

博时转债增强债券型证券投资基金

2016 年年度报告摘要

2016 年 12 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：二〇一七年三月二十七日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2017 年 3 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	博时转债增强债券	
基金主代码	050019	
交易代码	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	
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	
报告期末基金份额总额	212,470,138.89 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	博时转债增强债券 A 类	博时转债增强债券 C 类
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	81,711,097.30 份	130,759,041.59 份

2.2 基金产品说明

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。
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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		博时基金管理有限公司	中国光大银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孙麒清	张建春
	联系电话	0755-83169999	010-63639180
	电子邮箱	service@bosera.com	zhangjianchun@cebbank.com
客户服务电话		95105568	95595
传真		0755-83195140	010-63639132

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.bosera.com
---------------------	---

基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处
------------	--------------

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

博时转债增强债券 A 类：

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016 年	2015 年	2014 年
本期已实现收益	-15,679,411.47	142,417,334.71	15,106,862.54
本期利润	-29,698,728.51	-8,523,715.45	340,025,897.66
加权平均基金份额本期利润	-0.3323	-0.0431	0.6442
本期基金份额净值增长率	-19.27%	1.11%	93.46%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配基金份额利润	0.3243	0.5617	0.0213
期末基金资产净值	108,211,960.25	160,066,782.55	708,447,540.82
期末基金份额净值	1.324	1.640	1.627

博时转债增强债券 C 类：

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016 年	2015 年	2014 年
本期已实现收益	-23,186,046.67	288,133,684.92	57,565,540.70
本期利润	-47,417,867.29	-35,555,407.78	421,236,235.00
加权平均基金份额本期利润	-0.3667	-0.0943	0.8680
本期基金份额净值增长率	-19.50%	1.00%	93.76%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配基金份额利润	0.3091	0.5510	0.0156
期末基金资产净值	171,182,394.92	207,561,429.20	1,392,409,283.40
期末基金份额净值	1.309	1.626	1.614

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。

上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 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

博时转债增强债券 A 类：

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	-4.82%	0.81%	-1.41%	0.12%	-3.41%	0.69%
过去六个月	-3.71%	0.64%	0.53%	0.09%	-4.24%	0.55%

过去一年	-19.27%	0.90%	2.12%	0.08%	-21.39%	0.82%
过去三年	57.92%	1.70%	20.98%	0.08%	36.94%	1.62%
过去五年	48.89%	1.44%	24.78%	0.08%	24.11%	1.36%
自基金合同生效起至今	32.81%	1.33%	32.32%	0.08%	0.49%	1.25%

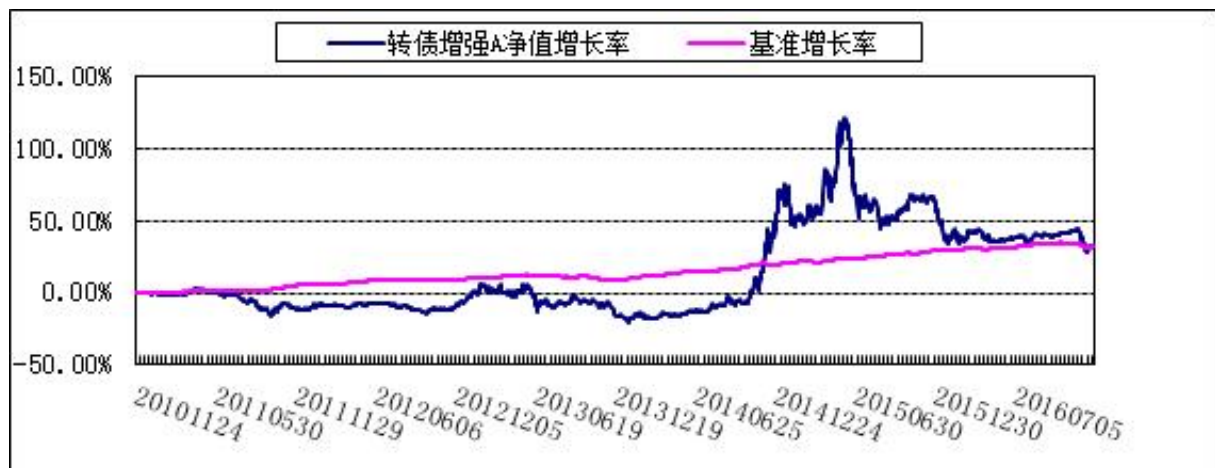
博时转债增强债券 C 类:

