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 3 季度报告

2026 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：二〇二六年十月二十七日

§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约定，于 2026 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 2026 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 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	4,646,786,670.00 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	本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。本基金将采用抽样复制法，主要以标的指数的成份券构成为基础，综合考虑跟踪效果、流动性、操作风险等因素构建组合，并根据本基金资产规模、日常申购赎回情况、市场流动性等情况，进行抽样优化调整，达到复制标的指数、降低交易成本的目的。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.3%，年跟踪误差不超过 4%。对于出现市场流动性不足、

	因法律法规原因被限制投资等情况，导致本基金无法获得对个别成份债足够数量的投资时，基金管理人将通过投资其他成份券、非成份券、成份券个券衍生品等方式进行替代。其他投资策略包括固定收益品种投资策略，含利率策略、骑乘策略、放大策略、其他金融工具投资策略以及国债期货投资策略等。
业绩比较基准	中证可转债及可交换债券指数收益率
风险收益特征	本基金属于债券型基金，其预期收益及风险水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。本基金采用优化抽样复制策略，跟踪中证可转债及可交换债券指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。
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 7 月 1 日-2026 年 9 月 30 日)
1.本期已实现收益	181,533,059.98
2.本期利润	-4,214,424,159.81
3.加权平均基金份额本期利润	-0.9227
4.期末基金资产净值	60,600,778,356.51
5.期末基金份额净值	13.0414

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。

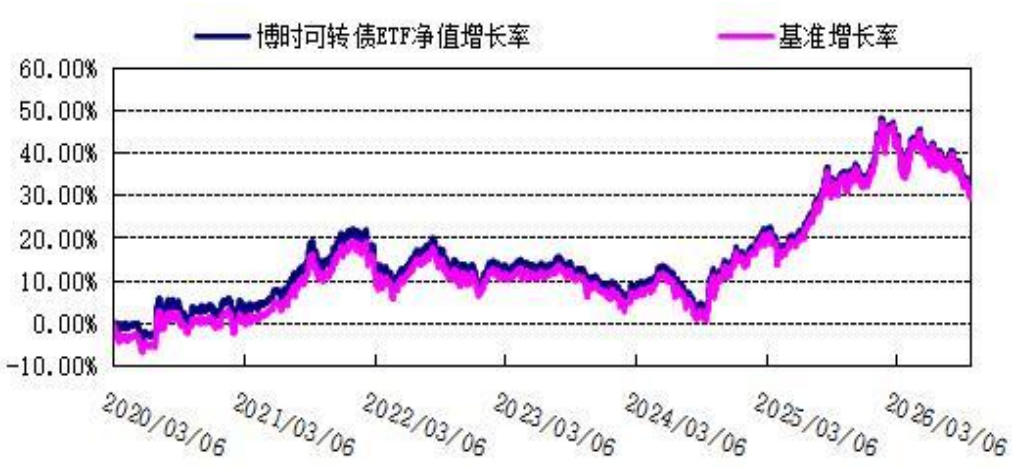
所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-6.74%	0.61%	-6.72%	0.61%	-0.02%	0.00%
过去六个月	-3.55%	0.73%	-3.41%	0.74%	-0.14%	-0.01%
过去一年	-3.47%	0.77%	-3.30%	0.77%	-0.17%	0.00%
过去三年	15.56%	0.65%	16.82%	0.66%	-1.26%	-0.01%
过去五年	13.80%	0.60%	16.13%	0.61%	-2.33%	-0.01%
自基金合同生效起至今	30.41%	0.59%	29.63%	0.60%	0.78%	-0.01%

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	-	15.4	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	-	25.2	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 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。

