

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 4 季度报告  
2021 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：二〇二二年一月二十四日

## §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 2022 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 2021 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	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	52,786,670.00 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	<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 10 月 1 日-2021 年 12 月 31 日)
1.本期已实现收益	13,891,510.13
2.本期利润	40,611,640.30
3.加权平均基金份额本期利润	0.7305
4.期末基金资产净值	643,643,587.72
5.期末基金份额净值	12.1933

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。

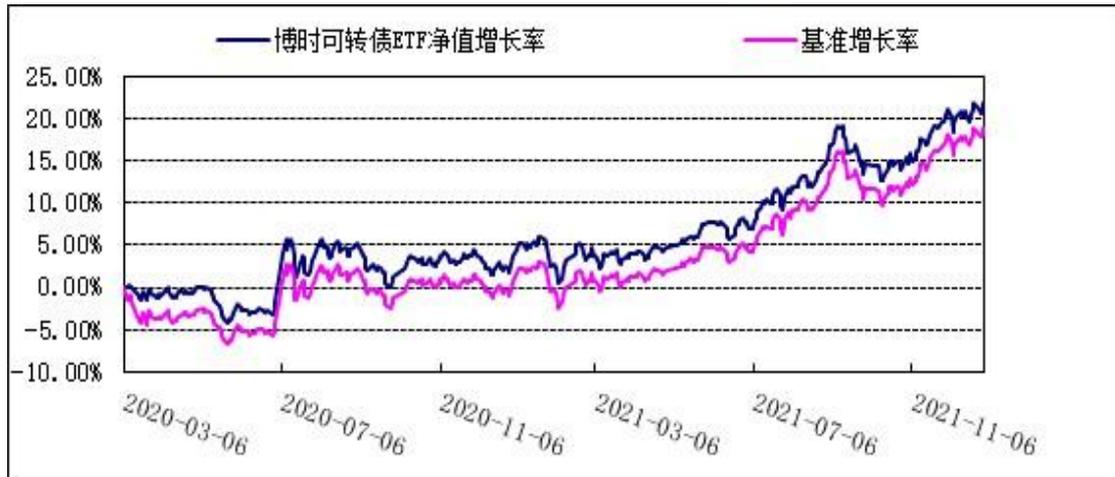
所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 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	6.40%	0.52%	6.54%	0.51%	-0.14%	0.01%
过去六个月	13.15%	0.57%	13.34%	0.56%	-0.19%	0.01%
过去一年	17.63%	0.53%	17.97%	0.52%	-0.34%	0.01%
自基金合同生 效起至今	21.93%	0.56%	18.94%	0.56%	2.99%	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	-	13.4	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

				<p>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、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</p>
--	--	--	--	---

				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)、博时鑫荣稳健混合型证券投资基金(2021 年 12 月 9 日—至今)、博时恒兴一年定期开放混合型证券投资基金(2021 年 12 月 9 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遵规守信情况的说明

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 7 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 年在流动性并未收紧的大格局下，权益市场风险并不大，全 A 市场在震荡中录得高个位数收益，不过内部结构分化明显，阶段性结构性行情突出，如一季度市场风格切换明显，中小盘迎来高光时刻，同

时“茅指数”或消费医药表现偏弱，而以新能源汽车为代表的新兴产业成为当年组合收益表现的胜负手，主要发生在 4-7 月份。在权益市场风格转变下，发行人以中小企业为主的可转债表现亮眼，年度收益大超市场预期，“转股价值+估值”双轮推动中证转债及可交换债指数上涨 17.8%。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，调整组合与目标指数的结构基本一致。展望未来，值得重点关注的就是 12 月的中央政治局会议和中央经济工作会议释放出来的增量信息，可能对未来投资布局产生较大影响。从经济自身周期角度看，基本面下行压力仍在，那么政策将会成为投资分析中的重要变量，中央经济工作会议定调 2022 年“稳字当头、稳中求进”，突出稳增长的重要性和迫切性，我们判断货币政策会维持较为宽松状态，财政发力将是稳增长的重要着力点，可能在一季度看到宽信用的明显边际变化。从权益类资产投资角度看，宽信用预期对市场风险偏好会产生正面作用，但如何发力和力度如何值得持续观察，且考虑到企业盈利增速在下行，投资上不能一味乐观。我们需要重点关注政策发力的方向和领域，顺着政策方向进行布局容易取得超额收益，比如新旧基建应是方向之一，重视部分可能迎来景气度向上拐点的领域如养殖、建材和部分消费电子等，对于符合时代发展大势的行业需持续保持重点跟踪分析，如绿电、新能源车产业链等。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 12 月 31 日，本基金基金份额净值为 12.1933 元，份额累计净值为 1.2193 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为 6.40%，同期业绩基准增长率为 6.54%。

