

宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资 基金 2015 年年度报告

2015 年 12 月 31 日

基金管理人：宝盈基金管理有限公司

基金托管人：广发证券股份有限公司

送出日期：2016 年 3 月 26 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 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。

基金托管人广发证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 3 月 25 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。

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金财务会计报告出具了标准无保留意见的审计报告，基金管理人在本报告中对相关事项亦有详细说明，请投资者注意阅读。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 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	17
§ 5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	17
§ 6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§ 7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	21
7.4 报表附注	22
§ 8 投资组合报告	43
8.1 期末基金资产组合情况	43
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	43
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	44
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	53
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	54

8.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	54
8.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	54
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	54
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
8.12	投资组合报告附注	54
§ 9	基金份额持有人信息	55
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	56
§ 10	开放式基金份额变动	56
§ 11	重大事件揭示	57
11.1	基金份额持有人大会决议	57
11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	57
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	57
11.4	基金投资策略的改变	57
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	57
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	58
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	58
11.8	其他重大事件	59
§ 12	影响投资者决策的其他重要信息	66
§ 13	备查文件目录	66
13.1	备查文件目录	66
13.2	存放地点	66
13.3	查阅方式	66

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	宝盈睿丰创新混合	
基金主代码	000794	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014 年 9 月 26 日	
基金管理人	宝盈基金管理有限公司	
基金托管人	广发证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	590,768,588.29 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	宝盈睿丰创新混合 A/B	宝盈睿丰创新混合 C
下属分级基金的交易代码:	000794	000796
下属分级基金的前端交易代码	000794	-
下属分级基金的后端交易代码	000795	-
报告期末下属分级基金的份额总额	106,885,196.14 份	483,883,392.15 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过相对灵活的资产配置，重点关注具备持续创新能力的上市公司，在严格控制风险的前提下，谋求基金资产的长期、稳定增值。
投资策略	本基金的投资策略分为两个层面：首先，依据基金管理人 的大类资产配置策略动态调整基金资产在各大类资产间的分配比例；而后，进行各大类资产中的个股、个券精选。具体由大类资产配置策略、股票投资策略、固定收益类资产投资策略和权证投资策略四部分组成。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×65% + 中债综合指数收益率（全价）×35%
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。

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	宝盈基金管理有限公司	广发证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张瑾
	联系电话	0755-83276688
	电子邮箱	zhangj@byfunds.com
客户服务电话	400-8888-300	-
传真	0755-83515599	020-87555129
注册地址	深圳市深南路 6008 号特区报业大厦 1501	广东省广州市天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼
办公地址	广东省深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 10 层	广东省广州市天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼
邮政编码	518034	510620

法定代表人	李文众	孙树明
-------	-----	-----

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、证券时报、上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.byfunds.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼
注册登记机构	宝盈基金管理有限公司	广东省深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 10 层

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015 年		2014 年 9 月 26 日(基金合同生效日)-2014 年 12 月 31 日	
	宝盈睿丰创新混合 A/B	宝盈睿丰创新混合 C	宝盈睿丰创新混合 A/B	宝盈睿丰创新混合 C
本期已实现收益	17,956,692.25	-156,759,649.00	3,208,148.80	18,306,710.27
本期利润	-234,300,999.35	149,204,891.33	2,067,709.21	16,569,454.16
加权平均基金份额本期利润	-0.3751	0.2657	0.0257	0.0281
本期加权平均净值利润率	-23.30%	17.63%	2.51%	2.75%
本期基金份额净值增长率	82.20%	69.92%	1.70%	1.40%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末		2014 年末	
期末可供分配利润	-34,052,313.22	-186,285,219.10	1,177,779.98	5,850,029.98
期末可供分配基金份额利润	-0.3186	-0.3850	0.0171	0.0139
期末基金资产净值	198,106,943.23	833,669,512.99	70,089,490.00	427,968,239.87
期末基金份额净值	1.853	1.723	1.017	1.014
3.1.3 累计期末指标	2015 年末		2014 年末	
基金份额累计净值增长率	85.30%	72.30%	1.70%	1.40%

注：1、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。

2、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、期末可供分配利润采用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。

4、所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 基金净值表现

3.2.1 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

宝盈睿丰创新混合 A/B

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	43.98%	2.40%	11.34%	1.08%	32.64%	1.32%
过去六个月	17.95%	3.82%	-9.27%	1.74%	27.22%	2.08%
过去一年	82.20%	2.84%	6.94%	1.61%	75.26%	1.23%
自基金合同生效起至今	85.30%	2.61%	37.30%	1.52%	48.00%	1.09%

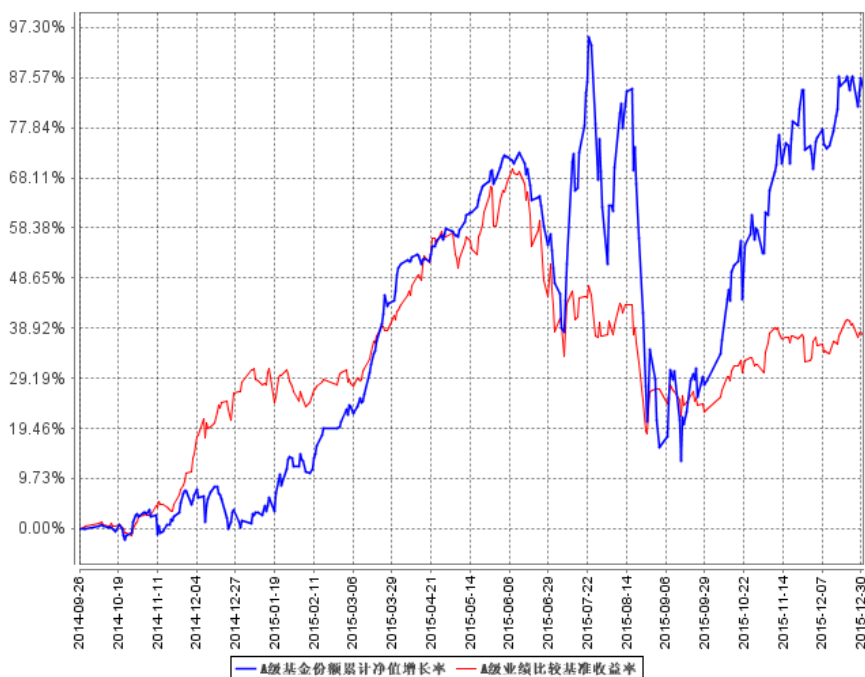
宝盈睿丰创新混合 C

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	43.46%	2.40%	11.34%	1.08%	32.12%	1.32%
过去六个月	10.52%	3.85%	-9.27%	1.74%	19.79%	2.11%
过去一年	69.92%	2.87%	6.94%	1.61%	62.98%	1.26%
自基金合同生效起至今	72.30%	2.63%	37.30%	1.52%	35.00%	1.11%

