

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 年中期报告  
2023 年 6 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：二〇二三年八月三十一日

## § 1 重要提示及目录

---

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>1</b>
1.1 重要提示 .....	1
1.2 目录 .....	2
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>4</b>
2.1 基金基本情况 .....	4
2.2 基金产品说明 .....	4
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	4
2.4 信息披露方式 .....	5
2.5 其他相关资料 .....	5
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>5</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	5
3.2 基金净值表现 .....	6
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>6</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....	11
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 .....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 .....	11
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>11</b>
6.1 资产负债表 .....	11
6.2 利润表 .....	13
6.3 净资产（基金净值）变动表 .....	14
6.4 报表附注 .....	16
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>32</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	32
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	32
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	33
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	33
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	34
7.6 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 .....	34
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	35
7.8 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贵金属投资明细 .....	35
7.9 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 .....	35
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	35
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	35

7.12 投资组合报告附注 .....	35
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>46</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	46
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	46
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	46
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	47
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>47</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>47</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	47
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	47
10.4 基金投资策略的改变 .....	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	48
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	48
10.8 其他重大事件 .....	49
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>50</b>
11.1 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.....	50
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	50
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>50</b>
12.1 备查文件目录 .....	50
12.2 存放地点 .....	51
12.3 查阅方式 .....	51

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	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
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
报告期末基金份额总额	277,786,670.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2020 年 4 月 7 日

### 2.2 基金产品说明

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。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		博时基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孙麒清	张姗
	联系电话	0755-83169999	0755-83077987

电子邮箱	service@bosera.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话	95105568	95555
传真	0755-83195140	0755-83195201
注册地址	深圳市福田区莲花街道福新社区益田路5999号基金大厦21层	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址	广东省深圳市福田区益田路5999号基金大厦21层	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码	518040	518040
法定代表人	江向阳	缪建民

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.bosera.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	4,334,123.58
本期利润	77,899,516.73
加权平均基金份额本期利润	0.3534
本期加权平均净值利润率	3.12%
本期基金份额净值增长率	3.34%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	368,460,606.94
期末可供分配基金份额利润	1.3264
期末基金资产净值	3,146,327,467.60
期末基金份额净值	11.3264
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	13.26%

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。

期末可供分配利润是指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

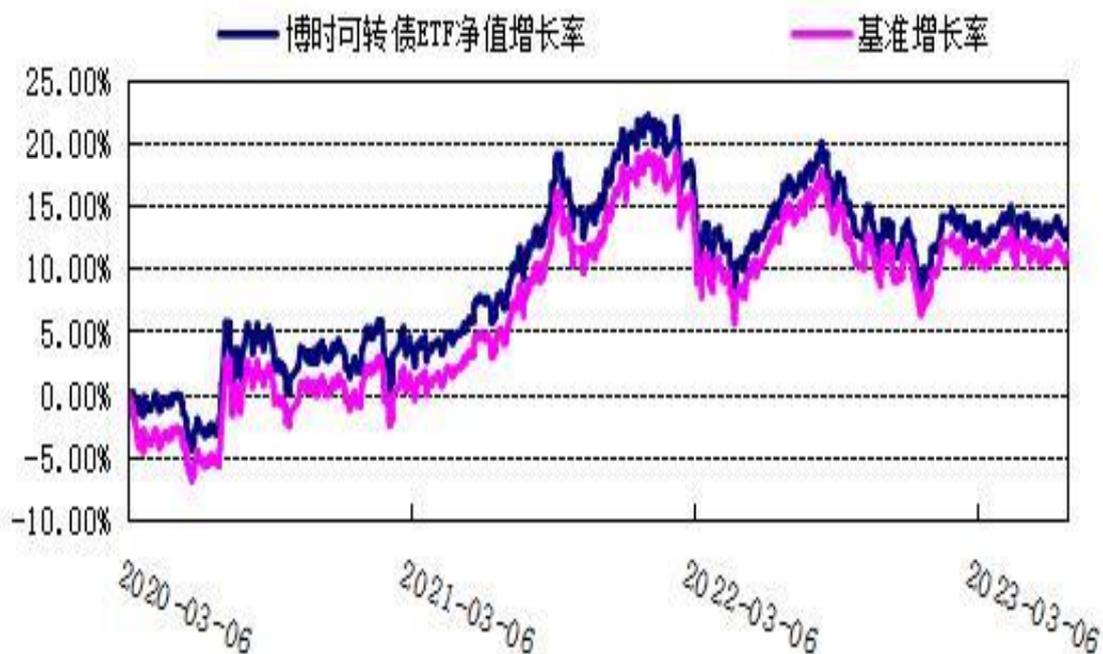
上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	0.71%	0.32%	0.85%	0.32%	-0.14%	0.00%
过去三个月	0.05%	0.38%	0.11%	0.39%	-0.06%	-0.01%
过去六个月	3.34%	0.37%	3.54%	0.38%	-0.20%	-0.01%
过去一年	-2.81%	0.43%	-2.69%	0.44%	-0.12%	-0.01%
过去三年	16.46%	0.57%	17.49%	0.56%	-1.03%	0.01%
自基金合同生效起至今	13.26%	0.55%	11.39%	0.55%	1.87%	0.00%

#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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 基金管理人及基金经理情况

### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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 6 月 30 日，博时基金公司共管理 355 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 14767 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 5220 亿元人民币，累计分红逾 1851 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。

### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）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	-	14.9	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日一至今)、博时转债增强债券型证券投资基金(2019年4月25日一至今)、博时稳定价值债券投资基金(2020年2月24日一至今)、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日一至今)、博时鑫荣稳健混合型证券投资基金(2021年12月9日一至今)、博时恒兴一年定期开放混合型证券投资基金(2021年12月9日一至今)、博时恒瑞混合型证券投资基金(2022年2月24日一至今)、博时恒享债券型证券投资基金(2023年3月30日一至今)、博时稳健增利债券型证券投资基金(2023年6月20日一至今)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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 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 89 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年中债总财富指数上涨 2.55%，中证转债指数上涨 3.37%，万得全 A 指数上涨 3.06%，本基金跟踪的中证转债及可交债指数上涨 3.54%。回顾上半年国内宏观运行情况，可以观察到市场预期差体现在经济复苏强度方面。今年国内经济基本面经历年初“强预期”到如今“弱预期”，4 月份以来增长预期持续下修，特别是 5 月份经济高频数据走弱进一步降低了市场的预期。6 月份后对稳增长政策的讨论开始增加，经济预期可能得以企稳回升。在此背景下，上半年金融资产经历了一季度的股强债弱和二季度的债强股弱走势。具体来看，年初债券收益率普遍上行，春节后利率债处于震荡状态，信用利差开始压缩，两会后长端利率债收益率开启下行趋势，6 月上旬央行调降公开市场操作方面的政策利率，如 1 年 MLF 利率下行 10bp 到 2.65%，债券收益率超预期下行。目前 10 年国债收益率基本围绕 1 年期 MLF 利率窄幅波动。股市方面结构性行情很突出，人工智能和中特估成为市场阶段性的两条主线，6 月份开始对稳增长政策预期的驱动下，周期相关的板块开始见底回升。在偏弱的股市环境下，转债市场自年初上涨后基本上处于横盘震荡状况，机会更依赖正股所处行业结构选择和个券挖掘。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。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 06 月 30 日，本基金基金份额净值为 11.3264 元，份额累计净值为 1.1326 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为 3.34%，同期业绩基准增长率为 3.54%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，我们预判经济在下半年会逐步向上，企业盈利会得以提升，当前对经济悲观预期反应较充分的权益市场是否会迎来一波震荡上行行情，我们倾向于认为机会大于风险，而债券市场所处境界较为尴尬，短期基本面相对友好但后续边际效应可能逐渐往不利方向发展，且当前债市赔率不足，因此对债市持中性态度并多一份谨慎，在调整中寻找机会。可转债市场的问题在于估值偏高，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。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，设立了博时基金管理有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），制定了估值政策和估值程序。估值委员会成员由主管运营的公司领导、督察长、投资总监、研究部负责人、运作部负责人等成员组成，基金经理原则上不参与估值委员会的工作，其估值建议经估值委员会成员评估后审慎采用。估值委员会成员均具有 5 年以上专业工作经历，具备良好的专业经验和专业胜任能力，具有绝对的独立性。估值委员会的职责主要包括有：保证基金估值的公平、合理；制订健全、有效的估值政策和程序；确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性；定期对估值政策和程序进行评价等。

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管银行有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未进行收益分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 5 托管人报告

---

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

---

#### 6.1 资产负债表

会计主体：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

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.3.1	44,007,857.44	63,194,196.44
结算备付金		3,605,535.78	3,408,276.44
存出保证金		90,010.13	56,012.14
交易性金融资产	6.4.3.2	3,089,022,062.45	2,157,716,175.09
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		3,089,022,062.45	2,157,716,175.09
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	54,387,441.92	26,992,235.62
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资	6.4.3.5	-	-
应收清算款		44,108.31	45,777.02
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	75,616.24	-
资产总计		3,191,232,632.27	2,251,412,672.75
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年6月30日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		43,765,594.86	43,499,988.03
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		366,338.20	245,202.67
应付托管费		122,112.72	81,734.24
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		30,001.27	18,009.66
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.7	621,117.62	321,119.13

负债合计		44,905,164.67	44,166,053.73
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.3.8	2,777,866,860.66	2,013,866,816.31
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.3.9	368,460,606.94	193,379,802.71
净资产合计		3,146,327,467.60	2,207,246,619.02
<b>负债和净资产总计</b>		<b>3,191,232,632.27</b>	<b>2,251,412,672.75</b>

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 11.3264 元，基金份额总额 277,786,670.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：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

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年1月1日至2023 年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30 日
<b>一、营业总收入</b>		80,831,357.53	-28,139,676.63
1. 利息收入		512,350.85	70,883.24
其中：存款利息收入	6.4.3.10	87,282.42	23,571.67
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		425,068.43	47,311.57
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		5,610,358.07	15,196,529.34
其中：股票投资收益	6.4.3.11	342,073.82	-86,111.14
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.12	5,268,284.25	15,282,640.48
资产支持证券投资收益	6.4.3.13	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.3.14	-	-
股利收益	6.4.3.15	-	-
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益（若有）		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.16	73,565,393.15	-44,564,977.18
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	1,143,255.46	1,157,887.97

<b>减：二、营业总支出</b>		2,931,840.80	1,018,712.52
1. 管理人报酬		1,853,629.11	574,450.63
2. 托管费		617,876.33	191,483.53
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.3.18	-	-
7. 税金及附加		15,645.31	4,163.54
8. 其他费用	6.4.3.19	444,690.05	248,614.82
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		77,899,516.73	-29,158,389.15
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		77,899,516.73	-29,158,389.15
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		77,899,516.73	-29,158,389.15

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：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

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 （基金净值）	2,013,866,816.31	-	193,379,802.71	2,207,246,619.02
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 （基金净值）	2,013,866,816.31	-	193,379,802.71	2,207,246,619.02
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填 列）	764,000,044.35	-	175,080,804.23	939,080,848.58
（一）、综合收益总 额	-	-	77,899,516.73	77,899,516.73
（二）、本期基金份 额交易产生的基金	764,000,044.35	-	97,181,287.50	861,181,331.85

净值变动数（净值减少以“-”号填列）				
其中：1. 基金申购款	1,087,000,062.98	-	140,741,424.59	1,227,741,487.57
2. 基金赎回款	-323,000,018.63	-	-43,560,137.09	-366,560,155.72
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	2,777,866,860.66	-	368,460,606.94	3,146,327,467.60
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	实收基金	其他综合收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	527,866,730.67	-	115,776,857.05	643,643,587.72
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	527,866,730.67	-	115,776,857.05	643,643,587.72
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	116,000,006.33	-	-9,272,508.28	106,727,498.05
（一）、综合收益总额	-	-	-29,158,389.15	-29,158,389.15
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	116,000,006.33	-	19,885,880.87	135,885,887.20
其中：1. 基金申购款	307,000,017.38	-	47,896,729.19	354,896,746.57
2. 基金赎回款	-191,000,011.05	-	-28,010,848.32	-219,010,859.37
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以	-	-	-	-

“-”号填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	643,866,737.00	-	106,504,348.77	750,371,085.77

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：江向阳，主管会计工作负责人：徐卫，会计机构负责人：倡方方

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全

额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

### 6.4.3 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
活期存款	44,007,857.44
等于：本金	44,004,255.88
加：应计利息	3,601.56
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	44,007,857.44

#### 6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-

债券	交易所市场	3,085,429,482.36	11,227,196.65	3,089,022,062.45	-7,634,616.56
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	3,085,429,482.36	11,227,196.65	3,089,022,062.45	-7,634,616.56
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		3,085,429,482.36	11,227,196.65	3,089,022,062.45	-7,634,616.56

#### 6.4.3.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.3.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无余额。

##### 6.4.3.4 买入返售金融资产

##### 6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	54,387,441.92	-
银行间市场	-	-
合计	54,387,441.92	-

##### 6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

##### 6.4.3.5 其他权益工具投资

##### 6.4.3.5.1 其他权益工具投资情况

无。

##### 6.4.3.5.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

##### 6.4.3.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应收利息	-

其他应收款	-
待摊费用	75,616.24
合计	75,616.24

#### 6.4.3.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	16,632.63
其中：交易所市场	16,632.63
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	104,138.35
应付指数使用费	450,429.65
应付 IOPV 计算与发布费	49,916.99
合计	621,117.62

