

# 博时转债增强债券型证券投资基金

## 2019 年第 1 季度报告

### 2019 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：中国光大银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一九年四月二十二日

## §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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 4 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 2019 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

## §2 基金产品概况

|                 |                                                                                                                                                                                           |                  |
|-----------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|
| 基金简称            | 博时转债增强债券                                                                                                                                                                                  |                  |
| 基金主代码           | 050019                                                                                                                                                                                    |                  |
| 基金运作方式          | 契约型开放式                                                                                                                                                                                    |                  |
| 基金合同生效日         | 2010 年 11 月 24 日                                                                                                                                                                          |                  |
| 报告期末基金份额总额      | 323,016,252.72 份                                                                                                                                                                          |                  |
| 投资目标            | 通过自上而下的分析对固定收益类资产和权益类资产进行配置，并充分利用可转换债券兼具权益类证券与固定收益类证券的特性，实施对大类资产的配置，在控制风险并保持良好流动性的基础上，追求超越业绩比较基准的超额收益。                                                                                    |                  |
| 投资策略            | 本产品的类属资产配置策略主要通过自上而下的宏观分析，结合量化的经济指标综合判断经济周期的运行方向，决定类属资产的投资比例。分析的内容包括：影响经济中长期运行的变量，如经济增长模式、中长期经济增长动力；影响宏观经济的周期性变量，如宏观政策、货币供应、CPI 等；市场自身的指标，如可转债的转股溢价率和隐含波动率等、股票的估值指标、债券市场的信用利差、期限利差、远期利率等。 |                  |
| 业绩比较基准          | 中证综合债指数收益率。                                                                                                                                                                               |                  |
| 风险收益特征          | 本基金为债券型基金，债券型基金的风险高于货币市场基金，低于混合型 and 股票型基金，属于中低收益/风险的品种。                                                                                                                                  |                  |
| 基金管理人           | 博时基金管理有限公司                                                                                                                                                                                |                  |
| 基金托管人           | 中国光大银行股份有限公司                                                                                                                                                                              |                  |
| 下属分级基金的基金简称     | 博时转债增强债券 A                                                                                                                                                                                | 博时转债增强债券 C       |
| 下属分级基金的交易代码     | 050019                                                                                                                                                                                    | 050119           |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 112,250,485.17 份                                                                                                                                                                          | 210,765,767.55 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<br>(2019 年 1 月 1 日-2019 年 3 月 31 日) |                |
|----------------|-----------------------------------------|----------------|
|                | 博时转债增强债券 A                              | 博时转债增强债券 C     |
| 1.本期已实现收益      | 6,777,643.00                            | 13,306,537.63  |
| 2.本期利润         | 17,161,520.60                           | 32,148,533.87  |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.2123                                  | 0.2069         |
| 4.期末基金资产净值     | 155,393,439.63                          | 286,126,305.47 |
| 5.期末基金份额净值     | 1.384                                   | 1.358          |

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。

上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后投资人的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. 博时转债增强债券A:

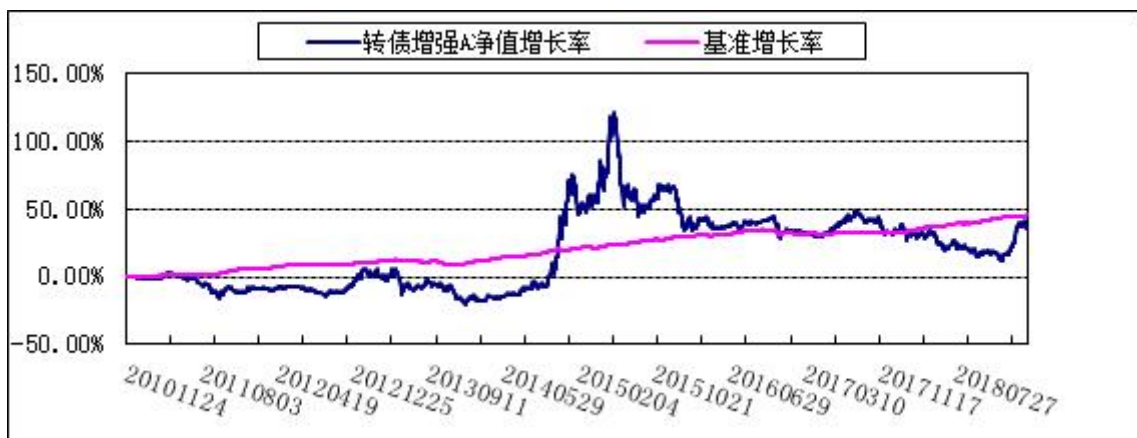
| 阶段        | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基准<br>收益率标准差<br>④ | ①—③    | ②—④   |
|-----------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三<br>个月 | 22.37%     | 1.22%         | 1.35%          | 0.05%                 | 21.02% | 1.17% |

