

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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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	518,586,670.00 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 (2023 年 7 月 1 日-2023 年 9 月 30 日)
1.本期已实现收益	12,673,058.51
2.本期利润	-19,891,401.20
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0564
4.期末基金资产净值	5,852,445,623.56
5.期末基金份额净值	11.2854

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。

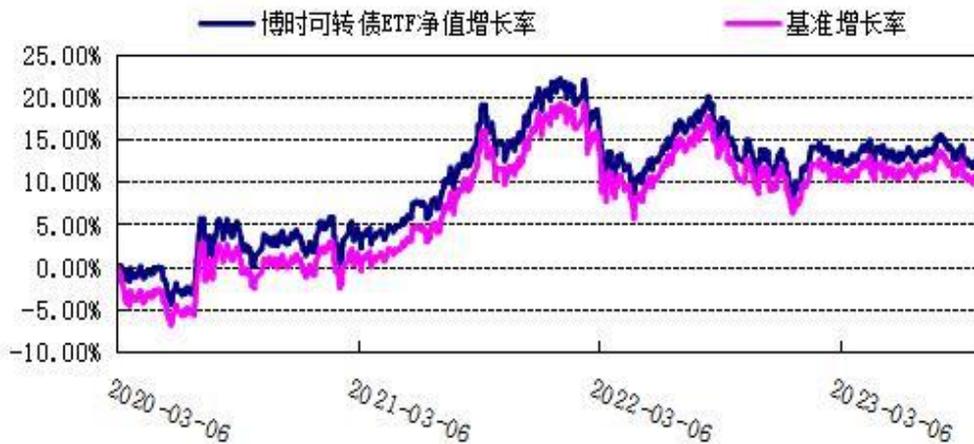
所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-0.36%	0.30%	-0.38%	0.31%	0.02%	-0.01%
过去六个月	-0.31%	0.34%	-0.27%	0.35%	-0.04%	-0.01%
过去一年	0.01%	0.40%	0.39%	0.40%	-0.38%	0.00%
过去三年	11.34%	0.52%	12.48%	0.51%	-1.14%	0.01%
自基金合同生 效起至今	12.85%	0.54%	10.97%	0.54%	1.88%	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		
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
--	--	--	--	---

					<p>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。</p>
邓欣雨	混合资产 投资部投 资总监助 理/基金经 理	2020-03-06	-	15.2	<p>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</p>

				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、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，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 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。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。

三季度，本基金跟踪的中证转债及可交换债指数下跌 0.38%，好于股市表现。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。三季度可转债 ETF 规模继续上升，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 2023 年 09 月 30 日，本基金基金份额净值为 11.2854 元，份额累计净值为 1.1285 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为-0.36%，同期业绩基准增长率为-0.38%。

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	5,794,225,311.86	98.89
	其中：债券	5,794,225,311.86	98.89
	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	33,761,340.28	0.58
	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	31,115,754.68	0.53
8	其他各项资产	168,986.10	0.00
9	合计	5,859,271,392.92	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）	5,794,225,311.86	99.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,794,225,311.86	99.01

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	2,723,000	296,302,312.45	5.06
2	113052	兴业转债	2,763,950	285,224,873.68	4.87
3	113021	中信转债	2,172,100	253,027,631.44	4.32
4	113044	大秦转债	1,650,900	194,372,442.98	3.32
5	132018	G 三峡 EB1	1,105,440	162,886,281.14	2.78

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浙江银保监局、安徽银保监局的处罚。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保定监管分局、国家外汇管理局泰州市中心支局的处罚。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、上海银保监局的处罚。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。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南阳监管分局、宜昌监管分局、青岛银保监局、国家外汇管理局深圳市分局、黑龙江省分局、中国人民银行西安分行的处罚。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上海监管局、中国银行保险监督管理委员会徐州监管分局、山东银保监局、中国人民银行厦门市中心支行、中国人民银行河南省分行、国家外汇管理局嘉兴市中心支局、国家外汇管理局山西省分局的处罚。重庆银行股份有限公司在报告编制前一年受到两江银保监分局的处罚。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	131,178.18
2	应收证券清算款	-
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	168,986.10

