

**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 4 季度报告
2020 年 12 月 31 日**

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年一月二十二日

§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 2021 年 1 月 20 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 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 博时可转债 ETF |
| 场内简称 | 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 | 99,386,670.00 份 |
| 投资目标 | 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。 |
| 投资策略 | <p>本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。本基金将采用抽样复制法，主要以标的指数的成份券构成为基础，综合考虑跟踪效果、流动性、操作风险等因素构建组合，并根据本基金资产规模、日常申购赎回情况、市场流动性等情况，进行抽样优化调整，达到复制标的指数、降低交易成本的目的。</p> <p>本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.3%，年跟踪误差不超过 4%。对于出现市场流动性不足、因法律法规原因被限制投资等情况，导致本基金无法获得对个别成份债足够数量的投资时，基金管理人将通过投资其他成份券、非成份券、成份券个券衍生品等方式进行替代。其他投资策略包括固定收益品种投资策略，含利率策略、骑乘策略、放大策略、其他金融工具投资策略以及国债期货投资策略等。</p> |
| 业绩比较基准 | 本基金的业绩比较基准为中证可转债及可交换债券指数收益率。 |
| 风险收益特征 | 本基金属于债券型基金，其预期收益及风险水平低于股票型基金、混合型基 |

| | |
|-------|---|
| | 金，高于货币市场基金。本基金采用优化抽样复制策略，跟踪中证可转债及可交换债券指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。 |
| 基金管理人 | 博时基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 招商银行股份有限公司 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期 (2020 年 10 月 1 日-2020 年 12 月 31 日) |
|----------------|---|
| 1.本期已实现收益 | 13,101,800.39 |
| 2.本期利润 | 24,055,552.04 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.2349 |
| 4.期末基金资产净值 | 1,030,207,961.89 |
| 5.期末基金份额净值 | 10.3657 |

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。

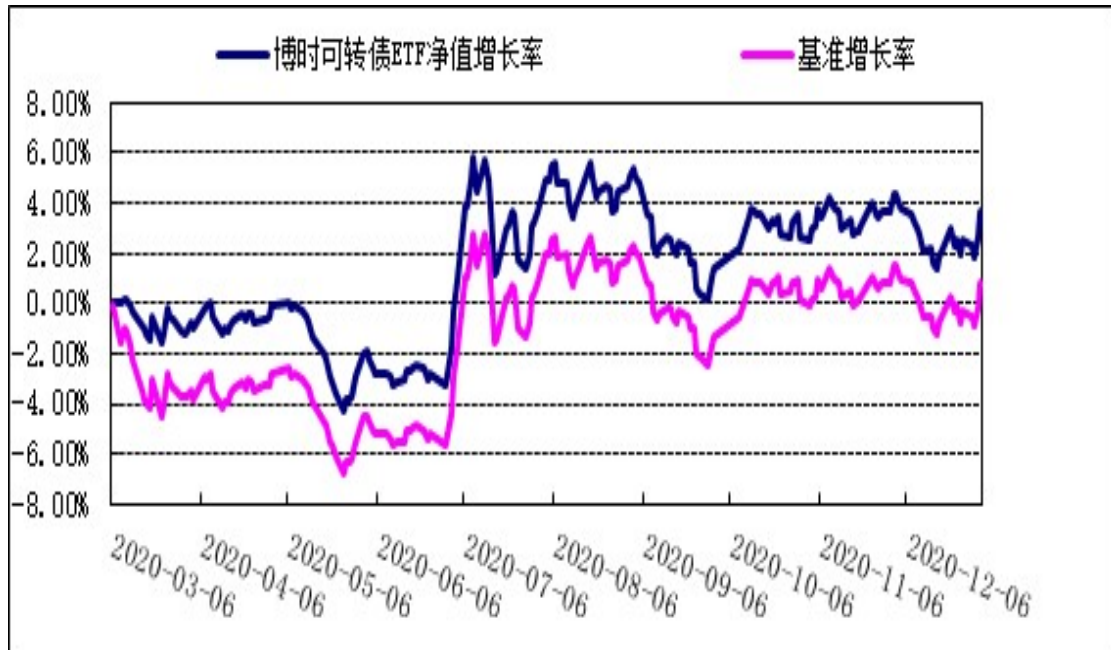
所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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 | 2.26% | 0.46% | 2.19% | 0.44% | 0.07% | 0.02% |
| 过去六个月 | 6.58% | 0.69% | 6.34% | 0.66% | 0.24% | 0.03% |
| 自基金合同生 效起至今 | 3.66% | 0.60% | 0.82% | 0.61% | 2.84% | -0.01% |

