

博时转债增强债券型证券投资基金
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：中国光大银行股份有限公司

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。

基金托管人中国光大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 | 1,767,335,894.94 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 | <p>本基金主要投资策略包括：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1.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。 2.固定收益类资产投资策略除可转债外，本基金可投资的债券范围包括国债、金融债、央票、企业债、公司债、资产证券化产品和短期融资券等其他债券资产。在该部分投资管理上，本基金灵活应用各种期限结构策略、信用策略、互换策略、息差策略和资产支持证券策略等，在合理管理并控制组合风险的前提下，为组合增加最大的收益。 3.可转债投资策略在分析宏观经济运行特征并对各类市场大势做出判断的前提下，本基金着重对可转债所对应的基础股票进行分析和研究，从行业选择 |

| | | |
|-----------------|--|------------------|
| | 和个券选择两方面进行全方位的评估，对盈利能力或成长性较好的行业和上市公司的可转债进行重点关注，并结合博时可转债评级系统对可转债投资价值进行有效的评估，选择投资价值较高的个券进行投资。 4.权益类品种投资策略本产品在大类资产配置下，通过对股票基本面的分析来精选个股。分析主要包括股票的价值和成长性指标。价值投资的核心思想是寻找市场上被低估的股票，具体指标包括：市盈率、市净率、市销率、股息收益率等。成长股的重要评估指标是考察公司的成长性，具体指标包括：预期净利润增长率、中长期净利润增长率、内部成长率及历史增长率等。 | |
| 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，低于混合型和股票型基金，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 | 1,332,148,221.16 份 | 435,187,673.78 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 (2022 年 1 月 1 日-2022 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 | -25,949,575.11 | -14,498,774.73 |
| 2.本期利润 | -516,138,539.62 | -123,694,751.67 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.3292 | -0.3198 |
| 4.期末基金资产净值 | 2,651,902,126.15 | 839,585,253.02 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.991 | 1.929 |

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. 博时转债增强债券A:

| 阶段 | 净值增长率 | 净值增长率 | 业绩比较基 | 业绩比较基 | ①-③ | ②-④ |
|----|-------|-------|-------|-------|-----|-----|
|----|-------|-------|-------|-------|-----|-----|

| | ① | 标准差② | 准收益率③ | 准收益率标准差④ | | |
|------------|---------|-------|--------|----------|---------|-------|
| 过去三个月 | -14.62% | 1.18% | 0.76% | 0.06% | -15.38% | 1.12% |
| 过去六个月 | -6.96% | 1.02% | 2.03% | 0.05% | -8.99% | 0.97% |
| 过去一年 | 11.67% | 1.03% | 5.03% | 0.05% | 6.64% | 0.98% |
| 过去三年 | 43.86% | 1.16% | 12.75% | 0.06% | 31.11% | 1.10% |
| 过去五年 | 51.18% | 1.03% | 24.07% | 0.06% | 27.11% | 0.97% |
| 自基金合同生效起至今 | 99.72% | 1.19% | 63.95% | 0.07% | 35.77% | 1.12% |

2. 博时转债增强债券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 | -14.76% | 1.19% | 0.76% | 0.06% | -15.52% | 1.13% |
| 过去六个月 | -7.17% | 1.03% | 2.03% | 0.05% | -9.20% | 0.98% |
| 过去一年 | 11.18% | 1.03% | 5.03% | 0.05% | 6.15% | 0.98% |
| 过去三年 | 42.05% | 1.16% | 12.75% | 0.06% | 29.30% | 1.10% |
| 过去五年 | 48.27% | 1.03% | 24.07% | 0.06% | 24.20% | 0.97% |
| 自基金合同生效起至今 | 93.38% | 1.19% | 63.95% | 0.07% | 29.43% | 1.12% |

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 | 混合资产投资部投资总监助理/基金经理 | 2019-04-25 | - | 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遵规守信情况的说明

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，中证转债指数阶段性最大回撤达到 10%。本组合在可转债上的配置较为均衡，股票仓位中等偏上。

展望未来，外部方面短期内美联储加息落地，但通胀压力在，市场对后续短期高强度收紧有一定反应，如 2 年和 10 年美债收益率都已在 2.6% 附近，短期内长债收益率压力可能较充分释放，后续看 5 月份美联储缩表情况和通胀压力。另外，俄乌战争对市场的负面影响有缓解迹象，当然这块较难做预判分析。国内方面，3 月 16 日金融委会议后，市场对股市“政策底”讨论很多，个人认同主流观点——“政策底”已现，接下来需要关注国内稳增长的进展。从历史对比来看，市场出现反转需要伴随企业盈利预期好转，即基本面层面，或者流动性出现超宽松局面，如 2014 年那次。从目前状况分析来看，短期经济基本面压力仍不小，3 月份国内疫情形成额外压力，如 3 月份的制造业 PMI 就回落到临界点以内，细分项更显示制造业供应链受