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	296,302,312.45	5.06
2	113052	兴业转债	285,224,873.68	4.87
3	113021	中信转债	253,027,631.44	4.32
4	113044	大秦转债	194,372,442.98	3.32
5	132018	G 三峡 EB1	162,886,281.14	2.78
6	113042	上银转债	119,698,048.85	2.05
7	113050	南银转债	104,591,324.15	1.79

8	110079	杭银转债	96,402,879.27	1.65
9	110085	通 22 转债	78,584,460.00	1.34
10	113056	重银转债	74,653,180.83	1.28
11	127045	牧原转债	62,036,891.48	1.06
12	132026	G 三峡 EB2	61,787,554.03	1.06
13	123107	温氏转债	52,953,157.08	0.90
14	118031	天 23 转债	51,513,649.38	0.88
15	110081	闻泰转债	51,223,300.51	0.88
16	110073	国投转债	49,731,698.69	0.85
17	127049	希望转 2	49,245,915.93	0.84
18	113060	浙 22 转债	48,630,890.96	0.83
19	113065	齐鲁转债	45,457,642.21	0.78
20	113641	华友转债	44,483,067.60	0.76
21	113057	中银转债	42,177,773.60	0.72
22	110075	南航转债	40,985,897.99	0.70
23	113053	隆 22 转债	40,871,007.92	0.70
24	113062	常银转债	38,995,547.05	0.67
25	110083	苏租转债	38,684,383.77	0.66
26	127018	本钢转债	37,940,717.87	0.65
27	113055	成银转债	35,962,265.41	0.61
28	127012	招路转债	35,040,660.45	0.60
29	110061	川投转债	34,515,565.62	0.59
30	127030	盛虹转债	33,909,829.59	0.58
31	127032	苏行转债	33,350,264.37	0.57
32	127056	中特转债	30,228,630.02	0.52
33	127005	长证转债	29,817,204.44	0.51
34	128129	青农转债	28,147,979.74	0.48
35	132020	19 蓝星 EB	27,283,808.49	0.47
36	113037	紫银转债	26,367,473.13	0.45
37	127040	国泰转债	25,068,617.66	0.43
38	113059	福莱转债	24,888,827.03	0.43
39	113043	财通转债	23,630,538.15	0.40
40	113045	环旭转债	22,377,140.03	0.38
41	111010	立昂转债	21,944,389.79	0.37
42	113049	长汽转债	21,934,587.95	0.37
43	127020	中金转债	21,827,591.17	0.37
44	110062	烽火转债	20,834,212.40	0.36
45	127073	天赐转债	20,834,031.97	0.36
46	110045	海澜转债	20,779,737.00	0.36
47	127058	科伦转债	20,642,136.54	0.35
48	110088	淮 22 转债	20,484,403.64	0.35
49	118024	冠宇转债	20,363,288.39	0.35
50	113066	平煤转债	20,342,583.91	0.35

51	127061	美锦转债	20,145,151.74	0.34
52	113051	节能转债	20,099,798.97	0.34
53	128081	海亮转债	20,072,568.67	0.34
54	110093	神马转债	19,460,723.66	0.33
55	113661	福 22 转债	18,865,160.67	0.32
56	113024	核建转债	18,846,515.40	0.32
57	118022	锂科转债	18,608,919.26	0.32
58	110091	合力转债	18,471,908.00	0.32
59	113061	拓普转债	18,426,406.28	0.31
60	128136	立讯转债	18,377,276.20	0.31
61	110087	天业转债	18,310,311.37	0.31
62	127067	恒逸转 2	18,265,323.29	0.31
63	110067	华安转债	17,921,608.06	0.31
64	110072	广汇转债	17,615,693.10	0.30
65	110043	无锡转债	17,344,364.33	0.30
66	110089	兴发转债	17,314,826.66	0.30
67	127006	敖东转债	16,801,375.27	0.29
68	113063	赛轮转债	16,665,983.91	0.28
69	110068	龙净转债	16,377,616.27	0.28
70	113623	凤 21 转债	16,350,523.86	0.28
71	128048	张行转债	16,082,132.76	0.27
72	110092	三房转债	15,996,538.11	0.27
73	127063	贵轮转债	15,974,168.85	0.27
74	127050	麒麟转债	15,863,526.35	0.27
75	113616	韦尔转债	15,295,719.60	0.26
76	110077	洪城转债	15,264,068.97	0.26
77	123158	宙邦转债	14,221,913.84	0.24
78	113048	晶科转债	14,132,649.64	0.24
79	113054	绿动转债	14,073,429.72	0.24
80	113632	鹤 21 转债	13,906,792.83	0.24
81	113615	金诚转债	13,852,845.14	0.24
82	110047	山鹰转债	13,844,974.66	0.24
83	113058	友发转债	13,779,275.13	0.24
84	123119	康泰转 2	13,549,521.85	0.23
85	127027	能化转债	13,504,087.27	0.23
86	113655	欧 22 转债	13,226,718.09	0.23
87	128035	大族转债	13,000,964.49	0.22
88	113666	爱玛转债	12,852,184.35	0.22
89	118030	睿创转债	12,559,906.79	0.21
90	110090	爱迪转债	12,541,134.62	0.21
91	110082	宏发转债	12,533,731.51	0.21
92	127039	北港转债	12,439,449.60	0.21
93	110086	精工转债	12,433,129.06	0.21

