博时裕隆灵活配置混合型证券投资基金（原裕隆证券投资基金转型）

2014 半年度 报告摘要

2014年6月30日

基金管理人：博时基金管理有限公司
基金托管人：中国农业银行股份有限公司
报告送出日期：2014年8月28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。本半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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年8月27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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

自2014年6月3日裕隆证券投资基金终止上市之日起，原裕隆证券投资基金名称变更为博时裕隆灵活配置混合型证券投资基金。原裕隆证券投资基金本报告期自2014年1月1日至2014年6月2日止，博时裕隆灵活配置混合型证券投资基金本报告期自2014年6月3日至2014年6月30日止。

§2基金简介

2.1基金基本情况

基金名称：博时裕隆灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	博时裕隆混合
基金主代码	000652
交易代码	000652
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年6月3日
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,788,409,167.00份
基金合同存续期	不定期
转型前基金名称：裕隆证券投资基金	
基金简称	博时裕隆封闭
场内简称	基金裕隆
基金主代码	184692
交易代码	184692
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	1999年6月15日
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,000,000,000.00份
基金合同存续期	15年
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	1999-06-24

注：裕隆证券投资基金（转型前基金）于2014年6月3日终止上市。

2.2基金产品说明

基金名称：博时裕隆灵活配置混合型证券投资基金	
投资目标	通过对多种投资策略的有机结合，在有效控制风险的前提下，力争为基金份额持有人获取长期持续稳定的投资回报。
投资策略	本基金将按照风险收益配比原则，实行动态的资产配置。围绕对经济周期景气的预判以及宏观经济政策的调整来实施大类资产的配置。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×75%+中证全债指数收益率×25%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，属于中高收益/风险特征的基金。
转型前基金名称：裕隆证券投资基金	
投资目标	为投资者减少和分散投资风险，确保基金资产的安全并主要通过投资于业绩能够保持长期可持续增长、从长远来看市场价值被低估的成长型上市公司来实现基金的投资收益。
投资策略	本基金的投资组合应本着收益性、安全性、流动性的原则。依据上市公司的预期收益和发展潜力，通过投资于业绩能够保持长期可持续增长、从长远来看市场价值被低估的成长型公司来实现基金长期的股票投资收益。通过综合国内国际经济环境、行业、公司和证券市场的相关因素，确定各类金融工具的投资组合比例，达到分散和降低投资风险，确保基金资产安全，谋求基金收益长期稳定的目的。
业绩比较基准	无
风险收益特征	本基金是一只偏股型的证券投资基金，属于中等风险品种。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孙麒清	李芳菲
	联系电话	0755-83169999	010-66060069
	电子邮箱	service@bosera.com	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		95105568	95599
传真		0755-83195140	010-63201816

2.4信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.bosera.com
基金半年度报告备置地点	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基金名称：博时裕隆灵活配置混合型证券投资基金

3.1.1主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1.1期间数据和指标	2014年6月3日-2014年6月30日
本期已实现收益	6,548,883.34
本期利润	48,507,275.65
加权平均基金份额本期利润	0.0165
本期基金份额净值增长率	2.07%
3.1.1.2 期末数据和指标	2014年6月30日
期末可供分配基金份额利润	-0.1582
期末基金资产净值	2,392,922,655.67
期末基金份额净值	0.858

注：2014年6月3日，原裕隆证券投资基金转型为博时裕隆灵活配置混合型证券投资基金。

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。

期末可供分配利润是指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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。

3.1.2基金净值表现

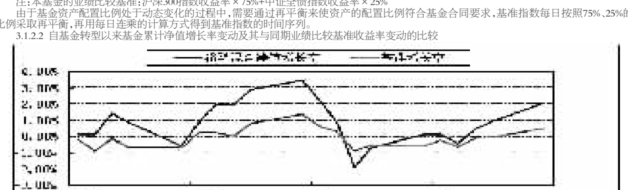
3.1.2.1基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
自基金转型起至今	2.07%	1.11%	0.51%	0.58%	1.56%	0.53%

注：本基金的业绩比较基准：沪深300指数收益率×75%+中证全债指数收益率×25%

由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照75%、25%的比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

