

**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
2026年第1季度报告
2026年3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：二〇二六年四月二十二日

§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 2026 年 4 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 2026 年 1 月 1 日起至 3 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 博时 |
| 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 | 4,404,786,670.00 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 |
|----------------|----------------------------------|
| | (2026 年 1 月 1 日-2026 年 3 月 31 日) |
| 1.本期已实现收益 | 1,293,469,904.70 |
| 2.本期利润 | -1,284,600,556.24 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.2946 |
| 4.期末基金资产净值 | 59,557,166,202.79 |
| 5.期末基金份额净值 | 13.5210 |

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。

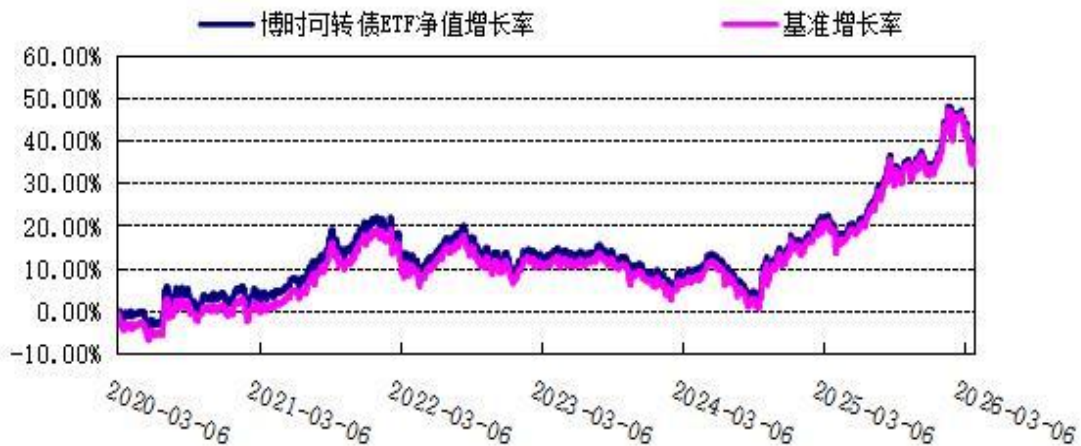
所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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 | -1.12% | 1.03% | -1.14% | 1.04% | 0.02% | -0.01% |
| 过去六个月 | 0.08% | 0.81% | 0.11% | 0.82% | -0.03% | -0.01% |
| 过去一年 | 12.95% | 0.74% | 13.45% | 0.75% | -0.50% | -0.01% |
| 过去三年 | 19.44% | 0.60% | 20.61% | 0.60% | -1.17% | 0.00% |
| 过去五年 | 30.54% | 0.58% | 33.07% | 0.58% | -2.53% | 0.00% |
| 自基金合同生 效起至今 | 35.21% | 0.58% | 34.21% | 0.58% | 1.00% | 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 | - | 14.9 | 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 | - | 24.7 | 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 8 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

一季度，国内经济“开门红”预期兑现，年初稳增长政策持续发力效果显现。3 月制造业 PMI 重返扩张区间，需求改善快于生产，特别是在全球制造业景气度回暖的背景下，出口链展现出较强韧性，新出口订单显著回升。全国两会定调积极，强调实施更加积极有为的财政政策并持续扩大内需，为全年经济运行托底。海外宏观环境复杂严峻，中东地缘政治局势的持续胶着导致原油等大宗商品价格居高不下。这不仅在 3 月国内 PMI 价格分项中有所显现，也使得 PPI 同比由负转正的概率提高。海外高通胀预期的反复，直接扰动了美联储及全球主要央行的降息路径，也对全球权益资产的定价中枢形成压制。A 股市场先扬后抑，整体宽幅震荡，风格差异明显，中证 1000 指数小幅上涨 0.32%，成为唯一上涨的宽基指数，万得全 A 小幅下跌 1.15%，沪深 300 下跌 3.89%。

债券市场整体呈现震荡格局，收益率曲线分化。长端利率受政府债券供给、信贷“开门红”及机构行为等多重因素扰动，波动加大；短端利率则在宽松的资金面下表现稳定，确定性收益机会更明确。市场驱动因素从单一基本面预期转向地缘政治、基本面、政策面与机构行为交织的复杂状态。

