

**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 4 季度报告
2022 年 12 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：二〇二三年一月二十日

§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 2023 年 1 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 2022 年 10 月 1 日起至 12 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	201,386,670.00 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 10 月 1 日-2022 年 12 月 31 日)
1.本期已实现收益	-11,616.89
2.本期利润	-52,867,968.14
3.加权平均基金份额本期利润	-0.3639
4.期末基金资产净值	2,207,246,619.02
5.期末基金份额净值	10.9602

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。

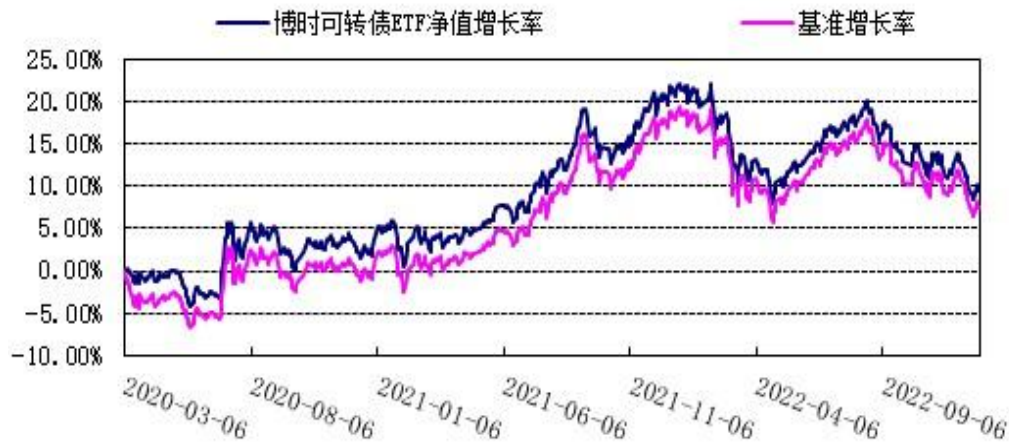
所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-2.87%	0.53%	-2.67%	0.53%	-0.20%	0.00%
过去六个月	-5.95%	0.48%	-6.02%	0.49%	0.07%	-0.01%
过去一年	-10.11%	0.60%	-9.55%	0.60%	-0.56%	0.00%
自基金合同生 效起至今	9.60%	0.58%	7.58%	0.58%	2.02%	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	-	14.4	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

				<p>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</p>
--	--	--	--	---

					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，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 31 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

四季度股市处于震荡走势，上证指数震荡收涨 2.14%，创业板涨 2.53%，下半季度随着地产融资政策的变化以及疫情防控转变，困境反转成为市场的投资焦点，金融地产和消费出现修复上涨，而以电新为代表的成长板块表现不佳。下半季度银行理财行为对债市造成明显扰动，在经济基本面偏弱情况下债市出现明显调整，有超调迹象，在此背景下转债市场也受到冲击，中证转债及可交债指数在股市上涨背景下出现 2.67% 的下跌。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 12 月 31 日，本基金基金份额净值为 10.9602 元，份额累计净值为 1.0960 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为-2.87%，同期业绩基准增长率为-2.67%。

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	2,157,716,175.09	95.84
	其中：债券	2,157,716,175.09	95.84
	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	26,992,235.62	1.20
	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	66,602,472.88	2.96

8	其他各项资产	101,789.16	0.00
9	合计	2,251,412,672.75	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）	2,157,716,175.09	97.76
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,157,716,175.09	97.76

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	1,148,190	120,472,656.10	5.46
2	113052	兴业转债	1,149,160	117,002,276.36	5.30
3	113021	中信转债	907,280	99,627,795.38	4.51
4	113044	大秦转债	733,750	80,572,584.93	3.65
5	132018	G 三峡 EB1	444,340	59,033,125.47	2.67

