

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
2022年第3季度报告
2022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：二〇二二年十月二十六日

§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 2022 年 10 月 24 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 2022 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
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	106,886,670.00 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	本基金的业绩比较基准为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 (2022 年 7 月 1 日-2022 年 9 月 30 日)
1.本期已实现收益	4,124,783.19
2.本期利润	-41,514,517.49
3.加权平均基金份额本期利润	-0.5212
4.期末基金资产净值	1,206,142,868.12
5.期末基金份额净值	11.2843

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。

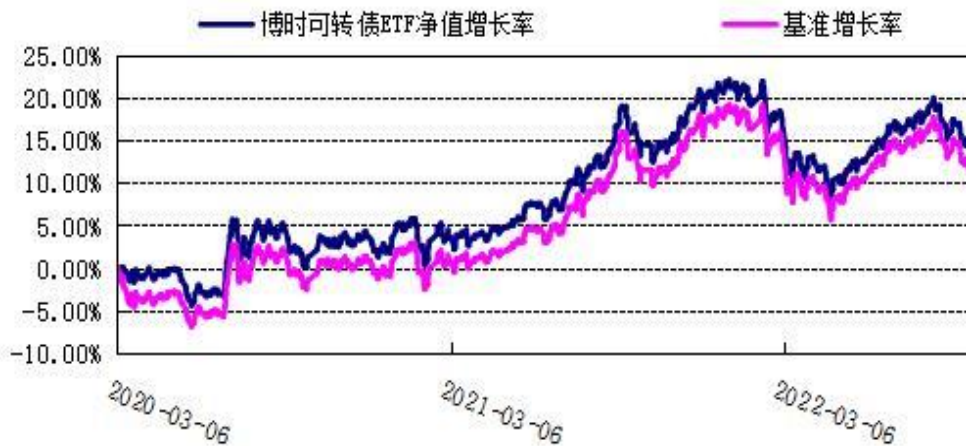
所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-3.17%	0.44%	-3.44%	0.44%	0.27%	0.00%
过去六个月	0.83%	0.49%	0.95%	0.49%	-0.12%	0.00%
过去一年	-1.53%	0.60%	-0.98%	0.60%	-0.55%	0.00%
自基金合同生 效起至今	12.84%	0.58%	10.53%	0.58%	2.31%	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		
邓欣雨	混合资产投资部投资总监助理/基金经理	2020-03-06	-	14.2	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(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。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)、博时恒兴一年定期开放混合型证券投资基金(2021 年 12 月 9 日—至今)、博时恒瑞一年封闭运作混合型证券投资基金(2022 年 2 月 24 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 25 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

三季度权益资产集体表现不佳，国内基本处于持续下行中，而海外美国则走出了“过山车”行情。国内主要股票指数跌幅均在 10% 以上，创业板指跌超 18%，沪深 300 跌超 15%，季度初基本上就是高点。中证转债及可交债指数经历缓慢上涨后于后半季度快速调整，单季度下跌 3.44%。除了国内对复苏强度的修正外，调整主要受高通胀下美联储激进加息影响，美元指数超强势和美债收益率大幅快速上行给全球风险资产带来极大压力。海外控通胀重于防衰退，美联储难在真实衰退出现前停止加息紧缩，不能过早交易衰退宽松。不过美国通胀很大可能已步入下行趋势中，但仍处于高位，4% 左右的 10 年美债收益率已较充分反应加息预期，我们认为支持美元进一步走强的环境也可能在发生变化。经历调整后，从政策、估值、盈利三方面看国内权益市场机会大于风险，且股权风险溢价和股息率显示中期配置价值高，如一年维度市场胜率非常高。转债估值收缩但仍不低，考虑到转债与股票在方向上强相关，估值只是制约收益空间，转债机会在迫近。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。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 09 月 30 日，本基金基金份额净值为 11.2843 元，份额累计净值为 1.1284 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为-3.17%，同期业绩基准增长率-3.44%。

