(上接40版)

⑾ 厦门证券有限公司
注册地址:厦门市莲前西路二号莲富大厦十七楼
办公地址:厦门市莲前西路二号莲富大厦十七楼
法定代表人:傅毅辉
联系人:卢金文
电话:0592-5161816
传真:0592-5161102
客户服务电话:0592-5163588
网址:http://www.xmzq.cn

⑿ 双建证券有限责任公司
注册地址:上海市南京西路758号23楼
办公地址:上海市浦东新区世纪大道1600号32楼
法定代表人:郭林
联系人:陈敏
电话:021-32229888
传真:021-68728703
客户服务电话:021-63340678
网址:http://www.ajzq.com

⒀ 天证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层
办公地址:深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层
法定代表人:赵文安
联系人:刘晓章
电话:0755-83007190
传真:0755-83007167
客户服务电话:0755-26982993
网址:http://www.ydsc.com.cn

二、注册登记机构
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: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:吕红、安冬

四、会计师事务所和经办注册会计师
机构名称:普华永道中天会计师事务所有限公司
注册地址: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:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
法人代表:杨绍信
电话:021-23238888
传真:021-23238800
联系人:金毅
经办注册会计师:汪棵、金毅

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。

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

⑴ 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、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

⑴ 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,在控制管理并松弛组合风险的前提下,为组合增加最大的收益。

⑵ 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。

⑶ 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子业走势,确定各类债券投资比例。

⑷ 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。

⑸ 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。

⑹ 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。

⑴ 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,可转债与股票形或联系,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可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。

⑵ 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目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可转债定价的核心,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。

⑶ 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战略,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。

⑷ 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需要求时,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。

⑸ 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:

⑴ 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。

⑵ 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:

⑴ 股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。

⑵ 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。

⑶ 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。

⑷ 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。

⑸ 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。

⑹ 监察法律部对投资的全过程进行合规风险监控。

⑺ 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。

⑻ 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,或有更具权威、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2012年9月30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	362,008,553.09	12.59
	其中:股票	362,008,553.09	12.59
2	固定收益投资	2,405,813,856.90	83.70
	其中:债券	2,405,813,856.90	83.70
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	94,262,901.73	3.28
6	其他各项资产	12,291,921.59	0.43
7	合计	2,874,377,233.31	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	采掘业	3,000.00	0.00
C	制造业	4,259,449.04	0.20
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	4,259,449.04	0.20
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	160,433,674.05	7.57
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	197,312,430.00	9.31
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	362,008,553.09	17.08

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	601006	大秦铁路	32,346,300	197,312,430.00	9.31
2	600886	国投电力	27,043,431	114,934,581.75	5.42
3	600674	川投能源	3,854,727	26,597,616.30	1.25
4	600795	国电电力	7,875,615	18,901,476.00	0.89
5	002031	巨轮股份	749,903	4,259,449.04	0.20
6	603993	洛阳钼业	1,000	3,000.00	0.00

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	80,120,000.00	3.78
2	央行票据	-	-
3	金融债券	226,819,000.00	10.70
	其中:政策性金融债	226,819,000.00	10.70
4	企业债券	65,378,250.00	3.08
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	2,033,496,606.90	95.92
8	其他	-	-
9	合计	2,405,813,856.90	113.48

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	113001	中行转债	7,562,920	727,250,387.20	34.30
2	113002	工行转债	6,823,180	689,141,180.00	32.51
3	110018	国电转债	1,762,680	184,799,371.20	8.72
4	110013	国投转债	1,634,480	169,691,713.60	8.00
5	110015	石化转债	1,637,570	159,335,561.00	7.52

6、本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、本基金本报告期末未持有权证。

8、投资组合报告附注

⑴ 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。

⑵ 基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

⑶ 基金的其他资产包括:

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	250,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	11,891,271.12
5	应收申购款	150,650.47
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,291,921.59

⑷ 报告期末持有处于转股期的可转换债券。

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产的净值比例(%)
1	113001	中行转债	727,250,387.20	34.30
2	113002	工行转债	689,141,180.00	32.51
3	110018	国电转债	184,799,371.20	8.72
4	110013	国投转债	169,691,713.60	8.00
5	110015	石化转债	159,335,561.00	7.52