注：上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，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 11 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，国内经济呈现生产保持韧性、内需修复偏慢的结构性特征。制造业 PMI 在 7、8 月低于荣枯线，9 月回升至 50.1%，产需两端保持扩张，装备制造业与高技术制造业延续较高景气。8 月规模以上工业增加值同比增长 5.2%，社会消费品零售总额增长 0.4%，1—8 月固定资产投资下降 7.2%，生产与需求表现仍不均衡。同时，8 月 PPI 同比上涨 3.8%，工业品价格回升与需求偏弱并存，价格改善向企业盈利的传导仍取决于行业供需及成本差异。海外方面，通胀压力及地缘政治扰动持续，美联储 9 月加息 25 个基点至 3.75%—4.00%，海外利率上行对风险资产估值形成约束。

A 股市场由二季度的上涨转入较明显调整，7 月集中回落、8 月阶段性修复、9 月再度走弱，成交活跃度逐步下降。三季度沪深 300、万得全 A 分别下跌 12.49%、13.33%，前期涨幅较大的成长方向调整较多，中小盘整体承压更明显。上半年估值扩张后的获利回吐、盈利兑现分化与海外利率预期变化共同影响市场定价，资金对估值和业绩匹配度的要求提高。市场更加重视基本面验证，单纯依靠风险偏好提升推动的上涨难以持续，行业轮动及个股分化进一步加剧。

债券市场整体震荡走强，7 月下旬及 9 月下旬表现较为突出，其余阶段以区间波动为主。10 年期国债收益率由 6 月末约 1.73%降至 9 月末约 1.68%，累计下行约 5 个基点。内需恢复偏慢、资金面总体平稳和权益调整对债市形成支撑，长端及超长端表现相对占优；短端受资金成本约束，下行弹性有限，收益率曲线趋于平坦。国内外利率走势分化，国内债市仍主要围绕基本面、政策预期及机构配置行为定价。同时，政府债供给、增量政策预期和机构头寸变化继续带来阶段性扰动。

转债方面，中证转债及可交换债券指数三季度下跌 6.72%，平价波动与溢价率变化共同影响收益。7 月转债在权益调整中相对抗跌，溢价率被动抬升；8 月正股反弹期间，溢价率收缩削弱收益弹性；9 月部分品种受到平价下降与估值消化的双重拖累。价格中位数由 129.50 元微升至 130.05 元，转股溢价率中位数由 50.35%微升至 50.51%，新上市尚未进入转股期的个券抬升了整体的估值水位。全样本到期收益率中位数仍为负值，收益实现较依赖正股表现及条款价值。供给端，新券上市增加、市场余额出现企稳迹象，偿债退出与强赎继续影响存量结构；需求端，ETF 配置规模维持高位，公募构成边际增量，但成交萎缩、新券比价和资金流向分化使高估值品种面临消化压力。

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 规模保持平稳、场内成交额跟随市场缩量有所下降。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2026 年 09 月 30 日，本基金基金份额净值为 13.0414 元，份额累计净值为 1.3041 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为-6.74%，同期业绩基准增长率-6.72%。

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	59,944,642,305.55	98.54
	其中：债券	59,944,642,305.55	98.54
	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	453,872,456.15	0.75
	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	313,673,822.69	0.52
8	其他各项资产	121,757,232.95	0.20
9	合计	60,833,945,817.34	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

无。

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）	59,944,642,305.55	98.92
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	59,944,642,305.55	98.92

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	39,398,690	4,459,213,896.18	7.36

2	113042	上银转债	18,666,550	2,192,736,614.88	3.62
3	113056	重银转债	11,016,570	1,380,762,555.47	2.28
4	132026	G 三峡 EB2	9,485,930	1,295,431,086.89	2.14
5	110085	通 22 转债	11,417,150	1,287,626,177.00	2.12

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广东省分行、国家外汇管理局南平市分局、国家外汇管理局海南省分局、金融监管总局的处罚。通威股份有限公司在报告编制前一年受到国家税务总局成都市税务局第三稽查局的处罚。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	3,973,672.01
2	应收证券清算款	117,753,315.15
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	30,245.79
8	其他	-
9	合计	121,757,232.95

