

博时稳健回报债券型证券投资基金（LOF）
2023 年第 4 季度报告
2023 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：二〇二四年一月二十二日

§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 2024 年 1 月 18 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 2023 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金产品概况

| | | |
|-------------|---|----------------|
| 基金简称 | 博时稳健回报债券（LOF） | |
| 场内简称 | 稳健债 LOF | |
| 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 | 2,502,307,556.39 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 LOF | - |
| 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 | 999,894,829.32 份 | 1,502,412,727.07 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 (2023 年 10 月 1 日-2023 年 12 月 31 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 | -19,423,984.33 | -28,322,424.21 |
| 2.本期利润 | -7,746,222.58 | -12,388,265.60 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0070 | -0.0073 |
| 4.期末基金资产净值 | 1,951,281,130.67 | 2,531,923,647.80 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.9515 | 1.6852 |

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

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 | -0.22% | 0.12% | 1.44% | 0.05% | -1.66% | 0.07% |
| 过去六个月 | 0.60% | 0.10% | 2.19% | 0.06% | -1.59% | 0.04% |
| 过去一年 | 3.53% | 0.10% | 5.23% | 0.05% | -1.70% | 0.05% |
| 过去三年 | 13.00% | 0.15% | 15.05% | 0.06% | -2.05% | 0.09% |
| 过去五年 | 36.28% | 0.21% | 24.43% | 0.07% | 11.85% | 0.14% |
| 自基金合同 生效起至今 | 84.52% | 0.33% | 57.56% | 0.08% | 26.96% | 0.25% |

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 | -0.31% | 0.12% | 1.44% | 0.05% | -1.75% | 0.07% |
| 过去六个月 | 0.42% | 0.10% | 2.19% | 0.06% | -1.77% | 0.04% |

| | | | | | | |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 过去一年 | 3.17% | 0.10% | 5.23% | 0.05% | -2.06% | 0.05% |
| 过去三年 | 11.82% | 0.15% | 15.05% | 0.06% | -3.23% | 0.09% |
| 过去五年 | 33.96% | 0.22% | 24.43% | 0.07% | 9.53% | 0.15% |
| 自基金合同生效起至今 | 79.02% | 0.33% | 57.56% | 0.08% | 21.46% | 0.25% |

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 | | |
| 罗霄 | 基金经理 | 2022-09-30 | - | 11.4 | 罗霄先生，硕士。2012 年加入博时基金管理有限公司。历任固定收益部研究员、 |

| | | | | | |
|-----|------|------------|------------|------|---|
| | | | | | 固定收益总部高级研究员、固定收益总部高级研究员兼基金经理助理、年金投资部投资经理、博时恒康一年持有期混合型证券投资基金(2023年3月1日-2023年7月27日)基金经理。现任博时稳健回报债券型证券投资基金（LOF）(2022年9月30日—至今)、博时荣升稳健添利18个月定期开放混合型证券投资基金(2023年3月23日—至今)、博时稳定价值债券投资基金(2023年7月28日—至今)、博时恒瑞混合型证券投资基金(2023年9月15日—至今)、博时稳健增利债券型证券投资基金(2023年10月20日—至今)的基金经理。 |
| 高晖 | 基金经理 | 2023-10-20 | - | 12.7 | 高晖先生，硕士。2011年加入博时基金管理有限公司。现任博时转债增强债券型证券投资基金(2023年10月20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(2023年10月20日—至今)、博时稳健回报债券型证券投资基金（LOF）(2023年10月20日—至今)的基金经理。 |
| 邓欣雨 | 基金经理 | 2018-04-23 | 2023-10-20 | 15.4 | 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、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-2023 年 6 月 27 日)、博时稳健回报债券型证券投资基金（LOF）(2018 年 4 月 23 日-2023 年 10 月 20 日)、博时转债增强债券型证券投资基金(2019 年 4 月 25 日-2023 年 10 月 20 日)、博时稳定价值债券投资基金(2020 年 2 月 24 日-2023 年 10 月 20 日)、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-2023 年 10 月 20 日)、博时鑫荣稳健混合型证券投资基金(2021 年 12 月 9 日-2023 年 10 月 20 日)、博时恒瑞混合型证券投资基金(2022 年 2 月 24 日-2023 年 10 月 20 日)、博时稳健增利债券型证券投资基金(2023 年 6 月 20 日-2023 年 10 月 20 日)、博时恒享债券型证券投资基金(2023 年 3 月 30 日-2023 年 10 月 23 日)的基金经理、混合资产投资部投资总监助理。 |
|--|--|--|--|--|

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，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 45 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

四季度，海外流动性出现边际好转，美债收益率冲高回落后快速下行带动全球风险资产上涨。国内市场受到房地产下行趋势未止、制造业景气度回踩、地方政府化债掣肘财政端发力等不利影响，权益市场出现单边下跌，沪深 300、万得全 A 分别下跌 7%、3.84%，大类资产继续呈现债强股弱的格局，与总量经济相关的板块跌幅较大，微盘、红利策略占优，当前沪深 300 的估值水平已位于历史底部区域。政策端，中央发行万亿特别国债、上调赤字率托底经济，三大工程因年末尚未形成实物工作量。CPI、PPI 指标在快速下行后进入到了较长时间的低通胀格局，社融、M1 等指标底部徘徊。