#### 6.4.3.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	201,386,670.00	2,013,866,816.31
本期申购	108,700,000.00	1,087,000,062.98
本期赎回（以“-”号填列）	-32,300,000.00	-323,000,018.63
本期末	277,786,670.00	2,777,866,860.66

注：申购含红利再投、转换入、级别调整入份额；赎回含转换出、级别调整出份额（如适用）。

#### 6.4.3.9 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	277,603,205.17	-84,223,402.46	193,379,802.71
本期利润	4,334,123.58	73,565,393.15	77,899,516.73
本期基金份额交易产生的变动数	106,734,452.02	-9,553,164.52	97,181,287.50
其中：基金申购款	151,286,224.94	-10,544,800.35	140,741,424.59
基金赎回款	-44,551,772.92	991,635.83	-43,560,137.09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	388,671,780.77	-20,211,173.83	368,460,606.94

**6.4.3.10 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	47,348.72
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	39,284.88
其他	648.82
合计	87,282.42

**6.4.3.11 股票投资收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	37,337,309.55
减：卖出股票成本总额	36,927,655.77
减：交易费用	67,579.96
买卖股票差价收入	342,073.82

**6.4.3.12 债券投资收益**
**6.4.3.12.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	9,505,178.71
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-4,236,894.46
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	5,268,284.25

**6.4.3.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	752,729,355.40
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	752,716,081.47
减：应计利息总额	4,160,803.61
减：交易费用	89,364.78

买卖债券差价收入	-4,236,894.46
----------	---------------

**6.4.3.12.3 债券投资收益——赎回差价收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
赎回基金份额对价总额	366,560,155.72
减：现金支付赎回款总额	366,560,155.72
减：赎回债券成本总额	-
减：赎回债券应计利息总额	-
减：交易费用	-
赎回差价收入	-

**6.4.3.13 资产支持证券投资收益**
**6.4.3.13.1 资产支持证券投资收益项目构成**

无发生额。

**6.4.3.13.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入**

无发生额。

**6.4.3.14 衍生工具收益**
**6.4.3.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

无发生额。

**6.4.3.14.2 衍生工具收益——其他投资收益**

无发生额。

**6.4.3.15 股利收益**

无发生额。

**6.4.3.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	73,565,393.15
——股票投资	-
——债券投资	73,565,393.15
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-

减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	73,565,393.15

#### 6.4.3.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	1,143,255.46
合计	1,143,255.46

#### 6.4.3.18 信用减值损失

无发生额。

#### 6.4.3.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	44,630.98
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
指数使用费	247,150.57
中登注册登记费	74,383.76
银行汇划费	9,100.38
IOPV 计算与发布费	9,916.99
合计	444,690.05

### 6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.4.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

#### 6.4.4.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无须披露的资产负债表日后事项。

### 6.4.5 关联方关系

#### 6.4.5.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

#### 6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
博时基金管理有限公司(“博时基金”)	基金管理人

招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人
招商证券股份有限公司（“招商证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
博时财富基金销售有限公司（“博时财富”）	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.6.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
招商证券	11,468,621.40	30.72%	-	-

###### 6.4.6.1.2 权证交易

无。

###### 6.4.6.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
招商证券	1,032,769,961.26	44.65%	-	-

###### 6.4.6.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
招商证券	1,146,700,000.00	27.88%	-	-

###### 6.4.6.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券	8,387.00	30.72%	3,458.21	20.79%

关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额 的比例
-	-	-	-	-

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 6.4.6.2 关联方报酬

##### 6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,853,629.11	574,450.63
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：支付基金管理人博时基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.15% / 当年天数。

##### 6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	617,876.33	191,483.53

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.05% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.05% / 当年天数。

#### 6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 6.4.6.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.6.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

##### 6.4.6.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

#### 6.4.6.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.6.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

##### 6.4.6.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
招商证券	391,405.00	0.14%	95,237.00	0.05%

注：1. 除基金管理人之外的其他关联方投资本基金适用的交易费率与本基金法律文件规定一致。  
 2. 持有的基金份额占基金总份额的比例为四舍五入后的结果。

#### 6.4.6.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行-活期存款	44,007,857.44	47,348.72	6,461,386.46	15,372.52

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行活期利率/银行同业利率/约定利率计息。

#### 6.4.6.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.6.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.7 利润分配情况

无。

#### 6.4.8 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

##### 6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

##### 6.4.8.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

## 6.4.9 金融工具风险及管理

### 6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

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。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

本基金的基金管理人建立了董事会领导，以风险管理委员会为核心的，由总经理、督察长、监察法律部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，董事会负责制定公司的风险管理政策，对风险管理负完全的和最终的责任；在董事会下设立风险管理委员会，负责批准公司风险管理系统文件和批准每一个部门的风险级别，以及负责解决重大的突发的风险；督察长独立行使督察权利，直接对董事会负责，向风险管理委员会提交独立的风险管理报告和风险管理建议；监察法律部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；风险管理部负责建立和完善公司投资风险管理制度与流程，组织实施公司投资风险管理与绩效分析工作，确保公司各类投资风险得到良好监督与控制。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

### 6.4.9.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人，定期存款存放在具有证券投资基金托管资格、基金销售业务资格或合格境外机构投资者托管人资格的银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易主要以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，本基金的基金管理人管理的基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进

行动态调整，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

#### 6.4.9.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

#### 6.4.9.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.9.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 6.4.9.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年6月30日	上年末 2022年12月31日
AAA	1,448,464,157.26	1,180,469,010.85
AAA 以下	1,640,559,175.62	977,238,822.40
未评级	-	-
合计	3,089,023,332.88	2,157,707,833.25

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。2. 未评级债券为国债、政策性金融债、央票及无第三方机构评级的债券。

#### 6.4.9.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.9.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

### 6.4.9.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险来自调整基金投资组合时，由于组合资产流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

于本期末，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息。本基金赎回基金份额采用组合证券形式，流动性风险相对较低。

#### 6.4.9.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内

变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

除附注“期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。在本基金开放日，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于本期末，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 6.4.9.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.9.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年6月30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	44,007,857.44	-	-	-	44,007,857.44
结算备付金	3,605,535.78	-	-	-	3,605,535.78
存出保证金	90,010.13	-	-	-	90,010.13
交易性金融资产	182,014,505.16	2,316,348,370.98	590,659,186.31	-	3,089,022,062.45
应收清算款	-	-	-	44,108.31	44,108.31
买入返售金融资产	54,387,441.92	-	-	-	54,387,441.92