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	4,459,213,896.18	7.36
2	113042	上银转债	2,192,736,614.88	3.62
3	113056	重银转债	1,380,762,555.47	2.28
4	132026	G 三峡 EB2	1,295,431,086.89	2.14
5	110085	通 22 转债	1,287,626,177.00	2.12
6	127045	牧原转债	1,072,548,042.24	1.77
7	127089	晶澳转债	974,815,983.61	1.61
8	118034	晶能转债	917,322,468.53	1.51

9	127049	希望转 2	840,509,761.62	1.39
10	123107	温氏转债	818,664,429.19	1.35
11	113053	隆 22 转债	759,617,651.69	1.25
12	113062	常银转债	724,743,678.35	1.20
13	118030	睿创转债	665,767,963.41	1.10
14	118031	天 23 转债	652,768,300.09	1.08
15	127110	广核转债	637,289,852.95	1.05
16	113691	和邦转债	588,215,777.68	0.97
17	127056	中特转债	576,327,046.20	0.95
18	127083	山路转债	557,477,250.22	0.92
19	127030	盛虹转债	535,186,209.10	0.88
20	110099	福能转债	523,773,775.55	0.86
21	123176	精测转 2	473,955,879.77	0.78
22	113059	福莱转债	442,912,656.93	0.73
23	127040	国泰转债	439,446,384.56	0.73
24	123158	宙邦转债	405,814,256.71	0.67
25	113043	财通转债	395,809,503.36	0.65
26	113661	福 22 转债	372,051,440.13	0.61
27	118022	锂科转债	361,042,676.63	0.60
28	118058	微导转债	356,247,156.11	0.59
29	118024	冠宇转债	354,440,934.65	0.58
30	113049	长汽转债	353,018,418.40	0.58
31	113067	燃 23 转债	352,044,753.92	0.58
32	113696	伯 25 转债	350,075,707.58	0.58
33	113699	金 25 转债	347,118,039.53	0.57
34	110087	天业转债	342,701,397.62	0.57
35	127108	太能转债	340,998,842.17	0.56
36	123247	万凯转债	335,113,386.65	0.55
37	113615	金诚转债	331,530,619.71	0.55
38	127084	柳工转 2	317,916,000.95	0.52
39	128136	立讯转债	307,525,371.38	0.51
40	113051	节能转债	292,802,355.39	0.48
41	127061	美锦转债	284,965,054.47	0.47
42	113677	华懋转债	282,442,015.11	0.47
43	123255	鼎龙转债	280,139,026.75	0.46
44	127085	韵达转债	278,927,307.67	0.46
45	113054	绿动转债	276,031,118.25	0.46
46	123216	科顺转债	260,721,063.48	0.43
47	113616	韦尔转债	253,890,360.35	0.42
48	127103	东南转债	250,932,971.40	0.41
49	110093	神马转债	246,964,420.08	0.41
50	127050	麒麟转债	236,222,904.71	0.39
51	118051	皓元转债	233,472,111.49	0.39

