

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2季度报告  
2022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：二〇二二年七月二十一日

## §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 2022 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 2022 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	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	64,386,670.00 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 4 月 1 日-2022 年 6 月 30 日)
1.本期已实现收益	2,860,912.77
2.本期利润	32,507,351.21
3.加权平均基金份额本期利润	0.4534
4.期末基金资产净值	750,371,085.77
5.期末基金份额净值	11.6541

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（不包含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

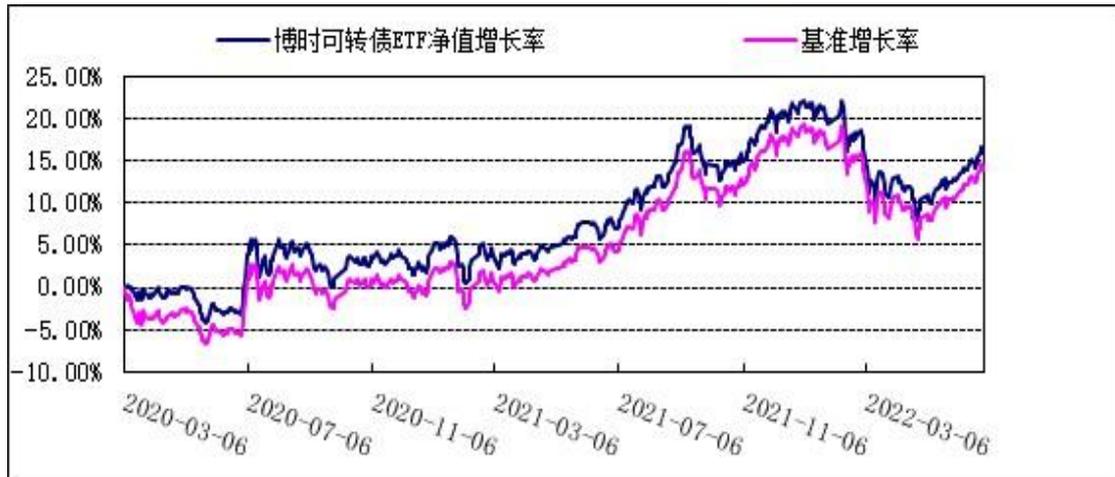
所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 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	4.14%	0.54%	4.55%	0.54%	-0.41%	0.00%
过去六个月	-4.42%	0.71%	-3.76%	0.71%	-0.66%	0.00%
过去一年	8.15%	0.65%	9.09%	0.64%	-0.94%	0.01%
自基金合同生 效起至今	16.54%	0.60%	14.47%	0.59%	2.07%	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	-	13.9	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

				<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 4 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

整体看二季度债券市场短端利率整体有所下行，而中长端利率处于震荡局面，信用利差继续压缩，股市走出深“V”局面，可转债先抑后扬录得正回报，股市和可转债表现优于纯债资产。具体来看，4 月份国内疫情对经济拖累的影响愈发明显，央行通过降准继续释放流动性，资金面偏宽松，中短端债券收益率出现下行，但长端利率债处于横盘震荡，一定程度上受到美国 10 年期国债利率大幅上升的影响，而在不利的宏观环境下股市继续调整。4 月底政治局会议指示疫情防控方面坚持“动态清零”，国内需关注疫情变化，国外看通胀，预期在疫情防控达到目标后，未来市场的核心矛盾转向稳增长情况。5 月份国内经济仍一定程度上受疫情拖累影响，基本面压力偏大，稳增长相关政策进一步加码，在此背景下债券收益率先下后上，窄幅震荡持平，一方面表明流动性宽松和基本面因素偏多，一方面市场对宽信用层面有所警惕。与此同时，随着市场对悲观预期的较充分反应和未来复工复产预期下，权益资产出现一波明显的反弹，转债市场也跟随受益。5 月底稳增长大会后各项有利政策陆续落实，专项债加快发行，并有一些针对性的资金支持政策，如调高政策性银行信贷额度、发行金融债补充项目资本金等，6 月份 PMI 指标验证经济开始呈现复苏状态，在此相对不利环境下债券长端收益率开始震荡上行，股市和可转债市场继续上涨，转债市场估值也得以提升到偏高位。展望未来，当前债券收益率绝对水平不高，流动性最宽松的阶段可能已过去，经济基本面也开始好转，宏观环境对债市并不友好，我们对债市看法相对偏谨慎，认为需进一步等待机会。随着下半年经济步入复苏阶段，企业盈利增速见底回升，流动性维持现有宽松局面概率偏大，同时考虑到股市估值处于中性偏低位，整体认为未来股市机会大于风险，短期关注交易情绪偏高状态，预期股市大概率处于震荡回升态势，结构更为重要，如可考虑估值仍处于低位医药板块，前期滞胀的稳增长受益链等。可转债市场估值不便宜，结构选择更为重要，并需适当加强波段交易。市场风险点主要来自海外通胀超预期。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。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 06 月 30 日，本基金基金份额净值为 11.6541 元，份额累计净值为 1.1654 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为 4.14%，同期业绩基准增长率为 4.55%。

