2	4,239,643.25	0.02
417	123175	百畅转债	4,237,975.34	0.02
418	123089	九洲转 2	4,219,586.89	0.02
419	127062	垒知转债	4,199,694.57	0.02
420	128117	道恩转债	4,183,427.30	0.02
421	123156	博汇转债	4,175,386.41	0.02
422	123199	山河转债	4,137,226.03	0.02
423	127079	华亚转债	4,109,869.58	0.02
424	123141	宏丰转债	3,960,916.19	0.01
425	113524	奇精转债	3,951,277.33	0.01
426	123171	共同转债	3,914,865.26	0.01
427	128090	汽模转 2	3,897,398.46	0.01
428	123126	瑞丰转债	3,886,591.81	0.01
429	118021	新致转债	3,872,985.51	0.01
430	123160	泰福转债	3,839,362.46	0.01
431	123220	易瑞转债	3,834,062.46	0.01
432	113598	法兰转债	3,818,048.64	0.01
433	123185	能辉转债	3,801,249.13	0.01
434	123196	正元转 02	3,724,363.73	0.01
435	113671	武进转债	3,705,362.05	0.01
436	118045	盟升转债	3,658,673.08	0.01
437	113030	东风转债	3,654,634.94	0.01
438	123152	润禾转债	3,617,685.68	0.01
439	113597	佳力转债	3,602,264.37	0.01
440	123088	威唐转债	3,591,091.86	0.01
441	123155	中陆转债	3,588,669.19	0.01
442	113039	嘉泽转债	3,588,032.88	0.01
443	113573	纵横转债	3,582,731.08	0.01
444	123163	金沃转债	3,579,546.00	0.01
445	110052	贵广转债	3,561,389.38	0.01
446	123103	震安转债	3,534,465.66	0.01
447	128101	联创转债	3,532,928.08	0.01
448	113665	汇通转债	3,530,772.07	0.01
449	111012	福新转债	3,523,620.43	0.01
450	113527	维格转债	3,495,044.69	0.01
451	128072	翔鹭转债	3,477,099.18	0.01
452	128071	合兴转债	3,409,408.87	0.01
453	123180	浙矿转债	3,397,047.72	0.01
454	123206	开能转债	3,387,719.10	0.01
455	110058	永鼎转债	3,384,375.15	0.01
456	110055	伊力转债	3,372,789.01	0.01
457	123159	崧盛转债	3,322,525.01	0.01
458	127094	红墙转债	3,321,121.32	0.01

459	128122	兴森转债	3,317,669.06	0.01
460	123022	长信转债	3,281,927.66	0.01
461	123177	测绘转债	3,280,099.94	0.01
462	123189	晓鸣转债	3,271,605.69	0.01
463	118016	京源转债	3,256,173.77	0.01
464	123166	蒙泰转债	3,213,791.20	0.01
465	123061	航新转债	3,176,786.36	0.01
466	113546	迪贝转债	3,130,254.51	0.01
467	123067	斯莱转债	3,077,641.03	0.01
468	123093	金陵转债	3,061,131.55	0.01
469	127080	声迅转债	3,031,040.08	0.01
470	123112	万讯转债	2,992,929.48	0.01
471	123135	泰林转债	2,983,317.44	0.01
472	123173	恒锋转债	2,979,229.09	0.01
473	123209	聚隆转债	2,965,691.42	0.01
474	123138	丝路转债	2,937,596.18	0.01
475	128070	智能转债	2,910,976.34	0.01
476	127093	章鼓转债	2,821,985.17	0.01
477	128076	金轮转债	2,818,882.83	0.01
478	118007	山石转债	2,816,257.36	0.01
479	123039	开润转债	2,729,550.07	0.01
480	113519	长久转债	2,661,629.76	0.01
481	113574	华体转债	2,616,553.59	0.01
482	123065	宝莱转债	2,608,199.72	0.01
483	123054	思特转债	2,563,500.47	0.01
484	113565	宏辉转债	2,560,439.34	0.01
485	110070	凌钢转债	2,541,677.61	0.01
486	123232	金现转债	2,478,099.39	0.01
487	128049	华源转债	2,412,991.82	0.01
488	123129	锦鸡转债	2,380,134.14	0.01
489	128143	锋龙转债	2,238,732.68	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	1,093,186,670.00
--------------	------------------



报告期期间基金总申购份额	1,369,100,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	50,800,000.00
报告期期间基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	2,411,486,670.00

## §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 9 月 30 日，博时基金公司共管理 380 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 15835 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 6105 亿元人民币，累计分红逾 2044 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  
二〇二四年十月二十五日