⑸ 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)	占基金资产的净值比例(%)	流通受限情况说明
1	603993	洛阳钼业	3,000.00	0.00	新股流通受限

⑹ 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年11月24日至2010年12月31日	-0.60%	0.19%	0.47%	0.08%	-1.07%	0.11%
2011年1月1日至2011年12月31日	-10.26%	0.59%	5.55%	0.11%	-15.81%	0.48%
2012年1月1日至2012年6月30日	3.59%	0.46%	2.97%	0.07%	0.62%	0.39%
2010年11月24日至2012年9月30日	-12.60%	0.51%	9.15%	0.09%	-21.75%	0.42%

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年11月24日至2010年12月31日	-0.60%	0.17%	0.47%	0.08%	-1.07%	0.09%
2011年1月1日至2011年12月31日	-10.66%	0.59%	5.55%	0.11%	-16.21%	0.48%
2012年1月1日至2012年6月30日	3.38%	0.45%	2.97%	0.07%	0.41%	0.38%
2010年11月24日至2012年9月30日	-13.20%	0.51%	9.15%	0.09%	-22.35%	0.42%

第十三部分 基金费用与税收

一、与基金运作有关的费用

⑴ 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。

⑵ 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×0.75%÷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×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×0.40%÷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》、《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》及其它有关法律法规的要求,对本基金管理人于2012年7月7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招募说明书更新2012年第1号)进行了更新,主要更新的内容如下:

1.在"三、基金管理人"中,对基金管理人博时基金管理公司的基本情况、部门设置、人员结构及投资决策委员会成员进行了更新;

2.在"四、基金托管人"中,对基金托管人的基本情况及基金托管情况等相关业务经营情况进行了更新;

3.在"五、相关服务机构"中,更新了相关服务机构的内容,增加了新增的代销机构;

4.在"八、基金的投资"中,更新了"十二、基金投资组合报告",数据内容截止时间为2012年9月30日,财务数据未经审计;

5.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及其与同期业绩比较基准收益率的比较"的数据及列表内容,数据内容截止时间为2012年9月30日;6.在"二十一、其它应披露的事项"中,按露了如下事项:

(一)2012年6月5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《关于博时基金管理有限公司旗下部分开放式基金增加金华银行股份有限公司为代销机构的公告》;

(二)2012年6月8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《关于博时基金管理有限公司旗下部分开放式基金新增诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司为代销机构的公告》;

(三)2012年7月12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《关于博时基金管理有限公司旗下部分开放式基金增加江苏常熟农村商业银行股份有限公司为代销机构的公告》;

(四)2012年7月13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《关于博时基金管理有限公司旗下部分开放式基金新增西部证券股份有限公司为代销机构的公告》;

(五)2012年7月20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《博时转债增强债券型证券投资基金2012年第2季度报告》;

(六)2012年8月1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《关于博时基金管理有限公司旗下部分开放式基金增加嘉兴银行股份有限公司为代销机构的公告》;

(七)2012年8月25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《博时转债增强债券型证券投资基金2012年半年度报告(摘要)》;

(八)2012年8月28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《关于博时旗下部分基金增加江阴农村商业银行为代销机构的公告》;

(九)2012年9月8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《关于博时基金参加河北银行网银申购和定投申购费率优惠活动的公告》;

(十)2012年9月28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《关于博时旗下部分基金增加北京展恒基金销售有限公司为代销机构的公告》;

(十一)2012年10月11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《关于博时公司旗下部分基金增加东海证券为代销机构的公告》;

(十二)2012年10月18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《关于博时旗下部分基金增加浙江同花顺基金销售有限公司为代销机构的公告》;

(十三)2012年10月25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《博时转债增强债券型证券投资基金2012年第3季度报告》;

(十四)2012年10月26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《关于博时旗下部分基金增加温州银行股份有限公司为代销机构的公告》;