#### 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	755,350,538.66	98.27
	其中：债券	755,350,538.66	98.27
	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	6,915,588.51	0.90
8	其他各项资产	6,343,311.91	0.83
9	合计	768,609,439.08	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 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）	755,350,538.66	100.66
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	755,350,538.66	100.66

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	387,520	43,275,101.59	5.77
2	110059	浦发转债	382,340	40,528,406.63	5.40
3	113021	中信转债	306,020	33,472,425.68	4.46
4	113044	大秦转债	248,050	27,052,978.61	3.61
5	132018	G 三峡 EB1	157,150	21,998,438.24	2.93

### 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、中国人民银行呼和浩特市中心支行、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、国家外汇管理局上海市分局、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宁波监管局、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。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、中国人民银行营业管理部的处罚。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、中国人民银行青岛市中心支行、国家外汇管理局北京外汇管理部的处罚。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。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	73,038.02
2	应收证券清算款	6,194,657.65
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	75,616.24
8	其他	-
9	合计	6,343,311.91

#### 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	113052	兴业转债	43,275,101.59	5.77
2	110059	浦发转债	40,528,406.63	5.40
3	113021	中信转债	33,472,425.68	4.46
4	113044	大秦转债	27,052,978.61	3.61
5	132018	G 三峡 EB1	21,998,438.24	2.93
6	110053	苏银转债	19,711,597.61	2.63
7	113011	光大转债	19,693,531.53	2.62
8	113050	南银转债	19,441,935.63	2.59
9	132015	18 中油 EB	16,165,913.27	2.15
10	113042	上银转债	16,107,292.32	2.15
11	110079	杭银转债	15,003,893.72	2.00
12	123107	温氏转债	9,962,162.66	1.33

