

# 博时稳健回报债券型证券投资基金( LOF ) 博时稳健回报债券( LOF )

## A ) 基金产品资料概要更新

编制日期：2024年6月25日

送出日期：2024年6月26日

本概要提供本基金的重要信息，是招募说明书的一部分。  
作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。

### 一、产品概况

基金简称	博时稳健回报债券( LOF )	基金代码	160513
下属基金简称	博时稳健回报债券( LOF ) A	下属基金代码	160513
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
基金合同生效日	2011-06-10	上市交易所及上市日期	深圳证券交易所 2014-07-01
基金类型	债券型	交易币种	人民币
运作方式	普通开放式	开放频率	每个开放日开放申购、赎回
基金经理	高晖	开始担任本基金基金经理的日期	2023-10-20
		证券从业日期	2011-04-11
		开始担任本基金基金经理的日期	2022-09-30
基金经理	罗霄	开始担任本基金基金经理的日期	2022-09-30
		证券从业日期	2012-07-13
		其他概况	2014年06月10日由博时裕祥分级债券转型而来 本基金自基金合同生效之日起满3年转换成“博时稳健回报债券型证券投资基金( LOF )”后，有下列情形之一的，本基金合同终止：基金合同生效后，连续60个工作日基金份额持有人数量不满200人的；基金合同生效后，连续60个工作日基金资产净值低于3000万元的；基金合同生效后，连续60个工作日基金前10大份额持有人持有基金份额总数超过基金总份额90%的。
场内简称	稳健债 LOF		

### 二、基金投资与净值表现

#### (一) 投资目标与投资策略

敬请投资者阅读更新的《招募说明书》第十章了解详细情况

投资目标	在谨慎投资的前提下，本基金力争获取高于业绩比较基准的投资收益。
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，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券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（但须符合中国证监会的相关规定）。 本基金也可投资于非固定收益类金融工具。本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，但可以参与一级市场新股申购或增发新股，并可持有因可转债转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证以及因投资可分离债券而产生的权证等，以及法律法

规或中国证监会允许投资的其他非固定收益类品种。因上述原因持有的股票和权证等资产，本基金应在其可交易之日起的30个交易日内卖出。

本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%，投资于非债券资产的比例不高于基金资产的20%，现金或者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%；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或监管机构以后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。

**主要投资策略**

通过宏观方面自上而下的分析及债券市场方面自下而上的判断，把握市场利率水平的运行态势，根据债券市场收益率曲线的整体运动方向进行久期选择。在微观方面，基于债券市场的状况，主要采用骑乘、息差及利差策略等投资策略。同时积极参与一级市场新股、债券申购，提高组合预期收益水平。主要投资策略包括资产配置策略、固定收益类品种投资策略、权益类品种投资策略。

