

博时转债增强债券型证券投资基金更新 招募说明书摘要 2016 年第 2 号

博时转债增强债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）本基金于 2010 年 10 月 14 日经中国证券监督管理委员会证监许可[2010]1406 号文核准。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。

本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。本基金投资中的风险包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券市场价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金份额持有人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的积极管理风险，本基金的特定风险等。本基金以固定收益类投资为主，预期收益和风险高于货币市场基金，但低于混合型基金和股票型基金，属于中低风险/收益的产品。投资者在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本招募说明书（更新）所载内容截止日为 2016 年 5 月 24 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2016 年 3 月 31 日（财务数据未经审计）。

第一部分 基金管理人

（一）基金管理人概况

名称： 博时基金管理有限公司
住所： 广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 29 层
办公地址： 广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 29 层
法定代表人： 张光华
成立时间： 1998 年 7 月 13 日
注册资本： 2.5 亿元人民币
存续期间： 持续经营
联系人： 韩强
联系电话： （0755）8316 9999

博时基金管理有限公司（以下简称“公司”）经中国证监会证监基字[1998]26 号文批准设立。目前公司股东为招商证券股份有限公司，持有股份 49%；中国长城资产管理公司，持有股份 25%；天津港（集团）有限公司，持有股份 6%；上海汇华实业有限公司，持有股份 12%；上海盛业股权投资基金有限公司，持有股份 6%；广厦建设集团有限责任公司，持有股份 2%。注册资本为 2.5 亿元人民币。

公司设立了投资决策委员会。投资决策委员会负责指导基金资产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则。

公司下设两大总部和二十六个直属部门，分别是：权益投资总部、固定收益总部以及宏观策略部、交易部、指数与量化投资部、特定资产管理部、年金投资部、产品规划部、营销服务部、客户服务中心、市场部、养老金业务部、战略客户部、机构-上海、机构-南方、券商业务部、零售-北京、零售-上海、零售-南方、互联网金融部、董事会办公室、办公室、人力资源部、财务部、信息技术部、基金运作部、风险管理部和监察法律部。

权益投资总部负责公司所管理资产的权益投资管理及相关工作。权益投资总部下设股票投资部（含各投资风格小组）、研究部。股票投资部负责进行股票选择和组合管理。研究部负责完成对宏观经济、投资策略、行业上市公司及市场的研究。固定收益总部负责公司所管理资产的固定收益投资管理及相关工作。固定收益总部下设现金管理组、公募基金组、专户组、国际组和研究组，分别负责各类固定收益资产的研究和投资工作。

市场部负责公司市场和销售管理、销售组织、目标和费用管理、销售督导与营销培训管理、推动金融同业业务合作与拓展、国际业务的推动与协作等工作。战略客户部负责北方地区由国资委和财政部直接管辖企业以及该区域机构客户的销售与服务工作。机构-上海和机构-南方分别主要负责华东地区、华南地区以及其他指定区域的机构客户销售与服务工作。养老金业务部负责养老金业务的研究、拓展和服务等工作。券商业务部负责券商渠道的开拓

和销售服务。零售-北京、零售-上海、零售-南方负责公司全国范围内零售客户的渠道销售和服务。营销服务部负责营销策划、总行渠道维护和销售支持等工作。

宏观策略部负责为投委会审定资产配置计划提供宏观研究和策略研究支持。交易部负责执行基金经理的交易指令并进行交易分析和交易监督。指数与量化投资部负责公司各类指数与量化投资产品的研究和投资管理工作。特定资产管理部负责公司权益类特定资产专户和权益类社保投资组合的投资管理及相关工作。年金投资部负责公司所管理企业年金等养老金资产的投资管理及相关工作。产品规划部负责新产品设计、新产品报批、主管部门沟通维护、产品维护以及年金方案设计等工作。互联网金融部负责公司互联网金融战略规划的设计和和实施，公司互联网金融的平台建设、业务拓展和客户运营，推动公司相关业务在互联网平台的整合与创新。客户服务中心负责零售客户的服务和咨询工作。

董事会办公室专门负责股东会、董事会、监事会及董事会各专业委员会各项会务工作；股东关系管理与董、监事的联络、沟通及服务；基金行业政策、公司治理、战略发展研究；与公司治理及发展战略等相关的重大信息披露管理；政府公共关系管理；党务工作；博时慈善基金会的管理及运营等。办公室负责公司的战略规划研究、行政后勤支持、会议及文件管理、公司文化建设、品牌传播、对外媒体宣传、外事活动管理、档案管理及工会工作等。人力资源部负责公司的人员招聘、培训发展、薪酬福利、绩效评估、员工沟通、人力资源信息管理工作。财务部负责公司预算管理、财务核算、成本控制、财务分析等工作。信息技术部负责信息系统开发、网络运行及维护、IT 系统安全及数据备份等工作。基金运作部负责基金会计和基金注册登记等业务。风险管理部负责建立和完善公司投资风险管理制度与流程，组织实施公司投资风险管理及绩效分析工作，确保公司各类投资风险得到良好监督与控制。监察法律部负责对公司投资决策、基金运作、内部管理、制度执行等方面进行监察，并向公司管理层和有关机构提供独立、客观、公正的意见和建议。

另设北京分公司、上海分公司、沈阳分公司、郑州分公司和成都分公司，分别负责对驻京、沪、沈阳、郑州和成都人员日常行政管理和对赴京、沪、沈阳和郑州处理公务人员给予协助。此外，还设有全资子公司博时资本管理有限公司，以及境外子公司博时基金（国际）有限公司。

截止到 2016 年 3 月 31 日，公司总人数为 431 人，其中研究员和基金经理超过 94%拥有硕士及以上学历。

公司已经建立健全投资管理制度、风险控制制度、内部监察制度、财务管理制度、人事管理制度、信息披露制度和员工行为准则等公司管理制度体系。

（二）主要成员情况

1、基金管理人董事会成员

张光华先生，博士，董事长。历任国家外汇管理局政研室副主任，计划处处长，中国人

民银行海南省分行副行长、党委委员，中国人民银行广州分行副行长、党委副书记，广东发展银行行长、党委副书记，招商银行副行长、执行董事、副董事长、党委副书记，在招商银行任职期间曾兼任永隆银行副董事长、招商基金管理有限公司董事长、招商信诺人寿保险有限公司董事长、招银国际金融有限公司董事长、招银金融租赁有限公司董事长。2015 年 8 月起，任博时基金管理有限公司董事长暨法定代表人。