13	127045	牧原转债	9,719,221.22	1.30
14	110081	闻泰转债	8,495,904.11	1.13
15	132009	17 中油 EB	8,484,191.26	1.13
16	127049	希望转 2	8,041,159.93	1.07
17	110073	国投转债	7,389,751.11	0.98
18	113013	国君转债	6,989,833.29	0.93
19	110075	南航转债	6,729,285.37	0.90
20	127030	盛虹转债	6,254,377.38	0.83
21	127005	长证转债	5,221,261.20	0.70
22	127018	本钢转债	5,168,322.00	0.69
23	110083	苏租转债	5,105,767.66	0.68
24	127012	招路转债	4,928,880.55	0.66
25	110061	川投转债	4,827,772.98	0.64
26	127032	苏行转债	4,651,824.64	0.62
27	127040	国泰转债	4,612,922.43	0.61
28	132020	19 蓝星 EB	4,459,739.97	0.59
29	132014	18 中化 EB	4,367,114.44	0.58
30	128129	青农转债	4,022,854.50	0.54
31	113043	财通转债	3,762,762.21	0.50
32	113049	长汽转债	3,637,304.89	0.48
33	113037	紫银转债	3,614,118.64	0.48
34	113051	节能转债	3,388,969.36	0.45
35	127036	三花转债	3,234,076.83	0.43
36	113045	环旭转债	3,105,829.87	0.41
37	127020	中金转债	3,093,966.66	0.41
38	127027	靖远转债	2,933,903.42	0.39
39	128081	海亮转债	2,916,445.98	0.39
40	127039	北港转债	2,852,720.93	0.38
41	113024	核建转债	2,828,854.15	0.38
42	113025	明泰转债	2,768,910.85	0.37
43	110043	无锡转债	2,694,274.80	0.36
44	113048	晶科转债	2,685,172.98	0.36
45	113616	韦尔转债	2,670,682.49	0.36
46	110072	广汇转债	2,642,569.84	0.35
47	128136	立讯转债	2,611,558.10	0.35
48	110062	烽火转债	2,542,457.60	0.34
49	128048	张行转债	2,506,891.74	0.33
50	110067	华安转债	2,506,196.10	0.33
51	110045	海澜转债	2,454,943.70	0.33
52	110048	福能转债	2,357,873.01	0.31
53	127038	国微转债	2,343,502.19	0.31
54	113623	凤 21 转债	2,281,682.71	0.30
55	110068	龙净转债	2,204,241.04	0.29

56	127050	麒麟转债	2,147,811.83	0.29
57	127006	敖东转债	2,118,653.15	0.28
58	110082	宏发转债	2,034,802.39	0.27
59	128035	大族转债	2,018,384.19	0.27
60	127022	恒逸转债	1,992,941.25	0.27
61	132021	19 中电 EB	1,952,951.23	0.26
62	128109	楚江转债	1,947,974.90	0.26
63	113632	鹤 21 转债	1,921,727.07	0.26
64	110047	山鹰转债	1,910,467.23	0.25
65	113047	旗滨转债	1,904,501.47	0.25
66	123119	康泰转 2	1,820,830.39	0.24
67	110077	洪城转债	1,790,635.17	0.24
68	110056	亨通转债	1,736,690.95	0.23
69	113626	伯特转债	1,700,575.11	0.23
70	128140	润建转债	1,690,485.62	0.23
71	113602	景 20 转债	1,662,831.74	0.22
72	128034	江银转债	1,661,530.54	0.22
73	110076	华海转债	1,630,054.06	0.22
74	110063	鹰 19 转债	1,618,649.19	0.22
75	123114	三角转债	1,615,403.87	0.22
76	127043	川恒转债	1,608,981.75	0.21
77	127025	冀东转债	1,577,592.89	0.21
78	128134	鸿路转债	1,545,985.64	0.21
79	110064	建工转债	1,543,280.24	0.21
80	113046	金田转债	1,538,531.99	0.21
81	113033	利群转债	1,526,538.95	0.20
82	110057	现代转债	1,491,831.62	0.20
83	128095	恩捷转债	1,480,974.78	0.20
84	123108	乐普转 2	1,428,157.34	0.19
85	128141	旺能转债	1,402,935.01	0.19
86	110080	东湖转债	1,395,935.15	0.19
87	128135	洽洽转债	1,395,173.12	0.19
88	128114	正邦转债	1,393,874.26	0.19
89	110052	贵广转债	1,389,627.48	0.19
90	123070	鹏辉转债	1,320,286.24	0.18
91	113635	升 21 转债	1,286,066.84	0.17
92	128017	金禾转债	1,274,592.65	0.17
93	113605	大参转债	1,236,254.14	0.16
94	113636	甬金转债	1,229,382.89	0.16
95	127016	鲁泰转债	1,223,526.30	0.16
96	123115	捷捷转债	1,221,808.05	0.16
97	128046	利尔转债	1,208,681.64	0.16
98	128131	崇达转 2	1,206,433.89	0.16

