博时稳健回报债券型证券投资基金（LOF）上市交易公告书

基金管理人： 博时基金管理有限公司
基金托管人： 招商银行股份有限公司
注册登记机构： 中国证券登记结算有限责任公司
上市地点： 深圳证券交易所
上市时间： 2014年7月1日
公告日期： 2014年6月26日

一、重要声明与提示

《博时稳健回报债券型证券投资基金（LOF）上市交易公告书》（以下简称“本公告”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号＜上市交易公告书的内容与格式＞》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，博时稳健回报债券型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）管理人博时基金管理有限公司的董事会及董事保证本公告所载资料不存在虚假记载、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。本基金托管人招商银行股份有限公司保证本公告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、深圳证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。凡本公告未涉及的有关内容，请投资者详细查阅博时基金管理有限公司网站（www.bosera.com）上的《博时裕祥分级债券型证券投资基金招募说明书》及后续更新。

二、基金概览

1、基金名称：博时稳健回报债券型证券投资基金（LOF）
2、基金类别：债券型
3、基金运作方式：契约型开放式
4、基金存续期限：不定期
5、基金份额总额：本基金总份额1,134,332,087.35份，其中稳健债A：799,624,776.92份，稳健债C：334,707,310.43份（截至2014年6月24日）
6、稳健债A的份额参考净值：1.121元（截止2014年6月24日）
7、本次上市交易的基金份额简称及代码：稳健债A，代码：160513
8、本次上市交易的基金份额总额：442,070,134份（截至2014年6月24日）
9、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所
10、上市交易日期：2014年7月1日
11、基金管理人：博时基金管理有限公司
12、基金托管人：招商银行股份有限公司
13、本次上市交易的基金份额注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司

三、基金的历史、份额转换、日常申赎、上市交易和跨系统转托管

（一）本基金的历史

博时稳健回报债券型证券投资基金（LOF）由博时裕祥分级债券型证券投资基金三年运作期届满转型而成。

博时裕祥分级债券型证券投资基金经中国证监会2011年5月13日证监许可【2011】708号文核准募集。

博时裕祥分级债券型证券投资基金基金管理人为博时基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。基金管理人于2011年6月10日获得中国证监会书面确认，《博时裕祥分级债券型证券投资基金基金合同》生效，基金募集规模4,001,826,380.28份。

（二）本基金的转型

根据《博时裕祥分级债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金《基金合同》生效后3年运作期届满，本基金无需召开基金份额持有人大会，即转换为上市开放式基金（LOF），基金名称变更为“博时稳健回报债券型证券投资基金（LOF）”。

基金管理人于2014年4月24日和2014年6月5日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、深圳证券交易所网站及本基金管理人网站上披露了《博时裕祥分级债券型证券投资基金3年运作期届满与基金份额转换的公告》和《博时裕祥分级债券型证券投资基金之裕祥A份额开放赎回业务公告》。

本基金管理人于2014年6月10日对博时裕祥分级债券型证券投资基金进行了3年运作期届满后的基金转型工作。经本基金管理人计算并经本基金托管人招商银行股份有限公司确认，基金份额转换日（2014年6月10日）前博时裕祥分级债券型证券投资基金之裕祥A份额（以下简称“裕祥A”）的基金份额净值为1.024元，本基金管理人按照1:1的转换比例进行了转换，转换后的裕祥A的基金份额总额为334,707,310.43份；转换前博时裕祥分级债券型证券投资基金之裕祥B份额（以下简称“裕祥B”）的基金份额净值为1.120元，本基金管理人按照1:1的转换比例进行了转换，转换后的裕祥B的基金份额为799,624,776.92份。基金份额总额与持有人持有的基金份额数额没有发生变化，份额转换对持有人的权益无实质性影响。

本基金管理人已向中国证券登记结算有限责任公司提交份额变更登记申请并于2014年6月12日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、基金管理人网站及深圳证券交易所网站发布了《博时裕祥分级债券型证券投资基金基金份额转换结果的公告》。

