

**博时转债增强债券型证券投资基金**  
**2023 年第 3 季度报告**  
**2023 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：中国光大银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年十月二十五日

## §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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 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 2023 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	博时转债增强债券
基金主代码	050019
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 11 月 24 日
报告期末基金份额总额	841,502,069.27 份
投资目标	通过自上而下的分析对固定收益类资产和权益类资产进行配置，并充分利用可转换债券兼具权益类证券与固定收益类证券的特性，实施对大类资产的配置，在控制风险并保持良好流动性的基础上，追求超越业绩比较基准的超额收益。
投资策略	本基金主要投资策略包括：（1）类属资产配置策略，主要通过自上而下的宏观分析，结合量化的经济指标综合判断经济周期的运行方向，决定类属资产的投资比例；（2）固定收益类资产投资策略，本基金灵活应用各种期限结构策略、信用策略、互换策略、息差策略和资产支持证券策略等，在合理管理并控制组合风险的前提下，为组合增加最大的收益；（3）可转债投资策略，在分析宏观经济运行特征并对各类市场大势做出判断的前提下，本基金着重对可转债所对应的基础股票进行分析和研究，从行业选择和个券选择两方面进行全方位的评估，对盈利能力或成长性较好的行业和上市公司的可转债进行重点关注，并结合博时可转债评级系统对可转债投资价值进行有效的评估，选择投资价值较高的个券进行投资；（4）权益类品种投资策略，本产品在大类资产配置下，通过对股票基本面的分析来精选个股。分析主要包括股票的价值和成长性指标。价值投资的核心思想是寻找市场上被低估的股票，具体

	指标包括：市盈率、市净率、市销率、股息收益率等。成长股的重要评估指标是考察公司的成长性，具体指标包括：预期净利润增长率、中长期净利润增长率、内部成长率及历史增长率等。	
业绩比较基准	中证综合债指数收益率	
风险收益特征	本基金为债券型基金，债券型基金的风险高于货币市场基金，低于混合型和股票型基金，属于中低收益/风险的品种。	
基金管理人	博时基金管理有限公司	
基金托管人	中国光大银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	博时转债增强债券 A	博时转债增强债券 C
下属分级基金的交易代码	050019	050119
报告期末下属分级基金的份额总额	673,564,815.83 份	167,937,253.44 份

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2023 年 7 月 1 日-2023 年 9 月 30 日)	
	博时转债增强债券 A	博时转债增强债券 C
1.本期已实现收益	-44,261,232.97	-12,418,239.62
2.本期利润	-76,150,481.44	-23,081,812.57
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1051	-0.1127
4.期末基金资产净值	1,162,119,436.01	279,172,340.29
5.期末基金份额净值	1.725	1.662

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

###### 1. 博时转债增强债券A:

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	-6.05%	0.62%	0.69%	0.05%	-6.74%	0.57%
过去六个月	-9.02%	0.66%	2.49%	0.05%	-11.51%	0.61%
过去一年	-10.62%	0.81%	3.39%	0.05%	-14.01%	0.76%

过去三年	-0.23%	1.00%	13.82%	0.05%	-14.05%	0.95%
过去五年	43.99%	1.06%	24.32%	0.06%	19.67%	1.00%
自基金合同生效起至今	73.04%	1.15%	73.89%	0.07%	-0.85%	1.08%

**2. 博时转债增强债券C:**

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	-6.10%	0.63%	0.69%	0.05%	-6.79%	0.58%
过去六个月	-9.18%	0.66%	2.49%	0.05%	-11.67%	0.61%
过去一年	-10.98%	0.81%	3.39%	0.05%	-14.37%	0.76%
过去三年	-1.42%	1.00%	13.82%	0.05%	-15.24%	0.95%
过去五年	41.33%	1.06%	24.32%	0.06%	17.01%	1.00%
自基金合同生效起至今	66.62%	1.15%	73.89%	0.07%	-7.27%	1.08%