转债方面，中证转债及可交换债指数下跌 1.14%，为连续七个季度取得正回报后首次录得负收益。1-2 月份在权益市场风险偏好较高的阶段，资金明显向成交活跃、正股表现强势的转债集中，股性逻辑成为影响价格表现的核心因素。随着 3 月以来市场波动加大，强赎事件增加，资金风险偏好有所回落，转债投资

逻辑由此前的“股性进攻”逐步向“债性防御”过渡。从供需结构来看，一级市场发行节奏整体偏慢，存量规模小幅收缩，而年金、公募等机构资金保持稳定配置需求，为转债市场提供了较强支撑。

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。一季度可转债 ETF 规模显著增长，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 2026 年 03 月 31 日，本基金基金份额净值为 13.5210 元，份额累计净值为 1.3521 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为-1.12%，同期业绩基准增长率-1.14%。

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 | 58,205,704,538.56 | 95.69 |
| | 其中：债券 | 58,205,704,538.56 | 95.69 |
| | 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 | 936,000,000.00 | 1.54 |
| | 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 | 1,653,647,513.82 | 2.72 |
| 8 | 其他各项资产 | 34,597,075.11 | 0.06 |
| 9 | 合计 | 60,829,949,127.49 | 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） | 58,205,704,538.56 | 97.73 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 58,205,704,538.56 | 97.73 |

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 | 35,276,320 | 4,222,527,180.38 | 7.09 |
| 2 | 113042 | 上银转债 | 17,039,230 | 2,106,956,808.87 | 3.54 |
| 3 | 113056 | 重银转债 | 11,086,760 | 1,406,151,995.66 | 2.36 |
| 4 | 110085 | 通 22 转债 | 10,217,730 | 1,240,509,404.93 | 2.08 |
| 5 | 132026 | G 三峡 EB2 | 8,525,600 | 1,152,177,613.36 | 1.93 |

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，上海银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国人民银行、国家金融监督管理总局上海监管局的处罚。兴业银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国人民银行宁夏回族自治区分行、国家外汇管理局北京市分局、宁德市市场监督管理局、金融监管总局的处罚。温氏食品集团股份有限公司在报告编制前一年受到新兴县新城镇人民政府的处罚。重庆银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国人民银行万州分行、国家外汇管理局重庆市分局、重庆金融监管局的处罚。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 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | 3,583,119.60 |
| 2 | 应收证券清算款 | 31,013,955.51 |
| 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 | 34,597,075.11 |

5.11.3 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 | 4,222,527,180.38 | 7.09 |
| 2 | 113042 | 上银转债 | 2,106,956,808.87 | 3.54 |
| 3 | 113056 | 重银转债 | 1,406,151,995.66 | 2.36 |
| 4 | 110085 | 通 22 转债 | 1,240,509,404.93 | 2.08 |
| 5 | 132026 | G 三峡 EB2 | 1,152,177,613.36 | 1.93 |
| 6 | 118034 | 晶能转债 | 1,037,041,141.85 | 1.74 |
| 7 | 127045 | 牧原转债 | 1,033,370,286.62 | 1.74 |
| 8 | 127089 | 晶澳转债 | 955,025,461.79 | 1.60 |
| 9 | 123107 | 温氏转债 | 822,185,197.71 | 1.38 |
| 10 | 110081 | 闻泰转债 | 813,386,698.68 | 1.37 |
| 11 | 127049 | 希望转 2 | 792,018,046.77 | 1.33 |
| 12 | 113053 | 隆 22 转债 | 775,013,934.02 | 1.30 |
| 13 | 110073 | 国投转债 | 731,146,971.07 | 1.23 |
| 14 | 113062 | 常银转债 | 660,696,729.05 | 1.11 |
| 15 | 113691 | 和邦转债 | 638,376,014.83 | 1.07 |
| 16 | 118031 | 天 23 转债 | 630,878,562.34 | 1.06 |
| 17 | 127110 | 广核转债 | 606,134,462.90 | 1.02 |
| 18 | 110075 | 南航转债 | 593,022,314.84 | 1.00 |
| 19 | 127018 | 本钢转债 | 572,245,390.43 | 0.96 |
| 20 | 123254 | 亿纬转债 | 572,087,249.42 | 0.96 |
| 21 | 127056 | 中特转债 | 534,460,331.00 | 0.90 |
| 22 | 127083 | 山路转债 | 510,152,106.85 | 0.86 |
| 23 | 127030 | 盛虹转债 | 506,916,857.94 | 0.85 |
| 24 | 128129 | 青农转债 | 458,212,477.17 | 0.77 |
| 25 | 127040 | 国泰转债 | 454,109,607.23 | 0.76 |
| 26 | 123247 | 万凯转债 | 435,400,980.17 | 0.73 |
| 27 | 113037 | 紫银转债 | 419,940,259.24 | 0.71 |
| 28 | 113059 | 福莱转债 | 415,796,227.41 | 0.70 |
| 29 | 113043 | 财通转债 | 391,010,206.76 | 0.66 |
| 30 | 111010 | 立昂转债 | 379,787,888.18 | 0.64 |
| 31 | 127067 | 恒逸转 2 | 360,374,684.36 | 0.61 |
| 32 | 113661 | 福 22 转债 | 352,407,550.29 | 0.59 |
| 33 | 113051 | 节能转债 | 350,194,850.24 | 0.59 |
| 34 | 127070 | 大中转债 | 349,837,487.21 | 0.59 |
| 35 | 118022 | 锂科转债 | 344,408,824.75 | 0.58 |
| 36 | 110087 | 天业转债 | 338,483,223.21 | 0.57 |

