

**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 2 季度报告
2021 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：二〇二一年七月二十一日

§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 2021 年 7 月 19 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 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	64,286,670.00 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。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。
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 4 月 1 日-2021 年 6 月 30 日)
1.本期已实现收益	4,817,437.39
2.本期利润	28,239,330.24
3.加权平均基金份额本期利润	0.4194
4.期末基金资产净值	692,762,961.89
5.期末基金份额净值	10.7762

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。

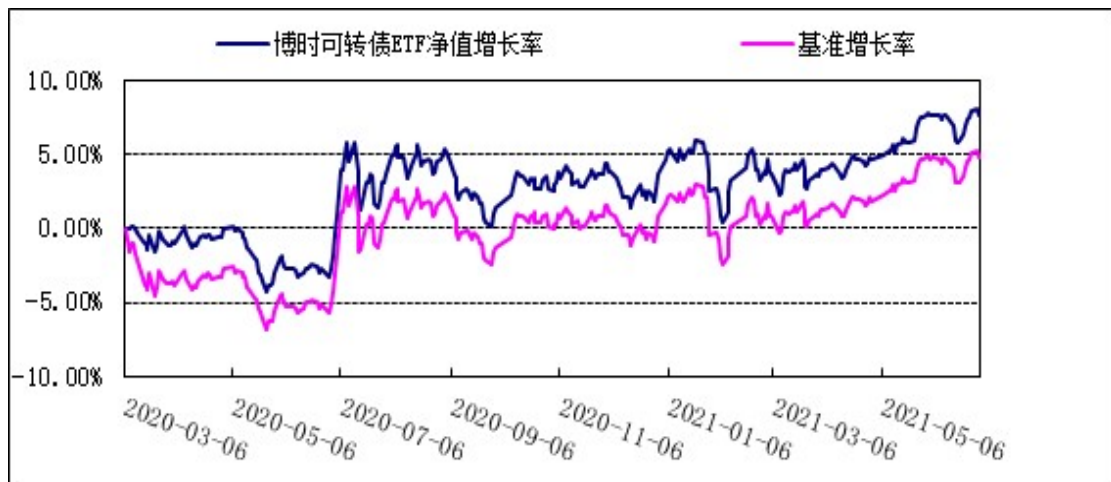
所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	4.04%	0.32%	4.05%	0.30%	-0.01%	0.02%
过去六个月	3.96%	0.49%	4.08%	0.46%	-0.12%	0.03%
过去一年	10.80%	0.60%	10.68%	0.57%	0.12%	0.03%
自基金合同生 效起至今	7.76%	0.56%	4.94%	0.56%	2.82%	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“投资范围”、“投资禁止行为与限制”章节的有关约定。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	-	12.9	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。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 13 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

2 季度股市和债市均有上涨表现，主要得益于流动性较为宽松，外部美债长端利率见顶回落，美元指

数重回走弱局面，整个环境对国内股债资产较为友好。另外，上市公司一季报业绩亮眼更催化权益市场走强，不过内部结构分化严重，创业板和中证 500 表征的风格领涨，而沪深 300 和上证 50 仅横盘震荡，成长也好于周期。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，从社融方面看，上半年处于信用收缩局面，符合稳宏观杠杆率基调，这将对下半年增长带来一定下行压力，预计两年复合增速已过高点。不过社融存在增速下降最快的阶段可能已过去。从 4 月政治局会议提到“用好稳增长压力较小的窗口期”来看，这反映上层对经济局面满意，也暂时难有财政刺激等动作，上半年地方债发行节奏较慢，不排除下半年也低于预期。后续关注 7 月份政治局会议在经济方面的定调。从经济增长贡献角度分析看，上半年增长贡献亮点仍在出口，但增速开始有所下行，后续担忧海外供应链的修复影响，值得观察。国内消费偏弱，居民储蓄意愿上行，收入感受指数不强，预期下半年消费仍难有亮点，投资方面房地产有一些压力，前期基建投资偏弱，后续重点需看政策。关于增长转弱，换一个资产交易视角看，从中证 500 与沪深 300 的对比表现或者周期与成长风格对比，均是前者偏强，股市交易更倾向于反映国内增长转弱局面。关于通胀，目前主流央行对通胀似乎并不太担心，“暂时性”占主导，倾向于随着供应链的修复将对通胀压力缓解带来积极作用，美联储收紧货币预期在增强，通胀预期在回落。国内政府对大宗商品价格已有较高关注，如 5 月份国常会，后续有价格调研和抛储等动作。如果通胀下行的逻辑逐步得到验证，即使同比水平偏高，市场对通胀担忧可能明显缓解。流动性方面，上半年稳货币特征明显，市场流动性充足，资金利率如债券回购利率等在偏低位，波动性也偏低。央行在最新一期的货币政策执行报告中提及货币政策要继续稳字当头。在基本面转向和通胀未成为主要压力点情景下，货币政策更可能维持现状，3 季度需要关注美联储可能释放 Taper 预期给市场流动性带来的一些扰动，下半年地方债发行节奏可能加快会否给流动性和利率带来一些短期压力也值得关注。