应收申购款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	75,616.24	75,616.24
<b>资产总计</b>	<b>284,105,350.43</b>	<b>2,316,348,370.98</b>	<b>590,659,186.31</b>	<b>119,724.55</b>	<b>3,191,232,632.27</b>
<b>负债</b>					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	43,765,594.86	43,765,594.86
应付管理人报酬	-	-	-	366,338.20	366,338.20
应付托管费	-	-	-	122,112.72	122,112.72
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	30,001.27	30,001.27
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	621,117.62	621,117.62
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>44,905,164.67</b>	<b>44,905,164.67</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>284,105,350.43</b>	<b>2,316,348,370.98</b>	<b>590,659,186.31</b>	<b>-44,785,440.12</b>	<b>3,146,327,467.60</b>
<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
<b>资产</b>					
银行存款	63,194,196.44	-	-	-	63,194,196.44
结算备付金	3,408,276.44	-	-	-	3,408,276.44
存出保证金	56,012.14	-	-	-	56,012.14
交易性金融资产	161,307,418.15	1,535,548,055.38	460,860,701.56	-	2,157,716,175.09
应收清算款	-	-	-	45,777.02	45,777.02
买入返售金融资产	26,992,235.62	-	-	-	26,992,235.62
应收申购款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
<b>资产总计</b>	<b>254,958,138.79</b>	<b>1,535,548,055.38</b>	<b>460,860,701.56</b>	<b>45,777.02</b>	<b>2,251,412,672.75</b>
<b>负债</b>					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	43,499,988.03	43,499,988.03
应付管理人报酬	-	-	-	245,202.67	245,202.67
应付托管费	-	-	-	81,734.24	81,734.24

应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	18,009.66	18,009.66
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	321,119.13	321,119.13
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>44,166,053.73</b>	<b>44,166,053.73</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>254,958,138.79</b>	<b>1,535,548,055.38</b>	<b>460,860,701.56</b>	<b>-44,120,276.71</b>	<b>2,207,246,619.02</b>

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本期末本基金未持有交易性债券投资和资产支持证券投资（不包括可转债和可交换债），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上期：同）。

#### 6.4.9.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.9.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	-	-	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	3,089,022,062.45	98.18	2,157,716,175.09	97.76
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

合计	3,089,022,06 2.45	98.18	2,157,716,1 75.09	97.76
----	----------------------	-------	----------------------	-------

注：1、债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

2、其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注“衍生金融资产/负债”)。在当日无负债结算制度下,期货投资于相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵扣后的净额为0。

#### 6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额(单位:人民币万元)	
		本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
	业绩比较基准上升5%	增加约6,021	增加约3,975
	业绩比较基准下降5%	减少约6,021	减少约3,975

### 6.4.10 公允价值

#### 6.4.10.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 6.4.10.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.10.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位:人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年6月30日
第一层次	3,085,605,746.90
第二层次	3,416,315.55
第三层次	-
合计	3,089,022,062.45

##### 6.4.10.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的证券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关证券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### 6.4.10.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

#### 6.4.10.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 6.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	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	3,089,022,062.45	96.80
	其中：债券	3,089,022,062.45	96.80
	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	54,387,441.92	1.70
	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	47,613,393.22	1.49
8	其他各项资产	209,734.68	0.01
9	合计	3,191,232,632.27	100.00

注：债券投资项包含可退替代款估值增值。

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601117	中国化学	9,127,568.71	0.41
2	605133	嵘泰股份	5,410,660.38	0.25
3	600420	国药现代	4,176,835.70	0.19
4	601900	南方传媒	3,148,012.94	0.14
5	300229	拓尔思	2,496,743.40	0.11
6	603298	杭叉集团	1,865,310.42	0.08
7	300682	朗新科技	1,830,610.90	0.08
8	002368	太极股份	1,815,955.00	0.08
9	300723	一品红	1,686,081.76	0.08
10	300170	汉得信息	1,341,973.05	0.06
11	300827	上能电气	1,171,682.33	0.05
12	000070	特发信息	685,301.32	0.03
13	300586	美联新材	642,047.22	0.03
14	002953	日丰股份	619,024.56	0.03
15	603331	百达精工	608,121.46	0.03
16	603617	君禾股份	202,454.37	0.01
17	002758	浙农股份	99,272.25	0.00

注：本项“买入金额”均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601117	中国化学	9,114,876.38	0.41
2	605133	嵘泰股份	5,247,110.39	0.24
3	600420	国药现代	4,269,170.12	0.19
4	601900	南方传媒	3,464,746.00	0.16
5	300229	拓尔思	2,835,252.11	0.13
6	300682	朗新科技	1,881,244.20	0.09
7	002368	太极股份	1,856,574.00	0.08
8	603298	杭叉集团	1,796,886.75	0.08
9	300723	一品红	1,602,897.51	0.07
10	300170	汉得信息	1,258,592.35	0.06

11	300827	上能电气	1,163,214.20	0.05
12	000070	特发信息	704,119.34	0.03
13	300586	美联新材	617,256.01	0.03
14	002953	日丰股份	614,357.24	0.03
15	603331	百达精工	609,115.12	0.03
16	603617	君禾股份	200,191.65	0.01
17	002758	浙农股份	101,706.18	0.00

注：本项“卖出金额”均按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	36,927,655.77
卖出股票的收入（成交）总额	37,337,309.55

注：本项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	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）	3,089,022,062.45	98.18
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,089,022,062.45	98.18

注：上述可转债（可交换债）投资项包含可退替代款估值增值。

### 7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110059	浦发转债	1,469,050	158,797,462.86	5.05
2	113052	兴业转债	1,484,670	151,011,480.33	4.80
3	113021	中信转债	1,181,850	136,046,639.03	4.32
4	113044	大秦转债	947,000	109,392,899.59	3.48

5	132018	G 三峡 EB1	591,340	83,901,506.35	2.67
---	--------	----------	---------	---------------	------

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

### 7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 7.9 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。

### 7.10 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。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.11.1 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。

### 7.12 投资组合报告附注

#### 7.12.1 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中国银行保险监督管理委员会深圳证监局的处罚。江苏银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国人民银行的处罚。上海浦东发展银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国银行保险监督管理委员会、中国银行保险监督管理委员会九江监管分局、国家外汇管理局上海市分局的处罚。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的处罚。兴业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广东监管局、中国银行保险监督管理委员会嘉兴监管分局的处罚。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。

7.12.2 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。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	90,010.13
2	应收清算款	44,108.31
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	75,616.24
8	其他	-
9	合计	209,734.68

