

**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 3 季度报告
2020 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：二〇二〇年十月二十八日

§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 10 月 26 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 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	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	102,786,670.00 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7月1日-2020年9月30日)
1.本期已实现收益	14,394,711.34
2.本期利润	19,951,613.83
3.加权平均基金份额本期利润	0.2530
4.期末基金资产净值	1,041,886,219.88
5.期末基金份额净值	10.1364

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。

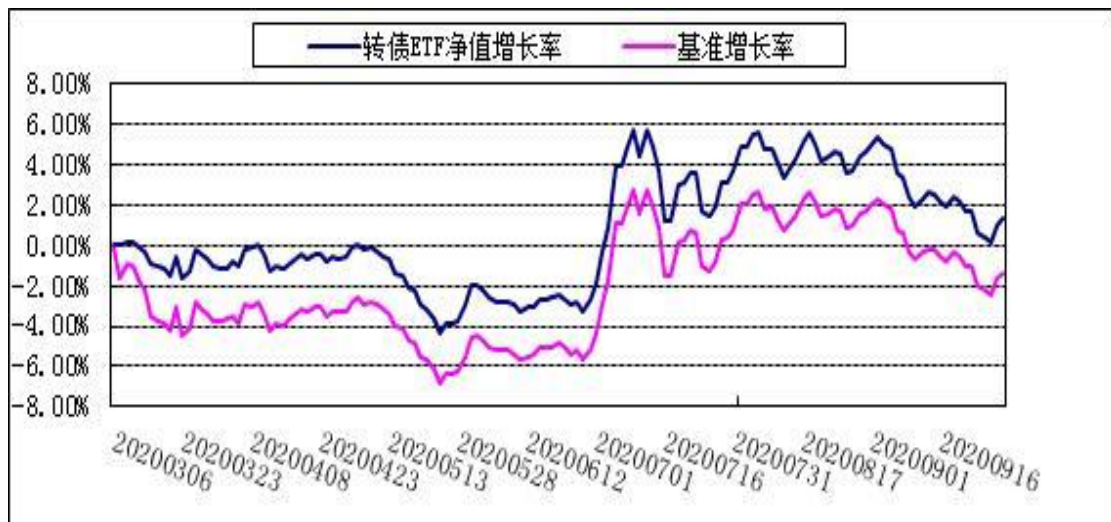
所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	4.23%	0.85%	4.06%	0.82%	0.17%	0.03%
过去六个月	2.56%	0.67%	2.49%	0.65%	0.07%	0.02%
自基金合同生 效起至今	1.36%	0.65%	-1.34%	0.67%	2.70%	-0.02%

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。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

§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	-	12.3	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，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 9 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

受益于基本面持续回升和全球宽松的货币环境，季初权益市场出现了一波明显的快速上涨行情，后期考虑到货币政策已从疫情后的超宽松状态回归到正常态势，随着债市收益率的上行，前期流动性推动的权益估值扩张行情已较难维持，市场开始寻求业绩改善的方向，市场波动也开始加大。9 月份股票市场震荡下行，万得全 A 指数下跌 6%，为 3 月份以后的首次月度下跌，前期流动性推动下涨幅非常明显的高估值的科技成长以及消费医药都出现了一波较为明显的回调，有内部流动性收紧的担忧，也有美国大选前的外部国际环境不确定性和爆发二次疫情潜在可能的担忧。在风险偏好明显下降环境下，9 月份中高价格的可转债市场几乎走出单边下跌行情，估值回落到年内低点。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结构一致。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2020 年 09 月 30 日，本基金基金份额净值为 10.1364 元，份额累计净值为 1.0136 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为 4.23%，同期业绩基准增长率为 4.06%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,027,399,346.12	89.82
	其中：债券	1,027,399,346.12	89.82
	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	0.44
	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	107,811,281.74	9.43
8	其他各项资产	3,662,922.64	0.32
9	合计	1,143,873,550.50	100.00