**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**

**1. 博时转债增强债券A:**



**2. 博时转债增强债券C:**



## §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		
过钧	首席基金经理/基金经理	2023-09-15	-	22.2	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)的基金经理。
邓欣雨	混合资产投资部投资总监助理/基金经理	2019-04-25	-	15.2	邓欣雨先生，硕士。2008年硕士研究生毕业后加入博时基金管理有限公司。历任固定收益研究员、固定收益研究员兼基金经理助理、博时聚瑞纯债债券型证券投资基金(2016年5月26日-2017年11月8日)、博时富祥纯债债券型证券投资基金(2016年11月10日-2017年11月16日)、博时聚利纯债债券型证券投资基金(2016年9月18日-2017年11月22日)、博时兴盛货币市场基金(2016年12月21日-2017年12月29日)、博时泰和债券型证券投资基金(2016年5月25日-2018年3月9日)、博时兴荣货币市场基金(2017年2月24日-2018年3月19日)、博时悦楚纯债债券型证券投资基金

				<p>(2016 年 9 月 9 日-2018 年 4 月 9 日)、博时双债增强债券型证券投资基金(2015 年 7 月 16 日-2018 年 5 月 5 日)、博时慧选纯债债券型证券投资基金(2016 年 12 月 19 日-2018 年 7 月 30 日)、博时慧选纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金(2018 年 7 月 30 日-2018 年 8 月 9 日)、博时利发纯债债券型证券投资基金(2016 年 9 月 7 日-2018 年 11 月 6 日)、博时景发纯债债券型证券投资基金(2016 年 8 月 3 日-2018 年 11 月 19 日)、博时转债增强债券型证券投资基金(2013 年 9 月 25 日-2019 年 1 月 28 日)、博时富元纯债债券型证券投资基金(2017 年 2 月 16 日-2019 年 2 月 25 日)、博时裕利纯债债券型证券投资基金(2016 年 5 月 9 日-2019 年 3 月 4 日)、博时聚盈纯债债券型证券投资基金(2016 年 7 月 27 日-2019 年 3 月 4 日)、博时聚润纯债债券型证券投资基金(2016 年 8 月 30 日-2019 年 3 月 4 日)、博时富发纯债债券型证券投资基金(2016 年 9 月 7 日-2019 年 3 月 4 日)、博时富诚纯债债券型证券投资基金(2017 年 3 月 17 日-2019 年 3 月 4 日)、博时富和纯债债券型证券投资基金(2017 年 8 月 30 日-2019 年 3 月 4 日)、博时稳悦 63 个月定期开放债券型证券投资基金(2020 年 1 月 13 日-2021 年 2 月 25 日)的基金经理、固定收益总部指数与创新组投资总监助理、博时恒兴一年定期开放混合型证券投资基金(2021 年 12 月 9 日-2023 年 6 月 27 日)基金经理。现任混合资产投资部投资总监助理兼博时稳健回报债券型证券投资基金(LOF)(2018 年 4 月 23 日—至今)、博时转债增强债券型证券投资基金(2019 年 4 月 25 日—至今)、博时稳定价值债券投资基金(2020 年 2 月 24 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(2020 年 3 月 6 日—至今)、博时鑫荣稳健混合型证券投资基金(2021 年 12 月 9 日—至今)、博时恒瑞混合型证券投资基金(2022 年 2 月 24 日—至今)、博时恒享债券型证券投资基</p>
--	--	--	--	---

					金(2023 年 3 月 30 日—至今)、博时稳健 增利债券型证券投资基金(2023 年 6 月 20 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。管理人于 2023 年 10 月 21 日发布公告称，聘任高晖先生担任本基金基金经理，与过钧先生共同担任本基金基金经理，邓欣雨先生不再担任本基金基金经理。