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110059	浦发转债	158,797,462.86	5.05
2	113052	兴业转债	151,011,480.33	4.80
3	113021	中信转债	136,046,639.03	4.32
4	113044	大秦转债	109,392,899.59	3.48
5	132018	G 三峡 EB1	83,901,506.35	2.67
6	110053	苏银转债	74,437,230.32	2.37
7	113042	上银转债	63,940,036.31	2.03
8	113050	南银转债	55,481,311.81	1.76
9	110079	杭银转债	51,201,684.92	1.63
10	110085	通 22 转债	43,863,669.57	1.39
11	113056	重银转债	39,078,777.16	1.24
12	127045	牧原转债	33,359,000.42	1.06
13	132026	G 三峡 EB2	32,422,077.53	1.03
14	113057	中银转债	30,092,140.32	0.96
15	123107	温氏转债	28,771,129.56	0.91
16	110081	闻泰转债	28,461,996.10	0.90
17	127049	希望转 2	26,943,297.75	0.86
18	110073	国投转债	25,709,497.88	0.82
19	113060	浙 22 转债	25,255,283.46	0.80
20	113641	华友转债	24,578,739.28	0.78
21	113065	齐鲁转债	23,549,246.63	0.75
22	113053	隆 22 转债	22,365,177.16	0.71
23	113055	成银转债	21,850,970.77	0.69
24	110075	南航转债	21,784,883.31	0.69
25	113062	常银转债	20,219,369.70	0.64

26	127018	本钢转债	19,996,104.16	0.64
27	110083	苏租转债	19,006,542.08	0.60
28	127030	盛虹转债	18,690,637.49	0.59
29	127012	招路转债	18,513,503.66	0.59
30	110061	川投转债	18,119,994.79	0.58
31	127032	苏行转债	17,574,512.61	0.56
32	127056	中特转债	16,277,358.72	0.52
33	127005	长证转债	15,868,938.63	0.50
34	128129	青农转债	14,893,450.64	0.47
35	132020	19 蓝星 EB	14,374,666.68	0.46
36	113059	福莱转债	14,181,447.60	0.45
37	113037	紫银转债	13,899,418.28	0.44
38	127040	国泰转债	13,693,746.74	0.44
39	127036	三花转债	12,664,690.62	0.40
40	111010	立昂转债	12,653,211.87	0.40
41	127073	天赐转债	12,589,811.25	0.40
42	113045	环旭转债	12,058,738.19	0.38
43	113043	财通转债	12,020,984.53	0.38
44	113049	长汽转债	11,850,173.59	0.38
45	127058	科伦转债	11,662,924.03	0.37
46	110062	烽火转债	11,304,242.94	0.36
47	127020	中金转债	11,277,083.24	0.36
48	113051	节能转债	11,153,737.81	0.35
49	110045	海澜转债	10,891,526.79	0.35
50	113661	福 22 转债	10,828,336.44	0.34
51	118024	冠宇转债	10,785,733.19	0.34
52	113024	核建转债	10,698,869.54	0.34
53	118022	锂科转债	10,617,654.08	0.34
54	128081	海亮转债	10,609,802.71	0.34
55	110068	龙净转债	10,383,343.56	0.33
56	127061	美锦转债	10,357,202.27	0.33
57	110088	淮 22 转债	10,278,662.89	0.33
58	113061	拓普转债	10,111,863.24	0.32
59	128136	立讯转债	9,964,641.09	0.32
60	110087	天业转债	9,623,907.00	0.31
61	127067	恒逸转 2	9,435,916.34	0.30
62	110091	合力转债	9,423,935.17	0.30
63	110043	无锡转债	9,409,435.81	0.30
64	110072	广汇转债	9,189,633.24	0.29
65	110067	华安转债	9,124,386.07	0.29
66	110089	兴发转债	9,050,481.35	0.29
67	127006	敖东转债	8,837,832.57	0.28
68	128048	张行转债	8,503,176.51	0.27
69	113616	韦尔转债	8,498,664.04	0.27

70	113623	凤 21 转债	8,474,945.26	0.27
71	127050	麒麟转债	8,400,944.40	0.27
72	113048	晶科转债	8,152,508.55	0.26
73	113063	赛轮转债	8,136,810.64	0.26
74	123158	宙邦转债	8,083,983.16	0.26
75	110077	洪城转债	7,588,790.69	0.24
76	113054	绿动转债	7,581,322.39	0.24
77	110047	山鹰转债	7,385,323.82	0.23
78	113655	欧 22 转债	7,152,706.56	0.23
79	113632	鹤 21 转债	7,151,382.39	0.23
80	127063	贵轮转债	7,107,773.37	0.23
81	113058	友发转债	7,073,525.18	0.22
82	110048	福能转债	7,033,224.03	0.22
83	128035	大族转债	6,965,748.43	0.22
84	127027	能化转债	6,930,604.81	0.22
85	123119	康泰转 2	6,814,609.03	0.22
86	110086	精工转债	6,735,341.58	0.21
87	113602	景 20 转债	6,708,034.71	0.21
88	110082	宏发转债	6,694,052.25	0.21
89	110090	爱迪转债	6,592,792.23	0.21
90	113615	金诚转债	6,582,028.44	0.21
91	127039	北港转债	6,549,643.54	0.21
92	128109	楚江转债	6,343,413.27	0.20
93	127038	国微转债	6,330,439.88	0.20
94	113025	明泰转债	6,266,256.98	0.20
95	110063	鹰 19 转债	6,177,974.35	0.20
96	127022	恒逸转债	6,166,060.23	0.20
97	128140	润建转债	6,110,258.05	0.19
98	110076	华海转债	6,012,515.95	0.19
99	123108	乐普转 2	5,986,596.30	0.19
100	110080	东湖转债	5,887,616.00	0.19
101	128134	鸿路转债	5,870,771.72	0.19
102	118023	广大转债	5,842,395.85	0.19
103	113064	东材转债	5,705,026.91	0.18
104	113626	伯特转债	5,685,953.77	0.18
105	128034	江银转债	5,683,502.15	0.18
106	127070	大中转债	5,629,538.85	0.18
107	127066	科利转债	5,626,385.28	0.18
108	127025	冀东转债	5,597,518.71	0.18
109	113033	利群转债	5,596,774.15	0.18
110	123149	通裕转债	5,558,073.36	0.18
111	113047	旗滨转债	5,522,561.48	0.18
112	113647	禾丰转债	5,235,242.12	0.17
113	127064	杭氧转债	5,141,180.15	0.16