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	1,185,857,030.60	95.52

	其中：债券	1,185,857,030.60	95.52
	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	17,985,978.50	1.45
	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	37,524,315.68	3.02
8	其他各项资产	98,712.71	0.01
9	合计	1,241,466,037.49	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

本基金本报告期末未持有股票。

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）	1,185,857,030.60	98.32
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,185,857,030.60	98.32

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	624,970	67,214,924.22	5.57
2	113052	兴业转债	630,350	67,190,474.44	5.57
3	113021	中信转债	499,210	55,132,547.24	4.57
4	113044	大秦转债	401,620	44,555,172.64	3.69
5	132018	G 三峡 EB1	243,150	34,743,636.88	2.88

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银保监会及中国人民银行呼和浩特市中心的处罚。上海浦东发展银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国银行保险监督管理委员会、国家外汇管理局上海市分局、中国人民银行福州中心支行的处罚。中信银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国银行保险监督管理委员会、中国人民银行沈阳分行、中国人民银行南昌市中心支行的处罚。江苏银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国银行保险监督管理委员会北京监管局、中国人民银行营业管理部的处罚。中国光大银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国银行保险监督管理委员会、中国人民银行青岛市中心支行、国家外汇管理局北京外汇管理部的处罚。南京银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国银行保险监督管理委员会江苏监管局的处罚。上海银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国银行保险监督管理委员会上海监管局的处罚。杭州银行股份有限公司在报告编

制前一年受到中国银行保险监督管理委员会深圳监管局、中国人民银行杭州中心支行的处罚。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	34,015.28
2	应收证券清算款	26,889.51
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	37,807.92
8	其他	-
9	合计	98,712.71

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	67,214,924.22	5.57
2	113052	兴业转债	67,190,474.44	5.57
3	113021	中信转债	55,132,547.24	4.57
4	113044	大秦转债	44,555,172.64	3.69
5	132018	G 三峡 EB1	34,743,636.88	2.88
6	110053	苏银转债	32,797,712.71	2.72
7	113011	光大转债	31,783,047.10	2.64
8	113042	上银转债	26,831,005.10	2.22
9	113050	南银转债	26,776,939.54	2.22
10	132015	18 中油 EB	24,422,236.45	2.02
11	110079	杭银转债	24,341,059.33	2.02
12	110085	通 22 转债	19,700,175.60	1.63
13	123107	温氏转债	16,393,251.85	1.36
14	127045	牧原转债	16,240,246.59	1.35
15	113056	重银转债	16,099,056.50	1.33
16	113055	成银转债	13,110,215.85	1.09
17	127049	希望转 2	12,583,598.10	1.04
18	110081	闻泰转债	12,404,796.23	1.03
19	113641	华友转债	11,547,760.00	0.96
20	113057	中银转债	11,378,555.27	0.94
21	113053	隆 22 转债	11,033,515.32	0.91
22	110073	国投转债	10,301,006.22	0.85

