

## 博时裕隆灵活配置混合型证券投资基金

# 【2015】半年度报告摘要

(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。估值委员会成员均有三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,当存在异议时,托管银行有责任要求基金管理人作出合理解释,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 管理人对于报告期内本基金利润分配情况的说明  
本基金管理人已于2015年1月12日发布公告,以2014年12月31日可分配利润为基准,每10份基金份额派发红利0.060元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明  
无。

§5 托管人报告  
5.1 报告期内本基金托管人遵守法律法规的情况说明  
在托管本基金的过程中,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、托管协议的约定,对本基金基金管理人—博时基金管理有限公司 2015 年 1 月 1 日至 2015 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本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、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。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、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,基金管理人内编制和披露的本基金半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、投资报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

§6 半年度财务会计报告 (未经审计)  
6.1 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:2015年6月30日

| 资产         | 本期末<br>2015年6月30日 | 上年度末<br>2014年12月31日 |
|------------|-------------------|---------------------|
| 货币         | 122,384,660.29    | 70,414,440.86       |
| 银行存款       | 2,232,196.30      | 550,681.90          |
| 结算备付金      | 354,865.32        | 683,053.94          |
| 存出保证金      | 955,801,038.61    | 792,344,197.44      |
| 其中:股票保证金   | 955,801,038.61    | 792,344,197.44      |
| 基金投资       | -                 | -                   |
| 债券投资       | -                 | -                   |
| 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    | 2,794,441.29      | 20,656,435.13       |
| 应收利息       | 19,603.24         | 15,530.07           |
| 应收股利       | -                 | -                   |
| 应收申购款      | 1,029,852.07      | 350,303.77          |
| 递延所得税资产    | -                 | -                   |
| 其他资产       | -                 | -                   |
| 资产总计       | 1,084,316,697.22  | 885,014,110.05      |
| 负债和所有者权益   | 2015年6月30日        | 上年度末<br>2014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     | 2,651,380.24      | -                   |
| 应付赎回款      | 39,162,415.06     | 27,374,681.44       |
| 应付管理人报酬    | 1,730,901.97      | 1,197,067.10        |
| 应付托管费      | 288,485.64        | 199,511.21          |
| 应付销售服务费    | -                 | -                   |
| 应付交易费用     | 1,494,563.14      | 973,844.23          |
| 应交税费       | 145,972.00        | 145,972.00          |
| 应付利息       | -                 | -                   |
| 应付利润       | -                 | -                   |
| 其他负债       | -                 | -                   |
| 基金所得负债     | 1,743,978.42      | 1,669,323.17        |
| 负债合计       | 46,977,465.17     | 32,060,385.15       |
| 所有者权益:     |                   |                     |
| 实收基金       | 610,964,381.86    | 789,327,785.52      |
| 未分配利润      | 428,354,850.19    | 72,115,056.32       |
| 所有者权益合计    | 1,037,319,232.05  | 852,963,729.70      |
| 负债和所有者权益总计 | 1,084,316,697.22  | 885,014,110.05      |

注:报告截止日2015年6月30日,基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.2 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:2015年1月1日至2015年6月30日

| 资产                    | 本期末<br>2015年6月30日 | 上年度末<br>2014年12月31日 |
|-----------------------|-------------------|---------------------|
| 一、收入                  | 341,402,210.72    | 52,561,015.71       |
| 1.利息收入                | 288,302.59        | 1,719,000.00        |
| 其中:存款利息收入             | 288,302.59        | 64,520.68           |
| 债券利息收入                | -                 | 1,654,181.16        |
| 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)      | 371,469,734.07    | 7,563,504.19        |
| 其中:股票投资收益             | 369,809,468.00    | 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                  | 1,660,260.07      | 2,189,031.55        |
| 3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列) | -32,611,769.22    | 41,868,392.31       |
| 4.汇兑收益(损失以“-”号填列)     | -                 | -                   |
| 5.其他收入(损失以“-”号填列)     | 2,245,942.04      | 1,320,112.57        |
| 二、费用                  | 12,985,192.06     | 4,053,740.06        |
| 1. 管理人报酬              | 7,513,033.02      | 2,862,790.50        |
| 2. 托管费                | 1,252,172.21      | 477,132.26          |
| 3. 销售服务费              | -                 | -                   |
| 4. 交易费用               | 3,000,356.24      | 692,625.31          |
| 5. 利息支出               | -                 | -                   |
| 其中:卖出回购金融资产支出         | -                 | -                   |
| 6. 其他费用               | 199,567.57        | 31,189.99           |
| 二、费用合计(亏损以“-”号填列)     | 328,537,000.00    | 46,567,275.65       |
| 三、净利润(净亏损以“-”号填列)     | 328,537,000.00    | 46,567,275.65       |

6.3 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:2015年1月1日至2015年6月30日

| 项目                                 | 2015年1月1日至2015年6月30日 | 2014年6月30日至2014年12月31日 |
|------------------------------------|----------------------|------------------------|
| 一、期初所有者权益(基金净值)                    | 789,327,785.52       | 72,115,056.32          |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)           | -328,537,000.00      | 328,537,000.00         |
| 三、本期基金份额变动产生的基金净值变动数(本期申购、赎回及转入转出) | -169,873,403.67      | 29,670,661.97          |
| 四、本期基金投资损益                         | 339,563,433.45       | 316,467,376.49         |
| 五、本期基金费用                           | -609,428,527.12      | -296,776,743.54        |
| 六、本期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净利润)      | -                    | -796,223,561.64        |
| 七、期末所有者权益(基金净值)                    | 610,964,381.86       | 428,354,850.19         |
| 八、未分配利润                            | 428,354,850.19       | 72,115,056.32          |
| 九、所有者权益合计                          | 1,037,319,232.05     | 852,963,729.70         |
| 十、净利润                              | 328,537,000.00       | 46,567,275.65          |

6.4 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.5 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.6 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.7 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.8 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.9 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.10 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.11 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.12 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.13 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.14 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.15 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.16 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.17 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.18 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.19 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.20 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.21 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.22 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.23 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.24 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.25 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.26 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.27 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.28 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.29 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.30 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.31 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.32 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.33 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.34 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.35 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.36 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.37 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.38 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.39 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.40 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.41 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.42 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.43 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.44 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.45 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.46 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.47 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.48 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.49 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.50 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.51 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.52 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.53 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.54 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.55 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.56 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.57 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.58 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.59 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.60 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.61 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.62 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.63 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.64 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.65 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.66 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.67 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.68 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.69 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.70 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.71 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.72 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.73 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.74 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.75 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.76 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.77 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.78 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.79 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.80 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.81 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.82 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.83 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.84 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.85 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.86 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.87 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.88 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.89 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.90 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.91 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.92 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.93 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.94 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.95 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.96 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.97 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.98 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.99 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.100 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.101 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.102 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.103 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.104 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.105 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.106 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.107 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。

6.108 本报告期末基金份额净值1.964元,基金份额总额528,238,240.77份。