99	127047	帝欧转债	1,204,360.82	0.16
100	127024	盈峰转债	1,198,707.06	0.16
101	113516	苏农转债	1,192,594.96	0.16
102	128108	蓝帆转债	1,175,039.16	0.16
103	118000	嘉元转债	1,159,206.59	0.15
104	113615	金诚转债	1,149,625.18	0.15
105	128029	太阳转债	1,145,714.35	0.15
106	113622	杭叉转债	1,134,200.32	0.15
107	127044	蒙娜转债	1,095,120.43	0.15
108	113534	鼎胜转债	1,094,939.73	0.15
109	123128	首华转债	1,089,906.98	0.15
110	111000	起帆转债	1,074,195.71	0.14
111	127046	百润转债	1,074,121.87	0.14
112	127033	中装转 2	1,071,420.05	0.14
113	123083	朗新转债	1,064,816.66	0.14
114	123085	万顺转 2	1,054,761.30	0.14
115	113620	傲农转债	1,048,972.03	0.14
116	123086	海兰转债	1,046,319.23	0.14
117	123078	飞凯转债	1,044,889.57	0.14
118	113017	吉视转债	1,038,043.92	0.14
119	127052	西子转债	1,022,431.01	0.14
120	123113	仙乐转债	1,021,838.10	0.14
121	123077	汉得转债	1,020,647.70	0.14
122	113545	金能转债	1,014,966.38	0.14
123	113619	世运转债	1,006,758.33	0.13
124	127031	洋丰转债	988,657.29	0.13
125	128023	亚太转债	977,650.34	0.13
126	113633	科沃转债	973,463.56	0.13
127	128130	景兴转债	964,762.48	0.13
128	123121	帝尔转债	955,186.53	0.13
129	127017	万青转债	952,511.99	0.13
130	128078	太极转债	936,991.29	0.12
131	128119	龙大转债	935,242.67	0.12
132	113596	城地转债	926,482.98	0.12
133	123071	天能转债	920,170.63	0.12
134	128144	利民转债	917,548.68	0.12
135	123104	卫宁转债	887,162.97	0.12
136	128083	新北转债	881,223.53	0.12
137	123117	健帆转债	880,596.32	0.12
138	113637	华翔转债	874,072.50	0.12
139	127015	希望转债	868,037.23	0.12
140	113582	火炬转债	851,323.77	0.11
141	123120	隆华转债	842,435.92	0.11

142	110074	精达转债	830,040.72	0.11
143	113631	皖天转债	829,736.45	0.11
144	123125	元力转债	822,471.46	0.11
145	128127	文科转债	816,967.54	0.11
146	123035	利德转债	816,225.12	0.11
147	127029	中钢转债	812,504.29	0.11
148	113634	珀莱转债	798,192.30	0.11
149	123105	拓尔转债	798,053.87	0.11
150	123092	天壕转债	794,749.08	0.11
151	123049	维尔转债	784,116.93	0.10
152	123099	普利转债	782,928.26	0.10
153	118003	华兴转债	782,837.11	0.10
154	128132	交建转债	775,938.75	0.10
155	128133	奇正转债	767,909.79	0.10
156	128128	齐翔转 2	766,052.87	0.10
157	113630	赛伍转债	729,723.40	0.10
158	113549	白电转债	720,741.80	0.10
159	127037	银轮转债	720,515.07	0.10
160	127019	国城转债	718,816.78	0.10
161	113599	嘉友转债	714,295.64	0.10
162	123076	强力转债	704,673.35	0.09
163	111002	特纸转债	697,042.47	0.09
164	113563	柳药转债	696,519.99	0.09
165	123133	佩蒂转债	692,021.89	0.09
166	128145	日丰转债	673,186.89	0.09
167	113627	太平转债	672,701.18	0.09
168	113505	杭电转债	668,038.97	0.09
169	123096	思创转债	664,977.50	0.09
170	128139	祥鑫转债	655,545.31	0.09
171	132022	20 广版 EB	654,276.33	0.09
172	123004	铁汉转债	653,623.36	0.09
173	127042	嘉美转债	650,405.13	0.09
174	113609	永安转债	650,285.20	0.09
175	128015	久其转债	646,846.87	0.09
176	110038	济川转债	641,912.01	0.09
177	123132	回盛转债	635,822.57	0.08
178	128105	长集转债	623,143.31	0.08
179	128121	宏川转债	621,092.05	0.08
180	123075	贝斯转债	616,899.93	0.08
181	128142	新乳转债	616,330.99	0.08
182	123060	苏试转债	614,510.09	0.08
183	113629	泉峰转债	611,896.41	0.08
184	113621	彤程转债	611,539.09	0.08