熊剑涛先生，硕士，工程师，董事。1992 年 5 月至 1993 年 4 月任职于深圳山星电子有限公司。1993 年起，历任招商银行总行电脑部信息中心副经理，招商证券股份有限公司电脑部副经理、经理、电脑中心总经理、技术总监兼信息技术中心总经理；2004 年 1 月至 2004 年 10 月，被中国证监会借调至南方证券行政接管组任接管组成员；2005 年 12 月起任招商证券股份有限公司副总裁，现分管经纪业务、资产管理业务、信息技术中心，兼任招商期货有限公司董事长、中国证券业协会证券经纪专业委员会副主任委员。2014 年 11 月起，任博时基金管理有限公司第六届董事会董事。

江向阳先生，董事。2015 年 7 月起任博时基金管理有限公司总经理。中共党员，南开大学国际金融博士，清华大学金融媒体 EMBA。1986-1990 年就读于北京师范大学信息与情报学系，获学士学位；1994-1997 年就读于中国政法大学研究生院，获法学硕士学位；2003-2006 年，就读于南开大学国际经济研究所，获国际金融博士学位。2015 年 1 月至 7 月，任招商局金融集团副总经理、博时基金管理有限公司党委副书记。历任中国证监会办公厅、党办副主任兼新闻办（网信办）主任；中国证监会办公厅副巡视员；中国证监会深圳专员办处长、副专员；中国证监会期货监管部副处长、处长；中国农业工程研究设计院情报室干部。

王金宝先生，硕士，董事。1988 年 7 月至 1995 年 4 月在上海同济大学数学系工作，任教师。1995 年 4 月进入招商证券，先后任上海澳门路营业部总经理、上海地区总部副总经理（主持工作）、投资部总经理、投资部总经理兼固定收益部总经理、股票销售交易部总经理（现更名为机构业务总部）、机构业务董事总经理。2002 年 10 月至 2008 年 7 月，任博时基金管理有限公司第二届、第三届监事会监事。2008 年 7 月起，任博时基金管理有限公司第四届至第六届董事会董事。

陈克庆先生，北京大学工商管理硕士。2001 年起历任世纪证券投资银行北京总部副总经理，国信证券投行业务部副总经理，华西证券投资银行总部副总经理、董事总经理。2014 年加入中国长城资产管理公司，现任投资投行事业部副总经理。

杨林峰先生，硕士，高级经济师，董事。1988 年 8 月就职于国家纺织工业部，1992 年 7 月至 2006 年 6 月任职于中国华源集团有限公司，先后任华源发展股份有限公司（上海证交所上市公司）董秘、副总经理、常务副总经理等职。2006 年 7 月就职于上海市国资委直属上海大盛资产有限公司，任战略投资部副总经理。2007 年 10 月至今，出任上海盛业股权投资基金有限公司执行董事、总经理。2011 年 7 月至 2013 年 8 月，任博时基金管理有公司第五届监事会监事。2013 年 8 月起，任博时基金管理有限公司第五届、第六届董事会董事。

顾立基先生，硕士，独立董事。1968 年至 1978 年就职于上海印染机械修配厂，任共青团总支书记；1983 年起，先后任招商局蛇口工业区管理委员会办公室秘书、主任；招商局蛇口工业区免税品有限公司董事总经理；中国国际海运集装箱股份有限公司董事副总经理、总经理；招商局蛇口工业区有限公司副总经理、国际招商局贸易投资有限公司董事副总经理；蛇口招商港务股份有限公司董事总经理；招商局蛇口工业区有限公司董事总经理；香港海通有限公司董事总经理；招商局科技集团有限公司董事总经理、招商局蛇口工业区有限公司副总经理。2008 年退休。2008 年 2 月至今，任清华大学深圳研究生院兼职教授；2008 年 11 月至 2010 年 10 月，兼任招商局科技集团有限公司执行董事；2009 年 6 月至今，兼任中国平安保险（集团）股份有限公司外部监事、监事会主席；2011 年 3 月至今，兼任湘电集团有限公司外部董事；2013 年 5 月至 2014 年 8 月，兼任德华安顾人寿保险有限公司（ECNL）董事；2013 年 6 月至今，兼任深圳市昌红科技股份有限公司独立董事。2014 年 11 月起，任博时基金管理有限公司第六届董事会独立董事。

李南峰先生，学士，独立董事。1969 年起先后在中国人民解放军酒泉卫星基地、四川大学经济系、中国人民银行、深圳国际信托投资公司、华润深国投信托有限公司工作，历任中国人民银行总行金融研究所研究院、深圳特区人行办公室主任，深圳国际信托投资公司副总经理、总经理、董事长、党委书记，华润深国投信托有限公司总经理、副董事长。1994 年至 2008 年曾兼任国信证券股份有限公司董事、董事长。2010 年退休。2013 年 8 月起，任博时基金管理有限公司第五届、第六届董事会独立董事。

何迪先生，硕士，独立董事。1971 年起，先后在北京西城区半导体器件厂、北京东城区电子仪器一厂、中共北京市委党校、社科院美国研究所、加州大学伯克利分校、布鲁津斯学会、标准国际投资管理公司工作。1997 年 9 月至今任瑞银投资银行副主席。2008 年 1 月，何迪先生建立了资助、支持中国经济、社会与国际关系领域中长期问题研究的非营利公益组织“博源基金会”，并担任该基金会总干事。2012 年 7 月起，任博时基金管理有限公司第五届、第六届董事会独立董事。

