

**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
2022年第1季度报告
2022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：二〇二二年四月二十二日

§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 2022 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 2022 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	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	73,386,670.00 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 (2022 年 1 月 1 日-2022 年 3 月 31 日)
1.本期已实现收益	12,545,675.26
2.本期利润	-61,665,740.36
3.加权平均基金份额本期利润	-0.9598
4.期末基金资产净值	821,259,989.71
5.期末基金份额净值	11.1909

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	-8.22%	0.85%	-7.94%	0.84%	-0.28%	0.01%
过去六个月	-2.35%	0.71%	-1.92%	0.70%	-0.43%	0.01%
过去一年	8.04%	0.61%	8.56%	0.60%	-0.52%	0.01%
自基金合同生 效起至今	11.91%	0.61%	9.49%	0.60%	2.42%	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



§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	-	13.7	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

				<p>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、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</p>
--	--	--	--	---

				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)、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)、博时恒瑞一年封闭运作混合型证券投资基金(2022 年 2 月 24 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 6 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

在稳增长大局下，货币政策宽松取向明显，出现了降准降息，市场流动性充足，如 1 年国债收益率在 1 月份显著下行到 2% 以内。在宽信用前期，经济增长基本面仍处于下行中，流动性成为债市的重要主导因素，国内债市走出一波上涨行情，10 年国债收益率下破 2.7%，中短端表现更为出色。春节后市场对债市的关注点转向对宽信用的担忧，同时全球通胀压力偏大，国内债市出现震荡，机会不太明显。同期股市出现明显下跌调整，下跌行情与经济基本面下行较为相符，一般企业盈利开启下行周期后股市难有较好表现，但调整幅度应超出了一致预期，一定程度上跟国际环境有关系，俄乌冲突等地缘政治因素给市场增添了显著的不确定性。此时业绩突出的上游资源品表现突出，而成长股在分子和分母端均受到压力情况下表现很弱。在股市下行影响下，可转债本来就处于“高价格高估值”局面，市场的脆弱性开始体现，受到估值收缩和转股价值下行的双重压力，一季度本基金跟踪的中证转债及可交换债指数下跌 7.94%。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，短期股市负面因素减少，市场风险不大，不过国内稳增长有待观察验证，全球通胀走势还不好下结论，供给端问题更难把握，权益市场震荡偏多一些，预期 5 月份后形势更为明朗，也许下半年机会更好。考虑到可转债估值仍然不低，在股市未走出上行趋势性行情前，需注重市场的交易性机会

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 03 月 31 日，本基金基金份额净值为 11.1909 元，份额累计净值为 1.1191 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为-8.22%，同期业绩基准增长率-7.94%。

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	814,828,673.23	98.58
	其中：债券	814,828,673.23	98.58
	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	5,500,000.00	0.67
	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	5,717,527.35	0.69
8	其他各项资产	515,849.18	0.06
9	合计	826,562,049.76	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）	814,828,673.23	99.22
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	814,828,673.23	99.22

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	113052	兴业转债	479,600	52,752,189.48	6.42

2	110059	浦发转债	474,100	50,039,826.20	6.09
3	113021	中信转债	375,980	41,070,716.09	5.00
4	113044	大秦转债	304,610	33,101,342.79	4.03
5	132018	G 三峡 EB1	193,560	25,642,643.20	3.12

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 基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的投资决策程序说明

本基金投资的前十名证券的发行主体中，兴业银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国人民银行、国家外汇管理局福建省分局的处罚。上海浦东发展银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国银行保险监督管理委员会、中国人民银行福州中心支行的处罚。中信银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国银行保险监督管理委员会、中国人民银行沈阳分行、中国人民银行南昌市中心支行的处罚。中国光大银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国银行保险监督管理委员会、中国银行保险监督管理委员会海南监管局、中国银行保险监督管理委员会厦门监管局、中国银行保险监督管理委员会重庆监管局、中国银行保险监督管理委员会天津监管局、中国银行保险监督管理委员会云南监管局的处罚。南京银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国银行保险监督管理委员会江苏监管局的处罚。江苏银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国银行保险监督管理委员会北京监管局的处罚。上海银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国银行保险监督管理委员会上海监管局的处罚。本基金对上述证券的投资决策程序符合相关法规及公司制度的要求。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