## 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 61 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

三季度债券市场受美债利率上行、财政托底经济、杠杆盘去化等诸多利空因素影响，收益率先下后上，10 年期国债收益率在突破本轮下行低点 2.6% 后，快速上行，整个季度 10 年期国债收益率小幅上行 4bp。股市方面在 7 月末政治局会议“活跃资本市场，提振投资者信心”的积极定调后，一系列针对房地产和资本市场的稳增长政策陆续推出，市场一度走出超跌反弹行情，成交量有所放大。但受累于短期基本面数据羸弱、稳增长政策效果仍待观察、北向资金大幅流出等原因，市场再度转向低迷，进入探寻市场底阶段。整个季度万得全 A 指数收跌 4.33%，大部分宽基、行业指数均表现不佳，微盘与红利风格逆市走强。在中性的债市和偏弱的股市环境下，转债市场冲高回落，波动较上季度有所增加，整体仍处于横盘震荡状况，机会更依赖正股所处行业结构选择和个券挖掘。组合本季度可转债维持高仓位，止盈了部分高价标的；股票仓位维持在偏高区间，主要配置在通信、计算机、有色、非银、电力设备板块，较上季度末增配了金融。



展望后市，8 月财新 PMI、9 月制造业 PMI 重回扩张区间，8 月社融、固定资产投资、社零等多项经济和金融数据向好，CPI 与 PPI 读数也显示价格底部基本确认，预示企业被动去库存阶段接近尾声。此外，由于去年同期的基数较低，随着外需恢复，四季度出口增速也有望回升。房地产投资仍是上半年经济增长的最大掣肘，随着房地产总量政策与因城施策的不断优化，房地产销售面积同比负增长有望收窄，对经济的拖累作用也将显著降低。因此，本轮经济拐点有望在三季度得到确认，但复苏斜率仍然取决于地产销售面积的恢复速度，以及对未来若干年地产销售面积的中枢判断。在房贷利率仍有下行空间的大背景下，我们判断后续长端利率上行的空间也较为有限，目前制约债市的利空因素尚未消除，暂时没有太大的机会。权益市场方面，补库周期带来需求边际改善、价格上行，全 A 非金融、石油石化的盈利增速拐点也有望在三季度出现，政策底、经济底、市场底依次得到验证，以沪深 300 为代表的权重指数或将迎来基本面带动的反弹。可转债市场的问题在于偏高估值，在权益上行趋势并不强的环境下，可转债的参与难度不低，策略上可以跟随权益市场风格积极挖掘个券和做板块贝塔机会，适度加强交易。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 09 月 30 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.725 元，份额累计净值为 1.730 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.662 元，份额累计净值为 1.666 元，报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为-6.05%，本基金 C 类基金份额净值增长率为-6.10%，同期业绩基准增长率为 0.69%。

#### 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	225,192,643.57	13.17
	其中：股票	225,192,643.57	13.17
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,444,352,625.65	84.48
	其中：债券	1,444,352,625.65	84.48
	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	-	-

	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	36,381,890.26	2.13
8	其他各项资产	3,805,428.42	0.22
9	合计	1,709,732,587.90	100.00

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	11,584,150.00	0.80
C	制造业	113,051,155.40	7.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	17,531,492.00	1.22
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	49,744,546.05	3.45
J	金融业	33,281,300.12	2.31
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	225,192,643.57	15.62

## 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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600498	烽火通信	1,229,200	24,030,860.00	1.67
2	002929	润建股份	593,483	22,166,590.05	1.54
3	000060	中金岭南	4,210,400	21,641,456.00	1.50
4	601390	中国中铁	2,570,600	17,531,492.00	1.22
5	301339	通行宝	778,800	16,331,436.00	1.13
6	600030	中信证券	655,500	14,198,130.00	0.99
7	603081	大丰实业	966,000	12,886,440.00	0.89
8	601881	中国银河	1,152,188	12,662,546.12	0.88
9	601899	紫金矿业	955,000	11,584,150.00	0.80
10	002230	科大讯飞	222,000	11,246,520.00	0.78

#### 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	87,463,676.85	6.07
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）	1,356,888,948.80	94.14
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,444,352,625.65	100.21

#### 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	110062	烽火转债	666,430	82,328,206.03	5.71
2	110068	龙净转债	467,630	74,048,249.62	5.14
3	132018	G 三峡 EB1	452,600	66,668,786.00	4.63
4	127020	中金转债	425,802	55,763,029.92	3.87
5	127058	科伦转债	282,610	52,029,267.53	3.61