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 | - | 12.5 | 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

4 季度中证转债指数上涨 2.53%，结构性行情相当突出，高价格型和偏股型是相对更优选择，低价格和偏债型受到纯债市场的信用冲击影响而表现不如意，风格上电新产业链和周期上游品种表现突出，而大金融板块不尽人意。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。

展望未来，2021 年国内政策退坡和海外复苏将形成国内投资主线，国内稳宏观杠杆率下社融确定性降速，信用收缩基本成定局。目前确定性强的是货币政策正常性回归，国内基本面形势不错，在基本面未出现明显压力之前，货币政策易紧难松，且从历史经验看，在经济复苏中后期货币政策未出现过转向，判断货币政策方面仍将往紧平衡方向发展，不过考虑到疫苗接种节奏和疫情的波动性，未来一个季度货币政策维持现状的可能性更大。在信用收紧格局下，估值下行与盈利显著向上局面对应股市震荡格局概率偏大，行业业绩的分化提供结构性行情，全年指数涨跌可能并不明显。转债市场的整体估值也不算低，内部结构分层较为明显，明年估值上升动力不足，平价上行空间偏中性，对指数回报需适当降低收益预期。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2020 年 12 月 31 日，本基金基金份额净值为 10.3657 元，份额累计净值为 1.0366 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为 2.26%，同期业绩基准增长率 2.19%。

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 | 1,020,635,089.93 | 98.41 |
| | 其中：债券 | 1,020,635,089.93 | 98.41 |
| | 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 | 0.48 |
| | 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 | 7,321,065.55 | 0.71 |
| 8 | 其他各项资产 | 4,185,395.74 | 0.40 |
| 9 | 合计 | 1,037,141,551.22 | 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） | 1,020,635,089.93 | 99.07 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 1,020,635,089.93 | 99.07 |

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 | 806,410 | 82,068,345.70 | 7.97 |
| 2 | 113021 | 中信转债 | 644,620 | 67,736,669.60 | 6.58 |
| 3 | 113011 | 光大转债 | 492,340 | 60,872,917.60 | 5.91 |
| 4 | 132018 | G 三峡 EB1 | 342,270 | 40,322,828.70 | 3.91 |

| | | | | | |
|---|--------|------|---------|---------------|------|
| 5 | 110053 | 苏银转债 | 331,510 | 35,846,176.30 | 3.48 |
|---|--------|------|---------|---------------|------|

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)、南航转债(110075)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 12 月 31 日，因存在 1.个人贷款资金用途管控不严；2.发放流动资金贷款偿还银行承兑汇票垫款；3.理财投资和同业投资非标准化债权资产未严格比照自营贷款管理；4.个人理财资金对接项目资本金等违规行为，中国银行保险监督管理委员会江苏监管局对江苏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，因存在《大型飞机公共航空运输承运人运行合格审定规则》L 章第 121.363121.363 条的违规行为，民航中南局对中国南方航空股份有限公司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 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 | 71,643.91 |
| 2 | 应收证券清算款 | 545,517.93 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 3,568,233.90 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 4,185,395.74 |