3.1.2.2 自基金转型以来基金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



注：本基金合同于2014年6月3日生效。本基金于2014年7月4日完成了基金份额的集中申购。按照本基金的基金合同规定，自集中申购份额确认之日起6个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十条（二）投资范围、（五）投资限制的有关约定。本报告期末本基金的建仓期尚未结束。

3.2 转型前基金名称：裕隆证券投资基金

3.2.1主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.2.1.1期间数据和指标	2014年1月1日-2014年6月2日
本期已实现收益	-310,369,811.03
本期利润	-212,101,727.72
加权平均基金份额本期利润	-0.0707
本期基金份额净值增长率	-7.76%
3.2.1.2 期末数据和指标	2014年6月2日
期末可供分配基金份额利润	-0.1604
期末基金资产净值	2,521,764,424.48
期末基金份额净值	0.8406

注：2014年6月3日，原裕隆证券投资基金转型为博时裕隆灵活配置混合型证券投资基金。

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。

期末可供分配利润是指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

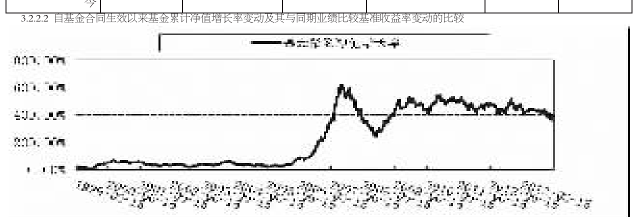
上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.2基金净值表现

3.2.2.1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

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	-3.87%	2.39%	-	-	-	-
过去六个月	-9.45%	2.42%	-	-	-	-
过去一年	-13.86%	2.24%	-	-	-	-
过去三年	-18.89%	2.34%	-	-	-	-
过去五年	-9.49%	2.27%	-	-	-	-
自基金成立起至今	394.66%	2.67%	-	-	-	-

3.2.2.2 自基金合同生效以来基金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



注：本基金合同于1999年6月15日生效，基金份额于1999年6月24日在深交所上市交易。按照本基金的基金合同规定，自基金份额上市之日起6个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第七条"（二）投资范围"、"（五）投资限制"的有关约定。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。本基金于2014年6月3日终止上市。

§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2014年6月30日，博时基金公司共管理四十七只开放式基金，并且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，公募基金资产规模逾1041亿元人民币，累计分红超过628亿元人民币，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，标准股票型基金中，截至6月30日，博时医疗保健股票基金、博时卓越品牌股票基金今年以来净值增长率在355只标准型股票基金中排名前1/4，博时主题行业股票基金今年以来净值增长率在355只标准型股票基金中排名前1/3。标准指数股票型基金中，博时沪深300指数、博时上证超大盘ETF、博时深证基本面200ETF三只基金今年以来净值增长率在150只同类基金中排名前1/2。混合基金方面，今年以来博时裕益收益率在35只灵活配置型同类基金中排名前1/2，博时平衡配置在16只股债平衡型同类基金中排名前1/2。

固定收益方面，博时信用债纯债今年以来收益率在101只长期标准债券型基金中排名前1/4，博时安丰18个月定期开放基金排名前1/3，博时安盈债券基金（A类）在6只中短期标准债券型基金中排名前1/2。

海外投资方面业绩方面，截至6月30日，博时亚洲票息收益债券基金在同类可比7只QDII债券基金中排名第1，博时大中华亚太精选今年以来收益率在9只QDII亚太股票型基金中排名第2，博时抗通胀在8只QDII商品基金中排名第2。