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.9 报告期末本基金投资的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，财通证券股份有限公司在报告编制前一年受到国家外汇管理局浙江省分局的处罚。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的处罚。福建龙净环保股份有限公司在报告期内被中国证券监督管理委员会的立案调查。在报告编制前一年受到中国证券监督管理委员会福建监管局的处罚。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	373,037.05
2	应收证券清算款	3,387,280.97
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	45,110.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,805,428.42

### 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	110062	烽火转债	82,328,206.03	5.71
2	110068	龙净转债	74,048,249.62	5.14
3	132018	G 三峡 EB1	66,668,786.00	4.63
4	127020	中金转债	55,763,029.92	3.87
5	127058	科伦转债	52,029,267.53	3.61
6	113050	南银转债	50,033,770.24	3.47
7	123107	温氏转债	49,671,068.49	3.45

8	113043	财通转债	45,119,178.08	3.13
9	113643	风语转债	37,352,614.29	2.59
10	111010	立昂转债	37,317,039.91	2.59
11	127005	长证转债	37,224,639.62	2.58
12	127061	美锦转债	37,017,268.48	2.57
13	110085	通 22 转债	36,445,290.10	2.53
14	113061	拓普转债	36,189,317.68	2.51
15	123158	宙邦转债	34,603,937.80	2.40
16	118023	广大转债	31,567,246.13	2.19
17	127006	敖东转债	31,066,902.97	2.16
18	110083	苏租转债	29,237,636.46	2.03
19	127043	川恒转债	28,286,345.30	1.96
20	127073	天赐转债	24,382,924.94	1.69
21	113055	成银转债	22,809,025.45	1.58
22	123164	法本转债	22,319,071.70	1.55
23	110067	华安转债	22,120,167.43	1.53
24	127056	中特转债	21,582,928.10	1.50
25	123114	三角转债	21,523,241.11	1.49
26	127074	麦米转 2	20,557,619.93	1.43
27	127045	牧原转债	19,673,545.67	1.36
28	123157	科蓝转债	19,536,573.31	1.36
29	128132	交建转债	18,799,530.21	1.30
30	113594	淳中转债	17,180,655.09	1.19
31	118019	金盘转债	14,765,031.44	1.02
32	113641	华友转债	14,436,262.88	1.00
33	127029	中钢转债	13,541,953.67	0.94
34	123121	帝尔转债	13,113,811.97	0.91
35	113662	豪能转债	11,664,144.68	0.81
36	127049	希望转 2	11,017,636.08	0.76
37	113060	浙 22 转债	11,017,536.27	0.76
38	118032	建龙转债	10,977,410.82	0.76
39	123122	富瀚转债	10,563,467.82	0.73
40	113647	禾丰转债	10,544,333.72	0.73
41	110061	川投转债	10,146,564.11	0.70
42	127027	能化转债	10,028,159.34	0.70
43	128141	旺能转债	9,381,776.63	0.65
44	118033	华特转债	8,752,853.18	0.61
45	113661	福 22 转债	8,701,452.71	0.60
46	118020	芳源转债	8,378,099.20	0.58
47	127014	北方转债	8,025,699.25	0.56
48	127063	贵轮转债	7,036,286.63	0.49
49	123120	隆华转债	3,449,854.42	0.24
50	113059	福莱转债	1,721,737.72	0.12

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 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

项目	博时转债增强债券A	博时转债增强债券C
本报告期期初基金份额总额	831,565,519.43	237,067,202.80
报告期期间基金总申购份额	64,828,164.40	8,562,215.04
减：报告期期间基金总赎回份额	222,828,868.00	77,692,164.40
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	673,564,815.83	167,937,253.44

## §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 2023 年 9 月 30 日，博时基金公司共管理 356 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 14570 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 5106 亿元人民币，累计

分红逾 1884 亿元人民币，是目前我国资产管理规模最大的基金公司之一。

## §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转债增强债券型证券投资基金设立的文件
- 2、《博时转债增强债券型证券投资基金基金合同》
- 3、《博时转债增强债券型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、博时转债增强债券型证券投资基金各年度审计报告正本
- 6、报告期内博时转债增强债券型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

二〇二三年十月二十五日