关于资产表现判断，增长转弱局面相对支持纯债走强，但在通胀回落到偏低水平和增长带来明显压力前，货币政策难以边际变松，预期纯债收益率上行和下行风险均不大。权益资产方面，流动性层面看不到边际上的正面效果，企业盈利能力虽然仍能维持，但经济动力的边际弱化会逐步带来盈利增速下滑的远期担忧，寻找权益市场中的结构性机会应更为重要，而非仓位制胜。结合流动性和业绩层面对比看，3 季度市场机会大概率不如 2 季度，市场风险点增多。转债市场的发行人仍在持续扩容，行业投资机会和自下而上挖掘个券的机会在增多，在权益市场暂时看不到大的系统性风险背景下，结合相对中性的可转债市场估值，认为可转债投资未到离场时，轻指数重结构。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 06 月 30 日，本基金基金份额净值为 10.7762 元，份额累计净值为 1.0776 元。报告期内，

本基金基金份额净值增长率为 4.04%，同期业绩基准增长率 4.05%。

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	676,468,365.99	97.14
	其中：债券	676,468,365.99	97.14
	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	13,000,000.00	1.87
	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	3,311,805.05	0.48
8	其他各项资产	3,627,218.13	0.52
9	合计	696,407,389.17	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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 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）	676,468,365.99	97.65
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	676,468,365.99	97.65

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	450,470	46,092,090.40	6.65
2	113021	中信转债	362,280	38,209,671.60	5.52
3	113044	大秦转债	284,500	29,272,205.00	4.23
4	113011	光大转债	220,140	25,421,767.20	3.67
5	110053	苏银转债	187,190	22,700,531.30	3.28

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：2021 年 4 月 30 日，因存在 2016 年 5 月至 2019 年 1 月未按规定开展代销业务的违规

行为，中国银行保险监督管理委员会上海监管局对上海浦东发展银行股份有限公司处以罚款的公开处罚。

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；4、与身份不明的客户进行交易等违规行为，中国人民银行对中信银行股份有限公司处以罚款的公开处罚。

主要违规事实：2021 年 6 月 15 日，因存在 1、以受让不良贷款本金为条件向企业融资，违规处置不良资产，且部分新增贷款已形成风险 2、信贷资产收益权不真实转让，借助通道实现部分不良贷款违规出表 3、结构性存款不真实，通过设置“假结构”违规吸收存款 4、个人贷款管理不审慎，贷款资金违规流入证券类账户或用于购买理财产品 5、贴现资金管控不严，导致企业利用关联关系套取银行信用，部分贴现资金回流至出票人并转存为本行结构性存款 6、未按监管要求在增值税发票正面加注已承兑信息等违规行为，中国银行保险监督管理委员会云南监管局对中国光大银行股份有限公司昆明分行处以罚款的公开处罚。

主要违规事实：2020 年 12 月 30 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；5、理财业务未与自营业务相分离；6、理财资金投资非标准化债权资产的余额超监管比例要求等违规行为，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公开处罚。