| | | | | |
|----|--------|---------|----------------|------|
| 37 | 113049 | 长汽转债 | 336,700,298.75 | 0.57 |
| 38 | 113067 | 燃 23 转债 | 332,151,302.18 | 0.56 |
| 39 | 127108 | 太能转债 | 328,937,476.78 | 0.55 |
| 40 | 118030 | 睿创转债 | 324,016,760.96 | 0.54 |
| 41 | 118024 | 冠宇转债 | 320,756,285.60 | 0.54 |
| 42 | 113696 | 伯 25 转债 | 316,269,647.17 | 0.53 |
| 43 | 113697 | 应流转债 | 315,121,773.69 | 0.53 |
| 44 | 128136 | 立讯转债 | 312,457,603.45 | 0.52 |
| 45 | 127084 | 柳工转 2 | 302,669,014.12 | 0.51 |
| 46 | 127061 | 美锦转债 | 282,416,430.41 | 0.47 |
| 47 | 123158 | 宙邦转债 | 263,876,217.84 | 0.44 |
| 48 | 123176 | 精测转 2 | 261,349,139.05 | 0.44 |
| 49 | 113048 | 晶科转债 | 252,709,280.87 | 0.42 |
| 50 | 113054 | 绿动转债 | 251,454,774.91 | 0.42 |
| 51 | 127085 | 韵达转债 | 250,224,588.38 | 0.42 |
| 52 | 123216 | 科顺转债 | 249,147,657.01 | 0.42 |
| 53 | 113615 | 金诚转债 | 247,697,666.92 | 0.42 |
| 54 | 110093 | 神马转债 | 242,781,203.64 | 0.41 |
| 55 | 127103 | 东南转债 | 238,727,095.80 | 0.40 |
| 56 | 113677 | 华懋转债 | 238,529,133.92 | 0.40 |
| 57 | 113616 | 韦尔转债 | 236,090,118.60 | 0.40 |
| 58 | 127050 | 麒麟转债 | 232,088,907.60 | 0.39 |
| 59 | 118058 | 微导转债 | 231,762,158.24 | 0.39 |
| 60 | 113632 | 鹤 21 转债 | 231,471,982.30 | 0.39 |
| 61 | 113058 | 友发转债 | 228,115,818.84 | 0.38 |
| 62 | 113655 | 欧 22 转债 | 226,136,502.79 | 0.38 |
| 63 | 127037 | 银轮转债 | 222,051,477.57 | 0.37 |
| 64 | 113666 | 爱玛转债 | 218,549,838.62 | 0.37 |
| 65 | 110092 | 三房转债 | 216,460,278.17 | 0.36 |
| 66 | 110086 | 精工转债 | 213,929,104.20 | 0.36 |
| 67 | 123119 | 康泰转 2 | 212,856,045.98 | 0.36 |
| 68 | 113070 | 渝水转债 | 205,654,996.72 | 0.35 |
| 69 | 127027 | 能化转债 | 197,881,063.13 | 0.33 |
| 70 | 118013 | 道通转债 | 196,268,447.50 | 0.33 |
| 71 | 113682 | 益丰转债 | 195,606,925.86 | 0.33 |
| 72 | 127066 | 科利转债 | 191,608,677.50 | 0.32 |
| 73 | 110076 | 华海转债 | 187,947,586.73 | 0.32 |
| 74 | 110090 | 爱迪转债 | 177,742,749.15 | 0.30 |
| 75 | 123255 | 鼎龙转债 | 175,092,174.05 | 0.29 |
| 76 | 113066 | 平煤转债 | 173,884,603.50 | 0.29 |
| 77 | 123149 | 通裕转债 | 168,842,414.34 | 0.28 |
| 78 | 128134 | 鸿路转债 | 165,693,204.96 | 0.28 |
| 79 | 113652 | 伟 22 转债 | 164,218,894.98 | 0.28 |