四季度债券市场短端和长端走势有所不同，债券短端由于降准预期落空以及地方政府再融资债和国债增发的影响持续处于结构性较为紧张的状态，直到年末央行大额投放跨年资金以及国债资金下达才推动了短端在年末出现了一波加速下行的行情。债券长端方面则没有大幅度的收益率调整，主要还是反应了对于基本面较弱的预期，且在年末短端收益率下行的过程当中也出现了一波收益率的下行。组合层面则延续了此前较为稳健的票息策略，在原有持仓基础上进行了微调，适度增加了部分性价比更好的债券品种的配置。另外在年末的债券长端机会较为确定的情况下也适当拉长了组合的久期进行了一次波段操作，为组合增厚了部分收益。展望未来，对于债券市场较为友好的外部环境短期来看仍未有实质性变化，年初各类机构也有较强的配置性需求，因此总体来看债券市场的调整风险不大，组合层面继续维持票息为主的思路，寻找

性价比更好的个券对组合进行持续的优化和调整，力争为投资者创造更好的回报体验。

转债方面，前期的估值韧性受到挑战，中长期对权益市场的悲观情绪叠加固收+基金赎回冲击，四季度转债估值出现了大幅调整，偏债型品种的纯债溢价率水平仅次于 2018 年末，当前各类属转债的绝对价格和估值均处于近两年内低位。组合坚持以低价券策略为主，配置上分为核心+卫星。核心仓集中在流动性较好的大盘高评级转债，以公用事业、非银金融、生猪养殖等行业为主。卫星仓则分散在绝对价格低、YTM 相对较高的偏债型转债，择券综合考虑转债条款、纯债溢价率、正股基本面预期、波动率、市值等因素。因转债估值回落后整体配置性价比提升，组合转债仓位保持在较高水平。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 12 月 31 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.9515 元，份额累计净值为 2.0265 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.6852 元，份额累计净值为 1.7852 元，报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 -0.22%，本基金 C 类基金份额净值增长率为 -0.31%，同期业绩基准增长率为 1.44%。

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 | 5,485,621,988.59 | 95.77 |
| | 其中：债券 | 5,485,621,988.59 | 95.77 |
| | 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 | 157,481,325.52 | 2.75 |
| 8 | 其他各项资产 | 84,825,044.49 | 1.48 |
| 9 | 合计 | 5,727,928,358.60 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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 | 222,967,113.86 | 4.97 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 731,992,021.87 | 16.33 |
| | 其中：政策性金融债 | 343,637,403.21 | 7.66 |
| 4 | 企业债券 | 1,660,624,855.81 | 37.04 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 1,744,839,570.37 | 38.92 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 1,115,120,182.11 | 24.87 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | 10,078,244.57 | 0.22 |
| 10 | 合计 | 5,485,621,988.59 | 122.36 |

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 | 220205 | 22 国开 05 | 1,700,000 | 178,038,438.36 | 3.97 |
| 2 | 019703 | 23 国债 10 | 1,200,000 | 121,703,671.24 | 2.71 |
| 3 | 210202 | 21 国开 02 | 1,100,000 | 113,237,134.25 | 2.53 |
| 4 | 230022 | 23 付息国债 22 | 1,000,000 | 101,263,442.62 | 2.26 |
| 5 | 113060 | 浙 22 转债 | 508,330 | 63,595,244.40 | 1.42 |

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

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

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，国家开发银行在报告编制前一年受到中国银行保险监督管理委员会湖北监管局、国家金融监督管理总局山西监管局、国家金融监督管理总局浙江监管局的处罚。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 | 57,854.38 |
| 2 | 应收证券清算款 | 31,176,457.09 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 53,590,733.02 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 84,825,044.49 |