#### 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	636,280,887.18	98.24
	其中：债券	636,280,887.18	98.24
	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	0.77
	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	2,334,120.12	0.36
8	其他各项资产	4,092,853.73	0.63
9	合计	647,707,861.03	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）	636,280,887.18	98.86
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	636,280,887.18	98.86

## 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	357,690	37,768,487.10	5.87
2	113021	中信转债	283,630	30,736,983.10	4.78
3	113044	大秦转债	228,870	25,047,532.80	3.89
4	132018	G 三峡 EB1	146,930	20,555,507.00	3.19
5	123111	东财转 3	119,930	20,166,229.50	3.13

## 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)、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：2021 年 12 月 03 日，因存在 1.采用不正当手段发放贷款，2.固定资产贷款项目审批要件不齐全，3.固定资产贷款管理严重失职，4.贷后管理不审慎导致个人消费贷款资金违规进入投资等限制性领域，5.同业投资业务违规接受第三方金融机构信用担保，6.同业投资业务项目审批要件不齐全且投后管理不到位导致部分资金被挪用，7.同业投资业务资金占比超监管要求等违规行为，中国银行保险监督管理委员会

会背景监管局对江苏银行股份有限公司北京分行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	20,341.18
2	应收证券清算款	2,018,358.12
3	应收股利	-
4	应收利息	2,054,154.43
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,092,853.73

#### 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	37,768,487.10	5.87
2	113021	中信转债	30,736,983.10	4.78
3	113044	大秦转债	25,047,532.80	3.89
4	132018	G 三峡 EB1	20,555,507.00	3.19
5	123111	东财转 3	20,166,229.50	3.13
6	113011	光大转债	19,150,522.00	2.98
7	113050	南银转债	17,351,061.00	2.70
8	110053	苏银转债	16,991,562.00	2.64
9	113042	上银转债	15,086,568.80	2.34
10	132015	18 中油 EB	14,921,230.10	2.32
11	110079	杭银转债	13,971,267.10	2.17
12	123107	温氏转债	9,544,068.85	1.48
13	113026	核能转债	8,208,205.40	1.28
14	132009	17 中油 EB	7,475,544.00	1.16
15	110073	国投转债	7,120,613.60	1.11
16	113013	国君转债	6,810,473.50	1.06
17	110075	南航转债	6,226,643.20	0.97
18	127030	盛虹转债	6,165,192.00	0.96

19	127018	本钢转债	5,020,005.90	0.78
20	127005	长证转债	4,987,408.05	0.77
21	110061	川投转债	4,925,130.60	0.77
22	127012	招路转债	4,572,362.56	0.71
23	132014	18 中化 EB	4,353,443.90	0.68
24	127032	苏行转债	4,043,025.60	0.63
25	113025	明泰转债	4,038,434.40	0.63
26	113049	长汽转债	3,927,776.20	0.61
27	132020	19 蓝星 EB	3,925,233.00	0.61
28	113048	晶科转债	3,920,835.60	0.61
29	128129	青农转债	3,880,584.78	0.60
30	110048	福能转债	3,855,980.40	0.60
31	113051	节能转债	3,843,057.90	0.60
32	113043	财通转债	3,664,138.40	0.57
33	113037	紫银转债	3,463,192.30	0.54
34	113616	韦尔转债	3,165,562.50	0.49
35	127036	三花转债	3,087,885.90	0.48
36	127020	中金转债	3,035,996.32	0.47
37	128081	海亮转债	3,017,655.20	0.47
38	113045	环旭转债	2,948,563.20	0.46
39	113024	核建转债	2,807,739.00	0.44
40	128136	立讯转债	2,703,846.60	0.42
41	110067	华安转债	2,606,281.60	0.40
42	110062	烽火转债	2,529,170.60	0.39
43	127027	靖远转债	2,518,941.70	0.39
44	110043	无锡转债	2,458,770.40	0.38
45	110072	广汇转债	2,422,998.00	0.38
46	128109	楚江转债	2,341,923.00	0.36
47	128035	大族转债	2,281,364.19	0.35
48	113623	凤 21 转债	2,251,098.70	0.35
49	128107	交科转债	2,194,011.72	0.34
50	128048	张行转债	2,193,953.89	0.34
51	127038	国微转债	2,191,712.40	0.34
52	113009	广汽转债	2,179,957.60	0.34
53	110045	海澜转债	2,157,789.40	0.34
54	127006	敖东转债	2,073,524.31	0.32
55	113047	旗滨转债	2,060,740.50	0.32
56	110047	山鹰转债	1,923,534.00	0.30
57	113602	景 20 转债	1,835,801.10	0.29
58	127025	冀东转债	1,833,392.60	0.28
59	128095	恩捷转债	1,788,209.50	0.28
60	110077	洪城转债	1,766,601.80	0.27
61	127022	恒逸转债	1,758,660.72	0.27

