

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1季度报告
2024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：二〇二四年四月二十二日

§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 2024 年 4 月 18 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 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
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	680,186,670.00 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 1 月 1 日-2024 年 3 月 31 日)
1.本期已实现收益	5,973,757.85
2.本期利润	3,188,200.88
3.加权平均基金份额本期利润	0.0049
4.期末基金资产净值	7,409,173,124.47
5.期末基金份额净值	10.8929

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。

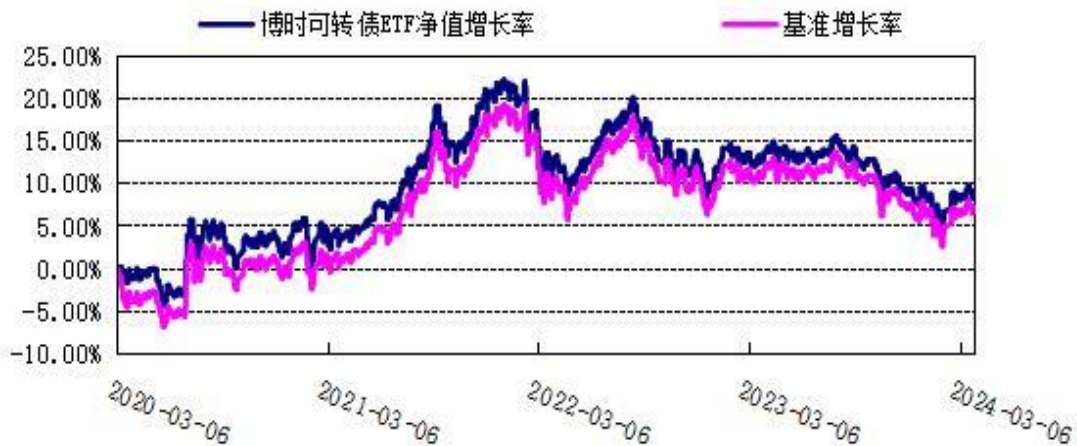
所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-0.59%	0.47%	-0.52%	0.48%	-0.07%	-0.01%
过去六个月	-3.48%	0.43%	-3.44%	0.44%	-0.04%	-0.01%
过去一年	-3.78%	0.39%	-3.70%	0.39%	-0.08%	0.00%
过去三年	5.16%	0.50%	6.25%	0.50%	-1.09%	0.00%
自基金合同生 效起至今	8.93%	0.53%	7.16%	0.53%	1.77%	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	-	12.9	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	-	22.7	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
--	--	--	--	--

				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)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 59 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，国内宏观经济整体呈现弱复苏态势，CPI 回暖，出口景气度回升，而房地产销售、投资仍为主要拖累项。大类资产表现上延续股弱债强，权益市场在 1 月至 2 月初经历了一轮流动性冲击，中小市值个股跌幅较大，在春节后悲观预期有所修正，权益市场快速反弹，整体风格上大强小弱，期间沪深 300 上涨 3.10%，国证 2000 下跌 8.83%，万得微盘股指数下跌 15.01%。

债券市场方面保持较为强势的格局，利率曲线整体收益率均有所下行，其中 1 年期国债收益率下行约 40bps，10 年期国债收益率下行约 27bps，30 年期国债收益率下行约 38bps。总体来看，超长端收益率下行带来的回报更加可观，主要是资金面在跨年之后转向宽松叠加市场整体风险在年前出现较大幅度下行导致。分月份来看，1 月下旬央行意外宣布降准引发了收益率的快速下行；进入 2 月之后权益市场出现较大幅度回撤，风险偏好的急剧下降又进一步推动了超长端利率品种收益率创出新低；3 月两会政策基本符合市场预期，1-2 月金融数据相对不强，债券做多情绪不减，收益率整体低位徘徊。

转债方面跟随权益大幅波动，估值中枢整体下移，中位数价格从年初的 118.55 元下跌至 112.17 元，绝对价格水平处于历史较低分位，若考虑到债底抬升，向下空间较为有限。各类属转债的转股溢价率仍不低，限制其向上弹性，估值结构上与 22 年两轮市场底部相仿。转债新券供给明显降速，预计二季度转债供给仍