114	123169	正海转债	5,110,617.39	0.16
115	118025	奕瑞转债	5,098,238.31	0.16
116	127074	麦米转 2	4,914,197.15	0.16
117	113046	金田转债	4,777,377.34	0.15
118	113652	伟 22 转债	4,777,096.60	0.15
119	127029	中钢转债	4,764,119.17	0.15
120	127024	盈峰转债	4,755,248.63	0.15
121	123150	九强转债	4,739,815.64	0.15
122	128131	崇达转 2	4,675,126.02	0.15
123	118013	道通转债	4,662,901.69	0.15
124	127016	鲁泰转债	4,616,457.25	0.15
125	128108	蓝帆转债	4,610,484.90	0.15
126	113605	大参转债	4,577,578.33	0.15
127	128141	旺能转债	4,563,156.92	0.15
128	128135	洽洽转债	4,559,054.35	0.14
129	123161	强联转债	4,448,193.79	0.14
130	123128	首华转债	4,233,855.38	0.13
131	113516	苏农转债	4,157,427.14	0.13
132	110064	建工转债	4,129,028.53	0.13
133	113659	莱克转债	4,125,929.45	0.13
134	113648	巨星转债	4,103,523.25	0.13
135	127046	百润转债	4,054,362.54	0.13
136	118027	宏图转债	3,992,919.60	0.13
137	127052	西子转债	3,991,395.35	0.13
138	123115	捷捷转债	3,931,735.75	0.12
139	127043	川恒转债	3,904,366.22	0.12
140	123145	药石转债	3,895,078.50	0.12
141	127037	银轮转债	3,860,725.72	0.12
142	127047	帝欧转债	3,860,169.62	0.12
143	111000	起帆转债	3,834,824.94	0.12
144	113619	世运转债	3,803,622.67	0.12
145	110084	贵燃转债	3,757,944.89	0.12
146	123114	三角转债	3,707,177.57	0.12
147	127014	北方转债	3,697,292.54	0.12
148	118019	金盘转债	3,690,024.72	0.12
149	127044	蒙娜转债	3,681,218.89	0.12
150	113644	艾迪转债	3,600,865.57	0.11
151	113017	吉视转债	3,535,345.82	0.11
152	113631	皖天转债	3,511,203.95	0.11
153	128130	景兴转债	3,465,971.87	0.11
154	123104	卫宁转债	3,443,563.44	0.11
155	128083	新北转债	3,428,484.11	0.11
156	123170	南电转债	3,416,315.55	0.11
157	118003	华兴转债	3,407,505.34	0.11

158	113633	科沃转债	3,391,452.49	0.11
159	113636	甬金转债	3,374,032.19	0.11
160	113545	金能转债	3,332,366.53	0.11
161	128144	利民转债	3,321,347.02	0.11
162	113534	鼎胜转债	3,298,108.86	0.10
163	113634	珀莱转债	3,295,377.66	0.10
164	113596	城地转债	3,291,703.78	0.10
165	127017	万青转债	3,280,067.31	0.10
166	128023	亚太转债	3,267,451.97	0.10
167	118021	新致转债	3,261,980.36	0.10
168	127031	洋丰转债	3,240,070.72	0.10
169	127033	中装转 2	3,238,344.61	0.10
170	123113	仙乐转债	3,232,135.95	0.10
171	111007	永和转债	3,229,341.75	0.10
172	128119	龙大转债	3,179,037.78	0.10
173	123117	健帆转债	3,163,897.75	0.10
174	128132	交建转债	3,157,754.44	0.10
175	113640	苏利转债	3,148,014.39	0.10
176	123099	普利转债	3,142,632.39	0.10
177	123120	隆华转债	3,141,635.30	0.10
178	123121	帝尔转债	3,132,503.68	0.10
179	113563	柳药转债	3,130,060.69	0.10
180	127075	百川转 2	3,121,612.92	0.10
181	123035	利德转债	3,112,151.80	0.10
182	118000	嘉元转债	3,104,375.60	0.10
183	123146	中环转 2	3,074,856.28	0.10
184	118028	会通转债	3,070,195.41	0.10
185	123092	天壕转债	3,062,153.55	0.10
186	123172	漱玉转债	3,057,370.12	0.10
187	127053	豪美转债	3,035,002.48	0.10
188	128133	奇正转债	3,030,216.34	0.10
189	113658	密卫转债	3,001,321.45	0.10
190	113549	白电转债	2,999,487.69	0.10
191	127015	希望转债	2,998,956.50	0.10
192	113637	华翔转债	2,992,791.66	0.10
193	110060	天路转债	2,958,798.70	0.09
194	128074	游族转债	2,950,627.34	0.09
195	128127	文科转债	2,921,120.75	0.09
196	123075	贝斯转债	2,904,964.47	0.09
197	118026	利元转债	2,902,270.20	0.09
198	123165	回天转债	2,889,086.48	0.09
199	123071	天能转债	2,876,742.45	0.09
200	127076	中宠转 2	2,868,115.60	0.09
201	127019	国城转债	2,857,320.44	0.09

202	127068	顺博转债	2,857,084.84	0.09
203	113663	新化转债	2,789,343.41	0.09
204	113505	杭电转债	2,767,129.39	0.09
205	113627	太平转债	2,760,019.73	0.09
206	123078	飞凯转债	2,756,073.91	0.09
207	113656	嘉诚转债	2,715,535.35	0.09
208	123164	法本转债	2,712,230.07	0.09
209	127069	小熊转债	2,705,832.76	0.09
210	128121	宏川转债	2,683,054.87	0.09
211	128095	恩捷转债	2,678,587.23	0.09
212	113609	永安转债	2,664,353.30	0.08
213	113530	大丰转债	2,659,996.79	0.08
214	113650	博 22 转债	2,654,834.40	0.08
215	128128	齐翔转 2	2,639,377.26	0.08
216	123049	维尔转债	2,635,265.31	0.08
217	123076	强力转债	2,627,067.99	0.08
218	113519	长久转债	2,624,138.62	0.08
219	123004	铁汉转债	2,621,559.45	0.08
220	111004	明新转债	2,613,719.20	0.08
221	128142	新乳转债	2,606,940.41	0.08
222	118005	天奈转债	2,585,791.82	0.08
223	123131	奥飞转债	2,584,995.95	0.08
224	123133	佩蒂转债	2,576,551.56	0.08
225	123118	惠城转债	2,563,067.85	0.08
226	111002	特纸转债	2,558,854.65	0.08
227	127065	瑞鹤转债	2,550,991.89	0.08
228	127042	嘉美转债	2,541,387.15	0.08
229	113653	永 22 转债	2,523,777.23	0.08
230	113654	永 02 转债	2,522,168.73	0.08
231	128105	长集转债	2,499,379.25	0.08
232	113588	润达转债	2,493,650.84	0.08
233	128137	洁美转债	2,489,852.39	0.08
234	123085	万顺转 2	2,485,060.79	0.08
235	113621	彤程转债	2,484,774.82	0.08
236	123151	康医转债	2,456,721.52	0.08
237	123063	大禹转债	2,455,481.92	0.08
238	127026	超声转债	2,443,917.41	0.08
239	123101	拓斯转债	2,442,062.59	0.08
240	128087	孚日转债	2,414,385.90	0.08
241	128044	岭南转债	2,400,437.29	0.08
242	111009	盛泰转债	2,399,554.38	0.08
243	123096	思创转债	2,397,750.14	0.08
244	123025	精测转债	2,385,874.78	0.08
245	118008	海优转债	2,383,154.76	0.08