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	-4.80%	0.80%	-1.41%	0.12%	-3.39%	0.68%
过去六个月	-3.82%	0.63%	0.53%	0.09%	-4.35%	0.54%
过去一年	-19.50%	0.90%	2.12%	0.08%	-21.62%	0.82%
过去三年	57.54%	1.70%	20.98%	0.08%	36.56%	1.62%
过去五年	47.78%	1.44%	24.78%	0.08%	23.00%	1.36%
自基金合同生效起至今	31.23%	1.33%	32.32%	0.08%	-1.09%	1.25%

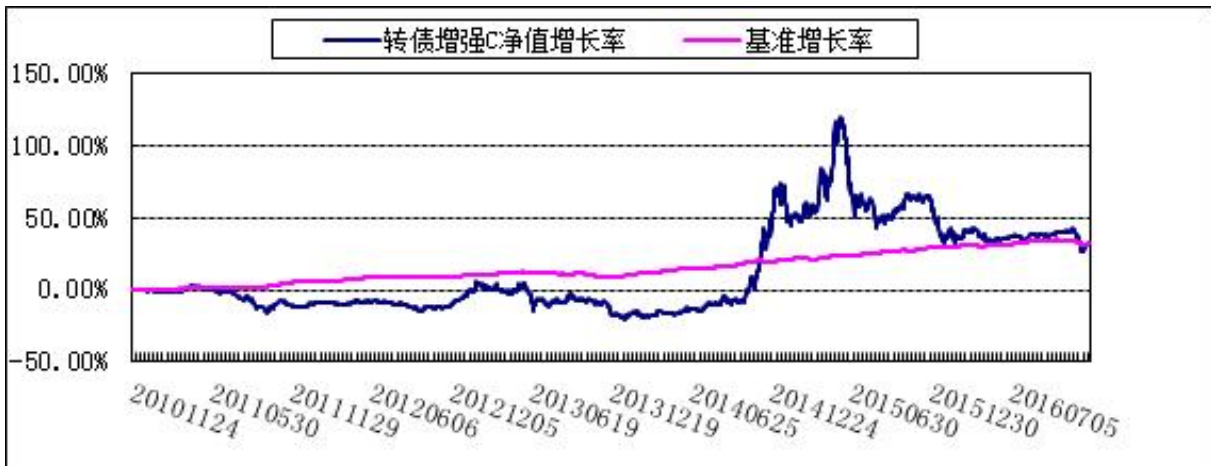
注：本基金的业绩比较基准为中证综合债指数收益率

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

博时转债增强债券 A 类

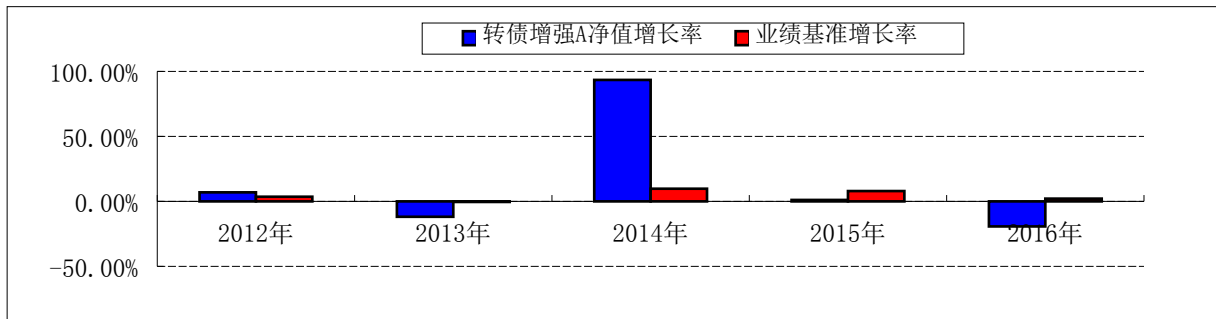


博时转债增强债券 C 类

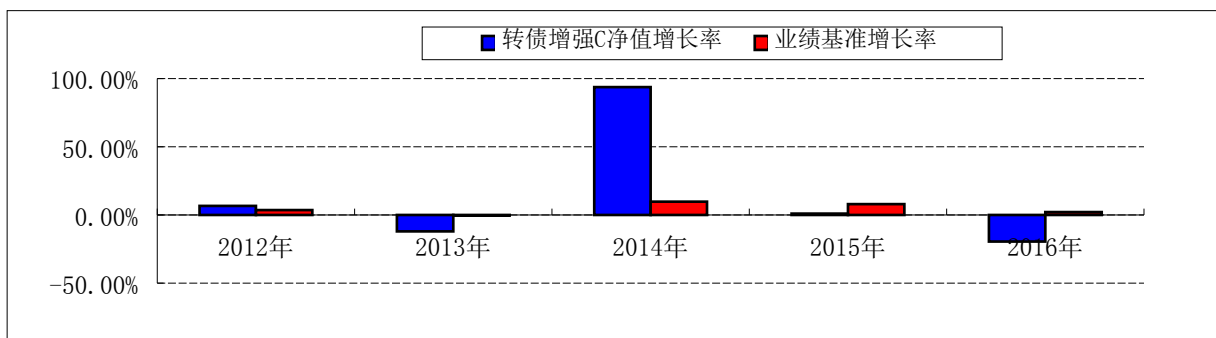


3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

博时转债增强债券 A 类



博时转债增强债券 C 类



3.3 过去三年基金的利润分配情况

博时转债增强债券 A 类:

单位: 人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2016 年	-	-	-	-	-
2015 年	0.050	1,673,866.61	1,024,425.35	2,698,291.96	2014 年度分红
2014 年	-	-	-	-	-
合计	0.050	1,673,866.61	1,024,425.35	2,698,291.96	-

博时转债增强债券 C 类:

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2016 年	-	-	-	-	-
2015 年	0.040	3,242,839.93	1,661,246.89	4,904,086.82	2014 年度分红
2014 年	-	-	-	-	-
合计	0.040	3,242,839.93	1,661,246.89	4,904,086.82	-

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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 2016 年 12 月 31 日，博时基金公司共管理 164 只开放式基金，并受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金，以及多个企业年金账户，管理资产总规模逾 6250 亿元人民币，其中公募基金规模逾 3760 亿元人民币，累计分红逾 781 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，养老金资产管理规模在同业中名列前茅。