主要违规事实：2020 年 7 月 29 日，因存在 1、违反《大型飞机公共航空运输承运人运行合格审定规则》第 121.381 条(a)款；2、违反《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；3、违反《民用航空安全信息管理规定》第十四条之（三）等违规行为，南方航空受到民航中南局行政处罚。

主要违规事实：2021 年 4 月 30 日，因存在未按照规定进行信息披露的违规行为，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公开处罚。

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	49,114.13
2	应收证券清算款	1,565,376.93
3	应收股利	-
4	应收利息	1,937,110.83
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	3,627,218.13

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	46,092,090.40	6.65

2	113021	中信转债	38,209,671.60	5.52
3	113044	大秦转债	29,272,205.00	4.23
4	113011	光大转债	25,421,767.20	3.67
5	110053	苏银转债	22,700,531.30	3.28
6	132018	G 三峡 EB1	22,576,554.00	3.26
7	132015	18 中油 EB	18,539,970.00	2.68
8	110075	南航转债	18,105,878.20	2.61
9	132009	17 中油 EB	9,289,812.00	1.34
10	110073	国投转债	7,655,337.00	1.11
11	113013	国君转债	7,633,803.50	1.10
12	113026	核能转债	7,324,317.00	1.06
13	127005	长证转债	5,652,212.72	0.82
14	127012	招路转债	5,334,164.00	0.77
15	132020	19 蓝星 EB	5,191,718.40	0.75
16	110061	川投转债	5,145,156.00	0.74
17	128129	青农转债	4,745,709.09	0.69
18	132007	16 凤凰 EB	4,149,601.80	0.60
19	113037	紫银转债	4,128,293.90	0.60
20	110051	中天转债	4,028,076.00	0.58
21	113043	财通转债	3,972,390.80	0.57
22	132014	18 中化 EB	3,889,189.20	0.56
23	110048	福能转债	3,730,486.50	0.54
24	127020	中金转债	3,708,920.52	0.54
25	128128	齐翔转 2	3,649,543.50	0.53
26	132004	15 国盛 EB	3,616,305.00	0.52
27	128134	鸿路转债	3,587,768.40	0.52
28	113040	星宇转债	3,402,192.80	0.49
29	128035	大族转债	3,322,642.33	0.48
30	110043	无锡转债	3,215,570.40	0.46
31	128081	海亮转债	3,183,056.40	0.46
32	113009	广汽转债	3,144,188.40	0.45
33	128136	立讯转债	3,098,645.00	0.45
34	128107	交科转债	3,064,518.36	0.44
35	128108	蓝帆转债	3,062,512.80	0.44
36	110067	华安转债	3,019,014.00	0.44
37	110062	烽火转债	2,922,772.80	0.42
38	113014	林洋转债	2,867,035.00	0.41
39	113611	福 20 转债	2,830,387.00	0.41
40	113508	新风转债	2,761,292.80	0.40
41	110072	广汇转债	2,739,079.00	0.40
42	113024	核建转债	2,730,517.20	0.39
43	127025	冀东转债	2,679,916.40	0.39
44	128064	司尔转债	2,644,061.30	0.38

