

办公地址：北京西城区金融大街27号投行广场32层
法定代表人：陈耀庭
电话：010-58598839
传真：010-58598834
联系人：李生立
· 律师事务所和经办律师
名称：上海市通力律师事务所
住所：上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19楼
办公地址：上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19楼
电话：021-31358666
传真：021-31358660
联系人：李冬冬
经办律师：吕俊、李冬冬
四、会计师事务所和经办注册会计师
名称：普华永道中天会计师事务所(普通合伙)
住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号1604室
电话：021-63391088
传真：021-63391118
联系人：李冬冬

办公地址：上海市浦东新区浦三路202号企业天地2号楼华永通中心11楼
 法人代表：杨信信
 电话：021-61238888
 传真：021-61238800
 经办注册会计师：王继康、张鸿

四、基金名称
 自基金合同生效之日起3年内，本基金名称为“鹏时裕祥分级债券型证券投资基金”，自基金合同生效之日起满3年后基金名称为“鹏时稳健回报债券型证券投资基金LOF”。

五、基金类型

[illegible]

符合本基金的风险分析结论。

2、中证全债指数自2007年12月发布以来,已经得到了投资者的广泛认同,被众多基金公司、保险公司和其他机构作为债券投资的基本基准。

3、中证全债指数的编制方法遵循国际标准和投资实践,在交易所上市的所有债券和银行间债券市场的所有债券中,分行业分类的券种作为指标的备选样本集合,样本券的期限至少1年,信用评级在投资级以上。可见,该指数能够客观、全面地反映债券市场价格的预期及样本券市场的走势,具有一致、透明和权威性较高等优点。

为基金募集设立并实际投资于证券市场、股票投资的业绩比较基准。若未来证券市场发生变化，业绩比较基准不适用时，本基金管理人可以根据维护投资者合法权益的原则，在与基金托管人协商一致并报中国证监会备案后，适当调整业绩比较基准并及时公告。

十一、基金的风险收益特征

本基金定位为运作灵活、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。从两类收益看，若按《持有人持有的基金份额按约定利率为一年期定期存款利率+1.50%，即出现低风险收益，收益相对稳定的收益；若按《持有人持有的基金份额按约定利率为一年期定期存款利率+1.50%，即出现低风险收益，收益相对稳定的收益；若按《持有人持有的基金份额按约定利率为一年期定期存款利率+1.50%，即出现低风险收益，收益相对稳定的收益。

2、基金投资组合报告

本基金管理人报告期内已勤勉尽责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法律责任。

基金管理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。

本报告组合投资数据截至2011年9月30日,本报告财务数据未经审计师审计。

1.报告期基金资产组合情况

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	9,666,085,086.22	86.66
	其中:债券	9,666,085,086.22	86.66

3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式逆回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	1,367,746,974.81	12.12
6	其他资产	130,526,560.37	1.19
7	合计	11,164,366,621.40	100.00
2.以公允价值计量的金融资产			
本基金本报告期末未持有股票。			
本基金本报告期末未持有债券。			
4.报告期末按公允价值计量的债券投资组合			
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	5,872,962,000.00	151.61

2	央行票据					
3	金融债券		366,091,000.00			9.
	其中:政策性金融债		366,091,000.00			
4	企业债券		1,785,916,689.82			46.
5	企业短期融资券		719,194,000.00			18.
6	中期票据		885,357,000.00			22.
7	可转换		36,564,396.40			0.
8	其他					
9	合计		9,666,085,086.22			249.
5.按期限分类:按公允价值计量且其公允价值变动计入损益的其他金融资产列报						
序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值 (元)	占金融资产公允价值总额 (例 %)	
1	019113	11国债(13)	53,500.00	5,296,500,000.00	136.	
2	019109	11国债(9)	5,800.00	576,462,000.00	14.	
3	110221	11国债(21)	1,600.00	156,848,000.00	4.	
4	118137	11年国债CP03	1,500.00	149,640,000.00	3.	
5	090705	09国债(05)	1,400.00	139,706,000.00	3.	