1、基金业绩

根据银河证券基金研究中心统计，截至 2016 年年末，博时旗下共 94 只（份额分开计算）成立满一年的基金产品参与分类排名。其中排名在同类前 1/2 的产品共有 60 只（主动权益 17 只，债券 16 只，指数 20 只，货币 3 只，QDII 基金 4 只），约 64%；排名在前 1/3 的产品共有 45 只，约 48%；排名前 1/4 的产品共有 34 只，约 36%。博时旗下各类产品均有表现突出的产品位居行业前列。

黄金基金类，博时黄金 ETF (D 类) 今年以来净值增长率 19.10%，在同类 8 只排名第 1。

固收方面，长期标准债券型基金里，博时双月薪定期支付债券，今年以来净值增长率为 6.54%，在同类 61 只中排名第 2；博时信用债纯债（A 类），今年以来净值增长率为 4.23%，在同类中排名第 4；中短期标准债券型基金，博时安盈债券（A 类）今年以来净值增长率为 2.02%，在同类 66 只排名第 1；普通债券型基金里，博时稳定价值债券（A 类）今年以来净值增长率为 2.31%，在同类排名前 1/3；货币市场基金里，博时外服货币今年以来净值增长率为 3.03%，同类 194 只排名第 6。

QDII 基金，博时标普 500ETF 今年以来净值增长率 18.34%，同类排名前 1/4。博时亚洲票息收益债券(QDII)今年以来净值增长率 14.43%，同类排名第 3。

2、 其他大事件

2016 年 12 月 27 日，2016 金融新媒体峰会暨金 V 榜 2016 颁奖典礼在广州举行，博时基金荣获“最具传播力基金公司”奖项。

2016 年 12 月 13 日，由中国经营报主办的“2016 第十四届中国企业竞争力年会暨金融高峰论坛”在北京举行，博时基金荣获“2016 卓越竞争力品牌建设金融机构”奖项。

2016 年 12 月 9 日，在证券日报主办的“第十二届中国证券市场年会”上，博时基金荣膺中国证券市场“2016 年度最全能公募基金龙鼎奖”。

2016 年 12 月 8 日，金融界网站主办的首届智能金融国际论坛暨第五届金融界“领航中国”年度盛典，博时基金荣获“2016 年杰出品牌奖”。

2016 年 12 月 6 日，全国社会保障基金理事会发布公告，博时成为基本养老保险基金首批证券投资机构之一。

2016 年 12 月 1 日，由《经济观察报》主办的“2015-2016 年度观察家金融峰会”在沪举办，博时基金再次独家蝉联“卓越固定收益投资团队奖”。

2016 年 11 月 25 日，由北大汇丰商学院、南方都市报、奥一网联合主办的 2016 年（第二届）CFAC 中国金融年会在深召开，博时基金再次蝉联“年度最佳基金公司大奖”。