45	113545	金能转债	2,560,487.20	0.37
46	110047	山鹰转债	2,537,293.50	0.37
47	110045	海澜转债	2,490,463.20	0.36
48	113605	大参转债	2,490,180.00	0.36
49	127027	靖远转债	2,484,751.50	0.36
50	128095	恩捷转债	2,455,481.70	0.35
51	128048	张行转债	2,424,872.52	0.35
52	113034	滨化转债	2,324,160.00	0.34
53	128119	龙大转债	2,317,612.28	0.33
54	127022	恒逸转债	2,178,062.57	0.31
55	127006	敖东转债	2,176,574.62	0.31
56	113025	明泰转债	2,128,750.40	0.31
57	110063	鹰 19 转债	2,108,767.20	0.30
58	123044	红相转债	2,085,704.32	0.30
59	128109	楚江转债	2,056,743.10	0.30
60	132021	19 中电 EB	2,033,570.00	0.29
61	113602	景 20 转债	1,867,151.00	0.27
62	113534	鼎胜转债	1,840,694.10	0.27
63	110077	洪城转债	1,828,023.00	0.26
64	110068	龙净转债	1,783,815.30	0.26
65	110041	蒙电转债	1,733,860.80	0.25
66	110076	华海转债	1,732,680.40	0.25
67	110066	盛屯转债	1,657,611.60	0.24
68	127017	万青转债	1,655,740.50	0.24
69	128034	江银转债	1,648,545.24	0.24
70	113016	小康转债	1,613,078.00	0.23
71	110057	现代转债	1,610,461.60	0.23
72	113033	利群转债	1,605,725.10	0.23
73	110056	亨通转债	1,569,561.60	0.23
74	128135	洽洽转债	1,504,628.80	0.22
75	128114	正邦转债	1,501,712.80	0.22
76	123075	贝斯转债	1,472,615.20	0.21
77	132017	19 新钢 EB	1,468,316.00	0.21
78	110064	建工转债	1,459,033.50	0.21
79	123060	苏试转债	1,455,458.40	0.21
80	127024	盈峰转债	1,445,137.20	0.21
81	110034	九州转债	1,433,823.50	0.21
82	128032	双环转债	1,397,006.76	0.20
83	110074	精达转债	1,387,059.00	0.20
84	113582	火炬转债	1,386,473.80	0.20
85	110052	贵广转债	1,373,617.00	0.20
86	128141	旺能转债	1,367,300.00	0.20
87	113017	吉视转债	1,348,286.70	0.19

88	128125	华阳转债	1,342,704.00	0.19
89	113614	健 20 转债	1,327,779.20	0.19
90	128017	金禾转债	1,324,533.66	0.19
91	113615	金诚转债	1,301,180.00	0.19
92	128029	太阳转债	1,299,453.86	0.19
93	127011	中鼎转 2	1,283,296.20	0.19
94	128131	崇达转 2	1,276,155.00	0.18
95	113039	嘉泽转债	1,265,817.00	0.18
96	127016	鲁泰转债	1,242,627.10	0.18
97	113607	伟 20 转债	1,225,474.80	0.18
98	110033	国贸转债	1,225,320.10	0.18
99	128046	利尔转债	1,213,963.20	0.18
100	113516	苏农转债	1,198,374.10	0.17
101	113584	家悦转债	1,161,315.00	0.17
102	123070	鹏辉转债	1,155,187.50	0.17
103	128026	众兴转债	1,119,678.40	0.16
104	128130	景兴转债	1,119,096.00	0.16
105	128096	奥瑞转债	1,110,712.57	0.16
106	128097	奥佳转债	1,098,342.50	0.16
107	113579	健友转债	1,074,895.00	0.16
108	128140	润建转债	1,074,614.20	0.16
109	127007	湖广转债	1,074,502.38	0.16
110	113609	永安转债	1,037,572.80	0.15
111	113543	欧派转债	998,200.00	0.14
112	128078	太极转债	990,200.68	0.14
113	113596	城地转债	963,455.50	0.14
114	113537	文灿转债	928,624.00	0.13
115	127015	希望转债	925,888.00	0.13
116	123085	万顺转 2	923,979.00	0.13
117	127013	创维转债	922,902.12	0.13
118	123078	飞凯转债	893,552.40	0.13
119	128023	亚太转债	890,330.80	0.13
120	123049	维尔转债	885,068.64	0.13
121	123035	利德转债	879,960.80	0.13
122	123083	朗新转债	877,129.03	0.13
123	123077	汉得转债	858,884.30	0.12
124	128127	文科转债	831,548.80	0.12
125	128111	中矿转债	827,944.80	0.12
126	113549	白电转债	826,448.00	0.12
127	113603	东缆转债	812,748.70	0.12
128	128083	新北转债	809,305.56	0.12
129	128113	比音转债	794,270.40	0.11
130	128105	长集转债	772,575.23	0.11