（三）本基金的日常申购、赎回

本基金管理人自2014年7月1日开始办理本基金的日常申购、赎回业务。具体业务办理规则请见相关公告。

（四）本基金上市交易的主要内容

1、基金上市交易的核准机构和核准文号：深圳证券交易所深证上【2014】217号
2、上市交易日期：2014年7月1日
3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所
4、上市交易的基金份额简称：博时稳健回报债券（LOF）A
场内简称：稳健债A
5、交易代码：160513
6、本次上市交易份额：442,070,134份（截至2014年6月24日）
7、基金资产净值的披露：每个工作日的次日公布博时稳健回报债券型证券投资基金（LOF）A类份额和C类份额的基金份额净值，并在深交所行情发布系统揭示。
8、未上市交易份额的流通规定：未上市交易的稳健债A份额托管在场外，基金份额持有人将其转托管至深圳证券交易所场内后即可上市流通。

（五）本基金转托管的主要内容

为了保证基金份额持有人的利益，本基金管理人向深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司提出申请，为基金份额持有人开通了转托管业务的处理事宜。

基金份额持有人自2014年7月1日起可以通过本基金的代销机构或本基金管理人直销机构办理本基金转托管业务，转托管的具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司的相关规定办理。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

（一）持有人户数

截至2014年6月24日，稳健债A的场内基金份额持有人总户数为578户，平均每户持有的场内基金份额为764,827.22份；稳健债A的场外基金份额持有人总户数为519户，平均每户持有的场外基金份额为688,929.95份；稳健债C的场外基金份额持有人总户数 5303 户，平均每户持有的场外基金份额为63,116.60份。

（二）持有人结构

截至2014年6月24日，场内基金份额持有人结构如下：

场内机构投资者持有的稳健债A的场内基金份额为371,999,376份，占比84.1494%；场内个人投资者持有的稳健债A的场内基金份额为70,070,758份，占比15.8506%。

（三）截至2014年6月24日，稳健债A的场内基金份额前十名持有人情况

序号	持有人名称（全称）	持有基金份额	备注（占场内总份额比例）
1	华宝投资有限公司	118,377,407	26.78%
2	中信证券-华夏银行-中信证券贵宾定制2号集合资产管理计划	45,191,492	10.22%
3	全国社保基金二一零组合	36,331,232	8.22%
4	中信信托有限责任公司-中信证券安鑫2号信托金融投资项目资金信托	15,523,200	3.51%
5	全国社保基金一一零零三组合	13,788,496	3.12%
6	天风证券-光大-天象量化套利1号限额特定集合资产管理计划	11,627,511	2.63%
7	中欧基金-广发银行-中欧盛世-利可2号资产管理计划	10,527,170	2.38%
8	东方证券股份有限公司	10,346,900	2.34%
9	陈鸣宇	8,783,152	1.99%
10	中欧盛世资本-广发银行-中欧盛世-利可1号资产管理计划	8,700,122	1.97%

注：以上信息依据中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司提供的持有人信息编制；由于四舍五入的原因，占场内总份额比例分项之和与合计可能有尾差。

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人
1、名称：博时基金管理有限公司
2、法定代表人：杨鞠
3、总裁：吴姚东
4、注册资本：2.5亿元人民币
5、注册地址：广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦29层
6、设立批准文号：中国证监会证监基字[1998]26号
7、工商登记注册的法人营业执照文号：440301103465194号
8、经营范围：基金募集；基金销售；资产管理以及中国证监会许可的其它业务
9、股权结构（截至2014年6月24日）：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%；珺安股权投资有限公司，持有股份6%；上海盛业股权投资基金有限公司，持有股份6%；上海丰益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%。
10、内部组织结构及职能：

本基金管理人公司治理结构完善，经营运作规范，能够切实维护基金投资者的合法权益。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。

公司下设三大总部和十二个直属部门，分别是：权益投资总部、固定收益总部、市场销售总部以及宏观策略部、交易部、产品规划部、互联网金融部、董事长办公室、总裁办公室、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）、特定资产管理部、研究部和国际组。股票投资部负责进行股票选择和组合管理。特定资产管理部负责特定资产的管理和客户咨询服务。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。国际组负责公司海外投资业务中与权益类资产管理和研究相关的工作。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。市场销售总部负责公司全国范围内的客户、销售和服务工作。市场销售总部下设机构与零售两大业务线和营销服务部。机构业务线含战略客户部、机构-上海、机构-南方三大区域和养老金部、券商业务部两个部门。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省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。零售业务线含零售-北京、零售-上海、零售-南方三大区域，以及电子商务部、客户服务中心。其中，零售三大区域负责公司全国范围内零售客户的渠道销售和服务。电子商务部负责公司电子商务业务的发展、各部门使用公司官方网站营销资源的归口管理和公司直销网上交易平台的建设与管理工作。客户服务中心负责零售客户的服务和咨询工作。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。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。董事长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。总裁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与绩效分析工作，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。