注：债券投资项包含可退替代款估值增值。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-

7	可转债（可交换债）	1,027,399,346.12	98.61
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,027,399,346.12	98.61

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	872,310	89,211,143.70	8.56
2	113021	中信转债	698,650	73,288,385.00	7.03
3	113011	光大转债	538,960	63,414,033.60	6.09
4	132018	G 三峡 EB1	375,860	43,674,932.00	4.19
5	110053	苏银转债	369,680	40,949,453.60	3.93

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)、国君转债(113013)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：2020 年 8 月 11 日，因该行在 2013 年至 2018 年，存在 1.未按专营部门制规定开展同业业务；2.同业投资资金违规投向“四证”不全的房地产项目；3.延迟支付同业投资资金吸收存款等违规行为，中国保险监督管理委员会上海保监局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：2020 年 2 月 21 日，因存在违规发放土地储备贷款；受托支付不符合监管规定；信托消费贷款业务开展不审慎等违规行为，中国银行保险监督管理委员会北京监管局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：2020 年 4 月 30 日，国泰君安证券股份有限公司作为富贵鸟股份有限公司公开发行 2014 年公司债券的承销机构和受托管理人，在尽职调查和受托管理过程中未严格遵守执业规范，未能勤勉尽责地履行相关责任，中国证券监督管理委员会福建监管局对其处以出具警示函的监管措施。

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	67,451.51
2	应收证券清算款	16,606.00
3	应收股利	-
4	应收利息	3,536,838.42
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	42,026.71
8	其他	-
9	合计	3,662,922.64

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	89,211,143.70	8.56
2	113021	中信转债	73,288,385.00	7.03
3	113011	光大转债	63,414,033.60	6.09
4	132018	G 三峡 EB1	43,674,932.00	4.19
5	110053	苏银转债	40,949,453.60	3.93
6	132015	18 中油 EB	33,879,353.20	3.25
7	132009	17 中油 EB	17,222,446.80	1.65
8	132013	17 宝武 EB	15,234,286.50	1.46
9	113013	国君转债	14,743,265.00	1.42
10	113026	核能转债	13,579,742.80	1.30
11	127005	长证转债	11,629,402.92	1.12
12	127015	希望转债	10,303,180.50	0.99
13	128102	海大转债	9,391,070.00	0.90
14	127012	招路转债	8,903,109.48	0.85
15	110051	中天转债	8,503,591.50	0.82
16	110061	川投转债	8,362,820.00	0.80
17	113020	桐昆转债	8,234,508.30	0.79
18	113008	电气转债	8,209,837.50	0.79
19	128048	张行转债	7,187,308.03	0.69

20	110065	淮矿转债	6,869,011.10	0.66
21	110067	华安转债	6,664,983.00	0.64
22	132007	16 凤凰 EB	6,248,484.00	0.60
23	110062	烽火转债	6,227,050.80	0.60
24	110048	福能转债	6,221,616.30	0.60
25	113032	桐 20 转债	6,171,770.50	0.59
26	110043	无锡转债	5,959,882.60	0.57
27	113029	明阳转债	5,890,752.00	0.57
28	113014	林洋转债	5,824,456.00	0.56
29	128081	海亮转债	5,557,254.30	0.53
30	132004	15 国盛 EB	5,405,928.20	0.52
31	113024	核建转债	5,294,180.80	0.51
32	110031	航信转债	5,238,332.00	0.50
33	110066	盛屯转债	5,195,074.50	0.50
34	113543	欧派转债	5,054,252.00	0.49
35	132014	18 中化 EB	4,917,220.00	0.47
36	113009	广汽转债	4,806,019.40	0.46
37	110068	龙净转债	4,641,816.00	0.45
38	110047	山鹰转债	4,577,889.60	0.44
39	128085	鸿达转债	4,441,353.36	0.43
40	127006	敖东转债	4,397,307.18	0.42
41	128035	大族转债	4,250,231.91	0.41
42	128095	恩捷转债	4,192,874.40	0.40
43	123044	红相转债	3,913,355.70	0.38
44	132005	15 国资 EB	3,898,362.00	0.37
45	113508	新风转债	3,877,672.80	0.37
46	110034	九州转债	3,831,533.40	0.37
47	110045	海澜转债	3,708,943.00	0.36
48	110041	蒙电转债	3,701,872.20	0.36
49	110063	鹰 19 转债	3,662,047.50	0.35
50	128098	康弘转债	3,653,842.50	0.35
51	113555	振德转债	3,636,747.20	0.35
52	128029	太阳转债	3,501,751.68	0.34
53	113025	明泰转债	3,486,918.40	0.33
54	128034	江银转债	3,363,390.54	0.32
55	110056	亨通转债	3,263,185.20	0.31
56	110057	现代转债	3,201,013.50	0.31
57	128097	奥佳转债	3,096,556.10	0.30
58	123036	先导转债	3,029,093.10	0.29
59	113545	金能转债	3,021,872.40	0.29
60	110064	建工转债	3,018,537.60	0.29
61	110052	贵广转债	2,910,054.00	0.28
62	113553	金牌转债	2,745,576.00	0.26