52	118065	艾为转债	232,629,355.89	0.38
53	123259	锦浪转 02	232,272,653.48	0.38
54	110086	精工转债	229,935,549.95	0.38
55	113655	欧 22 转债	228,376,140.44	0.38
56	113666	爱玛转债	228,029,146.52	0.38
57	123119	康泰转 2	225,936,855.74	0.37
58	113058	友发转债	225,204,746.54	0.37
59	127112	尚太转债	224,055,635.03	0.37
60	113070	渝水转债	221,870,829.40	0.37
61	127070	大中转债	218,079,882.07	0.36
62	118063	金 05 转债	215,262,301.70	0.36
63	113682	益丰转债	213,547,959.71	0.35
64	127027	能化转债	203,845,278.84	0.34
65	118064	联瑞转债	199,967,217.53	0.33
66	118013	道通转债	198,505,123.75	0.33
67	127037	银轮转债	197,747,776.02	0.33
68	110081	闻泰转债	194,851,027.74	0.32
69	110076	华海转债	194,143,391.56	0.32
70	113066	平煤转债	187,012,650.56	0.31
71	110090	爱迪转债	186,736,116.72	0.31
72	123241	欧通转债	186,174,265.04	0.31
73	127025	冀东转债	176,970,495.55	0.29
74	113652	伟 22 转债	169,312,183.22	0.28
75	113673	岱美转债	168,463,052.04	0.28
76	118050	航宇转债	167,692,271.64	0.28
77	113692	保隆转债	166,900,419.32	0.28
78	113048	晶科转债	166,358,436.67	0.27
79	127111	金威转债	164,487,511.91	0.27
80	113046	金田转债	162,693,969.04	0.27
81	113647	禾丰转债	162,001,305.25	0.27
82	118060	瑞可转债	160,063,143.46	0.26
83	127038	国微转债	158,195,756.16	0.26
84	118059	颀中转债	154,206,995.76	0.25
85	123178	花园转债	153,932,075.64	0.25
86	123257	安克转债	153,731,864.80	0.25
87	111018	华康转债	152,796,606.63	0.25
88	127092	运机转债	152,688,026.84	0.25
89	110095	双良转债	150,216,130.56	0.25
90	118056	路维转债	149,351,989.98	0.25
91	113605	大参转债	148,384,072.06	0.24
92	113659	莱克转债	148,344,252.36	0.24
93	127064	杭氧转债	145,751,200.52	0.24
94	128135	洽洽转债	144,934,246.75	0.24

95	127082	亚科转债	142,574,363.93	0.24
96	123150	九强转债	140,739,178.64	0.23
97	118042	奥维转债	135,396,158.78	0.22
98	123149	通裕转债	135,341,259.22	0.22
99	110098	南药转债	135,188,390.85	0.22
100	127046	百润转债	131,419,067.60	0.22
101	110097	天润转债	130,747,674.25	0.22
102	118062	天淮转债	129,034,566.28	0.21
103	110077	洪城转债	126,362,332.85	0.21
104	111000	起帆转债	125,320,453.29	0.21
105	113636	甬金转债	123,200,811.20	0.20
106	123253	永贵转债	119,015,388.69	0.20
107	127096	泰坦转债	118,049,552.76	0.19
108	123263	鼎捷转债	117,979,919.35	0.19
109	123104	卫宁转债	113,638,818.94	0.19
110	127102	浙建转债	113,460,370.45	0.19
111	110100	龙建转债	110,995,833.28	0.18
112	123194	百洋转债	110,430,507.43	0.18
113	113633	科沃转债	110,268,525.49	0.18
114	123113	仙乐转债	109,921,362.46	0.18
115	123179	立高转债	109,383,619.99	0.18
116	127031	洋丰转债	107,839,212.78	0.18
117	127113	长高转债	106,776,639.74	0.18
118	123165	回天转债	105,661,353.94	0.17
119	113679	芯能转债	104,785,745.16	0.17
120	123117	健帆转债	104,274,019.61	0.17
121	110075	南航转债	103,496,793.26	0.17
122	111024	澳弘转债	103,105,836.07	0.17
123	111021	奥锐转债	103,030,862.49	0.17
124	123114	三角转债	102,998,450.24	0.17
125	110084	贵燃转债	100,421,402.02	0.17
126	123172	漱玉转债	99,913,448.79	0.16
127	113688	国检转债	99,795,416.07	0.16
128	123215	铭利转债	98,618,883.89	0.16
129	113648	巨星转债	97,117,327.04	0.16
130	118005	天奈转债	96,750,503.48	0.16
131	113700	海天转债	96,670,783.16	0.16
132	118061	茂莱转债	95,277,277.38	0.16
133	123252	银邦转债	94,639,453.25	0.16
134	127105	龙星转债	93,098,946.63	0.15
135	123264	双乐转债	92,346,624.78	0.15
136	127068	顺博转债	91,838,953.26	0.15
137	127088	赫达转债	91,224,759.63	0.15