| | | | | |
|-----|--------|------|----------------|------|
| 80 | 118025 | 奕瑞转债 | 164,064,336.27 | 0.28 |
| 81 | 113046 | 金田转债 | 162,753,050.79 | 0.27 |
| 82 | 110095 | 双良转债 | 161,981,796.38 | 0.27 |
| 83 | 118050 | 航宇转债 | 161,670,385.66 | 0.27 |
| 84 | 127025 | 冀东转债 | 161,119,112.64 | 0.27 |
| 85 | 118057 | 甬矽转债 | 159,994,393.18 | 0.27 |
| 86 | 127024 | 盈峰转债 | 159,373,133.92 | 0.27 |
| 87 | 127038 | 国微转债 | 159,047,645.01 | 0.27 |
| 88 | 113647 | 禾丰转债 | 153,609,571.86 | 0.26 |
| 89 | 113692 | 保隆转债 | 152,028,000.04 | 0.26 |
| 90 | 113605 | 大参转债 | 149,350,782.90 | 0.25 |
| 91 | 127111 | 金威转债 | 147,168,269.21 | 0.25 |
| 92 | 127082 | 亚科转债 | 146,650,315.05 | 0.25 |
| 93 | 118049 | 汇成转债 | 143,371,879.39 | 0.24 |
| 94 | 111018 | 华康转债 | 143,335,107.41 | 0.24 |
| 95 | 123241 | 欧通转债 | 141,735,554.22 | 0.24 |
| 96 | 118051 | 皓元转债 | 141,453,893.14 | 0.24 |
| 97 | 127064 | 杭氧转债 | 138,496,173.08 | 0.23 |
| 98 | 123251 | 华医转债 | 137,645,311.29 | 0.23 |
| 99 | 123178 | 花园转债 | 135,904,162.27 | 0.23 |
| 100 | 127092 | 运机转债 | 132,994,962.37 | 0.22 |
| 101 | 113659 | 莱克转债 | 132,416,339.26 | 0.22 |
| 102 | 123257 | 安克转债 | 132,307,641.17 | 0.22 |
| 103 | 118042 | 奥维转债 | 131,340,086.94 | 0.22 |
| 104 | 113687 | 振华转债 | 131,226,260.99 | 0.22 |
| 105 | 128135 | 洽洽转债 | 130,154,556.76 | 0.22 |
| 106 | 128141 | 旺能转债 | 129,418,115.00 | 0.22 |
| 107 | 127046 | 百润转债 | 122,399,977.53 | 0.21 |
| 108 | 110098 | 南药转债 | 122,167,441.01 | 0.21 |
| 109 | 110077 | 洪城转债 | 121,089,257.75 | 0.20 |
| 110 | 110097 | 天润转债 | 118,903,042.85 | 0.20 |
| 111 | 118038 | 金宏转债 | 118,795,427.02 | 0.20 |
| 112 | 123150 | 九强转债 | 118,781,821.45 | 0.20 |
| 113 | 113673 | 岱美转债 | 117,868,691.87 | 0.20 |
| 114 | 118053 | 正帆转债 | 116,451,486.74 | 0.20 |
| 115 | 111000 | 起帆转债 | 116,055,477.51 | 0.19 |
| 116 | 113644 | 艾迪转债 | 114,821,484.67 | 0.19 |
| 117 | 123114 | 三角转债 | 110,302,808.93 | 0.19 |
| 118 | 123253 | 永贵转债 | 110,154,159.34 | 0.18 |
| 119 | 111023 | 利柏转债 | 109,724,615.07 | 0.18 |
| 120 | 127031 | 洋丰转债 | 108,930,446.26 | 0.18 |
| 121 | 123104 | 卫宁转债 | 106,547,396.76 | 0.18 |
| 122 | 113640 | 苏利转债 | 106,348,507.71 | 0.18 |