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。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。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。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。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。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。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	56,012.14
2	应收证券清算款	45,777.02
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	-
8	其他	-
9	合计	101,789.16

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	120,472,656.10	5.46
2	113052	兴业转债	117,002,276.36	5.30
3	113021	中信转债	99,627,795.38	4.51
4	113044	大秦转债	80,572,584.93	3.65
5	132018	G 三峡 EB1	59,033,125.47	2.67
6	113011	光大转债	57,593,828.32	2.61
7	110053	苏银转债	56,331,347.75	2.55
8	113042	上银转债	48,042,609.09	2.18
9	132015	18 中油 EB	46,643,079.08	2.11
10	113050	南银转债	46,100,378.21	2.09
11	110079	杭银转债	40,095,255.03	1.82
12	110085	通 22 转债	33,000,249.08	1.50
13	113056	重银转债	28,967,783.53	1.31
14	127045	牧原转债	26,533,752.02	1.20
15	123107	温氏转债	22,363,704.98	1.01
16	110081	闻泰转债	21,396,711.68	0.97
17	113057	中银转债	21,010,811.06	0.95
18	127049	希望转 2	20,817,693.24	0.94
19	113055	成银转债	19,431,883.71	0.88
20	113641	华友转债	19,425,518.93	0.88
21	113060	浙 22 转债	19,360,637.96	0.88
22	110073	国投转债	19,144,388.83	0.87
23	110075	南航转债	18,340,195.69	0.83
24	113053	隆 22 转债	18,301,823.17	0.83
25	113013	国君转债	16,836,324.40	0.76
26	127018	本钢转债	14,939,122.19	0.68
27	127030	盛虹转债	14,536,448.62	0.66
28	110083	苏租转债	14,096,227.68	0.64

29	127032	苏行转债	13,775,044.38	0.62
30	127012	招路转债	12,945,722.33	0.59
31	127005	长证转债	12,508,600.60	0.57
32	127056	中特转债	12,201,621.63	0.55
33	110061	川投转债	11,813,130.53	0.54
34	128129	青农转债	11,474,078.51	0.52
35	127058	科伦转债	11,381,102.33	0.52
36	113059	福莱转债	10,876,031.17	0.49
37	127040	国泰转债	10,778,218.90	0.49
38	113037	紫银转债	10,287,938.38	0.47
39	132020	19 蓝星 EB	9,838,390.21	0.45
40	113043	财通转债	9,290,643.77	0.42
41	113049	长汽转债	9,183,120.35	0.42
42	113045	环旭转债	9,046,072.67	0.41
43	127061	美锦转债	8,689,830.52	0.39
44	128081	海亮转债	8,550,154.86	0.39
45	127036	三花转债	8,343,296.72	0.38
46	113051	节能转债	8,304,349.98	0.38
47	113024	核建转债	7,738,414.64	0.35
48	127020	中金转债	7,536,879.79	0.34
49	128136	立讯转债	7,343,237.39	0.33
50	110087	天业转债	7,280,530.82	0.33
51	110072	广汇转债	7,257,151.02	0.33
52	110043	无锡转债	7,184,632.36	0.33
53	110045	海澜转债	7,163,458.18	0.32
54	110062	烽火转债	7,036,961.95	0.32
55	110067	华安转债	6,787,310.84	0.31
56	113048	晶科转债	6,628,583.96	0.30
57	128048	张行转债	6,622,274.92	0.30
58	110068	龙净转债	6,588,122.69	0.30
59	127006	敖东转债	6,568,067.45	0.30
60	127050	麒麟转债	6,401,133.48	0.29
61	113623	凤 21 转债	6,343,025.35	0.29
62	110047	山鹰转债	6,152,683.38	0.28
63	113616	韦尔转债	6,121,083.19	0.28
64	113632	鹤 21 转债	5,750,859.75	0.26
65	113054	绿动转债	5,707,838.19	0.26
66	128035	大族转债	5,694,665.59	0.26
67	127038	国微转债	5,548,406.18	0.25
68	113025	明泰转债	5,461,053.25	0.25
69	123119	康泰转 2	5,271,556.36	0.24
70	127027	靖远转债	5,051,087.82	0.23
71	127063	贵轮转债	5,028,398.78	0.23