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 | 82,068,345.70 | 7.97 |
| 2 | 113021 | 中信转债 | 67,736,669.60 | 6.58 |
| 3 | 113011 | 光大转债 | 60,872,917.60 | 5.91 |
| 4 | 132018 | G 三峡 EB1 | 40,322,828.70 | 3.91 |
| 5 | 110053 | 苏银转债 | 35,846,176.30 | 3.48 |
| 6 | 132015 | 18 中油 EB | 31,575,322.00 | 3.06 |
| 7 | 132009 | 17 中油 EB | 16,799,959.40 | 1.63 |
| 8 | 113013 | 国君转债 | 13,913,850.60 | 1.35 |
| 9 | 127005 | 长证转债 | 12,739,797.07 | 1.24 |
| 10 | 113026 | 核能转债 | 12,684,985.00 | 1.23 |
| 11 | 128112 | 歌尔转 2 | 10,906,821.46 | 1.06 |
| 12 | 132020 | 19 蓝星 EB | 9,056,817.00 | 0.88 |
| 13 | 127012 | 招路转债 | 8,218,302.54 | 0.80 |
| 14 | 113009 | 广汽转债 | 7,820,603.10 | 0.76 |
| 15 | 128107 | 交科转债 | 7,765,275.68 | 0.75 |
| 16 | 110061 | 川投转债 | 7,533,795.00 | 0.73 |
| 17 | 110051 | 中天转债 | 7,429,570.40 | 0.72 |
| 18 | 113008 | 电气转债 | 7,283,856.00 | 0.71 |
| 19 | 113035 | 福莱转债 | 6,710,210.80 | 0.65 |
| 20 | 110067 | 华安转债 | 6,682,953.60 | 0.65 |
| 21 | 110065 | 淮矿转债 | 6,457,581.00 | 0.63 |
| 22 | 128048 | 张行转债 | 6,278,682.33 | 0.61 |
| 23 | 132007 | 16 凤凰 EB | 6,272,091.00 | 0.61 |
| 24 | 113025 | 明泰转债 | 6,232,283.00 | 0.60 |
| 25 | 113034 | 滨化转债 | 6,172,990.80 | 0.60 |
| 26 | 132014 | 18 中化 EB | 6,051,595.00 | 0.59 |
| 27 | 128108 | 蓝帆转债 | 5,986,195.80 | 0.58 |
| 28 | 110062 | 烽火转债 | 5,510,265.30 | 0.53 |

| | | | | |
|----|--------|----------|--------------|------|
| 29 | 110043 | 无锡转债 | 5,454,539.40 | 0.53 |
| 30 | 132004 | 15 国盛 EB | 5,420,083.20 | 0.53 |
| 31 | 113583 | 益丰转债 | 5,299,927.50 | 0.51 |
| 32 | 113014 | 林洋转债 | 5,208,052.00 | 0.51 |
| 33 | 110048 | 福能转债 | 4,998,662.40 | 0.49 |
| 34 | 128095 | 恩捷转债 | 4,983,631.60 | 0.48 |
| 35 | 123044 | 红相转债 | 4,959,581.74 | 0.48 |
| 36 | 128081 | 海亮转债 | 4,926,761.00 | 0.48 |
| 37 | 113024 | 核建转债 | 4,781,410.20 | 0.46 |
| 38 | 113582 | 火炬转债 | 4,674,748.80 | 0.45 |
| 39 | 113586 | 上机转债 | 4,349,049.10 | 0.42 |
| 40 | 127017 | 万青转债 | 4,251,645.09 | 0.41 |
| 41 | 110068 | 龙净转债 | 4,204,069.60 | 0.41 |
| 42 | 132021 | 19 中电 EB | 4,188,505.20 | 0.41 |
| 43 | 113029 | 明阳转债 | 4,015,988.40 | 0.39 |
| 44 | 128035 | 大族转债 | 3,952,325.41 | 0.38 |
| 45 | 110031 | 航信转债 | 3,951,988.30 | 0.38 |
| 46 | 127006 | 敖东转债 | 3,930,358.32 | 0.38 |
| 47 | 110047 | 山鹰转债 | 3,870,794.40 | 0.38 |
| 48 | 113508 | 新风转债 | 3,825,718.40 | 0.37 |
| 49 | 110066 | 盛屯转债 | 3,804,788.10 | 0.37 |
| 50 | 113545 | 金能转债 | 3,645,890.10 | 0.35 |
| 51 | 110069 | 瀚蓝转债 | 3,606,403.80 | 0.35 |
| 52 | 128028 | 赣锋转债 | 3,472,367.96 | 0.34 |
| 53 | 128110 | 永兴转债 | 3,468,135.33 | 0.34 |
| 54 | 127015 | 希望转债 | 3,450,033.00 | 0.33 |
| 55 | 128109 | 楚江转债 | 3,428,715.40 | 0.33 |
| 56 | 128065 | 雅化转债 | 3,418,080.87 | 0.33 |
| 57 | 110045 | 海澜转债 | 3,376,810.80 | 0.33 |
| 58 | 110041 | 蒙电转债 | 3,197,134.80 | 0.31 |
| 59 | 110063 | 鹰 19 转债 | 3,133,646.20 | 0.30 |
| 60 | 128029 | 太阳转债 | 3,015,397.44 | 0.29 |
| 61 | 113033 | 利群转债 | 3,005,318.40 | 0.29 |
| 62 | 123017 | 寒锐转债 | 2,999,691.20 | 0.29 |
| 63 | 128034 | 江银转债 | 2,975,302.88 | 0.29 |
| 64 | 128114 | 正邦转债 | 2,945,732.80 | 0.29 |
| 65 | 110056 | 亨通转债 | 2,903,577.60 | 0.28 |
| 66 | 113537 | 文灿转债 | 2,862,543.20 | 0.28 |
| 67 | 110057 | 现代转债 | 2,799,160.20 | 0.27 |
| 68 | 110034 | 九州转债 | 2,725,398.00 | 0.26 |
| 69 | 113543 | 欧派转债 | 2,679,423.40 | 0.26 |
| 70 | 110064 | 建工转债 | 2,662,810.80 | 0.26 |
| 71 | 113550 | 常汽转债 | 2,560,916.40 | 0.25 |