2、基金管理人监事会成员

车晓昕女士，硕士，监事。1983 年起历任郑州航空工业管理学院助教、讲师、珠海证券有限公司经理、招商证券股份有限公司投资银行总部总经理。现任招商证券股份有限公司财务管理董事总经理。2008 年 7 月起，任博时基金管理有限公司第四至六届监事会监事。

余和研先生，监事。1974 年 12 月入伍服役。自 1979 年 4 月进入中国农业银行总行工作，先后在办公室、农村金融研究所、发展研究部、国际业务部等部门担任科员、副处长、处长等职务；1993 年 8 月起先后在英国和美国担任中国农业银行伦敦代表处首席代表、纽约代表处首席代表；1998 年 8 月回到中国农业银行总行，在零售业务部担任副总经理。1999 年 10 月起在中国长城资产管理公司工作，先后在总部国际业务部、人力资源部担任总经理；2008 年 8 月起先后到中国长城资产管理公司天津办事处、北京办事处担任总经理；2014 年

3 月至今担任中国长城资产管理公司控股的长城国富置业有限公司监事、监事会主席，长城环亚国际投资有限公司董事；2015 年 7 月起任博时基金管理有限公司监事。

赵兴利先生，硕士，监事。1987 年至 1995 年就职于天津港务局计财处。1995 年至 2012 年 5 月先后任天津港贸易公司财务科科长、天津港货运公司会计主管、华夏人寿保险股份有限公司财务部总经理、天津港财务有限公司常务副总经理。2012 年 5 月筹备天津港（集团）有限公司金融事业部，2011 年 11 月至今任天津港（集团）有限公司金融事业部副部长。2013 年 3 月起，任博时基金管理有限公司第五至六届监事会监事。

郑波先生，博士，监事。2001 年起先后在中国平安保险公司总公司、博时基金管理有限公司工作。现任博时基金管理有限公司人力资源部总经理。2008 年 7 月起，任博时基金管理有限公司第四至六届监事会监事。

黄健斌先生，工商管理硕士。1995 年起先后在广发证券有限公司、广发基金管理有限责任公司投资管理部、中银国际基金管理有限公司基金管理部工作。2005 年加入博时基金管理公司，历任固定收益部基金经理、博时平衡配置混合型基金经理、固定收益部副总经理、社保组合投资经理、固定收益部总经理。现任公司总经理助理兼固定收益总部董事总经理、年金投资部总经理、社保组合投资经理、高级投资经理、兼任博时资本管理有限公司董事。2016 年 3 月 18 日至今担任博时基金管理有限公司监事会员工监事。

严斌先生，硕士，监事。1997 年 7 月起先后在华侨城集团公司、博时基金管理有限公司工作。现任博时基金管理有限公司财务部副总经理。2015 年 5 月起，任博时基金管理有限公司第六届监事会监事。

3、高级管理人员

张光华先生，简历同上。

江向阳先生，简历同上。

王德英先生，硕士，副总经理。1995 年起先后在北京清华计算机公司任开发部经理、清华紫光股份公司 CAD 与信息事业部任总工程师。2000 年加入博时基金管理有限公司，历任行政管理部副经理，电脑部副经理、信息技术部总经理、公司代总经理。现任公司副总经理，主管 IT、财务、运作、指数与量化投资和互联网金融等工作，博时基金（国际）有限公司及博时资本管理有限公司董事。

董良泓先生，CFA，MBA，副总经理。1993 年起先后在中国技术进出口总公司、中技上海投资公司、融通基金管理有限公司、长城基金管理有限公司从事投资管理工作。2005 年 2 月加入博时基金管理有限公司，历任社保股票基金经理，特定资产高级投资经理，研究部总经理兼特定资产高级投资经理、社保股票基金经理、特定资产管理部总经理。现任公司副总经理兼高级投资经理、社保组合投资经理，兼任博时基金（国际）有限公司董事、博时资本管理有限公司董事。

邵凯先生，经济学硕士，副总经理。1997 年至 1999 年在河北省经济开发投资公司从事

投资管理的工作。2000 年 8 月加入博时基金管理有限公司，历任债券组合经理助理、债券组合经理、社保债券基金基金经理、固定收益部副总经理兼社保债券基金基金经理、固定收益部总经理、固定收益投资总监、社保组合投资经理。现任公司副总经理、兼任博时基金（国际）有限公司董事、博时资本管理有限公司董事。

徐卫先生，硕士，副总经理。1993 年起先后在深圳市证券管理办公室、中国证监会、摩根士丹利华鑫基金工作。2015 年 6 月加入博时基金管理有限公司，现任公司副总经理。

孙麒清女士，商法学硕士，督察长。曾供职于广东深港律师事务所。2002 年加入博时基金管理有限公司，历任监察法律部法律顾问、监察法律部总经理。现任公司督察长，兼任博时基金（国际）有限公司董事、博时资本管理有限公司副董事长。

4、本基金基金经理

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、基金经理助理。现任博时转债增强债券基金（2013 年 9 月 25 日-至今）、博时双债增强债券基金（2015 年 7 月 16 日-至今）、博时裕利纯债债券基金（2016 年 5 月 9 日-至今）、博时泰和债券基金（2016 年 5 月 25 日-至今）、博时聚瑞纯债债券基金（2016 年 5 月 26 日-至今）的基金经理。

本基金历任基金经理：过钧先生（2010 年 11 月 24 日至 2013 年 9 月 24 日）。

5、投资决策委员会成员

委员：江向阳、邵凯、黄健斌、李权胜、欧阳凡、魏凤春、王俊

江向阳先生，简历同上。

邵凯先生，简历同上。

黄健斌先生，简历同上。

李权胜先生，硕士。2001 年起先后在招商证券、银华基金工作。2006 年加入博时基金管理有限公司，历任研究员、研究员兼基金经理助理、特定资产投资经理、特定资产管理部副总经理、博时医疗保健行业股票基金基金经理、股票投资部副总经理、股票投资部成长组投资总监。现任股票投资部总经理兼价值组投资总监、博时精选混合基金基金经理。