94	113602	景 20 转债	12,056,241.99	0.21
95	110048	福能转债	11,920,980.30	0.20
96	128109	楚江转债	11,870,397.97	0.20
97	127022	恒逸转债	11,842,204.38	0.20
98	123176	精测转 2	11,779,772.40	0.20
99	110063	鹰 19 转债	11,462,632.00	0.20
100	127038	国微转债	11,410,122.06	0.19
101	110076	华海转债	11,232,032.07	0.19
102	128134	鸿路转债	10,839,993.84	0.19
103	113033	利群转债	10,652,867.68	0.18
104	127070	大中转债	10,559,737.61	0.18
105	127025	冀东转债	10,454,392.38	0.18
106	113064	东材转债	10,406,421.62	0.18
107	128034	江银转债	10,403,598.87	0.18
108	123108	乐普转 2	10,219,698.67	0.17
109	123149	通裕转债	10,218,579.49	0.17
110	113047	旗滨转债	10,047,430.69	0.17
111	113647	禾丰转债	9,850,417.74	0.17
112	127066	科利转债	9,782,932.32	0.17
113	123169	正海转债	9,241,920.06	0.16
114	118025	奕瑞转债	9,188,992.53	0.16
115	118023	广大转债	9,144,502.25	0.16
116	113046	金田转债	9,088,608.98	0.16
117	127064	杭氧转债	9,081,380.64	0.16
118	113626	伯特转债	9,035,229.12	0.15
119	127024	盈峰转债	8,860,773.21	0.15
120	113652	伟 22 转债	8,791,264.39	0.15
121	118013	道通转债	8,662,998.21	0.15
122	128108	蓝帆转债	8,640,768.05	0.15
123	127074	麦米转 2	8,637,774.33	0.15
124	128141	旺能转债	8,610,477.88	0.15
125	128131	崇达转 2	8,608,718.51	0.15
126	127016	鲁泰转债	8,574,408.07	0.15
127	113605	大参转债	8,554,068.85	0.15
128	113025	明泰转债	8,505,641.29	0.15
129	128135	洽洽转债	8,425,866.46	0.14
130	123150	九强转债	8,309,705.30	0.14
131	127082	亚科转债	8,013,387.37	0.14
132	123128	首华转债	8,002,560.74	0.14
133	113516	苏农转债	7,807,498.39	0.13
134	110064	建工转债	7,803,373.22	0.13
135	123161	强联转债	7,798,710.73	0.13
136	113659	莱克转债	7,712,547.07	0.13

