

**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  
2021 年第 1 季度报告  
2021 年 3 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：二〇二一年四月二十二日

## §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 4 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 2021 年 1 月 1 日起至 3 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	70,286,670.00 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	<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 (2021 年 1 月 1 日-2021 年 3 月 31 日)
1.本期已实现收益	16,488,121.78
2.本期利润	1,826,570.82
3.加权平均基金份额本期利润	0.0218
4.期末基金资产净值	728,028,672.90
5.期末基金份额净值	10.3580

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。

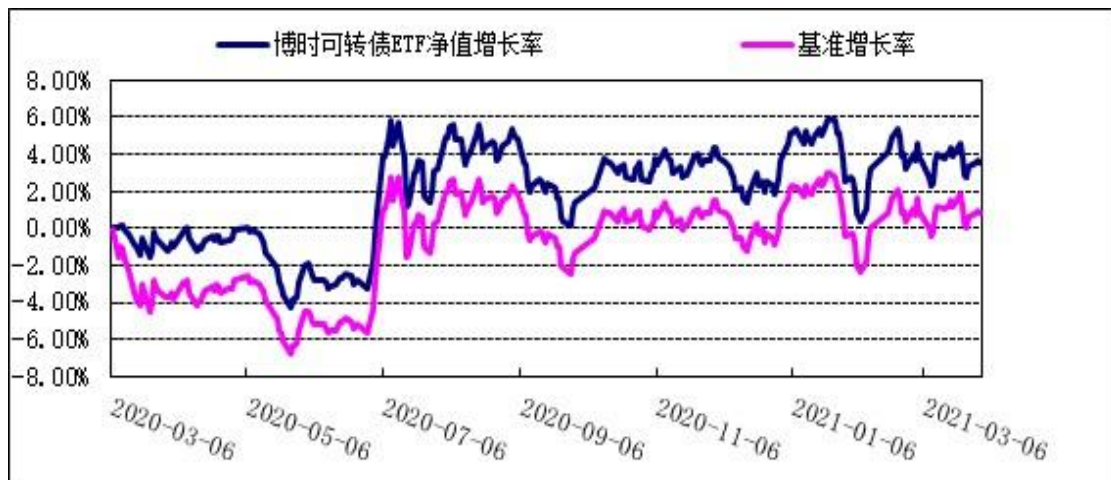
所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 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	-0.07%	0.62%	0.03%	0.58%	-0.10%	0.04%
过去六个月	2.19%	0.54%	2.22%	0.51%	-0.03%	0.03%
过去一年	4.80%	0.61%	4.77%	0.58%	0.03%	0.03%
自基金合同生 效起至今	3.58%	0.60%	0.85%	0.60%	2.73%	0.00%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



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	固定收益总部指数与创新组投资总监助理/基金经理	2020-03-06	-	12.7	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。现任固定收益总
--	--	--	--	--	---

					部指数与创新组投资总监助理兼博时稳健回报债券型证券投资基金 (LOF) (2018 年 4 月 23 日—至今)、博时转债增强债券型证券投资基金 (2019 年 4 月 25 日—至今)、博时稳定价值证券投资基金 (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 11 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

2021 年一季度，市场流动性基本维持前期较为宽松状态，债券收益率处于窄幅震荡局面，中债总财富（总值）指数上涨 0.68%。从债券收益率看，1 年国债收益率震荡上行 10bp 至 2.6%，10 年国债收益率在 3.1%-3.3% 之间波动，季末处于 3.2%，基本持平，3 年中期票据收益率在 3.60%（AAA）、3.85%（AA+）、4.3%（AA）。A 股市场震荡调整，相比 2020 年 4 季度波动有所加大，沪深 300 指数下跌 3.13%、上证指数

下跌 0.90%、创业板指数下跌 7.00%，同期中证转债及可交债指数上涨 0.04%。一季度，市场对疫情后的海外发达经济体复苏给予较高期待，10 年美债收益率快速上行超市场预期，同时原油价格也上涨明显，给权益市场带来了一波调整压力。国内货币政策仍维持偏宽松状态，收紧力度应低于预期，信用收缩较为平缓。股票市场分化挺明显，从申万一级行业看，钢铁、公用事业、银行、休闲服务和建筑装饰等板块表现较好且有不错的正收益，而国防军工、非银金融、通信和计算机等板块表现落后，负收益明显，可转债方面基本映射正股市场，2020 年疫情受损明显的行业表现靠前。纯债方面，票息收益是主要收益来源，但防范信用风险需重点关注。