185	110060	天路转债	610,592.82	0.08
186	113519	长久转债	609,305.29	0.08
187	123063	大禹转债	608,987.88	0.08
188	127026	超声转债	608,865.09	0.08
189	118001	金博转债	602,380.80	0.08
190	123131	奥飞转债	599,965.10	0.08
191	128137	洁美转债	586,494.60	0.08
192	128106	华统转债	584,080.99	0.08
193	127034	绿茵转债	570,841.30	0.08
194	128044	岭南转债	561,242.42	0.07
195	123101	拓斯转债	559,053.62	0.07
196	111001	山玻转债	556,273.80	0.07
197	128124	科华转债	556,236.99	0.07
198	113504	艾华转债	550,355.35	0.07
199	123091	长海转债	545,453.85	0.07
200	113530	大丰转债	542,854.58	0.07
201	127035	濮耐转债	539,872.05	0.07
202	128063	未来转债	539,397.57	0.07
203	123122	富瀚转债	538,051.73	0.07
204	123064	万孚转债	534,342.05	0.07
205	128116	瑞达转债	532,010.30	0.07
206	127028	英特转债	528,442.75	0.07
207	127014	北方转债	513,545.00	0.07
208	113618	美诺转债	511,496.67	0.07
209	123129	锦鸡转债	510,302.76	0.07
210	123123	江丰转债	507,898.69	0.07
211	128022	众信转债	504,772.96	0.07
212	113584	家悦转债	499,853.47	0.07
213	113604	多伦转债	498,569.07	0.07
214	127041	弘亚转债	498,531.45	0.07
215	113606	荣泰转债	498,040.80	0.07
216	113625	江山转债	496,537.34	0.07
217	113542	好客转债	486,621.65	0.06
218	127007	湖广转债	479,924.97	0.06
219	128075	远东转债	477,336.66	0.06
220	123044	红相转债	463,998.33	0.06
221	123098	一品转债	462,753.68	0.06
222	113600	新星转债	458,301.59	0.06
223	123023	迪森转债	456,349.83	0.06
224	123056	雪榕转债	454,898.55	0.06
225	123087	明电转债	453,548.42	0.06
226	113579	健友转债	452,137.08	0.06
227	113601	塞力转债	442,972.69	0.06