| | | | | |
|-----|--------|---------|----------------|------|
| 123 | 113636 | 甬金转债 | 106,165,511.73 | 0.18 |
| 124 | 113633 | 科沃转债 | 106,131,389.69 | 0.18 |
| 125 | 127102 | 浙建转债 | 105,744,922.54 | 0.18 |
| 126 | 123113 | 仙乐转债 | 105,366,050.87 | 0.18 |
| 127 | 111021 | 奥锐转债 | 101,388,360.47 | 0.17 |
| 128 | 123117 | 健帆转债 | 101,088,741.71 | 0.17 |
| 129 | 113658 | 密卫转债 | 99,456,998.60 | 0.17 |
| 130 | 123179 | 立高转债 | 98,437,788.55 | 0.17 |
| 131 | 123215 | 铭利转债 | 98,249,585.31 | 0.16 |
| 132 | 110084 | 贵燃转债 | 97,364,863.80 | 0.16 |
| 133 | 113679 | 芯能转债 | 97,119,939.21 | 0.16 |
| 134 | 127017 | 万青转债 | 95,873,633.41 | 0.16 |
| 135 | 123121 | 帝尔转债 | 95,391,369.06 | 0.16 |
| 136 | 123252 | 银邦转债 | 94,719,168.05 | 0.16 |
| 137 | 123194 | 百洋转债 | 94,271,999.16 | 0.16 |
| 138 | 123188 | 水羊转债 | 93,981,930.11 | 0.16 |
| 139 | 118056 | 路维转债 | 93,544,014.86 | 0.16 |
| 140 | 113648 | 巨星转债 | 92,392,498.65 | 0.16 |
| 141 | 113688 | 国检转债 | 90,114,939.80 | 0.15 |
| 142 | 110074 | 精达转债 | 89,790,882.12 | 0.15 |
| 143 | 123165 | 回天转债 | 89,671,183.48 | 0.15 |
| 144 | 123236 | 家联转债 | 89,219,699.85 | 0.15 |
| 145 | 123172 | 漱玉转债 | 89,061,579.68 | 0.15 |
| 146 | 118027 | 宏图转债 | 88,232,779.53 | 0.15 |
| 147 | 118005 | 天奈转债 | 87,512,948.06 | 0.15 |
| 148 | 127068 | 顺博转债 | 86,607,349.70 | 0.15 |
| 149 | 128137 | 洁美转债 | 86,020,801.41 | 0.14 |
| 150 | 127105 | 龙星转债 | 85,643,708.91 | 0.14 |
| 151 | 118003 | 华兴转债 | 84,437,114.20 | 0.14 |
| 152 | 113656 | 嘉诚转债 | 82,461,018.30 | 0.14 |
| 153 | 113650 | 博 22 转债 | 81,995,123.62 | 0.14 |
| 154 | 113627 | 太平转债 | 80,613,527.09 | 0.14 |
| 155 | 113618 | 美诺转债 | 80,336,174.80 | 0.13 |
| 156 | 113634 | 珀莱转债 | 80,154,845.91 | 0.13 |
| 157 | 113670 | 金 23 转债 | 80,068,597.50 | 0.13 |
| 158 | 127095 | 广泰转债 | 79,737,404.43 | 0.13 |
| 159 | 123133 | 佩蒂转债 | 79,424,644.97 | 0.13 |
| 160 | 127088 | 赫达转债 | 79,366,122.60 | 0.13 |
| 161 | 127047 | 帝欧转债 | 79,290,177.40 | 0.13 |
| 162 | 128142 | 新乳转债 | 77,943,237.10 | 0.13 |
| 163 | 128127 | 文科转债 | 77,468,646.78 | 0.13 |
| 164 | 111004 | 明新转债 | 77,186,894.67 | 0.13 |
| 165 | 123192 | 科思转债 | 76,815,757.80 | 0.13 |

