

**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 3 季度报告
2021 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：二〇二一年十月二十七日

§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 10 月 25 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 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	57,886,670.00 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 7 月 1 日-2021 年 9 月 30 日)
1.本期已实现收益	16,030,171.11
2.本期利润	42,854,629.77
3.加权平均基金份额本期利润	0.7010
4.期末基金资产净值	663,363,579.50
5.期末基金份额净值	11.4597

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。

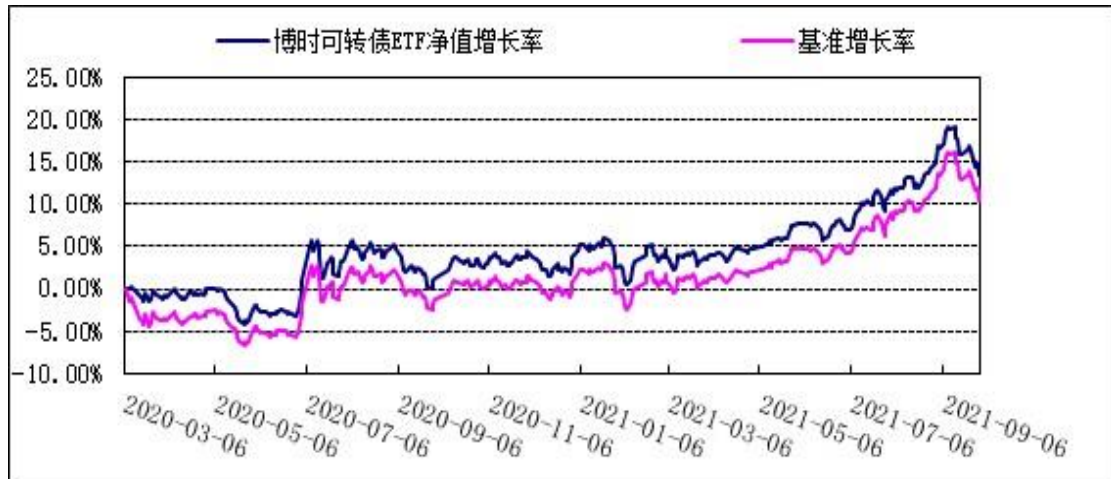
所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	6.34%	0.62%	6.38%	0.62%	-0.04%	0.00%
过去六个月	10.64%	0.50%	10.69%	0.49%	-0.05%	0.01%
过去一年	13.05%	0.52%	13.15%	0.50%	-0.10%	0.02%
自基金合同生 效起至今	14.60%	0.57%	11.63%	0.57%	2.97%	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



§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	混合资产投资部投资总监助理/基金经理	2020-03-06	-	13.2	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)、

				<p>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、固定收益总部指数与创新组投资总监助理。现任混合资产投资部投资总监助理兼博时稳健回报债券型证券投资基金 (LOF)</p>
--	--	--	--	--

					(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，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 10 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

3 季度转债市场有不错表现，先持续上涨至 9 月中旬，后续出现较明显的快速调整。在纯债市场较难获得较高收益情况下，转债市场成了不少债券类资金关注的对象，转债估值持续被推高至近三年高位，绝对价格也处于偏高位置，转债性价比显著下降，如部分热门赛道中的品种呈现高价高估值的“双高”状态，大幅透支正股上涨空间，而当股市走势并未走出转债市场预期的上涨行情后，偏高估值下的转债市场受到平价下行和估值压缩的双重压力出现快速回调。这也再次说明当市场估值受到资金推动处于高位后，市场性价

比已明显不足，此时风险控制就显得更为重要，对高估值市场的贪婪容易使投资者犯错。展望未来，在经济增长承压下，流动性将维持宽松状态，后续呈现“宽货币+稳信用”的概率偏大，且 A 股估值并不贵，因此认为 A 股暂无系统性风险，调整后的可转债仍值得重点关注。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 09 月 30 日，本基金基金份额净值为 11.4597 元，份额累计净值为 1.1460 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为 6.34%，同期业绩基准增长率为 6.38%。

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	660,699,969.75	98.55
	其中：债券	660,699,969.75	98.55
	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	-	-
	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	3,296,474.24	0.49
8	其他各项资产	6,457,662.09	0.96
9	合计	670,454,106.08	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）	660,699,969.75	99.60
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	660,699,969.75	99.60

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	399,090	41,409,578.40	6.24
2	113021	中信转债	314,100	33,501,906.00	5.05
3	113044	大秦转债	257,660	27,180,553.40	4.10
4	113011	光大转债	190,490	21,652,998.30	3.26
5	132018	G 三峡 EB1	161,260	21,099,258.40	3.18