欧阳凡先生，硕士。2003 年起先后在衡阳市金杯电缆厂、南方基金工作。2011 年加入博时基金管理有限公司，曾任特定资产管理部副总经理、社保组合投资经理助理。现任特定资产管理部总经理兼社保组合投资经理。

魏凤春先生，经济学博士。1993 年起先后在山东经济学院、江南证券、清华大学、江南证券、中信建投证券公司工作。2011 年加入博时基金管理有限公司，曾任投资经理。现任首席宏观策略分析师兼宏观策略部总经理、博时抗通胀增强回报（QDII-FOF）基金、博时平衡配置混合基金的基金经理。

王俊先生，硕士，CFA。2008 年从上海交通大学硕士研究生毕业后加入博时基金管理有

限公司。历任研究员、金融地产与公用事业组组长、研究部副总经理。现任研究部总经理兼博时主题行业混合(LOF)基金、博时国企改革股票基金、博时丝路主题股票基金的基金经理。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

第二部分 基金托管人

(一) 基金托管人基本情况

1、基本情况

名称：中国光大银行股份有限公司

住所及办公地址：北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心

成立日期：1992 年 8 月 18 日

批准设立机关和批准设立文号：中国人民银行，银复 1992[152]号

组织形式：股份有限公司

注册资本：404.3479 亿元人民币

法定代表人：唐双宁

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【2002】75 号

投资与托管部总经理：曾闻学

托管部门联系人：李宁

电话：（010）63636363

传真：（010）63639132

网址：www.cebbank.com

2、主要人员情况

法定代表人唐双宁先生，历任中国人民建设银行沈阳市分行常务副行长、中国人民银行沈阳市分行行长，中国人民银行信贷管理司司长、货币金银局局长、银行监管一司司长，中国银行业监督管理委员会副主席，中国光大（集团）总公司董事长、党委书记等职务。现任十二届全国人大农业与农村委员会副主任，十一届全国政协委员，中国光大集团股份公司董事长、党委书记，中国光大集团有限公司董事长，兼任中国光大银行股份有限公司董事长、党委书记，中国光大控股有限公司董事局主席，中国光大国际有限公司董事局主席。

行长张金良先生，曾任中国银行财会部会计制度处副处长、处长、副总经理兼任 IT 蓝图实施办公室主任、总经理，中国银行北京市分行行长、党委书记，中国银行副行长、党委委员。现任中国光大集团股份公司党委委员，兼任中国光大银行行长、党委副书记。

曾闻学先生，曾任中国光大银行办公室副总经理，中国光大银行北京分行副行长。现任中国光大银行股份有限公司投资托管部总经理。

3、基金托管业务经营情况

截至 2016 年 3 月 31 日，中国光大银行股份有限公司托管国投瑞银创新动力股票型证券投资基金、国投瑞银景气行业证券投资基金、国投瑞银融华债券型证券投资基金、摩根士丹利华鑫资源优选混合型证券投资基金(LOF)、摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金、工银瑞信保本混合型证券投资基金、博时转债增强债券型证券投资基金、大成策略回报股票型证券投资基金、大成货币市场基金、建信恒稳价值混合型证券投资基金、光大保德信量化核心证券投资基金、光大保德信添天利季度开放短期理财债券型证券投资基金、国联安双佳信用分级债券型证券投资基金、泰信先行策略开放式证券投资基金、招商安本增利债券型证券投资基金、中欧新动力股票型证券投资基金（LOF）、国金通用国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金、农银汇理深证 100 指数增强型证券投资基金、益民核心增长灵活配置混合型证券投资基金、建信纯债债券型证券投资基金、兴业商业模式优选股票型证券投资基金、工银瑞信保本 2 号混合型发起式证券投资基金、国金通用沪深 300 指数分级证券投资基金、中加货币市场基金、益民服务领先灵活配置混合型证券投资基金、建信健康民生混合型证券投资基金、鑫元一年定期开放债券型证券投资基金、江信聚福定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元稳利债券型证券投资基金、国金通用鑫安保本混合型证券投资基金、鑫元合享分级债券型证券投资基金、鑫元半年定期开放债券型证券投资基金、东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金、建信信息产业股票型证券投资基金、泓德优选成长混合型证券投资基金、东方新策略灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信鼎鑫灵活配置混合型证券投资基金、中融新动力灵活配置混合型证券投资基金、红塔红土盛金新动力灵活配置混合型证券投资基金、金鹰产业整合灵活配置混合型证券投资基金、国金通用鑫运灵活配置混合型证券投资基金、大成景裕灵活配置混合型证券投资基金、财通多策略精选混合型证券投资基金、鹏华添利货币市场基金、江信同福灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信耀钱包货币市场基金、大成景沛灵活配置混合型证券投资基金、易方达瑞选灵活配置混合型证券投资基金、中加心享灵活配置混合型证券投资基金、建信稳定丰利债券型证券投资基金、南方弘利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元兴利债券型证券投资基金、博时安泰 18 个月定期开放债券型证券投资基金、建信安心保本五号混合型证券投资基金、银华添益定期开放债券型证券投资基金、中欧强盈定期开放债券型证券投资基金、华夏恒利 6 个月定期开放债券型证券投资基金共 56 只证券投资基金，托管基金资产规模 1,012.49 亿元。同时，开展了证券公司资产管理计划、专户理财、企业年金基金、QDII、银行理财、保险债权投资计划等资产的托管及信托公司资金信托计划、产业投资基金、股权基金等产品的保管业务。

（二）基金托管人的内部控制制度

1、内部控制目标

确保有关法律法规在基金托管业务中得到全面严格的贯彻执行；确保基金托管人有关基

金托管的各项管理制度和业务操作规程在基金托管业务中得到全面严格的贯彻执行；确保基金财产安全；保证基金托管业务稳健运行；保护基金份额持有人、基金管理公司及基金托管人的合法权益。