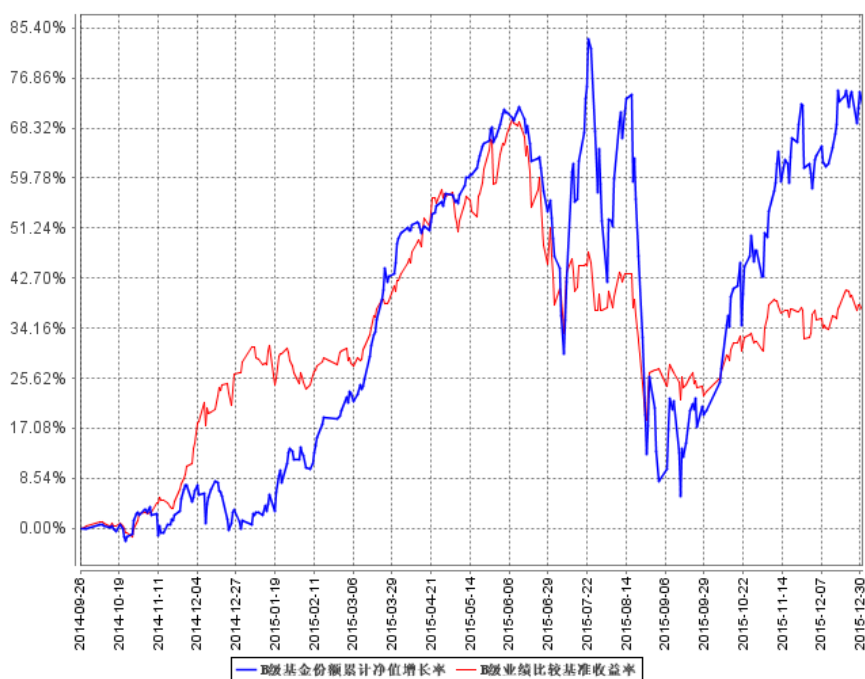
注：本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×65% +中债综合指数收益率（全价）×35%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



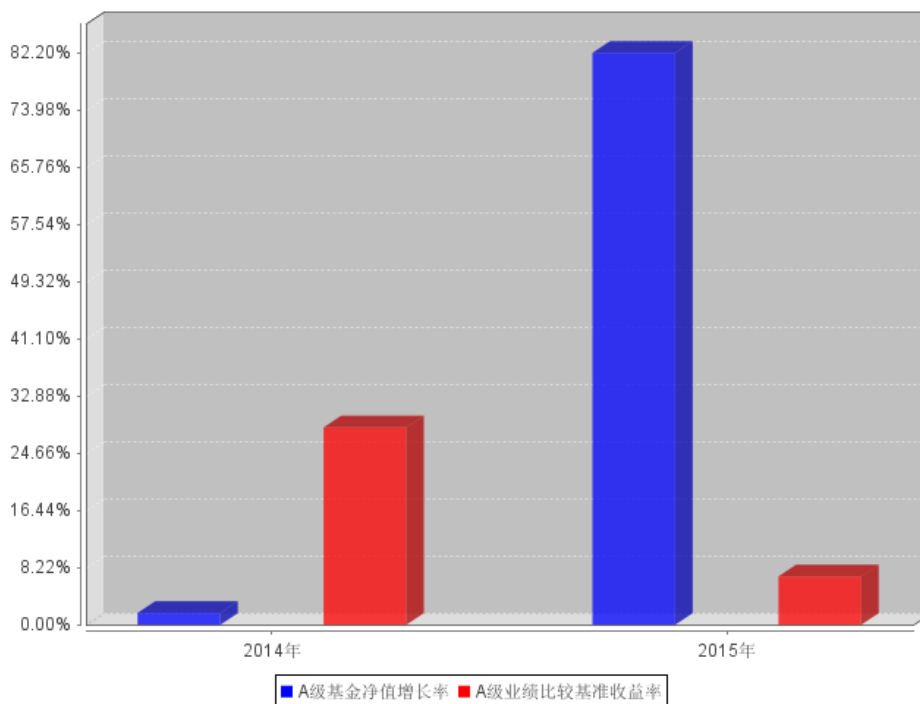
B级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



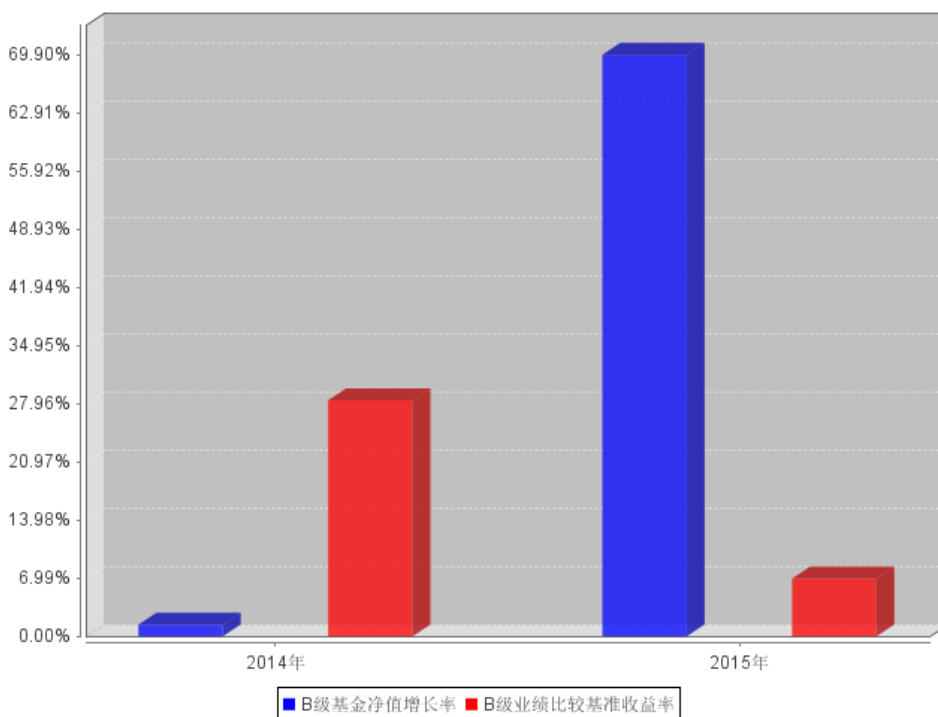
注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起的 6 个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同中的相关约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

A级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



B级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金合同生效不足3年，至报告期末未进行利润分配。

§ 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

基金管理人：宝盈基金管理有限公司是 2001 年按照证监会“新的治理结构、新的内控体系”标准设立的首批基金管理公司之一，2001 年 5 月 18 日成立，注册资本为人民币 1 亿元，注册地在深圳。公司目前管理基金鸿阳、宝盈鸿利收益混合、宝盈泛沿海混合、宝盈策略增长混合、宝盈增强收益债券、宝盈资源优选混合、宝盈核心优势混合、宝盈货币、宝盈中证 100 指数增强、宝盈新价值混合、宝盈祥瑞养老混合、宝盈科技 30 混合、宝盈睿丰创新混合、宝盈先进制造混合、宝盈新兴产业混合、宝盈转型动力混合、宝盈祥泰养老混合、宝盈优势产业混合、宝盈新锐混合、宝盈医疗健康沪港深股票、宝盈国家安全沪港深股票二十一只基金，公司恪守价值投资的投资理念，并逐渐形成了稳健、规范的投资风格。公司拥有一支经验丰富的投资管理团队，在研究方面，公司汇聚着一批从事宏观经济、行业、上市公司、债券和金融工程研究的专业人才，为公司的投资决策提供科学的研究支持；在投资方面，公司的基金经理具有丰富的证券市场投资经验，以自己的专业知识致力于获得良好业绩，努力为投资者创造丰厚的回报。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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		
彭敢	本基金、宝盈资源优选混合型证券投资基金、宝盈科技 30 灵活配置混合型证券投资基金、宝盈策略增长混合型证券投资基金、宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；总经理助理；投资部总监	2014 年 9 月 26 日	-	14 年	彭敢先生，金融学硕士。曾就职于大鹏证券有限责任公司综合研究所、银华基金管理有限公司投资管理部、万联证券有限责任公司研发中心、财富证券有限责任公司从事投资研究工作。2010 年 9 月起任职于宝盈基金管理有限公司投资部。中国国籍，证券投资基金从业人员资格。
易祚兴	本基金、宝盈资源优选混合型证券投资基金、	2015 年 1 月 30 日	-	4 年	易祚兴先生，浙江大学计算机应用硕士。历任浙江天

	宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金、宝盈策略增长混合型证券投资基金、宝盈科技 30 灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理			堂硅谷资管集团产业整合部投资经理、中投证券资产管理部专户投资经理/研究员，2014 年 11 月起加入宝盈基金管理有限公司任研究员、基金经理助理。中国国籍，证券投资基金从业人员资格。
--	---	--	--	---

注：1. 本基金基金经理为首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写；

2. 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，证券从业年限的计算截至 2015 年 12 月 31 日。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，无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 公平交易制度和控制方法

我公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《宝盈基金管理有限公司公平交易制度》对本基金的日常交易行为进行监控。

公司对不同投资组合，尤其是同一位投资组合经理管理的不同投资组合同日同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行监控，同时对不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析，形成《公平交易分析报告》，并要求相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理解释。

公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。确因投资组合的投资策略或流动性等需要而发生的同日反向交易，公司要求相关投资组合经理提供决策依据，并留存记录备查，但是完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合等除外。

公司对其他可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，对于异常交易发生后不同投资组合买卖该异常交易证券的情况进行分析，并要求相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《宝盈基金管理有限公司公平交易制度》对本基金的日常交易行为进行监控，并定期制作公平交易分析报告，对不同投资组合的收益率、同向交易价差、反向交易价差作专项分析。报告结果表明，本基金在本报告期内的同向交易价差均在可合理解释范围之内；在本报告期内基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，在投资活动中公平对待不同投资组合，公平交易制度执行情况良好，无损害基金持有人利益的行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，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的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015 年股票市场走势波澜壮阔，上半年呈现创业板带动中小板、主板快速上涨行情，6 到 8 月份又快速回落，9 月后到年底又企稳反弹；全年，上证指数涨幅 9.41%、沪深 300 涨幅 5.58%、深成指涨幅 14.98%，同期，创业板指数涨幅 84.41%，中小板指数涨幅为 53.7%；整体来看中小板、创业板在 2015 年呈现牛市特征。本基金在 2015 年实现收益显著高于比较基准，为基金持有人获取了较为丰厚的收益。

本基金管理人认为，本届政府对中国经济转型的决心毋庸置疑，虽然政府反腐力度逐渐加大等，某种程度上短期对经济及职能效率有一定程度影响，但长期来看，出清腐败、加强监管、巩固执政理念，有利于更强有力的改革措施出台，减少改革阻力。目前来看，实体经济增速放缓趋势依然严峻，GDP 增速在持续下滑调整过程中，政府需要通过各种货币政策工具来降低实体经济利率，给企业减压输血，同时也通过供给侧改革来加速传统产业整合升级；从整体来看，政府依然能有决心实现稳步的经济增长，同时也全面支持发展新兴产业，无论是对创业者的政策环境支持还是通过资本市场改革来扶持新兴企业发展，都能体现国家对经济结构转型升级的决心。

从改革开放三十多年的经济发展历程来看，不要去质疑政府对发展经济作为第一要务的决心，也不要轻易判断经济会断崖式下跌或者硬着陆等，我们需要积极的去适应当前经济转型的新常态，需要有耐心的寻找产业转型新的方向和政府职能转变后新的机遇，总之，我们处在激烈变革

的新时代，必然伴随着社会行为及市场主体发生着相应的波动行为，我们相信当前的一切痛苦可以是一个深度的自然净化过程，我们需要的是一种坚持的信念。

回顾市场，2015 年 A 股各类主题依然纷繁复杂，上半年成长风格依然延续过去两年走势，且小市值股票遭到跟风热炒，同时大盘也走强跟涨，主板和创业板发生共振，上证都创出 5178.19 的 8 年新高位置，然而下半年开始，市场发生巨幅调整，高杠杆的去除过程也加速了市场的下跌，整体市场情绪在下半年的调整过程中由牛转熊，但全年来看依然是创业板和中小板的牛市年份。虽然全年市场表象上与基金管理人的理念基本吻合，中小创依然是领涨市场，但在实际操作中，基金管理人坚持以较严格的公司成长模式和业绩增长标准来来操作，在板块选择上坚持选择与过往市场不同的新的投资方向和成长主题，虽然由此也丧失了一些投资机会，但从整体结果来看，获取的收益率较为理想。年末主要持仓集中在环保、TMT、医药、军工、体育、泛娱乐等方向。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

宝盈睿丰创新混合 A/B：本基金在本报告期内净值增长率是 82.20%，同期业绩比较基准收益率是 6.94%。

宝盈睿丰创新混合 C：本基金在本报告期内净值增长率是 69.92%，同期业绩比较基准收益率是 6.94%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 年中国的宏观经济仍然处于持续触底的过程，尽管政府出台了多项改革和稳增长的财政和货币政策，但经济增长的固有规律在发挥作用，过剩产能以及前期大量的房地产和固定资产投资仍然成为经济的主要风险。而油价的大幅下跌虽然短期有利于中国经济成本降低，但是否会带来输入性通缩，并与产能过剩带来的内在的经济通缩叠加，对企业经营已经构成了下行压力，目前来看国家在稳定经济增长方面信心十足，及时的提出供给侧改革让我们更坚定的看好本届政府对经济转型的决心。

从我们分析来看，A 股经历了三年的牛市上升通道，主要核心逻辑主要在如下几点：（1）中国的经济结构正在发生近 30 年来前所未有的变化，新技术、新商业模式的企业三年来加速呈现在市场中；（2）2013 年后中国的货币政策基本处于宽松的氛围中，流动性宽裕、政策面宽松；（3）政府对党政机关及国企反腐态势蔓延，民众对改革转型预期较强，市场也给予了较高的改革估值溢价；（4）传统的民营上市企业在经济转型中走在时代前列，在注册制没有放开的过去三年，通过兼并整合及借壳上市等资本运作方式给市场带来了不少新板块、新龙头和大量投资热点，市场参与热情高涨，新增资金入市积极。在我们看来，这三年 A 股市场演绎着这个时代的转型特征，

中国需要新经济、政府需要新增长，虽然市场制度在进行循序渐进的改革尝试，但是新一代的企业家和主动迎合时代发展趋势的企业家正在成为市场新的主力龙头，互联网金融、数字营销、新媒体、机器人等都从市场追逐概念变成了较为成熟的板块，带来了巨大的财富效应和社会效应；我们坚信一个大时代的变迁不会是短短三年能完成变迁的，从国外发达经济体的转型之路来看也是一个较为长期充满波折的长期过程，在过去的 2015 年经历了波澜壮阔的涨跌行情，从另一种角度也可以体现为大变革时代的一种显著特征。

从市场来看，目前股票市场经历了三季度巨幅震荡下跌后，国家层面救市政策已经落实，股指期货等股票衍生工具对市场的影响已经降低到 2014 年以前的水平，降准降息同步落地，市场在四季度逐渐企稳。在利率下行趋势下，在降息降准已经兑现，资产价格决定于未来现金流，现金流充裕的情况和 A 股不发生系统性风险前提下，以成长股为代表的创业板、盈利模式逐渐清晰的新型蓝筹以及智能制造转型升级等都存在着新时代资本市场盛宴的机会。从制度红利来看，中国政府对资本市场和国企治理的决心已毋庸置疑，沪港通、深港通、证券法修改及注册制等都是资本市场已发生或即将发生的重大影响意义的事件；同时国企治理对改革转型起到关键性作用，国有资产证券化是较好的实现途径。从长期看，中国通过改革转型提升经济增长的空间仍然很大，新的国家战略如一带一路的提出等让市场预期政府会通过向全球输出中国的高铁等优势产业来缓解产能过剩问题。同样的，“互联网+”为主要手段的各行业互联网化趋势逐渐确立，互联网金融、互联网医疗、互联网能源以及互联网农业等在转型升级的中国带来了很多投资机遇和新的产业形态。