##### 2. 博时转债增强债券C:

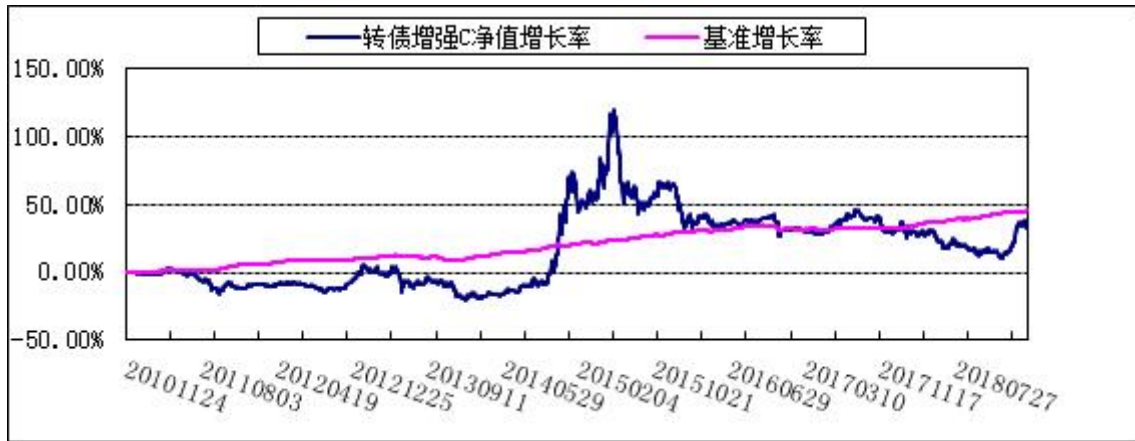
| 阶段        | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基准<br>收益率标准差<br>④ | ①—③    | ②—④   |
|-----------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三<br>个月 | 22.34%     | 1.23%         | 1.35%          | 0.05%                 | 20.99% | 1.18% |

#### 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

##### 1. 博时转债增强债券A:



##### 2. 博时转债增强债券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 | 基金经理 | 2013-09-25  | 2019-01-28 | 10.8   | <p>邓欣雨先生，硕士。</p> <p>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</p> |