非常有限。从需求端来看，公募基金、企业年金均在权益市场调整剧烈的 1、2 月份大幅减仓转债，随着春节后反弹行情的展开，机构配置转债意愿回升。

一季度，本基金跟踪的中证转债及可交换债指数下跌 0.52%。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极少数个券进行有效替代，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 规模稳步增长，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 03 月 31 日，本基金基金份额净值为 10.8929 元，份额累计净值为 1.0893 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为-0.59%，同期业绩基准增长率-0.52%。

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	7,216,540,362.77	97.08
	其中：债券	7,216,540,362.77	97.08
	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	167,000,000.00	2.25
	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	49,711,796.73	0.67
8	其他各项资产	321,899.30	0.00
9	合计	7,433,574,058.80	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）	7,216,540,362.77	97.40
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	7,216,540,362.77	97.40

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	3,743,060	408,026,868.62	5.51
2	113052	兴业转债	3,742,890	389,897,876.74	5.26
3	113021	中信转债	2,979,790	344,096,760.84	4.64
4	113044	大秦转债	1,665,320	199,509,670.39	2.69
5	132018	G 三峡 EB1	1,195,260	196,786,460.27	2.66

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外汇管理局江苏省分局、国家金融监督管理总局连云港监管分局的处罚。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北京监管局、国家外汇管理局上海市分局、中国人民银行河南省分行的处罚。上海银行股份有限公司在报告编制前一年受到国家外汇管理局上海市分局、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国家金融监督管理总局安徽监管局、国家外汇管理局绵阳市分局、中国银行保险监督管理委员会上海监管局的处罚。中信银行股份有限公司在报告编制前一年受到国家金融监督管理总局、国家外汇管理局南通市分局和中国人民银行安徽省分行的处罚。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。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	206,741.18
2	应收证券清算款	2,453.56
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	112,704.56
8	其他	-
9	合计	321,899.30

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	408,026,868.62	5.51
2	113052	兴业转债	389,897,876.74	5.26
3	113021	中信转债	344,096,760.84	4.64
4	113044	大秦转债	199,509,670.39	2.69
5	132018	G 三峡 EB1	196,786,460.27	2.66
6	113042	上银转债	166,094,942.98	2.24
7	113050	南银转债	141,845,707.17	1.91
8	110079	杭银转债	125,363,878.00	1.69
9	113056	重银转债	101,886,951.42	1.38
10	110085	通 22 转债	96,952,855.76	1.31
11	132026	G 三峡 EB2	90,293,919.26	1.22
12	127045	牧原转债	81,761,892.63	1.10
13	118034	晶能转债	78,672,956.19	1.06
14	123107	温氏转债	71,442,184.08	0.96
15	127089	晶澳转债	69,547,259.87	0.94
16	118031	天 23 转债	67,161,253.02	0.91
17	110081	闻泰转债	66,237,367.81	0.89
18	113060	浙 22 转债	65,200,076.08	0.88
19	110073	国投转债	64,441,525.00	0.87
20	127049	希望转 2	63,110,451.36	0.85
21	113641	华友转债	58,487,113.32	0.79
22	113065	齐鲁转债	57,767,630.09	0.78
23	113053	隆 22 转债	52,886,289.19	0.71
24	110075	南航转债	52,723,714.49	0.71
25	113062	常银转债	51,553,019.40	0.70
26	110083	苏租转债	50,849,879.37	0.69
27	127018	本钢转债	50,363,574.88	0.68