公司另设有北京分公司、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、郑州和成都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和珺外子公司：博时基金（国际）有限公司。

11、人员情况：
截止到2014年5月31日，公司总人数393人，其中研究员和基金经理超过94%拥有硕士及以上学位。
12、信息披露负责人：孙麒清
电话：0755-83169999
13、基金管理业务情况简介：
截至2014年6月20日，博时公司管理着博时价值增长混合、博时沪深300指数、博时现金收益货币、博时精选股票、博时主题行业股票（LOF）、博时稳定价值债券、博时平衡配置混合、博时价值增长贰号混合、博时第三产业成长股票、博时新兴成长股票、博时特许价值股票、博时信用债券、博时策略混合、博时上证超大盘ETF及联接基金、博时创业成长股票、博时大中华亚太精选股票（QDII）、博时宏观回报债券、博时转债增强债券、博时行业轮动股票、博时抗通胀增强回报（QDII-FOF）、博时卓越品牌股票（LOF）、博时深证基本面200ETF及联接基金、博时稳健回报债券（LOF）、博时回报混合、博时天颐债券、博时上证自然资源ETF及联接、博时医疗保健、博时信用债纯债、博时安心收益定期开放债券、博时理财30天债券、博时亚洲票息收益债券（QDII）、博时安盈债券、博时岁岁增利一年定期开放债券、博时月月薪定期支付债券、博时安丰18个月定期开放、博时上证企债30ETF、博时双债增强债券、博时双月薪定期支付债券、博时裕益混合、博时混合、博时内需增长混合、博时标普500ETF及联接和博时裕隆灵活配置混合等47只开放式基金。

14、本基金基金经理
过钧先生，硕士，CFA。1995年起先后在上海工艺品进出口公司、德国德累斯顿银行上海分行、美国Lowes食品有限公司、美国通用电气公司、华夏基金固定收益部工作。2005年加入博时基金管理有限公司，历任基金经理、博时稳定价值债券投资基金的基金经理、固定收益部副总经理、博时转债增强债券型证券投资基金、博时亚洲票息收益债券型证券投资基金、博时裕祥分级债券型证券投资基金的基金经理。现任固定收益总部公募基金组投资总监兼博时信用债券投资基金、博时双债增强债券型证券投资基金、博时稳健回报债券型证券投资基金（LOF）的基金经理。

（二）基金托管人
1、基本情况
名称：招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）
设立日期：1987年4月8日
注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦
注册资本：215.77亿元
法定代表人：傅育宁
行长：田惠宇
资产托管业务批准文号：证监基金字[2002]83号
电话：0755-83199084
传真：0755-83195201
资产托管部信息披露负责人：张燕
2、主要人员情况
傅育宁先生，招商银行董事长和非执行董事，英国布鲁诺尔大学博士学位。1999年3月开始担任本公司董事，2010年8月起任招商局集团有限公司董事长。兼任招商局国际有限公司（香港联合交易所上市公司）主席，利和经销集团有限公司（香港联合交易所上市公司）及信和置业有限公司（香港联合交易所上市公司）独立非执行董事，香港港口发展局董事，香港证券及期货事务监察委员会成员等；中国南山开发（集团）股份有限公司董事长，招商局能源运输股份有限公司(上海证券交易所上市公司)董事长，及中国国际海运集装箱(集团)股份有限公司(深圳证券交易所上市公司)董事长，及新加坡上市公司嘉德置地有限公司独立非执行董事。

田惠宇先生，本行行长、执行董事，2013年5月起担任本行行长、本行执行董事。美国哥伦比亚大学公共管理硕士学位，高级经济师。曾于2003 年7 月至2013年5月历任上海银行副行长、中国建设银行上海市分行副行长、深圳市分行行长，中国建设银行零售业务总监兼北京市分行行长。