我们认为中国资本市场不管是过去、现在还是未来的走势均是对中国经济前景和改革信心的反应。从目前宏观经济数据和改革管理措施来看，看不到改善的迹象，各种改革措施总体来说也是雷声大雨点小，资本市场的大环境难言乐观。但从另一方面来看，中国经济的韧性和中国企业家的创新精神和奋斗意识在全球横向比较中仍然有一定的优势，中国经济的前景也无需过于担心。

因此，现阶段的市场调整可以更多的理解为市场下跌趋势的惯性延续。投资者信心的恢复需要时间，而市场重新走出趋势性的上涨行情需要更多的宏观经济数据的变化和政府改革措施的落实实施，并给投资者带来信心。

目前来看，市场的悲观因素反应较为充分，而市场积极的因素在累积，如 G20 会议带来的全球宏观政策的协调、美联储加息政策的变化、两会前后十三五规划的讨论、国家以供给侧改革为核心的国有企业改革措施的落实等等。所以在目前阶段，虽然市场信心较弱，但在经历多次下跌后，市场目前所处的位置具有较好的风险收益比。即使从市场波动来看，考虑到目前市场与历史估值比较相对偏低的位置，个人判断今年仍然存在一轮趋势性上涨的机会。投资的热点可能集中

在周期性股票的博弈机会、国企改革带来的国企控股优质公司的变革，成长股方面，体育传媒等新兴消费服务业、以云计算大数据为核心的科技产业、以 VR 等技术变革为中心的新技术产业会有持续的盈利机会。

从价值投资的角度来看，目前自下而上选股可投资的股票越来越多，有相当一部分股票进入合理乃至极有价值的投资区间。虽然我们认为市场未来仍有调整空间，但市场分化也将产生，我们相信，部分优质公司的选择仍能提供较好的获利机会。

从 2016 年全年来看，2016 年是中国资本市场新变革的起点，注册制、战略新兴板、深港通等都要一一落地，新的 2016 年是变革之年，也是经历了 2015 年 A 股市场大震荡后市场重建的一年。我们认为新的一年需要去耐心观察新机制推出后产生新的变化、也需要主动适应新的变化、更需要积极寻找新的机遇，可以判断的是经历了三年上期上涨趋势后，2016 年不大会出现 2015 年上半年高收益的基础，也不能排除 2015 年三季度暴跌动荡的可能性，但个人认为市场企稳后结构性行情依然存在，我们需要在新的 2016 年降低投资收益的预期，但也需要充分寻找新的投资机会，为持有人获取较好的投资回报。

当然我们也需要看到目前市场的一些主要风险因素，正如我们前面已经提到的：1、投资者的对经济企稳和政治体系稳定的信心；2、货币政策与汇率稳定的关系；3、资本市场改革进度和措施低于预期及市场适应新制度的能力；4、“互联网+”创新显著低于预期；5、楼市及部分固定资产快速泡沫化后的消化能力。

基金管理人秉承几个最基本的投资理念：1、投资不可能赚到所有的钱，投资要赚自己所理解和能把握的钱。投资收益有两类钱，一类是市场博弈赚趋势交易的钱，我的收益即是他人的亏损。在这个充分竞争的市场机会本基金管理人不可能持久赚到博弈的钱；2、第二类投资收益是赚公司成长的钱。优质的成长股不管在何种市场风口，最后必然超越市场涨幅，在无法判别市场风向的市场，挑选最强健的猪。尤其是成长空间巨大的公司，要有充分的耐心，这是本基金管理人的目标收益；3、中国的经济已经进入必须转型的阶段，中国经济的核心不可能是靠地产和传统国企来支撑。变革和转型创新是中国经济更重要的部分。而目前传统产业在中国股票市场中的市值比率并不低，这类企业无论是从静态还是动态估值跟国际对比偏贵、从管理水平和制度结构来说跟跨国公司对比也差距巨大。

本基金将继续重点以个股投资价值判断为主，继续采取自下而上的投资策略。基金管理人将坚持价值投资的理念，结合睿丰创新基金重点投资技术资源、渠道资源、品牌资源的特点，为投资者追求较高的收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期，公司监察稽核部门通过加强对基金投资交易业务的日常投资监控、交易流程检查、注册登记、客户服务等业务进行日常跟踪检查等工作，不断加强和完善对投资交易的事前、事中和事后控制，并定期出具专项监察报告及合规性报告等，对基金投资运作的合规性情况等等进行总结和报告。

通过以上工作，在本报告期内本基金运作过程中未发生关联交易、内幕交易，也不存在本基金管理人管理的各基金之间的违规交叉交易，基金运作整体合法合规。

本基金管理人将继续坚持一贯的内部控制理念，提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照新会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金持有的投资品种进行估值。会计师事务所就我司所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。基金托管人负责对基金管理公司采用的估值政策和程序进行核查，并对估值结果及净值计算进行复核。

本基金管理人设立估值工作小组，由投资部、研究部、固定收益部、专户投资部、量化投资部、基金运营部、监察稽核部指定人员组成。相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经验。估值工作小组负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。投资部、研究部、固定收益部、专户投资部负责定期对经济环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生影响证券价格的重大事件以及估值政策和程序进行评价；量化投资部负责对估值模型及方法进行筛选，选择最具适用性的估值模型及参数，并负责估值模型的选择及测算；基金运营部负责进行日常估值，并与托管行的估值结果核对一致；监察稽核部负责审核估值政策和程序的一致性，监督估值委员会工作流程中的风险控制，并负责估值调整事项的信息披露工作。

上述参与估值流程的本基金管理人、本基金托管人和本基金聘请的会计师事务所各方不存在任何重大利益冲突。基金经理不参与决定本基金估值的程序。本基金未接受任何已签约的与估值相关的任何定价服务。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.9 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

本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 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

本报告期内，本基金托管人在对宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金的管理人——宝盈基金管理有限公司在宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本报告期内，宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对宝盈基金管理有限公司编制和披露的宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金 2015 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2016)第 22197 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
--------	------

审计报告收件人	宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人	
引言段	我们审计了后附的宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“宝盈睿丰创新混合基金”)的财务报表,包括 2015 年 12 月 31 日的资产负债表、2015 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。	
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是宝盈睿丰创新混合基金的基金管理人宝盈基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括: (1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,并使其实现公允反映; (2) 设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。	
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。 我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。	
审计意见段	我们认为,上述宝盈睿丰创新混合基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了宝盈睿丰创新混合基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和基金净值变动情况。	
注册会计师的姓名	薛竞	周祎
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
会计师事务所的地址	中国·上海市	
审计报告日期	2016 年 3 月 24 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体: 宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	76,854,432.44	13,952,152.85
结算备付金		3,973,929.30	707,492.79
存出保证金		3,645,508.00	1,114,936.26
交易性金融资产	7.4.7.2	964,358,164.58	488,180,670.79
其中：股票投资		964,358,164.58	461,323,140.79
基金投资		-	-
债券投资		-	26,857,530.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		58,735.98	6,550,575.21
应收利息	7.4.7.5	19,336.24	457,326.26
应收股利		-	-
应收申购款		9,560,659.75	2,858,329.57
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,058,470,766.29	513,821,483.73
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		8,675,811.62	8,222,969.65
应付赎回款		13,565,192.08	5,422,133.17
应付管理人报酬		1,263,135.98	685,035.57
应付托管费		210,522.66	114,172.61
应付销售服务费		533,372.03	313,909.83
应付交易费用	7.4.7.7	2,273,380.38	918,002.01
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	172,895.32	87,531.02
负债合计		26,694,310.07	15,763,753.86
所有者权益：			

实收基金	7.4.7.9	590,768,588.29	491,029,919.91
未分配利润	7.4.7.10	441,007,867.93	7,027,809.96
所有者权益合计		1,031,776,456.22	498,057,729.87
负债和所有者权益总计		1,058,470,766.29	513,821,483.73