28	113055	成银转债	45,982,132.36	0.62
29	127032	苏行转债	45,803,473.31	0.62
30	127030	盛虹转债	41,281,352.27	0.56
31	127056	中特转债	39,479,533.57	0.53
32	128129	青农转债	39,004,239.85	0.53
33	127083	山路转债	37,604,806.70	0.51
34	132020	19 蓝星 EB	36,995,763.59	0.50
35	113037	紫银转债	36,182,788.47	0.49
36	113059	福莱转债	33,471,358.15	0.45
37	127040	国泰转债	32,402,488.79	0.44
38	113043	财通转债	31,036,248.79	0.42
39	127073	天赐转债	28,765,054.43	0.39
40	127086	恒邦转债	28,491,879.45	0.38
41	113066	平煤转债	28,190,005.82	0.38
42	113045	环旭转债	28,075,207.33	0.38
43	127084	柳工转 2	27,960,693.54	0.38
44	127020	中金转债	27,682,234.57	0.37
45	113049	长汽转债	27,310,229.63	0.37
46	113067	燃 23 转债	27,196,073.87	0.37
47	111010	立昂转债	27,068,354.35	0.37
48	110062	烽火转债	26,537,322.55	0.36
49	113051	节能转债	25,537,983.78	0.34
50	113615	金诚转债	24,741,490.69	0.33
51	127061	美锦转债	24,673,703.97	0.33
52	113661	福 22 转债	24,565,748.11	0.33
53	110093	神马转债	24,532,504.19	0.33
54	128136	立讯转债	24,445,719.04	0.33
55	118024	冠宇转债	24,411,097.09	0.33
56	113024	核建转债	24,041,561.16	0.32
57	118022	锂科转债	23,841,066.66	0.32
58	110072	广汇转债	23,290,200.74	0.31
59	110067	华安转债	23,154,762.23	0.31
60	128081	海亮转债	22,997,044.04	0.31
61	127067	恒逸转 2	22,518,522.37	0.30
62	110087	天业转债	22,336,539.74	0.30
63	113061	拓普转债	22,286,566.40	0.30
64	110089	兴发转债	22,210,499.50	0.30
65	110091	合力转债	21,847,342.83	0.29
66	113623	凤 21 转债	21,776,333.63	0.29
67	127050	麒麟转债	20,788,780.50	0.28
68	113616	韦尔转债	20,349,875.27	0.27
69	128048	张行转债	20,238,160.75	0.27
70	110095	双良转债	20,069,644.75	0.27

71	127085	韵达转债	19,235,981.21	0.26
72	110068	龙净转债	18,824,037.29	0.25
73	113054	绿动转债	18,416,618.17	0.25
74	123190	道氏转 02	18,332,992.28	0.25
75	110047	山鹰转债	18,200,153.53	0.25
76	110048	福能转债	18,114,631.62	0.24
77	113048	晶科转债	17,988,166.07	0.24
78	113632	鹤 21 转债	17,670,492.25	0.24
79	110092	三房转债	17,555,893.08	0.24
80	123119	康泰转 2	17,427,960.02	0.24
81	123158	宙邦转债	16,977,209.99	0.23
82	113058	友发转债	16,962,909.01	0.23
83	123216	科顺转债	16,725,349.39	0.23
84	127027	能化转债	16,606,468.17	0.22
85	113666	爱玛转债	16,535,179.35	0.22
86	110082	宏发转债	16,172,268.59	0.22
87	128109	楚江转债	15,936,446.67	0.22
88	127039	北港转债	15,857,973.11	0.21
89	113655	欧 22 转债	15,689,503.71	0.21
90	113602	景 20 转债	15,417,488.55	0.21
91	110077	洪城转债	15,358,047.97	0.21
92	127022	恒逸转债	14,954,772.18	0.20
93	118030	睿创转债	14,758,997.13	0.20
94	127063	贵轮转债	14,724,180.64	0.20
95	110076	华海转债	14,617,758.90	0.20
96	110090	爱迪转债	14,385,207.17	0.19
97	113033	利群转债	14,233,935.60	0.19
98	110086	精工转债	14,067,183.43	0.19
99	110063	鹰 19 转债	13,827,103.01	0.19
100	127025	冀东转债	13,630,787.75	0.18
101	127091	科数转债	13,102,710.92	0.18
102	118025	奕瑞转债	13,088,709.33	0.18
103	110094	众和转债	13,051,874.47	0.18
104	123176	精测转 2	12,807,926.22	0.17
105	123108	乐普转 2	12,798,900.07	0.17
106	127070	大中转债	12,666,400.43	0.17
107	128134	鸿路转债	12,476,804.98	0.17
108	127066	科利转债	12,385,343.61	0.17
109	127038	国微转债	12,339,171.67	0.17
110	123149	通裕转债	12,296,158.85	0.17
111	113068	金铜转债	12,291,493.54	0.17
112	113047	旗滨转债	12,139,363.16	0.16
113	113046	金田转债	11,805,099.07	0.16