72	110077	洪城转债	4,944,478.89	0.22
73	110082	宏发转债	4,932,554.24	0.22
74	110086	精工转债	4,834,404.38	0.22
75	113058	友发转债	4,808,218.84	0.22
76	110048	福能转债	4,806,992.55	0.22
77	110063	鹰 19 转债	4,758,602.97	0.22
78	128109	楚江转债	4,683,266.86	0.21
79	127022	恒逸转债	4,655,046.49	0.21
80	127039	北港转债	4,650,909.07	0.21
81	110076	华海转债	4,602,651.73	0.21
82	123108	乐普转 2	4,479,475.06	0.20
83	128134	鸿路转债	4,460,674.07	0.20
84	128034	江银转债	4,447,487.87	0.20
85	113602	景 20 转债	4,441,932.54	0.20
86	113647	禾丰转债	4,422,201.00	0.20
87	113626	伯特转债	4,398,734.77	0.20
88	113047	旗滨转债	4,375,026.42	0.20
89	113033	利群转债	4,327,949.72	0.20
90	127025	冀东转债	4,246,905.43	0.19
91	110057	现代转债	4,224,755.64	0.19
92	123149	通裕转债	4,155,732.73	0.19
93	132014	18 中化 EB	4,118,774.66	0.19
94	110080	东湖转债	4,076,518.02	0.18
95	113615	金诚转债	3,995,147.76	0.18
96	128140	润建转债	3,961,904.65	0.18
97	128135	洽洽转债	3,860,590.40	0.17
98	113605	大参转债	3,844,279.47	0.17
99	127064	杭氧转债	3,777,517.40	0.17
100	127016	鲁泰转债	3,773,099.09	0.17
101	113046	金田转债	3,702,357.28	0.17
102	128131	崇达转 2	3,628,953.57	0.16
103	128108	蓝帆转债	3,604,261.66	0.16
104	127024	盈峰转债	3,589,553.02	0.16
105	127047	帝欧转债	3,435,952.76	0.16
106	113534	鼎胜转债	3,346,076.73	0.15
107	128141	旺能转债	3,298,714.27	0.15
108	123128	首华转债	3,285,788.44	0.15
109	127043	川恒转债	3,147,912.46	0.14
110	111000	起帆转债	3,140,798.73	0.14
111	113622	杭叉转债	3,092,416.32	0.14
112	113516	苏农转债	3,084,738.90	0.14
113	128078	太极转债	3,078,064.03	0.14
114	123145	药石转债	3,059,230.89	0.14