2、内部控制的原则

(1) 全面性原则。内部控制必须渗透到基金托管业务的各个操作环节，覆盖所有的岗位，不留任何死角。

(2) 预防性原则。树立“预防为主”的管理理念，从风险发生的源头加强内部控制，防患于未然，尽量避免业务操作中各种问题的产生。

(3) 及时性原则。建立健全各项规章制度，采取有效措施加强内部控制。发现问题，及时处理，堵塞漏洞。

(4) 独立性原则。基金托管业务内部控制机构独立于基金托管业务执行机构，业务操作人员和内控人员分开，以保证内控机构的工作不受干扰。

3、内部控制组织结构

中国光大银行股份有限公司董事会下设风险管理委员会、审计委员会，委员会委员由相关部门的负责人担任，工作重点是对总行各部门、各类业务的风险和内控进行监督、管理和协调，建立横向的内控管理制约体制。各部门负责分管系统内的内部控制的组织实施，建立纵向的内控管理制约体制。基金托管部建立了严密的内控督察体系，设立了风险管理处，负责证券投资基金托管业务的风险管理。

4、内部控制制度

中国光大银行股份有限公司基金托管部自成立以来严格遵照《基金法》、《中华人民共和国商业银行法》、《信息披露办法》、《运作办法》、《销售办法》等法律、法规的要求，并根据相关法律法规制订、完善了《中国光大银行证券投资基金托管业务内部控制规定》、《中国光大银行基金托管部保密规定》等十余项规章制度和实施细则，将风险控制落实到每一个工作环节。中国光大银行基金托管部以控制和防范基金托管业务风险为主线，在重要岗位（基金清算、基金核算、监督稽核）还建立了安全保密区，安装了录象监视系统和录音监听系统，以保障基金信息的安全。

（三）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据法律、法规和基金合同等的要求，基金托管人主要通过定性和定量相结合、事前监督和事后控制相结合、技术与人工监督相结合等方式方法，对基金投资品种、投资组合比例每日进行监督；同时，对基金管理人就基金资产净值的计算、基金管理人和基金托管人报酬的计提和支付、基金收益分配、基金费用支付等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人发现基金管理人的违反法律、法规和基金合同等规定的行为，及时以书面或电话形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式对

基金托管人发出回函。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

第三部分 相关服务机构

一、基金份额销售机构

1、直销机构

(1) 博时基金管理有限公司北京分公司及北京直销中心

名称：博时基金管理有限公司北京分公司及北京直销中心
地址：北京市建国门内大街 18 号恒基中心 1 座 23 层
电话：010-65187055
传真：010-65187032
联系人：尚继源
全国统一服务热线：95105568（免长途话费）

(2) 博时基金管理有限公司上海分公司

名称：博时基金管理有限公司上海分公司
地址：上海市黄浦区中山南路 28 号久事大厦 25 层
电话：021-33024909
传真：021-63305180
联系人：周明远

(3) 博时基金管理有限公司总公司

名称：博时基金管理有限公司总公司
地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 35 层
电话：0755-83169999
传真：0755-83199450
联系人：程姣姣

二、登记机构

名称：博时基金管理有限公司(内容同基金管理人)

三、律师事务所和经办律师

名称：上海市通力律师事务所
注册地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼
办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼
电话：021- 31358666
传真：021- 31358600

联系人： 安冬

经办律师： 安东、陆奇

四、会计师事务所和经办注册会计师

名称： 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

住所： 上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址： 上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人： 李丹

联系电话： (021) 23238888

传真： (021) 23238800

联系人： 陈熹

经办注册会计师： 薛竞、陈熹

第四部分 基金的名称

博时转债增强债券型证券投资基金

第五部分 基金的类型

契约型开放式

第六部分 基金的投资

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。

第七部分 投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金重点投资于固定收益类证券，包括国债、央行票据、公司债、企业债、资产支持证券、短期融资券、政府机构债、政策性金融机构金融债、可转换公司债券、可分离交易可转债、正回购和逆回购，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于固定收益类证券的比例不低于基金资产的 80%，其中对可转换公司债券（包含可分离交易可转债）的投资比例不低于基金固定收益类证券资产的 80%；现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%；投资于股票和权证等权益类证券的比例不高于基金资产的 20%。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

第八部分 投资策略

1、 本基金资产配置策略

(1) 类属资产配置策略

本基金投资组合中投资于固定收益类证券的比例不低于基金资产的 80%，其中对可转换公司债券（包含可分离交易可转债）的投资比例不低于基金固定收益类证券资产的 80%；投资于股票和权证等权益类证券的比例不高于基金资产的 20%，现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。

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。

通常，在经济从复苏到繁荣时，股票市场将进入牛市，在这两个阶段，权益资产的收益率都超过固定收益类资产。当经济从滞涨到衰退时，债券市场开始逐步向好进而进入债券市场的牛市。通过对权益类资产和固定收益类资产投资比例的调整可以提高产品的收益水平。

可转债兼有股性和债性两方面的属性，对普通债券和可转债灵活配置的策略是大类资产配置策略的有效补充和辅助。在经济处于复苏和繁荣的阶段，可转债的股性表现突出，通过对可转债的超配可以增强债券组合的收益；在经济处于衰退的阶段，普通债券的收益表现较好，通过超配普通债券来获得较好的收益。

2、 本基金固定收益类资产的主要投资策略

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。

(1) 期限结构策略

通过预测收益率曲线的形状和变化趋势，对各类型债券进行久期配置，确保组合收益超过基准收益。具体来看，又分为跟踪收益率曲线的骑乘策略和基于收益率曲线变化的子弹策略、杠铃策略及梯式策略。

(2) 信用策略

信用利差收益率主要受两个方面的影响，一是债券对应信用水平的市场信用利差曲线走势；二是债券本身的信用变化。本基金依靠内部评级系统分析债券的相对信用水平、违约风

险及理论信用利差，分析信用利差曲线整体及分行业走势，确定各类债券投资比例。

（3）互换策略

不同券种在利息、违约风险、久期、流动性、税收和衍生条款等方面存在差别，投资管理人可以同时买入和卖出具有相近特性的两个或两个以上券种，赚取收益率差。

（4）息差策略

息差策略是指利用回购利率低于债券收益率的情形，通过正回购将所获得资金投资于债券的策略。

息差策略实际上也就是杠杆放大策略，进行放大策略时，必须考虑回购资金成本与债券收益率之间的关系，只有当债券收益率高于回购资金成本（即回购利率）时，息差策略才能取得正的收益。