操作方面，本组合为指数类基金，操作方面重点关注组合的跟踪误差，同时避免很不合理的一些个券并进行优化调整。

展望未来，在权益市场偏震荡和货币政策缺乏宽松空间局面下，可转债市场的估值中枢下行风险相对偏大，同时平价难以形成上行力量，对转债指数回报持偏中性态度，交易上重视逆向思维。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 03 月 31 日，本基金基金份额净值为 10.3580 元，份额累计净值为 1.0358 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为-0.07%，同期业绩基准增长率 0.03%。

#### 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	714,190,217.80	97.17
	其中：债券	714,190,217.80	97.17
	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	10,000,000.00	1.36
	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	7,066,506.59	0.96
8	其他各项资产	3,727,134.89	0.51
9	合计	734,983,859.28	100.00

## 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）	714,190,217.80	98.10
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	714,190,217.80	98.10

## 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	533,050	54,706,921.50	7.51
2	113021	中信转债	426,840	44,920,641.60	6.17
3	113044	大秦转债	342,320	35,098,069.60	4.82
4	113011	光大转债	272,790	33,250,373.10	4.57
5	132018	G 三峡 EB1	224,930	27,459,454.40	3.77

## 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)、上银转债(113042)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：2021 年 2 月 5 日，因存在：1.未按规定履行客户身份识别义务；2.未按规定保存客户身份资料和交易记录；3.未按规定报送大额交易报告和可疑交易报告等违规行为，中国人民银行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 5 月 9 日，光大银行监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在以下违法违规行为：（一）分户账明细记录应报未报；（二）关键且应报字段漏报或填报错误；（三）向检查组提供与事实不符的材料；（四）账户设置不能如实反映业务实际。中国银行保险监督管理委员会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 121.363 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。

主要违规事实：2020 年 11 月 25 日，因存在 1.2014 年至 2018 年，该行绩效考评管理严重违反审慎经营规则。2.2018 年，该行未按规定延期支付 2017 年度绩效薪酬等违规行为，中国银行保险监督管理委员会上海监管局对上海银行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	75,980.51
2	应收证券清算款	2,071,820.31
3	应收股利	-
4	应收利息	1,579,334.07
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,727,134.89

#### 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	54,706,921.50	7.51
2	113021	中信转债	44,920,641.60	6.17
3	113011	光大转债	33,250,373.10	4.57
4	132018	G 三峡 EB1	27,459,454.40	3.77
5	110053	苏银转债	25,435,269.90	3.49
6	132015	18 中油 EB	21,599,335.80	2.97
7	132009	17 中油 EB	10,865,263.50	1.49
8	110073	国投转债	8,991,537.00	1.24
9	113026	核能转债	8,765,805.20	1.20
10	113013	国君转债	8,163,744.00	1.12
11	132020	19 蓝星 EB	6,036,840.00	0.83
12	127005	长证转债	6,026,585.76	0.83
13	127012	招路转债	5,847,217.48	0.80
14	128129	青农转债	5,690,932.11	0.78
15	110061	川投转债	5,595,034.90	0.77
16	110051	中天转债	5,053,100.00	0.69
17	128128	齐翔转 2	4,895,848.80	0.67
18	113037	紫银转债	4,887,663.30	0.67
19	127020	中金转债	4,525,330.32	0.62
20	132007	16 凤凰 EB	4,493,132.00	0.62
21	128108	蓝帆转债	4,459,958.10	0.61
22	132014	18 中化 EB	4,012,496.00	0.55
23	113009	广汽转债	4,004,991.00	0.55
24	132004	15 国盛 EB	3,907,833.40	0.54
25	110043	无锡转债	3,870,904.20	0.53
26	128035	大族转债	3,845,910.78	0.53
27	128126	赣锋转 2	3,833,289.80	0.53
28	110065	淮矿转债	3,704,742.00	0.51
29	110048	福能转债	3,689,023.60	0.51
30	128107	交科转债	3,527,194.88	0.48
31	110062	烽火转债	3,455,676.00	0.47
32	128081	海亮转债	3,451,698.00	0.47