| | | | | |
|-----|--------|----------|--------------|------|
| 72 | 110052 | 贵广转债 | 2,424,480.00 | 0.24 |
| 73 | 113542 | 好客转债 | 2,391,219.00 | 0.23 |
| 74 | 113017 | 吉视转债 | 2,360,925.60 | 0.23 |
| 75 | 110055 | 伊力转债 | 2,342,016.00 | 0.23 |
| 76 | 128017 | 金禾转债 | 2,287,113.51 | 0.22 |
| 77 | 113584 | 家悦转债 | 2,203,747.00 | 0.21 |
| 78 | 113516 | 苏农转债 | 2,184,967.20 | 0.21 |
| 79 | 127016 | 鲁泰转债 | 2,181,062.40 | 0.21 |
| 80 | 128111 | 中矿转债 | 2,157,268.80 | 0.21 |
| 81 | 132017 | 19 新钢 EB | 2,092,896.00 | 0.20 |
| 82 | 113534 | 鼎胜转债 | 2,073,718.80 | 0.20 |
| 83 | 110033 | 国贸转债 | 2,027,694.50 | 0.20 |
| 84 | 127011 | 中鼎转 2 | 2,011,348.00 | 0.20 |
| 85 | 128096 | 奥瑞转债 | 1,961,857.38 | 0.19 |
| 86 | 127007 | 湖广转债 | 1,919,368.34 | 0.19 |
| 87 | 113579 | 健友转债 | 1,745,513.70 | 0.17 |
| 88 | 128046 | 利尔转债 | 1,734,930.09 | 0.17 |
| 89 | 123049 | 维尔转债 | 1,601,161.04 | 0.16 |
| 90 | 113587 | 泛微转债 | 1,600,332.50 | 0.16 |
| 91 | 128078 | 太极转债 | 1,560,870.72 | 0.15 |
| 92 | 123055 | 晨光转债 | 1,544,412.90 | 0.15 |
| 93 | 127013 | 创维转债 | 1,526,607.24 | 0.15 |
| 94 | 128026 | 众兴转债 | 1,518,312.50 | 0.15 |
| 95 | 123048 | 应急转债 | 1,475,545.68 | 0.14 |
| 96 | 113549 | 白电转债 | 1,474,629.80 | 0.14 |
| 97 | 128083 | 新北转债 | 1,458,465.11 | 0.14 |
| 98 | 123050 | 聚飞转债 | 1,457,809.47 | 0.14 |
| 99 | 123035 | 利德转债 | 1,444,630.00 | 0.14 |
| 100 | 128018 | 时达转债 | 1,407,856.14 | 0.14 |
| 101 | 128075 | 远东转债 | 1,404,676.02 | 0.14 |
| 102 | 128064 | 司尔转债 | 1,398,196.80 | 0.14 |
| 103 | 113563 | 柳药转债 | 1,380,699.60 | 0.13 |
| 104 | 128105 | 长集转债 | 1,355,331.51 | 0.13 |
| 105 | 128097 | 奥佳转债 | 1,283,537.40 | 0.12 |
| 106 | 128113 | 比音转债 | 1,268,230.80 | 0.12 |
| 107 | 123004 | 铁汉转债 | 1,248,942.40 | 0.12 |
| 108 | 128013 | 洪涛转债 | 1,247,875.90 | 0.12 |
| 109 | 110060 | 天路转债 | 1,235,858.40 | 0.12 |
| 110 | 113504 | 艾华转债 | 1,212,166.80 | 0.12 |
| 111 | 128015 | 久其转债 | 1,189,097.40 | 0.12 |
| 112 | 128032 | 双环转债 | 1,178,396.44 | 0.11 |
| 113 | 128023 | 亚太转债 | 1,168,680.00 | 0.11 |
| 114 | 113505 | 杭电转债 | 1,158,638.80 | 0.11 |