137	110080	东湖转债	7,641,912.78	0.13
138	127047	帝欧转债	7,577,188.39	0.13
139	123178	花园转债	7,519,675.45	0.13
140	123174	精锻转债	7,505,693.19	0.13
141	127037	银轮转债	7,474,907.18	0.13
142	113648	巨星转债	7,264,124.59	0.12
143	123115	捷捷转债	7,261,023.74	0.12
144	118019	金盘转债	7,179,329.59	0.12
145	127046	百润转债	7,119,364.03	0.12
146	123145	药石转债	7,049,308.93	0.12
147	127044	蒙娜转债	7,047,536.15	0.12
148	127043	川恒转债	7,031,574.38	0.12
149	127052	西子转债	6,941,611.28	0.12
150	118027	宏图转债	6,921,332.15	0.12
151	113619	世运转债	6,855,987.10	0.12
152	127033	中装转 2	6,749,556.06	0.12
153	111000	起帆转债	6,731,180.89	0.12
154	128130	景兴转债	6,678,934.60	0.11
155	123114	三角转债	6,673,044.39	0.11
156	113017	吉视转债	6,550,771.46	0.11
157	110084	贵燃转债	6,543,787.03	0.11
158	127029	中钢转债	6,541,069.46	0.11
159	113636	甬金转债	6,521,605.30	0.11
160	113545	金能转债	6,494,765.41	0.11
161	113631	皖天转债	6,467,347.02	0.11
162	123170	南电转债	6,457,998.16	0.11
163	113596	城地转债	6,356,221.49	0.11
164	128083	新北转债	6,346,111.10	0.11
165	113644	艾迪转债	6,286,005.67	0.11
166	113633	科沃转债	6,218,011.63	0.11
167	127017	万青转债	6,212,732.48	0.11
168	123099	普利转债	6,159,502.07	0.11
169	127014	北方转债	6,153,473.30	0.11
170	128132	交建转债	6,140,999.39	0.10
171	111007	永和转债	6,140,161.42	0.10
172	128144	利民转债	6,133,351.97	0.10
173	127031	洋丰转债	6,112,706.53	0.10
174	123179	立高转债	6,096,046.76	0.10
175	123104	卫宁转债	6,073,301.69	0.10
176	123113	仙乐转债	6,058,698.58	0.10
177	128023	亚太转债	6,021,498.74	0.10
178	123117	健帆转债	6,006,445.90	0.10
179	123121	帝尔转债	5,913,670.48	0.10

180	118003	华兴转债	5,910,411.88	0.10
181	113640	苏利转债	5,894,818.59	0.10
182	127075	百川转 2	5,843,596.23	0.10
183	128119	龙大转债	5,795,236.87	0.10
184	128133	奇正转债	5,793,330.77	0.10
185	118028	会通转债	5,792,953.65	0.10
186	127053	豪美转债	5,781,896.93	0.10
187	113634	珀莱转债	5,765,094.70	0.10
188	127065	瑞鹄转债	5,763,069.72	0.10
189	128127	文科转债	5,723,646.22	0.10
190	118000	嘉元转债	5,704,007.42	0.10
191	123035	利德转债	5,649,213.28	0.10
192	127015	希望转债	5,615,595.62	0.10
193	123120	隆华转债	5,583,650.33	0.10
194	113563	柳药转债	5,565,233.38	0.10
195	123146	中环转 2	5,513,274.63	0.09
196	113549	白电转债	5,470,715.90	0.09
197	110060	天路转债	5,437,939.86	0.09
198	123172	漱玉转债	5,433,424.67	0.09
199	113637	华翔转债	5,397,391.35	0.09
200	113658	密卫转债	5,391,286.58	0.09
201	118026	利元转债	5,363,263.36	0.09
202	113519	长久转债	5,350,209.05	0.09
203	123165	回天转债	5,316,682.12	0.09
204	123049	维尔转债	5,249,373.18	0.09
205	113627	太平转债	5,238,106.83	0.09
206	127076	中宠转 2	5,181,295.98	0.09
207	113656	嘉诚转债	5,146,370.93	0.09
208	128128	齐翔转 2	5,108,355.11	0.09
209	123076	强力转债	5,107,788.04	0.09
210	118021	新致转债	5,106,977.16	0.09
211	111004	明新转债	5,078,023.04	0.09
212	127068	顺博转债	5,064,038.36	0.09
213	123071	天能转债	5,015,222.98	0.09
214	128121	宏川转债	4,939,081.10	0.08
215	123092	天壕转债	4,814,544.50	0.08
216	128105	长集转债	4,809,501.13	0.08
217	113650	博 22 转债	4,807,734.62	0.08
218	128142	新乳转债	4,805,419.07	0.08
219	127019	国城转债	4,799,793.86	0.08
220	113505	杭电转债	4,799,448.86	0.08
221	113609	永安转债	4,785,151.32	0.08
222	118005	天奈转债	4,757,311.07	0.08

