

**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 年第 2 季度报告
2020 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：二〇二〇年七月二十一日

§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 2020 年 7 月 17 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 2020 年 4 月 1 日起至 6 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	证券简称：转债 ETF；扩位证券简称：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	59,286,670.00 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	本基金主要采用完全复制法进行投资，即按照成份股在标的指数中的基准权重来构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。
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 (2020 年 4 月 1 日-2020 年 6 月 30 日)
1.本期已实现收益	-1,499,683.60
2.本期利润	-10,365,354.39
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1699
4.期末基金资产净值	576,583,703.79
5.期末基金份额净值	9.7254

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。

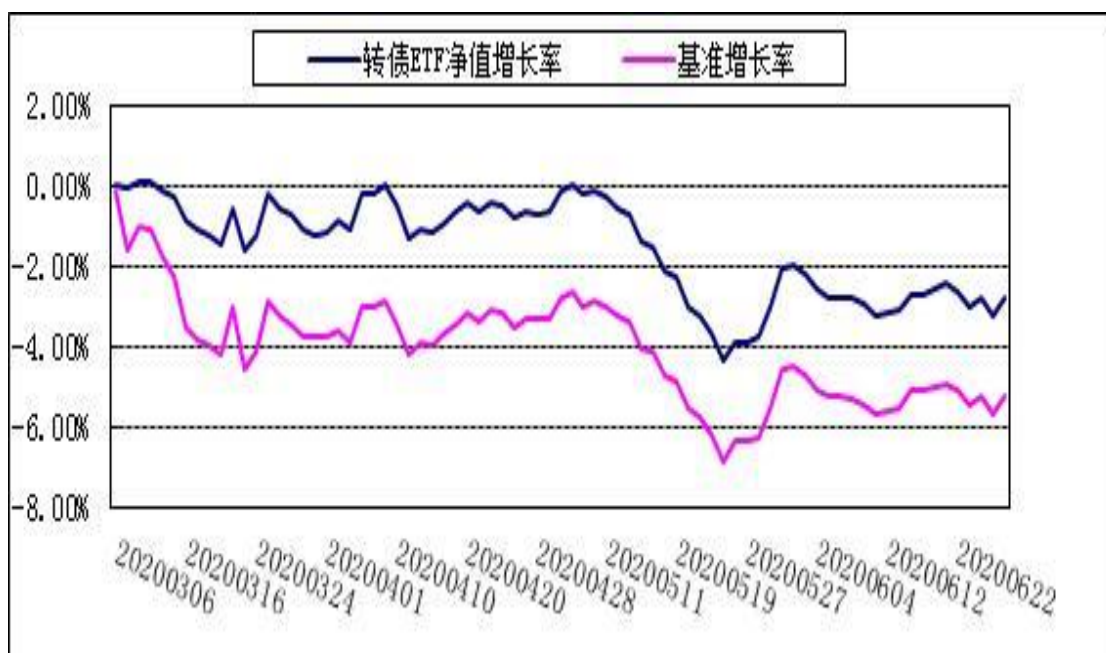
所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-1.60%	0.38%	-1.51%	0.38%	-0.09%	0.00%
自基金合同生 效起至今	-2.75%	0.40%	-5.19%	0.51%	2.44%	-0.11%

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



注：本基金的基金合同于 2020 年 3 月 6 日生效。按照本基金的基金合同规定,自基金合同生效之日起 6

个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十五部分“(二) 投资范围”、“(五) 投资组合管理”的有关约定。截至本报告期末，本基金尚未完成建仓。

§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	基金经理	2020-03-06	-	12.0	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)的基金经理。现任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)、博时稳悦63个月定期开放债券型证券投资基金(2020年1月13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)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 66 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

2020 年 2 季度权益类资产表现显著好于固收类资产。当季 Wind 全 A 指数上涨 14.7%，连续 3 个月出现上涨，特别是创业板指数上涨 30.3%；中债总财富指数下跌 0.82%，而上季度该指数上涨 3.51%，10 年期国债期货价格下跌 1.52%，表明固收类资产在 2 季度是比较受压的。转债市场方面，中证转债及可交债指数下跌 1.51%，该指数为本基金跟踪的标的指数，可转债市场的内部结构性行情较为明显，以银行转债为代表的大金融板块表现欠佳。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，逐步调整组合与目标指数的一致。

展望未来，全球从宽货币到宽信用应是主要趋势，疫情后为应对下行风险全球各重要经济体在货币和财政方面实施了强有力的对冲政策，经济基本面逐步改善将占主流，但复苏难呈现过热状态，流动性宽松局面暂难有趋势线的扭转，权益资产相对固收类资产可能仍然会占优，预计市场上仍将演绎低风险资产向偏高风险资产配置转移趋势，对国内权益市场可乐观一些。经过 2 季度调整后，转债估值已回到去年 4 季