23	110075	南航转债	10,167,010.34	0.84
24	113013	国君转债	9,862,569.49	0.82
25	127030	盛虹转债	9,668,815.85	0.80
26	110083	苏租转债	8,386,759.96	0.70
27	127018	本钢转债	8,184,599.45	0.68
28	127012	招路转债	7,498,214.76	0.62
29	127032	苏行转债	7,429,105.71	0.62
30	127005	长证转债	7,294,301.14	0.60
31	127056	中特转债	7,100,894.39	0.59
32	110061	川投转债	6,864,957.05	0.57
33	113642	上 22 转债	6,827,659.06	0.57
34	128129	青农转债	6,479,645.13	0.54
35	127040	国泰转债	6,035,036.30	0.50
36	113037	紫银转债	5,753,061.87	0.48
37	127058	科伦转债	5,497,651.81	0.46
38	113043	财通转债	5,461,289.38	0.45
39	113051	节能转债	5,409,309.97	0.45
40	127036	三花转债	5,240,358.51	0.43
41	113049	长汽转债	5,073,932.62	0.42
42	113045	环旭转债	4,988,957.60	0.41
43	132020	19 蓝星 EB	4,915,297.60	0.41
44	128081	海亮转债	4,787,526.73	0.40
45	127020	中金转债	4,475,558.20	0.37
46	113024	核建转债	4,382,756.12	0.36
47	128136	立讯转债	4,335,928.84	0.36
48	110043	无锡转债	4,234,426.81	0.35
49	110062	烽火转债	4,172,050.18	0.35
50	110072	广汇转债	4,127,264.91	0.34
51	127027	靖远转债	4,124,279.49	0.34
52	132014	18 中化 EB	4,030,694.88	0.33
53	113025	明泰转债	4,025,927.84	0.33
54	110045	海澜转债	3,769,808.72	0.31
55	128048	张行转债	3,766,222.98	0.31
56	110067	华安转债	3,706,055.42	0.31
57	127038	国微转债	3,637,398.33	0.30
58	113048	晶科转债	3,593,258.41	0.30
59	127050	麒麟转债	3,576,686.58	0.30
60	110068	龙净转债	3,558,839.28	0.30
61	127006	敖东转债	3,554,181.56	0.29
62	113616	韦尔转债	3,526,980.41	0.29
63	113623	凤 21 转债	3,460,930.54	0.29
64	113632	鹤 21 转债	3,347,868.59	0.28
65	110082	宏发转债	3,322,537.97	0.28

66	113054	绿动转债	3,220,912.53	0.27
67	110047	山鹰转债	3,213,706.17	0.27
68	128035	大族转债	3,167,851.24	0.26
69	110056	亨通转债	2,930,617.99	0.24
70	110048	福能转债	2,920,401.74	0.24
71	123119	康泰转 2	2,886,973.24	0.24
72	128109	楚江转债	2,848,732.94	0.24
73	110077	洪城转债	2,815,147.48	0.23
74	128140	润建转债	2,699,860.50	0.22
75	113626	伯特转债	2,642,252.38	0.22
76	113047	旗滨转债	2,637,432.81	0.22
77	127022	恒逸转债	2,585,269.02	0.21
78	127039	北港转债	2,545,823.82	0.21
79	128134	鸿路转债	2,532,660.31	0.21
80	113602	景 20 转债	2,523,488.51	0.21
81	110063	鹰 19 转债	2,453,155.40	0.20
82	110076	华海转债	2,434,893.23	0.20
83	123108	乐普转 2	2,425,121.92	0.20
84	113033	利群转债	2,392,472.19	0.20
85	127025	冀东转债	2,382,993.94	0.20
86	128034	江银转债	2,381,146.80	0.20
87	113534	鼎胜转债	2,368,711.99	0.20
88	110057	现代转债	2,345,967.34	0.19
89	113046	金田转债	2,335,990.60	0.19
90	110052	贵广转债	2,242,308.92	0.19
91	128095	恩捷转债	2,223,861.13	0.18
92	110080	东湖转债	2,211,385.54	0.18
93	128135	洽洽转债	2,114,096.39	0.18
94	127016	鲁泰转债	2,086,451.14	0.17
95	128114	正邦转债	2,024,008.32	0.17
96	113605	大参转债	2,004,656.58	0.17
97	127024	盈峰转债	2,000,830.87	0.17
98	128131	崇达转 2	1,997,874.92	0.17
99	128017	金禾转债	1,983,039.24	0.16
100	128141	旺能转债	1,981,964.08	0.16
101	128108	蓝帆转债	1,954,499.95	0.16
102	113615	金诚转债	1,921,614.89	0.16
103	127047	帝欧转债	1,921,119.27	0.16
104	123128	首华转债	1,870,758.23	0.16
105	132021	19 中电 EB	1,868,938.45	0.15
106	123092	天壕转债	1,851,457.47	0.15
107	123114	三角转债	1,808,104.29	0.15
108	127043	川恒转债	1,731,043.21	0.14