115	128095	恩捷转债	3,007,886.27	0.14
116	127046	百润转债	2,917,586.98	0.13
117	123092	天壕转债	2,894,085.06	0.13
118	123114	三角转债	2,884,518.07	0.13
119	110064	建工转债	2,884,467.78	0.13
120	123115	捷捷转债	2,873,621.92	0.13
121	128114	正邦转债	2,804,838.47	0.13
122	127044	蒙娜转债	2,782,170.39	0.13
123	127033	中装转 2	2,738,623.18	0.12
124	127052	西子转债	2,732,841.22	0.12
125	113648	巨星转债	2,684,144.42	0.12
126	113017	吉视转债	2,666,028.10	0.12
127	110084	贵燃转债	2,609,278.58	0.12
128	113636	甬金转债	2,563,008.69	0.12
129	123077	汉得转债	2,526,515.55	0.11
130	113545	金能转债	2,523,313.29	0.11
131	123121	帝尔转债	2,508,465.75	0.11
132	128130	景兴转债	2,507,116.47	0.11
133	123105	拓尔转债	2,471,467.98	0.11
134	123104	卫宁转债	2,471,061.28	0.11
135	128144	利民转债	2,470,441.71	0.11
136	113619	世运转债	2,469,647.75	0.11
137	113634	珀莱转债	2,468,334.76	0.11
138	128119	龙大转债	2,465,237.23	0.11
139	127017	万青转债	2,465,094.55	0.11
140	128017	金禾转债	2,459,432.52	0.11
141	113633	科沃转债	2,450,064.64	0.11
142	113596	城地转债	2,447,526.51	0.11
143	128023	亚太转债	2,438,620.97	0.11
144	113640	苏利转债	2,435,953.21	0.11
145	123083	朗新转债	2,417,235.99	0.11
146	113631	皖天转债	2,406,080.56	0.11
147	123113	仙乐转债	2,397,967.16	0.11
148	118000	嘉元转债	2,397,114.94	0.11
149	127037	银轮转债	2,394,501.98	0.11
150	127031	洋丰转债	2,384,675.39	0.11
151	113644	艾迪转债	2,360,804.98	0.11
152	128083	新北转债	2,353,699.61	0.11
153	123117	健帆转债	2,324,031.70	0.11
154	123099	普利转债	2,317,203.28	0.10
155	127029	中钢转债	2,316,132.54	0.10
156	127015	希望转债	2,284,843.07	0.10
157	128127	文科转债	2,266,042.24	0.10

158	118003	华兴转债	2,254,410.10	0.10
159	113582	火炬转债	2,251,876.00	0.10
160	123120	隆华转债	2,238,712.77	0.10
161	111002	特纸转债	2,226,887.47	0.10
162	128133	奇正转债	2,201,410.45	0.10
163	123146	中环转 2	2,197,307.97	0.10
164	123085	万顺转 2	2,194,083.99	0.10
165	128128	齐翔转 2	2,193,057.25	0.10
166	111004	明新转债	2,187,303.78	0.10
167	127053	豪美转债	2,182,562.66	0.10
168	127019	国城转债	2,169,316.54	0.10
169	123049	维尔转债	2,167,086.12	0.10
170	113637	华翔转债	2,165,802.96	0.10
171	123071	天能转债	2,165,469.92	0.10
172	123035	利德转债	2,125,417.51	0.10
173	123133	佩蒂转债	2,105,360.71	0.10
174	113563	柳药转债	2,102,043.82	0.10
175	128132	交建转债	2,083,646.42	0.09
176	113549	白电转债	2,078,163.70	0.09
177	118008	海优转债	2,043,583.19	0.09
178	123078	飞凯转债	2,039,807.24	0.09
179	123004	铁汉转债	2,038,104.14	0.09
180	118005	天奈转债	2,018,739.06	0.09
181	123076	强力转债	2,013,904.02	0.09
182	128121	宏川转债	2,010,988.82	0.09
183	113627	太平转债	1,979,814.88	0.09
184	128106	华统转债	1,972,758.46	0.09
185	113505	杭电转债	1,966,556.76	0.09
186	127042	嘉美转债	1,966,445.51	0.09
187	128137	洁美转债	1,956,883.54	0.09
188	113519	长久转债	1,951,438.51	0.09
189	128087	孚日转债	1,937,658.37	0.09
190	110060	天路转债	1,933,927.72	0.09
191	128142	新乳转债	1,920,271.56	0.09
192	123132	回盛转债	1,917,283.59	0.09
193	123096	思创转债	1,911,965.51	0.09
194	113609	永安转债	1,911,340.75	0.09
195	123144	裕兴转债	1,907,784.90	0.09
196	128105	长集转债	1,898,615.11	0.09
197	127060	湘佳转债	1,886,960.50	0.09
198	127026	超声转债	1,853,864.14	0.08
199	123063	大禹转债	1,851,282.95	0.08
200	113629	泉峰转债	1,843,169.13	0.08