度水平正常水平，绝对价格水平也中等偏低，值得重视该类资产的机会。在投资策略上，本基金作为一只被动的指数类基金，我们会以最小化跟踪误差为目标，紧密跟踪标的指数。同时我们仍然看好中国长期的经济增长，希望通过本基金为投资人提供分享中国长期经济增长的机会。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2020 年 06 月 30 日，本基金基金份额净值为 9.7254 元，份额累计净值为 0.9725 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为-1.60%，同期业绩基准增长率为-1.51%。

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	568,139,079.01	98.40
	其中：债券	568,139,079.01	98.40
	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	5,000,000.00	0.87
	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	2,525,137.30	0.44
8	其他各项资产	1,698,918.48	0.29
9	合计	577,363,134.79	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

5.2.1 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。

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）	568,139,079.01	98.54
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	568,139,079.01	98.54

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	512,610	52,199,076.30	9.05
2	113021	中信转债	413,930	43,313,635.20	7.51
3	113011	光大转债	310,440	35,380,846.80	6.14
4	132018	G 三峡 EB1	226,750	25,160,180.00	4.36
5	110053	苏银转债	202,360	21,423,853.20	3.72

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

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

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 本报告期内，本基金投资的前十名证券中除浦发转债(110059)、中信转债(113021)、光大转债(113011)、苏银转债(110053)的发行主体外，没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

主要违规事实：2019 年 10 月 14 日，因公司成都分行授信业务及整改情况严重失察、重大审计发现未向监管部门报告、轮岗制度执行不力的违规行为，中国银行保险监督管理委员会对上海浦东发展银行股份有限公司处以罚款的行政处罚。

主要违规事实：2019 年 8 月 9 日，因存在未按规定提供报表且逾期未改正等违规行为，中国银行保险监督管理委员会对中信银行股份有限公司处以罚款的行政处罚。

主要违规事实：2020 年 2 月 14 日，因存在未按规定履行客户身份识别义务、未按规定保存客户身份资料和交易记录等违规行为，中国人民银行对中国光大银行股份有限公司处以罚款的行政处罚。

主要违规事实：2019 年 8 月 19 日，因存在违规发放流动资金贷款的违规行为，中国银行业监督管理委员会南通监管分局对江苏银行股份有限公司海安支行处以罚款的行政处罚。

对该证券投资决策程序的说明：根据我司的基金投资管理相关制度，以相应的研究报告为基础，结合其未来增长前景，由基金经理决定具体投资行为。

5.11.2 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	39,816.68
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,575,048.57
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	84,053.23
8	其他	-
9	合计	1,698,918.48

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	52,199,076.30	9.05
2	113021	中信转债	43,313,635.20	7.51
3	113011	光大转债	35,380,846.80	6.14
4	132018	G 三峡 EB1	25,160,180.00	4.36
5	110053	苏银转债	21,423,853.20	3.72
6	132015	18 中油 EB	20,327,000.00	3.53
7	132013	17 宝武 EB	16,223,901.00	2.81

8	132009	17 中油 EB	10,993,976.00	1.91
9	128080	顺丰转债	8,843,070.40	1.53
10	113013	国君转债	8,048,568.00	1.40
11	113026	核能转债	7,904,879.20	1.37
12	132007	16 凤凰 EB	6,209,760.00	1.08
13	127005	长证转债	5,888,455.80	1.02
14	110051	中天转债	5,250,392.00	0.91
15	127012	招路转债	5,087,367.20	0.88
16	113008	电气转债	4,911,150.00	0.85
17	132004	15 国盛 EB	4,789,828.80	0.83
18	110061	川投转债	4,547,613.90	0.79
19	113020	桐昆转债	4,135,760.80	0.72
20	128086	国轩转债	4,126,096.10	0.72
21	113022	浙商转债	3,929,987.00	0.68
22	110062	烽火转债	3,911,211.60	0.68
23	128084	木森转债	3,672,011.90	0.64
24	128081	海亮转债	3,325,995.20	0.58
25	132014	18 中化 EB	3,312,572.00	0.57
26	110043	无锡转债	3,123,221.40	0.54
27	110048	福能转债	3,076,077.60	0.53
28	113014	林洋转债	3,045,130.10	0.53
29	113024	核建转债	3,039,911.70	0.53
30	110065	淮矿转债	2,936,782.50	0.51
31	110045	海澜转债	2,890,433.00	0.50
32	128048	张行转债	2,854,192.97	0.50
33	110042	航电转债	2,744,527.10	0.48
34	113028	环境转债	2,706,337.20	0.47
35	113009	广汽转债	2,685,821.60	0.47
36	110031	航信转债	2,624,233.80	0.46
37	128085	鸿达转债	2,568,245.54	0.45
38	127006	敖东转债	2,537,830.32	0.44
39	128045	机电转债	2,514,312.00	0.44
40	110047	山鹰转债	2,507,109.80	0.43
41	128035	大族转债	2,491,425.60	0.43
42	113019	玲珑转债	2,483,092.80	0.43
43	128088	深南转债	2,402,627.20	0.42
44	113543	欧派转债	2,401,862.40	0.42
45	132005	15 国资 EB	2,272,550.00	0.39
46	113508	新风转债	2,179,032.70	0.38
47	110034	九州转债	2,158,573.20	0.37
48	110056	亨通转债	2,059,197.60	0.36
49	110041	蒙电转债	2,026,314.40	0.35
50	110063	鹰 19 转债	2,013,606.00	0.35