2、客户服务

2014年上半年，博时基金共举办各类渠道培训活动284场，参加人数7355人。

3、其他大事件

2014年1月9日，金融界网站在北京举办"第二届领航中国2013金融行业年度颁奖典礼"，博时基金荣获"2013金融界领航中国年度评选基金公司最佳品牌奖"。

2014年1月11日，在和讯网主办的2013年第十一届财经风云榜基金行业评选中，博时基金荣获"2013年度基金业最佳投资者关系奖"。

2014年6月16日，大智慧在上海举办"智慧财经巅峰榜"，博时基金荣获"十佳基金公司"奖项，基金经理张溪冈荣获智慧财经巅峰榜"最佳基金经理"奖项。

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		
丛林	基金经理	2014-6-3	-	9	2001年起先后在北京大学电子集团、银联咨询公司工作。2005年起在华西证券、安信证券从事研究工作。2010年起在景顺长城基金历任研究员、基金经理。2012年11月加入博时基金管理有限公司，曾任裕隆证券投资基金基金经理。现任博时裕隆灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
丛林	基金经理	2014-4-2	2014-6-2	9	2001年起先后在北京大学电子集团、银联咨询公司工作。2005年起在华西证券、安信证券从事研究工作。2010年起在景顺长城基金历任研究员、基金经理。2012年11月加入博时基金管理有限公司，曾任裕隆证券投资基金基金经理。现任博时裕隆灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
温宇峰	基金经理	2010-10-13	2014-4-2	13	1994年起先后在中国证监会发行部、中银国际控股公司、博时基金管理有限公司、上投摩根基金管理公司、Prime Capital、Fidelity International Limited (Hong Kong)从事投资、研究工作。2010年6月加入博时基金管理有限公司，曾任裕隆证券投资基金基金经理。现任博时价值增长混合基金、博时价值增长贰号混合基金基金经理。

注：上述人员的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日，证券从业年限计算的起始时间按照从事证券行业开始时间计算。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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、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，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，没有损害基金持有人利益的行为。

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。

4.3.2 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说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

在上半年度中期，对裕隆的主要投资方向做了调整，由金融、地产、银行为代表的传统产业，转变为如下两个方面：符合产业结构调整方向、以TMT为代表的新兴产业。具体到产业方面，主要是水处理、智慧城市、互联网金融、移动互联网应用等，同时比较看好军工企业的改制和资产证券化前景，配置了一部分的军工企业。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2014年6月30日，本基金份额净值为0.858元，累计净值为0.858元。报告期内，本基金由裕隆证券投资基金转型为博时裕隆灵活配置混合型证券投资基金。转型前，自2014年1月1日至2014年6月2日，裕隆证券投资基金份额净值增长率为-7.76%；转型后，自2014年6月3日至报告期末，博时裕隆灵活配置混合型证券投资基金份额净值增长率为2.07%，同期业绩基准增长率为0.51%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从宏观经济来看，政策层面在持续放松，先后有近30个城市放开了房地产限购政策，总理也在强调今年有信心达到7.5%的经济增长目标，政府也准备好了经济调整政策，以确保目标任务的完成。上周央行也实现了年内第二次的定向降准，我们预期未来存在降息的可能。

对于A股后市的表现，我们认为在稳增长的财政政策和宽松的货币政策下，市场整体的下调空间有限，价值股的估值依旧处于一个比较低的水平，银行估值存在修复空间，保险、券商等金融股短期基本面有所改善，上证综指有一定的上行空间。而成长股下半年会进入到业绩确认和估值切换的一个时期，预期个股分化会比较严重，其中一些投资逻辑和业绩逐步得到认证的标的，我们认为可能会有超预期的表现。

从行业上来看，我们依旧比较看好之前提到的产业，比如环保、金融互联网、移动平台应用、军工等。尤其是环保行业，按照政府的"十二五规划"，很多子行业的进度远慢于预期，下半年在环保板块的投入会加速。而从估值层面来看，目前的很多标的都已处在近年的历史低位，未来一到两个季度，随着业绩的逐步兑现以及下半年的估值切换，股价预期会有比较好的表现。

4.6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。

4.7管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金报告期内未进行利润分配。

§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

在托管博时裕隆灵活配置混合型证券投资基金（原裕隆证券投资基金）的过程中，本基金托管人—中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同的约定，对博时裕隆灵活配置混合型证券投资基金（原裕隆证券投资基金）基金管理人—博时基金管理有限公司2014年1月1日至2014年6月30日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，博时基金管理有限公司在博时裕隆灵活配置混合型证券投资基金（原裕隆证券投资基金）的投资运作、基金资产净值的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人认为，博时基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的博时裕隆灵活配置混合型证券投资基金（原裕隆证券投资基金）年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1基金名称：博时裕隆灵活配置混合型证券投资基金