注：报告期截止日 2015 年 12 月 31 日，宝盈睿丰创新基金 A/B 类基金份额净值 1.853 元，基金份额总额 106,885,196.14 份；宝盈睿丰创新基金 C 类基金份额净值 1.723 元，基金份额总额 483,883,392.15 份；宝盈睿丰创新基金 A/B 类基金和宝盈睿丰创新基金 C 类基金的合计份额总数 590,768,588.29 份。

7.2 利润表

会计主体：宝盈睿丰创新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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 9 月 26 日(基 金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日
一、收入		-34,321,916.84	24,915,254.10
1. 利息收入		9,399,407.87	676,971.35
其中：存款利息收入	7.4.7.11	3,994,129.14	361,414.88
债券利息收入		3,078,593.50	121,708.10
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,326,685.23	193,848.37
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-123,060,736.19	26,652,891.45
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-93,252,329.96	26,537,913.63
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-32,100,754.34	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	2,292,348.11	114,977.82
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	53,706,848.73	-2,877,695.70
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	25,632,562.75	463,087.00
减：二、费用		50,774,191.18	6,278,090.73
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	27,198,448.95	2,750,733.20
2. 托管费	7.4.10.2.2	4,533,074.84	458,455.54

3. 销售服务费	7.4.10.2.3	6,635,383.19	1,292,794.67
4. 交易费用	7.4.7.19	11,819,614.14	1,622,095.72
5. 利息支出		208,670.06	18,111.60
其中：卖出回购金融资产支出		208,670.06	18,111.60
6. 其他费用	7.4.7.20	379,000.00	135,900.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-85,096,108.02	18,637,163.37
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-85,096,108.02	18,637,163.37

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：宝盈睿丰创新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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 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）	491,029,919.91	7,027,809.96	498,057,729.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-85,096,108.02	-85,096,108.02
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）	99,738,668.38	519,076,165.99	618,814,834.37
其中：1. 基金申购款	5,977,102,737.73	3,245,892,616.67	9,222,995,354.40
2. 基金赎回款	-5,877,364,069.35	-2,726,816,450.68	-8,604,180,520.03
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）	590,768,588.29	441,007,867.93	1,031,776,456.22
项目	上年度可比期间 2014 年 9 月 26 日（基金合同生效日）至 2014 年 12 月 31 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）	861,446,781.93	-	861,446,781.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	18,637,163.37	18,637,163.37
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）	-370,416,862.02	-11,609,353.41	-382,026,215.43
其中：1. 基金申购款	112,609,866.76	3,260,206.22	115,870,072.98
2. 基金赎回款	-483,026,728.78	-14,869,559.63	-497,896,288.41
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）	491,029,919.91	7,027,809.96	498,057,729.87

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>汪钦</u>	<u>胡坤</u>	<u>何瑜</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2014]第 887 号《关于核准宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》核准,由宝盈基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 861,446,781.93 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2014)第 569 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2014 年 9 月 26 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 861,446,781.93 份基金份额。本基金的基金管理人为宝盈基金管理有限公司,基金托管人为广发证券股份有限公司。

根据《宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书》并报中国证监会备案,本基金根据认购/申购费用、赎回费用、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取前端认购/申购费用、赎回时收取赎回费用的,称为 A 类基金份额;在投资人认购/申购时不收取认购/申购

费用、赎回时收取后端认购/申购费用和赎回费用的，称为 B 类基金份额；在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用、赎回时收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。本基金 A/B 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额，但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有较好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、中小企业私募债、央行票据、中期票据、短期融资券)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 0% - 95%，其中投资于创新主题上市公司证券的比例不低于非现金基金资产的 80%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；权证投资比例不得超过基金资产净值的 3%。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×65%+中债综合指数收益率(全价)×35%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本财务报表的实际编制期间为 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日。比较财务报表的实际编制期间为 2014 年 9 月 26 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日止期间。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 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、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表以衍生金融资产列示外，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卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 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。

7.4.4.5 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。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 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。

7.4.4.8 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)。

7.4.4.9 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结转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。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在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。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本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。

7.4.4.12 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。

7.4.4.13 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，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《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息，本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 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》、财税[2015]101号《关于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。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，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，暂免征收个人所得税。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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
活期存款	76,854,432.44	13,952,152.85
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	76,854,432.44	13,952,152.85

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	913,529,011.55	964,358,164.58	50,829,153.03
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	913,529,011.55	964,358,164.58	50,829,153.03
项目	上年度末		

	2014 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	464,144,766.49	461,323,140.79	-2,821,625.70
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	26,913,600.00	-56,070.00
	银行间市场	-	-
	合计	26,913,600.00	-56,070.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	491,058,366.49	488,180,670.79	-2,877,695.70

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	15,564.56	3,255.66
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	1,967.13	350.24
应收债券利息	-	453,168.49
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	1,804.55	551.87
合计	19,336.24	457,326.26

7.4.7.6 其他资产

无余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	2,273,380.38	918,002.01
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	2,273,380.38	918,002.01

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
应付赎回费	2,895.32	2,531.02
预提审计费	70,000.00	60,000.00
预提信息披露费	100,000.00	25,000.00
合计	172,895.32	87,531.02

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

宝盈睿丰创新混合 A/B		
项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	68,911,710.02	68,911,710.02
本期申购	3,089,171,902.56	3,089,171,902.56
本期赎回（以“-”号填列）	-3,051,198,416.44	-3,051,198,416.44
本期末	106,885,196.14	106,885,196.14

金额单位：人民币元

宝盈睿丰创新混合 C		
项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	422,118,209.89	422,118,209.89
本期申购	2,887,930,835.17	2,887,930,835.17
本期赎回（以“-”号填列）	-2,826,165,652.91	-2,826,165,652.91
本期末	483,883,392.15	483,883,392.15

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

宝盈睿丰创新混合 A/B			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

上年度末	2,854,983.78	-1,677,203.80	1,177,779.98
本期利润	17,956,692.25	-252,257,691.60	-234,300,999.35
本期基金份额交易产生的变动数	-54,863,989.25	379,208,955.71	324,344,966.46
其中：基金申购款	347,854,408.57	1,421,861,173.32	1,769,715,581.89
基金赎回款	-402,718,397.82	-1,042,652,217.61	-1,445,370,615.43
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-34,052,313.22	125,274,060.31	91,221,747.09

单位：人民币元

宝盈睿丰创新混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	16,068,253.42	-10,218,223.44	5,850,029.98
本期利润	-156,759,649.00	305,964,540.33	149,204,891.33
本期基金份额交易产生的变动数	-45,593,823.52	240,325,023.05	194,731,199.53
其中：基金申购款	-159,226,026.06	1,635,403,060.84	1,476,177,034.78
基金赎回款	113,632,202.54	-1,395,078,037.79	-1,281,445,835.25
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-186,285,219.10	536,071,339.94	349,786,120.84

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年 12月31日	上年度可比期间 2014年9月26日(基金合同生效日) 至2014年12月31日
活期存款利息收入	3,455,834.55	335,019.47
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	278,350.42	22,845.74
其他	259,944.17	3,549.67
合计	3,994,129.14	361,414.88

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12 月31日	上年度可比期间 2014年9月26日(基金合同 生效日)至2014年12月31日
卖出股票成交总额	3,770,436,175.87	400,036,237.15
减：卖出股票成本总额	3,863,688,505.83	373,498,323.52
买卖股票差价收入	-93,252,329.96	26,537,913.63

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 9 月 26 日(基金合同 生效日)至 2014 年 12 月 31 日
卖出债券(债转股及债券到期兑付) 成交总额	472,105,850.48	-
减: 卖出债券(债转股及债券到期 兑付)成本总额	497,144,064.39	-
减: 应收利息总额	7,062,540.43	-
买卖债券差价收入	-32,100,754.34	-