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)、南银转债(113050)、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 7 月 16 日，因存在 1、监管发现的问题屡查屡犯；2、配合现场检查不力；3、内部控制制度修订不及时；4、信息系统管控有效性不足；5、未向监管部门真实反映业务数据；6、净值型理财产品估值方法使用不准确；7、未严格执行理财投资合作机构名单制管理；8、理财产品相互交易调节收益；9、使用理财资金偿还本行贷款；10、理财产品发行审批管理不到位等违规行为，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 12 月 28 日，因存在未按规定履行客户身份识别义务；未按照规定保存客户身份资料和交易记录；未按照规定报送大额交易报告或者可疑交易报告；未按规定报送账户开户资料；未按规定开立账户使用；未按规定加强特约商户与受理终端管理；违规占压财政资金等违规行为，中国人民银行南京分行对南京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 7 月 12 日，因存在 1、2018 年 12 月，该行某笔同业投资房地产企业合规审查严重违反审慎经营规则。2、2019 年 11 月，该行某笔经营性物业贷款授信后管理严重违反审慎经营规则；3、2019 年 2 月至 4 月，该行部分个人贷款违规用于购房；4、2020 年 5 月至 7 月，该行对部分个人住房贷款借款人偿债能力审查不审慎。5、2020 年 7 月，该行在助贷环节对第三方机构收费管理严重违反审慎经营规则；6、2020 年 6 月至 12 月，该行部分业务以贷收费的违规行为，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	24,599.84
2	应收证券清算款	4,171,688.02
3	应收股利	-
4	应收利息	2,223,566.31
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	37,807.92
8	其他	-
9	合计	6,457,662.09

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	41,409,578.40	6.24
2	113021	中信转债	33,501,906.00	5.05
3	113044	大秦转债	27,180,553.40	4.10
4	113011	光大转债	21,652,998.30	3.26
5	132018	G 三峡 EB1	21,099,258.40	3.18
6	110053	苏银转债	19,714,203.10	2.97
7	113042	上银转债	16,799,449.40	2.53
8	132015	18 中油 EB	16,519,104.10	2.49
9	127030	盛虹转债	8,532,385.20	1.29
10	132009	17 中油 EB	8,317,646.40	1.25
11	113026	核能转债	8,212,720.00	1.24
12	110073	国投转债	7,793,282.50	1.17
13	113013	国君转债	7,229,224.80	1.09
14	110075	南航转债	6,193,128.80	0.93
15	127018	本钢转债	6,042,137.70	0.91
16	110061	川投转债	5,654,260.30	0.85
17	127005	长证转债	5,433,045.05	0.82
18	127012	招路转债	4,973,303.76	0.75
19	128129	青农转债	4,272,726.64	0.64
20	132020	19 蓝星 EB	4,234,930.00	0.64
21	132014	18 中化 EB	4,142,462.10	0.62
22	110048	福能转债	3,883,754.20	0.59
23	113043	财通转债	3,770,526.00	0.57
24	132007	16 凤凰 EB	3,767,260.50	0.57
25	113037	紫银转债	3,731,928.00	0.56

26	110051	中天转债	3,701,538.00	0.56
27	127020	中金转债	3,666,678.28	0.55
28	113025	明泰转债	3,315,009.60	0.50
29	132004	15 国盛 EB	3,284,855.00	0.50
30	128081	海亮转债	3,155,723.10	0.48
31	113616	韦尔转债	3,038,885.10	0.46
32	110067	华安转债	2,867,221.00	0.43
33	128136	立讯转债	2,784,079.80	0.42
34	113024	核建转债	2,782,345.00	0.42
35	113009	广汽转债	2,768,029.20	0.42
36	110043	无锡转债	2,723,644.20	0.41
37	127027	靖远转债	2,716,375.60	0.41
38	110072	广汇转债	2,653,747.20	0.40
39	110062	烽火转债	2,633,144.40	0.40
40	128035	大族转债	2,410,237.90	0.36
41	110045	海澜转债	2,385,891.20	0.36
42	128048	张行转债	2,315,426.40	0.35
43	128095	恩捷转债	2,286,525.40	0.34
44	127025	冀东转债	2,279,337.60	0.34
45	128134	鸿路转债	2,254,099.20	0.34
46	110041	蒙电转债	2,247,962.00	0.34
47	128107	交科转债	2,244,190.32	0.34
48	128128	齐翔转 2	2,235,998.80	0.34
49	127006	敖东转债	2,189,608.74	0.33
50	110047	山鹰转债	2,107,837.20	0.32
51	128109	楚江转债	2,063,399.00	0.31
52	132017	19 新钢 EB	1,971,456.00	0.30
53	127022	恒逸转债	1,943,830.91	0.29
54	128108	蓝帆转债	1,859,170.50	0.28
55	110077	洪城转债	1,846,000.00	0.28
56	113545	金能转债	1,837,557.40	0.28
57	132021	19 中电 EB	1,773,008.90	0.27
58	110063	鹰 19 转债	1,742,973.00	0.26
59	118000	嘉元转债	1,739,161.20	0.26
60	110068	龙净转债	1,719,280.20	0.26
61	113602	景 20 转债	1,670,359.60	0.25
62	113605	大参转债	1,635,792.40	0.25
63	113534	鼎胜转债	1,601,135.00	0.24
64	110056	亨通转债	1,575,649.80	0.24
65	110076	华海转债	1,569,354.00	0.24
66	128141	旺能转债	1,506,518.40	0.23
67	128034	江银转债	1,497,146.40	0.23
68	110057	现代转债	1,487,464.20	0.22