228	123130	设研转债	442,829.03	0.06
229	113588	润达转债	442,613.12	0.06
230	123127	耐普转债	441,008.30	0.06
231	123067	斯莱转债	440,150.82	0.06
232	127051	博杰转债	437,803.77	0.06
233	128037	岩土转债	435,673.71	0.06
234	113589	天创转债	427,280.84	0.06
235	113591	胜达转债	426,780.90	0.06
236	123050	聚飞转债	426,190.50	0.06
237	123090	三诺转债	423,983.48	0.06
238	128097	奥佳转债	422,255.48	0.06
239	123073	同和转债	421,974.63	0.06
240	123048	应急转债	418,133.19	0.06
241	113610	灵康转债	412,663.01	0.05
242	123082	北陆转债	412,477.89	0.05
243	123100	朗科转债	410,453.63	0.05
244	123059	银信转债	408,478.62	0.05
245	123109	昌红转债	406,823.50	0.05
246	128101	联创转债	402,670.87	0.05
247	113593	沪工转债	402,635.93	0.05
248	113608	威派转债	397,750.04	0.05
249	123089	九洲转 2	383,028.34	0.05
250	110055	伊力转债	348,385.18	0.05
251	113027	华钰转债	342,896.63	0.05
252	128117	道恩转债	335,606.28	0.04
253	113532	海环转债	331,622.03	0.04
254	128042	凯中转债	325,212.08	0.04
255	128066	亚泰转债	319,729.19	0.04
256	128111	中矿转债	315,453.03	0.04
257	128138	侨银转债	312,232.35	0.04
258	123124	晶瑞转 2	310,169.90	0.04
259	113016	小康转债	306,255.82	0.04
260	113535	大业转债	304,851.08	0.04
261	123010	博世转债	302,818.20	0.04
262	128125	华阳转债	301,087.31	0.04
263	113628	晨丰转债	295,600.60	0.04
264	113569	科达转债	288,543.93	0.04
265	113624	正川转债	285,019.67	0.04
266	128026	众兴转债	281,635.45	0.04
267	113537	文灿转债	278,095.56	0.04
268	123084	高澜转债	276,283.88	0.04
269	123022	长信转债	267,228.23	0.04
270	128090	汽模转 2	267,132.38	0.04

271	128049	华源转债	265,561.15	0.04
272	113578	全筑转债	259,449.46	0.03
273	113524	奇精转债	259,301.53	0.03
274	128025	特一转债	257,108.52	0.03
275	113039	嘉泽转债	256,985.49	0.03
276	123126	瑞丰转债	254,659.20	0.03
277	128014	永东转债	253,250.56	0.03
278	123025	精测转债	251,393.28	0.03
279	113597	佳力转债	247,048.46	0.03
280	123106	正丹转债	246,231.12	0.03
281	123088	威唐转债	244,420.07	0.03
282	113030	东风转债	242,413.01	0.03
283	128082	华锋转债	241,854.35	0.03
284	128021	兄弟转债	241,411.08	0.03
285	128123	国光转债	239,308.28	0.03
286	123118	惠城转债	239,272.67	0.03
287	123103	震安转债	239,076.79	0.03
288	128069	华森转债	233,855.72	0.03
289	113570	百达转债	232,122.33	0.03
290	113598	法兰转债	231,116.42	0.03
291	128033	迪龙转债	230,071.19	0.03
292	113594	淳中转债	228,881.87	0.03
293	128071	合兴转债	227,434.54	0.03
294	128040	华通转债	226,734.74	0.03
295	128072	翔鹭转债	217,441.05	0.03
296	128118	瀛通转债	217,372.20	0.03
297	128122	兴森转债	215,332.86	0.03
298	113525	台华转债	214,306.27	0.03
299	113567	君禾转债	207,523.66	0.03
300	128070	智能转债	203,987.07	0.03
301	113573	纵横转债	201,833.18	0.03
302	110058	永鼎转债	196,245.59	0.03
303	123116	万兴转债	194,293.18	0.03
304	123011	德尔转债	192,000.22	0.03
305	123002	国祯转债	190,836.00	0.03
306	123039	开润转债	183,475.86	0.02
307	113565	宏辉转债	179,283.55	0.02
308	110070	凌钢转债	176,652.43	0.02
309	128076	金轮转债	175,332.21	0.02
310	113574	华体转债	158,431.50	0.02
311	123045	雷迪转债	158,263.23	0.02
312	113577	春秋转债	149,891.42	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	73,386,670.00
报告期期间基金总申购份额	4,800,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	13,800,000.00
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	64,386,670.00

## §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

无。

### 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 6 月 30 日，博时基金公司共管理 327 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 16491 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 5557 亿元人民币，累计

分红逾 1678 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  
二〇二二年七月二十一日