| | | | | |
|-----|--------|---------|---------------|------|
| 166 | 127026 | 超声转债 | 76,410,886.98 | 0.13 |
| 167 | 118033 | 华特转债 | 75,847,268.34 | 0.13 |
| 168 | 111015 | 东亚转债 | 75,155,588.97 | 0.13 |
| 169 | 111002 | 特纸转债 | 73,838,966.55 | 0.12 |
| 170 | 113667 | 春 23 转债 | 73,799,999.87 | 0.12 |
| 171 | 123071 | 天能转债 | 73,788,674.57 | 0.12 |
| 172 | 111017 | 蓝天转债 | 73,670,922.74 | 0.12 |
| 173 | 128128 | 齐翔转 2 | 72,619,899.28 | 0.12 |
| 174 | 118032 | 建龙转债 | 72,614,803.07 | 0.12 |
| 175 | 111009 | 盛泰转债 | 72,381,950.47 | 0.12 |
| 176 | 113693 | 志邦转债 | 71,331,915.91 | 0.12 |
| 177 | 123151 | 康医转债 | 71,294,590.94 | 0.12 |
| 178 | 118041 | 星球转债 | 70,906,631.98 | 0.12 |
| 179 | 127104 | 姚记转债 | 70,821,367.88 | 0.12 |
| 180 | 123183 | 海顺转债 | 70,398,932.90 | 0.12 |
| 181 | 123131 | 奥飞转债 | 69,849,793.60 | 0.12 |
| 182 | 113631 | 皖天转债 | 69,649,974.18 | 0.12 |
| 183 | 123195 | 蓝晓转 02 | 69,395,049.42 | 0.12 |
| 184 | 123225 | 翔丰转债 | 67,635,397.78 | 0.11 |
| 185 | 128121 | 宏川转债 | 67,305,216.53 | 0.11 |
| 186 | 111001 | 山玻转债 | 67,188,844.89 | 0.11 |
| 187 | 113681 | 镇洋转债 | 67,116,868.89 | 0.11 |
| 188 | 113678 | 中贝转债 | 66,742,521.64 | 0.11 |
| 189 | 111022 | 锡振转债 | 66,094,658.16 | 0.11 |
| 190 | 123235 | 亿田转债 | 65,629,484.35 | 0.11 |
| 191 | 127109 | 电化转债 | 65,378,771.79 | 0.11 |
| 192 | 113695 | 华辰转债 | 64,586,463.35 | 0.11 |
| 193 | 118020 | 芳源转债 | 64,507,348.97 | 0.11 |
| 194 | 127060 | 湘佳转债 | 64,471,447.88 | 0.11 |
| 195 | 111005 | 富春转债 | 63,680,379.91 | 0.11 |
| 196 | 123091 | 长海转债 | 63,444,260.34 | 0.11 |
| 197 | 123193 | 海能转债 | 63,307,385.08 | 0.11 |
| 198 | 113638 | 台 21 转债 | 63,097,799.42 | 0.11 |
| 199 | 123049 | 维尔转债 | 62,864,243.92 | 0.11 |
| 200 | 111014 | 李子转债 | 62,282,311.90 | 0.10 |
| 201 | 118012 | 微芯转债 | 61,999,431.66 | 0.10 |
| 202 | 123085 | 万顺转 2 | 61,976,203.21 | 0.10 |
| 203 | 113694 | 清源转债 | 61,975,410.52 | 0.10 |
| 204 | 123144 | 裕兴转债 | 61,929,354.50 | 0.10 |
| 205 | 123076 | 强力转债 | 61,852,697.81 | 0.10 |
| 206 | 113654 | 永 02 转债 | 60,831,237.50 | 0.10 |
| 207 | 123213 | 天源转债 | 60,534,533.10 | 0.10 |
| 208 | 123118 | 惠城转债 | 60,197,275.33 | 0.10 |