33	113034	滨化转债	3,391,444.90	0.47
34	113025	明泰转债	3,311,652.00	0.45
35	110067	华安转债	3,295,674.60	0.45
36	113024	核建转债	3,275,589.80	0.45
37	113014	林洋转债	3,161,158.00	0.43
38	113545	金能转债	3,095,067.50	0.43
39	128048	张行转债	2,927,753.58	0.40
40	110072	广汇转债	2,871,844.80	0.39
41	110047	山鹰转债	2,788,862.40	0.38
42	113508	新风转债	2,767,984.40	0.38
43	123058	欣旺转债	2,762,144.28	0.38
44	123044	红相转债	2,742,815.04	0.38
45	127017	万青转债	2,736,930.60	0.38
46	110031	航信转债	2,712,892.00	0.37
47	128064	司尔转债	2,543,798.40	0.35
48	127006	敖东转债	2,527,165.16	0.35
49	110045	海澜转债	2,463,310.80	0.34
50	128119	龙大转债	2,454,321.96	0.34
51	132021	19 中电 EB	2,450,520.00	0.34
52	110063	鹰 19 转债	2,317,123.20	0.32
53	110068	龙净转债	2,181,412.80	0.30
54	113602	景 20 转债	2,139,872.00	0.29
55	110041	蒙电转债	2,111,274.00	0.29
56	128109	楚江转债	2,024,698.90	0.28
57	128034	江银转债	1,944,475.68	0.27
58	113033	利群转债	1,884,623.00	0.26
59	128114	正邦转债	1,869,385.20	0.26
60	110057	现代转债	1,830,442.60	0.25
61	128029	太阳转债	1,805,973.18	0.25
62	110034	九州转债	1,793,315.00	0.25
63	110074	精达转债	1,785,908.60	0.25
64	110056	亨通转债	1,782,444.40	0.24
65	128125	华阳转债	1,754,628.40	0.24
66	110064	建工转债	1,714,245.00	0.24
67	113582	火炬转债	1,652,373.60	0.23
68	110052	贵广转债	1,614,121.50	0.22
69	113017	吉视转债	1,603,385.10	0.22
70	128130	景兴转债	1,599,207.90	0.22
71	128017	金禾转债	1,589,578.54	0.22
72	110066	盛屯转债	1,579,662.00	0.22
73	123060	苏试转债	1,572,227.20	0.22
74	132017	19 新钢 EB	1,558,076.00	0.21
75	127016	鲁泰转债	1,497,920.00	0.21

76	128131	崇达转 2	1,495,297.90	0.21
77	128095	恩捷转债	1,486,425.60	0.20
78	128078	太极转债	1,469,322.82	0.20
79	113516	苏农转债	1,441,638.20	0.20
80	113039	嘉泽转债	1,435,747.20	0.20
81	127011	中鼎转 2	1,422,036.00	0.20
82	110033	国贸转债	1,363,764.90	0.19
83	113584	家悦转债	1,335,267.00	0.18
84	113603	东缆转债	1,334,144.80	0.18
85	128046	利尔转债	1,255,107.15	0.17
86	127007	湖广转债	1,247,357.88	0.17
87	128096	奥瑞转债	1,233,578.19	0.17
88	113543	欧派转债	1,225,813.20	0.17
89	113534	鼎胜转债	1,180,010.00	0.16
90	113579	健友转债	1,172,026.80	0.16
91	113557	森特转债	1,169,532.00	0.16
92	127015	希望转债	1,167,391.70	0.16
93	113550	常汽转债	1,166,888.80	0.16
94	123049	维尔转债	1,116,533.76	0.15
95	128032	双环转债	1,107,733.16	0.15
96	113596	城地转债	1,090,042.20	0.15
97	110069	瀚蓝转债	1,043,713.00	0.14
98	123035	利德转债	1,034,583.00	0.14
99	127013	创维转债	1,028,984.16	0.14
100	128127	文科转债	1,024,900.20	0.14
101	128113	比音转债	1,007,732.00	0.14
102	128018	时达转债	993,559.56	0.14
103	128026	众兴转债	989,445.60	0.14
104	128097	奥佳转债	988,462.50	0.14
105	128083	新北转债	982,254.36	0.13
106	113549	白电转债	970,371.60	0.13
107	113563	柳药转债	959,232.80	0.13
108	113537	文灿转债	946,981.60	0.13
109	113016	小康转债	935,320.80	0.13
110	128111	中矿转债	934,065.60	0.13
111	128105	长集转债	932,306.71	0.13
112	123004	铁汉转债	884,876.40	0.12
113	128015	久其转债	864,545.30	0.12
114	128023	亚太转债	863,123.80	0.12
115	110060	天路转债	854,331.10	0.12
116	123050	聚飞转债	850,006.18	0.12
117	128033	迪龙转债	819,149.76	0.11
118	113504	艾华转债	814,638.60	0.11