223	123078	飞凯转债	4,755,888.74	0.08
224	123004	铁汉转债	4,747,351.98	0.08
225	113663	新化转债	4,728,887.11	0.08
226	111002	特纸转债	4,723,701.55	0.08
227	127042	嘉美转债	4,716,764.63	0.08
228	123164	法本转债	4,669,235.44	0.08
229	113653	永 22 转债	4,650,350.27	0.08
230	111011	冠盛转债	4,646,505.70	0.08
231	123133	佩蒂转债	4,639,429.08	0.08
232	123182	广联转债	4,626,626.06	0.08
233	123096	思创转债	4,607,891.18	0.08
234	118033	华特转债	4,576,249.58	0.08
235	113534	鼎胜转债	4,555,743.95	0.08
236	127028	英特转债	4,526,713.39	0.08
237	123131	奥飞转债	4,525,361.07	0.08
238	128074	游族转债	4,513,759.86	0.08
239	113530	大丰转债	4,506,337.56	0.08
240	128087	孚日转债	4,485,208.82	0.08
241	123063	大禹转债	4,459,420.67	0.08
242	127026	超声转债	4,456,147.74	0.08
243	128137	洁美转债	4,450,974.40	0.08
244	123151	康医转债	4,446,417.24	0.08
245	118032	建龙转债	4,416,531.99	0.08
246	123101	拓斯转债	4,403,684.92	0.08
247	113588	润达转债	4,381,937.79	0.07
248	128075	远东转债	4,379,997.53	0.07
249	113604	多伦转债	4,347,359.90	0.07
250	111009	盛泰转债	4,339,893.81	0.07
251	128063	未来转债	4,336,283.90	0.07
252	127034	绿茵转债	4,310,755.64	0.07
253	123181	亚康转债	4,305,652.30	0.07
254	113654	永 02 转债	4,279,674.59	0.07
255	123132	回盛转债	4,277,205.04	0.07
256	113621	彤程转债	4,266,037.19	0.07
257	128044	岭南转债	4,251,367.58	0.07
258	127035	濮耐转债	4,229,685.88	0.07
259	123147	中辰转债	4,225,386.75	0.07
260	118008	海优转债	4,216,027.64	0.07
261	127078	优彩转债	4,194,869.85	0.07
262	123118	惠城转债	4,191,672.30	0.07
263	113651	松霖转债	4,154,001.00	0.07
264	128124	科华转债	4,136,459.26	0.07
265	123085	万顺转 2	4,098,612.81	0.07

266	111005	富春转债	4,060,514.40	0.07
267	110074	精达转债	4,038,371.47	0.07
268	123162	东杰转债	4,017,406.68	0.07
269	113639	华正转债	4,017,064.75	0.07
270	127041	弘亚转债	4,017,045.40	0.07
271	123129	锦鸡转债	4,002,645.95	0.07
272	113629	泉峰转债	3,978,585.19	0.07
273	128116	瑞达转债	3,951,854.88	0.07
274	127069	小熊转债	3,943,826.02	0.07
275	113667	春 23 转债	3,933,849.75	0.07
276	123144	裕兴转债	3,900,815.96	0.07
277	113638	台 21 转债	3,900,702.70	0.07
278	127060	湘佳转债	3,882,037.08	0.07
279	118020	芳源转债	3,880,015.59	0.07
280	113606	荣泰转债	3,872,415.58	0.07
281	113542	好客转债	3,870,652.33	0.07
282	113584	家悦转债	3,865,554.41	0.07
283	113625	江山转债	3,855,576.29	0.07
284	111001	山玻转债	3,849,403.68	0.07
285	123091	长海转债	3,842,365.57	0.07
286	113582	火炬转债	3,778,459.63	0.06
287	123122	富瀚转债	3,768,217.36	0.06
288	123064	万孚转债	3,763,829.88	0.06
289	127055	精装转债	3,763,057.50	0.06
290	127054	双箭转债	3,760,377.25	0.06
291	128037	岩土转债	3,704,484.48	0.06
292	123056	雪榕转债	3,689,858.47	0.06
293	123142	申昊转债	3,670,570.54	0.06
294	127072	博实转债	3,653,127.01	0.06
295	127081	中旗转债	3,625,430.37	0.06
296	113591	胜达转债	3,607,033.02	0.06
297	123157	科蓝转债	3,526,206.44	0.06
298	123154	火星转债	3,504,495.50	0.06
299	128017	金禾转债	3,493,886.26	0.06
300	111013	新港转债	3,488,668.61	0.06
301	113664	大元转债	3,486,139.70	0.06
302	113535	大业转债	3,441,815.03	0.06
303	123025	精测转债	3,441,025.59	0.06
304	123124	晶瑞转 2	3,422,514.76	0.06
305	127051	博杰转债	3,409,781.48	0.06
306	118012	微芯转债	3,408,603.05	0.06
307	113589	天创转债	3,394,408.41	0.06
308	113662	豪能转债	3,388,017.65	0.06