246	123132	回盛转债	2,357,905.54	0.07
247	127028	英特转债	2,355,778.18	0.07
248	123142	申昊转债	2,309,337.97	0.07
249	123162	东杰转债	2,303,094.02	0.07
250	127034	绿茵转债	2,301,411.04	0.07
251	113582	火炬转债	2,292,549.23	0.07
252	111005	富春转债	2,271,230.00	0.07
253	128063	未来转债	2,266,707.92	0.07
254	113604	多伦转债	2,266,680.04	0.07
255	128124	科华转债	2,261,031.57	0.07
256	113651	松霖转债	2,260,059.14	0.07
257	110074	精达转债	2,253,749.93	0.07
258	127035	濮耐转债	2,250,074.63	0.07
259	113639	华正转债	2,245,430.92	0.07
260	113629	泉峰转债	2,225,382.94	0.07
261	128075	远东转债	2,206,840.34	0.07
262	127078	优彩转债	2,197,352.49	0.07
263	118020	芳源转债	2,196,319.70	0.07
264	123147	中辰转债	2,193,206.84	0.07
265	127060	湘佳转债	2,189,083.20	0.07
266	127041	弘亚转债	2,172,526.88	0.07
267	128017	金禾转债	2,140,768.40	0.07
268	123122	富瀚转债	2,133,837.14	0.07
269	123144	裕兴转债	2,132,258.62	0.07
270	113638	台 21 转债	2,130,911.74	0.07
271	113625	江山转债	2,116,988.75	0.07
272	123129	锦鸡转债	2,114,668.27	0.07
273	113542	好客转债	2,102,887.30	0.07
274	113664	大元转债	2,094,790.49	0.07
275	127054	双箭转债	2,091,605.17	0.07
276	123091	长海转债	2,091,470.20	0.07
277	113584	家悦转债	2,089,599.46	0.07
278	111001	山玻转债	2,087,281.58	0.07
279	127055	精装转债	2,084,303.55	0.07
280	128037	岩土转债	2,083,042.61	0.07
281	113643	风语转债	2,078,116.87	0.07
282	128116	瑞达转债	2,077,321.06	0.07
283	113606	荣泰转债	2,064,572.12	0.07
284	123064	万孚转债	2,054,947.52	0.07
285	123056	雪榕转债	2,010,288.98	0.06
286	127072	博实转债	1,999,554.55	0.06
287	127071	天箭转债	1,997,900.76	0.06
288	123154	火星转债	1,990,756.27	0.06
289	123124	晶瑞转 2	1,959,560.05	0.06

290	127077	华宏转债	1,955,351.62	0.06
291	127051	博杰转债	1,932,864.89	0.06
292	118012	微芯转债	1,842,257.94	0.06
293	123157	科蓝转债	1,832,061.28	0.06
294	113569	科达转债	1,803,777.74	0.06
295	110055	伊力转债	1,790,564.14	0.06
296	113589	天创转债	1,775,481.09	0.06
297	113662	豪能转债	1,733,791.96	0.06
298	118014	高测转债	1,731,259.11	0.06
299	113649	丰山转债	1,708,839.88	0.05
300	113504	艾华转债	1,696,415.97	0.05
301	113535	大业转债	1,691,681.63	0.05
302	123090	三诺转债	1,660,780.05	0.05
303	113601	塞力转债	1,619,306.23	0.05
304	118011	银微转债	1,614,613.62	0.05
305	113591	胜达转债	1,582,958.40	0.05
306	123044	红相转债	1,577,387.37	0.05
307	113579	健友转债	1,556,686.47	0.05
308	113660	寿 22 转债	1,554,989.52	0.05
309	123168	惠云转债	1,548,786.68	0.05
310	113657	再 22 转债	1,548,375.35	0.05
311	123082	北陆转债	1,542,878.66	0.05
312	128106	华统转债	1,541,409.50	0.05
313	123050	聚飞转债	1,519,521.63	0.05
314	113600	新星转债	1,492,154.07	0.05
315	113618	美诺转债	1,472,089.17	0.05
316	118029	富淼转债	1,467,577.61	0.05
317	128066	亚泰转债	1,462,417.70	0.05
318	123109	昌红转债	1,458,890.42	0.05
319	123156	博汇转债	1,456,575.53	0.05
320	128097	奥佳转债	1,453,452.54	0.05
321	123087	明电转债	1,441,422.17	0.05
322	113628	晨丰转债	1,439,594.36	0.05
323	128042	凯中转债	1,426,719.69	0.05
324	118004	博瑞转债	1,426,556.93	0.05
325	113532	海环转债	1,408,534.64	0.04
326	123048	应急转债	1,403,199.83	0.04
327	118009	华锐转债	1,392,178.50	0.04
328	123127	耐普转债	1,385,909.17	0.04
329	123167	商络转债	1,373,853.95	0.04
330	118018	瑞科转债	1,369,350.77	0.04
331	111008	沿浦转债	1,368,484.83	0.04
332	128125	华阳转债	1,360,124.21	0.04
333	123130	设研转债	1,353,750.67	0.04

334	118017	深科转债	1,342,821.24	0.04
335	128138	侨银转债	1,340,374.77	0.04
336	123059	银信转债	1,334,848.93	0.04
337	113610	灵康转债	1,320,190.58	0.04
338	127007	湖广转债	1,305,199.56	0.04
339	113039	嘉泽转债	1,296,758.95	0.04
340	110058	永鼎转债	1,295,815.77	0.04
341	123010	博世转债	1,291,808.60	0.04
342	128026	众兴转债	1,278,754.30	0.04
343	127062	垒知转债	1,276,231.50	0.04
344	118015	芯海转债	1,274,458.28	0.04
345	118010	洁特转债	1,268,343.08	0.04
346	127079	华亚转债	1,267,015.70	0.04
347	113608	威派转债	1,254,797.66	0.04
348	123171	共同转债	1,238,223.87	0.04
349	113593	沪工转债	1,212,739.10	0.04
350	123100	朗科转债	1,205,853.44	0.04
351	128049	华源转债	1,197,095.99	0.04
352	127059	永东转 2	1,195,980.05	0.04
353	113598	法兰转债	1,191,895.64	0.04
354	113624	正川转债	1,190,590.56	0.04
355	113594	淳中转债	1,175,534.29	0.04
356	128122	兴森转债	1,171,258.69	0.04
357	110052	贵广转债	1,142,651.51	0.04
358	113597	佳力转债	1,139,423.95	0.04
359	128117	道恩转债	1,130,376.46	0.04
360	113524	奇精转债	1,118,817.82	0.04
361	123141	宏丰转债	1,114,758.68	0.04
362	123160	泰福转债	1,106,693.63	0.04
363	113665	汇通转债	1,099,939.84	0.03
364	128025	特一转债	1,091,153.15	0.03
365	123089	九洲转 2	1,088,066.75	0.03
366	123155	中陆转债	1,085,358.71	0.03
367	118016	京源转债	1,080,092.48	0.03
368	123153	英力转债	1,059,810.16	0.03
369	123163	金沃转债	1,047,417.07	0.03
370	128123	国光转债	1,047,291.86	0.03
371	128090	汽模转 2	1,038,188.26	0.03
372	123166	蒙泰转债	1,037,315.58	0.03
373	123067	斯莱转债	1,036,565.81	0.03
374	123126	瑞丰转债	1,031,883.88	0.03
375	128033	迪龙转债	1,026,430.44	0.03
376	123152	润禾转债	1,010,704.66	0.03
377	123088	威唐转债	1,006,135.88	0.03