114	113064	东材转债	11,721,683.55	0.16
115	127024	盈峰转债	11,706,782.38	0.16
116	113647	禾丰转债	11,528,866.03	0.16
117	113652	伟 22 转债	11,506,323.20	0.16
118	127016	鲁泰转债	11,399,585.56	0.15
119	128135	洽洽转债	11,397,822.94	0.15
120	128108	蓝帆转债	11,387,516.06	0.15
121	123169	正海转债	11,375,506.70	0.15
122	128131	崇达转 2	11,209,311.29	0.15
123	113605	大参转债	11,127,656.08	0.15
124	127064	杭氧转债	10,842,022.32	0.15
125	128141	旺能转债	10,810,828.22	0.15
126	123150	九强转债	10,638,362.25	0.14
127	113516	苏农转债	10,607,423.98	0.14
128	110064	建工转债	10,480,541.12	0.14
129	127082	亚科转债	10,375,487.21	0.14
130	127074	麦米转 2	10,274,173.53	0.14
131	118013	道通转债	10,215,598.96	0.14
132	113675	新 23 转债	10,107,155.52	0.14
133	118023	广大转债	10,079,230.19	0.14
134	113648	巨星转债	10,054,735.27	0.14
135	123210	信服转债	9,966,651.64	0.13
136	113659	莱克转债	9,833,787.11	0.13
137	118042	奥维转债	9,769,944.03	0.13
138	113669	景 23 转债	9,655,493.51	0.13
139	123128	首华转债	9,563,712.21	0.13
140	123161	强联转债	9,556,430.77	0.13
141	123178	花园转债	9,542,043.38	0.13
142	123115	捷捷转债	9,522,246.78	0.13
143	118019	金盘转债	9,300,968.75	0.13
144	127043	川恒转债	9,235,954.83	0.12
145	113619	世运转债	9,233,595.20	0.12
146	123145	药石转债	9,030,919.80	0.12
147	127046	百润转债	8,916,051.55	0.12
148	111017	蓝天转债	8,913,094.58	0.12
149	127037	银轮转债	8,904,612.08	0.12
150	111000	起帆转债	8,780,052.01	0.12
151	123208	孩王转债	8,778,014.48	0.12
152	127044	蒙娜转债	8,754,917.29	0.12
153	127052	西子转债	8,627,197.94	0.12
154	113596	城地转债	8,591,384.55	0.12
155	118038	金宏转债	8,585,906.68	0.12
156	123184	天阳转债	8,583,290.57	0.12

157	113631	皖天转债	8,557,898.84	0.12
158	123194	百洋转债	8,419,695.97	0.11
159	123192	科思转债	8,415,418.83	0.11
160	123213	天源转债	8,401,179.77	0.11
161	128130	景兴转债	8,369,817.42	0.11
162	123174	精锻转债	8,350,434.84	0.11
163	127017	万青转债	8,306,764.25	0.11
164	123215	铭利转债	8,285,698.69	0.11
165	123113	仙乐转债	8,283,700.10	0.11
166	113672	福蓉转债	8,272,366.20	0.11
167	113677	华懋转债	8,258,530.12	0.11
168	123104	卫宁转债	8,243,603.98	0.11
169	127031	洋丰转债	8,135,937.23	0.11
170	113644	艾迪转债	8,092,237.41	0.11
171	113633	科沃转债	8,081,679.35	0.11
172	113673	岱美转债	8,072,416.27	0.11
173	123117	健帆转债	8,048,878.62	0.11
174	113636	甬金转债	8,003,144.69	0.11
175	110084	贵燃转债	7,865,234.85	0.11
176	111007	永和转债	7,826,395.46	0.11
177	113545	金能转债	7,793,214.61	0.11
178	128083	新北转债	7,726,516.49	0.10
179	123114	三角转债	7,718,935.44	0.10
180	123188	水羊转债	7,695,829.04	0.10
181	118000	嘉元转债	7,688,027.99	0.10
182	123170	南电转债	7,640,593.68	0.10
183	123212	立中转债	7,601,316.01	0.10
184	128144	利民转债	7,534,423.52	0.10
185	127015	希望转债	7,515,462.54	0.10
186	128119	龙大转债	7,448,701.76	0.10
187	113640	苏利转债	7,430,654.27	0.10
188	128133	奇正转债	7,429,135.45	0.10
189	127081	中旗转债	7,382,772.51	0.10
190	118027	宏图转债	7,382,541.24	0.10
191	113658	密卫转债	7,249,715.28	0.10
192	128132	交建转债	7,237,956.12	0.10
193	123179	立高转债	7,182,647.81	0.10
194	118003	华兴转债	7,160,272.95	0.10
195	113563	柳药转债	7,147,243.59	0.10
196	128127	文科转债	7,136,393.96	0.10
197	113637	华翔转债	7,062,757.92	0.10
198	118028	会通转债	7,057,034.22	0.10
199	127092	运机转债	7,053,887.30	0.10