|    |                              |            |   |      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
|----|------------------------------|------------|---|------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |                              |            |   |      | 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)的基金经理。现任博时稳健回报债券型证券投资基金 (LOF) (2018 年 4 月 23 日—至今)的基金经理。 |
| 过钧 | 公司董事总经理/固定收益总部指数与创新组负责人/基金经理 | 2019-01-28 | - | 17.8 | 过钧先生，硕士。<br>1995 年起先后在上海工艺品进出口公司、德国德累斯顿银行上海分行、美国 Lowes 食品有限公司、美国通用电气公司、华夏基金固定收益部工作。<br>2005 年加入博时基金管理有限公司。历任博时稳定价值债券投资基金                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
|--|--|--|--|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | <p>(2005 年 8 月 24 日-2010 年 8 月 4 日)基金经理、固定收益部副总经理、博时转债增强债券型证券投资基金(2010 年 11 月 24 日-2013 年 9 月 25 日)、博时亚洲票息收益债券型证券投资基金(2013 年 2 月 1 日-2014 年 4 月 2 日)、博时裕祥分级债券型证券投资基金(2014 年 1 月 8 日-2014 年 6 月 10 日)、博时双债增强债券型证券投资基金(2013 年 9 月 13 日-2015 年 7 月 16 日)、博时新财富混合型证券投资基金(2015 年 6 月 24 日-2016 年 7 月 4 日)、博时新机遇混合型证券投资基金(2016 年 3 月 29 日-2018 年 2 月 6 日)、博时新策略灵活配置混合型证券投资基金(2016 年 8 月 1 日-2018 年 2 月 6 日)、博时稳健回报债券型证券投资基金 (LOF) (2014 年 6 月 10 日-2018 年 4 月 23 日)、博时双债增强债券型证券投资基金(2016 年 10 月 24 日-2018 年 5 月 5 日)、博时鑫润灵活配置混合型证券投资基金(2017 年 2 月 10 日-2018 年 5 月 21 日)、博时鑫和灵活配置混合型证券投资基金(2017 年 12 月 13 日-2018 年 6 月 16 日)、博时鑫惠灵活配置混合型证券投资基金(2017 年 1 月 10 日-2018 年 7 月 30 日)的基金经理、固定收益总部公募基金组负责人。现任公司董事总经理兼固定收益总部指数与创新组负责人、博时信用债券投资基金(2009 年 6 月 10 日—至今)、博时新收益灵活配置混合型证券投资基金(2016 年 2 月 29 日—至今)、博时新价值灵活配置混</p> |
|--|--|--|--|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
|--|--|--|--|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | 合型证券投资基金<br>(2016 年 3 月 29 日—至今)<br>、博时鑫源灵活配置混合<br>型证券投资基金(2016 年<br>9 月 6 日—至今)、博时乐<br>臻定期开放混合型证券投<br>资基金(2016 年 9 月 29 日<br>—至今)、博时新起点灵<br>活配置混合型证券投资基金<br>(2016 年 10 月 17 日—<br>至今)、博时鑫瑞灵活配<br>置混合型证券投资基金<br>(2017 年 2 月 10 日—至今)<br>、博时中债 3-5 年进出口<br>行债券指数证券投资基金<br>(2018 年 12 月 25 日—至<br>今)、博时转债增强债券<br>型证券投资基金(2019 年<br>1 月 28 日—至今)的基金<br>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，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

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

## 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

一季度货币环境延续宽松局面，央行实施了全面降准，回购利率维持低位，短期债券收益率中枢有一定下行，如本季度 1 年期利率债收益率下行 15-20bp，1 年 AA+中短期票据下行 40-50bp。短期通胀还不构成风险，经济增长仍处于本轮寻底过程中，基本面对债市还未形成明显利空，但长债收益率经过本轮债券牛市下行后，绝对水平已处于可比较低水平，下行空间显著降低，预期债市已进入牛尾阶段，赚取资本利得难度显著上升。去年底政策层面强调逆周期调控，继续推进宽信用，

社融增速有所回升，这对债市形成一定的边际利空预期。整体来看 1 季度长端利率下行较为纠结，如 10 年国开债收益率仅震荡下行 6bp，相应的 10 年-1 年利差上升 14bp。一季度股票市场出现显著反转，上涨幅度和速度应均有超预期表现，如 1 季度上证综指上涨 23.9%，创业板指数上涨 35.4%。考虑到去年底可转债市场整体价格已处于历史底部区域，估值显著偏低，与纯债市场相比性价比优势凸显，只等股市悲观预期的修复。在股市出现反转后，市场风险偏好得以修复和上升，可转债受正股和估值双重推动，表现出色，如一季度中证转债指数上涨 17.5%。我们一直认为今年纯债收益率预期不高，超额收益来自风险资产的暴露，可转债值得战略性看多。本季度组合加大权益和转债类资产的风险暴露，积极交易可转债类资产，取得了不错的效果。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2019 年 03 月 31 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.384 元，份额累计净值为 1.389 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.358 元，份额累计净值为 1.362 元。报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 22.37%，本基金 C 类基金份额净值增长率为 22.34%，同期业绩基准增长率 1.35%。

