

限公司(石化转债)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。

中国石化上海石油化工股份有限公司于2014年1月12日发布公告，经国务院对山西省晋中“11·22”中石化东陈输油管道泄漏爆炸特别重大事故调查处理报告作出批复后，同意事故责任事故调查报告的调查处理和结果，认定一起特别重大生产安全责任；同意对事故有关责任单位和责任人依法进行处理。对中国石化及当地相关企业的三名责任人给予党纪处分和行政处分，对涉嫌犯罪的16名责任人移送司法机关依法追究法律责任。

根据该事故投资决策程序的情况说明：

对该事故的基金投资管理相对独立，以相应的研究报告为决策基础，结合其基金未增长前顺，由基金治理层决定具体执行行为。

2、基金投资运作过程中存在瑕疵，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票

11.3 投资组合构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	217,631.49
2	应收证券清算款	789,097.56
3	应收股利	-
4	应收利息	4,973,299.85
5	应收申购款	323,690.87
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,303,719.77

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)	占净值比例 (%)
1	113001	中期转债	387,475,953.60	50.31
2	110015	石化转债	271,582,827.00	35.26
3	113005	平安转债	217,448,693.00	28.23
4	113002	民生转债	106,954,976.70	13.89
5	110023	工银转债	99,480,476.80	12.92
6	113003	重工转债	60,299,600.00	7.82
7	110018	国信转债	33,312,405.60	4.32
8	110024	盛通转债	33,027,844.80	4.29

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	002065	东华软件	19,863,099.03	2.58	重大事项停牌

11.6 投资组合报告期内其他文字描述说明

由于四舍五入的原因，分项之和与合计之间可能存在尾差。

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。投资者购买基金并不等于将资金投资于特定个股或行业，基金的投资风险较高，投资者在做出投资决策之前应仔细阅读基金招募说明书。

本报告期基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较：

1、博时转债增强债券型基金的比较：

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—2011.12.31	-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	-	1.22%	-0.43%	0.08%	-	1.14%
2014.1.1—2014.9.30	11.89%	0.80%	7.02%	0.06%	4.87%	0.74%
2010.11.24—2014.9.30	-5.90%	0.81%	17.05%	0.08%	22.95%	0.73%

2、博时转债增强债券型基金的比较：

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—2011.12.31	-	0.17%	0.47%	0.08%	-1.07%	0.09%
2011.1.1—2011.12.31	10.66%	-	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%	-	1.13%
2014.1.1—2014.9.30	11.52%	0.79%	7.02%	0.06%	4.50%	0.73%
2010.11.24—2014.9.30	7.10%	0.80%	17.05%	0.08%	-	0.72%

三、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、基金财产的证券交易费用及其他费用（包括但不限于手续费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、经纪交易的结算费及其他类似性质的费用等）；

5、基金合同生效以后信息披露费用；

6、基金份额持有人大会费；

7、基金合同生效后发生的会计师费和律师费；

8、基金资产的审计费用；

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。

计算方法如下：
 $H = E \times 0.75\%$ ，当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。经基金管理人及基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月前首日起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。

计算方法如下：
 $H = E \times 0.20\%$ ，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。经基金管理人及基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月前首日起3个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

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率年费率为0.40%。

本基金销售服务费按照前一日C类基金资产净值的0.40%年费率计提。

计算方法如下：
 $H = E \times 0.40\%$ ，当年天数
H为C类基金份额前一日计提的销售服务费
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。经基金管理人及基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月前首日起3个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

4、本条第一款第（三）至第四项费用由基金管理人及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资产中计提的管理费、托管费、销售服务费的金额，并说明管理费中支付给基金中介机构的费用结构。

二、与基金销售有关的费用

1、申购费

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	按约定收取，1000元/笔

C类基金份额

申购费率	赎回费率
0%	0%

2、赎回费

表：本基金的赎回费率结构

A类基金份额	
持有时间Y	赎回费率
Y<1天	0.10%
1天≤Y≤2天	0.05%
Y≥2天	0%

C类基金份额

赎回费率	持有期限少于30日的基金全部赎回，赎回费率为0.75%；持有期限不少于30日（含30日）的基金全部赎回，不收取赎回费。
0.75%	

3、转换费

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差异情形而定。基金转换费用由基金持有人承担。

基金转出和转入的金额，在计算时，以该基金份额所对应的基金份额为基础。基金转出时赎回费的收取按照转出份额的赎回费率进行计算。基金转入时申购费的收取按照转入份额的申购费率进行计算。

三、不列入基金费用的项目

下列费用计入基金费用或由基金管理人承担，以及基金持有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管理人、基金托管人和基金持有人的其他应由各自承担的支出：

（一）基金管理人和基金托管人的报酬

基金管理人及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 对招募说明书更新情况的说明

《博时转债增强债券型证券投资基金招募说明书》（以下简称“《招募说明书》”）已于2014年9月20日在中国证监会指定网站进行了更新，主要内容如下：

一、在“八、基金的费用”中，更新了“（十二）基金投资估值报告”的内容，数据内容截至2014年9月30日。

二、在“九、基金的风险控制”中，更新了“（自基金合同生效之日起开始实施风险管理”的数据及内容，数据内容截至2014年9月30日。

三、在“十、其他重要事项”中，更新了以下事项：

（一）2014年11月07日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《关于博时转债增强债券型证券投资基金增加场外开放式基金销售渠道的公告》；

（二）2014年1