63	113017	吉视转债	2,719,724.00	0.26
64	113550	常汽转债	2,591,198.50	0.25
65	128096	奥瑞转债	2,588,043.27	0.25
66	113542	好客转债	2,520,581.70	0.24
67	128065	雅化转债	2,505,385.77	0.24
68	113571	博特转债	2,495,750.40	0.24
69	123017	寒锐转债	2,345,354.00	0.23
70	128028	赣锋转债	2,344,305.76	0.23
71	113537	文灿转债	2,315,695.20	0.22
72	113516	苏农转债	2,293,179.60	0.22
73	110060	天路转债	2,291,835.00	0.22
74	128019	久立转 2	2,259,739.88	0.22
75	113534	鼎胜转债	2,239,207.10	0.21
76	110033	国贸转债	2,237,663.40	0.21
77	127007	湖广转债	2,215,645.52	0.21
78	113562	璞泰转债	2,204,800.00	0.21
79	113504	艾华转债	2,115,567.10	0.20
80	128075	远东转债	2,113,665.27	0.20
81	128046	利尔转债	2,081,699.13	0.20
82	110058	永鼎转债	2,036,588.10	0.20
83	110055	伊力转债	1,992,126.00	0.19
84	127013	创维转债	1,877,416.36	0.18
85	127003	海印转债	1,841,414.70	0.18
86	123035	利德转债	1,602,371.40	0.15
87	128083	新北转债	1,556,712.78	0.15
88	128078	太极转债	1,549,477.48	0.15
89	113563	柳药转债	1,545,788.90	0.15
90	113549	白电转债	1,523,779.20	0.15
91	128099	永高转债	1,503,428.05	0.14
92	128026	众兴转债	1,485,392.00	0.14
93	128017	金禾转债	1,476,470.94	0.14
94	123002	国祯转债	1,438,854.40	0.14
95	128018	时达转债	1,436,412.48	0.14
96	128013	洪涛转债	1,434,430.80	0.14
97	123004	铁汉转债	1,428,806.40	0.14
98	113509	新泉转债	1,415,506.60	0.14
99	128064	司尔转债	1,399,682.60	0.13
100	128021	兄弟转债	1,379,991.96	0.13
101	128022	众信转债	1,348,733.70	0.13
102	128032	双环转债	1,345,989.96	0.13
103	128071	合兴转债	1,298,342.32	0.12
104	128015	久其转债	1,285,338.60	0.12
105	128058	拓邦转债	1,258,530.84	0.12