109	123121	帝尔转债	1,728,106.97	0.14
110	123085	万顺转 2	1,714,228.75	0.14
111	123060	苏试转债	1,671,386.90	0.14
112	113516	苏农转债	1,670,919.41	0.14
113	113636	甬金转债	1,642,914.00	0.14
114	128029	太阳转债	1,620,268.04	0.13
115	123083	朗新转债	1,603,870.77	0.13
116	110064	建工转债	1,578,658.32	0.13
117	128106	华统转债	1,569,646.44	0.13
118	113622	杭叉转债	1,539,063.95	0.13
119	123115	捷捷转债	1,532,588.04	0.13
120	111000	起帆转债	1,522,728.30	0.13
121	127052	西子转债	1,491,452.68	0.12
122	127046	百润转债	1,449,229.02	0.12
123	128046	利尔转债	1,423,455.03	0.12
124	110084	贵燃转债	1,422,117.37	0.12
125	127044	蒙娜转债	1,413,055.31	0.12
126	113545	金能转债	1,412,810.54	0.12
127	113582	火炬转债	1,400,472.99	0.12
128	127031	洋丰转债	1,383,918.22	0.11
129	127017	万青转债	1,380,575.67	0.11
130	127033	中装转 2	1,377,752.27	0.11
131	128023	亚太转债	1,372,989.02	0.11
132	128078	太极转债	1,372,081.87	0.11
133	113619	世运转债	1,372,024.85	0.11
134	113017	吉视转债	1,370,356.96	0.11
135	123123	江丰转债	1,368,366.58	0.11
136	123125	元力转债	1,357,539.03	0.11
137	123077	汉得转债	1,354,545.91	0.11
138	118000	嘉元转债	1,353,632.90	0.11
139	123113	仙乐转债	1,348,701.22	0.11
140	128144	利民转债	1,347,459.39	0.11
141	123071	天能转债	1,345,444.02	0.11
142	128119	龙大转债	1,343,301.32	0.11
143	127037	银轮转债	1,342,604.03	0.11
144	123105	拓尔转债	1,339,822.25	0.11
145	113634	珀莱转债	1,336,818.42	0.11
146	113640	苏利转债	1,331,009.41	0.11
147	128130	景兴转债	1,330,378.12	0.11
148	123117	健帆转债	1,325,702.98	0.11
149	113633	科沃转债	1,321,411.25	0.11
150	113637	华翔转债	1,302,144.89	0.11
151	113631	皖天转债	1,298,403.37	0.11

152	123104	卫宁转债	1,295,316.08	0.11
153	118005	天奈转债	1,271,403.65	0.11
154	127015	希望转债	1,271,186.13	0.11
155	123120	隆华转债	1,267,641.84	0.11
156	123078	飞凯转债	1,266,124.79	0.10
157	113596	城地转债	1,260,340.77	0.10
158	123133	佩蒂转债	1,249,310.18	0.10
159	118003	华兴转债	1,249,074.29	0.10
160	128128	齐翔转 2	1,223,706.11	0.10
161	127029	中钢转债	1,220,457.67	0.10
162	110074	精达转债	1,218,520.65	0.10
163	123035	利德转债	1,214,822.47	0.10
164	123049	维尔转债	1,202,009.06	0.10
165	127019	国城转债	1,181,939.21	0.10
166	123099	普利转债	1,178,854.96	0.10
167	128133	奇正转债	1,161,867.75	0.10
168	128015	久其转债	1,147,318.66	0.10
169	128083	新北转债	1,143,987.68	0.09
170	123067	斯莱转债	1,141,116.17	0.09
171	128121	宏川转债	1,139,765.20	0.09
172	123132	回盛转债	1,130,113.68	0.09
173	113549	白电转债	1,128,799.53	0.09
174	127053	豪美转债	1,126,884.62	0.09
175	128132	交建转债	1,126,188.74	0.09
176	123076	强力转债	1,121,471.19	0.09
177	113563	柳药转债	1,116,624.18	0.09
178	113629	泉峰转债	1,111,806.27	0.09
179	128127	文科转债	1,107,841.32	0.09
180	123004	铁汉转债	1,101,455.25	0.09
181	113627	太平转债	1,088,902.65	0.09
182	113505	杭电转债	1,085,516.36	0.09
183	123096	思创转债	1,082,131.17	0.09
184	127014	北方转债	1,061,058.51	0.09
185	127042	嘉美转债	1,053,541.92	0.09
186	110060	天路转债	1,051,831.03	0.09
187	111002	特纸转债	1,049,772.88	0.09
188	128105	长集转债	1,047,442.66	0.09
189	113621	彤程转债	1,040,656.98	0.09
190	127026	超声转债	1,034,140.66	0.09
191	113609	永安转债	1,033,974.84	0.09
192	113519	长久转债	1,031,149.26	0.09
193	127035	濮耐转债	1,001,982.16	0.08
194	128142	新乳转债	999,542.58	0.08