62	127011	中鼎转 2	1,757,678.40	0.27
63	123115	捷捷转债	1,725,889.35	0.27
64	128017	金禾转债	1,711,164.25	0.27
65	128134	鸿路转债	1,693,644.00	0.26
66	123070	鹏辉转债	1,639,248.00	0.25
67	118000	嘉元转债	1,637,110.40	0.25
68	110056	亨通转债	1,612,429.00	0.25
69	132021	19 中电 EB	1,603,390.00	0.25
70	123113	仙乐转债	1,586,409.72	0.25
71	123114	三角转债	1,581,795.60	0.25
72	110063	鹰 19 转债	1,578,727.10	0.25
73	110068	龙净转债	1,563,662.30	0.24
74	110076	华海转债	1,558,097.10	0.24
75	123083	朗新转债	1,452,629.07	0.23
76	113582	火炬转债	1,442,901.60	0.22
77	113545	金能转债	1,440,100.90	0.22
78	113033	利群转债	1,430,517.00	0.22
79	110057	现代转债	1,426,230.00	0.22
80	128034	江银转债	1,395,336.78	0.22
81	123108	乐普转 2	1,383,770.70	0.21
82	110064	建工转债	1,361,633.00	0.21
83	128128	齐翔转 2	1,347,928.30	0.21
84	113615	金诚转债	1,334,566.20	0.21
85	127024	盈峰转债	1,279,108.80	0.20
86	113017	吉视转债	1,275,719.20	0.20
87	113046	金田转债	1,273,474.00	0.20
88	128131	崇达转 2	1,264,347.00	0.20
89	128108	蓝帆转债	1,263,310.00	0.20
90	110074	精达转债	1,261,574.10	0.20
91	128135	洽洽转债	1,256,948.80	0.20
92	128119	龙大转债	1,255,229.64	0.20
93	132017	19 新钢 EB	1,246,560.00	0.19
94	128114	正邦转债	1,242,354.60	0.19
95	128096	奥瑞转债	1,239,569.87	0.19
96	110080	东湖转债	1,232,366.60	0.19
97	123075	贝斯转债	1,231,265.00	0.19
98	128140	润建转债	1,227,584.60	0.19
99	127031	洋丰转债	1,221,826.80	0.19
100	123109	昌红转债	1,204,771.38	0.19
101	110052	贵广转债	1,182,476.10	0.18
102	113605	大参转债	1,181,679.00	0.18
103	123086	海兰转债	1,169,462.00	0.18
104	128141	旺能转债	1,169,204.40	0.18

105	123060	苏试转债	1,115,978.40	0.17
106	128046	利尔转债	1,100,429.07	0.17
107	127016	鲁泰转债	1,097,750.40	0.17
108	113534	鼎胜转债	1,075,383.70	0.17
109	113516	苏农转债	1,067,362.80	0.17
110	128078	太极转债	1,062,695.52	0.17
111	127007	湖广转债	1,061,496.48	0.16
112	128029	太阳转债	1,058,908.76	0.16
113	123071	天能转债	1,050,813.60	0.16
114	111000	起帆转债	1,037,274.80	0.16
115	113619	世运转债	1,016,423.60	0.16
116	128144	利民转债	1,000,753.50	0.16
117	110066	盛屯转债	998,741.20	0.16
118	123078	飞凯转债	994,870.80	0.15
119	127029	中钢转债	992,563.40	0.15
120	127033	中装转 2	986,668.80	0.15
121	123035	利德转债	981,447.20	0.15
122	123085	万顺转 2	979,804.80	0.15
123	113622	杭叉转债	960,378.00	0.15
124	128023	亚太转债	940,895.60	0.15
125	128130	景兴转债	929,344.20	0.14
126	123104	卫宁转债	925,086.96	0.14
127	127017	万青转债	915,607.20	0.14
128	113620	傲农转债	900,583.60	0.14
129	113621	彤程转债	881,881.50	0.14
130	123099	普利转债	880,423.68	0.14
131	127013	创维转债	851,166.54	0.13
132	123117	健帆转债	841,288.00	0.13
133	113549	白电转债	828,034.90	0.13
134	123077	汉得转债	816,345.00	0.13
135	113596	城地转债	813,354.50	0.13
136	127015	希望转债	811,519.50	0.13
137	128127	文科转债	771,818.60	0.12
138	123049	维尔转债	766,687.60	0.12
139	127037	银轮转债	743,838.40	0.12
140	128083	新北转债	738,252.50	0.11
141	123105	拓尔转债	726,066.00	0.11
142	128133	奇正转债	720,716.20	0.11
143	123096	思创转债	719,363.70	0.11
144	113609	永安转债	712,309.20	0.11
145	113504	艾华转债	694,933.60	0.11
146	113599	嘉友转债	671,880.00	0.10
147	127026	超声转债	670,850.00	0.10