6.1.1资产负债表

会计主体：博时裕隆灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2014年6月30日

单位：人民币元

资 产	本期末 2014年6月30日
资 产：	
银行存款	121,073,388.51
结算备付金	173,500.32
存出保证金	671,355.43
交易性金融资产	2,276,718,269.61
其中：股票投资	1,709,657,269.61
基金投资	-
债券投资	567,061,000.00
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	-
应收利息	16,522,295.98
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	
资产总计	2,415,158,809.85
负债和所有者权益	本期末 2014年6月30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	-
应付证券清算款	2,374,755.71
应付赎回款	13,797,270.48
应付管理人报酬	3,070,069.49
应付托管费	511,678.26
应付销售服务费	-
应付交易费用	627,903.82
应交税费	145,972.00
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	1,708,504.42
负债合计	22,236,154.18
所有者权益：	-
实收基金	2,788,409,167.00
未分配利润	-395,486,511.33
所有者权益合计	2,392,922,655.67
负债和所有者权益总计	2,415,158,809.85

注：1. 报告截止日2014年6月30日，基金份额净值0.858元，基金份额总额2,788,409,167.00份。

2.本财务报表的实际编制期间为2014年6月3日(基金合同生效日)至2014年6月30日。

6.1.2利润表

会计主体：博时裕隆灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2014年6月3日（基金合同生效日）至2014年6月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2014年6月3日（基金合同生效日）至2014年6月30日
一、收入	52,561,015.71
1.利息收入	1,719,000.84
其中：存款利息收入	64,820.68
债券利息收入	1,654,180.16
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	-
其他利息收入	-
2.投资收益（损失以"-"填列）	7,553,504.19
其中：股票投资收益	5,364,472.64
基金投资收益	-
债券投资收益	-
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	2,189,031.55
3.公允价值变动收益（损失以"-"号填列）	41,958,392.31
4.汇兑收益（损失以"-"号填列）	-
5.其他收入（损失以"-"号填列）	1,330,118.37
减：二、费用	4,053,740.06
1.管理人报酬	2,862,793.50
2.托管费	477,132.26
3.销售服务费	-
4.交易费用	682,625.31
5.利息支出	-
其中：卖出回购金融资产支出	-
6.其他费用	31,188.99
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）	48,507,275.65
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以"-"号填列）	48,507,275.65

6.1.3所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：博时裕隆灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2014年6月3日（基金合同生效日）至2014年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2014年6月3日（基金合同生效日）至2014年6月30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）	3,000,000,000.00	-478,235,575.52	2,521,764,424.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	48,507,275.65	48,507,275.65
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）	-211,590,833.00	34,241,788.54	-177,349,044.46
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-211,590,833.00	34,241,788.54	-177,349,044.46
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）	2,788,409,167.00	-395,486,511.33	2,392,922,655.67

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1.1至6.1.4财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：吴姚东　主管会计工作负责人：王德英　会计机构负责人：成江

6.1.4报表附注

6.1.4.1 重要会计政策和会计估计

6.1.4.1.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2014年6月3日(基金合同生效日)至2014年6月30日。

6.1.4.1.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.1.4.1.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

6.1.4.1.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.1.4.1.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

6.1.4.1.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.1.4.1.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆算引起的实收基金份额变动于基金份额拆算日根据拆算前的基金份额数及确定的拆算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.1.4.1.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.1.4.1.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益转出的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.1.4.1.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费按照费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.1.4.1.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.1.4.1.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.1.4.1.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

6.1.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.1.4.2.1会计政策变更的说明

无。

6.1.4.2.2会计估计变更的说明

无。

6.1.4.2.3差错更正的说明

无。

6.1.4.3 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(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，股权的股息、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。自2013年1月1日起，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，暂减按25%计入应纳税所得额。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。

6.1.4.4 关联方关系

6.1.4.4.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.1.4.4.2本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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、基金注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（"中国农业银行"）	基金托管人、基金代销机构
招商证券股份有限公司（"招商证券"）	基金管理人的股东、基金代销机构