106	113505	杭电转债	1,256,974.10	0.12
107	113519	长久转债	1,249,560.00	0.12
108	113027	华钰转债	1,248,157.50	0.12
109	128023	亚太转债	1,220,827.20	0.12
110	123010	博世转债	1,219,851.36	0.12
111	123046	天铁转债	1,204,628.28	0.12
112	110038	济川转债	1,192,799.30	0.11
113	128063	未来转债	1,150,553.52	0.11
114	128100	搜特转债	1,144,025.60	0.11
115	128044	岭南转债	1,116,221.70	0.11
116	113557	森特转债	1,107,516.80	0.11
117	113530	大丰转债	1,103,671.20	0.11
118	113528	长城转债	1,099,503.10	0.11
119	123022	长信转债	1,098,679.56	0.11
120	128087	孚日转债	1,092,602.40	0.10
121	113525	台华转债	1,083,813.60	0.10
122	127014	北方转债	1,082,063.43	0.10
123	128057	博彦转债	1,076,053.74	0.10
124	113016	小康转债	1,066,158.00	0.10
125	132008	17 山高 EB	1,052,660.00	0.10
126	123023	迪森转债	1,047,334.60	0.10
127	113559	永创转债	1,040,478.50	0.10
128	123027	蓝晓转债	1,003,517.10	0.10
129	128093	百川转债	983,947.50	0.09
130	123028	清水转债	981,372.48	0.09
131	128090	汽模转 2	978,933.50	0.09
132	123033	金力转债	971,246.30	0.09
133	113012	骆驼转债	963,349.20	0.09
134	128066	亚泰转债	960,876.00	0.09
135	113556	至纯转债	939,820.00	0.09
136	128033	迪龙转债	922,077.30	0.09
137	123030	九洲转债	907,625.00	0.09
138	113532	海环转债	869,528.40	0.08
139	113564	天目转债	842,275.60	0.08
140	128049	华源转债	835,200.00	0.08
141	128042	凯中转债	828,781.10	0.08
142	113541	荣晟转债	793,235.20	0.08
143	113565	宏辉转债	765,056.60	0.07
144	128082	华锋转债	759,870.50	0.07
145	128037	岩土转债	758,238.80	0.07
146	128010	顺昌转债	692,520.60	0.07
147	113568	新春转债	691,418.00	0.07
148	113569	科达转债	676,137.90	0.06

149	123025	精测转债	651,635.50	0.06
150	113548	石英转债	552,388.00	0.05
151	128050	钧达转债	481,624.00	0.05
152	113030	东风转债	459,258.80	0.04
153	123045	雷迪转债	457,023.40	0.04
154	128101	联创转债	452,448.92	0.04
155	123007	道氏转债	447,714.48	0.04
156	128069	华森转债	442,773.00	0.04
157	128025	特一转债	434,755.80	0.04
158	128094	星帅转债	432,899.00	0.04
159	113524	奇精转债	415,778.10	0.04
160	123047	久吾转债	415,450.00	0.04
161	123026	中环转债	413,988.84	0.04
162	113570	百达转债	412,363.80	0.04
163	113526	联泰转债	400,981.60	0.04
164	128051	光华转债	395,684.80	0.04
165	128014	永东转债	394,646.40	0.04
166	113521	科森转债	385,291.50	0.04
167	123011	德尔转债	359,078.80	0.03
168	123039	开润转债	354,953.40	0.03
169	123038	联得转债	353,169.60	0.03
170	128040	华通转债	348,070.40	0.03
171	128070	智能转债	330,979.70	0.03
172	113567	君禾转债	325,554.00	0.03
173	113572	三祥转债	324,940.60	0.03
174	128072	翔鹭转债	318,207.60	0.03
175	113566	翔港转债	303,186.00	0.03
176	113561	正裕转债	295,898.80	0.03
177	113535	大业转债	288,057.60	0.03
178	123031	晶瑞转债	244,573.50	0.02
179	113536	三星转债	244,542.00	0.02
180	123032	万里转债	232,767.00	0.02
181	128076	金轮转债	232,189.80	0.02
182	128079	英联转债	232,050.00	0.02
183	113520	百合转债	219,100.80	0.02
184	123042	银河转债	182,850.30	0.02
185	123018	溢利转债	138,315.10	0.01
186	128030	天康转债	54,859.30	0.01
187	128039	三力转债	42,446.00	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	59,286,670.00
报告期基金总申购份额	43,500,000.00
减：报告期基金总赎回份额	-
报告期基金拆分变动份额	0.00
本报告期期末基金份额总额	102,786,670.00

