

**博时转债增强债券型证券投资基金**  
**2021 年第 3 季度报告**  
**2021 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：中国光大银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年十月二十七日

## §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 2021 年 10 月 25 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 7 月 1 日起至 9 月 30 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	1,571,584,946.04 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	本基金主要投资策略包括： <ol style="list-style-type: none"> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> </ol>

	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	1,363,598,386.04 份	207,986,560.00 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7月1日-2021年9月30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	116,319,754.80	21,127,168.94
2.本期利润	185,199,077.71	42,081,080.97
3.加权平均基金份额本期利润	0.1601	0.1820
4.期末基金资产净值	2,917,978,896.57	432,192,093.62
5.期末基金份额净值	2.140	2.078

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 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	9.74%	1.25%	1.70%	0.06%	8.04%	1.19%

过去六个月	20.02%	1.02%	2.95%	0.05%	17.07%	0.97%
过去一年	23.77%	1.18%	5.19%	0.05%	18.58%	1.13%
过去三年	78.63%	1.16%	14.89%	0.06%	63.74%	1.10%
过去五年	53.85%	0.99%	19.74%	0.07%	34.11%	0.92%
自基金合同生效起至今	114.67%	1.20%	60.69%	0.07%	53.98%	1.13%

**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	9.66%	1.24%	1.70%	0.06%	7.96%	1.18%
过去六个月	19.77%	1.02%	2.95%	0.05%	16.82%	0.97%
过去一年	23.25%	1.18%	5.19%	0.05%	18.06%	1.13%
过去三年	76.70%	1.16%	14.89%	0.06%	61.81%	1.10%
过去五年	51.13%	0.99%	19.74%	0.07%	31.39%	0.92%
自基金合同生效起至今	108.32%	1.19%	60.69%	0.07%	47.63%	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	-	13.2	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)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，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 10 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

3 季度纯债市场呈现先上涨后震荡局面，转债市场有不错表现，先持续上涨至 9 月中旬，后续出现较明

显的快速调整。具体来看，7 月份受经济基本面下行和央行通过降准等投放流动性影响，债券收益率出现一波下行，不过后续债市表现一般，虽然基本面比预期偏弱，但 8 月份开始债券收益率下行动力明显不足，8-9 月债券市场呈现窄幅震荡局面，收益率变化不大，市场情绪开始变得偏谨慎起来。究其原因可能主要受两方面影响：1) 合理宽松的货币政策并未带来流动性的进一步宽松，短端利率自 8 月份开始有所上行；2) 信用收缩最快阶段可能已过去，随着经济压力的出现，市场对宽信用预期开始上升。另外，PPI 同比持续创出高点且在 8% 以上，市场对“滞胀”可能开始有所担心，当然看 CPI 或核心 CPI 指标，仍然处于不高水平，而 PPI 的走高与供给有很大关系，并非是需求占主导地位。对通胀可继续观察，但不必提前过度担忧。在纯债市场较难获得较高收益情况下，转债市场成了不少债券类资金关注的对象，转债估值持续被推高至近三年高位，绝对价格也处于偏高位置，转债性价比显著下降，如部分热门赛道中的品种呈现高价高估值的“双高”状态，大幅透支正股上涨空间，而当股市走势并未走出转债市场预期的上涨行情后，偏高估值下的转债市场受到平价下行和估值压缩的双重压力出现快速回调。这也再次说明当市场估值受到资金推动处于高位后，市场性价比已明显不足，此时风险控制就显得更为重要，对高估值市场的贪婪容易使投资者犯错。关于宽信用方面，主要是考虑到经济下行压力显现。而且消费一直不强，地产产业链受到调控后也处于下行态势，从政策层面看稳增长概率上升。但考虑到地产受限后，稳增长可能源自基建，不过预期不应过于激进，从过去情况看，可能更多是托而不举。另外，在宽信用的过程中，一般货币条件也不会变紧。因此，在基本面延续下行和流动性整体合理宽松格局下，我们认为债市的整体风险还并不大，调整幅度很可能相对有限，如果债市继续出现超预期调整，那么会利用债市调整机会加强中短期限以内的信用债配置，以提高组合的静态收益和提升组合杠杆率，长端利率债主要关注波段机会。当然，后续需密切关注美联储的 Taper 行动和美元指数走势等，并据此作出相应的对策调整。在经济增长承压下，流动性将维持宽松状态，后续呈现“宽货币+稳信用”的概率偏大，且 A 股估值并不贵，因此认为 A 股暂无系统性风险，调整后的可转债仍值得重点关注，并继续挖掘结构性机会，沿着低估值内需稳增长和中期成长性确定性强的方向精选个券。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 09 月 30 日，本基金 A 类基金份额净值为 2.140 元，份额累计净值为 2.145 元，本基金 C 类基金份额净值为 2.078 元，份额累计净值为 2.082 元，报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 9.74%，本基金 C 类基金份额净值增长率为 9.66%，同期业绩基准增长率为 1.70%。