201	127028	英特转债	1,842,837.07	0.08
202	127014	北方转债	1,841,988.15	0.08
203	113621	彤程转债	1,839,309.37	0.08
204	123101	拓斯转债	1,832,151.95	0.08
205	128063	未来转债	1,830,425.02	0.08
206	113530	大丰转债	1,824,545.99	0.08
207	113504	艾华转债	1,794,253.50	0.08
208	111005	富春转债	1,791,853.72	0.08
209	128044	岭南转债	1,791,370.88	0.08
210	127035	濮耐转债	1,783,249.52	0.08
211	128037	岩土转债	1,780,994.60	0.08
212	128124	科华转债	1,773,136.58	0.08
213	110074	精达转债	1,769,487.91	0.08
214	123147	中辰转债	1,761,755.24	0.08
215	127034	绿茵转债	1,759,119.40	0.08
216	123131	奥飞转债	1,747,879.24	0.08
217	123091	长海转债	1,733,733.65	0.08
218	127055	精装转债	1,727,957.30	0.08
219	123075	贝斯转债	1,719,326.70	0.08
220	111001	山玻转债	1,716,146.74	0.08
221	113625	江山转债	1,714,463.04	0.08
222	123090	三诺转债	1,706,937.86	0.08
223	123064	万孚转债	1,698,936.83	0.08
224	123044	红相转债	1,695,607.91	0.08
225	113638	台 21 转债	1,679,134.96	0.08
226	123129	锦鸡转债	1,675,539.93	0.08
227	113604	多伦转债	1,670,546.85	0.08
228	128116	瑞达转债	1,661,222.07	0.08
229	113606	荣泰转债	1,651,387.50	0.07
230	113542	好客转债	1,650,565.09	0.07
231	123122	富瀚转债	1,644,341.10	0.07
232	113584	家悦转债	1,628,518.75	0.07
233	127041	弘亚转债	1,615,288.89	0.07
234	113618	美诺转债	1,614,772.30	0.07
235	123056	雪榕转债	1,611,866.61	0.07
236	113588	润达转债	1,611,210.63	0.07
237	123142	申昊转债	1,575,892.02	0.07
238	113601	塞力转债	1,548,209.26	0.07
239	113579	健友转债	1,535,053.54	0.07
240	113639	华正转债	1,521,096.55	0.07
241	127051	博杰转债	1,506,952.89	0.07
242	123082	北陆转债	1,479,024.04	0.07
243	113589	天创转债	1,474,464.97	0.07

244	123109	昌红转债	1,471,979.40	0.07
245	110052	贵广转债	970,887.93	0.04
246	123148	上能转债	933,894.21	0.04
247	127065	瑞鹄转债	862,773.90	0.04
248	123067	斯莱转债	786,917.68	0.04
249	127062	垒知转债	776,862.46	0.04
250	113610	灵康转债	704,707.55	0.03
251	132022	20 广版 EB	657,721.91	0.03
252	128097	奥佳转债	593,624.45	0.03
253	123143	胜蓝转债	514,051.04	0.02
254	113600	新星转债	494,537.62	0.02
255	123141	宏丰转债	460,837.60	0.02
256	128145	日丰转债	459,674.91	0.02
257	123098	一品转债	436,931.41	0.02
258	118009	华锐转债	435,905.67	0.02
259	123118	惠城转债	421,272.82	0.02
260	127059	永东转 2	410,801.57	0.02
261	113643	风语转债	402,316.60	0.02
262	113591	胜达转债	391,261.33	0.02
263	128025	特一转债	388,623.78	0.02
264	127054	双箭转债	383,100.89	0.02
265	118004	博瑞转债	366,105.72	0.02
266	127007	湖广转债	365,110.47	0.02
267	123087	明电转债	359,923.09	0.02
268	123127	耐普转债	339,242.67	0.02
269	123059	银信转债	336,596.58	0.02
270	123130	设研转债	333,821.62	0.02
271	113608	威派转债	332,527.38	0.02
272	123050	聚飞转债	328,484.20	0.01
273	113593	沪工转债	328,129.97	0.01
274	123048	应急转债	323,927.66	0.01
275	123136	城市转债	321,952.52	0.01
276	123100	朗科转债	310,609.79	0.01
277	128138	侨银转债	309,600.94	0.01
278	128042	凯中转债	307,323.86	0.01
279	128066	亚泰转债	299,927.84	0.01
280	113532	海环转债	297,502.79	0.01
281	123010	博世转债	295,598.97	0.01
282	113535	大业转债	294,661.73	0.01
283	113537	文灿转债	293,105.96	0.01
284	128026	众兴转债	291,495.53	0.01
285	128125	华阳转债	284,400.02	0.01
286	123124	晶瑞转 2	282,755.11	0.01