2016 年 11 月 23 日，由新浪财经主办的“2016 新浪全球资产管理论坛”在京举行，“2016 中国（首届）波特菲勒奖综合评选”结果揭晓。博时基金荣获“2016 最具互联网创新基金公司”、基金经理过钧获评“2016 最佳债券基金经理”、何凯获“2016 最佳 QDII 基金经理”。本届波特菲勒奖博时基金共斩获三项大奖，成为获奖最多的公募基金公司之一。

2016 年 11 月 17 日，全国社保基金境内投资管理人 2016 年座谈会在上海举行，博时基金副总裁董良泓荣获“五年服务社保奖”，该奖项授予长期为社保服务且业绩优秀的投资管理人，本次仅授予 5 人，董良泓先生是自 2015 年之后再次蝉联该奖项。

2016 年 9 月 7 日，第二届结构性融资与资产证券化论坛暨 2016 年度资产证券化·介甫奖颁奖典礼上，“博时资本-平安银行橙鑫橙 e 资产支持专项计划”荣获“应收账款类最受投资者欢迎产品”和“最佳风控产品”两项大奖。

2016 年 8 月 5 日，由 21 世纪经济报道主办的“2016 深港通论坛暨 ‘金帆奖’ 系列颁奖礼上，博时一举斩获 2016 年综合实力十强基金公司奖、2016 年互联网突出表现奖、2016 年 ABS 最具实力管理人奖（博时资本）三项大奖。

2016 年 6 月 24 日，由南方日报主办的一年一度 “金榕奖” 南方金融大奖系列评选正式揭晓，博时基金董事长张光华荣膺 “2016 南方金融领导力年度大奖”，博时基金基金经理魏桢荣获 “2016 南方金融年度投资理财师” 称号。

由中国基金报、香山财富论坛、深圳市政府金融办、国泰基金联合主办的“中国机构投资者峰会暨财富管理国际论坛” 2016 年 5 月 13 日在深举行。博时旗下博时信用债券获得 “五年持续回报积极债券型明星基金奖”。

2016 年 5 月 10 日，由上海证券报主办的 2016 中国基金业峰会暨第十三届 “金基金” 奖颁奖典礼在上海举办，博时基金荣获 “2015 年度金基金·债券投资回报基金管理公司” 大奖。

2016 年 4 月 15 日，由中国基金报主办的第三届中国基金业英华奖评选揭晓，博时基金经理过钧先生获评三年期二级债基最佳基金经理、五年期二级债基最佳基金经理。

2016 年 3 月 27 日，第十三届中国基金业金牛奖揭晓，博时基金摘得了基金业的 “奥斯卡” 奖— “固定收益投资金牛基金公司” 奖。

2016 年 3 月 15 日，由腾讯证券主办的《“挑战 机遇” 315 评选——投资者最认同的券商、基金领军人物》评选活动日前揭晓，博时基金董事长张光华先生获评 “投资者最认同的公募基金领军人物”，网络票选高居第二位。

2016 年 1 月 18 日，大众证券报 “2015 中国基金风云榜” 上，博时创业成长（050014）荣获 2015 “最受投资者喜爱基金” 奖、博时安丰 18 个月定开债（160515）荣获 2015 “最佳固定收益型基金” 奖。

2016 年 1 月 15 日，2016 年金融理财创新与发展论坛暨第六届 “金貔貅” 奖颁奖在京举办，博时基金获评年度金牌品牌力、金牌创新力两项大奖；博时 “存金宝” 获年度金牌创新力金融产品奖。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
邓欣雨	基金经理	2013-09-25	-	8.5	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兼博时双债增强债券基金、博时裕利纯债债券基金、博时聚瑞纯债债券基金、博时泰和债券基金、博时聚盈纯债债券基金、博时景发纯债债券基金、博时聚润纯债债券基金、博时利发纯债债券基金、博时富发纯债债券基金、博时悦楚纯债债券基金、博时聚利纯债债券基金、博时富祥纯债债券基金、博时慧选纯债债券基金、博时兴盛货币基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

报告期内，根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关要求，公司进一步完善了《公平交易管理制度》，通过系统及人工相结合的方式，分别对一级市场及二级市场的权益类及固定收益类投资的公平交易原则、流程，按照境内及境外业务进行了详细规范，同时也通过强化事后分析评估监督机制来确保公司公平对待管理的不同投资组合。