丁伟先生，本行副行长。大学本科毕业，副研究员。1996年12月加入本行，历任杭州分行办公室主任兼营业部总经理、杭州分行行长助理、副行长，南昌支行行长，南昌分行行长，总行人力资源部总经理，总行行长助理，2008年4月起任本行副行长。兼任招银国际金融有限公司董事长。

吴晓辉先生，招商银行资产托管部总经理，硕士研究生，高级经济师。1993年10月进入招商银行工作；历任招商银行总行计划资金部副总经理，总行资金交易部总经理，招银国际金融有限公司总裁；招商银行济南分行党委书记、行长，2011年7月起担任招商银行总行资产托管部总经理。

3、基金托管业务经营情况
截至2014年5月31日，招商银行股份有限公司托管了招商安泰系列证券投资基金（含招商股票证券投资基金、招商平衡型证券投资基金和招商债券证券投资基金），招商现金增值开放式证券投资基金、华夏经典配置混合型证券投资基金、长城久泰沪深300指数证券投资基金、华夏货币市场基金、光大保德信货币市场基金、华泰柏瑞全宇塔稳本增利债券型证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金、光大保德信新增长股票型证券投资基金、富国天合稳健优选股票型证券投资基金、上证红利交易型开放式指数证券投资基金、德邻优势股票证券投资基金、华富成长趋势股票型证券投资基金、光大保德信优势配置股票型证券投资基金、益民多利债券型证券投资基金、德盛红利股票证券投资基金、上证中央企业50交易型开放式指数证券投资基金、上投摩根行业轮动股票型证券投资基金、中银蓝筹精选灵活配置混合型证券投资基金、南方策略优化股票型证券投资基金、兴全合润分级股票型证券投资基金、中邮核心主题股票型证券投资基金、长盛沪深300指数证券投资基金（LOF）、中银价值精选灵活配置混合型证券投资基金、中银稳健双利债券型证券投资基金、银河创新成长股票型证券投资基金、嘉实多利分级债券型证券投资基金、国泰保本混合型证券投资基金、华宝兴业可转债债券型证券投资基金、建信双利策略主题分级股票型证券投资基金、诺安保本混合型证券投资基金、鹏华新兴产业股票型证券投资基金、博时裕祥分级债券型证券投资基金、上证国有企业100交易型开放式指数证券投资基金、华安可转换债券债券型证券投资基金、中银转债增强债券型证券投资基金、富国低碳环保股票型证券投资基金、诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）、中银中小盘成长股票型证券投资基金、国泰成长优选股票型证券投资基金、兴全轻资产投资股票型证券投资基金（LOF）、易方达纯债债券型证券投资基金、中银沪深 300 等权重指数证券投资基金(LOF)、中银保本混合型证券投资基金、嘉实增强收益定期开放债券型证券投资基金、工银瑞信14天理财债券型发起式证券投资基金、鹏华中小企业纯债债券型发起式证券投资基金、诺安双利债券型发起式证券投资基金、中银纯债债券型证券投资基金、南方安心保本混合型证券投资基金、中银理财7天债券型证券投资基金、海富裕纯债分级债券型发起式证券投资基金、建信双月安心理财债券型证券投资基金、中银理财30天债券型证券投资基金、广发新经济股票型发起式证券投资基金、中银稳健添利债券型发起式证券投资基金、博时亚洲票息收益债券型证券投资基金、工银瑞信增利分级债券型证券投资基金、鹏华丰利分级债券型发起式证券投资基金、中银消费主题股票型证券投资基金、工银瑞信信用纯债一年定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛6个月定期开放债券型证券投资基金、工银瑞信保本3号混合型证券投资基金、中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基金、博时月月薪定期支付债券型证券投资基金、中银保本二号混合型证券投资基金、建信安心回报两年定期开放债券型证券投资基金、中海惠利纯债分级债券型证券投资基金、富国恒利分级债券型证券投资基金、中银优秀企业股票型证券投资基金、中银多策略灵活配置混合型证券投资基金、华安新活力灵活配置混合型证券投资基金、宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金、安银施罗德新成长股票型证券投资基金、嘉实对冲套利定期开放混合型投资基金、宝盈瑞祥养老混合型证券投资基金和银华永益分级债券型证券投资基金共79只开放式基金及其它托管资产，托管资产为26186.49亿元人民币。

（三）基金验资机构
机构名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
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： 021-61238888
传真： 021-61238800
经办注册会计师：薛竞、沈兆杰