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。

6.1.4.5本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.1.4.5.1通过关联方交易单元进行的交易

6.1.4.5.1.1股票交易

无。

6.1.4.5.1.2 权证交易

无。

6.1.4.5.1.3债券交易

无。

6.1.4.5.1.4债券回购交易

无。

6.1.4.5.1.5应支付关联方的佣金

无。

6.1.4.5.2关联方报酬

6.1.4.5.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2014年6月3日（基金合同生效日）至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,862,793.50
其中：支付销售机构的客户维护费	-

注：支付基金管理人博时基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%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：日管理人报酬＝前一日基金资产净值×1.5%/当年天数。

6.1.4.5.2.2基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2014年6月3日（基金合同生效日）至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	477,132.26

注：支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%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：日托管费＝前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

6.1.4.5.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.1.4.5.4各关联方投资本基金的情况

6.1.4.5.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2014年6月3日（基金合同生效日）至2014年6月30日
报告期初持有的基金份额(原基金裕隆)	6,000,000.00
报告期间申购/买入总份额	-
报告期间因拆分变动份额	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-
报告期末持有的基金份额	6,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.22%

6.1.4.5.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期 2014年6月3日（基金合同生效日）至2014年6月30日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
招商证券	3,000,000.00	0.11%

6.1.4.5.5 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 2014年6月3日（基金合同生效日）至2014年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	121,073,088.51	63,729.81

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

6.1.4.5.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.1.4.5.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.1.4.6 期末（2014年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.1.4.6.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

单位：人民币元

6.4.6.1.1 受限证券类别：股票											
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
603369	今世缘	14/06/25	14/07/03	新股网上申购	16.93	16.93	1,000	16,930.00	16,930.00	

6.1.4.6.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.1.4.6.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.1.4.6.3.1银行间市场债券正回购

无。

6.1.4.6.3.2交易所市场债券正回购

无。

6.2转型前基金名称：裕隆证券投资基金

6.2.1资产负债表

会计主体：裕隆证券投资基金

报告截止日：2014年6月2日(基金合同失效前日)

单位：人民币元

资 产	本期末 2014年6月2日(基金合同失效前日)	上年度末 2013年12月31日
资 产：		
银行存款	36,359,618.14	29,743,315.19
结算备付金	727,305.29	1,689,358.43
存出保证金	692,928.79	333,503.84
交易性金融资产	2,475,091,444.44	2,700,413,483.63
其中：股票投资	1,909,297,444.44	2,071,342,036.13
基金投资	-	-
债券投资	565,794,000.00	629,071,447.50
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	-	-
应收利息	14,889,262.07	8,161,851.42
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	2,527,760,558.73	2,740,341,512.51
负债和所有者权益	本期末 2014年6月2日(基金合同失效前日)	上年度末 2013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	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	3,324,746.60	3,514,694.66
应付托管费	554,124.43	585,782.44
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	293,471.44	543,911.21
应交税费	145,972.00	145,972.00
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,677,819.78	1,685,000.00
负债合计	5,996,134.25	6,475,360.31
所有者权益：	-	-
实收基金	3,000,000,000.00	3,000,000,000.00
未分配利润	-478,235,575.52	-266,133,847.80
所有者权益合计	2,521,764,424.48	2,733,866,152.20
负债和所有者权益总计	2,527,760,558.73	2,740,341,512.51

注：1、报告截止日2014年6月2日(基金合同失效前日)，基金份额净值0.8406元，基金份额总额3,000,000,000.00份。

2、本财务报表的实际编制期间为2014年1月1日至2014年6月2日(基金合同失效前日)。

6.2.2利润表

会计主体：裕隆证券投资基金

本报告期：2014年1月1日至2014年6月2日(基金合同失效前日)