4.3.2 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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年，不寻常的一年，英国脱欧，特朗普上台，A 股熔断，国债期货跌停，全球货币政策也开始出现转向的迹象，国内呈现出以股票市场的快速下跌开始并以债券市场的快速下跌收尾局面，蓦然回首，现金为王，当然大宗商品走出一波壮阔的大超预期牛市除外。受股票市场低迷表现和债券市场流动性冲击，可转债市场双向承压，另外年初时可转债估值本来就偏高，多重负面因素使得可转债下跌幅度超出股票市场和债券市场。本组合受制于可转债最低仓位要求，表现令人失望，虽然在可转债投资较为谨慎。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 12 月 31 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.324 元，份额累计净值为 1.329 元；C 类基金份额净值为 1.309 元，份额累计净值为 1.313 元。报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为-19.27%，C 类基金份额净值增长率为-19.50%，同期业绩基准增长率 2.12%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，首先经历 2016 年 12 月份的大幅调整后，可转债市场（含可交换债）估值有了明显的改善，个券绝对价格也基本回落到 110 元左右或以下，且有过半数个券的到期收益率为正，相对安全性明显提高，但机会是否已出现，这取决于股票市场能否走稳并有所上行。而从中观行业和企业微观数据观察看，短期经济下行压力明显减轻，企业整体经营效益好转，相信短期内企业业绩会给股票市场提供一定支撑，当然也考虑到金融监管和去杠杆可能带来的事件性风险冲击，我们对股市持谨慎乐观态度，在股市不出现大问题前提下，可转债市场的投资情绪会有所恢复，结合前面所述可转债市场综合情况，相对纯债市场来说，可转债市场获得超额收益的机会更大，在当前难以判断股市有大行情下，可转债市场仍可能处于磨底阶段。本组合在采取中性偏上仓位情况下，会优先选择基本面好的上市公司的品种，以待市场更为明朗。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人的经营运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，在完善内部控制制度和流程手册的同时，推动内控体系和制度措施的落实；强化对基金投资运作和公司经营管理的合规性监察，通过实时监控、定期检查、专项检查等方式，及时发现情况，提出改进建议并跟踪改进落实情况。公司监察法律部对公司遵守

各项法规和管理制度及旗下各基金履行合同义务的情况进行核查，发现违规隐患及时与有关业务人员沟通并向管理层报告，定期向公司董事、总经理和监管部门出具监察稽核报告。

2016 年，我公司根据法律、法规的规定，制定、修订和完善了《博时货币市场基金投资管理制度》、《博时基金国债期货投资管理流程手册》、《博时基金国债期货风险管理流程手册》、《博时基金流动性风险管理制度》、《关联交易管理办法》、《交易部公平交易管理制度》、《博时 ETF 基金风险管理制度》、《博时基金反洗钱工作手册》、《开放式基金业务规则》等制度和流程手册等制度。定期更新了各公募基金的《投资管理细则》，以制度形式明确了投资管理相关的内部流程及内部要求。不断完善“博时客户关系管理系统”、“博时投资决策支持系统”等管理平台，加强了公司的市场体系、投研体系和后台运作的风险监控工作。在新基金发行和老基金持续营销的过程中，严格规范基金销售业务，按照《证券投资基金销售管理办法》的规定审查宣传推介材料，选择有代销资格的代销机构销售基金，并努力做好投资者教育工作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，设立了博时基金管理有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），制定了估值政策和估值程序。估值委员会成员由主管运营的副总经理、督察长、投资总监、研究部负责人、风险管理部负责人、运作部负责人等成员组成，基金经理原则上不参与估值委员会的工作，其估值建议经估值委员会成员评估后审慎采用。估值委员会成员均具有 5 年以上专业工作经历，具备良好的专业经验和专业胜任能力，具有绝对的独立性。估值委员会的职责主要包括有：保证基金估值的公平、合理；制订健全、有效的估值政策和程序；确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性；定期对估值政策和程序进行评价等。

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管银行有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提

供在银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

收益分配原则：基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值，基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截止日；在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年最多为 4 次；每次基金收益分配比例不得低于期末（收益分配基准日）可供分配利润的 20%。基金的收益分配比例以期末可供分配利润为基准计算，期末可供分配利润以期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数为准。基金合同生效不满三个月，收益可不分配。

根据相关法律法规和基金合同的要求以及本基金的实际运作情况，本报告期内本基金未进行收益分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2016 年度，中国光大银行股份有限公司在博时转债增强债券型证券投资基金托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对博时转债增强债券型证券投资基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2016 年度，中国光大银行股份有限公司依据《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人——博时基金管理有限公司的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金

合同及实际运作情况进行处理。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人——博时基金管理有限公司编制的“博时转债增强债券型证券投资基金 2016 年年度报告”进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确。