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件：基金合同摘要。

七、基金财务状况

深圳证券交易所在本基金募集期间未收取任何费用，其他各基金销售机构根据本基金招募说明书设定的费率收取认购费。

本基金募集结束后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

博时稳健回报债券型证券投资基金（LOF）2014年6月24日资产负债表如下：

（除特别注明外，金额单位为人民币元）

表：博时稳健回报债券型证券投资基金（LOF）

序号	期末余额	负债和所有者权益	期末余额
资产：		负债：	
银行存款	304,414,040.42	短期借款	
结算备付金	16,324,251.16	交易性金融负债	
存出保证金	379,518.63	衍生金融负债	
交易性金融资产	1,022,847,150.89	卖出回购金融资产款	
其中：股票投资		应付证券清算款	109,379,363.08
债券投资	1,022,847,150.89	应付赎回款	
基金投资		应付管理人报酬	765,022.05
衍生金融资产		应付托管费	191,255.53
买入返售金融资产		应付销售服务费	129,069.30
应收证券清算款	104.78	应付交易费用	-201,955.71
应收利息	9,964,697.29	应付税费	4,364,963.23
应收股利		应付利息	
应收申购款		应付利润	
其他资产		其他负债	220,545.50
		负债合计	114,848,262.98
		所有者权益：	
		实收基金	1,075,694,896.38
		未分配利润	163,386,603.81
		所有者权益合计	1,239,081,500.19
资产合计：	1,353,929,763.17	负债与持有人权益总计：	1,353,929,763.17

八、基金投资组合

截至公告前两个工作日即2014年6月24日，博时稳健回报债券型证券投资基金（LOF）的投资组合如下：

1、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		
	其中：股票		
2	固定收益投资	1,022,847,150.89	75.55
	其中：债券	1,022,847,150.89	75.55
	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	320,738,291.58	23.69
6	其他各项资产	10,344,320.70	0.76
7	合计	1,353,929,763.17	100.00

2、按行业分类的股票投资组合
无。
3、截至公告前两个工作日即 2014年6月24日，按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细
无。
4、截至公告前两个工作日即 2014年6月24日，按券种分类的债券投资组合

序号	名称	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	9,955,000.00	0.80
2	央行票据		
3	金融债券	100,170,000.00	8.08
	其中：政策性金融债	100,170,000.00	8.08
4	企业债券	250,648,436.49	20.23
5	企业短期融资券	361,299,000.00	29.16
6	中期票据	49,226,000.00	3.97
7	可转债	251,548,714.40	20.30
8	其他		
9	合计	1,022,847,150.89	82.55

5、截至公告前两个工作日即 2014年6月24日，按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细：

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	041453007	14苏交通CP001	1,000,000	100,510,000.00	8.11
2	140212	14国开12	1,000,000	100,170,000.00	8.08
3	113005	平安转债	858,020	91,207,526.00	7.36
4	1180075	11鄂城投债	700,000	71,603,000.00	5.78
5	122077	11西钢债	799,600	71,228,368.00	5.75

6、截至公告前两个工作日即 2014年6月24日，按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券明细：
无。
7、投资组合报告附注
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。
（1）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。
（2）其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	379,518.63
2	应收证券清算款	104.78
3	应收股利	
4	应收利息	9,964,697.29
5	应收申购款	
6	其他应收款	
7	待摊费用	
8	其他	
9	合计	10,344,320.70

（3）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	占基金资产净值比例(%)
1	113005	平安转债	91,207,526.00	7.36
2	110023	民生转债	46,110,000.00	3.72
3	113001	中行转债	44,372,854.80	3.58
4	110016	川投转债	38,625,000.00	3.12
5	110015	石化转债	31,233,333.60	2.52

（4）报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。
（5）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。

九、重大事件揭示

本基金自合同生效至上市交易期间未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

十、基金管理人承诺

本基金管理人就本基金上市交易之后履行管理人职责做出如下承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

（二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、证券交易所的监督管理。

（三）在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，设立专门的基金托管部，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员负责基金财产托管事宜。