195	123063	大禹转债	999,307.31	0.08
196	113504	艾华转债	979,129.80	0.08
197	128137	洁美转债	978,312.56	0.08
198	128124	科华转债	975,695.55	0.08
199	123131	奥飞转债	974,315.06	0.08
200	127028	英特转债	973,936.72	0.08
201	128063	未来转债	973,578.12	0.08
202	123101	拓斯转债	968,880.22	0.08
203	127034	绿茵转债	964,625.45	0.08
204	113530	大丰转债	947,892.38	0.08
205	128044	岭南转债	927,646.89	0.08
206	113638	台 21 转债	916,454.27	0.08
207	111001	山玻转债	915,263.69	0.08
208	128116	瑞达转债	914,786.09	0.08
209	123075	贝斯转债	914,259.13	0.08
210	123091	长海转债	912,867.25	0.08
211	123142	申昊转债	905,196.82	0.08
212	128037	岩土转债	903,572.08	0.07
213	110038	济川转债	903,479.55	0.07
214	123122	富瀚转债	900,369.19	0.07
215	123044	红相转债	897,935.45	0.07
216	113625	江山转债	896,229.50	0.07
217	113542	好客转债	891,875.93	0.07
218	113584	家悦转债	888,471.98	0.07
219	123064	万孚转债	887,205.16	0.07
220	113604	多伦转债	883,754.71	0.07
221	113606	荣泰转债	883,598.56	0.07
222	127041	弘亚转债	882,975.83	0.07
223	123129	锦鸡转债	882,214.10	0.07
224	127055	精装转债	876,888.82	0.07
225	123056	雪榕转债	856,529.67	0.07
226	113588	润达转债	846,079.69	0.07
227	113639	华正转债	836,130.80	0.07
228	123090	三诺转债	834,940.91	0.07
229	113618	美诺转债	823,880.06	0.07
230	113579	健友转债	807,419.48	0.07
231	113601	塞力转债	803,052.85	0.07
232	127051	博杰转债	798,952.06	0.07
233	113589	天创转债	789,377.11	0.07
234	123082	北陆转债	780,092.90	0.06
235	123109	昌红转债	734,273.83	0.06
236	113610	灵康转债	723,543.68	0.06
237	132022	20 广版 EB	657,564.12	0.05