148	123076	强力转债	670,198.40	0.10
149	113563	柳药转债	662,074.50	0.10
150	123092	天壕转债	661,796.80	0.10
151	110071	湖盐转债	661,547.30	0.10
152	128137	洁美转债	658,591.20	0.10
153	113505	杭电转债	655,828.80	0.10
154	128106	华统转债	653,829.60	0.10
155	128121	宏川转债	643,254.15	0.10
156	128105	长集转债	635,111.08	0.10
157	128142	新乳转债	623,001.60	0.10
158	123004	铁汉转债	621,505.60	0.10
159	110038	济川转债	614,891.20	0.10
160	128015	久其转债	597,129.40	0.09
161	110060	天路转债	593,414.40	0.09
162	123050	聚飞转债	592,841.61	0.09
163	123063	大禹转债	590,607.60	0.09
164	113584	家悦转债	586,486.40	0.09
165	132008	17 山高 EB	585,467.20	0.09
166	128124	科华转债	570,493.80	0.09
167	113525	台华转债	567,694.20	0.09
168	127003	海印转债	560,475.00	0.09
169	113034	滨化转债	560,281.80	0.09
170	113600	新星转债	559,021.20	0.09
171	128044	岭南转债	555,274.50	0.09
172	127035	濮耐转债	547,790.40	0.09
173	113519	长久转债	542,615.40	0.08
174	128116	瑞达转债	542,393.80	0.08
175	123101	拓斯转债	538,693.40	0.08
176	127028	英特转债	536,583.60	0.08
177	113606	荣泰转债	529,630.20	0.08
178	128139	祥鑫转债	527,561.45	0.08
179	128063	未来转债	519,049.41	0.08
180	113530	大丰转债	518,981.20	0.08
181	128113	比音转债	517,546.80	0.08
182	123067	斯莱转债	516,597.20	0.08
183	123091	长海转债	503,611.20	0.08
184	113579	健友转债	501,952.00	0.08
185	113016	小康转债	482,844.60	0.08
186	113604	多伦转债	481,089.50	0.07
187	123064	万孚转债	479,449.50	0.07
188	113591	胜达转债	475,228.30	0.07
189	128097	奥佳转债	469,728.00	0.07
190	113625	江山转债	469,174.20	0.07

191	113542	好客转债	469,164.80	0.07
192	128075	远东转债	468,164.06	0.07
193	123098	一品转债	466,078.20	0.07
194	113537	文灿转债	465,094.00	0.07
195	113588	润达转债	463,385.60	0.07
196	123073	同和转债	451,832.70	0.07
197	123044	红相转债	449,461.16	0.07
198	113593	沪工转债	447,356.80	0.07
199	123022	长信转债	446,231.77	0.07
200	132022	20 广版 EB	445,170.00	0.07
201	113618	美诺转债	442,652.10	0.07
202	127014	北方转债	441,804.87	0.07
203	123056	雪榕转债	435,680.00	0.07
204	113589	天创转债	432,264.00	0.07
205	113601	塞力转债	431,508.00	0.07
206	128101	联创转债	422,699.20	0.07
207	123082	北陆转债	413,254.80	0.06
208	113610	灵康转债	408,543.30	0.06
209	113036	宁建转债	408,434.30	0.06
210	113568	新春转债	407,720.60	0.06
211	123023	迪森转债	400,820.00	0.06
212	123090	三诺转债	398,646.60	0.06
213	128145	日丰转债	392,892.50	0.06
214	123087	明电转债	391,384.00	0.06
215	128082	华锋转债	390,294.60	0.06
216	123089	九洲转 2	377,045.50	0.06
217	123100	朗科转债	375,760.00	0.06
218	113550	常汽转债	375,641.40	0.06
219	123025	精测转债	368,552.00	0.06
220	113039	嘉泽转债	368,093.40	0.06
221	110055	伊力转债	366,271.60	0.06
222	128111	中矿转债	360,498.40	0.06
223	123048	应急转债	358,607.04	0.06
224	123103	震安转债	353,358.00	0.05
225	113608	威派转债	349,552.50	0.05
226	123084	高澜转债	349,076.60	0.05
227	113030	东风转债	346,468.80	0.05
228	123059	银信转债	344,301.90	0.05
229	113548	石英转债	343,812.70	0.05
230	113535	大业转债	334,739.80	0.05
231	128042	凯中转债	333,110.82	0.05
232	113027	华钰转债	332,015.20	0.05
233	128125	华阳转债	331,768.50	0.05