138	113650	博 22 转债	91,215,728.55	0.15
139	127095	广泰转债	90,489,551.31	0.15
140	113640	苏利转债	89,837,041.13	0.15
141	123195	蓝晓转 02	89,697,928.50	0.15
142	113670	金 23 转债	89,429,121.01	0.15
143	113656	嘉诚转债	88,743,848.73	0.15
144	123133	佩蒂转债	87,654,536.68	0.14
145	113634	珀莱转债	84,910,495.70	0.14
146	111004	明新转债	84,433,985.89	0.14
147	111015	东亚转债	84,385,605.51	0.14
148	111002	特纸转债	84,169,938.37	0.14
149	123192	科思转债	84,162,543.07	0.14
150	113627	太平转债	83,829,016.45	0.14
151	111017	蓝天转债	81,376,658.42	0.13
152	118032	建龙转债	80,930,529.13	0.13
153	111009	盛泰转债	80,428,014.26	0.13
154	123151	康医转债	78,753,069.76	0.13
155	123183	海顺转债	77,788,180.99	0.13
156	123213	天源转债	77,186,128.66	0.13
157	113693	志邦转债	77,041,691.79	0.13
158	111022	锡振转债	76,792,221.26	0.13
159	128142	新乳转债	75,690,606.21	0.12
160	123235	亿田转债	75,311,993.45	0.12
161	127060	湘佳转债	75,305,769.23	0.12
162	127104	姚记转债	74,803,100.80	0.12
163	113631	皖天转债	74,396,793.98	0.12
164	123071	天能转债	74,296,592.72	0.12
165	123225	翔丰转债	73,409,382.33	0.12
166	123193	海能转债	73,076,248.84	0.12
167	123131	奥飞转债	72,460,105.05	0.12
168	123144	裕兴转债	71,854,099.52	0.12
169	118020	芳源转债	71,370,524.04	0.12
170	113681	镇洋转债	71,189,418.52	0.12
171	123122	富瀚转债	69,587,596.11	0.11
172	118066	统联转债	68,552,013.72	0.11
173	118012	微芯转债	68,495,268.47	0.11
174	113638	台 21 转债	68,480,877.22	0.11
175	111014	李子转债	68,446,566.24	0.11
176	127109	电化转债	68,055,735.26	0.11
177	118044	赛特转债	66,391,009.07	0.11
178	118035	国力转债	66,363,729.28	0.11
179	113643	风语转债	66,122,603.84	0.11
180	113678	中贝转债	65,332,813.11	0.11