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	63,426.36
2	应收证券清算款	339,409.22
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	113,013.60
8	其他	-
9	合计	515,849.18

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	50,039,826.20	6.09
2	113021	中信转债	41,070,716.09	5.00
3	113044	大秦转债	33,101,342.79	4.03
4	132018	G 三峡 EB1	25,642,643.20	3.12
5	113011	光大转债	24,428,085.09	2.97
6	113050	南银转债	23,380,693.40	2.85
7	110053	苏银转债	23,209,573.11	2.83
8	113042	上银转债	19,948,429.43	2.43
9	132015	18 中油 EB	19,847,453.32	2.42
10	110079	杭银转债	17,942,336.64	2.18
11	123107	温氏转债	12,250,861.30	1.49
12	127045	牧原转债	12,044,196.10	1.47
13	132009	17 中油 EB	9,960,233.56	1.21
14	110081	闻泰转债	9,889,681.19	1.20
15	110073	国投转债	8,676,895.52	1.06
16	113013	国君转债	8,089,369.83	0.98
17	110075	南航转债	6,950,576.29	0.85
18	127030	盛虹转债	6,292,671.53	0.77
19	127018	本钢转债	6,134,363.05	0.75
20	127005	长证转债	6,086,694.89	0.74
21	127012	招路转债	5,811,846.53	0.71
22	110061	川投转债	5,318,948.52	0.65
23	127032	苏行转债	5,312,616.92	0.65
24	127040	国泰转债	5,237,130.72	0.64
25	128129	青农转债	4,991,240.65	0.61

26	132020	19 蓝星 EB	4,813,566.19	0.59
27	132014	18 中化 EB	4,804,662.38	0.59
28	113025	明泰转债	4,582,277.59	0.56
29	113037	紫银转债	4,456,493.16	0.54
30	113043	财通转债	4,242,658.63	0.52
31	113049	长汽转债	3,806,288.31	0.46
32	127020	中金转债	3,804,635.54	0.46
33	113051	节能转债	3,631,149.35	0.44
34	113045	环旭转债	3,594,293.54	0.44
35	127027	靖远转债	3,418,906.44	0.42
36	128081	海亮转债	3,412,655.19	0.42
37	127036	三花转债	3,290,679.56	0.40
38	110043	无锡转债	3,246,963.84	0.40
39	113024	核建转债	3,221,427.58	0.39
40	110062	烽火转债	3,211,573.29	0.39
41	128136	立讯转债	3,210,190.95	0.39
42	127039	北港转债	3,183,583.20	0.39
43	113048	晶科转债	3,108,320.03	0.38
44	128107	交科转债	3,103,085.25	0.38
45	110072	广汇转债	3,050,888.63	0.37
46	113616	韦尔转债	2,911,694.87	0.35
47	110067	华安转债	2,903,084.41	0.35
48	128048	张行转债	2,855,788.97	0.35
49	110045	海澜转债	2,694,288.05	0.33
50	127038	国微转债	2,664,972.66	0.32
51	110048	福能转债	2,575,602.97	0.31
52	113623	凤 21 转债	2,540,120.24	0.31
53	128035	大族转债	2,520,952.11	0.31
54	113047	旗滨转债	2,503,854.00	0.30
55	127006	敖东转债	2,496,828.98	0.30
56	110047	山鹰转债	2,407,845.75	0.29
57	113046	金田转债	2,305,742.65	0.28
58	123119	康泰转 2	2,274,940.27	0.28
59	110068	龙净转债	2,264,371.84	0.28
60	128140	润建转债	2,158,477.86	0.26
61	132021	19 中电 EB	2,140,209.52	0.26
62	128109	楚江转债	2,094,965.71	0.26
63	127022	恒逸转债	2,057,675.55	0.25
64	110077	洪城转债	2,016,028.22	0.25
65	110064	建工转债	1,940,946.46	0.24
66	127025	冀东转债	1,917,906.20	0.23
67	128134	鸿路转债	1,910,147.39	0.23
68	110056	亨通转债	1,909,731.79	0.23