200	113634	珀莱转债	7,028,623.11	0.09
201	123035	利德转债	7,028,195.40	0.09
202	123076	强力转债	7,026,871.95	0.09
203	123049	维尔转债	6,920,802.21	0.09
204	113549	白电转债	6,910,583.20	0.09
205	123172	漱玉转债	6,835,993.41	0.09
206	118026	利元转债	6,792,822.99	0.09
207	123120	隆华转债	6,772,163.89	0.09
208	123121	帝尔转债	6,751,464.97	0.09
209	123165	回天转债	6,608,604.89	0.09
210	123146	中环转 2	6,578,003.37	0.09
211	127076	中宠转 2	6,543,303.87	0.09
212	113627	太平转债	6,483,557.89	0.09
213	127019	国城转债	6,463,045.76	0.09
214	113656	嘉诚转债	6,449,683.83	0.09
215	123131	奥飞转债	6,345,297.87	0.09
216	127075	百川转 2	6,332,574.29	0.09
217	113650	博 22 转债	6,302,560.23	0.09
218	128105	长集转债	6,291,575.18	0.08
219	118005	天奈转债	6,250,232.57	0.08
220	123204	金丹转债	6,221,267.31	0.08
221	123182	广联转债	6,184,101.83	0.08
222	127042	嘉美转债	6,084,581.54	0.08
223	113670	金 23 转债	6,014,865.08	0.08
224	111015	东亚转债	6,009,954.11	0.08
225	113653	永 22 转债	5,994,338.72	0.08
226	127033	中装转 2	5,950,645.92	0.08
227	113609	永安转债	5,931,460.14	0.08
228	127068	顺博转债	5,926,598.22	0.08
229	123167	商络转债	5,881,684.68	0.08
230	127014	北方转债	5,875,261.87	0.08
231	111002	特纸转债	5,869,614.57	0.08
232	128074	游族转债	5,824,064.21	0.08
233	111011	冠盛转债	5,814,523.51	0.08
234	123071	天能转债	5,795,628.83	0.08
235	128128	齐翔转 2	5,782,852.92	0.08
236	113651	松霖转债	5,775,309.97	0.08
237	118043	福立转债	5,704,696.86	0.08
238	128142	新乳转债	5,701,660.10	0.08
239	128063	未来转债	5,697,378.88	0.08
240	123133	佩蒂转债	5,680,689.09	0.08
241	127026	超声转债	5,603,623.91	0.08
242	128087	孚日转债	5,567,950.58	0.08

243	113663	新化转债	5,558,393.39	0.08
244	128121	宏川转债	5,552,765.21	0.07
245	123191	智尚转债	5,537,313.88	0.07
246	110074	精达转债	5,533,740.78	0.07
247	123063	大禹转债	5,501,521.03	0.07
248	111004	明新转债	5,438,221.20	0.07
249	113530	大丰转债	5,438,050.44	0.07
250	128124	科华转债	5,431,137.25	0.07
251	123151	康医转债	5,430,184.87	0.07
252	123211	阳谷转债	5,400,174.75	0.07
253	123101	拓斯转债	5,388,638.11	0.07
254	123132	回盛转债	5,382,635.55	0.07
255	111009	盛泰转债	5,369,073.44	0.07
256	123183	海顺转债	5,330,302.53	0.07
257	118032	建龙转债	5,314,210.85	0.07
258	123219	宇瞳转债	5,252,719.08	0.07
259	123078	飞凯转债	5,231,145.25	0.07
260	118041	星球转债	5,223,931.82	0.07
261	127034	绿茵转债	5,184,914.74	0.07
262	111016	神通转债	5,170,810.48	0.07
263	128137	洁美转债	5,153,100.03	0.07
264	127035	濮耐转债	5,148,006.03	0.07
265	127078	优彩转债	5,133,372.76	0.07
266	128116	瑞达转债	5,128,023.82	0.07
267	118033	华特转债	5,092,825.07	0.07
268	113676	荣 23 转债	5,089,290.59	0.07
269	113584	家悦转债	5,068,511.68	0.07
270	118008	海优转债	5,062,669.41	0.07
271	113667	春 23 转债	5,056,005.12	0.07
272	128106	华统转债	5,016,205.35	0.07
273	123096	思创转债	5,012,127.04	0.07
274	127041	弘亚转债	4,993,680.47	0.07
275	110060	天路转债	4,979,772.55	0.07
276	113606	荣泰转债	4,940,997.55	0.07
277	123056	雪榕转债	4,911,428.27	0.07
278	127088	赫达转债	4,892,070.72	0.07
279	113654	永 02 转债	4,884,670.88	0.07
280	128044	岭南转债	4,877,805.34	0.07
281	113542	好客转债	4,869,993.29	0.07
282	111014	李子转债	4,869,137.92	0.07
283	113621	彤程转债	4,832,284.93	0.07
284	123064	万孚转债	4,811,800.64	0.06
285	113625	江山转债	4,780,467.04	0.06

