

博时稳健回报债券型证券投资基金（LOF）  
2024 年第 3 季度报告  
2024 年 9 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：二〇二四年十月二十五日

## §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 10 月 23 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 2024 年 7 月 1 日起至 9 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 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  | 1,389,885,613.80 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 | 486,750,512.88 份 | 903,135,100.92 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>(2024年7月1日-2024年9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      | -2,830,680.58                 | -6,033,011.72    |
| 2.本期利润         | 543,051.00                    | -248,132.45      |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0010                        | -0.0002          |
| 4.期末基金资产净值     | 973,304,162.32                | 1,555,432,438.84 |
| 5.期末基金份额净值     | 1.9996                        | 1.7223           |

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<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<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③    | ②—④   |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月          | 0.30%      | 0.19%         | 1.24%          | 0.12%                 | -0.94% | 0.07% |
| 过去六个月          | 1.64%      | 0.16%         | 3.19%          | 0.11%                 | -1.55% | 0.05% |
| 过去一年           | 2.24%      | 0.15%         | 7.13%          | 0.09%                 | -4.89% | 0.06% |
| 过去三年           | 7.68%      | 0.11%         | 16.57%         | 0.07%                 | -8.89% | 0.04% |
| 过去五年           | 33.40%     | 0.20%         | 26.83%         | 0.07%                 | 6.57%  | 0.13% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 89.06%     | 0.32%         | 66.39%         | 0.08%                 | 22.67% | 0.24% |

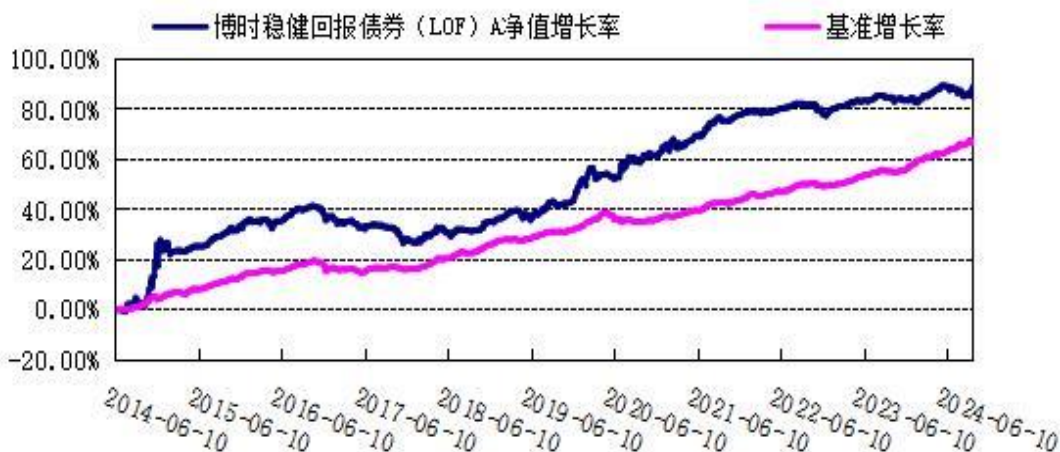
###### 2. 博时稳健回报债券（LOF）C：

| 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<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③    | ②—④   |
|-------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 0.21%      | 0.19%         | 1.24%          | 0.12%                 | -1.03% | 0.07% |
| 过去六个月 | 1.46%      | 0.16%         | 3.19%          | 0.11%                 | -1.73% | 0.05% |