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 | 113060 | 浙 22 转债 | 63,595,244.40 | 1.42 |
| 2 | 127020 | 中金转债 | 61,949,191.63 | 1.38 |
| 3 | 110083 | 苏租转债 | 60,649,779.28 | 1.35 |
| 4 | 123107 | 温氏转债 | 56,619,307.37 | 1.26 |
| 5 | 113043 | 财通转债 | 45,952,436.73 | 1.02 |
| 6 | 113049 | 长汽转债 | 41,090,131.12 | 0.92 |
| 7 | 127045 | 牧原转债 | 38,835,910.26 | 0.87 |
| 8 | 127032 | 苏行转债 | 37,615,920.12 | 0.84 |
| 9 | 113044 | 大秦转债 | 37,274,783.41 | 0.83 |
| 10 | 110073 | 国投转债 | 37,230,782.47 | 0.83 |
| 11 | 110088 | 淮 22 转债 | 37,077,390.21 | 0.83 |
| 12 | 110068 | 龙净转债 | 35,692,906.85 | 0.80 |
| 13 | 127018 | 本钢转债 | 33,344,946.35 | 0.74 |
| 14 | 110061 | 川投转债 | 28,633,216.07 | 0.64 |
| 15 | 132018 | G 三峡 EB1 | 26,742,421.53 | 0.60 |
| 16 | 110067 | 华安转债 | 23,948,855.01 | 0.53 |
| 17 | 127012 | 招路转债 | 23,256,405.35 | 0.52 |
| 18 | 123091 | 长海转债 | 17,973,523.99 | 0.40 |
| 19 | 132026 | G 三峡 EB2 | 17,892,459.70 | 0.40 |
| 20 | 110077 | 洪城转债 | 17,189,948.86 | 0.38 |
| 21 | 113039 | 嘉泽转债 | 17,062,137.39 | 0.38 |
| 22 | 113647 | 禾丰转债 | 16,681,786.06 | 0.37 |
| 23 | 123101 | 拓斯转债 | 16,539,454.51 | 0.37 |
| 24 | 113653 | 永 22 转债 | 16,263,302.44 | 0.36 |
| 25 | 127041 | 弘亚转债 | 15,785,831.64 | 0.35 |
| 26 | 123128 | 首华转债 | 15,492,003.37 | 0.35 |
| 27 | 123158 | 宙邦转债 | 15,148,606.83 | 0.34 |
| 28 | 123142 | 申昊转债 | 14,393,488.32 | 0.32 |
| 29 | 123109 | 昌红转债 | 13,834,514.55 | 0.31 |
| 30 | 127082 | 亚科转债 | 12,096,872.91 | 0.27 |
| 31 | 118000 | 嘉元转债 | 11,377,425.69 | 0.25 |
| 32 | 111010 | 立昂转债 | 10,917,256.00 | 0.24 |
| 33 | 110048 | 福能转债 | 10,631,822.12 | 0.24 |
| 34 | 127074 | 麦米转 2 | 10,572,262.32 | 0.24 |
| 35 | 113530 | 大丰转债 | 10,223,806.51 | 0.23 |
| 36 | 127044 | 蒙娜转债 | 9,490,755.72 | 0.21 |
| 37 | 127031 | 洋丰转债 | 9,489,865.56 | 0.21 |
| 38 | 110062 | 烽火转债 | 9,275,113.56 | 0.21 |
| 39 | 113584 | 家悦转债 | 9,020,588.25 | 0.20 |
| 40 | 127077 | 华宏转债 | 8,975,146.64 | 0.20 |
| 41 | 127043 | 川恒转债 | 8,820,317.64 | 0.20 |

| | | | | |
|----|--------|---------|--------------|------|
| 42 | 118013 | 道通转债 | 8,802,596.78 | 0.20 |
| 43 | 127052 | 西子转债 | 7,804,988.89 | 0.17 |
| 44 | 128106 | 华统转债 | 7,546,355.47 | 0.17 |
| 45 | 127066 | 科利转债 | 6,946,906.23 | 0.15 |
| 46 | 128116 | 瑞达转债 | 6,540,506.74 | 0.15 |
| 47 | 127038 | 国微转债 | 6,344,567.62 | 0.14 |
| 48 | 118018 | 瑞科转债 | 6,037,318.38 | 0.13 |
| 49 | 118005 | 天奈转债 | 6,025,050.31 | 0.13 |
| 50 | 113650 | 博 22 转债 | 5,981,935.04 | 0.13 |
| 51 | 123151 | 康医转债 | 5,950,464.49 | 0.13 |
| 52 | 123093 | 金陵转债 | 5,265,186.57 | 0.12 |
| 53 | 118015 | 芯海转债 | 5,137,355.76 | 0.11 |
| 54 | 113624 | 正川转债 | 5,011,608.92 | 0.11 |
| 55 | 123064 | 万孚转债 | 5,010,305.90 | 0.11 |
| 56 | 118023 | 广大转债 | 4,817,059.49 | 0.11 |
| 57 | 113569 | 科达转债 | 4,805,717.50 | 0.11 |
| 58 | 118027 | 宏图转债 | 4,643,411.93 | 0.10 |
| 59 | 123196 | 正元转 02 | 1,737,038.22 | 0.04 |
| 60 | 127060 | 湘佳转债 | 1,000,510.51 | 0.02 |
| 61 | 128117 | 道恩转债 | 930,631.48 | 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

本基金本报告期末未持有股票。

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 | 1,291,644,747.59 | 1,905,229,373.08 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 85,728,884.77 | 60,018,434.35 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 377,478,803.04 | 462,835,080.36 |
| 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 | 999,894,829.32 | 1,502,412,727.07 |

§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 2023 年 12 月 31 日，博时基金公司共管理 367 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 14668 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 5478 亿元人民币，累计分红逾 1936 亿元人民币，是目前我国资产管理规模领先的基金公司之一。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 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
- 2、《博时稳健回报债券型证券投资基金（LOF）基金合同》
- 3、《博时稳健回报债券型证券投资基金（LOF）托管协议》
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 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
- 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

二〇二四年一月二十二日