| | | | | |
|-----|--------|----------|--------------|------|
| 115 | 113016 | 小康转债 | 1,121,778.00 | 0.11 |
| 116 | 127003 | 海印转债 | 1,120,521.60 | 0.11 |
| 117 | 113519 | 长久转债 | 1,077,780.00 | 0.10 |
| 118 | 132008 | 17 山高 EB | 1,057,740.00 | 0.10 |
| 119 | 128063 | 未来转债 | 1,050,170.67 | 0.10 |
| 120 | 110038 | 济川转债 | 1,043,854.50 | 0.10 |
| 121 | 128106 | 华统转债 | 1,022,170.50 | 0.10 |
| 122 | 113528 | 长城转债 | 987,935.50 | 0.10 |
| 123 | 113530 | 大丰转债 | 978,318.00 | 0.09 |
| 124 | 128100 | 搜特转债 | 963,331.20 | 0.09 |
| 125 | 127014 | 北方转债 | 952,321.86 | 0.09 |
| 126 | 128087 | 孚日转债 | 949,335.80 | 0.09 |
| 127 | 128044 | 岭南转债 | 943,542.00 | 0.09 |
| 128 | 123023 | 迪森转债 | 939,268.20 | 0.09 |
| 129 | 113588 | 润达转债 | 929,218.00 | 0.09 |
| 130 | 113557 | 森特转债 | 920,933.80 | 0.09 |
| 131 | 128057 | 博彦转债 | 918,577.26 | 0.09 |
| 132 | 113575 | 东时转债 | 898,267.70 | 0.09 |
| 133 | 128090 | 汽模转 2 | 893,980.48 | 0.09 |
| 134 | 128093 | 百川转债 | 880,524.00 | 0.09 |
| 135 | 113012 | 骆驼转债 | 875,679.60 | 0.09 |
| 136 | 123053 | 宝通转债 | 875,353.50 | 0.08 |
| 137 | 113576 | 起步转债 | 867,652.80 | 0.08 |
| 138 | 113559 | 永创转债 | 850,120.00 | 0.08 |
| 139 | 128033 | 迪龙转债 | 807,806.72 | 0.08 |
| 140 | 128010 | 顺昌转债 | 784,496.90 | 0.08 |
| 141 | 123033 | 金力转债 | 776,388.80 | 0.08 |
| 142 | 123028 | 清水转债 | 775,045.72 | 0.08 |
| 143 | 128066 | 亚泰转债 | 771,352.10 | 0.07 |
| 144 | 113525 | 台华转债 | 753,410.50 | 0.07 |
| 145 | 113532 | 海环转债 | 711,288.00 | 0.07 |
| 146 | 123010 | 博世转债 | 695,294.22 | 0.07 |
| 147 | 113585 | 寿仙转债 | 694,291.60 | 0.07 |
| 148 | 110070 | 凌钢转债 | 692,582.80 | 0.07 |
| 149 | 113556 | 至纯转债 | 688,574.00 | 0.07 |
| 150 | 128022 | 众信转债 | 681,884.00 | 0.07 |
| 151 | 128037 | 岩土转债 | 668,590.00 | 0.06 |
| 152 | 128042 | 凯中转债 | 662,075.04 | 0.06 |
| 153 | 123025 | 精测转债 | 641,904.00 | 0.06 |
| 154 | 123022 | 长信转债 | 619,557.24 | 0.06 |
| 155 | 113578 | 全筑转债 | 619,380.00 | 0.06 |
| 156 | 113580 | 康隆转债 | 590,502.00 | 0.06 |
| 157 | 113027 | 华钰转债 | 584,606.40 | 0.06 |