§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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2020-07-07~2020-07-07; 2020-08-06~2020-08-20; 2020-08-24	2,439,394.00	6,851,210.00	-	9,290,604.00	9.04%
产品特有风险							
本报告期内，本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过20%的情况，当该基金份额持有人选择							

大比例赎回时，可能引发巨额赎回。若发生巨额赎回而本基金没有足够现金时，存在一定的流动性风险；为应对巨额赎回而进行投资标的变现时，可能存在仓位调整困难，甚至对基金份额净值造成不利影响。基金经理会对可能出现的巨额赎回情况进行充分准备并做好流动性管理，但当基金出现巨额赎回并被全部确认时，申请赎回的基金份额持有人有可能面临赎回款项被延缓支付的风险，未赎回的基金份额持有人有可能承担短期内基金资产变现冲击成本对基金份额净值产生的不利影响。

本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过20%的情况，根据基金合同相关约定，该份额持有人可以独立向基金管理人申请召开基金份额持有人大会，并有权自行召集基金份额持有人大会。该基金份额持有人可以根据自身需要独立提出持有人大会议案并就相关事项进行表决。基金管理人会对该议案的合理性进行评估，充分向所有基金份额持有人揭示议案的相关风险。

在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模连续六十个工作日低于5000万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

此外，当单一基金份额持有人所持有的基金份额已经达到或超过本基金规模的50%或者接受某笔或者某些申购或转换转入申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%时，本基金管理人可拒绝该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。

注：申购赎回金额包含场内二级市场交易金额。由于场内具体交易情况无法获悉，场内二级市场交易金额为本报告期间净买入/卖出金额。

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 9 月 30 日，博时基金公司共管理 233 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 12159 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 3655 亿元人民币，累计分红逾 1335 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 9 月 22 日，由《投资时报》及标点财经研究院联合主办的“见未来 2020 第三届资本市场高峰论坛暨金禧奖年度颁奖盛典”在京举办，凭借综合资产管理能力和旗下产品业绩表现，博时基金荣获三项大奖。博时获评“金禧奖 2020 卓越公募基金公司”、“金禧奖 2020 优秀固收类基金团队”、“金禧奖 2020 大湾区特别贡献奖”。

2020 年 9 月 15 日，《上海证券报》第十七届“金基金”奖颁奖典礼在上海隆重举办，凭借综合资产管理能力和旗下产品业绩表现，博时基金及子公司博时资本共荣获三项大奖。博时基金荣获 2019 年度金基金·海外投资回报基金管理公司奖。博时旗下基金产品博时新起点灵活配置混合型证券投资基金获得 2019 年度金基金·灵活配置型基金三年期奖。博时资本张存相荣获“金阳光 三年卓越私募基金经理(MOM 类)”奖项。

2020 年 8 月 6 日，《经济观察报》“见圳四十年---深圳经济特区成立 40 周年特别盛典”在深圳举办，博时基金荣获“致敬深圳经济特区成立四十周年卓越企业”奖项。

2020 年 7 月 9 日，新浪财经“2020 中国基金业开放与发展高峰论坛暨基金业致敬资本市场 30 周年峰会”

在云端举办，届时公布了 2020 中国基金业金麒麟奖，博时基金荣获“2020 十大风云基金公司”，此外，博时基金王俊荣获“2020 最受青睐股票基金经理”奖项，博时基金赵云阳、桂征辉、王祥均荣获“2020 最受青睐指数与 ETF 基金经理”奖项。

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
二〇二〇年十月二十八日