#### 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                  | 86,426,683.92  | 16.08        |
|    | 其中：股票                 | 86,426,683.92  | 16.08        |
| 2  | 基金投资                  | -              | -            |
| 3  | 固定收益投资                | 414,402,277.11 | 77.12        |
|    | 其中：债券                 | 414,402,277.11 | 77.12        |
|    | 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<br>买入返售金融资产 | -              | -            |
| 7  | 银行存款和结算备付<br>金合计      | 7,366,270.97   | 1.37         |
| 8  | 其他各项资产                | 29,174,193.87  | 5.43         |
| 9  | 合计                    | 537,369,425.87 | 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              | 48,271,556.00 | 10.93 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -             | -     |
| E | 建筑业              | -             | -     |
| F | 批发和零售业           | -             | -     |
| G | 交通运输、仓储和邮政业      | 4,778,620.00  | 1.08  |
| H | 住宿和餐饮业           | -             | -     |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 127,296.00    | 0.03  |
| J | 金融业              | 33,249,211.92 | 7.53  |
| 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               | 86,426,683.92 | 19.57 |

### 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

| 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  | 600438 | 通威股份 | 1,135,200 | 13,804,032.00 | 3.13         |
| 2  | 601336 | 新华保险 | 199,700   | 10,721,893.00 | 2.43         |
| 3  | 300463 | 迈克生物 | 355,700   | 7,185,140.00  | 1.63         |
| 4  | 601318 | 中国平安 | 91,700    | 7,070,070.00  | 1.60         |
| 5  | 603806 | 福斯特  | 210,900   | 6,959,700.00  | 1.58         |
| 6  | 000001 | 平安银行 | 528,300   | 6,772,806.00  | 1.53         |
| 7  | 000030 | 富奥股份 | 930,700   | 4,821,026.00  | 1.09         |
| 8  | 601021 | 春秋航空 | 117,700   | 4,778,620.00  | 1.08         |
| 9  | 002293 | 罗莱生活 | 359,000   | 4,487,500.00  | 1.02         |
| 10 | 600104 | 上汽集团 | 171,800   | 4,478,826.00  | 1.01         |

### 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 | 12,124,000.00 | 2.75         |
| 2  | 央行票据 | -             | -            |
| 3  | 金融债券 | 22,824,282.20 | 5.17         |

|    |           |                |       |
|----|-----------|----------------|-------|
|    | 其中：政策性金融债 | 22,824,282.20  | 5.17  |
| 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） | 379,453,994.91 | 85.94 |
| 8  | 同业存单      | -              | -     |
| 9  | 其他        | -              | -     |
| 10 | 合计        | 414,402,277.11 | 93.86 |

### 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  | 127005 | 长证转债    | 359,240 | 41,309,007.60 | 9.36         |
| 2  | 128024 | 宁行转债    | 218,172 | 26,798,066.76 | 6.07         |
| 3  | 113515 | 高能转债    | 217,130 | 24,635,569.80 | 5.58         |
| 4  | 018005 | 国开 1701 | 228,220 | 22,824,282.20 | 5.17         |
| 5  | 113013 | 国君转债    | 140,520 | 16,638,973.20 | 3.77         |

### 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仓股指期货。

### 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仓国债期货。

## 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的发行主体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。

**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   | 52,155.46     |
| 2  | 应收证券清算款 | 24,780,277.49 |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 1,421,964.49  |
| 5  | 应收申购款   | 2,919,796.43  |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 29,174,193.87 |