7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

无。

7.4.7.14 贵金属投资收益

无。

7.4.7.15 衍生工具收益

无。

7.4.7.16 股利收益

单位: 人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 9 月 26 日(基金合同生效 日)至 2014 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	2,292,348.11	114,977.82
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	2,292,348.11	114,977.82

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位: 人民币元

项目名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 9 月 26 日(基金合同生效 日)至 2014 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	53,706,848.73	-2,877,695.70
——股票投资	53,650,778.73	-2,821,625.70
——债券投资	56,070.00	-56,070.00
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	53,706,848.73	-2,877,695.70

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年9月26日(基金合同生效日)至2014年12月31日
基金赎回费收入	10,538,624.21	429,499.51
其他	110,417.96	-
基金转换费收入	14,983,520.58	33,587.49
合计	25,632,562.75	463,087.00

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费 25% 归入转出基金的基金资产。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年9月26日(基金合同生效日)至2014年12月31日
交易所市场交易费用	11,819,614.14	1,622,095.72
银行间市场交易费用	-	-
合计	11,819,614.14	1,622,095.72

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年9月26日(基金合同生效日)至2014年12月31日
审计费用	70,000.00	60,000.00
信息披露费	300,000.00	75,000.00
债券帐户维护费	9,000.00	-
其他	-	900.00
合计	379,000.00	135,900.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须做披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
宝盈基金管理有限公司（以下简称“宝盈基金公司”）	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
广发证券股份有限公司（以下简称“广发证券”）	基金托管人、基金代销机构
中铁信托有限责任公司	基金管理人的股东
中国对外经济贸易信托有限公司	基金管理人的股东
中铁宝盈资产管理有限公司	基金管理人的子公司

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年9月26日(基金合同生效日)至 2014年12月31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
广发证券	8,048,211,095.12	100.00%	1,222,026,885.02	100.00%

7.4.10.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31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
广发证券	7,240,459.03	100.00%	2,273,380.38	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2014年9月26日(基金合同生效日)至2014年12月31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
广发证券	1,080,213.95	100.00%	918,002.01	100.00%

注：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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年9月26日(基金合同生效日)至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	27,198,448.95	2,750,733.20
其中：支付销售机构的客户维护费	3,612,776.94	1,307,414.00

注：支付基金管理人宝盈基金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 X 1.5% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年9月26日(基金合同生效日)至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	4,533,074.84	458,455.54

注：支付基金托管人广发证券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。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2015年1月1日至2015年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	宝盈睿丰创新混合 A/B	宝盈睿丰创新混合 C	合计
广发证券	-	2,146,538.41	2,146,538.41
宝盈基金	-	3,588,478.98	3,588,478.98
合计	-	5,735,017.39	5,735,017.39
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2014年9月26日(基金合同生效日)至2014年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		

	宝盈睿丰创新混合 A/B	宝盈睿丰创新混合 C	合计
广发证券	-	1,224,373.74	1,224,373.74
宝盈基金	-	56,988.24	56,988.24
合计	-	1,281,361.98	1,281,361.98

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值 0.8% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给宝盈基金公司，再由宝盈基金公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额资产净值 × 0.8% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用自有资金投资。

7.4.10.4.2 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

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

7.4.10.5 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 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2014 年 9 月 26 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
广发证券	76,854,432.44	3,455,834.55	13,952,152.85	335,019.47

注：本基金的银行存款由基金托管人广发证券保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2015 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券**7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

无。

7.4.12.2 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
002053	云南盐化	2015 年 11 月 19 日	重大资产重组	25.84	2016 年 3 月 14 日	23.26	899,925	24,078,586.64	23,254,062.00	-
300326	凯利泰	2015 年 9 月 24 日	重大资产重组	27.92	2016 年 1 月 22 日	23.98	830,200	31,470,344.34	23,179,184.00	-
300162	雷曼股份	2015 年 11 月 2 日	重大资产重组	27.06	2016 年 2 月 29 日	21.47	300,000	6,896,343.00	8,118,000.00	-

注：本基金截至 2015 年 12 月 31 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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的余额。

7.4.13 金融工具风险及管理**7.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金，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。本基金的投资范围为具有较好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是按照风险收益配比原则对投资组合进行严格的风险管理，在风险预算范围内追求收益最大化。

本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程

中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估，督察长负责组织指导监察稽核工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行广发证券，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2015 年 12 月 31 日，本基金未持有信用类债券(2014 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本

基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2015 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、及存出保证金等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	76,854,432.44	-	-	-	76,854,432.44
结算备付金	3,973,929.30	-	-	-	3,973,929.30
存出保证金	3,645,508.00	-	-	-	3,645,508.00
交易性金融资产	-	-	-	964,358,164.58	964,358,164.58

应收证券清算款	-	-	-	58,735.98	58,735.98
应收利息	-	-	-	19,336.24	19,336.24
应收申购款	107,443.35	-	-	9,453,216.40	9,560,659.75
资产总计	84,581,313.09	-	-	973,889,453.20	1,058,470,766.29
负债					
应付证券清算款	-	-	-	8,675,811.62	8,675,811.62
应付赎回款	-	-	-	13,565,192.08	13,565,192.08
应付管理人报酬	-	-	-	1,263,135.98	1,263,135.98
应付托管费	-	-	-	210,522.66	210,522.66
应付销售服务费	-	-	-	533,372.03	533,372.03
应付交易费用	-	-	-	2,273,380.38	2,273,380.38
其他负债	-	-	-	172,895.32	172,895.32
负债总计	-	-	-	26,694,310.07	26,694,310.07
利率敏感度缺口	84,581,313.09	-	-	947,195,143.13	1,031,776,456.22
上年度末 2014 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	13,952,152.85	-	-	-	13,952,152.85
结算备付金	707,492.79	-	-	-	707,492.79
存出保证金	1,114,936.26	-	-	-	1,114,936.26
交易性金融资产	26,857,530.00	-	-	461,323,140.79	488,180,670.79
应收证券清算款	-	-	-	6,550,575.21	6,550,575.21
应收利息	-	-	-	457,326.26	457,326.26
应收申购款	61,700.00	-	-	2,796,629.57	2,858,329.57
资产总计	42,693,811.90	-	-	471,127,671.83	513,821,483.73
负债					
应付证券清算款	-	-	-	8,222,969.65	8,222,969.65
应付赎回款	-	-	-	5,422,133.17	5,422,133.17
应付管理人报酬	-	-	-	685,035.57	685,035.57
应付托管费	-	-	-	114,172.61	114,172.61
应付销售服务费	-	-	-	313,909.83	313,909.83
应付交易费用	-	-	-	918,002.01	918,002.01
其他负债	-	-	-	87,531.02	87,531.02
负债总计	-	-	-	15,763,753.86	15,763,753.86
利率敏感度缺口	42,693,811.90	-	-	455,363,917.97	498,057,729.87

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2015 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资（2014 年 12 月 31 日：5.39%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2014 年 12 月 31 日：同）。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。

本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 0%-95%，其中投资于创新主题上市公司证券的比例不低于非现金基金资产的 80%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；权证投资比例不得超过基金资产净值的 3%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日		上年度末 2014 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	964,358,164.58	93.47	461,323,140.79	92.62
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	964,358,164.58	93.47	461,323,140.79	92.62

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2015 年 12 月 31 日）	上年度末（2014 年 12 月 31 日）
	1. 沪深 300 指数上升 5%	35,761,985.00	-
2. 沪深 300 指数下降 5%	-35,761,985.00	-	

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2015 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 890,573,418.58 元，属于第二层次的余额为 73,784,746.00 元，无属于第三层次的余额(2014 年 12 月 31 日：第一层次 463,086,020.95 元，第二层次 25,094,649.84，无属于第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。对于在证券交易所上市或挂牌转让的不含权固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，本基金于 2015 年 3 月 27 日起改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值(附注 7.4.5.2)，并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2015 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2014 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	964,358,164.58	91.11
	其中：股票	964,358,164.58	91.11
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	80,828,361.74	7.64
7	其他各项资产	13,284,239.97	1.26
8	合计	1,058,470,766.29	100.00