#### 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	460,801,620.55	13.46
	其中：股票	460,801,620.55	13.46
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,868,967,387.10	83.78
	其中：债券	2,868,967,387.10	83.78
	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	31,999,892.22	0.93
8	其他各项资产	62,714,629.00	1.83
9	合计	3,424,483,528.87	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	432,572,258.67	12.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	456.00	0.00
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	28,228,905.88	0.84
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	460,801,620.55	13.75
----	----------------	-------

### 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	601012	隆基股份	536,520	44,252,169.60	1.32
2	002709	天赐材料	271,804	41,346,824.48	1.23
3	300628	亿联网络	481,124	39,091,325.00	1.17
4	601636	旗滨集团	2,002,739	34,707,466.87	1.04
5	000739	普洛药业	806,444	30,790,031.92	0.92
6	300724	捷佳伟创	223,500	30,708,900.00	0.92
7	300059	东方财富	821,324	28,228,905.88	0.84
8	002594	比亚迪	112,818	28,149,219.18	0.84
9	002475	立讯精密	654,733	23,380,515.43	0.70
10	300450	先导智能	312,500	21,818,750.00	0.65

### 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	172,422,040.30	5.15
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	3,984,400.00	0.12
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	2,692,560,946.80	80.37
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,868,967,387.10	85.64

### 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	110053	苏银转债	2,014,900	235,259,724.00	7.02
2	128128	齐翔转 2	873,509	188,538,182.56	5.63
3	123111	东财转 3	1,181,489	183,154,424.78	5.47
4	019645	20 国债 15	1,191,500	119,257,235.00	3.56
5	132018	G 三峡 EB1	882,720	115,495,084.80	3.45

### 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** 本报告期内，本基金投资的前十名证券中除苏银转债(110053)、南银转债(113050)、杭银转债(110079)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：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。

主要违规事实：2020 年 12 月 28 日，因存在未按规定履行客户身份识别义务；未按照规定保存客户身份资料和交易记录；未按规定报送大额交易报告或者可疑交易报告；未按规定报送账户开户资料；未按规定开立账户使用；未按规定加强特约商户与受理终端管理；违规占压财政资金等违规行为，中国人民银行南京分行对南京银行股份有限公司处以罚款的公开处罚。

主要违规事实：2021 年 5 月 24 日，因存在 1、房地产项目融资业务不审慎；2、流动资金贷款管理不审慎，资金被挪用于支付土地出让金；3、授信投放不审慎，超额投放；4、理财资金管理不审慎，回流借款人母公司挪用于支付土地出让保证金；5、个人经营贷款管理不审慎，资金挪用于购房；6、个人消费贷款管理不审慎，资金挪用于购房等违规行为，中国银行保险监督管理委员会浙江监管局对杭州银行股份有限公司处以罚款的行政处罚。

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	480,877.97
2	应收证券清算款	41,206,058.08

3	应收股利	-
4	应收利息	8,258,746.74
5	应收申购款	12,768,946.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	62,714,629.00