6. 按照期末资产净值占基金总资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资者持有本基金报告期末未持有资产支持证券。

7. 按照期末资产净值占基金总资产净值比例大小排名的前十名权证投资明细

基金投资组合报告附注

本基金本报告期末持有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、处罚的情况。

8. 本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。

9. 报告期末资产配置情况

序号	名称	金额(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		130,278.560
5	应收申购款		
6	其他应收款		
7	待摊费用		
8			
9	合计		130,528.560
6 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)
			占基金资产净值比例 (%)

1	110013	国债逆回购	13,256,896.40
2	110015	石化转债	13,111,500.00
3	113002	工行存单	10,196,000.00

⑦ 报告期内本基金投资中有无发生流动性危机的说明：
 ⑧ 本基金本报告期末未持有停牌股票。
 ⑨ 其他需说明的重要事项：
 ⑩ 报告期内本基金的前十名持仓之和与合计项之间可能存在重叠。

十三、基金的投资

基金管理人依据投资组合中、诚信信用、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，也不保证基金最低收益。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金管理人是否推荐或购买基金无直接关系。

历史时期内基金份额净值增长率及其与业绩比较基准收益率的比较。

期间	①份额增长率	②份额净值增长率	③业绩比较基准收益率	④业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
2011年6月1日至2011年9月30日	-3.30%	0.55%	-0.28%	0.12%	-3.02%	0.43%

十四、基金的费用概览

1. 基金运作有关的费用

①基金管理人管理费
 在通常情况下,基金管理人按基金资产净值的0.80%费率计提,计算方法如下:
 $H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$
 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
 费用自基金成立首月支付,经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

②基金托管人托管费
 在通常情况下,基金托管费按基金资产净值的0.20%费率计提,计算方法如下:
 $H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$
 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
 费用自基金成立首月支付,经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

① 基金销售服务费费率如下：

1. 销售服务费

A: 基金合同生效之日起满3年内的销售服务费

B: 基金合同生效之日起满3年后, 对持有A基金份额的销售服务费费率率为0.35%, 对持有B基金份额的不收取销售服务费。

基金管理人收取之日起满3年后, 对持有A基金份额的销售服务费费率率为0.35%费率费率。

计算方法如下:

E=H-E/360*当年天数

H为持有A基金份额的投资者应计的销售服务费

E为每一基金份额的销售服务费和与持有A基金份额的份额数的乘积

销售服务费按日计提, 按月支付, 由基金管理人向基金托管人核对应付, 由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金资产中支付给基金管理人。

销售服务费主要用于支付本基金的营销及销售以及基金份额持有人服务等各项费用。

本基金管理人自2015年12月1日起,将本基金的业绩报酬计提方式调整为:本基金转换为以上市开放式基金(LOP),其中类型基金的超额不收取业绩服务费,业绩服务费按照基金净值为0.35%计提,业绩报酬计提周期为12个月。

计算方式如下:

1、 $Has = 0.35\% \times \text{基金净资产}$

2、计算基金净值自计提日起计提的销售服务费

3、基金净值的超额=基金净值-Has

4、业绩报酬=基金净值的超额 $\times$ 业绩报酬计提比例

业绩服务费每日计提,按月支付,经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金管理人于次月首日起3个工作日内向基金托管人发送划款指令,由基金托管人于次月首日起3个工作日内支付给基金管理人。

业绩报酬计提于管理费于基金净利润扣除以及基金净值约有入服务等各项费用。

业绩报酬计提比例:

1) 若基金净值自计提日起,基金净值超额在50%以内,业绩报酬计提比例为50%。

2) 若基金净值自计提日起,基金净值超额在50%-100%之间,业绩报酬计提比例为70%。

3) 若基金净值自计提日起,基金净值超额在100%以上,业绩报酬计提比例为100%。

基金管理人有权根据基金净值的变动,基金管理人相应支付的销售服务费收取方式

[illegible][illegible]

(注) 一、自 2017 年 12 月 19 日，我公司发行在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《朝川裕祥分级债券型证券投资基金资产份额申购及赎回公告》。

二、自 2018 年 12 月 16 日，我公司发行在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《朝川裕祥分级债券型证券投资基金资产份额赎回公告》。

三、自 2019 年 12 月 17 日，我公司发行在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《朝川裕祥分级债券型证券投资基金资产份额赎回公告》。

四、自 2019 年 12 月 19 日，我公司发行在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《朝川裕祥分级债券型证券投资基金资产份额赎回公告》。

五、自 2020 年 1 月 17 日，我公司发行在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《朝川裕祥分级债券型证券投资基金资产份额赎回公告》。

博时基金管理有限
2012年1月