| | | | | |
|-----|--------|--------|---------------|------|
| 209 | 127041 | 弘亚转债 | 60,194,753.20 | 0.10 |
| 210 | 113625 | 江山转债 | 60,162,881.90 | 0.10 |
| 211 | 123122 | 富瀚转债 | 59,360,591.34 | 0.10 |
| 212 | 113584 | 家悦转债 | 59,272,677.41 | 0.10 |
| 213 | 123064 | 万孚转债 | 58,087,291.70 | 0.10 |
| 214 | 123124 | 晶瑞转 2 | 57,833,295.49 | 0.10 |
| 215 | 118004 | 博瑞转债 | 57,187,941.87 | 0.10 |
| 216 | 123256 | 恒帅转债 | 55,949,795.16 | 0.09 |
| 217 | 128119 | 龙大转债 | 55,898,071.56 | 0.09 |
| 218 | 123258 | 胜蓝转 02 | 55,871,910.86 | 0.09 |
| 219 | 118011 | 银微转债 | 55,603,085.89 | 0.09 |
| 220 | 127054 | 双箭转债 | 54,855,986.85 | 0.09 |
| 221 | 127069 | 小熊转债 | 54,499,740.29 | 0.09 |
| 222 | 127096 | 泰坦转债 | 54,205,332.31 | 0.09 |
| 223 | 127078 | 优彩转债 | 53,626,635.90 | 0.09 |
| 224 | 123243 | 严牌转债 | 53,563,697.38 | 0.09 |
| 225 | 113643 | 风语转债 | 53,459,935.20 | 0.09 |
| 226 | 127016 | 鲁泰转债 | 53,429,016.38 | 0.09 |
| 227 | 123154 | 火星转债 | 53,363,431.15 | 0.09 |
| 228 | 118039 | 煜邦转债 | 53,342,783.18 | 0.09 |
| 229 | 123142 | 申昊转债 | 53,239,820.92 | 0.09 |
| 230 | 127090 | 兴瑞转债 | 53,076,291.94 | 0.09 |
| 231 | 113649 | 丰山转债 | 52,703,270.38 | 0.09 |
| 232 | 118035 | 国力转债 | 52,473,920.89 | 0.09 |
| 233 | 127079 | 华亚转债 | 51,992,294.03 | 0.09 |
| 234 | 123168 | 惠云转债 | 51,492,876.90 | 0.09 |
| 235 | 118044 | 赛特转债 | 51,398,752.28 | 0.09 |
| 236 | 123237 | 佳禾转债 | 50,668,675.07 | 0.09 |
| 237 | 118037 | 上声转债 | 50,251,948.12 | 0.08 |
| 238 | 127072 | 博实转债 | 48,628,873.38 | 0.08 |
| 239 | 127099 | 盛航转债 | 48,392,904.35 | 0.08 |
| 240 | 123109 | 昌红转债 | 47,959,264.00 | 0.08 |
| 241 | 118040 | 宏微转债 | 47,721,747.26 | 0.08 |
| 242 | 123214 | 东宝转债 | 47,227,443.23 | 0.08 |
| 243 | 127053 | 豪美转债 | 47,095,824.45 | 0.08 |
| 244 | 127098 | 欧晶转债 | 46,980,731.24 | 0.08 |
| 245 | 123090 | 三诺转债 | 46,810,002.35 | 0.08 |
| 246 | 127034 | 绿茵转债 | 46,622,694.61 | 0.08 |
| 247 | 118018 | 瑞科转债 | 46,506,978.97 | 0.08 |
| 248 | 113624 | 正川转债 | 46,384,637.58 | 0.08 |
| 249 | 113039 | 嘉泽转债 | 46,206,627.80 | 0.08 |
| 250 | 113579 | 健友转债 | 45,314,407.24 | 0.08 |
| 251 | 123187 | 超达转债 | 45,270,114.80 | 0.08 |