69	110066	盛屯转债	1,485,205.80	0.22
70	113033	利群转债	1,483,053.00	0.22
71	128017	金禾转债	1,465,557.39	0.22
72	113582	火炬转债	1,452,889.80	0.22
73	128119	龙大转债	1,400,731.58	0.21
74	110064	建工转债	1,384,033.30	0.21
75	128135	洽洽转债	1,365,386.00	0.21
76	128114	正邦转债	1,360,254.50	0.21
77	113615	金诚转债	1,359,892.50	0.20
78	127024	盈峰转债	1,333,881.00	0.20
79	113046	金田转债	1,306,412.20	0.20
80	127011	中鼎转 2	1,299,955.30	0.20
81	110034	九州转债	1,297,035.20	0.20
82	128046	利尔转债	1,267,535.94	0.19
83	123075	贝斯转债	1,254,224.80	0.19
84	110052	贵广转债	1,254,086.40	0.19
85	113017	吉视转债	1,228,185.00	0.19
86	113614	健 20 转债	1,219,233.40	0.18
87	128144	利民转债	1,199,363.00	0.18
88	123102	华自转债	1,189,478.40	0.18
89	113607	伟 20 转债	1,189,259.40	0.18
90	128096	奥瑞转债	1,178,782.47	0.18
91	128131	崇达转 2	1,178,555.50	0.18
92	113516	苏农转债	1,165,398.00	0.18
93	110074	精达转债	1,159,617.60	0.17
94	128029	太阳转债	1,156,707.12	0.17
95	127016	鲁泰转债	1,139,509.30	0.17
96	123104	卫宁转债	1,129,738.01	0.17
97	123070	鹏辉转债	1,112,181.70	0.17
98	113528	长城转债	1,111,784.00	0.17
99	127029	中钢转债	1,100,758.50	0.17
100	128140	润建转债	1,099,098.00	0.17
101	123083	朗新转债	1,072,263.10	0.16
102	127017	万青转债	1,062,069.30	0.16
103	128130	景兴转债	1,054,218.80	0.16
104	110033	国贸转债	1,035,664.80	0.16
105	113621	彤程转债	1,034,941.60	0.16
106	123085	万顺转 2	970,112.00	0.15
107	123035	利德转债	966,517.60	0.15
108	127007	湖广转债	962,858.82	0.15
109	113584	家悦转债	958,964.50	0.14
110	128078	太极转债	957,803.12	0.14
111	113034	滨化转债	954,847.50	0.14

