

博时稳健回报债券型证券投资基金（LOF）
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 | 博时稳健回报债券（LOF） | |
| 场内简称 | 稳健债 A | |
| 基金主代码 | 160513 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2011年6月10日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 221,709,096.28 份 | |
| 投资目标 | 在谨慎投资的前提下，本基金力争获取高于业绩比较基准的投资收益。 | |
| 投资策略 | 通过宏观方面自上而下的分析及债券市场方面自下而上的判断，把握市场利率水平的运行态势，根据债券市场收益率曲线的整体运动方向进行久期选择。在微观方面，基于债券市场的状况，主要采用骑乘、息差及利差策略等投资策略。同时积极参与一级市场新股、债券申购，提高组合预期收益水平。主要投资策略包括资产配置策略、固定收益类品种投资策略、权益类品种投资策略。 | |
| 业绩比较基准 | 中证全债指数收益率 | |
| 风险收益特征 | 从基金整体运作来看，本基金属于中低风险品种，预期收益和风险高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。 | |
| 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 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 博时稳健回报债券（LOF）A | 博时稳健回报债券（LOF）C |
| 下属分级基金的场内简称 | 稳健债 A | 稳健债 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 160513 | 160514 |

| | | |
|-----------------|-----------------|------------------|
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 55,439,663.90 份 | 166,269,432.38 份 |
|-----------------|-----------------|------------------|

§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) | |
|----------------|-------------------------------|----------------|
| | 博时稳健回报债券（LOF）A | 博时稳健回报债券（LOF）C |
| 1.本期已实现收益 | 629,464.92 | 1,028,357.02 |
| 2.本期利润 | 1,584,380.06 | 2,833,178.93 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0482 | 0.0388 |
| 4.期末基金资产净值 | 99,775,194.13 | 260,626,701.76 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.800 | 1.567 |

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

1. 博时稳健回报债券（LOF）A：

| 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 | 3.03% | 0.14% | 1.32% | 0.04% | 1.71% | 0.10% |
| 过去六个月 | 4.23% | 0.28% | 2.31% | 0.04% | 1.92% | 0.24% |
| 过去一年 | 10.91% | 0.31% | 2.84% | 0.06% | 8.07% | 0.25% |
| 过去三年 | 30.06% | 0.26% | 15.42% | 0.07% | 14.64% | 0.19% |
| 过去五年 | 23.97% | 0.25% | 20.48% | 0.08% | 3.49% | 0.17% |
| 自基金合同 生效起至今 | 70.19% | 0.38% | 40.12% | 0.08% | 30.07% | 0.30% |

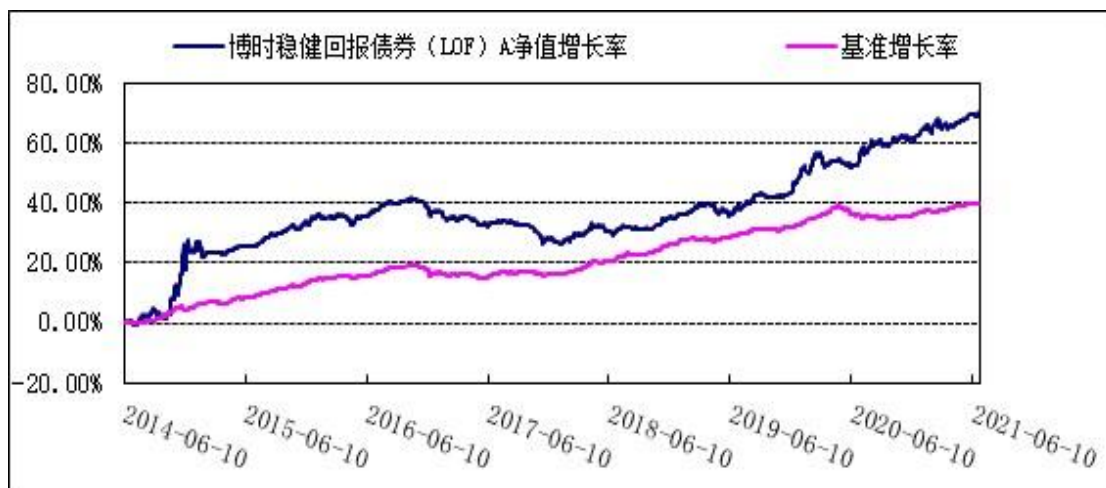
2. 博时稳健回报债券（LOF）C：

| 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 | 2.89% | 0.14% | 1.32% | 0.04% | 1.57% | 0.10% |
| 过去六个月 | 3.98% | 0.27% | 2.31% | 0.04% | 1.67% | 0.23% |