| | | | | |
|-----|--------|---------|---------------|------|
| 252 | 128138 | 侨银转债 | 45,159,513.83 | 0.08 |
| 253 | 123160 | 泰福转债 | 45,082,243.84 | 0.08 |
| 254 | 128125 | 华阳转债 | 45,067,771.58 | 0.08 |
| 255 | 111013 | 新港转债 | 44,097,019.20 | 0.07 |
| 256 | 118010 | 洁特转债 | 43,919,269.25 | 0.07 |
| 257 | 113686 | 泰瑞转债 | 43,678,217.47 | 0.07 |
| 258 | 118036 | 力合转债 | 42,323,046.87 | 0.07 |
| 259 | 113674 | 华设转债 | 42,265,893.64 | 0.07 |
| 260 | 118015 | 芯海转债 | 41,538,528.22 | 0.07 |
| 261 | 127062 | 垒知转债 | 41,441,712.03 | 0.07 |
| 262 | 118006 | 阿拉转债 | 41,018,051.97 | 0.07 |
| 263 | 118052 | 浩瀚转债 | 40,705,769.86 | 0.07 |
| 264 | 127059 | 永东转 2 | 40,687,306.45 | 0.07 |
| 265 | 123175 | 百畅转债 | 40,611,189.86 | 0.07 |
| 266 | 123250 | 嘉益转债 | 40,603,016.00 | 0.07 |
| 267 | 113660 | 寿 22 转债 | 40,538,842.13 | 0.07 |
| 268 | 123211 | 阳谷转债 | 40,043,123.72 | 0.07 |
| 269 | 123222 | 博俊转债 | 39,328,213.56 | 0.07 |
| 270 | 123171 | 共同转债 | 39,089,160.39 | 0.07 |
| 271 | 123155 | 中陆转债 | 38,553,961.28 | 0.06 |
| 272 | 113665 | 汇通转债 | 38,147,850.79 | 0.06 |
| 273 | 123126 | 瑞丰转债 | 37,615,092.34 | 0.06 |
| 274 | 111020 | 合顺转债 | 37,120,399.42 | 0.06 |
| 275 | 123092 | 天壕转债 | 36,913,544.18 | 0.06 |
| 276 | 123196 | 正元转 02 | 36,827,911.60 | 0.06 |
| 277 | 123199 | 山河转债 | 36,400,371.87 | 0.06 |
| 278 | 123180 | 浙矿转债 | 35,530,896.80 | 0.06 |
| 279 | 113698 | 凯众转债 | 35,483,786.21 | 0.06 |
| 280 | 123207 | 冠中转债 | 35,478,946.86 | 0.06 |
| 281 | 123198 | 金埔转债 | 35,441,655.96 | 0.06 |
| 282 | 123189 | 晓鸣转债 | 35,285,027.78 | 0.06 |
| 283 | 113671 | 武进转债 | 34,145,977.34 | 0.06 |
| 284 | 113680 | 丽岛转债 | 34,107,952.80 | 0.06 |
| 285 | 123224 | 宇邦转债 | 33,970,606.69 | 0.06 |
| 286 | 127044 | 蒙娜转债 | 32,887,988.70 | 0.06 |
| 287 | 123088 | 威唐转债 | 32,309,018.27 | 0.05 |
| 288 | 123245 | 集智转债 | 32,083,331.47 | 0.05 |
| 289 | 123220 | 易瑞转债 | 31,721,325.05 | 0.05 |
| 290 | 128108 | 蓝帆转债 | 31,585,776.32 | 0.05 |
| 291 | 118007 | 山石转债 | 31,276,541.99 | 0.05 |
| 292 | 111012 | 福新转债 | 31,097,286.54 | 0.05 |
| 293 | 113597 | 佳力转债 | 30,826,549.09 | 0.05 |
| 294 | 127055 | 精装转债 | 30,339,305.50 | 0.05 |

| | | | | |
|-----|--------|--------|---------------|------|
| 295 | 127093 | 章鼓转债 | 28,991,016.68 | 0.05 |
| 296 | 123173 | 恒锋转债 | 28,607,832.91 | 0.05 |
| 297 | 123209 | 聚隆转债 | 28,028,533.30 | 0.05 |
| 298 | 123157 | 科蓝转债 | 27,618,966.02 | 0.05 |
| 299 | 123138 | 丝路转债 | 27,211,060.18 | 0.05 |
| 300 | 123112 | 万讯转债 | 27,020,121.41 | 0.05 |
| 301 | 113588 | 润达转债 | 25,764,948.53 | 0.04 |
| 302 | 123223 | 九典转 02 | 24,559,374.80 | 0.04 |
| 303 | 111003 | 聚合转债 | 24,356,862.95 | 0.04 |
| 304 | 123065 | 宝莱转债 | 24,128,181.53 | 0.04 |
| 305 | 123129 | 锦鸡转债 | 23,275,646.18 | 0.04 |
| 306 | 118016 | 京源转债 | 22,598,705.47 | 0.04 |
| 307 | 113646 | 永吉转债 | 21,779,322.83 | 0.04 |
| 308 | 110070 | 凌钢转债 | 21,503,711.49 | 0.04 |
| 309 | 128124 | 科华转债 | 21,219,495.81 | 0.04 |
| 310 | 123229 | 艾录转债 | 20,393,975.34 | 0.03 |
| 311 | 123054 | 思特转债 | 19,561,511.24 | 0.03 |
| 312 | 123061 | 航新转债 | 19,158,262.65 | 0.03 |
| 313 | 123059 | 银信转债 | 18,803,506.84 | 0.03 |

5.11.4 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。

5.11.5 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 | 3,794,286,670.00 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 1,134,800,000.00 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 524,300,000.00 |
| 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 | 4,404,786,670.00 |

§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”是公司的使命。公司的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 2026 年 3 月 31 日，博时基金管理有限公司共管理 402 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 16,585 亿元人民币，剔除货币基金后，博时基金管理有限公司公募资产管理总规模逾 6,653 亿元人民币，累计分红逾 2,286 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

二〇二六年四月二十二日