

博时鑫泽灵活配置混合型证券投资基金 2016年年度报告摘要

2016年12月31日
基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

“由中国基金报、香山财富论坛、深圳市政府金融办、国泰基金联合主办的“中国机构投资者峰会暨财富管理国际论坛”2016年5月13日在深举行。博时旗下博时信用债券获得“五年持续跟踪荣获优秀明星基金奖”

“2016年5月10日,由上海证券报主办的2016中国基金高峰论坛第十三届“基金”颁奖盛典在上海举办,博时基金荣获“2015年度基金·债券投资回报基金基金经理”大奖。

“2016年4月15日,由中国基金报主办的第二届中国基金业中华英评选揭晓,博时基金经理刘欣先生获评三期二届中国基金业最佳基金经理,二期二届中国基金业最佳基金经理。

“2016年3月27日,第十三届中国基金金牛奖揭晓,博时基金赢得了基金业的“奥斯卡”奖——“固定收益类基金·基金公司”奖。

“2016年3月15日,由和讯证券主办的“‘挑战·机遇’315评选——投资者最认可的券商、基金领军人物”评选活动日前揭晓,博时基金董事长张光华先生获评“投资者最认可的公募基金领军人物”,网络票选高居第二位。

“2016年1月18日,大众证券报“2015中国基金风云榜”颁奖盛典在(050014)荣获2015“最受投资者喜爱基金”奖、博时安丰18个月定开债(160615)荣获2015“最佳固定收益型基金”奖。

“2016年1月15日,2016年金理财奖颁奖典礼暨第六届“金貔貅”奖颁奖典礼在京举办,博时基金获评年度金貔貅品牌力、金貔貅创新力两项大奖,博时“存金宝”获年度金貔貅创新力金融产品奖。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的介绍

注:上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的信息日期填写。证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内,本基金管理人严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他各项法律法规、基金合同和其他相关法律法规的规定,并未有实际运作违规、操纵市场、欺诈等行为,严格遵守了基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制、禁止行为等规定,未发生任何违法违规行为,未发生任何损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内本基金交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

报告期内,根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关要求,公司进一步提高了公平交易管理水平,通过完善交易方式和流程,分别对一级市场和二级市场交易的策略和投资品种的公平交易原则,控制境内及境外业务进行了详细梳理,同时通过强化事后分析评估监督机制来确保公司公平对待管理的所有投资组合。

4.3.2 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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内本基金的投资策略和业绩表现

报告期内,本基金经理刘欣先生秉承了“稳健、灵活、长期”的投资理念,在严格控制风险的前提下,积极把握市场机会,通过精选个股和债券,力争实现基金资产的长期增值。

4.4.2 报告期内基金的投资策略

4.4.2.1 资产配置

报告期内,本基金A类基金份额净值增长率为0.09%,份额累计增长率为0.09%。报告期内,本基金A类基金份额净值增长率为-0.10%,同期业绩基准增长率为-0.76%。

4.4.2.2 行业配置

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。

4.4.2.3 个股选择

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。

4.4.2.4 债券选择

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。

4.4.2.5 衍生品选择

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。

4.4.2.6 其他选择

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。

4.4.2.7 风险控制

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。

4.4.2.8 其他说明

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。

4.4.2.9 其他说明

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。

4.4.2.10 其他说明

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。

4.4.2.11 其他说明

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。

4.4.2.12 其他说明

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。

4.4.2.13 其他说明

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。

4.4.2.14 其他说明

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。

4.4.2.15 其他说明

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。

4.4.2.16 其他说明

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。

4.4.2.17 其他说明

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。

4.4.2.18 其他说明

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。

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。

7.2 利润表

博时鑫泽灵活配置混合型证券投资基金
2016年10月17日(基金合同生效日)至2016年12月31日

Table with columns: 项目, 2016年10月17日至2016年12月31日, 2016年10月17日至2016年12月31日, 2016年10月17日至2016年12月31日. Rows include 营业收入, 公允价值变动损益, 投资收益, 其他收入, 营业利润, 营业外收入, 营业外支出, 利润总额, 所得税费用, 净利润, 归属于母公司所有者权益的变动情况.