119	113505	杭电转债	810,213.50	0.11
120	110071	湖盐转债	800,248.50	0.11
121	113599	嘉友转债	799,565.60	0.11
122	128121	宏川转债	785,907.76	0.11
123	128124	科华转债	772,807.20	0.11
124	132008	17 山高 EB	757,290.60	0.10
125	123063	大禹转债	735,833.40	0.10
126	113519	长久转债	730,350.00	0.10
127	127003	海印转债	730,084.80	0.10
128	123064	万孚转债	728,469.00	0.10
129	113542	好客转债	725,734.50	0.10
130	128100	搜特转债	724,502.70	0.10
131	113593	沪工转债	707,744.00	0.10
132	127014	北方转债	701,883.05	0.10
133	110038	济川转债	689,411.20	0.09
134	128106	华统转债	670,505.00	0.09
135	128063	未来转债	668,023.50	0.09
136	128116	瑞达转债	666,934.00	0.09
137	128087	孚日转债	659,239.20	0.09
138	113530	大丰转债	658,350.00	0.09
139	113528	长城转债	650,231.20	0.09
140	128044	岭南转债	644,960.00	0.09
141	128075	远东转债	640,901.87	0.09
142	123056	雪榕转债	633,973.00	0.09
143	113559	永创转债	625,878.00	0.09
144	113012	骆驼转债	621,158.40	0.09
145	128057	博彦转债	614,668.83	0.08
146	113588	润达转债	602,911.50	0.08
147	113600	新星转债	585,986.20	0.08
148	113591	胜达转债	553,135.00	0.08
149	113036	宁建转债	547,087.20	0.08
150	113589	天创转债	543,736.80	0.07
151	128093	百川转债	534,910.58	0.07
152	113526	联泰转债	527,577.90	0.07
153	123023	迪森转债	516,325.50	0.07
154	123053	宝通转债	499,004.00	0.07
155	123033	金力转债	443,866.50	0.06
156	113525	台华转债	440,076.20	0.06
157	128066	亚泰转债	430,975.60	0.06
158	113564	天目转债	430,359.20	0.06
159	128022	众信转债	425,273.20	0.06
160	113532	海环转债	420,673.50	0.06
161	123028	清水转债	413,716.68	0.06

162	123067	斯莱转债	404,373.00	0.06
163	123066	赛意转债	402,597.00	0.06
164	128037	岩土转债	401,186.40	0.06
165	110070	凌钢转债	400,663.20	0.06
166	123048	应急转债	387,251.02	0.05
167	123025	精测转债	384,969.20	0.05
168	128082	华锋转债	384,306.00	0.05
169	123059	银信转债	383,315.70	0.05
170	128042	凯中转债	382,971.16	0.05
171	128014	永东转债	378,520.40	0.05
172	113524	奇精转债	374,624.90	0.05
173	128049	华源转债	374,446.80	0.05
174	110055	伊力转债	373,651.20	0.05
175	113568	新春转债	373,570.50	0.05
176	128117	道恩转债	370,424.00	0.05
177	113030	东风转债	369,276.20	0.05
178	113578	全筑转债	368,068.00	0.05
179	123010	博世转债	367,599.40	0.05
180	113541	荣晟转债	362,668.80	0.05
181	128025	特一转债	360,476.10	0.05
182	113597	佳力转债	359,714.00	0.05
183	128069	华森转债	359,627.40	0.05
184	113573	纵横转债	351,830.60	0.05
185	128118	瀛通转债	350,390.00	0.05
186	128071	合兴转债	350,172.24	0.05
187	113569	科达转债	349,487.50	0.05
188	113594	淳中转债	347,975.00	0.05
189	128101	联创转债	346,398.80	0.05
190	113595	花王转债	344,029.20	0.05
191	113598	法兰转债	342,126.40	0.05
192	113576	起步转债	341,941.40	0.05
193	128094	星帅转债	341,813.80	0.05
194	123051	今天转债	340,196.40	0.05
195	128123	国光转债	340,060.98	0.05
196	128051	光华转债	339,416.00	0.05
197	123002	国祯转债	335,388.60	0.05
198	128021	兄弟转债	333,952.46	0.05
199	113570	百达转债	332,304.00	0.05
200	128122	兴森转债	330,635.90	0.05
201	128090	汽模转 2	328,144.96	0.05
202	123007	道氏转债	326,285.26	0.04
203	113585	寿仙转债	324,519.00	0.04
204	123011	德尔转债	319,221.50	0.04