单位：人民币元

项 目	本期 2014年1月1日-2014年6月2日（基金合同失效前日）	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、收入	-186,316,478.77	-328,168,236.18
1.利息收入	9,337,113.55	12,060,515.30
其中：存款利息收入	180,492.86	59,359.94
债券利息收入	9,156,620.69	12,001,155.36
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以"-"填列）	-293,921,675.63	52,662,331.96
其中：股票投资收益	-303,832,465.21	28,833,063.26
基金投资收益	-	-
债券投资收益	639,790.97	6,580.00
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	9,270,998.61	23,822,688.70
3.公允价值变动收益（损失以"-"号填列）	98,268,083.31	-392,895,376.90
4.汇兑收益（损失以"-"号填列）	-	-
5.其他收入（损失以"-"号填列）	-	4,293.46
减：二、费用	25,785,248.95	26,148,207.95
1.管理人报酬	16,242,385.04	21,466,527.54
2.托管费	2,707,064.13	3,577,754.62
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	6,572,989.24	865,199.18
5.利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	262,810.54	238,726.61
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）	-212,101,727.72	-354,316,444.13
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以"-"号填列）	-212,101,727.72	-354,316,444.13

6.2.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：裕隆证券投资基金

本报告期：2014年1月1日至2014年6月2日(基金合同失效前日)

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日-2014年6月2日（基金合同失效前日）		
	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）	3,000,000,000.00	-266,133,847.80	2,733,866,152.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-212,101,727.72	-212,101,727.72
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）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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）	3,000,000,000.00	-478,235,575.52	2,521,764,424.48
项目	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30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）	3,000,000,000.00	-61,174,917.35	2,938,825,082.65
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-354,316,444.13	-354,316,444.13
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）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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）	3,000,000,000.00	-415,491,361.48	2,584,508,638.52

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.2.1至6.2.4财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：吴姚东　主管会计工作负责人：王德英　会计机构负责人：成江

6.2.4报表附注

6.2.4.1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政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.2.4.2税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(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，股权的股息、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。自2013年1月1日起，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，暂减按25%计入应纳税所得额。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。

6.2.4.3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"）	基金发起人、基金管理人
中国农业银行股份有限公司（"中国农业银行"）	基金托管人
光大证券股份有限公司（"光大证券"）	基金发起人
中国长城信托投资公司（"长城信托"）	基金发起人
金信信托投资股份有限公司（"金信信托"）	基金发起人
招商证券股份有限公司（"招商证券"）	基金发起人、基金管理人的股东

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。

6.2.4.4本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.2.4.4.1通过关联方交易单元进行的交易

6.2.4.4.1.1股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月2日(基金合同失效前日)		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30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	694,211,354.43	15.62%	37,687,097.12	6.46%
光大证券	-	-	1,028,326.83	0.18%

6.2.4.4.1.2权证交易

无。

6.2.4.4.1.3债券交易

无。

6.2.4.4.1.4债券回购交易

无。

6.2.4.4.1.5应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月2日(基金合同失效前日)			
	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	632,011.77	16.40%	-	-
光大证券	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30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	34,310.30	6.94%	34,310.30	11.04%
光大证券	909.97	0.18%	909.97	0.29%

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。

6.2.4.4.2关联方报酬

6.2.4.4.2.1基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月2日(基金合同失效前日)	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	16,242,385.04	21,466,527.54

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1.50%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：日管理人报酬＝前一日基金资产净值 X 1.50% / 当年天数。

6.2.4.4.2.2基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月2日(基金合同失效前日)	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,707,064.13	3,577,754.62

注：支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%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：日托管费＝前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

6.2.4.4.3与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.2.4.4.4各关联方投资本基金的情况

6.2.4.4.4.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月2日(基金合同失效前日)	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
期初持有的基金份额	6,000,000.00	6,000,000.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	6,000,000.00	6,000,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.20%	0.20%

6.2.4.4.4.2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

份额单位：份

项目	本期末 2014年6月2日(基金合同失效前日)		上年度末 2013年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
光大证券	3,000,000.00	0.10%	3,000,000.00	0.10%
长城信托	6,000,000.00	0.20%	6,000,000.00	0.20%
金信信托	6,000,000.00	0.20%	6,000,000.00	0.20%
招商证券	3,000,000.00	0.10%	3,000,000.00	0.10%