### 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  | 127005 | 长证转债     | 41,309,007.60 | 9.36         |
| 2  | 128024 | 宁行转债     | 26,798,066.76 | 6.07         |
| 3  | 113515 | 高能转债     | 24,635,569.80 | 5.58         |
| 4  | 113013 | 国君转债     | 16,638,973.20 | 3.77         |
| 5  | 132013 | 17 宝武 EB | 14,269,386.00 | 3.23         |
| 6  | 132009 | 17 中油 EB | 14,220,145.00 | 3.22         |
| 7  | 123009 | 星源转债     | 14,196,904.80 | 3.22         |
| 8  | 128015 | 久其转债     | 13,191,048.59 | 2.99         |
| 9  | 110034 | 九州转债     | 12,944,536.60 | 2.93         |
| 10 | 113008 | 电气转债     | 12,146,189.40 | 2.75         |
| 11 | 128029 | 太阳转债     | 10,998,242.50 | 2.49         |
| 12 | 128028 | 赣锋转债     | 9,699,353.05  | 2.20         |
| 13 | 113015 | 隆基转债     | 9,619,579.20  | 2.18         |
| 14 | 110040 | 生益转债     | 8,928,646.20  | 2.02         |
| 15 | 113512 | 景旺转债     | 7,738,574.70  | 1.75         |
| 16 | 128027 | 崇达转债     | 6,431,304.88  | 1.46         |
| 17 | 128034 | 江银转债     | 6,388,380.96  | 1.45         |
| 18 | 110043 | 无锡转债     | 6,276,168.00  | 1.42         |
| 19 | 128010 | 顺昌转债     | 5,746,215.43  | 1.30         |
| 20 | 113018 | 常熟转债     | 5,596,508.20  | 1.27         |
| 21 | 128045 | 机电转债     | 4,964,517.60  | 1.12         |
| 22 | 123006 | 东财转债     | 4,407,616.89  | 1.00         |
| 23 | 132005 | 15 国资 EB | 2,768,353.00  | 0.63         |
| 24 | 113508 | 新风转债     | 2,052,627.50  | 0.46         |
| 25 | 123010 | 博世转债     | 1,027,109.98  | 0.23         |
| 26 | 110041 | 蒙电转债     | 767,428.00    | 0.17         |
| 27 | 128035 | 大族转债     | 11,214.90     | 0.00         |
| 28 | 110044 | 广电转债     | 6,438.80      | 0.00         |

### 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           | 博时转债增强债券 A     | 博时转债增强债券 C     |
|--------------|----------------|----------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 61,600,614.81  | 109,327,956.71 |
| 报告期基金总申购份额   | 87,562,516.62  | 164,279,725.60 |
| 减：报告期基金总赎回份额 | 36,912,646.26  | 62,841,914.76  |
| 报告期基金拆分变动份额  | -              | -              |
| 本报告期期末基金份额总额 | 112,250,485.17 | 210,765,767.55 |

## §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 2019 年 3 月 31 日，博时基金公司共管理 183 只开放式基金，并受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金，以及多个企业年金账户，管理资产总规模逾 9462 亿元人民币，剔除货币基金与短期理财债券基金后，博时基金公司募资产管理总规模逾 2681 亿元人民币，累计分红逾 946 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。

#### 1、基金业绩

根据银河证券基金研究中心统计，截至 2019 年 1 季末：

博时旗下权益类基金业绩表现突出，50 只产品（各类份额分开计算，不含 QDII，下同）今年以来净值增长率银河同类排名在前 1/2，27 只银河同类排名在前 1/4，11 只银河同类排名在前 1/10。其中，博时回报灵活配置混合、博时乐臻定期开放混合今年以来净值增长率分别在 147 只、64 只同类产品中排名第 1，博时弘泰定期开放混合、博时文体娱乐主题混合今年以来净值增长率分别在 64 只、32 只同类产品中排名第 2，博时量化平衡混合今年以来净值增长率在 107 只同类产品中排名第 3，博时特许价值混合(A 类)、博时裕益灵活配置混合、博时新兴成长混合、博时睿利事件驱动灵活配置混合(LOF)、博时颐泰混合(C 类)今年以来净值增长率排名在银河同类前 1/10，博时睿远事件驱动灵活配置混合(LOF)、博时颐泰混合(A 类)、博时厚泽回报灵活配置混合(A/C 类)、博时新起点灵活配置混合(A/C 类)、博时新兴消费主题混合、博时互联网主题灵活配置混合、博时鑫源灵活配置混合(C 类)、博时裕隆灵活配置混合、博时鑫泽灵活配置混合(C 类)、博时医疗保健行业混合、博时弘盈定期开放混合(A/C 类)、博时战略新兴产业混合等基金今年以来净值增长率排名在银河同类前 1/4。