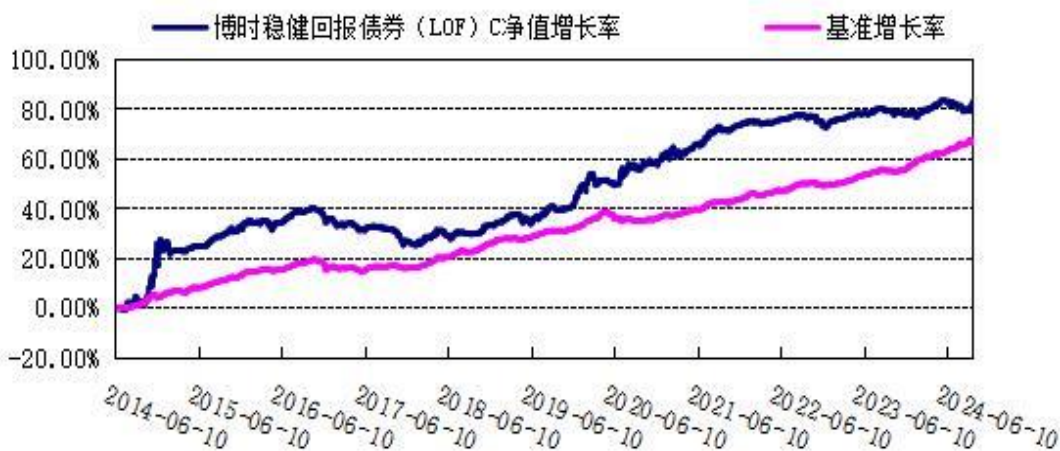
|            |        |       |        |       |        |       |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 过去一年       | 1.89%  | 0.15% | 7.13%  | 0.09% | -5.24% | 0.06% |
| 过去三年       | 6.58%  | 0.11% | 16.57% | 0.07% | -9.99% | 0.04% |
| 过去五年       | 31.17% | 0.21% | 26.83% | 0.07% | 4.34%  | 0.14% |
| 自基金合同生效起至今 | 82.96% | 0.32% | 66.39% | 0.08% | 16.57% | 0.24% |

### 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  | -    | 12.2   | 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)、博时恒鑫稳健一年持有期混合型证券投资基金(2024年2月2日—至今)、博时天颐债券型证券投资基金(2024年2月2日—至今)、博时恒进6个月持有期混合型证券投资基金(2024年2月2日—至今)、博时宏观回报债券型证券投资基金(2024年2月2日—至今)、博时稳合一年持有期混合型证券投资基金(2024年4月17日—至今)的基金经理。 |
| 高晖 | 基金经理 | 2023-10-20 | - | 13.4 | 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。   |

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 38 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

三季度，债券市场整体呈现较大波动格局。7 月债券市场总体表现较为强势，8 月则由于央行和交易商协会对于部分市场主体实施监管，使得收益率下行的势头放缓，且整体流动性衰减。9 月中上旬由于对下调存量房贷利率的预期，以及对降息降准的期待推动了长短端收益率的持续下行，10 年期国债一度触及 2.0% 的关口。但从 9 月 24 日开始，以央行为首的相关部门出台了一系列稳增长的政策，推动了市场整体预期的大幅扭转，长端收益率在短短三个交易日的时间内调整达到 20bp，直至 9 月 30 日收益率调整势头才有所放缓。组合方面主要是对流动性较弱的资产进行积极的置换，提高组合整体的流动性水平，同时适度拉长组合的整体久期水平，在市场出现大幅调整的过程当中把握机会寻找收益率较高的优质资产进行配置。

展望未来，债券市场收益率的波动预料会持续放大，且会面临一定的逆风局面，但中长期维度而言债券类资产仍有价值。对于组合而言，在保持一定久期水平的情况下，把握每次调整带来的系统性配置机会，力争为组合增厚收益，提升持有体验。

转债市场在经历了信用风险发酵和负债端导致的流动性冲击后，整体估值在 8 月中下旬达到历史极值水平，超过 30% 的转债跌破面值，YTM 中枢也触及历史最高水平，半数以上转债 YTM 为正。估值极致压缩行情导致转债市场在此轮权益市场探底阶段防守性一般，但同时也提供了不少错误定价的机会。随着政策转向，权益市场放量大涨，波动率急速放大，平价拉升迅速消化转股溢价率水平，而转债 9 月下旬的涨幅远不足以反应其应有的长期投资价值，各平价段转股溢价率水平远低于历史相似位置水平。一些转债仍处于高 YTM、转股溢价率适中的攻守兼备状态，而转债信用风险伴随转股价值上升迅速下降。总的来说，转债市场目前仍处于估值从低估转向正常化的过程之中。出于左侧布局的考虑，组合保持了相对积极的转债仓位，在 7-8 月份的下跌过程中对持仓结构进行了一定的优化，减持了核心仓中的部分红利类转债和生猪养殖转债，以及卫星仓中部分正股资质一般、转股溢价率过高的高 YTM 转债，逐步加仓正股资质优异的错杀双低个券，适当提升组合的攻击性。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2024年09月30日，本基金A类基金份额净值为1.9996元，份额累计净值为2.0746元，本基金C类基金份额净值为1.7223元，份额累计净值为1.8223元，报告期内，本基金A类基金份额净值增长率为0.30%，本基金C类基金份额净值增长率为0.21%，同期业绩基准增长率为1.24%。