51	113029	明阳转债	1,966,879.80	0.34
52	113025	明泰转债	1,914,608.50	0.33
53	128029	太阳转债	1,911,864.32	0.33
54	128034	江银转债	1,839,060.60	0.32
55	110057	现代转债	1,804,573.00	0.31
56	113545	金能转债	1,730,845.80	0.30
57	113518	顾家转债	1,724,235.50	0.30
58	110064	建工转债	1,705,173.60	0.30
59	110052	贵广转债	1,658,414.00	0.29
60	113554	仙鹤转债	1,626,460.50	0.28
61	113558	日月转债	1,613,742.00	0.28
62	113017	吉视转债	1,553,780.70	0.27
63	113555	振德转债	1,472,256.00	0.26
64	128078	太极转债	1,413,090.36	0.25
65	127007	湖广转债	1,355,228.88	0.24
66	123036	先导转债	1,340,908.26	0.23
67	113516	吴银转债	1,336,534.40	0.23
68	110033	国贸转债	1,327,785.00	0.23
69	113534	鼎胜转债	1,326,169.60	0.23
70	128013	洪涛转债	1,283,136.00	0.22
71	128028	赣锋转债	1,279,171.08	0.22
72	113544	桃李转债	1,260,020.00	0.22
73	128059	视源转债	1,251,070.20	0.22
74	110060	天路转债	1,234,563.80	0.21
75	113550	常汽转债	1,230,060.00	0.21
76	127013	创维转债	1,162,623.88	0.20
77	128019	久立转 2	1,142,550.42	0.20
78	113547	索发转债	1,103,036.00	0.19
79	110055	伊力转债	1,094,126.00	0.19
80	128075	远东转债	1,051,495.44	0.18
81	127003	海印转债	1,040,815.80	0.18
82	110058	永鼎转债	1,007,433.80	0.17
83	128065	雅化转债	986,217.04	0.17
84	128083	新北转债	973,681.08	0.17
85	128032	双环转债	967,847.96	0.17
86	128046	利尔转债	965,035.89	0.17
87	113504	艾华转债	964,299.00	0.17
88	113549	白电转债	955,615.20	0.17
89	128023	亚太转债	951,089.20	0.16
90	123035	利德转债	950,971.80	0.16
91	132008	17 山高 EB	948,184.80	0.16
92	128026	众兴转债	902,733.70	0.16
93	128018	时达转债	893,706.45	0.16

94	113016	小康转债	873,314.40	0.15
95	123004	铁汉转债	829,318.90	0.14
96	128064	司尔转债	827,732.20	0.14
97	128015	久其转债	806,640.00	0.14
98	128067	一心转债	782,899.26	0.14
99	113505	杭电转债	775,833.60	0.13
100	113519	长久转债	758,351.20	0.13
101	128022	众信转债	754,539.50	0.13
102	110038	济川转债	737,214.10	0.13
103	128017	金禾转债	725,385.20	0.13
104	113509	新泉转债	711,260.90	0.12
105	128063	未来转债	694,912.00	0.12
106	113542	好客转债	692,160.00	0.12
107	128058	拓邦转债	681,208.53	0.12
108	128044	岭南转债	666,825.60	0.12
109	128087	孚日转债	660,345.00	0.11
110	113528	长城转债	660,028.50	0.11
111	128071	合兴转债	651,741.72	0.11
112	113537	文灿转债	650,304.00	0.11
113	113027	华钰转债	649,047.00	0.11
114	113530	大丰转债	648,896.00	0.11
115	128057	博彦转债	629,974.41	0.11
116	113557	森特转债	629,279.70	0.11
117	127014	北方转债	624,814.28	0.11
118	128037	岩土转债	594,252.00	0.10
119	123023	迪森转债	593,105.10	0.10
120	128021	兄弟转债	579,919.56	0.10
121	113525	台华转债	570,723.60	0.10
122	113548	石英转债	552,939.20	0.10
123	128010	顺昌转债	531,353.60	0.09
124	128066	亚泰转债	528,378.50	0.09
125	113012	骆驼转债	526,540.80	0.09
126	113559	永创转债	516,081.50	0.09
127	123028	清水转债	513,015.46	0.09
128	128033	迪龙转债	512,774.98	0.09
129	123025	精测转债	506,340.00	0.09
130	113553	金牌转债	501,307.40	0.09
131	113556	至纯转债	489,402.70	0.08
132	123002	国祯转债	477,756.00	0.08
133	123037	新莱转债	477,573.60	0.08
134	123033	金力转债	477,551.40	0.08
135	113532	海环转债	466,716.00	0.08
136	123010	博世转债	455,310.10	0.08