| | | | | |
|-----|--------|------|------------|------|
| 158 | 128049 | 华源转债 | 580,496.00 | 0.06 |
| 159 | 128082 | 华锋转债 | 573,375.60 | 0.06 |
| 160 | 113564 | 天目转债 | 566,702.60 | 0.06 |
| 161 | 113565 | 宏辉转债 | 547,770.30 | 0.05 |
| 162 | 110058 | 永鼎转债 | 546,236.40 | 0.05 |
| 163 | 113569 | 科达转债 | 537,513.60 | 0.05 |
| 164 | 113541 | 荣晟转债 | 531,402.60 | 0.05 |
| 165 | 128071 | 合兴转债 | 525,518.28 | 0.05 |
| 166 | 113568 | 新春转债 | 523,477.50 | 0.05 |
| 167 | 123051 | 今天转债 | 513,752.40 | 0.05 |
| 168 | 113509 | 新泉转债 | 504,852.60 | 0.05 |
| 169 | 128021 | 兄弟转债 | 476,561.17 | 0.05 |
| 170 | 123007 | 道氏转债 | 470,025.00 | 0.05 |
| 171 | 123002 | 国祯转债 | 455,667.00 | 0.04 |
| 172 | 128101 | 联创转债 | 440,117.68 | 0.04 |
| 173 | 123046 | 天铁转债 | 438,721.92 | 0.04 |
| 174 | 113577 | 春秋转债 | 437,428.20 | 0.04 |
| 175 | 128050 | 钧达转债 | 432,361.60 | 0.04 |
| 176 | 113030 | 东风转债 | 427,146.50 | 0.04 |
| 177 | 128025 | 特一转债 | 412,931.70 | 0.04 |
| 178 | 128069 | 华森转债 | 411,640.20 | 0.04 |
| 179 | 113570 | 百达转债 | 399,818.80 | 0.04 |
| 180 | 113524 | 奇精转债 | 396,206.00 | 0.04 |
| 181 | 128014 | 永东转债 | 393,488.40 | 0.04 |
| 182 | 128051 | 光华转债 | 373,732.80 | 0.04 |
| 183 | 128094 | 星帅转债 | 372,624.00 | 0.04 |
| 184 | 113573 | 纵横转债 | 370,735.20 | 0.04 |
| 185 | 128040 | 华通转债 | 354,443.52 | 0.03 |
| 186 | 123011 | 德尔转债 | 340,948.40 | 0.03 |
| 187 | 123039 | 开润转债 | 326,924.30 | 0.03 |
| 188 | 113548 | 石英转债 | 319,166.40 | 0.03 |
| 189 | 123047 | 久吾转债 | 314,608.00 | 0.03 |
| 190 | 128103 | 同德转债 | 312,987.20 | 0.03 |
| 191 | 113572 | 三祥转债 | 310,349.20 | 0.03 |
| 192 | 128072 | 翔鹭转债 | 303,512.40 | 0.03 |
| 193 | 113561 | 正裕转债 | 302,394.60 | 0.03 |
| 194 | 123045 | 雷迪转债 | 300,288.00 | 0.03 |
| 195 | 123030 | 九洲转债 | 291,117.10 | 0.03 |
| 196 | 113567 | 君禾转债 | 288,260.00 | 0.03 |
| 197 | 113535 | 大业转债 | 276,192.00 | 0.03 |
| 198 | 113566 | 翔港转债 | 262,191.40 | 0.03 |
| 199 | 123031 | 晶瑞转债 | 251,974.80 | 0.02 |
| 200 | 113526 | 联泰转债 | 250,303.20 | 0.02 |

| | | | | |
|-----|--------|------|------------|------|
| 201 | 113536 | 三星转债 | 247,488.80 | 0.02 |
| 202 | 128070 | 智能转债 | 238,884.00 | 0.02 |
| 203 | 123038 | 联得转债 | 236,660.60 | 0.02 |
| 204 | 113574 | 华体转债 | 204,888.60 | 0.02 |
| 205 | 123027 | 蓝晓转债 | 196,676.20 | 0.02 |
| 206 | 128076 | 金轮转债 | 155,641.20 | 0.02 |
| 207 | 128079 | 英联转债 | 116,716.80 | 0.01 |
| 208 | 128030 | 天康转债 | 41,168.40 | 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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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 | 102,786,670.00 |
| 报告期基金总申购份额 | 5,000,000.00 |
| 减：报告期基金总赎回份额 | 8,400,000.00 |
| 报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 99,386,670.00 |

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内基金管理人未发生运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。“为国民创造财富”是博时的使命。博时的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 2020 年 12 月 31 日，博时基金公司共管理 246 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 13294 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 4012 亿元人民币，累计分红逾 1373 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。

其他大事件

2020 年 12 月 31 日，在中国证券业协会主办，中国期货业协会、中国证券投资基金业协会协办的第七届证券期货科学技术奖中，博时基金、金证财富《新一代投资决策支持系统》荣获证券期货科学技术奖三等奖。