131	113563	柳药转债	765,265.20	0.11
132	123076	强力转债	764,215.60	0.11
133	128142	新乳转债	742,951.00	0.11
134	123004	铁汉转债	728,186.90	0.11
135	123050	聚飞转债	725,248.87	0.10
136	123071	天能转债	721,974.60	0.10
137	113504	艾华转债	721,326.00	0.10
138	128015	久其转债	713,052.90	0.10
139	132008	17 山高 EB	699,907.80	0.10
140	113505	杭电转债	693,705.60	0.10
141	128124	科华转债	689,062.40	0.10
142	113599	嘉友转债	685,647.00	0.10
143	110071	湖盐转债	684,113.40	0.10
144	110060	天路转债	677,958.00	0.10
145	128137	洁美转债	675,744.60	0.10
146	113606	荣泰转债	661,990.60	0.10
147	123079	运达转债	660,834.70	0.10
148	123087	明电转债	656,282.10	0.09
149	113528	长城转债	647,248.00	0.09
150	128121	宏川转债	639,884.84	0.09
151	123063	大禹转债	639,181.20	0.09
152	113519	长久转债	630,352.80	0.09
153	123064	万孚转债	621,425.00	0.09
154	127003	海印转债	619,575.60	0.09
155	128093	百川转债	611,832.14	0.09
156	128087	孚日转债	599,917.50	0.09
157	123091	长海转债	595,513.60	0.09
158	113604	多伦转债	595,375.40	0.09
159	128100	搜特转债	592,822.80	0.09
160	128063	未来转债	588,042.21	0.08
161	128116	瑞达转债	581,462.00	0.08
162	110038	济川转债	580,481.20	0.08
163	113542	好客转债	575,869.50	0.08
164	128139	祥鑫转债	573,501.17	0.08
165	113612	永冠转债	573,283.20	0.08
166	113530	大丰转债	570,535.10	0.08
167	127014	北方转债	567,354.75	0.08
168	113550	常汽转债	564,310.80	0.08
169	128075	远东转债	563,357.19	0.08
170	128044	岭南转债	563,214.00	0.08
171	113012	骆驼转债	559,016.40	0.08
172	123068	弘信转债	552,570.40	0.08
173	128057	博彦转债	549,149.10	0.08

174	132022	20 广版 EB	542,460.70	0.08
175	123081	精研转债	537,637.24	0.08
176	123056	雪榕转债	532,716.00	0.08
177	128106	华统转债	524,882.40	0.08
178	123090	三诺转债	521,307.60	0.08
179	113588	润达转债	520,915.50	0.08
180	113600	新星转债	517,816.80	0.07
181	123089	九洲转 2	511,540.20	0.07
182	123067	斯莱转债	510,630.90	0.07
183	113589	天创转债	508,985.60	0.07
184	113591	胜达转债	501,087.20	0.07
185	113610	灵康转债	497,096.30	0.07
186	123082	北陆转债	483,671.60	0.07
187	113036	宁建转债	480,114.60	0.07
188	123023	迪森转债	459,885.00	0.07
189	123007	道氏转债	454,062.72	0.07
190	123053	宝通转债	453,425.60	0.07
191	110055	伊力转债	451,670.00	0.07
192	123066	赛意转债	430,010.40	0.06
193	123033	金力转债	423,605.00	0.06
194	113525	台华转债	421,951.10	0.06
195	128066	亚泰转债	403,707.50	0.06
196	123025	精测转债	398,578.80	0.06
197	128018	时达转债	396,283.32	0.06
198	123028	清水转债	393,607.80	0.06
199	123069	金诺转债	388,566.50	0.06
200	113608	威派转债	382,572.20	0.06
201	113593	沪工转债	381,477.60	0.06
202	128022	众信转债	377,117.20	0.05
203	128037	岩土转债	373,543.20	0.05
204	128042	凯中转债	370,953.30	0.05
205	113532	海环转债	363,544.50	0.05
206	123059	银信转债	363,293.25	0.05
207	128138	侨银转债	355,501.50	0.05
208	123073	同和转债	353,080.70	0.05
209	123048	应急转债	352,942.08	0.05
210	123010	博世转债	348,638.04	0.05
211	113578	全筑转债	348,036.00	0.05
212	128049	华源转债	339,270.80	0.05
213	128033	迪龙转债	338,094.76	0.05
214	113568	新春转债	338,075.10	0.05
215	128014	永东转债	337,890.30	0.05
216	128082	华锋转债	336,649.50	0.05