69	113602	景 20 转债	1,903,397.64	0.23
70	110063	鹰 19 转债	1,901,648.46	0.23
71	110057	现代转债	1,866,757.60	0.23
72	110076	华海转债	1,856,094.24	0.23
73	128095	恩捷转债	1,847,488.02	0.22
74	128034	江银转债	1,832,843.06	0.22
75	113615	金诚转债	1,801,922.45	0.22
76	113033	利群转债	1,799,854.00	0.22
77	123114	三角转债	1,755,079.85	0.21
78	123108	乐普转 2	1,745,020.97	0.21
79	110052	贵广转债	1,744,814.32	0.21
80	113017	吉视转债	1,741,789.59	0.21
81	110080	东湖转债	1,735,208.12	0.21
82	132017	19 新钢 EB	1,681,389.04	0.20
83	123113	仙乐转债	1,628,318.22	0.20
84	123115	捷捷转债	1,578,197.94	0.19
85	113505	杭电转债	1,569,795.55	0.19
86	113626	伯特转债	1,553,222.14	0.19
87	128108	蓝帆转债	1,546,614.99	0.19
88	128135	洽洽转债	1,530,756.34	0.19
89	128141	旺能转债	1,530,643.00	0.19
90	123077	汉得转债	1,525,257.64	0.19
91	128114	正邦转债	1,512,868.32	0.18
92	123075	贝斯转债	1,503,112.37	0.18
93	127007	湖广转债	1,485,944.00	0.18
94	127024	盈峰转债	1,478,450.47	0.18
95	123078	飞凯转债	1,460,966.10	0.18
96	113620	傲农转债	1,450,362.19	0.18
97	127016	鲁泰转债	1,439,331.22	0.18
98	128131	崇达转 2	1,439,288.79	0.18
99	113605	大参转债	1,435,988.18	0.17
100	113516	苏农转债	1,433,110.97	0.17
101	123070	鹏辉转债	1,426,843.11	0.17
102	123086	海兰转债	1,420,727.51	0.17
103	127043	川恒转债	1,403,536.71	0.17
104	128017	金禾转债	1,398,000.81	0.17
105	127033	中装转 2	1,358,740.34	0.17
106	123083	朗新转债	1,355,771.52	0.17
107	127044	蒙娜转债	1,315,159.41	0.16
108	118000	嘉元转债	1,305,361.18	0.16
109	110074	精达转债	1,247,246.76	0.15
110	113534	鼎胜转债	1,240,541.50	0.15
111	128029	太阳转债	1,235,605.35	0.15

112	113545	金能转债	1,234,062.10	0.15
113	128046	利尔转债	1,177,274.33	0.14
114	127031	洋丰转债	1,164,601.12	0.14
115	127013	创维转债	1,136,252.27	0.14
116	113596	城地转债	1,126,526.07	0.14
117	123121	帝尔转债	1,102,069.28	0.13
118	128130	景兴转债	1,100,031.86	0.13
119	113582	火炬转债	1,086,552.74	0.13
120	123071	天能转债	1,085,609.59	0.13
121	113622	杭叉转债	1,072,924.10	0.13
122	127017	万青转债	1,061,359.48	0.13
123	123085	万顺转 2	1,045,228.68	0.13
124	128144	利民转债	1,035,781.11	0.13
125	111000	起帆转债	1,034,648.07	0.13
126	128078	太极转债	1,032,185.27	0.13
127	113619	世运转债	1,023,352.40	0.12
128	128119	龙大转债	1,016,592.61	0.12
129	128128	齐翔转 2	983,211.57	0.12
130	127015	希望转债	982,076.31	0.12
131	113618	美诺转债	974,792.02	0.12
132	128023	亚太转债	964,972.25	0.12
133	123117	健帆转债	957,653.48	0.12
134	123104	卫宁转债	957,631.26	0.12
135	127029	中钢转债	957,094.98	0.12
136	123105	拓尔转债	936,850.14	0.11
137	123099	普利转债	932,243.20	0.11
138	123120	隆华转债	918,624.85	0.11
139	128127	文科转债	917,936.02	0.11
140	123035	利德转债	910,851.81	0.11
141	127019	国城转债	897,448.13	0.11
142	123125	元力转债	897,146.03	0.11
143	123049	维尔转债	888,699.70	0.11
144	110071	湖盐转债	883,840.36	0.11
145	113621	彤程转债	883,385.49	0.11
146	113549	白电转债	882,274.95	0.11
147	128083	新北转债	868,155.38	0.11
148	128133	奇正转债	865,829.40	0.11
149	123060	苏试转债	843,374.56	0.10
150	113599	嘉友转债	837,988.08	0.10
151	123092	天壕转债	829,970.20	0.10
152	127042	嘉美转债	826,966.31	0.10
153	113563	柳药转债	824,625.26	0.10
154	123096	思创转债	819,205.11	0.10