8.2 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	89,184,399.10	8.64
B	采矿业	19,175,000.00	1.86
C	制造业	611,875,798.16	59.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-

E	建筑业	19,811,052.00	1.92
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	142,189,752.40	13.78
J	金融业	-	-
K	房地产业	4,220,700.00	0.41
L	租赁和商务服务业	37,062,101.00	3.59
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	25,638,706.80	2.48
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	15,200,655.12	1.47
S	综合	-	-
	合计	964,358,164.58	93.47

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	300252	金信诺	1,519,400	61,383,760.00	5.95
2	002773	康弘药业	743,950	61,152,690.00	5.93
3	002522	浙江众成	3,299,915	61,147,424.95	5.93
4	300094	国联水产	1,694,068	42,690,513.60	4.14
5	002215	诺普信	1,950,392	37,408,518.56	3.63
6	002368	太极股份	487,372	32,702,661.20	3.17
7	300170	汉得信息	1,500,000	29,775,000.00	2.89
8	002549	凯美特气	2,034,818	25,638,706.80	2.48
9	600975	新五丰	1,510,470	25,391,000.70	2.46
10	300467	迅游科技	259,970	23,600,076.60	2.29
11	002053	云南盐化	899,925	23,254,062.00	2.25
12	300326	凯利泰	830,200	23,179,184.00	2.25
13	002373	千方科技	502,520	22,990,290.00	2.23
14	300463	迈克生物	187,600	22,022,364.00	2.13

15	002098	浔兴股份	1,395,421	21,573,208.66	2.09
16	300367	东方网力	300,000	20,910,000.00	2.03
17	000971	高升控股	550,000	19,233,500.00	1.86
18	600711	盛屯矿业	2,500,000	19,175,000.00	1.86
19	002746	仙坛股份	501,473	18,855,384.80	1.83
20	002518	科士达	513,283	18,118,889.90	1.76
21	300047	天源迪科	609,600	17,739,360.00	1.72
22	603456	九洲药业	248,641	17,680,861.51	1.71
23	300078	思创医惠	333,137	16,257,085.60	1.58
24	000681	视觉中国	399,912	15,200,655.12	1.47
25	600884	杉杉股份	371,090	14,561,571.60	1.41
26	600057	象屿股份	1,100,000	14,344,000.00	1.39
27	002047	宝鹰股份	1,149,300	12,918,132.00	1.25
28	600358	国旅联合	751,653	12,778,101.00	1.24
29	300390	天华超净	272,800	12,106,864.00	1.17
30	600332	白云山	399,524	12,093,591.48	1.17
31	002513	蓝丰生化	600,000	11,694,000.00	1.13
32	002396	星网锐捷	465,500	11,241,825.00	1.09
33	000070	特发信息	349,370	11,211,283.30	1.09
34	300373	扬杰科技	499,968	10,724,313.60	1.04
35	002341	新纶科技	599,971	9,989,517.15	0.97
36	300071	华谊嘉信	700,000	9,940,000.00	0.96
37	002271	东方雨虹	500,000	9,765,000.00	0.95
38	000547	航天发展	500,000	9,525,000.00	0.92
39	300299	富春通信	200,000	9,414,000.00	0.91
40	600562	国睿科技	150,000	9,328,500.00	0.90
41	002096	南岭民爆	355,439	9,244,968.39	0.90
42	300005	探路者	390,000	8,931,000.00	0.87
43	002445	中南重工	300,000	8,415,000.00	0.82
44	300162	雷曼股份	300,000	8,118,000.00	0.79
45	600276	恒瑞医药	159,945	7,856,498.40	0.76
46	002157	正邦科技	390,000	7,839,000.00	0.76
47	300322	硕贝德	387,294	7,552,233.00	0.73
48	002659	中泰桥梁	295,200	6,892,920.00	0.67
49	603308	应流股份	184,300	5,772,276.00	0.56
50	000892	星美联合	273,700	5,657,379.00	0.55
51	000910	大亚科技	299,987	4,961,784.98	0.48
52	002222	福晶科技	200,000	4,742,000.00	0.46
53	600708	海博股份	330,000	4,220,700.00	0.41

54	002023	海特高新	227,265	4,168,040.10	0.40
55	300327	中颖电子	100,000	3,970,000.00	0.38
56	600336	澳柯玛	287,209	2,360,857.98	0.23
57	002234	民和股份	125,000	2,247,500.00	0.22
58	600855	航天长峰	40,000	1,587,200.00	0.15
59	603703	盛洋科技	10,300	793,924.00	0.08
60	300229	拓尔思	9,904	310,985.60	0.03

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002522	浙江众成	260,178,046.23	52.24
2	300397	天和防务	139,791,440.07	28.07
3	300170	汉得信息	117,228,836.94	23.54
4	000758	中色股份	82,284,709.67	16.52
5	603703	盛洋科技	81,429,009.19	16.35
6	002773	康弘药业	77,830,829.86	15.63
7	300463	迈克生物	69,863,944.87	14.03
8	300047	天源迪科	63,379,050.17	12.73
9	300059	东方财富	63,365,127.14	12.72
10	000590	*ST 古汉	57,095,542.58	11.46
11	300451	创业软件	53,560,144.66	10.75
12	300252	金信诺	52,604,287.73	10.56
13	600745	中茵股份	52,009,246.13	10.44
14	603308	应流股份	50,501,572.73	10.14
15	000400	许继电气	48,705,087.24	9.78
16	300348	长亮科技	45,873,527.17	9.21
17	000558	莱茵体育	45,252,156.32	9.09
18	600571	信雅达	45,025,897.74	9.04
19	603456	九洲药业	44,602,954.00	8.96
20	300380	安硕信息	43,075,529.16	8.65
21	601058	赛轮金宇	41,819,478.97	8.40
22	300005	探路者	41,697,135.72	8.37
23	002746	仙坛股份	40,434,456.25	8.12
24	600038	中直股份	39,079,719.40	7.85

25	300326	凯利泰	39,051,733.00	7.84
26	002131	利欧股份	38,547,513.60	7.74
27	600234	山水文化	37,436,066.14	7.52
28	603883	老百姓	36,886,094.15	7.41
29	000732	泰禾集团	36,717,784.26	7.37
30	600061	国投安信	36,310,884.00	7.29
31	300373	扬杰科技	34,051,691.05	6.84
32	002638	勤上光电	33,651,582.93	6.76
33	002023	海特高新	33,495,671.71	6.73
34	300229	拓尔思	33,339,848.29	6.69
35	600975	新五丰	33,304,980.80	6.69
36	002098	浔兴股份	33,152,405.90	6.66
37	300318	博晖创新	32,861,909.00	6.60
38	600109	国金证券	32,173,508.98	6.46
39	002188	新嘉联	32,005,975.00	6.43
40	000892	星美联合	31,032,689.22	6.23
41	002157	正邦科技	30,823,605.00	6.19
42	002373	千方科技	30,333,982.53	6.09
43	300369	绿盟科技	30,299,052.10	6.08
44	000796	凯撒旅游	30,087,663.66	6.04
45	300243	瑞丰高材	29,932,956.90	6.01
46	300006	莱美药业	29,566,846.14	5.94
47	000815	*ST 美利	28,510,921.00	5.72
48	000503	海虹控股	28,166,796.62	5.66
49	000791	甘肃电投	28,014,505.93	5.62
50	000547	航天发展	27,920,718.97	5.61
51	600358	国旅联合	27,788,671.12	5.58
52	300467	迅游科技	27,541,760.50	5.53
53	002096	南岭民爆	27,294,938.15	5.48
54	002192	融捷股份	26,639,829.50	5.35
55	002123	荣信股份	26,534,183.00	5.33
56	300016	北陆药业	26,320,297.61	5.28
57	002175	东方网络	25,903,222.44	5.20
58	002053	云南盐化	24,078,586.64	4.83
59	000060	中金岭南	24,020,446.36	4.82
60	300367	东方网力	23,830,787.03	4.78