(十五)2012年10月29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《关于博时旗下部分基金参加展恒基金销售公司非现场交易费率优惠活动的公告》;

(十六)2012年10月30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《关于博时旗下部分基金参加众禄基金销售公司网银申购及定期定额申购费率优惠活动的公告》、《关于博时旗下部分基金增加深圳众禄基金销售有限公司为代销机构的公告》;

(十七)2012年11月9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《关于博时旗下部分基金参加长量基金销售公司非现场交易费率优惠活动的公告》、《关于博时旗下部分基金增加长量基金销售公司为代销机构的公告》;

(十八)2012年11月16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《关于博时旗下部分基金参加杭州数米基金销售有限公司定投及申购费率优惠活动的公告》、《关于博时旗下部分基金增加杭州数米基金销售有限公司为代销机构的公告》;

(十九)2012年11月21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《博时基金管理有限公司关于通联支付光大银行渠道暂停对博时旗下部分基金的网上支付服务的公告》;

博时基金管理有限公司
2013年1月8日

证券代码:600139 证券简称:西部资源 公告编号:临2013-001号

四川西部资源控股股份有限公司关于竞购维西凯龙矿业有限责任公司股权的摘牌公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,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。

凉山矿业股份有限公司等三位股东于2012年11月30日在北京产权交易所,以挂牌价18,376.98万元出让其持有的维西凯龙矿业有限责任公司(以下简称"维西凯龙")合计100%的股权,根据公司第七届董事会第十九次会议决议,公司参与了上述股权的竞购。

近日,公司收到北京产权交易所通知,本公司成为维西凯龙100%股权的最终受让方,成交价格为挂牌价18,376.98万元人民币。2013年1月5日,公司与各股权转让方分别签署了《产权交易合同》,公司将按照合同约定或北京产权交易所的要求,全部用自有资金支付交易价款,并尽快完成维西凯龙的股权变更工商登记等相关手续。

本次摘牌与公司2012年12月28日在《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》及上海证券交易所网站公告的内容不存在重大不一致的情形。

备查文件:

《产权交易合同》

特此公告

四川西部资源控股股份有限公司
董事会
2013年1月8日

证券代码:600139 证券简称:西部资源 公告编号:临2013-002号

四川西部资源控股股份有限公司关于受让维西凯龙矿业有限责任公司股权所涉矿业权公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,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。

重要内容提示:

1、四川西部资源控股股份有限公司(以下简称"西部资源"或"公司")通过北京产权交易所摘牌获得维西凯龙矿业有限责任公司(以下简称"维西凯龙")100%股权所取得的铜矿采矿权一项和探矿权一项,为维西凯龙合法取得并持有。

维西凯龙已将其探矿权勘查面积中的约10平方公里勘查区的使用权及收益权转让给重庆银坤矿业开发(集团)有限责任公司(以下简称"银坤矿业"),尚需履行批准程序。本次的评估作价主要是针对其余的约9.02平方公里的勘查区而进行。

2、维西凯龙拥有的"大宝山铜矿采矿权"和"云南省维西县大宝山—长土坡铜多金属矿探矿权",均已取得云南省国土资源厅(以下简称"云南国土厅")颁发的许可证。

根据云南国土厅出具的《关于云南省维西县大宝山铜矿普查报告(矿产资源储量评审备案证明)》,大宝山铜矿保有的资源储量铜矿石量197.31万吨,铜金属42,360.06吨,品位2.15%;伴生银金属量114.67吨,品位58.12g/t。

根据《大宝山铜矿地质工作报告》,估算大宝山铜矿拥有铜334资源量10.91万吨,伴生银334资源量275.80吨。

3、维西凯龙取得的生产建设属试验性建设,现处于停产状态。公司在本次收购完成后将加大勘探力度,并在增储的基础上,拟在大宝山铜矿建成生产规模为60-100万吨/年的选矿厂、采矿等采选工程设施,以达到资源开采效益最大化。

一、交易概述

(一)本次交易的基本情况

凉山矿业股份有限公司等三位股东于2012年11月30日在北京产权交易所,以挂牌价18,376.98万元出让其持有的维西凯