到明显影响，与疫情冲击相匹配。考虑到海外的收紧，上游资源品价格高企，如 1-2 月份工业企业利润显示采掘等上游板块盈利非常好，而中下游均承受不小压力，预期接下来稳增长发力重点在实体信用扩张方面，而宽货币局面维持。因此，股市能否从底部走出反转，企业盈利预期变化是重要观察点之一。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。投资上应以稳求进，方向上可考虑业绩确定性强和估值安全性高一些的领域，如跟通胀相关的上游资源品、农业，有业绩且估值安全性高的银行，以及国有性质的房地产企业；另一方面成长板块已调整较大，适当考虑配置行业景气度还不错的领域，作为弹性高的“卫星”交易品种。考虑到可转债估值仍然偏高，在股市未走出上行趋势性行情前，也更应重视结构性交易机会。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 03 月 31 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.991 元，份额累计净值为 1.996 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.929 元，份额累计净值为 1.933 元，报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为-14.62%，本基金 C 类基金份额净值增长率为-14.76%，同期业绩基准增长率为 0.76%。

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 | 565,595,354.21 | 15.60 |
| | 其中：股票 | 565,595,354.21 | 15.60 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 2,908,880,271.37 | 80.24 |
| | 其中：债券 | 2,908,880,271.37 | 80.24 |
| | 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 | 15,000,000.00 | 0.41 |
| | 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 | 87,660,165.98 | 2.42 |
| 8 | 其他各项资产 | 48,174,190.69 | 1.33 |

| | | | |
|---|----|------------------|--------|
| 9 | 合计 | 3,625,309,982.25 | 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 | 87,796,296.00 | 2.51 |
| C | 制造业 | 342,109,659.14 | 9.80 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 33,968,580.91 | 0.97 |
| E | 建筑业 | 19,734,984.00 | 0.57 |
| 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 | 38,638,620.00 | 1.11 |
| J | 金融业 | 20,812,350.16 | 0.60 |
| K | 房地产业 | 22,534,864.00 | 0.65 |
| 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 | 565,595,354.21 | 16.20 |

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 | 002271 | 东方雨虹 | 1,283,708 | 57,689,837.52 | 1.65 |
| 2 | 601012 | 隆基股份 | 572,960 | 41,361,982.40 | 1.18 |
| 3 | 002709 | 天赐材料 | 428,804 | 40,307,576.00 | 1.15 |
| 4 | 002929 | 润建股份 | 1,242,000 | 38,638,620.00 | 1.11 |
| 5 | 000983 | 山西焦煤 | 3,002,400 | 37,289,808.00 | 1.07 |
| 6 | 601985 | 中国核电 | 4,188,481 | 33,968,580.91 | 0.97 |
| 7 | 002241 | 歌尔股份 | 958,700 | 32,979,280.00 | 0.94 |
| 8 | 600188 | 兖矿能源 | 800,200 | 30,679,668.00 | 0.88 |
| 9 | 300628 | 亿联网络 | 343,424 | 26,701,216.00 | 0.76 |
| 10 | 002594 | 比亚迪 | 112,818 | 25,925,576.40 | 0.74 |

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 | 193,414,219.53 | 5.54 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | 4,065,949.59 | 0.12 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | 2,711,400,102.25 | 77.66 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 2,908,880,271.37 | 83.31 |

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 | 2,183,130 | 240,126,057.42 | 6.88 |
| 2 | 132018 | G 三峡 EB1 | 1,463,240 | 193,705,515.20 | 5.55 |
| 3 | 019664 | 21 国债 16 | 1,413,330 | 142,736,068.84 | 4.09 |
| 4 | 113050 | 南银转债 | 949,980 | 113,424,879.18 | 3.25 |
| 5 | 127027 | 靖运转债 | 787,681 | 103,971,755.55 | 2.98 |

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仓国债期货。

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。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。杭州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深圳监管局、中国银行保险监督管理委员会浙江监管局的处罚。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 | 450,105.50 |
| 2 | 应收证券清算款 | 34,900,000.00 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 12,824,085.19 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 48,174,190.69 |

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 | 132018 | G 三峡 EB1 | 193,705,515.20 | 5.55 |
| 2 | 113050 | 南银转债 | 113,424,879.18 | 3.25 |
| 3 | 127027 | 靖远转债 | 103,971,755.55 | 2.98 |
| 4 | 128140 | 润建转债 | 103,917,816.61 | 2.98 |
| 5 | 128095 | 恩捷转债 | 94,966,063.88 | 2.72 |
| 6 | 113049 | 长汽转债 | 94,844,185.60 | 2.72 |
| 7 | 110079 | 杭银转债 | 90,127,608.52 | 2.58 |
| 8 | 123107 | 温氏转债 | 90,089,693.08 | 2.58 |
| 9 | 110053 | 苏银转债 | 88,940,820.51 | 2.55 |
| 10 | 127005 | 长证转债 | 82,290,680.86 | 2.36 |
| 11 | 113043 | 财通转债 | 81,969,174.76 | 2.35 |
| 12 | 127038 | 国微转债 | 72,286,441.05 | 2.07 |
| 13 | 118000 | 嘉元转债 | 68,401,261.76 | 1.96 |
| 14 | 128136 | 立讯转债 | 53,944,918.24 | 1.55 |

