

(上接B342版)

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月2日(基金合同生效日至2014年6月30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	9,337,113.58	12,060,515.50
其中:存款利息收入	180,492.88	96,309.61
债券利息收入	9,156,620.69	12,061,135.36
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“-”号填列)	-293,921,675.63	52,662,331.96
其中: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	6,572,989.28	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(基金合同生效前日)

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月2日(基金合同生效日至2014年6月30日)	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
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期损益)	-	-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
项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	3,000,000,000.00	-41,714,917.35
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期损益)	-	-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

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:

基金管理人:吴晓东 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保持一致的说明

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规定操作,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

项目	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
中国银河证券股份有限公司(“银河证券”)	基金发起人
中信证券股份有限公司(“中信证券”)	基金发起人
招商证券股份有限公司(“招商证券”)	基金发起人、基金管理人关联方

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

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月2日(基金合同生效日至2014年6月30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	694,211,354.43	16,624,385.04
占当期股票成交金额的比例	15.62%	16.40%
占当期股票成交总额的比例	-	-
占当期股票成交总额的比例	-	-

6.2.4.4.1.2 权证交易

6.2.4.4.1.3 债券交易

6.2.4.4.1.4 债券回购交易

6.2.4.4.1.5 应支付关联方的佣金

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月2日(基金合同生效日至2014年6月30日)	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期佣金	632,011.77	16,400.97
占当期佣金总量的比例	16.40%	16.40%
占当期佣金总量的比例	-	-
占当期佣金总量的比例	-	-

注:1. 上述佣金参考市场价格按本基金的基金管理人于与对方协商确定,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证券登记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(基金合同生效日至2014年6月30日)	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金管理人报酬	16,242,385.04	21,466,527.54
注:支付基金管理人博时基金的基金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。	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×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

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(基金合同生效日至2014年6月30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	-	-
期间赎回/卖出总份额	-	-
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 2014年6月2日(基金合同生效前日)	上期 2013年12月31日
持有的基金份额	3,000,000.00	3,000,000.00
持有的基金份额占基金总份额的比例	0.10%	0.10%
持有的基金份额	6,000,000.00	6,000,000.00
持有的基金份额占基金总份额的比例	0.20%	0.20%
持有的基金份额	3,000,000.00	3,000,000.00
持有的基金份额占基金总份额的比例	0.10%	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(基金合同生效前日)	上期 2013年1月1日至2013年6月30日
期末余额	36,359,618.14	151,246.17
当期利息收入	-	-
中国工商银行	-	-

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

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(基金合同生效前日))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	期末单位数(股)	期末成本总额	期末市值总额
300068	万信通信	14/3/27	公司债券重组	19,55	14,6/25	20,48
300133	博时转债	14/3/29	公司债券重组	32,44	14,6/17	20,81
合计	1	1	1	1	1	1

注:本基金截至2014年6月2日(基金合同生效前日)止持有以上公布的大事件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 期末持有的正在回购交易中的作为抵押的债券

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)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	1,709,627,269.61	70.79
2	固定收益投资	1,709,627,269.61	70.79
3	贵金属投资	567,061,000.00	23.48
4	其中:债券	567,061,000.00	23.48
5	资产支持证券	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其中:买入返售金融资产	-	-
9	银行存款和结算备付金合计	121,246,888.83	5.02
10	其他流动资产	17,193,651.41	0.71
11	合计	2,415,138,809.85	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	36,580,288.68	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	卫生和社公工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	66,172,571.55	2.77
S	综合	-	-
合计		1,709,627,269.61	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	恒顺醋业	6,671,236	195,136,578.00	8.15
2	600570	恒生电子	5,621,998	168,283,801.20	6.91
3	002701	华宝基金	7,857,075	150,409,162.41	6.29
4	300002	神州泰岳	9,456,148	148,939,056.00	6.22
5	300334	津润科技	6,981,659	145,203,004.90	6.07
6	300012	弘业期货	3,946,752	125,612,272.64	5.17
7	300020	银江股份	2,743,962	83,965,237.20	3.51
8	002465	海格通信	5,192,526	82,723,528.11	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,应阅读披露于博时基金管理有限公司网站的半年度报告正文。

7.1.4 报告期末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	瑞红药业	16,821,645.36	0.70
2	601231	环境电子	15,753,142.51	0.66
3	300146	蓝色光标	13,741,209.55	0.57
4	300144	神州泰岳	7,857,075.00	0.33
5	601515	东风股份	4,284,504.50	0.18
6	300002	神州泰岳	4,242,451.23	0.10
7	601369	宁波银行	16,900.00	0.00

注:本项的“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	昆药集团	111,218,636.95	4.65
2	300070	恒顺醋业	29,974,254.93	1.25
3	002701	华宝基金	27,815,597.49	1.16
4	600570	恒生电子	23,689,946.58	0.99
5	300020	银江股份	23,657,393.09	0.99
6	002474	恒华科技	16,929,366.18	0.71
7	300010	航宇科技	10,171,641.76	0.43
8	002065	华胜软件	9,636,192.35	0.40
9	300045	华力创通	7,068,158.76	0.30
10	002249	天津光机	6,157,116.26	0.26
11	600481	良辰药业	6,148,528.38	0.26
12	600422	昆明制药	5,076,821.18	0.21
13	300104	华胜软件	4,938,406.48	0.21
14	300002	神州泰岳	4,759,426.35	0.20
15	002405	四维图新	4,749,024.59	0.20
16	300168	万达信息	4,708,080.36	0.20
17	300144	神州泰岳	3,805,152.75	0.16
18	002568	大农股份	3,530,367.27	0.15
19	300335	通鑫股份	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。

7.1.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

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(%)
----	------	------	----------	----------------