| | | | | | | |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 过去一年 | 10.43% | 0.31% | 2.84% | 0.06% | 7.59% | 0.25% |
| 过去三年 | 28.65% | 0.27% | 15.42% | 0.07% | 13.23% | 0.20% |
| 过去五年 | 22.14% | 0.25% | 20.48% | 0.08% | 1.66% | 0.17% |
| 自基金合同生效起至今 | 66.47% | 0.38% | 40.12% | 0.08% | 26.35% | 0.30% |

3.2.2 自基金转型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

1. 博时稳健回报债券（LOF）A：



2. 博时稳健回报债券（LOF）C：



§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 | 2018-04-23 | - | 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 |

| | | | | |
|--|---------------|--|--|---|
| | 新组投资总监助理/基金经理 | | | <p>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</p> |
|--|---------------|--|--|---|

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|
| | | | | | 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 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。组合在纯债方面偏中性久期，转债方面调整了部分结构，择券方面更自下而上考虑业绩，并关注估值偏低的部分中低价券。

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A类基金份额净值为1.800元，份额累计净值为1.875元，本基金C类基金份额净值为1.567元，份额累计净值为1.667元，报告期内，本基金A类基金份额净值增长率为3.03%，本基金C类基金份额净值增长率为2.89%，同期业绩基准增长率为1.32%。

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 | 729,904.69 | 0.19 |
| | 其中：股票 | 729,904.69 | 0.19 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 306,056,061.82 | 79.61 |
| | 其中：债券 | 306,056,061.82 | 79.61 |
| | 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 | 32,500,000.00 | 8.45 |
| | 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 | 28,346,081.67 | 7.37 |
| 8 | 其他各项资产 | 16,835,790.25 | 4.38 |
| 9 | 合计 | 384,467,838.43 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------------------|------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | - | - |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 729,904.69 | 0.20 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |

| | | |
|----|------------|------|
| 合计 | 729,904.69 | 0.20 |
|----|------------|------|

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

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------|------------|--------------|
| 1 | 600483 | 福能股份 | 69,581 | 729,904.69 | 0.20 |

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 | 63,768,805.60 | 17.69 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 30,259,000.00 | 8.40 |
| | 其中：政策性金融债 | 30,259,000.00 | 8.40 |
| 4 | 企业债券 | 27,968,500.00 | 7.76 |
| 5 | 企业短期融资券 | 15,014,000.00 | 4.17 |
| 6 | 中期票据 | 42,310,600.00 | 11.74 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 126,735,156.22 | 35.16 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 306,056,061.82 | 84.92 |

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 | 019645 | 20 国债 15 | 292,390 | 29,329,640.90 | 8.14 |
| 2 | 210205 | 21 国开 05 | 200,000 | 20,250,000.00 | 5.62 |
| 3 | 019640 | 20 国债 10 | 186,030 | 18,603,000.00 | 5.16 |
| 4 | 132015 | 18 中油 EB | 161,940 | 16,558,365.00 | 4.59 |
| 5 | 019547 | 16 国债 19 | 168,130 | 15,836,164.70 | 4.39 |

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 21 国开 05(210205)、浦发转债(110059)、苏银转债(110053)、21 国开 02(210202)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 1 月 15 日，因存在项目融资业务管理严重违反审慎经营规则的违规行为，中国银行保险监督管理委员会北京监管局对国家开发银行北京分行处以罚款的行政处罚。

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：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。

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 | 13,191.54 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 3,442,880.78 |
| 5 | 应收申购款 | 13,379,717.93 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 16,835,790.25 |