155	128015	久其转债	817,037.97	0.10
156	132008	17 山高 EB	816,402.23	0.10
157	128106	华统转债	815,079.43	0.10
158	123076	强力转债	806,537.61	0.10
159	113627	太平转债	801,344.81	0.10
160	127037	银轮转债	795,372.79	0.10
161	123004	铁汉转债	794,619.16	0.10
162	113609	永安转债	786,090.47	0.10
163	110038	济川转债	784,227.05	0.10
164	128105	长集转债	777,997.28	0.09
165	128142	新乳转债	767,708.84	0.09
166	123063	大禹转债	761,867.28	0.09
167	127003	海印转债	761,545.82	0.09
168	127026	超声转债	757,283.05	0.09
169	110060	天路转债	756,193.21	0.09
170	128121	宏川转债	750,152.12	0.09
171	113629	泉峰转债	745,839.40	0.09
172	113519	长久转债	741,945.34	0.09
173	128124	科华转债	738,138.49	0.09
174	128044	岭南转债	737,290.63	0.09
175	123064	万孚转债	726,985.53	0.09
176	128139	祥鑫转债	710,814.02	0.09
177	118001	金博转债	696,542.52	0.08
178	127028	英特转债	693,598.53	0.08
179	128137	洁美转债	693,174.51	0.08
180	123101	拓斯转债	685,100.07	0.08
181	128063	未来转债	677,802.89	0.08
182	132022	20 广版 EB	677,709.15	0.08
183	127035	濮耐转债	671,214.26	0.08
184	127014	北方转债	665,428.46	0.08
185	113530	大丰转债	663,679.45	0.08
186	128116	瑞达转债	658,492.19	0.08
187	113625	江山转债	656,450.50	0.08
188	123123	江丰转债	648,427.91	0.08
189	113606	荣泰转债	639,803.09	0.08
190	113604	多伦转债	638,196.47	0.08
191	113584	家悦转债	629,410.35	0.08
192	123122	富瀚转债	624,589.45	0.08
193	123091	长海转债	624,536.97	0.08
194	127041	弘亚转债	619,689.56	0.08
195	113542	好客转债	611,984.79	0.07
196	128075	远东转债	610,991.22	0.07
197	113504	艾华转债	604,770.08	0.07

198	113588	润达转债	603,061.81	0.07
199	113579	健友转债	597,305.58	0.07
200	113601	塞力转债	593,072.98	0.07
201	123056	雪榕转债	585,665.95	0.07
202	123044	红相转债	583,784.02	0.07
203	128101	联创转债	582,063.83	0.07
204	123067	斯莱转债	573,429.22	0.07
205	113591	胜达转债	568,965.85	0.07
206	113589	天创转债	568,825.27	0.07
207	123082	北陆转债	560,266.59	0.07
208	128037	岩土转债	536,462.45	0.07
209	123023	迪森转债	534,450.19	0.07
210	113600	新星转债	523,143.23	0.06
211	123090	三诺转债	513,055.32	0.06
212	123098	一品转债	510,313.12	0.06
213	123109	昌红转债	509,864.11	0.06
214	128022	众信转债	509,640.25	0.06
215	128097	奥佳转债	506,633.76	0.06
216	113610	灵康转债	493,412.40	0.06
217	123073	同和转债	458,895.87	0.06
218	123087	明电转债	457,917.75	0.06
219	123100	朗科转债	443,948.36	0.05
220	113593	沪工转债	436,004.05	0.05
221	113608	威派转债	435,854.42	0.05
222	123059	银信转债	431,329.72	0.05
223	123050	聚飞转债	431,113.76	0.05
224	123048	应急转债	430,541.99	0.05
225	128145	日丰转债	423,996.18	0.05
226	123089	九洲转 2	415,212.40	0.05
227	128111	中矿转债	404,330.61	0.05
228	113027	华钰转债	348,184.85	0.04
229	128066	亚泰转债	319,429.97	0.04
230	128042	凯中转债	307,172.43	0.04
231	113535	大业转债	305,277.90	0.04
232	128138	侨银转债	303,060.56	0.04
233	113532	海环转债	302,402.15	0.04
234	113548	石英转债	298,664.60	0.04
235	123124	晶瑞转 2	296,935.47	0.04
236	123010	博世转债	296,606.13	0.04
237	113550	常汽转债	296,393.93	0.04
238	128125	华阳转债	292,253.82	0.04
239	110055	伊力转债	291,298.59	0.04
240	113628	晨丰转债	290,076.26	0.04