238	128097	奥佳转债	603,922.01	0.05
239	123139	铂科转债	526,077.71	0.04
240	113600	新星转债	525,416.75	0.04
241	128022	众信转债	464,333.78	0.04
242	128145	日丰转债	414,209.74	0.03
243	113591	胜达转债	398,903.06	0.03
244	127054	双箭转债	385,912.04	0.03
245	123098	一品转债	385,901.59	0.03
246	118004	博瑞转债	369,237.05	0.03
247	123087	明电转债	367,376.09	0.03
248	113537	文灿转债	352,682.26	0.03
249	113608	威派转债	347,587.40	0.03
250	123127	耐普转债	342,867.04	0.03
251	123059	银信转债	337,058.57	0.03
252	123130	设研转债	335,467.79	0.03
253	113593	沪工转债	335,179.00	0.03
254	123136	城市转债	335,114.16	0.03
255	123050	聚飞转债	334,112.41	0.03
256	127007	湖广转债	333,436.48	0.03
257	123048	应急转债	328,326.92	0.03
258	123100	朗科转债	322,063.27	0.03
259	128042	凯中转债	320,579.40	0.03
260	128138	侨银转债	317,669.47	0.03
261	128066	亚泰转债	311,705.01	0.03
262	113532	海环转债	305,994.41	0.03
263	128101	联创转债	302,367.70	0.03
264	113535	大业转债	300,687.90	0.02
265	110055	伊力转债	299,444.99	0.02
266	123010	博世转债	298,432.36	0.02
267	123124	晶瑞转 2	295,383.00	0.02
268	123089	九洲转 2	294,300.75	0.02
269	128125	华阳转债	293,689.75	0.02
270	113628	晨丰转债	288,650.71	0.02
271	113569	科达转债	286,645.52	0.02
272	128026	众兴转债	282,010.50	0.02
273	113624	正川转债	279,489.28	0.02
274	128117	道恩转债	274,588.45	0.02
275	113027	华钰转债	264,227.78	0.02
276	128049	华源转债	262,561.46	0.02
277	118006	阿拉转债	259,636.21	0.02
278	113578	全筑转债	258,249.12	0.02
279	113524	奇精转债	247,752.85	0.02
280	123025	精测转债	244,142.68	0.02

281	123126	瑞丰转债	243,738.30	0.02
282	123118	惠城转债	242,863.56	0.02
283	128111	中矿转债	240,839.52	0.02
284	128090	汽模转 2	239,982.29	0.02
285	128014	永东转债	239,026.40	0.02
286	113039	嘉泽转债	238,269.16	0.02
287	128025	特一转债	234,276.03	0.02
288	113598	法兰转债	234,223.86	0.02
289	123106	正丹转债	230,633.14	0.02
290	123088	威唐转债	229,979.56	0.02
291	128123	国光转债	229,716.75	0.02
292	128033	迪龙转债	228,115.24	0.02
293	113597	佳力转债	225,004.42	0.02
294	113030	东风转债	224,157.34	0.02
295	123103	震安转债	223,096.98	0.02
296	128069	华森转债	222,928.22	0.02
297	123022	长信转债	220,763.20	0.02
298	113594	淳中转债	220,283.85	0.02
299	128021	兄弟转债	219,216.13	0.02
300	113570	百达转债	217,474.03	0.02
301	128072	翔鹭转债	215,345.05	0.02
302	128071	合兴转债	213,042.15	0.02
303	128118	瀛通转债	212,433.51	0.02
304	128122	兴森转债	207,257.08	0.02
305	128075	远东转债	203,702.09	0.02
306	113573	纵横转债	196,716.64	0.02
307	113525	台华转债	195,565.60	0.02
308	110058	永鼎转债	189,412.09	0.02
309	128040	华通转债	185,643.37	0.02
310	128082	华锋转债	185,475.72	0.02
311	123011	德尔转债	184,735.78	0.02
312	123116	万兴转债	184,250.56	0.02
313	113016	小康转债	183,415.36	0.02
314	123002	国祯转债	182,230.69	0.02
315	113567	君禾转债	182,106.49	0.02
316	128070	智能转债	173,458.39	0.01
317	113565	宏辉转债	167,320.11	0.01
318	123039	开润转债	163,988.48	0.01
319	128076	金轮转债	162,087.05	0.01
320	110070	凌钢转债	161,011.13	0.01
321	113574	华体转债	151,627.61	0.01
322	113577	春秋转债	138,824.36	0.01

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	64,386,670.00
报告期期间基金总申购份额	49,900,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	7,400,000.00
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	106,886,670.00

§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 2022 年 9 月 30 日，博时基金公司共管理 335 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 16597 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 5970 亿元人民币，累计

分红逾 1721 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

9.1.1 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

9.1.2 《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》

9.1.3 《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》

9.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

9.1.5 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

9.1.6 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

二〇二二年十月二十六日