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 | 132015 | 18 中油 EB | 16,558,365.00 | 4.59 |
| 2 | 110059 | 浦发转债 | 11,626,829.30 | 3.23 |
| 3 | 110053 | 苏银转债 | 11,348,373.60 | 3.15 |
| 4 | 132009 | 17 中油 EB | 10,290,000.00 | 2.86 |

| | | | | |
|----|--------|----------|--------------|------|
| 5 | 132018 | G 三峡 EB1 | 5,150,745.60 | 1.43 |
| 6 | 128128 | 齐翔转 2 | 4,171,857.30 | 1.16 |
| 7 | 128064 | 司尔转债 | 4,137,677.22 | 1.15 |
| 8 | 128140 | 润建转债 | 3,268,532.12 | 0.91 |
| 9 | 128136 | 立讯转债 | 3,161,158.50 | 0.88 |
| 10 | 127013 | 创维转债 | 2,712,608.25 | 0.75 |
| 11 | 113040 | 星宇转债 | 2,541,559.80 | 0.71 |
| 12 | 113044 | 大秦转债 | 2,414,268.60 | 0.67 |
| 13 | 110052 | 贵广转债 | 2,388,556.00 | 0.66 |
| 14 | 123044 | 红相转债 | 2,090,259.90 | 0.58 |
| 15 | 113593 | 沪工转债 | 2,050,293.00 | 0.57 |
| 16 | 127011 | 中鼎转 2 | 1,824,812.50 | 0.51 |
| 17 | 113504 | 艾华转债 | 1,752,684.70 | 0.49 |
| 18 | 113043 | 财通转债 | 1,700,638.60 | 0.47 |
| 19 | 123078 | 飞凯转债 | 1,575,219.00 | 0.44 |
| 20 | 110048 | 福能转债 | 1,569,565.00 | 0.44 |
| 21 | 123090 | 三诺转债 | 1,566,698.00 | 0.43 |
| 22 | 127006 | 敖东转债 | 1,376,947.90 | 0.38 |
| 23 | 127005 | 长证转债 | 1,364,681.00 | 0.38 |
| 24 | 128081 | 海亮转债 | 1,358,834.50 | 0.38 |
| 25 | 113012 | 骆驼转债 | 1,343,248.20 | 0.37 |
| 26 | 123087 | 明电转债 | 1,040,410.80 | 0.29 |
| 27 | 127007 | 湖广转债 | 996,243.36 | 0.28 |
| 28 | 113612 | 永冠转债 | 971,021.60 | 0.27 |
| 29 | 128083 | 新北转债 | 917,069.30 | 0.25 |
| 30 | 110067 | 华安转债 | 894,808.60 | 0.25 |
| 31 | 127027 | 靖远转债 | 869,347.60 | 0.24 |
| 32 | 113017 | 吉视转债 | 821,960.40 | 0.23 |
| 33 | 113508 | 新风转债 | 807,418.20 | 0.22 |
| 34 | 127012 | 招路转债 | 795,232.90 | 0.22 |
| 35 | 110043 | 无锡转债 | 771,858.00 | 0.21 |
| 36 | 113013 | 国君转债 | 677,988.10 | 0.19 |
| 37 | 110073 | 国投转债 | 532,087.40 | 0.15 |
| 38 | 113601 | 塞力转债 | 511,408.80 | 0.14 |
| 39 | 128119 | 龙大转债 | 385,521.00 | 0.11 |
| 40 | 110061 | 川投转债 | 385,110.60 | 0.11 |
| 41 | 123075 | 贝斯转债 | 334,908.63 | 0.09 |
| 42 | 128075 | 远东转债 | 320,105.20 | 0.09 |
| 43 | 128034 | 江银转债 | 201,984.00 | 0.06 |
| 44 | 128131 | 崇达转 2 | 181,750.40 | 0.05 |
| 45 | 123064 | 万孚转债 | 52,667.70 | 0.01 |
| 46 | 132022 | 20 广版 EB | 30,081.00 | 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

| 项目 | 博时稳健回报债券（LOF）A | 博时稳健回报债券（LOF）C |
|----------------|----------------|----------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 18,961,300.22 | 43,871,256.20 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 43,244,195.47 | 130,174,253.67 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 6,765,831.79 | 7,776,077.49 |
| 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 | 55,439,663.90 | 166,269,432.38 |

§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份额。

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 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稳健回报债券型证券投资基金（LOF）设立的文件
- 9.1.2 《博时稳健回报债券型证券投资基金（LOF）基金合同》
- 9.1.3 《博时稳健回报债券型证券投资基金（LOF）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 博时稳健回报债券型证券投资基金（LOF）各年度审计报告正本
- 9.1.6 报告期内博时稳健回报债券型证券投资基金（LOF）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