234	128066	亚泰转债	331,331.00	0.05
235	128138	侨银转债	330,222.20	0.05
236	113624	正川转债	328,728.40	0.05
237	128022	众信转债	327,565.60	0.05
238	128037	岩土转债	324,328.00	0.05
239	123010	博世转债	317,373.54	0.05
240	113594	淳中转债	317,097.60	0.05
241	113532	海环转债	316,692.00	0.05
242	128026	众兴转债	315,779.60	0.05
243	128025	特一转债	313,021.20	0.05
244	128049	华源转债	308,067.20	0.05
245	128117	道恩转债	306,777.50	0.05
246	113569	科达转债	303,646.20	0.05
247	113578	全筑转债	302,102.50	0.05
248	128093	百川转债	300,843.29	0.05
249	128094	星帅转债	300,110.20	0.05
250	128090	汽模转 2	298,482.86	0.05
251	123027	蓝晓转债	297,440.00	0.05
252	113524	奇精转债	291,893.00	0.05
253	128014	永东转债	288,675.00	0.04
254	123088	威唐转债	287,460.00	0.04
255	128069	华森转债	286,162.80	0.04
256	128122	兴森转债	285,854.40	0.04
257	123106	正丹转债	284,983.60	0.04
258	128033	迪龙转债	283,951.32	0.04
259	113570	百达转债	275,140.80	0.04
260	113598	法兰转债	273,193.80	0.04
261	128071	合兴转债	271,947.76	0.04
262	128123	国光转债	270,217.56	0.04
263	113597	佳力转债	267,472.80	0.04
264	113526	联泰转债	264,781.60	0.04
265	128072	翔鹭转债	262,870.60	0.04
266	128118	瀛通转债	257,960.80	0.04
267	128021	兄弟转债	255,479.49	0.04
268	110058	永鼎转债	254,318.00	0.04
269	128143	锋龙转债	242,184.60	0.04
270	113573	纵横转债	234,163.60	0.04
271	123002	国祯转债	231,422.60	0.04
272	128040	华通转债	229,624.58	0.04
273	123011	德尔转债	226,948.70	0.04
274	113541	荣晟转债	222,969.60	0.03
275	123116	万兴转债	218,312.64	0.03
276	113565	宏辉转债	214,872.60	0.03

277	110070	凌钢转债	210,856.80	0.03
278	113567	君禾转债	207,262.80	0.03
279	128070	智能转债	204,859.80	0.03
280	123039	开润转债	202,087.80	0.03
281	113577	春秋转债	198,554.10	0.03
282	128076	金轮转债	194,833.60	0.03
283	113574	华体转债	183,491.70	0.03
284	113585	寿仙转债	178,768.20	0.03
285	123045	雷迪转债	171,430.40	0.03
286	123038	联得转债	150,606.40	0.02
287	113566	翔港转债	145,080.00	0.02
288	113561	正裕转债	138,747.50	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	57,886,670.00
报告期期间基金总申购份额	1,000,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	6,100,000.00
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	52,786,670.00

## §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	2021-10-01~2021-10-12;2021-10-18~2021-10-26;2021-10-28~2021-11-07;2021-11-12~2021-12-07;2021-12-09~2021-12-31	16,787,405.00	30,077,780.00	34,888,900.00	11,976,285.00	22.69%

#### 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 12 月 31 日，博时基金公司共管理 311 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 16687 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 5366 亿元人民币，累计分红逾 1561 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 12 月 15 日，人民银行公示了 2020 年度金融科技发展奖获奖项目，博时基金“新一代投资决策

支持系统”荣获二等奖。

2021 年 12 月 1 日，广东省人民政府官网发布《关于 2020 年广东金融创新奖评选结果的通报》，博时基金“新一代投资决策支持系统”荣获三等奖。

2021 年 11 月 20 日，第五届中国海外基金金牛奖评选揭晓，博时基金海外全资子公司博时基金（国际）有限公司旗下的博时大中华债券基金凭借优异的业绩，荣膺“一年期金牛海外中国债券基金”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  
二〇二二年一月二十四日