（二）根据《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付等行为进行监督和核查。

（三）基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，督促基金管理人改正。

（四）基金托管人发现基金管理人有重大违规行为，将立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

十二、基金上市推荐人意见

本基金无上市推荐人。

十三、备查文件目录

以下备查文件存放于基金管理人和基金托管人的办公场所，投资者可在办公时间免费查阅。

（一）中国证监会核准博时裕祥分级债券型证券投资基金募集的文件；
（二）《博时裕祥分级债券型证券投资基金基金合同》；
（三）《博时裕祥分级债券型证券投资基金招募说明书》；
（四）《博时裕祥分级债券型证券投资基金托管协议》；
（五）法律意见书；
（六）基金管理人业务资格批件、营业执照；
（七）基金托管人业务资格批件、营业执照；
（八）中国证监会要求的其他文件。

附件：基金合同摘要

一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

（一）基金份额持有人的权利、义务

投资人自依基金合同、招募说明书取得基金份额即成为基金份额持有人和基金合同当事人，直至其不再持有本基金的基金份额，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的完全承认和接受。基金份额持有人作为基金合同当事人并不以在基金合同上书面签章或签字为必要条件。本基金同类别基金份额的每份基金份额具有同等的合法权益。各类基金份额由于基金份额净值的不同，基金收益分配时的可供分配利润以及参与清算后的剩余基金财产分配的数量将可能有所不同。

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的权利为：
1、分享基金财产收益；
2、参与分配清算后的剩余基金财产；
3、依法转让或申请赎回其持有的基金份额；
4、按照规定要求召开基金份额持有人大会；
5、出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
6、查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
7、监督基金管理人的投资运作；
8、对基金管理人、基金托管人、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
9、法律法规和基金合同规定的其他权利。

同一类别内每份基金份额具有同等的合法权益。

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的义务为：
1、遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；
2、交纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用；
3、在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；
4、不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法权益的活动；
5、执行生效的基金份额持有人大会决议；
6、返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人及基金管理人的代理人、基金托管人、代销机构、其他基金份额持有人处获得的不当得利；
7、法律法规和基金合同规定的其他义务。

（二）基金管理人的权利、义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的权利为：
1、自基金合同生效之日起，依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产；
2、依照基金合同获得基金管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；
3、发售基金份额；
4、依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
5、在符合有关法律法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则，在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高托管费率和管理费率之外的相关费率结构和收费方式；
6、根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；
7、在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回申请；
8、在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券；
9、自行担任或选择、更换注册登记机构，获取基金份额持有人名册，并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查；
10、选择、更换代销机构，并依据基金销售服务代理协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查；
11、选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
12、在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
13、依法召集基金份额持有人大会；
14、法律法规和基金合同规定的其他权利。

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的义务为：
1、依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
2、办理基金备案手续；
3、自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；
4、配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
5、建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；
6、除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；
7、依法接受基金托管人的监督；
8、计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
9、采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；
10、按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
11、进行基金会计核算并编制基金财务会计报表；
12、编制季度、半年度和年度基金报告；
13、严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
14、保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、投资意向等，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；
15、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；
16、依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
17、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
18、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
19、组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
20、因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
21、基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；
22、按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；
23、面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；
24、执行生效的基金份额持有人大会决议；
25、不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；
26、依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利，不谋求对上市公司的控股和直接管理；
27、法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

（三）基金托管人的权利、义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的权利为：
1、依基金合同约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；
2、监督基金管理人对本基金的投资运作；
3、自本基金合同生效之日起，依法保管基金资产；
4、在基金管理人更换时，提名新任基金管理人；
5、根据本基金合同及有关规定监督基金管理人，对于基金管理人违反本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会；
6、依法召集基金份额持有人大会；
7、按规定取得基金份额持有人名册资料；
8、法律法规和基金合同规定的其他权利。

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的义务为：
1、安全保管基金财产；
2、设立专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；
3、对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立；
4、除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基

（下转B007版）

博时稳健回报债券型证券投资基金（LOF）开放式定期定额投资业务公告

公告送出日期：2014年6月26日

1、公告基本信息

基金名称	博时稳健回报债券型证券投资基金(LOF)	
基金简称	博时稳健回报债券(LOF)	
基金主代码	160513	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011年6月10日	
基金管理人名称	博时基金管理有限公司	
基金托管人名称	招商银行股份有限公司	
基金注册登记机构名称	中国证券登记结算有限责任公司	
公告依据	《博时裕祥分级债券型证券投资基金招募说明书》及其更新	
定期定额投资起始日	2014年7月1