（5）资产支持证券策略

资产支持证券包括信贷资产支持证券和企业资产支持证券。根据目前监管机构的规定，基金只能投资信用评级在 **BBB** 及以上的资产支持债券，并且投资比例不超过基金净值的 **20%**。本基金在综合分析资产支持证券的资产的质量和构成、证券的条款、利率风险、信用评级、流动性和提前偿付速度的基础上，评估证券的相对的投资价值并作出相应的投资决策。资产支持证券投资也是本基金增强收益的策略之一。

3、 本基金可转债投资策略

本产品通过灵活配置可转债来增强投资收益，可转债部分的投资策略是本产品的核心策略。

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。

（1）可转债投资的行业选择

可转债投资的收益主要来自两大块：转股价值和估值水平的提升，前者与正股价格紧密相连，后者与转股溢价率和隐含波动率等有着密切的关系。可转债收益与其正股收益有较强的相关性，同时可转债还有其自身特点，特定情况下其走势还可能背离正股的走势，因此，本基金在股票分析框架的基础上建立一套特定的可转债分析方法和投资策略。

在可转债投资的行业类别选择上，可转债投资收益的来源是分析的根本出发点，根据收益来源的特征进行行业选择，以有效地完成可转债的配置。首先，可转债与股票形成联接，正股的变动从本质上影响着可转债的表现，因此需要根据股票市场周期和经济周期的相关性，确定可转债市场所处的投资环境和预期表现。具体来说，先从宏观环境大势确定未来经济运行态势，进而分析和预测股票市场的整体走势，并确定当前经济发展阶段所对应股票市场各行业的表现，以确定行业层面上的选择排序。比如在经济复苏阶段，选择资源类行业，

该类公司的股票表现相对更好，对应的可转债转股价值上升，带动转债价格上涨，从而分享正股上涨带来的收益，而在衰退阶段，选择一些非周期性防御性行业，如公共事业、食品等。其次，从经济层面确定好行业选择的排序后，需进一步根据可转债市场估值特点来最终确定该配置哪些最有效的行业。从估值方面看，转股溢价率和正股隐含波动率的提高是转债价格上升的最主要因素，而不同行业不同类型的公司对旗下可转债转股溢价率的支撑程度是不一样的，正股的波动性也不相同，比如当前成长性较快的行业其未来获利能力相对较强，市场对其关注度较高，投资者会有所偏爱，此类行业会被给予相对较高的估值，在其他因素相同的情形下，此类行业的可转债能支撑更高的转股溢价率等，可转债的估值水平会提升，从而提升可转债的价格，同时本基金会根据可转债当前价格来评估当前估值水平是否已经体现了其自身可支撑的未来估值水平，选择低估的行业和公司。

总体来看，对可转债行业选择的分析是结合经济周期、股票市场和可转债本身估值特点等因素综合考虑，结合数量分析，最终确定行业的排序，挖掘出特定时期下最优的行业并进行合适的配置。

（2）可转债个券的选择

可转债不同于一般的企业债券，该债券赋予投资者在一定条件下将可转债转换成股票的权利，投资者可能还具有回售等其他权利，因此从这方面看可转债的理论价值应等于普通债券的基础价值和可转债自身内含的期权价值之和。可转债的基础价值，即纯债价值，该部分价值的计算与普通债券价值的计算方法一样，即按照债券市场相应的收益率水平将未来的一系列现金流进行贴现即可。可转债价值中的另一部分即期权价值的定价是转债定价的核心，该部分定价涉及到对应正股的价格及其预期、可转债发行条款、该发债上市公司基本面特征、股价波动率等关键要素。关于期权定价，常用的模型有二叉树模型、修正的 BS 模型等，本基金在分析期权价值的过程将结合定价模型、市场定性分析和定量比较分析，充分考虑市场各时期的特征，合理地给出可转债的估值。在合理定价的基础上，结合博时可转债评级系统，尽量有效地挖掘出可转债的投资价值。

博时可转债评级系统主要由基本面评级与估值评级两部分组成。基本面评分主要是对可转债正股的投资价值进行评估，转债估值评分是从可转债溢价率，隐含波动率等一些反映可转债定价与估值水平的参数出发，评估可转债价格相对于正股价格的高低水平。

（3）可转债条款投资策略

国内转债一般具有提前赎回、修正转股价、提前回售等条款，这些条款在特定环境下对转债价值有着较大的影响。例如，当一段时间内正股价格持续低于转股价达到一定程度，则发行该可转债的公司董事会可发起向下修正转股价的提议，通过向下修正转股价而大幅提高转债的转股价值，从而提升转债价值，也为该转债未来可能出现较好表现提供支撑，这也有效地降低了正股可能较大幅下跌给转债带来的损失，因此提前对此进行合理的判断将提升组合投资价值。本基金从公司层面进行分析，包括当前经营状况和未来发展策略，以及公司的财务状况和融资需求，站在企业方面看问题，从而较好地把握企业在提前赎回、修正转股价等方面的态度。另外，因增发或派息等而引起转股价变动，不同的情形会对转债价值产生不同的影响，本基金可以通过有效分析相关信息而把握可能的投资机会。

（4）可转债转换成相应股票的投资策略

在转股期内，可转债具有按规定转换条件转换成相应股票的权力，因此需要有合理的可转债转换成股票的策略，本基金认为是否进行转股主要根据转股前后的价值对比进行判断，一般来说包括如下情况：1）当转股溢价率明显为负时，即一张可转债转换成股票后卖出的所得收益大于转债价格，本基金将抓住此套利机会，通过将可转债转股卖出而获得超额收益；2）当因正股价格大涨而触发提前赎回时，本基金将具体分析该正股未来的可能表现情况，据此首先做出将可转债进行转股来保障投资者的利益，然后进一步做出是继续持有正股还是立即卖出的决定；3）当转债流动性不能满足组合所要求时，本基金将合理地通过转股来保持高流通性；4）通过可转债转股能提升投资者收益的其他情况。