| | | | | |
|----|--------|----------|---------------|------|
| 15 | 110072 | 广汇转债 | 50,349,080.16 | 1.44 |
| 16 | 118002 | 天合转债 | 49,168,506.04 | 1.41 |
| 17 | 127029 | 中钢转债 | 44,386,028.81 | 1.27 |
| 18 | 123044 | 红相转债 | 43,032,972.27 | 1.23 |
| 19 | 128078 | 太极转债 | 41,197,996.07 | 1.18 |
| 20 | 123090 | 三诺转债 | 40,256,399.89 | 1.15 |
| 21 | 113619 | 世运转债 | 37,603,859.34 | 1.08 |
| 22 | 128109 | 楚江转债 | 36,304,027.08 | 1.04 |
| 23 | 132014 | 18 中化 EB | 33,026,500.10 | 0.95 |
| 24 | 110075 | 南航转债 | 30,771,111.60 | 0.88 |
| 25 | 123067 | 斯莱转债 | 30,652,412.31 | 0.88 |
| 26 | 127018 | 本钢转债 | 30,313,429.90 | 0.87 |
| 27 | 113600 | 新星转债 | 29,145,422.70 | 0.83 |
| 28 | 128023 | 亚太转债 | 28,387,119.66 | 0.81 |
| 29 | 110074 | 精达转债 | 27,878,454.14 | 0.80 |
| 30 | 110062 | 烽火转债 | 27,115,173.28 | 0.78 |
| 31 | 123060 | 苏试转债 | 25,069,582.82 | 0.72 |
| 32 | 132021 | 19 中电 EB | 24,969,346.03 | 0.72 |
| 33 | 113024 | 核建转债 | 23,827,769.34 | 0.68 |
| 34 | 128128 | 齐翔转 2 | 23,810,788.67 | 0.68 |
| 35 | 113582 | 火炬转债 | 23,620,348.74 | 0.68 |
| 36 | 128119 | 龙大转债 | 23,369,089.12 | 0.67 |
| 37 | 118001 | 金博转债 | 23,172,155.76 | 0.66 |
| 38 | 128141 | 旺能转债 | 23,033,633.47 | 0.66 |
| 39 | 123104 | 卫宁转债 | 22,557,055.70 | 0.65 |
| 40 | 110067 | 华安转债 | 21,434,097.66 | 0.61 |
| 41 | 113563 | 柳药转债 | 18,712,268.42 | 0.54 |
| 42 | 123077 | 汉得转债 | 17,500,740.23 | 0.50 |
| 43 | 127019 | 国城转债 | 14,842,823.39 | 0.43 |
| 44 | 123121 | 帝尔转债 | 14,537,672.75 | 0.42 |
| 45 | 110043 | 无锡转债 | 13,983,751.92 | 0.40 |
| 46 | 128114 | 正邦转债 | 13,828,923.13 | 0.40 |
| 47 | 123124 | 晶瑞转 2 | 13,681,177.86 | 0.39 |
| 48 | 123113 | 仙乐转债 | 13,491,478.96 | 0.39 |
| 49 | 123109 | 昌红转债 | 13,325,774.49 | 0.38 |
| 50 | 127024 | 盈峰转债 | 13,199,419.14 | 0.38 |
| 51 | 127043 | 川恒转债 | 12,291,397.24 | 0.35 |
| 52 | 113622 | 杭叉转债 | 10,294,301.12 | 0.29 |
| 53 | 128143 | 锋龙转债 | 9,699,579.68 | 0.28 |
| 54 | 128123 | 国光转债 | 7,681,503.72 | 0.22 |
| 55 | 113615 | 金诚转债 | 4,219,823.93 | 0.12 |
| 56 | 120002 | 18 中原 EB | 2,399,932.60 | 0.07 |
| 57 | 113044 | 大秦转债 | 2,278,775.43 | 0.07 |

| | | | | |
|----|--------|----------|--------------|------|
| 58 | 127045 | 牧原转债 | 1,625,066.27 | 0.05 |
| 59 | 113609 | 永安转债 | 1,582,287.52 | 0.05 |
| 60 | 132022 | 20 广版 EB | 369,499.02 | 0.01 |
| 61 | 132020 | 19 蓝星 EB | 276,792.26 | 0.01 |
| 62 | 110060 | 天路转债 | 199,761.72 | 0.01 |
| 63 | 110057 | 现代转债 | 186,920.10 | 0.01 |
| 64 | 113030 | 东风转债 | 35,590.19 | 0.00 |
| 65 | 128083 | 新北转债 | 1,318.21 | 0.00 |
| 66 | 127025 | 冀东转债 | 1,132.69 | 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 | 1,534,924,449.20 | 247,745,024.34 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 741,005,350.77 | 265,340,509.43 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 943,781,578.81 | 77,897,859.99 |
| 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 | 1,332,148,221.16 | 435,187,673.78 |

§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 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 博时转债增强债券型证券投资基金各年度审计报告正本
- 9.1.6 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

9.2 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）

二〇二二年四月二十二日