§ 6 审计报告

本报告已经普华永道中天会计师事务所审计并出具了无保留意见的审计报告。投资者欲了解审计报告详细内容，可通过登载于博时基金管理公司网站的年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：博时转债增强债券型证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	27,583,208.82	7,934,853.16
结算备付金	2,091,242.80	10,170,646.27
存出保证金	52,117.31	196,552.92
交易性金融资产	316,358,498.47	474,876,071.94
其中：股票投资	26,668,623.14	69,491,679.04
基金投资	-	-
债券投资	289,689,875.33	405,384,392.90
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	74,976,158.10
应收利息	995,747.53	805,891.10
应收股利	-	-
应收申购款	42,572.45	68,807.45

递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	347,123,387.38	569,028,980.94
负债和所有者权益	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	47,000,000.00	200,000,000.00
应付证券清算款	20,016,666.67	-
应付赎回款	168,473.73	757,809.27
应付管理人报酬	205,152.31	240,355.81
应付托管费	54,707.28	64,094.86
应付销售服务费	71,839.62	72,829.02
应付交易费用	51,055.21	85,546.08
应交税费	-	-
应付利息	1,040.47	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	160,096.92	180,134.15
负债合计	67,729,032.21	201,400,769.19
所有者权益:		
实收基金	212,470,138.89	225,290,346.35
未分配利润	66,924,216.28	142,337,865.40
所有者权益合计	279,394,355.17	367,628,211.75
负债和所有者权益总计	347,123,387.38	569,028,980.94

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额总额 212,470,138.89 份。其中 A 类基金份额净值 1.324 元，基金份额总额 81,711,097.30 份；C 类基金份额净值 1.309 元，基金份额总额 130,759,041.59 份。

7.2 利润表

会计主体：博时转债增强债券型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年12月31日
一、收入	-70,799,740.37	-23,239,160.58
1. 利息收入	3,380,377.90	10,869,344.80
其中：存款利息收入	263,862.07	899,687.85
债券利息收入	3,081,900.30	9,827,973.17

资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	34,615.53	141,683.78
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-36,185,005.52	436,042,513.70
其中：股票投资收益	-20,546,083.41	85,920,425.20
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-15,807,855.31	349,827,464.50
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	168,933.20	294,624.00
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-38,251,137.66	-474,630,142.86
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	256,024.91	4,479,123.78
减：二、费用	6,316,855.43	20,839,962.65
1. 管理人报酬	2,266,980.00	7,144,732.51
2. 托管费	604,528.03	1,905,261.96
3. 销售服务费	709,875.65	2,494,826.18
4. 交易费用	331,635.24	2,187,479.31
5. 利息支出	2,006,436.51	6,684,359.17
其中：卖出回购金融资产支出	2,006,436.51	6,684,359.17
6. 其他费用	397,400.00	423,303.52
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-77,116,595.80	-44,079,123.23
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-77,116,595.80	-44,079,123.23

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：博时转债增强债券型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	225,290,346.35	142,337,865.40	367,628,211.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-77,116,595.80	-77,116,595.80
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-12,820,207.46	1,702,946.68	-11,117,260.78

(净值减少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	101,477,490.34	40,022,968.49	141,500,458.83
2. 基金赎回款	-114,297,697.80	-38,320,021.81	-152,617,719.61
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	212,470,138.89	66,924,216.28	279,394,355.17
项目	上年度可比期间		
	2015年1月1日至2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,298,476,484.21	802,380,340.01	2,100,856,824.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-44,079,123.23	-44,079,123.23
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-1,073,186,137.86	-608,360,972.60	-1,681,547,110.46
其中：1. 基金申购款	954,287,856.35	658,521,304.34	1,612,809,160.69
2. 基金赎回款	-2,027,473,994.21	-1,266,882,276.94	-3,294,356,271.15
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-7,602,378.78	-7,602,378.78
五、期末所有者权益(基金净值)	225,290,346.35	142,337,865.40	367,628,211.75

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：江向阳 主管会计工作负责人：王德英 会计机构负责人：成江

7.4 报表附注

7.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.3 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
博时基金管理有限公司(“博时基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国光大银行股份有限公司(“光大银行”)	基金托管人、基金销售机构
招商证券股份有限公司(“招商证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
中国长城资产管理股份有限公司	基金管理人的股东
广厦建设集团有限责任公司	基金管理人的股东

天津港(集团)有限公司	基金管理人的股东
上海汇华实业有限公司	基金管理人的股东
上海盛业股权投资基金有限公司	基金管理人的股东
博时资本管理有限公司	基金管理人的子公司
博时基金(国际)有限公司	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.4.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
招商证券	196,205,230.98	81.00%	1,099,296,438.49	80.26%