378	128101	联创转债	1,003,846.56	0.03
379	123112	万讯转债	989,991.32	0.03
380	123106	正丹转债	987,249.71	0.03
381	113027	华钰转债	976,236.85	0.03
382	113030	东风转债	973,218.53	0.03
383	123022	长信转债	959,910.22	0.03
384	123159	崧盛转债	955,091.23	0.03
385	128070	智能转债	947,278.73	0.03
386	128071	合兴转债	936,864.85	0.03
387	118007	山石转债	931,963.31	0.03
388	128072	翔鹭转债	926,817.42	0.03
389	128143	锋龙转债	922,474.71	0.03
390	128118	瀛通转债	904,327.24	0.03
391	123138	丝路转债	901,483.20	0.03
392	123061	航新转债	886,780.51	0.03
393	128082	华锋转债	862,333.70	0.03
394	113573	纵横转债	858,273.59	0.03
395	123093	金陵转债	837,357.06	0.03
396	113546	迪贝转债	807,751.71	0.03
397	128021	兄弟转债	800,495.09	0.03
398	123011	德尔转债	795,878.19	0.03
399	123103	震安转债	789,581.68	0.03
400	123054	思特转债	778,904.09	0.02
401	128076	金轮转债	762,120.23	0.02
402	123002	国祯转债	745,476.20	0.02
403	113565	宏辉转债	736,915.75	0.02
404	110070	凌钢转债	700,292.99	0.02
405	123039	开润转债	699,445.24	0.02
406	123065	宝莱转债	694,979.15	0.02
407	113574	华体转债	654,158.72	0.02
408	128039	三力转债	649,358.23	0.02
409	123080	海波转债	564,768.25	0.02
410	123143	胜蓝转债	515,918.22	0.02
411	118006	阿拉转债	263,817.33	0.01
412	113537	文灿转债	235,380.45	0.01
413	113577	春秋转债	142,546.22	0.00

#### 7.12.5 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。

#### 7.12.6 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。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
5,369	51,739.00	258,946,986.00	93.22%	18,839,684.00	6.78%

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	财达证券股份有限公司	14,204,000.00	5.11%
2	平安证券股份有限公司	10,819,009.00	3.89%
3	信泰人寿保险股份有限公司—传统产品	10,189,996.00	3.67%
4	昆仑健康保险股份有限公司—传统保险产品 1	9,150,000.00	3.29%
5	创金合信基金—平安银行—创金合信安盛 5 号集合资产管理计划	8,914,800.00	3.21%
6	国泰君安证券股份有限公司	8,490,823.00	3.06%
7	中国平安人寿保险股份有限公司—寿险传统低	7,862,200.00	2.83%
8	昆仑健康保险股份有限公司—万能保险产品 3	7,600,000.00	2.74%
9	中国国际金融股份有限公司	6,935,198.00	2.50%
10	中国人寿再保险有限责任公司	5,151,500.00	1.85%

注：以上数据由中国证券登记结算公司提供，由于系统字数限制可能有持有人名称显示不全的情况，持有人为场内持有人。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

基金管理人从业人员未持有本基金。

## 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

- 1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。
- 2、本基金的基金经理未持有本基金。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020 年 3 月 6 日）基金份额总额	601,866,735.00
本报告期期初基金份额总额	201,386,670.00
本报告期基金总申购份额	108,700,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	32,300,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	277,786,670.00

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人于 2023 年 2 月 18 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，邵凯先生离任公司副总经理，继续担任公司投资决策委员会委员。

基金管理人于 2023 年 5 月 27 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，孙献离任公司财务负责人；吴慧峰任公司副总经理、财务负责人。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起，聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员没有受到监管部门的稽查或处罚。

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券	2	1,209,129.89	3.24%	884.16	3.24%	增加 2 个
中信证券	1	15,657,179.18	41.93%	11,449.10	41.93%	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	2,101,460.63	5.63%	1,536.88	5.63%	-
德邦证券	2	6,900,918.45	18.48%	5,046.96	18.48%	增加 2 个
招商证券	4	11,468,621.40	30.72%	8,387.00	30.72%	增加 2 个
中信建投	1	-	-	-	-	-

注：本基金根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基字[2007]48号）的有关规定要求，我在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向多家券商租用了基金专用交易席位。

1、基金专用交易席位的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公

司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易席位的选择程序如下

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构
- (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
长江证券	211,325,521.61	9.14%	931,800,000.00	22.65%	-	-
中信证券	294,129,338.35	12.72%	870,700,000.00	21.17%	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	26,905,115.96	1.16%	186,500,000.00	4.53%	-	-
德邦证券	747,671,859.23	32.33%	977,903,000.00	23.77%	-	-
招商证券	1,032,769,961.26	44.65%	1,146,700,000.00	27.88%	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增开源证券为申购、赎回代办券商的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-06-16
2	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增国金证券为申购、赎回代办券商的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-06-09
3	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20230601	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-06-01
4	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增华福证券为申购、赎回代办券商的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-05-30
5	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-05-27
6	博时中证可转债及可交换债券交易型开放式	上海证券报、基金管理人	2023-04-22

	指数证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	网站、证监会基金电子披露网站	
7	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 年年度报告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-03-30
8	关于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新增长城证券为申购、赎回代办券商的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-03-17
9	关于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新增东方证券为申购、赎回代办券商的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-03-09
10	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-02-18
11	博时基金管理有限公司关于直销网上交易开通兴业银行快捷开户和支付服务及费率优惠的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-02-13
12	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增中国国际金融股份有限公司为申购、赎回代办券商的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-02-08
13	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	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-01-20
14	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20230104	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-01-04

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 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

## 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

## 12.3 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  
二〇二三年八月三十一日