286	123222	博俊转债	4,778,908.02	0.06
287	111001	山玻转债	4,777,904.61	0.06
288	113638	台 21 转债	4,767,321.53	0.06
289	123099	普利转债	4,760,470.08	0.06
290	127055	精装转债	4,751,999.34	0.06
291	127054	双箭转债	4,732,181.79	0.06
292	123147	中辰转债	4,730,125.41	0.06
293	123195	蓝晓转 02	4,689,268.54	0.06
294	113639	华正转债	4,681,724.41	0.06
295	123085	万顺转 2	4,669,773.37	0.06
296	123223	九典转 02	4,660,530.63	0.06
297	113629	泉峰转债	4,655,601.65	0.06
298	111005	富春转债	4,650,105.16	0.06
299	123221	力诺转债	4,643,269.61	0.06
300	127069	小熊转债	4,642,888.27	0.06
301	123217	富仕转债	4,621,906.87	0.06
302	123122	富瀚转债	4,601,970.59	0.06
303	127060	湘佳转债	4,575,552.09	0.06
304	123193	海能转债	4,543,774.26	0.06
305	123144	裕兴转债	4,531,888.37	0.06
306	113589	天创转债	4,521,473.08	0.06
307	127053	豪美转债	4,479,110.21	0.06
308	123091	长海转债	4,452,112.00	0.06
309	113569	科达转债	4,391,831.84	0.06
310	127077	华宏转债	4,374,407.67	0.06
311	113643	风语转债	4,362,160.06	0.06
312	123205	大叶转债	4,361,892.34	0.06
313	118020	芳源转债	4,359,632.38	0.06
314	123162	东杰转债	4,342,773.46	0.06
315	123127	耐普转债	4,334,651.62	0.06
316	123224	宇邦转债	4,324,528.43	0.06
317	113649	丰山转债	4,319,304.33	0.06
318	123186	志特转债	4,305,442.05	0.06
319	127051	博杰转债	4,262,484.55	0.06
320	118004	博瑞转债	4,256,059.08	0.06
321	127071	天箭转债	4,226,697.79	0.06
322	113662	豪能转债	4,218,449.42	0.06
323	123142	申昊转债	4,211,869.26	0.06
324	127072	博实转债	4,211,832.16	0.06
325	123187	超达转债	4,198,000.14	0.06
326	118037	上声转债	4,170,590.08	0.06
327	118012	微芯转债	4,137,908.78	0.06
328	123090	三诺转债	4,069,518.32	0.05