112	113549	白电转债	920,731.80	0.14
113	113603	东缆转债	895,505.10	0.13
114	123086	海兰转债	893,836.80	0.13
115	113596	城地转债	871,866.50	0.13
116	123071	天能转债	866,198.40	0.13
117	127015	希望转债	861,606.00	0.13
118	113619	世运转债	857,173.50	0.13
119	113620	傲农转债	857,173.50	0.13
120	123099	普利转债	851,808.75	0.13
121	128023	亚太转债	849,031.40	0.13
122	123049	维尔转债	828,864.24	0.12
123	123078	飞凯转债	825,265.00	0.12
124	127013	创维转债	821,078.82	0.12
125	113609	永安转债	810,699.90	0.12
126	123077	汉得转债	800,204.50	0.12
127	123060	苏试转债	799,435.20	0.12
128	123105	拓尔转债	784,131.20	0.12
129	123089	九洲转 2	773,020.60	0.12
130	128133	奇正转债	771,735.20	0.12
131	128127	文科转债	746,931.90	0.11
132	113016	小康转债	736,664.30	0.11
133	113039	嘉泽转债	732,551.40	0.11
134	110071	湖盐转债	726,783.70	0.11
135	128083	新北转债	726,727.56	0.11
136	128105	长集转债	724,615.80	0.11
137	113505	杭电转债	707,233.00	0.11
138	123096	思创转债	703,404.00	0.11
139	123050	聚飞转债	703,304.13	0.11
140	123076	强力转债	701,297.00	0.11
141	113525	台华转债	673,600.40	0.10
142	128142	新乳转债	671,101.20	0.10
143	113563	柳药转债	664,875.80	0.10
144	123067	斯莱转债	656,476.60	0.10
145	123044	红相转债	653,336.60	0.10
146	123004	铁汉转债	652,287.20	0.10
147	113599	嘉友转债	651,277.40	0.10
148	128113	比音转债	650,204.10	0.10
149	110060	天路转债	645,015.60	0.10
150	113579	健友转债	639,171.90	0.10
151	132008	17 山高 EB	636,581.00	0.10
152	128015	久其转债	632,262.40	0.10
153	128121	宏川转债	628,822.10	0.09
154	123087	明电转债	620,312.00	0.09

155	113600	新星转债	615,250.00	0.09
156	113504	艾华转债	607,271.70	0.09
157	128124	科华转债	604,498.40	0.09
158	123063	大禹转债	600,450.00	0.09
159	128116	瑞达转债	590,376.00	0.09
160	128137	洁美转债	588,876.00	0.09
161	123101	拓斯转债	585,763.20	0.09
162	113519	长久转债	575,374.80	0.09
163	128139	祥鑫转债	569,986.58	0.09
164	128097	奥佳转债	568,334.80	0.09
165	128063	未来转债	565,865.95	0.09
166	127003	海印转债	564,243.20	0.09
167	123069	金诺转债	546,176.00	0.08
168	123091	长海转债	539,196.00	0.08
169	113530	大丰转债	537,271.40	0.08
170	123028	清水转债	531,189.40	0.08
171	113606	荣泰转债	530,332.50	0.08
172	113604	多伦转债	526,648.20	0.08
173	128111	中矿转债	523,684.00	0.08
174	110038	济川转债	521,899.00	0.08
175	123064	万孚转债	516,840.60	0.08
176	128044	岭南转债	514,069.50	0.08
177	123081	精研转债	513,447.68	0.08
178	128106	华统转债	513,267.70	0.08
179	113542	好客转债	504,079.80	0.08
180	128075	远东转债	502,242.16	0.08
181	113568	新春转债	500,238.20	0.08
182	128093	百川转债	489,560.31	0.07
183	123023	迪森转债	487,094.70	0.07
184	113591	胜达转债	485,883.20	0.07
185	132022	20 广版 EB	485,252.10	0.07
186	127014	北方转债	477,639.30	0.07
187	128057	博彦转债	477,281.11	0.07
188	123056	雪榕转债	471,836.20	0.07
189	113618	美诺转债	469,263.20	0.07
190	113589	天创转债	454,631.00	0.07
191	113588	润达转债	454,237.90	0.07
192	123098	一品转债	451,158.80	0.07
193	113610	灵康转债	449,086.40	0.07
194	113036	宁建转债	439,069.00	0.07
195	123053	宝通转债	430,344.00	0.06
196	123082	北陆转债	428,838.10	0.06
197	123090	三诺转债	417,084.80	0.06