6.2.4.4.5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 2014年1月1日至2014年6月2日(基金合同失效前日)		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	36,359,618.14	151,246.17	12,348,547.69	54,094.76

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

6.2.4.4.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.2.4.4.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.2.4.5期末（2014年6月2日(基金合同失效前日)）本基金持有的流通受限证券

6.2.4.5.1因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.2.4.5.2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(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300168	万达信息	14/3/27	公告重大事项	19.55	14/6/25	20.48	2,087,524	28,937,984.39	40,811,094.20	
300334	津膜科技	14/3/29	公告重大事项	32.44	14/6/17	20.81	4,587,773	146,836,481.80	148,827,356.12	
合计								175,774,466.19	189,638,450.32	

注：本基金截至2014年6月2日(基金合同失效前日)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。

6.2.4.5.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.2.4.5.3.1银行间市场债券正回购

无。

6.2.4.5.3.2交易所市场债券正回购

无。

§7 投资组合报告

7.1基金名称：博时裕隆灵活配置混合型证券投资基金

7.1.1期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,709,657,269.61	70.79
	其中：股票	1,709,657,269.61	70.79
2	固定收益投资	567,061,000.00	23.48
	其中：债券	567,061,000.00	23.48
	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	121,246,888.83	5.02
7	其他各项资产	17,193,651.41	0.71
8	合计	2,415,158,809.85	100.00

7.1.2报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

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	采矿业	-	-
C	制造业	802,153,475.16	33.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	36,580,248.68	1.53
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	604,906,121.34	25.28
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	199,844,852.88	8.35
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	66,172,571.55	2.77
S	综合	-	-
	合计	1,709,657,269.61	71.45

7.1.3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	300070	碧水源	6,671,336	195,136,578.00	8.15
2	600570	恒生电子	5,621,898	165,283,801.20	6.91
3	002701	奥瑞金	7,457,073	150,409,162.41	6.29
4	300002	神州泰岳	9,456,448	148,939,056.00	6.22
5	300334	津膜科技	6,881,659	145,203,004.90	6.07
6	300212	易华录	3,946,752	123,612,272.64	5.17
7	300020	银江股份	2,743,962	83,965,237.20	3.51
8	002465	海格通信	5,192,926	82,723,311.18	3.46
9	300133	华策影视	2,071,129	66,172,571.55	2.77
10	601515	东风股份	5,498,469	65,321,811.72	2.73

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于博时基金管理有限公司网站的半年度报告正文。

7.1.4报告期内股票投资组合的重大变动

7.1.4.1累计买入金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例（%）
1	300194	福安药业	16,821,645.36	0.70
2	601231	环旭电子	15,753,142.51	0.66
3	300146	汤臣倍健	13,741,239.55	0.57
4	300144	宋城演艺	7,803,363.46	0.33
5	601515	东风股份	4,284,504.50	0.18
6	300002	神州泰岳	2,412,451.23	0.10
7	603369	今世缘	16,930.00	0.00

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。

7.1.4.2累计卖出金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例（%）
1	300212	易华录	111,218,636.95	4.65
2	300070	碧水源	29,974,294.93	1.25
3	002701	奥瑞金	27,813,597.49	1.16
4	600570	恒生电子	23,659,946.58	0.99
5	300020	银江股份	23,657,393.09	0.99
6	002474	榕基软件	16,929,366.18	0.71
7	300101	振芯科技	10,171,641.76	0.43
8	002065	东华软件	9,636,192.35	0.40
9	300045	华力创通	7,068,158.76	0.30
10	002249	大洋电机	6,157,116.26	0.26
11	600481	双良节能	6,148,528.38	0.26
12	600422	昆明制药	5,076,821.18	0.21
13	300104	乐视网	4,938,406.48	0.21
14	300002	神州泰岳	4,758,426.35	0.20
15	002405	四维图新	4,740,024.59	0.20
16	300168	万达信息	4,708,080.36	0.20
17	300144	宋城演艺	3,805,152.75	0.16
18	002368	太极股份	3,530,367.27	0.15
19	300335	迪森股份	2,537,164.68	0.11

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。

（下转B223版）