309	128095	恩捷转债	3,387,844.80	0.06
310	113504	艾华转债	3,341,087.91	0.06
311	118011	银微转债	3,340,405.15	0.06
312	123177	测绘转债	3,335,990.67	0.06
313	127077	华宏转债	3,327,195.99	0.06
314	113601	塞力转债	3,301,346.32	0.06
315	111012	福新转债	3,191,361.85	0.05
316	113643	风语转债	3,190,498.70	0.05
317	113649	丰山转债	3,157,333.72	0.05
318	127071	天箭转债	3,142,109.69	0.05
319	123090	三诺转债	3,119,900.38	0.05
320	118014	高测转债	3,113,148.56	0.05
321	123044	红相转债	3,088,597.88	0.05
322	123082	北陆转债	3,022,404.05	0.05
323	123168	惠云转债	3,004,986.59	0.05
324	113657	再 22 转债	3,003,232.40	0.05
325	113579	健友转债	3,001,191.49	0.05
326	113600	新星转债	2,983,667.74	0.05
327	113569	科达转债	2,979,202.34	0.05
328	113660	寿 22 转债	2,960,483.67	0.05
329	128106	华统转债	2,939,478.35	0.05
330	123127	耐普转债	2,924,559.51	0.05
331	118004	博瑞转债	2,905,186.45	0.05
332	113618	美诺转债	2,836,124.60	0.05
333	128066	亚泰转债	2,829,944.15	0.05
334	123167	商络转债	2,811,135.37	0.05
335	123059	银信转债	2,797,056.92	0.05
336	118009	华锐转债	2,774,297.73	0.05
337	128097	奥佳转债	2,768,719.13	0.05
338	113628	晨丰转债	2,765,311.99	0.05
339	113532	海环转债	2,750,258.70	0.05
340	118029	富淼转债	2,738,829.76	0.05
341	123109	昌红转债	2,722,497.04	0.05
342	123087	明电转债	2,713,660.88	0.05
343	128042	凯中转债	2,682,037.39	0.05
344	123175	百畅转债	2,678,448.81	0.05
345	123050	聚飞转债	2,663,945.82	0.05
346	118018	瑞科转债	2,652,462.08	0.05
347	128125	华阳转债	2,640,562.09	0.05
348	111008	沿浦转债	2,621,392.67	0.04
349	123156	博汇转债	2,605,929.38	0.04
350	113610	灵康转债	2,589,534.14	0.04
351	128138	侨银转债	2,585,298.06	0.04