#### 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            | 3,257,710,684.83 | 94.72        |
|    | 其中：债券             | 3,257,710,684.83 | 94.72        |
|    | 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      | 110,094,399.74   | 3.20         |
| 8  | 其他各项资产            | 71,578,763.77    | 2.08         |
| 9  | 合计                | 3,439,383,848.34 | 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      | 434,981,919.37   | 17.20        |
| 2  | 央行票据      | -                | -            |
| 3  | 金融债券      | 346,152,506.95   | 13.69        |
|    | 其中：政策性金融债 | 64,343,895.17    | 2.54         |
| 4  | 企业债券      | 1,139,463,406.06 | 45.06        |
| 5  | 企业短期融资券   | -                | -            |
| 6  | 中期票据      | 634,817,595.50   | 25.10        |
| 7  | 可转债（可交换债） | 702,295,256.95   | 27.77        |
| 8  | 同业存单      | -                | -            |
| 9  | 其他        | -                | -            |
| 10 | 合计        | 3,257,710,684.83 | 128.83       |

#### 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  | 2400002 | 24 特别国债 02 | 700,000 | 72,206,997.28 | 2.86         |
| 2  | 019733  | 24 国债 02   | 620,000 | 62,934,399.45 | 2.49         |
| 3  | 230205  | 23 国开 05   | 500,000 | 53,824,630.14 | 2.13         |
| 4  | 148090  | 22 天投 01   | 500,000 | 51,273,947.95 | 2.03         |
| 5  | 240011  | 24 付息国债 11 | 500,000 | 50,907,866.85 | 2.01         |

#### 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国家金融监督管理总局福建监管局、中国人民银行湖北省分行的处罚。南京银行股份有限公司在报告编制前一年受到国家金融监督管理总局淮安监管分局和宿迁监管分局的处罚。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   | 58,318.79     |
| 2  | 应收证券清算款 | 69,894,023.80 |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | -             |
| 5  | 应收申购款   | 1,626,421.18  |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 71,578,763.77 |

### 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  | 30,804,206.51 | 1.22         |
| 2  | 127084 | 柳工转 2    | 23,591,147.51 | 0.93         |
| 3  | 110079 | 杭银转债     | 22,290,967.36 | 0.88         |
| 4  | 127032 | 苏行转债     | 22,127,270.09 | 0.88         |
| 5  | 110093 | 神马转债     | 21,936,803.90 | 0.87         |
| 6  | 132026 | G 三峡 EB2 | 20,867,534.07 | 0.83         |
| 7  | 127045 | 牧原转债     | 20,178,803.56 | 0.80         |
| 8  | 110077 | 洪城转债     | 18,692,174.40 | 0.74         |