137	128042	凯中转债	432,439.02	0.08
138	123017	寒锐转债	418,214.70	0.07
139	128049	华源转债	408,236.40	0.07
140	128082	华锋转债	370,392.00	0.06
141	123030	九洲转债	350,358.60	0.06
142	113524	奇精转债	348,525.80	0.06
143	113541	荣晟转债	348,156.60	0.06
144	128069	华森转债	347,359.10	0.06
145	113030	东风转债	342,071.60	0.06
146	128014	永东转债	342,001.50	0.06
147	128025	特一转债	340,037.40	0.06
148	123007	道氏转债	338,791.94	0.06
149	128072	翔鹭转债	316,009.60	0.05
150	113526	联泰转债	298,166.00	0.05
151	113535	大业转债	283,737.60	0.05
152	123026	中环转债	272,016.30	0.05
153	113552	克来转债	270,873.60	0.05
154	123011	德尔转债	264,356.70	0.05
155	128079	英联转债	247,513.50	0.04
156	128040	华通转债	238,082.40	0.04
157	128050	钧达转债	235,468.80	0.04
158	113536	三星转债	228,821.60	0.04
159	128076	金轮转债	223,709.40	0.04
160	123032	万里转债	205,923.50	0.04
161	128051	光华转债	168,548.80	0.03
162	128070	智能转债	166,738.80	0.03
163	123020	富祥转债	160,375.20	0.03
164	123018	溢利转债	132,308.50	0.02
165	123027	蓝晓转债	89,231.60	0.02
166	128030	天康转债	59,360.10	0.01
167	113521	科森转债	53,842.20	0.01
168	128039	三力转债	42,917.20	0.01
169	113520	百合转债	42,637.40	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	60,186,670.00
报告期基金总申购份额	4,100,000.00
减：报告期基金总赎回份额	5,000,000.00
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	59,286,670.00

§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 2020 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理 224 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 12150 亿元人民币，剔除货币基金与短期理财债券基金后，博时基金公募资产管理总规模逾 3882 亿元人民币，累计分红逾 1296 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。

2020 年 6 月 29 日，《证券时报》第十五届中国基金业明星基金奖榜单公布，博时基金共荣获三项大奖，旗下产品博时外延增长主题混合与博时宏观回报债券分别拿下“三年持续回报平衡混合型明星基金”与“三年持续回报积极债券型明星基金”奖。博时信用债券基金摘得“十年持续回报债券型明星基金”奖。

2020 年 4 月 1 日，博时基金及子公司博时国际荣获《亚洲资产管理》2020“Best of the Best Awards”三项大奖。博时基金董事长兼总经理江向阳荣获“中国年度最佳 CEO”（Winner, China CEO of the Year-Jiang Xiangyang），博时基金（国际）有限公司荣获“香港最佳中资基金公司”（Winner, Hong Kong Best China Fund

House)，博时信用债基金荣获“中国在岸人民币债券最佳业绩（5 年）”（Winner, CNY Bonds, Onshore 5 Years-Bosera Credit Bond Fund）。

2020 年 3 月 31 日，《中国证券报》第十七届中国基金业金牛奖评选结果揭晓，博时基金旗下绩优产品博时信用债纯债债券荣获“七年期开放式债券型持续优胜金牛基金奖”。

2020 年 3 月 26 日，Morningstar 晨星（中国）2020 年度基金评选结果揭晓，博时信用债券在参选的同类 428 只基金中脱颖而出，摘得晨星“2020 年度激进债券型基金奖”。

2020 年 1 月 10 日，新京报“开放 普惠 科技”2019 金融行业评选颁奖典礼在北京举办，博时基金凭借在可持续发展金融方面的努力成果，荣获“2019 年度杰出社会责任影响力企业”。

2020 年 1 月 4 日，2020《财经》可持续发展高峰论坛暨长青奖典礼在北京举办，博时基金凭借在 ESG 投资及可持续发展金融推动方面的耕耘和成果，荣获“2020《财经》长青奖-可持续发展创新奖”。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

9.1.1 中国证券监督管理委员会批准博时中证可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金设立的文件。

9.1.2 《博时中证可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

9.1.3 《博时中证可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

9.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

9.1.5 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阅，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

二〇二〇年七月二十一日