329	113579	健友转债	4,065,296.55	0.05
330	123157	科蓝转债	4,060,870.25	0.05
331	113532	海环转债	4,051,507.11	0.05
332	113664	大元转债	4,029,131.99	0.05
333	123154	火星转债	4,016,067.08	0.05
334	123092	天壕转债	3,995,444.61	0.05
335	127090	兴瑞转债	3,957,760.41	0.05
336	123168	惠云转债	3,954,882.05	0.05
337	118021	新致转债	3,928,390.97	0.05
338	123200	海泰转债	3,916,069.22	0.05
339	123202	祥源转债	3,915,309.03	0.05
340	113588	润达转债	3,912,381.92	0.05
341	123082	北陆转债	3,908,775.20	0.05
342	118035	国力转债	3,884,641.61	0.05
343	123124	晶瑞转 2	3,869,488.91	0.05
344	128095	恩捷转债	3,863,022.65	0.05
345	118044	赛特转债	3,845,009.84	0.05
346	128066	亚泰转债	3,844,536.95	0.05
347	123109	昌红转债	3,841,224.27	0.05
348	113657	再 22 转债	3,837,208.42	0.05
349	113668	鹿山转债	3,817,647.31	0.05
350	113618	美诺转债	3,816,591.78	0.05
351	113674	华设转债	3,810,274.27	0.05
352	113601	塞力转债	3,803,105.93	0.05
353	118011	银微转债	3,776,644.71	0.05
354	123203	明电转 02	3,765,852.02	0.05
355	127028	英特转债	3,758,470.96	0.05
356	113628	晨丰转债	3,756,594.93	0.05
357	127087	星帅转 2	3,751,314.25	0.05
358	113600	新星转债	3,741,960.66	0.05
359	128097	奥佳转债	3,733,392.26	0.05
360	113582	火炬转债	3,727,629.65	0.05
361	123198	金埔转债	3,720,618.92	0.05
362	118014	高测转债	3,699,168.44	0.05
363	111008	沿浦转债	3,668,051.41	0.05
364	128125	华阳转债	3,664,270.73	0.05
365	123059	银信转债	3,661,080.95	0.05
366	123214	东宝转债	3,638,720.50	0.05
367	128138	侨银转债	3,633,091.53	0.05
368	113610	灵康转债	3,607,297.57	0.05
369	123025	精测转债	3,606,543.12	0.05
370	123197	光力转债	3,562,633.31	0.05
371	118040	宏微转债	3,549,120.28	0.05

372	123087	明电转债	3,528,066.59	0.05
373	123050	聚飞转债	3,527,613.31	0.05
374	128042	凯中转债	3,523,773.40	0.05
375	123010	博世转债	3,511,926.18	0.05
376	123207	冠中转债	3,481,895.01	0.05
377	118015	芯海转债	3,431,201.68	0.05
378	113593	沪工转债	3,383,245.18	0.05
379	118039	煜邦转债	3,370,813.15	0.05
380	123201	纽泰转债	3,359,934.25	0.05
381	113660	寿 22 转债	3,355,608.53	0.05
382	113608	威派转债	3,349,374.51	0.05
383	118009	华锐转债	3,334,910.57	0.05
384	123156	博汇转债	3,320,489.55	0.04
385	111013	新港转债	3,316,348.77	0.04
386	127080	声迅转债	3,307,334.09	0.04
387	118029	富淼转债	3,303,793.22	0.04
388	113624	正川转债	3,294,756.98	0.04
389	118010	洁特转债	3,274,534.67	0.04
390	118018	瑞科转债	3,270,384.26	0.04
391	113534	鼎胜转债	3,270,161.22	0.04
392	123130	设研转债	3,249,359.58	0.04
393	118036	力合转债	3,211,463.16	0.04
394	123048	应急转债	3,208,333.96	0.04
395	123218	宏昌转债	3,183,104.48	0.04
396	118006	阿拉转债	3,158,321.18	0.04
397	127062	垒知转债	3,155,308.76	0.04
398	123100	朗科转债	3,154,373.75	0.04
399	128123	国光转债	3,102,501.00	0.04
400	127059	永东转 2	3,091,504.42	0.04
401	123143	胜蓝转债	3,073,433.88	0.04
402	128117	道恩转债	3,063,869.12	0.04
403	123175	百畅转债	3,013,449.78	0.04
404	123199	山河转债	3,000,898.78	0.04
405	127007	湖广转债	2,998,031.34	0.04
406	113671	武进转债	2,962,011.92	0.04
407	123118	惠城转债	2,960,044.05	0.04
408	123171	共同转债	2,931,709.50	0.04
409	127079	华亚转债	2,889,977.44	0.04
410	128090	汽模转 2	2,875,322.06	0.04
411	123126	瑞丰转债	2,856,666.28	0.04
412	123160	泰福转债	2,855,378.46	0.04
413	111012	福新转债	2,855,336.27	0.04
414	123141	宏丰转债	2,838,781.33	0.04