|    |        |         |               |      |
|----|--------|---------|---------------|------|
| 9  | 110068 | 龙净转债    | 17,808,350.48 | 0.70 |
| 10 | 113049 | 长汽转债    | 16,953,934.91 | 0.67 |
| 11 | 110062 | 烽火转债    | 16,768,729.07 | 0.66 |
| 12 | 110067 | 华安转债    | 15,039,419.93 | 0.59 |
| 13 | 127092 | 运机转债    | 14,277,062.01 | 0.56 |
| 14 | 111017 | 蓝天转债    | 12,949,557.92 | 0.51 |
| 15 | 123107 | 温氏转债    | 12,780,960.43 | 0.51 |
| 16 | 127020 | 中金转债    | 11,330,309.21 | 0.45 |
| 17 | 127082 | 亚科转债    | 11,225,646.98 | 0.44 |
| 18 | 127043 | 川恒转债    | 11,161,004.91 | 0.44 |
| 19 | 111000 | 起帆转债    | 11,059,398.33 | 0.44 |
| 20 | 123109 | 昌红转债    | 11,030,159.82 | 0.44 |
| 21 | 113621 | 彤程转债    | 10,679,056.53 | 0.42 |
| 22 | 127031 | 洋丰转债    | 10,642,778.65 | 0.42 |
| 23 | 118018 | 瑞科转债    | 9,650,644.32  | 0.38 |
| 24 | 111010 | 立昂转债    | 8,911,355.44  | 0.35 |
| 25 | 113653 | 永 22 转债 | 8,726,534.90  | 0.35 |
| 26 | 127068 | 顺博转债    | 8,691,944.05  | 0.34 |
| 27 | 123091 | 长海转债    | 8,636,840.36  | 0.34 |
| 28 | 127095 | 广泰转债    | 8,619,314.57  | 0.34 |
| 29 | 123182 | 广联转债    | 8,618,360.88  | 0.34 |
| 30 | 127066 | 科利转债    | 8,546,888.91  | 0.34 |
| 31 | 118028 | 会通转债    | 8,529,155.86  | 0.34 |
| 32 | 123115 | 捷捷转债    | 8,518,683.90  | 0.34 |
| 33 | 111011 | 冠盛转债    | 8,503,846.69  | 0.34 |
| 34 | 118015 | 芯海转债    | 8,485,719.44  | 0.34 |
| 35 | 113039 | 嘉泽转债    | 8,445,040.62  | 0.33 |
| 36 | 123101 | 拓斯转债    | 8,423,331.55  | 0.33 |
| 37 | 110082 | 宏发转债    | 8,230,692.09  | 0.33 |
| 38 | 123064 | 万孚转债    | 8,217,117.02  | 0.32 |
| 39 | 127052 | 西子转债    | 8,190,500.72  | 0.32 |
| 40 | 118013 | 道通转债    | 8,155,244.38  | 0.32 |
| 41 | 127085 | 韵达转债    | 8,137,283.19  | 0.32 |
| 42 | 118000 | 嘉元转债    | 8,072,330.44  | 0.32 |
| 43 | 123142 | 申昊转债    | 7,993,703.43  | 0.32 |
| 44 | 113069 | 博 23 转债 | 7,954,051.39  | 0.31 |
| 45 | 127074 | 麦米转 2   | 7,747,223.08  | 0.31 |
| 46 | 113609 | 永安转债    | 7,547,836.43  | 0.30 |
| 47 | 118039 | 煜邦转债    | 7,057,264.24  | 0.28 |
| 48 | 123120 | 隆华转债    | 6,979,588.09  | 0.28 |
| 49 | 127041 | 弘亚转债    | 6,844,744.59  | 0.27 |
| 50 | 113664 | 大元转债    | 6,722,771.57  | 0.27 |
| 51 | 128133 | 奇正转债    | 6,643,226.91  | 0.26 |

|    |        |         |              |      |
|----|--------|---------|--------------|------|
| 52 | 123227 | 雅创转债    | 6,455,167.77 | 0.26 |
| 53 | 127077 | 华宏转债    | 5,834,184.08 | 0.23 |
| 54 | 118035 | 国力转债    | 5,817,853.49 | 0.23 |
| 55 | 118044 | 赛特转债    | 5,808,724.27 | 0.23 |
| 56 | 113569 | 科达转债    | 5,779,852.48 | 0.23 |
| 57 | 123194 | 百洋转债    | 5,698,573.37 | 0.23 |
| 58 | 127079 | 华亚转债    | 5,501,196.25 | 0.22 |
| 59 | 123104 | 卫宁转债    | 5,440,707.02 | 0.22 |
| 60 | 118005 | 天奈转债    | 5,360,238.29 | 0.21 |
| 61 | 123093 | 金陵转债    | 5,296,409.88 | 0.21 |
| 62 | 113650 | 博 22 转债 | 5,229,562.27 | 0.21 |
| 63 | 127104 | 姚记转债    | 5,162,146.41 | 0.20 |
| 64 | 113624 | 正川转债    | 5,160,767.30 | 0.20 |
| 65 | 123088 | 威唐转债    | 4,580,071.93 | 0.18 |
| 66 | 123117 | 健帆转债    | 4,060,742.40 | 0.16 |
| 67 | 127088 | 赫达转债    | 3,776,874.93 | 0.15 |
| 68 | 113584 | 家悦转债    | 2,746,326.84 | 0.11 |
| 69 | 123228 | 震裕转债    | 2,706,036.77 | 0.11 |
| 70 | 118045 | 盟升转债    | 2,704,374.52 | 0.11 |
| 71 | 123196 | 正元转 02  | 2,641,738.92 | 0.10 |
| 72 | 123177 | 测绘转债    | 2,604,444.97 | 0.10 |

#### 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   | 647,870,536.38 | 1,144,327,514.21 |
| 报告期期间基金总申购份额   | 4,851,086.68   | 16,668,586.68    |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 165,971,110.18 | 257,860,999.97   |
| 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   | 486,750,512.88 | 903,135,100.92   |

## §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 2024 年 9 月 30 日，博时基金公司共管理 380 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 15835 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 6105 亿元人民币，累计分红逾 2044 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

二〇二四年十月二十五日