241	113016	小康转债	287,302.20	0.03
242	113569	科达转债	282,344.20	0.03
243	128026	众兴转债	280,359.76	0.03
244	113624	正川转债	278,957.38	0.03
245	113597	佳力转债	264,158.84	0.03
246	113578	全筑转债	262,823.37	0.03
247	128049	华源转债	255,536.65	0.03
248	123022	长信转债	255,116.24	0.03
249	128117	道恩转债	254,143.35	0.03
250	128025	特一转债	253,683.29	0.03
251	123126	瑞丰转债	246,984.00	0.03
252	123025	精测转债	244,118.81	0.03
253	113524	奇精转债	243,232.87	0.03
254	128040	华通转债	241,789.35	0.03
255	128014	永东转债	239,877.86	0.03
256	113039	嘉泽转债	236,497.72	0.03
257	113030	东风转债	234,392.32	0.03
258	123118	惠城转债	232,774.07	0.03
259	123106	正丹转债	229,606.46	0.03
260	113570	百达转债	228,361.56	0.03
261	128090	汽模转 2	227,454.55	0.03
262	128069	华森转债	227,353.74	0.03
263	128123	国光转债	223,785.20	0.03
264	113568	新春转债	223,275.75	0.03
265	123084	高澜转债	222,437.62	0.03
266	113594	淳中转债	219,358.25	0.03
267	123027	蓝晓转债	218,686.04	0.03
268	123088	威唐转债	218,201.90	0.03
269	128071	合兴转债	218,085.06	0.03
270	128033	迪龙转债	217,718.29	0.03
271	123103	震安转债	211,098.62	0.03
272	128072	翔鹭转债	210,846.38	0.03
273	113598	法兰转债	210,337.59	0.03
274	128118	瀛通转债	208,253.87	0.03
275	128021	兄弟转债	207,817.36	0.03
276	128122	兴森转债	196,675.41	0.02
277	113573	纵横转债	194,312.42	0.02
278	123116	万兴转债	192,517.87	0.02
279	113525	台华转债	189,332.78	0.02
280	113567	君禾转债	187,868.77	0.02
281	113537	文灿转债	187,361.88	0.02
282	110058	永鼎转债	187,238.57	0.02
283	113526	联泰转债	183,895.58	0.02

284	123002	国祯转债	180,963.76	0.02
285	128143	锋龙转债	180,434.70	0.02
286	123011	德尔转债	179,161.86	0.02
287	113565	宏辉转债	175,958.14	0.02
288	113541	荣晟转债	174,573.43	0.02
289	128082	华锋转债	173,905.91	0.02
290	128076	金轮转债	168,350.36	0.02
291	128070	智能转债	166,767.88	0.02
292	110070	凌钢转债	164,933.21	0.02
293	123039	开润转债	159,167.03	0.02
294	113574	华体转债	147,592.01	0.02
295	113585	寿仙转债	138,384.20	0.02
296	113577	春秋转债	137,295.98	0.02
297	123045	雷迪转债	133,587.30	0.02
298	113566	翔港转债	118,475.96	0.01
299	123038	联得转债	113,413.21	0.01
300	113561	正裕转债	110,984.81	0.01

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	52,786,670.00
报告期期间基金总申购份额	25,900,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	5,300,000.00
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	73,386,670.00

§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

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	2022-01-01~2022-01-04;2022-01-07~2022-01-13;2022-01-18~2022-01-24	11,976,285.00	28,014,290.00	37,505,710.00	2,484,865.00	3.39%

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 2022 年 3 月 31 日，博时基金公司共管理 322 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 15830 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 5144 亿元人民币，累计分红逾 1627 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
二〇二二年四月二十二日