博时固定收益类基金业绩持续亮眼，有 65 只产品（各类份额分开计算，不含 QDII，下同）今年以来净值增长率银河同类排名前 1/2，32 只银河同类排名在前 1/4，14 只银河同类排名在前 1/10。债券型基金中，博时转债增强债券(C 类)今年以来净值增长率在同类产品中排名第 1，博时安弘一年定期开放债券(A 类)今年以来净值增长率在 245 只同类产品中排名第 3，博时富兴纯债 3 个月定期开放债券发起式、博时安康 18 个月定期开放债券(LOF)、博时岁岁增利一年定期开放债券今年以来净值增长率分别在 245 只同类产品中排名第 8、第 12、第 21，博时安弘一年定期开放债券(C 类)在 65 只同类产品中排名第 4，博时富瑞纯债债券今年以来净值增长率分别在 356 只同类产品中排名第 18，博时信用债券(A/B 类)同类排名在前 1/10，博时转债增强债券(A 类)、博时信用债券(C 类)、博时双月薪定期支付债券、博时月月薪定期支付债券、博时稳健回报债券(LOF)(A/C 类)、博时安盈债券(A/C 类)、博时信用债纯债债券(A 类)、博时安盈债券(A 类)等基金今年以来净值增长率在同类产品中排名前 1/4。货币型基金中，博时合惠货币(A/B 类)今年以来净值增长率在同类产品中排名前 1/10，博时现金宝货币(B 类)今年以来净值增长率在同类产品中排名前 1/8，博时现金宝货币(A 类)今年以来净值增长率在同类产品中排名前 1/6。

商品型基金当中，博时黄金 ETF 联接 A 类今年以来净值增长率同类排名第 1，博时黄金 ETF 联接(C 类)今年以来净值增长率同类排名第 2。

QDII 基金方面，博时亚洲票息收益债券(美元)今年以来净值增长率在 29 只同类产品中排名第 4，博时亚洲票息收益债券今年以来净值增长率在 22 只同类产品中排名第 5。

## 2、其他大事件

2019 年 3 月 21 日，由证券时报主办的第六届中国机构投资者峰会暨财富管理国际论坛在北京隆重举行，同时第十四届中国基金业明星基金奖和中国公募基金首届英华奖也随之揭晓。博时基金凭借出色的资产管理能力和优秀的业绩表现，一举摘得“2018 年度十大明星基金公司”称号。在英华奖的评选中，博时基金在获评“2018 年度最佳电商业务发展基金公司”奖的同时，还凭借博时基金 20 周年品牌传播项目拿下了“2018 年度最佳营销策划案例(最佳综合)”奖。此外，博时

慈善基金会公益助学项目获得了“2018 年度最佳社会公益实践案例”。在产品奖方面，助力央企结构转型和改革的博时央企结构调整 ETF 获评英华奖“2018 年度最佳创新基金产品”；博时裕瑞纯债债券获得“2018 年度普通债券型明星基金”奖；博时宏观回报债券则凭借同类可比基金第一的佳绩喜获“2018 年度积极债券型明星基金”奖；博时亚洲票息收益债券(QDII)、博时双月薪定期支付债券双双以过去五年稳居同类前列的好成绩分别拿下“五年持续回报 QDII 明星基金”、“五年持续回报普通债券型明星基金”称号；博时裕恒纯债债券则摘得“三年期持续回报普通债券型明星基金”。

2019 年 2 月 25 日，博时国际在“投资洞见与委托”（Insights&Mandate）举办的第二届专业投资奖评选活动中荣获“2019 年度最佳机构法人投资经理”，并凭借博时国际于 2018 年 5 月 10 日共同成立的“博时—东方红大中华债券基金”获“最佳创新产品”大奖。

2019 年 1 月 23 日，由深圳市福田区金融发展事务署首届举办的“香蜜湖金融科技创新奖”颁奖典礼在深圳福田隆重举行，《博时基金基于大数据技术升级量化投资技术》项目荣获优秀项目奖，博时基金采用金融科技为业务赋能的创新发展成果获得行业和地方政府高度认可。

2019 年 1 月 11 日，中央国债登记结算有限责任公司（以下简称“中债登”）公布了《2018 年度中债优秀成员评选结果》。凭借在债券市场上的深厚积淀和优异的投研业绩，博时基金获评年度“优秀资产管理人”称号，全行业获此殊荣的基金公司仅有 10 家。

---

## §9 备查文件目录

---

### 9.1 备查文件目录

- 9.1.1 中国证监会批准博时转债增强债券型证券投资基金设立的文件
- 9.1.2 《博时转债增强债券型证券投资基金基金合同》
- 9.1.3 《博时转债增强债券型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 报告期内博时转债增强债券型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿
- 9.1.6 博时转债增强债券型证券投资基金各年度审计报告正本

### 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阅，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  
二〇一九年四月二十二日