287	113628	晨丰转债	282,652.27	0.01
288	113569	科达转债	281,238.31	0.01
289	123089	九洲转 2	277,932.32	0.01
290	110055	伊力转债	275,683.20	0.01
291	128101	联创转债	273,957.60	0.01
292	113624	正川转债	273,339.69	0.01
293	118006	阿拉转债	269,993.00	0.01
294	128117	道恩转债	259,903.10	0.01
295	128049	华源转债	259,252.77	0.01
296	123025	精测转债	255,424.88	0.01
297	113027	华钰转债	251,985.41	0.01
298	128014	永东转债	248,151.23	0.01
299	113578	全筑转债	246,864.37	0.01
300	113524	奇精转债	244,414.87	0.01
301	113598	法兰转债	243,112.89	0.01
302	123126	瑞丰转债	239,712.30	0.01
303	113039	嘉泽转债	236,708.94	0.01
304	128090	汽模转 2	234,869.90	0.01
305	128033	迪龙转债	232,138.83	0.01
306	113597	佳力转债	230,103.59	0.01
307	123106	正丹转债	227,970.67	0.01
308	123088	威唐转债	227,204.83	0.01
309	128123	国光转债	225,904.43	0.01
310	113030	东风转债	223,761.99	0.01
311	113594	淳中转债	222,315.11	0.01
312	128040	华通转债	219,853.12	0.01
313	113570	百达转债	216,739.73	0.01
314	128071	合兴转债	212,768.53	0.01
315	128118	瀛通转债	210,199.47	0.01
316	128122	兴森转债	208,056.44	0.01
317	128072	翔鹭转债	207,969.33	0.01
318	123103	震安转债	205,242.68	0.01
319	123022	长信转债	205,031.19	0.01
320	128075	远东转债	201,688.89	0.01
321	128021	兄弟转债	198,660.23	0.01
322	113573	纵横转债	196,323.01	0.01
323	110058	永鼎转债	184,632.68	0.01
324	123116	万兴转债	182,726.99	0.01
325	123011	德尔转债	182,085.70	0.01
326	123002	国祯转债	180,317.98	0.01
327	113567	君禾转债	177,951.82	0.01
328	128070	智能转债	176,447.32	0.01
329	128082	华锋转债	174,014.84	0.01

330	113016	小康转债	172,439.77	0.01
331	113565	宏辉转债	169,281.47	0.01
332	128111	中矿转债	167,400.18	0.01
333	123039	开润转债	162,890.71	0.01
334	128076	金轮转债	162,032.23	0.01
335	110070	凌钢转债	156,281.32	0.01
336	113574	华体转债	149,996.11	0.01
337	113577	春秋转债	138,028.70	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	106,886,670.00
报告期期间基金总申购份额	95,700,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	1,200,000.00
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	201,386,670.00

§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 12 月 31 日，博时基金公司共管理 341 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 15141 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 5227 亿元人民币，累计分红逾 1778 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

二〇二三年一月二十日