217	113569	科达转债	336,416.50	0.05
218	128101	联创转债	336,217.80	0.05
219	128117	道恩转债	333,211.20	0.05
220	123074	隆利转债	327,604.20	0.05
221	113524	奇精转债	327,600.00	0.05
222	123022	长信转债	323,019.90	0.05
223	128025	特一转债	314,051.20	0.05
224	128090	汽模转 2	309,990.48	0.04
225	113594	淳中转债	306,715.60	0.04
226	110070	凌钢转债	306,446.00	0.04
227	123027	蓝晓转债	305,030.00	0.04
228	128123	国光转债	298,843.37	0.04
229	113030	东风转债	298,696.20	0.04
230	113526	联泰转债	298,636.40	0.04
231	123051	今天转债	296,857.60	0.04
232	113541	荣晟转债	296,328.00	0.04
233	113597	佳力转债	295,240.00	0.04
234	113598	法兰转债	294,321.30	0.04
235	128094	星帅转债	294,150.00	0.04
236	128071	合兴转债	292,359.72	0.04
237	113027	华钰转债	291,444.00	0.04
238	128072	翔鹭转债	289,520.20	0.04
239	128069	华森转债	289,289.20	0.04
240	128051	光华转债	281,709.00	0.04
241	113535	大业转债	281,706.30	0.04
242	128118	瀛通转债	279,041.60	0.04
243	128122	兴森转债	276,442.40	0.04
244	113570	百达转债	270,004.20	0.04
245	113595	花王转债	268,909.60	0.04
246	113573	纵横转债	261,378.00	0.04
247	123047	久吾转债	260,903.10	0.04
248	128021	兄弟转债	254,229.21	0.04
249	123002	国祯转债	250,658.10	0.04
250	123011	德尔转债	250,591.50	0.04
251	110058	永鼎转债	248,424.00	0.04
252	113585	寿仙转债	242,640.40	0.04
253	113576	起步转债	227,360.00	0.03
254	113565	宏辉转债	222,380.10	0.03
255	128040	华通转债	218,774.16	0.03
256	123039	开润转债	215,301.80	0.03
257	128070	智能转债	214,018.20	0.03
258	113567	君禾转债	206,956.80	0.03
259	113577	春秋转债	205,142.80	0.03

260	113574	华体转债	201,096.00	0.03
261	113548	石英转债	196,930.20	0.03
262	123046	天铁转债	189,629.68	0.03
263	113509	新泉转债	184,102.30	0.03
264	128050	钧达转债	182,782.40	0.03
265	113572	三祥转债	178,048.50	0.03
266	123045	雷迪转债	173,751.20	0.03
267	113536	三星转债	163,878.00	0.02
268	128076	金轮转债	160,694.40	0.02
269	128103	同德转债	160,260.00	0.02
270	113566	翔港转债	159,869.60	0.02
271	123038	联得转债	156,789.00	0.02
272	123030	九洲转债	156,568.80	0.02
273	113561	正裕转债	156,297.60	0.02
274	113575	东时转债	117,333.00	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	70,286,670.00
报告期期间基金总申购份额	-
减：报告期期间基金总赎回份额	6,000,000.00
报告期期间基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	64,286,670.00

§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	2021-04-01~2021-06-30	19,578,306.00	22,873,766.00	13,222,100.00	29,229,972.00	45.47%

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 6 月 30 日，博时基金公司共管理 276 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 15482 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 4383 亿元人民币，累计分红逾 1465 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。

§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
二〇二一年七月二十一日