博时转债增强债券型证券投资基金

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：中国光大银行股份有限公司

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。

基金托管人中国光大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

2.1 基金基本情况

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	864,088,340.65 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	中证可转债及可交换债券指数收益率*95%+活期存款基准利率*5%		
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	博时转债增强债券 E
下属分级基金的交易代码	050019	050119	023165
报告期末下属分级基金的份额总额	296,417,788.13 份	150,635,869.36 份	417,034,683.16 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 (2026 年 7 月 1 日-2026 年 9 月 30 日)

	博时转债增强债券 A	博时转债增强债券 C	博时转债增强债券 E
1.本期已实现收益	18,401,055.71	8,249,037.75	25,997,775.80
2.本期利润	-70,072,267.80	-33,604,476.97	-90,534,579.80
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2285	-0.2219	-0.1963
4.期末基金资产净值	690,200,546.17	333,949,584.52	970,871,070.97
5.期末基金份额净值	2.3285	2.2169	2.3280

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	-8.82%	1.41%	-1.72%	0.18%	-7.10%	1.23%
过去六个月	1.69%	1.46%	-0.54%	0.14%	2.23%	1.32%
过去一年	3.11%	1.40%	0.82%	0.11%	2.29%	1.29%
过去三年	34.99%	1.27%	10.39%	0.10%	24.60%	1.17%
过去五年	8.81%	1.13%	19.45%	0.08%	-10.64%	1.05%
过去七年	67.52%	1.17%	29.38%	0.08%	38.14%	1.09%
过去十年	67.40%	1.06%	43.03%	0.07%	24.37%	0.99%
自基金合同生效起至今	133.58%	1.18%	91.96%	0.08%	41.62%	1.10%

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	-8.91%	1.41%	-1.72%	0.18%	-7.19%	1.23%
过去六个月	1.48%	1.46%	-0.54%	0.14%	2.02%	1.32%
过去一年	2.70%	1.40%	0.82%	0.11%	1.88%	1.29%
过去三年	33.39%	1.27%	10.39%	0.10%	23.00%	1.17%

过去五年	6.68%	1.13%	19.45%	0.08%	-12.77%	1.05%
过去七年	62.89%	1.17%	29.38%	0.08%	33.51%	1.09%
过去十年	61.23%	1.07%	43.03%	0.07%	18.20%	1.00%
自基金合同生效起至今	122.25%	1.18%	91.96%	0.08%	30.29%	1.10%

3．博时转债增强债券E：

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	-8.82%	1.41%	-1.72%	0.18%	-7.10%	1.23%
过去六个月	1.68%	1.46%	-0.54%	0.14%	2.22%	1.32%
过去一年	3.10%	1.40%	0.82%	0.11%	2.28%	1.29%
自基金合同生效起至今	33.04%	1.33%	0.70%	0.10%	32.34%	1.23%

注：自 2026 年 9 月 21 日起，本基金业绩比较基准由“中证综合债指数收益率”调整为“中证可转债及可交换债券指数收益率*95%+活期存款基准利率*5%”。基金业绩比较基准收益率在调整前后期间分别根据相应的指标计算。

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：



3．博时转债增强债券E：



§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，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 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。

本基金为可转债主题基金，三季度保持了较高的转债和股票仓位，期间净值表现跑输可转债等权指数。组合仍坚持采用哑铃型配置策略，一端关注经营稳定、现金流充裕且股东回报具有持续性的公用事业，以及具有独立宏观逻辑的贵金属方向；另一端关注人工智能、国产半导体、航空发动机及燃气轮机产业链，以及具备成本优势和竞争壁垒的出海型企业。防御端重视分红能力与估值约束，成长端重视订单兑现、收入确认和盈利转化，避免将产业趋势直接等同于上市公司盈利。行业配置保持适度均衡，个券选择聚焦竞争优势与风险收益比，兼顾偏股型转债的权益弹性和平衡型转债的回撤缓冲。组合管理以基本面研究为核心，综合评估正股估值、转股溢价率、纯债价值、剩余期限与信用资质。对高价及高溢价品种，将潜在上涨空间与回撤、强赎风险一并衡量，股票投资则侧重基本面与估值相匹配的机会，适当平衡转债资产的行业局限性。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2026 年 09 月 30 日，本基金 A 类基金份额净值为 2.3285 元，份额累计净值为 2.3335 元，本基金 C 类基金份额净值为 2.2169 元，份额累计净值为 2.2209 元，本基金 E 类基金份额净值为 2.3280 元，份额累计净值为 2.3280 元，报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为-8.82%，本基金 C 类基金份额净值增长率为-8.91%，本基金 E 类基金份额净值增长率为-8.82%，同期业绩基准增长率为-1.72%。

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	391,649,095.61	16.81
	其中：股票	391,649,095.61	16.81
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,873,321,819.95	80.42
	其中：债券	1,873,321,819.95	80.42
	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	46,642,724.73	2.00
8	其他资产	17,879,036.15	0.77
9	合计	2,329,492,676.44	100.00