7.4.4.1.2 权证交易

无。

7.4.4.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券	138,833.82	80.60%	17,653.95	34.58%
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券	769,872.06	79.97%	58,271.02	68.30%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2016年1月1日至2016年 12月31日	2015年1月1日至2015年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,266,980.00	7,144,732.51
其中：支付销售机构的客户维护费	697,076.88	2,126,908.82

注：支付基金管理人博时基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.75% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.75\% / \text{当年天数}。$$

7.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月 31日
当期发生的基金应支付的托管费	604,528.03	1,905,261.96

注：支付基金托管人光大银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

7.4.4.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的 各关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博时转债增强债券 A 类	博时转债增强债券 C 类	合计
博时基金	-	81,122.29	81,122.29
光大银行	-	250,855.51	250,855.51
招商证券	-	702.22	702.22
合计	-	332,680.02	332,680.02
获得销售服务费的 各关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博时转债增强债券A类	博时转债增强债券C类	合计
博时基金	-	342,232.21	342,232.21
光大银行	-	440,281.81	440,281.81
招商证券	-	4,579.02	4,579.02
合计	-	787,093.04	787,093.04

注：A 类基金份额不收取销售服务费。支付基金销售机构的 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给博时基金，再由博时基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金资产净值} \times 0.40\% / \text{当年天数}。$$

7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况
7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

7.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
光大银行	27,583,208.82	109,001.34	7,934,853.16	400,860.72

注：本基金的银行存款由基金托管人光大银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2016年1月1日至2016年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:张)	总金额
光大银行	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:张)	总金额
光大银行	1F1712	15 华电 SCP012	簿记建档 集中配售	300,000.00	29,988,900.00

7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.5 期末(2016年12月31日)本基金持有的流通受限证券
7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值 单价	复牌 日期	复牌开 盘单价	数量(单位: 股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	------	------	------------	----------	------------	--------------	--------	--------	----

603111	康尼机电	2016-12-26	公告重大 事项	14.70	-	-	249,868	3,085,961.51	3,673,059.60	-
--------	------	------------	------------	-------	---	---	---------	--------------	--------------	---

注：本基金截至 2016 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 47,000,000.00 元，于 2017 年 1 月 3 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

7.4.6 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 262,946,506.47 元，属于第二层次的余额为 53,411,992.00 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 432,025,507.86 元，第二层次 42,850,564.08 元，无属第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债

券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产
(2015 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	26,668,623.14	7.68
	其中：股票	26,668,623.14	7.68
2	固定收益投资	289,689,875.33	83.45
	其中：债券	289,689,875.33	83.45
	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	29,674,451.62	8.55
7	其他各项资产	1,090,437.29	0.31
8	合计	347,123,387.38	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值
----	------	------	---------

			比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	26,668,623.14	9.55
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	-	-
J	金融业	-	-
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	26,668,623.14	9.55

8.3 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600104	上汽集团	210,000	4,924,500.00	1.76
2	002456	欧菲光	119,903	4,110,274.84	1.47
3	002273	水晶光电	204,973	4,078,962.70	1.46
4	002684	猛狮科技	119,700	3,899,826.00	1.40
5	603111	康尼机电	249,868	3,673,059.60	1.31
6	600887	伊利股份	200,000	3,520,000.00	1.26
7	000651	格力电器	100,000	2,462,000.00	0.88

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002273	水晶光电	16,357,961.02	4.45
2	601377	兴业证券	7,145,754.00	1.94
3	603111	康尼机电	6,653,626.51	1.81

4	600535	天士力	6,563,888.27	1.79
5	002456	欧菲光	6,310,676.96	1.72
6	002684	猛狮科技	5,621,584.15	1.53
7	600104	上汽集团	5,350,953.39	1.46
8	300360	炬华科技	5,324,185.00	1.45
9	000651	格力电器	5,309,561.00	1.44
10	002590	万安科技	4,416,507.55	1.20
11	600585	海螺水泥	4,377,859.82	1.19
12	601688	华泰证券	4,279,348.00	1.16
13	600887	伊利股份	3,779,350.00	1.03
14	002049	紫光国芯	3,505,428.00	0.95
15	002460	赣锋锂业	3,073,237.00	0.84
16	600502	安徽水利	2,974,906.00	0.81
17	000666	经纬纺机	2,942,666.34	0.80
18	600755	厦门国贸	2,818,953.52	0.77
19	300291	华录百纳	2,747,756.75	0.75
20	600219	南山铝业	2,745,744.00	0.75