（5）可分离交易可转债投资策略

可分离交易可转债是一类特殊的可转债品种，与普通可转债不同的一点主要在于可分离交易可转债在上市后债券部分跟权证部分实行分离交易。在可分离交易可转债投资方面，本基金一般不主动从二级市场上买入权证部分，如果通过申购可分离交易可转债而获得部分权证，本基金采取上市后尽快卖出的策略以降低权证高波动风险。在可分离交易可转债纯债方面，本基金将综合分析纯债部分的信用状况、流动性以及与利率产品的利差等情况，以及分析可分离转债纯债跟股市之间的相关性，在此基础上合理评估可分离转债纯债部分的投资价值并作出相应的投资决策，力求在保持流动性的基础上为组合增强收益。

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。

在股票投资方面，本基金遵循如下投资步骤：

（1）对股票的风格特征进行评估，从股票池中选择成长与价值特性突出的股票。

根据一系列指标对市场上所有股票的风格特征进行评估，初步筛选出成长与价值股票池。

（2）对股票的基本面素质进行筛选，应用基本面分析方法，确定优质成长股与优质价值股的评价标准，在第一步选择出的具有鲜明风格的股票名单中，进一步分析，选出基本面较好的股票。

成长股与价值股在股票资产中进行相对均衡的配置，适度调整，以控制因风格带来的投资风险，降低组合波动，提高整体收益率。

5、 权证投资策略

权证为本基金辅助性投资工具，投资原则为有利于基金资产增值、控制下跌风险、实现保值和锁定收益。本基金将主要投资满足成长和价值优选条件的公司发行的权证。

6、 投资决策流程

投资决策委员会是本基金的最高决策机构，定期或遇重大事件时就投资管理业务的重大问题进行讨论，并对本基金投资做方向性指导。基金经理、研究员、交易员等各司其责，相互制衡。具体的投资流程为：

（1）投资决策委员会定期召开会议，确定本基金的总投资思路和投资原则。

(2) 研究部宏观策略分析师基于自上而下的研究为本基金提供总的资产配置建议；研究部行业研究员为信用债的信用分析提供研究支持；固定收益部数量及信用分析员为固定收益类投资决策提供依据。

(3) 固定收益部、股票投资部定期召开投资例会，根据投资决策委员会的决定，结合市场、个股和个券的变化，制定具体的投资策略。

(4) 基金经理依据投委会的决定，参考研究员的投资建议，结合风险控制和业绩评估的反馈意见，根据市场情况，制定并实施具体的投资组合方案。

(5) 基金经理向交易员下达指令，交易员执行后向基金经理反馈。

(6) 监察法律部对投资的全过程进行合规风险监控。

(7) 风险管理部通过行使风险管理职能，测算、分析和监控投资风险，根据风险限额管理政策防范超预期风险。

(8) 风险管理部对基金投资进行风险调整业绩评估，定期与基金经理讨论收益和风险预算。

第九部分 业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：中证综合债指数收益率

中证综合债指数是中证指数公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数。该指数是在中证全债指数样本的基础上，增加了央行票据、短期融资券及一年期以下的国债、金融债和企业债，于2008年11月12日正式发布，以更加全面地反映中国债券市场整体价格变动趋势。由于本基金为债券型基金，在综合考虑了指数的权威性和代表性、指数的编制方法以及指数与本基金投资范围、投资理念的吻合度后，本基金选择市场认同度较高的中证综合债指数收益率作为业绩比较基准。

如果今后市场出现更具代表性的业绩比较基准，或者指数编制单位停止编制该指数，或者更具权威、更科学的复合指数权重比例，在与基金托管人协商一致后，本基金管理人可以在报中国证监会备案后调整或变更业绩比较基准并及时公告。

第十部分 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。

第十一部分 基金投资组合报告

博时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。

基金托管人根据本基金合同规定，复核了本报告中的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。

本投资组合报告所载数据截至 2016 年 3 月 31 日，本报告中所列财务数据未经审计。

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	39,942,328.44	8.42
	其中：股票	39,942,328.44	8.42
2	固定收益投资	415,083,394.73	87.48
	其中：债券	415,083,394.73	87.48
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	17,366,280.36	3.66
7	其他各项资产	2,118,895.97	0.45
8	合计	474,510,899.50	100.00

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	23,196,621.98	7.64
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	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,515,706.46	1.49
J	金融业	7,032,000.00	2.32
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	5,198,000.00	1.71
S	综合	-	-
	合计	39,942,328.44	13.15

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	002273	水晶光电	229,982	8,254,053.98	2.72

2	002049	同方国芯	184,950	8,071,218.00	2.66
3	601377	兴业证券	800,000	7,032,000.00	2.32
4	300291	华录百纳	200,000	5,198,000.00	1.71
5	600654	中安消	199,987	4,515,706.46	1.49
6	603111	康尼机电	150,000	3,802,500.00	1.25
7	000666	经纬纺机	150,000	3,045,000.00	1.00
8	603861	白云电器	1,000	23,850.00	0.01

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	30,117,000.00	9.92
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	384,966,394.73	126.75
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	415,083,394.73	136.67

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	126018	08 江铜债	1,537,990	152,660,887.40	50.26
2	132001	14 宝钢 EB	551,930	68,240,625.20	22.47
3	113008	电气转债	520,450	61,839,869.00	20.36
4	128009	歌尔转债	263,700	33,416,064.00	11.00
5	011517012	15 华电 SCP012	300,000	30,117,000.00	9.92

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。

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。

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。

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。

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。

11 投资组合报告附注

11.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体除兴业证券（601377）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。

兴业证券于 2 月 20 日发布公告称，因公司违反了《证券公司融资融券业务内部控制指引》（证监会公告〔2011〕32 号）第十八条第一项和《关于加强证券经纪业务管理的规定》（证监会公告〔2010〕11 号）第四条第二项的相关规定，中国证券监督管理委员会福建监管局对公司采取了行政监管措施。