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

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	55,724,351.07	2.79
C	制造业	268,784,656.79	13.47

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	20,878,167.36	1.05
E	建筑业	-	-
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	-	-
J	金融业	26,539,467.94	1.33
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	9,645,210.45	0.48
N	水利、环境和公共设施管理业	10,077,242.00	0.51
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	391,649,095.61	19.63

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

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	001288	运机集团	763,254	23,905,115.28	1.20
2	603979	金诚信	228,000	16,479,840.00	0.83
3	601108	财通证券	1,991,584	16,231,409.60	0.81
4	002422	科伦药业	394,371	16,110,055.35	0.81
5	603733	仙鹤股份	903,821	16,033,784.54	0.80
6	300843	胜蓝股份	133,400	15,982,654.00	0.80
7	600160	巨化股份	423,000	14,013,990.00	0.70
8	688041	海光信息	60,494	13,720,039.20	0.69
9	300483	首华燃气	584,791	13,385,865.99	0.67

10	603678	火炬电子	309,100	13,204,752.00	0.66

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	104,523,878.46	5.24
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）	1,768,797,941.49	88.66
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,873,321,819.95	93.90

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	019846	26 国债 14	1,044,000	104,523,878.46	5.24
2	113052	兴业转债	822,680	93,112,094.44	4.67
3	113056	重银转债	722,000	90,489,743.56	4.54
4	110099	福能转债	622,520	90,013,117.38	4.51
5	127110	广核转债	655,416	89,486,334.71	4.49

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，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。四川省自贡运输机械集团股份有限公司在报告编制前一年受到宿松县市场监督管理局的处罚。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 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约定备选股票库之外的股票。本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	600,481.36
2	应收证券清算款	16,395,652.24
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	882,902.55
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	17,879,036.15

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	113052	兴业转债	93,112,094.44	4.67
2	113056	重银转债	90,489,743.56	4.54
3	110099	福能转债	90,013,117.38	4.51
4	127110	广核转债	89,486,334.71	4.49
5	118030	睿创转债	80,949,160.39	4.06
6	127092	运机转债	71,154,275.13	3.57
7	113067	燃 23 转债	65,763,610.92	3.30
8	127049	希望转 2	62,064,668.78	3.11
9	127083	山路转债	61,703,852.06	3.09
10	113066	平煤转债	44,303,594.60	2.22
11	127056	中特转债	42,436,759.77	2.13
12	111002	特纸转债	41,558,637.23	2.08
13	127078	优彩转债	41,101,982.48	2.06
14	113677	华懋转债	40,380,189.66	2.02
15	118051	皓元转债	40,164,532.16	2.01
16	118060	瑞可转债	40,149,258.40	2.01
17	113691	和邦转债	32,288,846.05	1.62
18	127104	姚记转债	32,287,602.80	1.62
19	123262	神宇转债	32,039,678.91	1.61
20	123247	万凯转债	31,606,153.34	1.58

21	123142	申昊转债	31,026,914.64	1.56
22	123158	宙邦转债	29,851,841.35	1.50
23	118050	航宇转债	29,172,673.05	1.46
24	123131	奥飞转债	28,985,379.03	1.45
25	123255	鼎龙转债	28,506,496.94	1.43
26	123176	精测转 2	27,241,519.14	1.37
27	118058	微导转债	26,255,705.81	1.32
28	118039	煜邦转债	24,402,577.08	1.22
29	123187	超达转债	24,100,346.41	1.21
30	123266	博士转债	22,729,810.08	1.14
31	118064	联瑞转债	22,305,787.69	1.12
32	113698	凯众转债	22,299,327.17	1.12
33	118061	茂莱转债	21,949,154.14	1.10
34	113643	风语转债	21,116,184.74	1.06
35	118013	道通转债	20,733,614.82	1.04
36	113673	岱美转债	20,724,930.55	1.04
37	127088	赫达转债	20,267,609.25	1.02
38	123150	九强转债	19,698,651.92	0.99
39	118062	天准转债	19,685,630.05	0.99
40	123207	冠中转债	18,968,987.26	0.95
41	123261	普联转债	16,651,411.13	0.83
42	118052	浩瀚转债	16,639,319.08	0.83
43	118007	山石转债	16,239,114.29	0.81
44	123160	泰福转债	16,218,781.20	0.81
45	113646	永吉转债	15,993,301.75	0.80
46	123209	聚隆转债	11,765,905.69	0.59
47	113694	清源转债	10,585,553.67	0.53
48	127047	帝欧转债	10,487,443.25	0.53
49	118035	国力转债	10,290,775.64	0.52

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	博时转债增强债券E
本报告期期初基金份额总额	329,683,680.69	160,376,788.31	458,996,606.41
报告期期间基金总申购份额	11,614,257.18	13,038,204.60	194,912,304.50
减：报告期期间基金总赎回份额	44,880,149.74	22,779,123.55	236,874,227.75
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	296,417,788.13	150,635,869.36	417,034,683.16

§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

二〇二六年十月二十七日