2020 年 12 月，大众证券报“2020 中国基金风云榜”揭晓，博时基金获“2020 年度十大风云基金公司”，博时医疗保健行业获“2020 年度十大风云基金产品”。

2020 年 12 月 23 日，在信息时报“金狮奖”中，博时基金荣获“年度最具核心竞争力基金公司”。

2020 年 12 月 15 日，“聚中国 投未来·2021 新财富资产管理年会”在深圳举办，博时基金荣获 2020 新财富最智慧投资机构。

2020 年 12 月 11 日，由证券时报·券商中国主办的“2020 中国金融科技先锋榜”隆重揭晓，博时基金荣登“中国公募基金智能投研先锋榜”。

2020 年 12 月 10 日，金融界“第五届智能金融国际论坛暨 2020 金融界领航中国年度盛典”，博时基金荣获四项大奖。博时基金董事长江向阳获“杰出年度基金领袖奖”，博时基金荣获“杰出年度创新基金公司奖”、“杰出年度基金公司奖”、“杰出年度海外投资基金公司奖”。

2020 年 12 月 10 日，香港中资基金业协会（HKCAMA）和彭博（Bloomberg）2020 年度“离岸中资基金大奖”中，博时国际荣膺“最佳跨境业务”大奖，“博时-东方红大中华债券基金”荣膺“最佳总回报-大中华区固定收益（1 年）”亚军。

2020 年 12 月 8 日，北京商报社主办的“数字金融 争渡未来·2020 年度北京金融论坛”在北京举办，博时基金荣获 2020 年度北京金融业十大品牌·产品创新卓越奖。

2020 年 12 月 2 日，经济观察报举办的 2020 卓越金融企业盛典举行，博时基金荣获“年度卓越综合实力基金公司”称号。

2020 年 11 月 28 日，由 21 世纪经济报道主办的第五届财经“金帆奖”评选中，博时基金荣获“2020 年度卓越基金管理公司”。

2020 年 11 月 27 日，国际金融报“第三届 CSR 先锋论坛暨 2020 先锋奖项颁奖典礼”在北京举办，凭借在社会责任方面的贡献，博时基金荣获 2020 年度社会责任先锋案例。

2020 年 11 月 20 日，2020 第一财经金融价值榜·颁奖典礼在上海举办，博时基金获选“2020 年度第一财经金融价值榜”年度基金公司管理人。

2020 年 11 月 19 日，由思维财经&投资者网主办的思维财经投资者年会暨“金桥奖”颁奖盛典上，博时基金荣获“金桥奖·年度最具投资价值基金公司”。

2020 年 11 月，联合国负责任投资原则组织(UN PRI)发布 2020 年度签署方评估报告。博时基金在衡量公司整体 ESG 管理水平的“战略与治理”模块，获得了首批最高评价“A+”评定。

2020 年 10 月 28 日，由《中国基金报》主办的“2020 中国机构投资者峰会”在上海浦东香格里拉酒店举行。第七届中国基金业英华奖中，博时基金陈凯杨荣获“五年期纯债投资最佳基金经理”，过均荣获“五年期二级债投资最佳基金经理”，何凯荣获“三年期海外固收投资最佳基金经理”及“五年期海外固收投资最佳基金经理”。第二届中国公募基金英华奖中，博时基金荣获“2019 年度最佳营销策划案例（最佳创意）”、“2019 年度最佳社会公益实践案例”、“2019 年度最佳电商业务发展基金公司”、“2019 年度最佳创新基金产品”、“2019 年度最佳营销策划案例（最佳综合）”、“2019 年度最佳指数增强基金”奖项。

2020 年 10 月 23 日，国际金融报主办的“2020 国际先锋金融机构高峰论坛暨颁奖典礼”在上海举办，博时基金董事长江向阳荣获“金融行业先锋领袖”、博时基金荣获“先锋证券投资机构”。

2020 年 10 月 16 日，由《每日经济新闻》主办的“2020 中国金融每经峰会资本市场高峰论坛暨 2020 中国金鼎奖颁奖典礼”在上海举行，博时基金成功斩获“固收+最具人气基金公司奖”和“最具影响力基金公司-专户一对多”奖项，博时基金投资经理王晓冬荣获“最具实力权益类专户基金经理”奖项。

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行，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颁奖典礼在北京举办，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

二〇二一年一月二十二日