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

博时鑫泽灵活配置混合型证券投资基金
2016年10月17日(基金合同生效日)至2016年12月31日

Table with columns: 项目, 2016年10月17日至2016年12月31日, 2016年10月17日至2016年12月31日, 2016年10月17日至2016年12月31日. Rows include 基金净值, 基金净值变动, 基金净值变动原因, 基金净值变动原因说明.

注:本报财务报表为财务报表的组成部分。

本报财务报表为财务报表的组成部分。

本报财务报表为财务报表的组成部分。

本报财务报表为财务报表的组成部分。

本报财务报表为财务报表的组成部分。

本报财务报表为财务报表的组成部分。

本报财务报表为财务报表的组成部分。

本报财务报表为财务报表的组成部分。

本报财务报表为财务报表的组成部分。

本报财务报表为财务报表的组成部分。

本报财务报表为财务报表的组成部分。

本报财务报表为财务报表的组成部分。

本报财务报表为财务报表的组成部分。

本报财务报表为财务报表的组成部分。

本报财务报表为财务报表的组成部分。

本报财务报表为财务报表的组成部分。

本报财务报表为财务报表的组成部分。

本报财务报表为财务报表的组成部分。

本报财务报表为财务报表的组成部分。

本报财务报表为财务报表的组成部分。

本报财务报表为财务报表的组成部分。

本报财务报表为财务报表的组成部分。

本报财务报表为财务报表的组成部分。

本报财务报表为财务报表的组成部分。

本报财务报表为财务报表的组成部分。

本报财务报表为财务报表的组成部分。

本报财务报表为财务报表的组成部分。

本报财务报表为财务报表的组成部分。

本报财务报表为财务报表的组成部分。

本报财务报表为财务报表的组成部分。

本报财务报表为财务报表的组成部分。

本报财务报表为财务报表的组成部分。

本报财务报表为财务报表的组成部分。

本报财务报表为财务报表的组成部分。

本报财务报表为财务报表的组成部分。

本报财务报表为财务报表的组成部分。

本报财务报表为财务报表的组成部分。

本报财务报表为财务报表的组成部分。

本报财务报表为财务报表的组成部分。

本报财务报表为财务报表的组成部分。

通知:财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2)对基金从事证券市场中取得收入,包括买卖股票、债券差价收入,股票股息、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)对基金取得的国债利息收入,应当由发行债券的企业在支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。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,暂免征收个人所得税。对持有超过1年的上市公司限售股,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。7.4.1 重要财务报表项目的说明

7.4.4 关联方关系

关联方关系

关联方关系

关联方关系

关联方关系

关联方关系

关联方关系

关联方关系

关联方关系

关联方关系

关联方关系

关联方关系

关联方关系

关联方关系

关联方关系

关联方关系

关联方关系

关联方关系

关联方关系

关联方关系

关联方关系

关联方关系

关联方关系

关联方关系

关联方关系

关联方关系

关联方关系

关联方关系

关联方关系

关联方关系

关联方关系

关联方关系

关联方关系

关联方关系

关联方关系

关联方关系

关联方关系

关联方关系

关联方关系

关联方关系

关联方关系

关联方关系

关联方关系

关联方关系

关联方关系

关联方关系

关联方关系

关联方关系

关联方关系

关联方关系

关联方关系

关联方关系

关联方关系

关联方关系

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年度报告正文。

8.4 报告期内期末投资组合的重大变动

8.4.1 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

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 买入金额(元), 占期末基金资产净值比例(%)

注:此项“买入金额”均按买入成交金额(成交单乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.2 买入股票的成本总额及卖出股票的成本总额

注:此项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额(成交单乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)