**业绩比较基准**

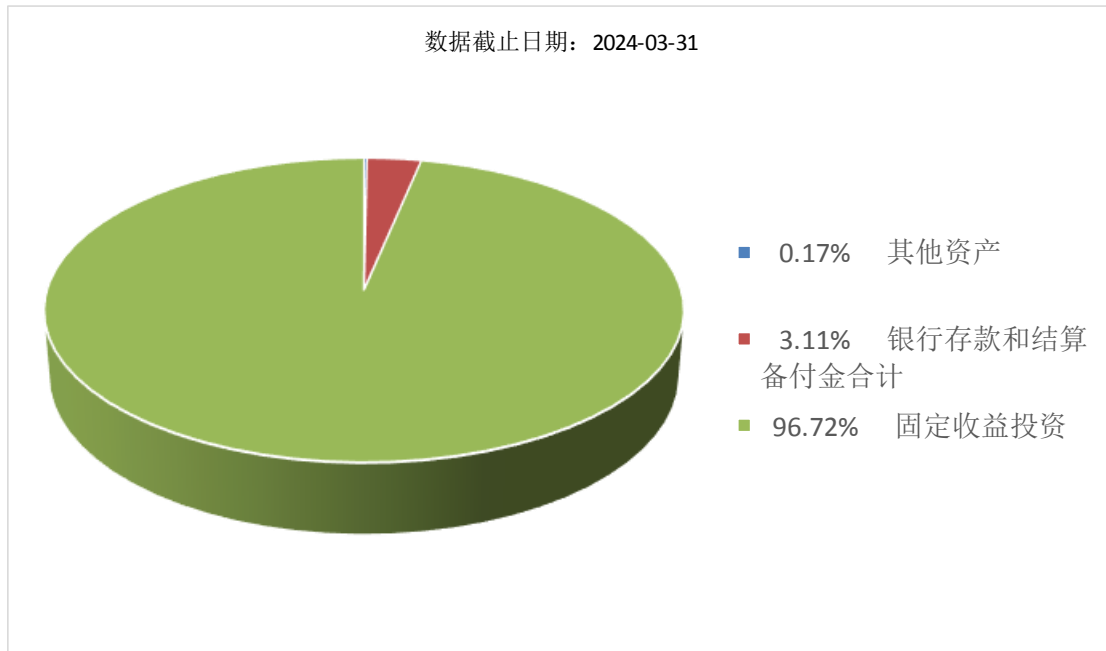
中证全债指数收益率

**风险收益特征**

从基金整体运作来看，本基金属于中低风险品种，预期收益和风险高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

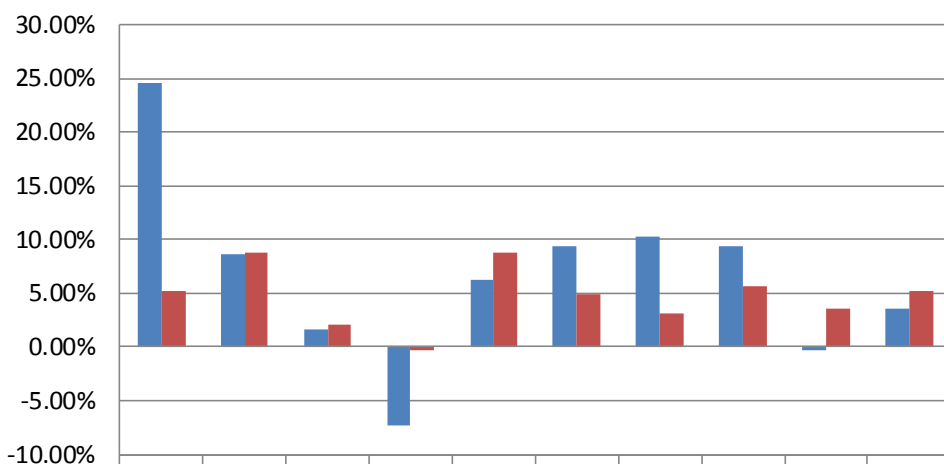
**(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表**

**投资组合资产配置图表**



**(三) 自基金合同生效以来基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图**

数据截止日期：2023-12-31



	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021	2022	2023
■ 净值增长率	24.51%	8.59%	1.61%	-7.30%	6.31%	9.36%	10.28%	9.40%	-0.24%	3.53%
■ 业绩基准收益率	5.25%	8.74%	2.00%	-0.34%	8.85%	4.96%	3.05%	5.65%	3.49%	5.23%

注：基金的过往业绩不代表未来表现。本基金份额生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 三、投资本基金涉及的费用

#### (一) 基金销售相关费用

以下费用在认购/申购/赎回基金过程中收取：

费用类型	份额 (S) 或金额 (M) /持有期限 (N)	收费方式/费率	备注
申购费 (前收费)	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	1000 元/笔	
赎回费	N < 7 天	1.50%	100%计入资产
	7 天 ≤ N < 365 天	0.10%	至少 25%计入资产
	365 天 ≤ N < 730 天	0.05%	至少 25%计入资产
	N ≥ 730 天	0.00%	

注：场内交易费用以证券公司实际收费为准。对于通过基金管理人直销渠道申购的养老金客户，享受申购费率1折优惠。对于通过基金管理人直销渠道赎回的养老金客户，将不计入基金资产部分的赎回费免除。

#### 申购费：

深圳证券交易所会员单位应按照 A 类基金份额场外申购费率设定 A 类基金份额场内申购费率；持续持有期限少于 7 日的 A 类基金份额场内赎回费率为 1.50%，持续持有期限大于等于 7 日的 A 类基金份额场内赎回费率为 0.10%。

#### (二) 基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除：

费用类别	收费方式/年费率或金额	收取方
管理费	固定比例 0.60%	基金管理人、销售机构

托管费	固定比例 0.15%	基金托管人
审计费用	96,000.00	会计师事务所
信息披露费	120,000.00	规定披露报刊
其他费用	基金合同生效后与本基金相关的律师费、基金份额持有人大会费用等，详见招募说明书或其更新“基金的费用与税收”章节。	