205	123022	长信转债	317,009.50	0.04
206	113027	华钰转债	313,089.40	0.04
207	113577	春秋转债	308,070.00	0.04
208	110058	永鼎转债	307,678.50	0.04
209	128050	钧达转债	304,750.60	0.04
210	128072	翔鹭转债	293,928.50	0.04
211	123039	开润转债	291,673.00	0.04
212	128040	华通转债	290,378.40	0.04
213	113565	宏辉转债	289,629.90	0.04
214	128103	同德转债	272,385.30	0.04
215	123047	久吾转债	268,814.80	0.04
216	113567	君禾转债	266,978.40	0.04
217	113535	大业转债	263,850.30	0.04
218	113509	新泉转债	262,332.00	0.04
219	113572	三祥转债	237,720.00	0.03
220	113536	三星转债	225,060.00	0.03
221	123045	雷迪转债	215,750.40	0.03
222	113548	石英转债	212,429.20	0.03
223	113561	正裕转债	204,727.00	0.03
224	128070	智能转债	204,355.80	0.03
225	123046	天铁转债	204,251.52	0.03
226	113566	翔港转债	201,029.80	0.03
227	123038	联得转债	198,580.20	0.03
228	113574	华体转债	193,648.00	0.03
229	123030	九洲转债	184,152.50	0.03
230	123031	晶瑞转债	178,393.80	0.02
231	123027	蓝晓转债	177,082.60	0.02
232	113575	东时转债	159,734.60	0.02
233	128079	英联转债	148,984.80	0.02
234	128076	金轮转债	144,962.40	0.02

#### 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	99,386,670.00
报告期基金总申购份额	-



减：报告期基金总赎回份额	29,100,000.00
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	70,286,670.00

## §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

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	2021-01-05~2021-01-28;2021-03-08~2021-03-31	19,515,504.00	15,069,005.00	15,006,203.00	19,578,306.00	27.85%

#### 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。

## 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 2021 年 3 月 31 日，博时基金公司共管理 259 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 14651 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 4208 亿元人民币，累计分红逾 1426 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：

2021 年 03 月 27 日，在华夏时报主办的华夏机构投资者年会暨第十四届金蝉奖颁奖盛典中，博时基金荣获年度品牌基金公司奖。

2021 年 03 月 26 日，由广东时代传媒集团举办的“影响力中国时代峰会 2021”在广东广州举办，博时基金荣获《时代周报》第五届时代金融金桔奖“最佳财富管理机构奖”。

2021 年 03 月 18 日，由易趣财经传媒、《金融理财》杂志社主办的 2020 年度第十一届“金貔貅奖”颁奖晚宴暨中国金融创新与发展论坛在北京维景国际大酒店成功召开，博时基金获 2020 年度第十一届金貔貅奖“年度金牌基金公司”。

2021 年 03 月 08 日，在《投资洞见与委托》（Insights & Mandate）举办的 2021 年度专业投资大奖评选中，博时国际荣获五项年度大奖，包括“最佳机构法人投资经理”、“年度最佳 CEO”、“年度最佳 CIO（固定收益）”三项市场表现大奖，“亚洲年度最佳人民币投资公司”一项区域表现大奖，以及“中国离岸债券基金（3 年）”一项投资表现大奖。

## §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 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

9.1.6 报告期内博时中证可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

## 9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

## 9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，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

二〇二一年四月二十二日