352	127080	声迅转债	2,555,743.78	0.04
353	123130	设研转债	2,552,323.50	0.04
354	123010	博世转债	2,533,996.74	0.04
355	128049	华源转债	2,512,884.03	0.04
356	123048	应急转债	2,446,619.17	0.04
357	118017	深科转债	2,441,593.28	0.04
358	113608	威派转债	2,416,492.92	0.04
359	118010	洁特转债	2,406,677.17	0.04
360	127007	湖广转债	2,404,547.70	0.04
361	127062	垒知转债	2,403,720.34	0.04
362	110055	伊力转债	2,395,295.34	0.04
363	113593	沪工转债	2,389,501.60	0.04
364	118015	芯海转债	2,379,561.03	0.04
365	123100	朗科转债	2,362,357.10	0.04
366	127079	华亚转债	2,349,067.08	0.04
367	123171	共同转债	2,320,079.31	0.04
368	127059	永东转 2	2,305,128.76	0.04
369	113624	正川转债	2,297,571.67	0.04
370	128026	众兴转债	2,291,274.70	0.04
371	110052	贵广转债	2,255,989.32	0.04
372	123160	泰福转债	2,202,324.89	0.04
373	123141	宏丰转债	2,194,557.65	0.04
374	128117	道恩转债	2,187,146.96	0.04
375	110058	永鼎转债	2,176,923.45	0.04
376	113524	奇精转债	2,170,031.63	0.04
377	123153	英力转债	2,146,949.49	0.04
378	118016	京源转债	2,125,888.01	0.04
379	113039	嘉泽转债	2,115,487.89	0.04
380	113665	汇通转债	2,111,819.30	0.04
381	123155	中陆转债	2,087,480.88	0.04
382	113598	法兰转债	2,073,186.28	0.04
383	113597	佳力转债	2,036,906.93	0.03
384	128123	国光转债	2,025,146.58	0.03
385	123126	瑞丰转债	2,009,696.75	0.03
386	123089	九洲转 2	2,008,076.28	0.03
387	113594	淳中转债	2,000,633.78	0.03
388	128025	特一转债	1,979,632.31	0.03
389	128090	汽模转 2	1,979,321.66	0.03
390	123163	金沃转债	1,972,211.04	0.03
391	128122	兴森转债	1,969,299.84	0.03
392	128101	联创转债	1,959,815.20	0.03
393	123166	蒙泰转债	1,934,492.67	0.03
394	123180	浙矿转债	1,934,122.44	0.03

395	123106	正丹转债	1,931,433.17	0.03
396	123152	润禾转债	1,915,707.52	0.03
397	123088	威唐转债	1,906,167.90	0.03
398	123022	长信转债	1,873,054.76	0.03
399	128071	合兴转债	1,838,656.80	0.03
400	113030	东风转债	1,837,522.34	0.03
401	128072	翔鹭转债	1,816,130.77	0.03
402	123159	崧盛转债	1,787,724.51	0.03
403	128033	迪龙转债	1,765,752.98	0.03
404	128118	瀛通转债	1,757,633.82	0.03
405	118007	山石转债	1,753,317.12	0.03
406	128070	智能转债	1,749,626.72	0.03
407	123112	万讯转债	1,740,127.56	0.03
408	123067	斯莱转债	1,735,231.01	0.03
409	113027	华钰转债	1,710,576.73	0.03
410	113573	纵横转债	1,681,742.29	0.03
411	123138	丝路转债	1,661,861.03	0.03
412	123061	航新转债	1,636,392.00	0.03
413	128143	锋龙转债	1,598,907.64	0.03
414	123093	金陵转债	1,568,061.18	0.03
415	128082	华锋转债	1,540,421.92	0.03
416	113546	迪贝转债	1,538,963.56	0.03
417	123011	德尔转债	1,528,283.42	0.03
418	128021	兄弟转债	1,520,650.29	0.03
419	123054	思特转债	1,511,310.99	0.03
420	123103	震安转债	1,507,758.15	0.03
421	128076	金轮转债	1,467,913.12	0.03
422	113565	宏辉转债	1,416,630.54	0.02
423	123002	国祯转债	1,395,704.22	0.02
424	110070	凌钢转债	1,374,668.93	0.02
425	123065	宝莱转债	1,352,138.70	0.02
426	123039	开润转债	1,347,824.58	0.02
427	113574	华体转债	1,252,766.90	0.02
428	128039	三力转债	1,224,407.45	0.02
429	123080	海波转债	1,086,753.02	0.02
430	123143	胜蓝转债	494,189.44	0.01
431	118006	阿拉转债	254,784.36	0.00
432	113537	文灿转债	236,955.58	0.00
433	113577	春秋转债	142,498.44	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	277,786,670.00
报告期期间基金总申购份额	244,800,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	4,000,000.00
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	518,586,670.00

§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 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
二〇二三年十月二十五日