注：1、本基金交易证券、基金等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。

2、本基金运作相关费用年金额为基金整体承担费用，非单个份额类别费用，且年金额为预估值，最终实际金额以基金定期报告披露为准。

### （三）基金运作综合费用测算

若投资者认购/申购本基金份额，在持有期间，投资者需支出的运作费率如下表：

	基金运作综合费率（年化）
基金运作综合费率	0.76%

注：基金管理费率、托管费率为基金现行费率，其他运作费用以最近一次基金年报披露的相关数据为基准测算。

## 四、风险揭示与重要提示

### （一）风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。

投资有风险，投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

投资者应认真阅读《基金合同》、《招募说明书》等法律文件，及时关注本公司出具的适当性意见，各销售机构关于适当性的意见不必然一致，本公司的适当性匹配意见并不表明对基金的风险和收益做出实质性判断或者保证。基金合同中关于基金风险收益特征与基金风险等级因考虑因素不同而存在差异。投资者应了解基金的风险收益情况，结合自身投资目的、期限、投资经验及风险承受能力谨慎决策并自行承担风险，不应采信不符合法律法规要求的销售行为及违规宣传推介材料。

#### 1. 本基金的特有风险

##### （1）特定投资对象风险

本基金为债券型基金，在具体投资管理中，本基金主要于投资债券类资产，同时参与新股申购，因此，本基金可能因投资债券类资产而面临较高的市场系统性风险，也可能面临新股发行放缓甚至停滞，或者新股申购收益率下降甚至出现亏损所带来的风险。

##### （2）博时稳健回报债券（LOF）A（以下简称“稳健债 A”）的特有风险

###### 1）上市交易风险

稳健债 A 可能因信息披露导致基金停牌，投资者在停牌期间不能买卖稳健债 A 份额，产生风险；稳健债 A 也可能因交易对手不足产生流动性风险。

###### 2）折/溢价交易风险

受市场供求关系等的影响，稳健债 A 的上市交易价格与其基金份额参考净值之间可能发生偏离从而出现折/溢价交易的风险。

###### 3）基金的收益分配

投资者可通过买卖稳健债 A 份额的方式获取投资回报，但是，投资者通过变现稳健债 A 份额以获取投资回报可能须承担相应的交易成本，还可能面临稳健债 A 份额价格波动及折价交易等风险。

##### （3）基金投资资产支持证券的风险

资产支持证券（ABS）是一种债券性质的金融工具，其向投资者支付的本息来自于基础资产池产生的现金流或剩余权益。与股票和一般债券不同，资产支持证券不是对某一经营实体的利益要求权，而是对基础资产池所产生的现金流和剩余权益的要求权，是一种以资产信用为支持的证券，所面临的风险主要包括交易结构风险、各种原因导致的基础资产池现金流与对应证券现金流不匹配产生的信用风险、市场交易不活跃导致的流动性风险等。

2. 本基金普通风险：市场风险（政策风险、经济周期风险、收益波动风险、利率风险、通货膨胀风险、再投资风险等）、管理风险（决策风险、操作风险、技术风险、估值风险等）、信用风险、流动性风险、合规风险和其他风险。

## (二) 重要提示

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。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。基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。基金产品资料概要信息发生重大变更的，基金管理人将在三个工作日内更新。其他信息发生变更的，基金管理人每年更新一次。因此，本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后，如需及时、准确获取基金的相关信息，敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告等。

## 五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站[网址：www.bosera.com][客服电话：95105568]

- (1)基金合同、托管协议、招募说明书
- (2)定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告
- (3)基金份额净值
- (4)基金销售机构及联系方式
- (5)其他重要资料

## 六、其他情况说明

**1、争议解决方式：**对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

**2、重大事项：**博时裕祥分级债券型证券投资基金于2011年05月13日经中国证券监督管理委员会证监许可[2011]708号文核准募集，基金合同于2011年6月10日生效。根据基金合同的有关规定，基金合同生效满3年后，满足基金合同约定的存续条件，博时裕祥分级债券型证券投资基金无需召开基金份额持有人大会，已自动转换为上市开放式基金（LOF），基金名称已变更为“博时稳健回报债券型证券投资基金（LOF）”。裕祥A和裕祥B的基金份额，已转换为博时稳健回报债券型证券投资基金（LOF）的不同类别份额。