181	123142	申昊转债	65,265,783.59	0.11
182	123124	晶瑞转 2	64,798,568.02	0.11
183	123091	长海转债	64,587,840.81	0.11
184	113625	江山转债	64,127,785.65	0.11
185	113695	华辰转债	61,984,189.54	0.10
186	123243	严牌转债	61,767,304.94	0.10
187	123154	火星转债	60,942,030.86	0.10
188	127078	优彩转债	60,872,582.35	0.10
189	123262	神宇转债	60,741,020.47	0.10
190	123260	卓镁转债	60,706,351.34	0.10
191	127069	小熊转债	60,508,022.09	0.10
192	123168	惠云转债	59,362,669.56	0.10
193	127054	双箭转债	58,991,416.00	0.10
194	113694	清源转债	58,823,185.15	0.10
195	127047	帝欧转债	58,084,469.87	0.10
196	127099	盛航转债	57,024,100.59	0.09
197	123109	昌红转债	56,919,959.31	0.09
198	123214	东宝转债	55,826,187.63	0.09
199	113649	丰山转债	55,688,983.99	0.09
200	123265	耐普转 02	55,684,040.58	0.09
201	118037	上声转债	55,569,388.88	0.09
202	127072	博实转债	55,413,613.91	0.09
203	113701	祥和转债	54,837,465.88	0.09
204	123237	佳禾转债	54,612,059.87	0.09
205	127098	欧晶转债	54,392,153.08	0.09
206	118010	洁特转债	53,138,427.91	0.09
207	123090	三诺转债	52,991,946.12	0.09
208	123245	集智转债	52,496,385.05	0.09
209	127053	豪美转债	51,931,461.22	0.09
210	118036	力合转债	50,954,653.83	0.08
211	118039	煜邦转债	50,016,425.60	0.08
212	127034	绿茵转债	49,245,951.13	0.08
213	118015	芯海转债	48,470,339.38	0.08
214	123266	博士转债	48,255,009.94	0.08
215	113674	华设转债	47,550,844.08	0.08
216	113686	泰瑞转债	47,206,174.63	0.08
217	118052	浩瀚转债	46,627,165.51	0.08
218	123171	共同转债	46,590,143.33	0.08
219	127062	垒知转债	46,581,312.83	0.08
220	113660	寿 22 转债	46,186,183.03	0.08
221	123250	嘉益转债	45,504,956.01	0.08
222	127059	永东转 2	45,382,090.11	0.07
223	123175	百畅转债	45,222,072.69	0.07

224	123155	中陆转债	43,599,070.94	0.07
225	123211	阳谷转债	43,068,839.36	0.07
226	113665	汇通转债	42,552,374.47	0.07
227	123199	山河转债	42,240,200.34	0.07
228	111020	合顺转债	42,034,402.50	0.07
229	123196	正元转 02	41,902,614.64	0.07
230	123189	晓鸣转债	41,847,490.30	0.07
231	123187	超达转债	41,611,346.34	0.07
232	123076	强力转债	40,248,502.81	0.07
233	118067	上 26 转债	39,405,338.88	0.07
234	113698	凯众转债	39,325,641.14	0.06
235	113680	丽岛转债	38,896,325.70	0.06
236	123180	浙矿转债	38,817,591.27	0.06
237	123118	惠城转债	38,576,200.75	0.06
238	123092	天壕转债	37,608,837.58	0.06
239	123224	宇邦转债	36,565,872.72	0.06
240	113671	武进转债	36,504,257.53	0.06
241	118007	山石转债	36,426,880.83	0.06
242	127044	蒙娜转债	36,345,910.82	0.06
243	123220	易瑞转债	36,236,461.53	0.06
244	123160	泰福转债	35,605,271.18	0.06
245	123261	普联转债	35,396,414.12	0.06
246	111012	福新转债	35,383,767.49	0.06
247	127055	精装转债	34,319,587.66	0.06
248	123088	威唐转债	32,905,393.31	0.05
249	123222	博俊转债	32,541,121.74	0.05
250	123173	恒锋转债	30,585,962.97	0.05
251	123157	科蓝转债	29,484,421.02	0.05
252	113610	灵康转债	29,149,463.46	0.05
253	123138	丝路转债	28,636,602.82	0.05
254	111003	聚合转债	26,536,728.79	0.04
255	123223	九典转 02	25,910,414.27	0.04
256	123207	冠中转债	25,599,374.22	0.04
257	123209	聚隆转债	25,389,244.46	0.04
258	118016	京源转债	23,881,037.62	0.04
259	123229	艾录转债	22,186,873.21	0.04
260	113646	永吉转债	20,150,489.45	0.03
261	123080	海波转债	17,258,007.26	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	4,320,886,670.00
报告期期间基金总申购份额	955,500,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	629,600,000.00
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	4,646,786,670.00

§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。“创造财富，共赴未来”是公司的使命。公司的投资理念是“投资价值发现者”。截至 2026 年 9 月 30 日，博时基金管理有限公司共管理 406

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 16,913 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 6,744 亿元人民币，累计分红逾 2,335 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

二〇二六年十月二十七日