198	128026	众兴转债	404,369.30	0.06
199	113593	沪工转债	385,396.90	0.06
200	123103	震安转债	381,602.40	0.06
201	113550	常汽转债	368,301.70	0.06
202	128087	孚日转债	366,022.80	0.06
203	110055	伊力转债	364,755.60	0.05
204	113027	华钰转债	364,702.00	0.05
205	113608	威派转债	363,888.00	0.05
206	128101	联创转债	361,422.72	0.05
207	128082	华锋转债	360,367.30	0.05
208	113537	文灿转债	360,087.20	0.05
209	128042	凯中转债	357,685.44	0.05
210	123059	银信转债	352,011.30	0.05
211	123073	同和转债	349,728.40	0.05
212	128138	侨银转债	345,117.90	0.05
213	123074	隆利转债	343,694.00	0.05
214	128037	岩土转债	342,354.40	0.05
215	123025	精测转债	342,115.20	0.05
216	128066	亚泰转债	339,589.50	0.05
217	123048	应急转债	338,686.04	0.05
218	123010	博世转债	336,678.60	0.05
219	113532	海环转债	332,025.80	0.05
220	128022	众信转债	329,394.70	0.05
221	128125	华阳转债	328,475.40	0.05
222	128100	搜特转债	325,017.00	0.05
223	113569	科达转债	320,044.80	0.05
224	128117	道恩转债	311,022.60	0.05
225	128049	华源转债	308,964.60	0.05
226	113578	全筑转债	308,006.40	0.05
227	113526	联泰转债	305,992.70	0.05
228	128014	永东转债	304,633.20	0.05
229	128033	迪龙转债	303,898.46	0.05
230	113030	东风转债	300,720.00	0.05
231	123022	长信转债	299,734.94	0.05
232	113535	大业转债	296,688.60	0.04
233	113524	奇精转债	290,619.20	0.04
234	128090	汽模转 2	288,495.90	0.04
235	128123	国光转债	277,552.86	0.04
236	128094	星帅转债	276,138.00	0.04
237	128025	特一转债	273,872.40	0.04
238	128122	兴森转债	271,150.00	0.04
239	113597	佳力转债	268,520.00	0.04
240	128071	合兴转债	267,982.56	0.04

241	128072	翔鹭转债	267,820.20	0.04
242	113594	淳中转债	267,613.50	0.04
243	128069	华森转债	259,811.20	0.04
244	128118	瀛通转债	258,475.00	0.04
245	113570	百达转债	257,708.40	0.04
246	123027	蓝晓转债	256,806.60	0.04
247	113598	法兰转债	252,090.00	0.04
248	113548	石英转债	249,759.00	0.04
249	128050	钧达转债	242,735.30	0.04
250	113595	花王转债	242,700.80	0.04
251	128143	锋龙转债	236,080.00	0.04
252	113573	纵横转债	232,276.00	0.04
253	128021	兄弟转债	231,856.29	0.03
254	123002	国祯转债	231,723.60	0.03
255	110058	永鼎转债	226,781.10	0.03
256	123011	德尔转债	223,339.20	0.03
257	110070	凌钢转债	223,108.50	0.03
258	128070	智能转债	206,781.20	0.03
259	113576	起步转债	206,562.30	0.03
260	128040	华通转债	205,072.70	0.03
261	113565	宏辉转债	201,811.20	0.03
262	123039	开润转债	199,317.20	0.03
263	113567	君禾转债	187,894.80	0.03
264	113574	华体转债	183,787.00	0.03
265	113577	春秋转债	175,160.00	0.03
266	113541	荣晟转债	170,785.30	0.03
267	128076	金轮转债	166,850.40	0.03
268	123045	雷迪转债	154,588.50	0.02
269	113536	三星转债	150,596.80	0.02
270	113566	翔港转债	144,698.40	0.02
271	123038	联得转债	144,048.00	0.02
272	113585	寿仙转债	141,655.90	0.02
273	113561	正裕转债	133,126.40	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	64,286,670.00
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	6,400,000.00
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	57,886,670.00

§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	2021-07-01~2021-09-30	29,229,972.00	21,165,615.00	33,608,182.00	16,787,405.00	29.00%

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 9 月 30 日，博时基金公司共管理 296 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 16138 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 4752 亿元人民币，累计分红逾 1509 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 9 月 28 日，由中国证券报社有限公司主办的第十八届中国基金业金牛奖评选结果正式揭晓，凭借出色的业绩以及卓越的投资实力，博时信用债纯债债券一举荣获了“五年期开放式债券型持续优胜金牛基金”奖。

2021 年 9 月 27 日，由证券时报报社有限公司主办的第十六届中国基金业明星基金奖正式公布，凭借出色的业绩以及卓越的投资实力，博时天颐债券荣获“三年持续回报积极债券型明星基金”奖。

2021 年 9 月，由北京济安金信科技有限公司主办的第三届济安“群星汇”评选结果揭晓，凭借卓越的综合管理实力和旗下基金产品出色的长期业绩，博时基金一举获得了“济安众星奖”、“济安五星奖”两项重量级的公司奖项。博时旗下产品博时合惠货币（004841）获得了“基金产品单项奖-货币型”，博时合惠货币基金经理魏桢则荣获了“五星基金明星奖”奖。

2021 年 7 月 6 日，由上海证券报社有限公司主办的第十七届“金基金”奖的评选结果揭晓。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 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。

§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

二〇二一年十月二十七日