对该股票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。

11.2 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。

11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	82,968.52
2	应收证券清算款	479,789.04
3	应收股利	-
4	应收利息	1,517,743.37
5	应收申购款	38,395.04
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,118,895.97

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	132001	14 宝钢 EB	68,240,625.20	22.47
2	113008	电气转债	61,839,869.00	20.36
3	128009	歌尔转债	33,416,064.00	11.00
4	110030	格力转债	12,803,128.00	4.22

11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600654	中安消	4,515,706.46	1.49	公告重大事项

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。

第十二部分 基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

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 类：

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
2010.11.24-2010.12.31	-0.60%	0.19%	0.47%	0.08%	-1.07%	0.11%
2011.1.1-2011.12.31	-10.26%	0.59%	5.55%	0.11%	-15.81%	0.48%
2012.1.1-2012.12.31	6.95%	0.45%	3.59%	0.06%	3.36%	0.39%
2013.1.1-2013.12.31	-11.84%	1.22%	-0.43%	0.08%	-11.41%	1.14%
2014.1.1-2014.12.31	93.46%	1.64%	9.75%	0.08%	83.71%	1.56%
2015.1.1-2015.12.31	1.11%	2.27%	7.95%	0.07%	-6.84%	2.20%
2016.1.1-2016.3.31	-13.60%	1.47%	1.16%	0.05%	-14.76%	1.42%
2010.11.24-2016.3.31	42.14%	1.40%	31.08%	0.08%	11.06%	1.32%

2、博时转债增强债券 C 类：

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
2010.11.24-2010.12.31	-0.60%	0.17%	0.47%	0.08%	-1.07%	0.09%
2011.1.1-2011.12.31	-10.66%	0.59%	5.55%	0.11%	-16.21%	0.48%
2012.1.1-2012.12.31	6.64%	0.45%	3.59%	0.06%	3.05%	0.39%
2013.1.1-2013.12.31	-12.04%	1.21%	-0.43%	0.08%	-11.61%	1.13%
2014.1.1-2014.12.31	93.76%	1.64%	9.75%	0.08%	84.01%	1.56%
2015.1.1-2015.12.31	1.00%	2.27%	7.95%	0.07%	-6.95%	2.20%
2016.1.1-2016.3.31	-13.65%	1.47%	1.16%	0.05%	-14.81%	1.42%
2010.11.24-2016.3.31	40.75%	1.40%	31.08%	0.08%	9.67%	1.32%

第十三部分 基金费用与税收

一、与基金运作有关的费用

(一) 基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、销售服务费：本基金从 C 类基金份额的基金资产中计提销售服务费；
- 4、因基金的证券交易或结算而产生的费用（包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等）；
- 5、基金合同生效以后的信息披露费用；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金合同生效以后的会计师费和律师费；
- 8、基金资产的资金汇划费用；
- 9、按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。

(二) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的 0.75% 年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 0.75% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.75\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

2、基金托管人的基金托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的 0.20% 年费率计提。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

3、销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%。

本基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.40% 年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

销售服务费主要用于本基金持续销售以及基金份额持有人服务等各项费用。

4、本条第一款第 4 至第 9 项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入当期基金费用。

5、基金管理人应当在基金半年度报告和基金年度报告中披露从基金财产中计提的管理费、托管费、基金销售服务费的金额，并说明管理费中支付给基金销售机构的客户维护费总额。

二、与基金销售有关的费用

1、申购费用

表：本基金的申购费率结构

A 类基金份额	
申购金额 M	申购费率
M < 100 万元	0.80%
100 万元 ≤ M < 300 万元	0.50%
300 万元 ≤ M < 500 万元	0.30%
M ≥ 500 万元	按笔收取，1000 元/笔
C 类基金份额	
申购费率	0%

2、赎回费用

表：本基金的赎回费率结构

A 类基金份额	
持有年限 Y	赎回费率
Y < 1 年	0.10%
1 年 ≤ Y < 2 年	0.05%
Y ≥ 2 年	0%
C 类基金份额	
赎回费率	持有期限少于 30 日的基金份额，赎回费率为 0.75%；持有期限不少于 30 日（含 30 日）的基金份额，不收取赎回费用。

3、转换费用

基金转换费用由转出基金赎回费和申购费补差两部分构成，其中：申购费补差具体收取情况，视每次转换时的两只基金的申购费率的差异情况而定。基金转换费用由基金份额持有人承担。

基金管理人可根据有关法律规定和市场情况，调整申购金额、赎回份额和账户最低持有余额的数量限制，基金管理人必须最迟在调整前 2 日在至少一种指定媒体上公告。

三、不列入基金费用的项目

本条第一款约定以外的其他费用，以及基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失不列入基金费用。

四、基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。

五、税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

第十四部分 对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法规的要求，对本基金管理人于2016年1月8日刊登的本基金原招募说明书（《博时转债增强债券型证券投资基金更新招募说明书》）进行了更新，并根据本基金管理人对本基金实施的投资经营活动进行了内容补充和更新，主要补充和更新的内容如下：

- 1、在“三、基金管理人”中，对基金管理人的基本情况进行了更新；
- 2、在“四、基金托管人”中，对基金托管人的基本情况进行了更新；
- 3、在“五、相关服务机构”中，更新了相关服务机构的内容，各新增代销机构均在指定媒体上公告列示；
- 4、在“七、基金份额的申购、赎回与转换”中，更新了“（三）申购与赎回的数额限制”的内容；
- 5、在“八、基金的投资”中，更新了“（十二）基金投资组合报告”的内容，数据内容截止时间为 2016 年 3 月 31 日；
- 6、在“九、基金的业绩”中，更新了“自基金合同生效开始基金份额净值增长率”的数据及列表内容，数据内容截止时间为 2016 年 3 月 31 日；
- 7、在“二十一、其它应披露的事项”中根据最新情况对相关应披露事项进行了更新。

博时基金管理有限公司

2016 年 07 月 08 日