#### 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	110053	苏银转债	235,259,724.00	7.02
2	128128	齐翔转 2	188,538,182.56	5.63
3	132018	G 三峡 EB1	115,495,084.80	3.45
4	113528	长城转债	99,279,725.60	2.96
5	113026	核能转债	99,212,394.40	2.96
6	113043	财通转债	91,150,153.20	2.72
7	127005	长证转债	83,268,838.32	2.49
8	118000	嘉元转债	75,693,438.60	2.26
9	123086	海兰转债	68,558,485.96	2.05
10	127011	中鼎转 2	61,478,261.00	1.84
11	128109	楚江转债	57,813,057.96	1.73
12	128136	立讯转债	52,257,768.72	1.56
13	128140	润建转债	52,237,528.20	1.56
14	113615	金诚转债	46,234,602.00	1.38
15	110072	广汇转债	45,267,996.00	1.35
16	123044	红相转债	43,566,634.98	1.30
17	127018	本钢转债	42,802,546.24	1.28
18	123090	三诺转债	41,402,928.12	1.24
19	127027	靖远转债	37,049,254.94	1.11
20	110067	华安转债	32,839,417.80	0.98
21	127020	中金转债	29,240,601.60	0.87
22	123067	斯莱转债	27,753,791.80	0.83
23	128119	龙大转债	25,629,731.55	0.77
24	123078	飞凯转债	25,095,830.40	0.75
25	132021	19 中电 EB	25,028,313.40	0.75
26	128121	宏川转债	19,381,738.32	0.58
27	110071	湖盐转债	16,765,944.80	0.50
28	127013	创维转债	15,861,671.51	0.47
29	123022	长信转债	15,669,444.60	0.47
30	113013	国君转债	15,612,337.80	0.47
31	110073	国投转债	15,497,235.00	0.46
32	110062	烽火转债	15,330,134.00	0.46
33	128137	洁美转债	14,520,459.16	0.43
34	110043	无锡转债	14,150,904.00	0.42

35	123075	贝斯转债	13,456,410.66	0.40
36	113593	沪工转债	11,188,177.50	0.33
37	128143	锋龙转债	10,897,655.37	0.33
38	113600	新星转债	10,763,134.20	0.32
39	123074	隆利转债	7,745,731.20	0.23
40	123060	苏试转债	6,433,973.70	0.19
41	123025	精测转债	3,604,365.80	0.11
42	128035	大族转债	3,326,520.00	0.10
43	120002	18 中原 EB	2,247,800.00	0.07
44	113609	永安转债	1,576,410.00	0.05
45	110076	华海转债	1,441,036.00	0.04
46	132022	20 广版 EB	355,037.70	0.01
47	132020	19 蓝星 EB	295,906.00	0.01
48	113599	嘉友转债	262,159.20	0.01
49	110060	天路转债	205,550.10	0.01
50	110057	现代转债	178,229.70	0.01
51	113030	东风转债	36,363.10	0.00
52	113034	滨化转债	11,236.00	0.00
53	128093	百川转债	2,793.90	0.00
54	128083	新北转债	1,255.32	0.00
55	110075	南航转债	1,220.00	0.00
56	127025	冀东转债	1,158.60	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	966,969,491.07	196,518,937.20
报告期期间基金总申购份额	901,756,554.01	146,894,182.79
减：报告期期间基金总赎回份额	505,127,659.04	135,426,559.99
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	1,363,598,386.04	207,986,560.00

## §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 2021 年 9 月 30 日，博时基金公司共管理 296 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 16138 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 4752 亿元人民币，累计分红逾 1509 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。

### 其他大事件

2021 年 9 月 28 日，由中国证券报社有限公司主办的第十八届中国基金业金牛奖评选结果正式揭晓，凭借出色的业绩以及卓越的投资实力，博时信用债纯债债券一举荣获了“五年期开放式债券型持续优胜金牛基金”奖。

2021 年 9 月 27 日，由证券时报报社有限公司主办的第十六届中国基金业明星基金奖正式公布，凭借出色的业绩以及卓越的投资实力，博时天颐债券荣获“三年持续回报积极债券型明星基金”奖。

2021 年 9 月，由北京济安金信科技有限公司主办的第三届济安“群星汇”评选结果揭晓，凭借卓越的综合管理实力和旗下基金产品出色的长期业绩，博时基金一举获得了“济安众星奖”、“济安五星奖”两项重量级的公司奖项。博时旗下产品博时合惠货币（004841）获得了“基金产品单项奖-货币型”，博时合惠货币基金经理魏桢则荣获了“五星基金明星奖”奖。

2021 年 7 月 6 日，由上海证券报社有限公司主办的第十七届“金基金”奖的评选结果揭晓。凭借综合资产管理能力和旗下产品业绩表现，博时基金荣获 2019 年度金基金·海外投资回报基金管理公司奖。博时旗下基金产品博时新起点灵活配置混合型证券投资基金获得 2019 年度金基金·灵活配置型基金三年期奖。

## §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）

博时基金管理有限公司

二〇二一年十月二十七日