415	123196	正元转 02	2,834,183.24	0.04
416	113524	奇精转债	2,829,778.88	0.04
417	123153	英力转债	2,793,074.84	0.04
418	113597	佳力转债	2,777,982.16	0.04
419	118045	盟升转债	2,726,139.11	0.04
420	123106	正丹转债	2,710,248.90	0.04
421	123155	中陆转债	2,709,008.38	0.04
422	123185	能辉转债	2,704,446.60	0.04
423	110055	伊力转债	2,700,089.15	0.04
424	113665	汇通转债	2,668,933.24	0.04
425	113598	法兰转债	2,654,430.48	0.04
426	123152	润禾转债	2,636,811.25	0.04
427	113030	东风转债	2,634,914.04	0.04
428	113039	嘉泽转债	2,623,726.47	0.04
429	123088	威唐转债	2,614,434.26	0.04
430	123089	九洲转 2	2,607,372.84	0.04
431	113527	维格转债	2,580,856.95	0.03
432	123163	金沃转债	2,577,125.66	0.03
433	123220	易瑞转债	2,552,435.95	0.03
434	123180	浙矿转债	2,538,391.30	0.03
435	128122	兴森转债	2,528,441.06	0.03
436	128072	翔鹭转债	2,516,025.74	0.03
437	128101	联创转债	2,485,259.61	0.03
438	113574	华体转债	2,476,382.31	0.03
439	110058	永鼎转债	2,465,382.42	0.03
440	128118	瀛通转债	2,465,241.21	0.03
441	113027	华钰转债	2,462,340.50	0.03
442	128071	合兴转债	2,452,441.08	0.03
443	110052	贵广转债	2,450,671.62	0.03
444	113573	纵横转债	2,442,766.62	0.03
445	123166	蒙泰转债	2,410,093.77	0.03
446	123189	晓鸣转债	2,392,931.58	0.03
447	118016	京源转债	2,370,885.41	0.03
448	123159	崧盛转债	2,368,035.81	0.03
449	123138	丝路转债	2,361,253.42	0.03
450	123177	测绘转债	2,347,327.96	0.03
451	123206	开能转债	2,314,916.38	0.03
452	128070	智能转债	2,270,449.74	0.03
453	123022	长信转债	2,265,434.25	0.03
454	123061	航新转债	2,265,369.29	0.03
455	113546	迪贝转债	2,193,405.92	0.03
456	123112	万讯转债	2,193,086.07	0.03
457	123093	金陵转债	2,187,158.71	0.03

458	123173	恒锋转债	2,165,954.27	0.03
459	123011	德尔转债	2,157,128.03	0.03
460	123135	泰林转债	2,146,001.39	0.03
461	123067	斯莱转债	2,110,564.38	0.03
462	118007	山石转债	2,084,226.82	0.03
463	123209	聚隆转债	2,012,329.31	0.03
464	123103	震安转债	2,001,806.33	0.03
465	128076	金轮转债	1,985,070.82	0.03
466	123054	思特转债	1,924,631.65	0.03
467	113519	长久转债	1,922,690.86	0.03
468	123039	开润转债	1,918,557.51	0.03
469	123129	锦鸡转债	1,905,253.81	0.03
470	128082	华锋转债	1,904,511.65	0.03
471	113565	宏辉转债	1,875,903.49	0.03
472	123065	宝莱转债	1,875,118.70	0.03
473	128143	锋龙转债	1,818,241.84	0.02
474	110070	凌钢转债	1,796,177.85	0.02
475	128049	华源转债	1,788,632.81	0.02
476	128039	三力转债	1,643,731.87	0.02
477	123080	海波转债	1,387,037.30	0.02
478	113594	淳中转债	1,347,345.13	0.02
479	113537	文灿转债	160,470.49	0.00
480	113577	春秋转债	142,256.70	0.00

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	573,486,670.00
报告期期间基金总申购份额	154,800,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	48,100,000.00
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	680,186,670.00

§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 3 月 31 日，博时基金公司共管理 372 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 15475 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 5694 亿元人民币，累计分红逾 1971 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
二〇二四年四月二十二日