注：本项“买入金额”均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002273	水晶光电	11,864,327.50	3.23
2	603308	应流股份	9,135,562.29	2.49
3	600535	天士力	6,772,100.74	1.84
4	002049	紫光国芯	6,076,999.00	1.65
5	601377	兴业证券	5,996,961.80	1.63
6	601989	中国重工	5,877,731.00	1.60
7	600030	中信证券	5,595,000.00	1.52
8	601318	中国平安	5,407,349.17	1.47
9	300360	炬华科技	5,025,040.76	1.37
10	002590	万安科技	4,852,995.50	1.32
11	300291	华录百纳	4,838,858.94	1.32
12	600654	中安消	4,718,212.18	1.28
13	000040	东旭蓝天	4,532,804.75	1.23
14	603111	康尼机电	4,336,413.00	1.18
15	600585	海螺水泥	4,106,657.50	1.12
16	601688	华泰证券	3,657,299.99	0.99
17	600325	华发股份	3,470,948.00	0.94
18	600893	中航动力	3,403,888.12	0.93
19	300058	蓝色光标	3,395,371.00	0.92

20	600502	安徽水利	3,318,080.00	0.90
----	--------	------	--------------	------

注：本项“卖出金额”均按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	109,721,565.81
卖出股票的收入（成交）总额	132,558,686.87

注：本项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	5,849,385.90	2.09
2	央行票据	-	-
3	金融债券	19,672,000.00	7.04
	其中：政策性金融债	19,672,000.00	7.04
4	企业债券	9,622,000.00	3.44
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	254,546,489.43	91.11
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	289,689,875.33	103.68

8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	132001	14 宝钢 EB	756,140	85,602,609.40	30.64
2	110035	白云转债	324,330	40,398,544.80	14.46
3	128009	歌尔转债	247,648	29,955,502.08	10.72
4	132006	16 皖新 EB	194,900	22,208,855.00	7.95
5	160208	16 国开 08	200,000	19,672,000.00	7.04

8.7 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。

8.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期末本基金未投资股指期货交易。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期末本基金未投资国债期货交易。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

8.12.2 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。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	52,117.31
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	995,747.53
5	应收申购款	42,572.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,090,437.29

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	132001	14 宝钢 EB	85,602,609.40	30.64
2	110035	白云转债	40,398,544.80	14.46
3	128009	歌尔转债	29,955,502.08	10.72
4	132004	15 国盛 EB	18,882,557.60	6.76
5	113008	电气转债	14,595,546.50	5.22
6	110034	九州转债	13,586,449.50	4.86
7	132003	15 清控 EB	10,403,366.40	3.72
8	128010	顺昌转债	5,238,907.47	1.88

9	132002	15 天集 EB	3,555,746.10	1.27
10	132005	15 国资 EB	485,070.00	0.17

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	603111	康尼机电	3,673,059.60	1.31	公告重大事项

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
博时转债增强债券 A 类	5,302	15,411.37	612,784.71	0.75%	81,098,312.59	99.25%
博时转债增强债券 C 类	6,324	20,676.64	18,197,631.61	13.92%	112,561,409.98	86.08%
合计	11,626	18,275.43	18,810,416.32	8.85%	193,659,722.57	91.15%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	博时转债增强债券 A 类	34,449.54	0.04%
	博时转债增强债券 C 类	29,730.10	0.02%
	合计	64,179.64	0.03%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	博时转债增强债券 A 类	-
	博时转债增强债券 C 类	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	博时转债增强债券 A 类	-
	博时转债增强债券 C 类	-
	合计	-

注：1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金；
 2、本基金的基金经理未持有本基金。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	博时转债增强债券 A 类	博时转债增强债券 C 类
基金合同生效日（2010 年 11 月 24 日）基金份额总额	1,553,165,897.13	2,081,601,789.62
本报告期期初基金份额总额	97,607,750.37	127,682,595.98
本报告期基金总申购份额	9,230,806.40	92,246,683.94
减：本报告期基金总赎回份额	25,127,459.47	89,170,238.33
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	81,711,097.30	130,759,041.59

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金提供审计服务。本报告期内本基金应付审计费 60,000 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	2	196,205,230.98	81.00%	138,833.82	80.60%	-
中泰证券	1	46,032,161.70	19.00%	33,411.48	19.40%	-
长江证券	1	-	-	-	-	-

注：本基金根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基字[2007]48号）的有关规定要求，本公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向多家券商租用了基金专用交易席位。

1、基金专用交易席位的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易席位的选择程序如下：

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构；
- (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
招商证券	270,037,765.05	51.73%	18,428,000,000.00	89.15%	-	-
中泰证券	252,002,283.95	48.27%	2,243,900,000.00	10.85%	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-

博时基金管理有限公司
二〇一七年三月二十七日