61	300078	思创医惠	23,658,835.92	4.75
62	300162	雷曼股份	23,483,618.30	4.72
63	002736	国信证券	22,894,865.39	4.60
64	600055	华润万东	22,484,934.00	4.51
65	000807	云铝股份	22,349,091.88	4.49
66	002171	楚江新材	21,516,176.35	4.32
67	002104	恒宝股份	20,933,279.24	4.20
68	600884	杉杉股份	20,789,836.67	4.17
69	600078	澄星股份	20,724,059.82	4.16
70	002606	大连电瓷	20,721,388.33	4.16
71	002251	步步高	20,714,855.86	4.16
72	600572	康恩贝	20,621,861.90	4.14
73	300071	华谊嘉信	20,616,281.70	4.14
74	002518	科士达	20,186,634.84	4.05
75	300329	海伦钢琴	20,104,740.52	4.04
76	000068	*ST 华赛	19,996,915.27	4.01
77	600711	盛屯矿业	19,811,696.00	3.98
78	600057	象屿股份	19,307,842.64	3.88
79	300355	蒙草抗旱	18,055,013.00	3.63
80	601336	新华保险	17,911,678.68	3.60
81	600332	白云山	17,551,347.71	3.52
82	600728	佳都科技	17,044,486.92	3.42
83	600287	江苏舜天	16,721,484.24	3.36
84	002215	诺普信	16,637,312.30	3.34
85	300094	国联水产	16,632,844.91	3.34
86	600505	西昌电力	16,562,598.88	3.33
87	000921	海信科龙	16,371,709.27	3.29
88	002113	天润控股	16,287,534.90	3.27
89	600096	云天化	16,265,588.70	3.27
90	000971	高升控股	16,234,332.10	3.26
91	601985	中国核电	15,983,517.78	3.21
92	300486	东杰智能	15,768,931.48	3.17
93	002064	华峰氨纶	15,327,703.11	3.08
94	000938	紫光股份	15,290,288.51	3.07
95	603898	好莱客	15,143,059.65	3.04
96	300033	同花顺	14,578,826.80	2.93

97	600837	海通证券	14,526,624.00	2.92
98	601628	中国人寿	14,518,791.02	2.92
99	002576	通达动力	14,502,271.00	2.91
100	000681	视觉中国	14,417,119.11	2.89
101	601166	兴业银行	14,410,285.10	2.89
102	600201	金宇集团	14,206,910.83	2.85
103	600715	松辽汽车	14,203,051.00	2.85
104	002402	和而泰	14,055,411.60	2.82
105	002382	蓝帆医疗	13,998,481.70	2.81
106	300089	文化长城	13,956,993.84	2.80
107	000070	特发信息	13,524,208.00	2.72
108	300390	天华超净	13,330,350.80	2.68
109	002047	宝鹰股份	12,881,523.00	2.59
110	002715	登云股份	12,649,402.00	2.54
111	000042	中洲控股	12,467,979.17	2.50
112	002549	凯美特气	12,312,182.40	2.47
113	300358	楚天科技	12,074,431.00	2.42
114	300168	万达信息	11,660,133.00	2.34
115	300018	中元华电	11,462,067.00	2.30
116	600767	运盛实业	11,418,386.52	2.29
117	300366	创意信息	11,359,559.05	2.28
118	000036	华联控股	11,280,000.00	2.26
119	002513	蓝丰生化	11,155,320.91	2.24
120	600171	上海贝岭	11,098,166.00	2.23
121	000977	浪潮信息	11,087,224.25	2.23
122	002396	星网锐捷	11,067,100.83	2.22
123	601318	中国平安	11,052,385.00	2.22
124	600015	华夏银行	11,037,499.79	2.22
125	000532	力合股份	10,937,137.82	2.20
126	002612	朗姿股份	10,844,756.00	2.18
127	002675	东诚药业	10,717,231.44	2.15
128	002100	天康生物	10,696,608.51	2.15
129	300299	富春通信	10,649,799.00	2.14
130	601233	桐昆股份	10,594,126.94	2.13
131	601021	春秋航空	10,582,408.28	2.12
132	300077	国民技术	10,550,539.53	2.12

133	600331	宏达股份	10,305,313.78	2.07
134	600999	招商证券	10,204,978.53	2.05
135	600028	中国石化	10,120,000.00	2.03

注：表中“本期累计买入金额”指买入成交金额，即成交单价乘以成交数量，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002522	浙江众成	171,307,713.89	34.40
2	300059	东方财富	93,256,884.43	18.72
3	000590	*ST 古汉	74,631,585.81	14.98
4	002023	海特高新	67,353,684.70	13.52
5	601985	中国核电	65,772,882.90	13.21
6	600745	中茵股份	59,361,198.61	11.92
7	300170	汉得信息	58,652,679.11	11.78
8	000758	中色股份	56,309,415.43	11.31
9	300397	天和防务	56,068,552.05	11.26
10	000400	许继电气	55,137,645.15	11.07
11	601058	赛轮金宇	51,566,292.07	10.35
12	300463	迈克生物	48,979,219.10	9.83
13	603703	盛洋科技	47,848,300.64	9.61
14	000558	莱茵体育	43,317,063.43	8.70
15	600038	中直股份	42,944,851.34	8.62
16	600061	国投安信	40,552,775.79	8.14
17	603308	应流股份	39,615,873.64	7.95
18	300229	拓尔思	38,767,539.33	7.78
19	603883	老百姓	38,722,104.00	7.77
20	002638	勤上光电	37,178,241.81	7.46
21	002188	新嘉联	36,799,749.58	7.39
22	300451	创业软件	35,692,497.81	7.17
23	300348	长亮科技	35,669,405.99	7.16
24	601208	东材科技	35,643,418.04	7.16
25	002131	利欧股份	35,329,592.71	7.09
26	300005	探路者	35,226,417.97	7.07
27	000815	*ST 美利	34,343,228.35	6.90
28	000988	华工科技	33,998,839.17	6.83

29	000791	甘肃电投	32,789,328.04	6.58
30	600109	国金证券	31,643,079.74	6.35
31	601166	兴业银行	31,566,664.80	6.34
32	000732	泰禾集团	30,953,354.43	6.21
33	600287	江苏舜天	30,667,998.61	6.16
34	002041	登海种业	30,280,766.68	6.08
35	300047	天源迪科	30,059,043.30	6.04
36	000892	星美联合	29,816,792.23	5.99
37	600234	山水文化	28,217,647.00	5.67
38	002192	融捷股份	26,715,526.88	5.36
39	300318	博晖创新	26,236,073.00	5.27
40	002096	南岭民爆	26,060,579.00	5.23
41	002157	正邦科技	25,180,899.40	5.06
42	002746	仙坛股份	24,764,200.94	4.97
43	300298	三诺生物	24,045,193.41	4.83
44	000060	中金岭南	23,938,916.52	4.81
45	601318	中国平安	23,700,686.14	4.76
46	000503	海虹控股	23,684,873.10	4.76
47	000068	*ST 华赛	23,305,131.24	4.68
48	600571	信雅达	22,279,068.34	4.47
49	002736	国信证券	22,213,722.11	4.46
50	600572	康恩贝	22,202,749.77	4.46
51	600967	北方创业	21,949,284.64	4.41
52	300049	福瑞股份	21,906,494.61	4.40
53	300006	莱美药业	21,237,008.46	4.26
54	002175	东方网络	21,143,634.07	4.25
55	300033	同花顺	21,011,059.90	4.22
56	002104	恒宝股份	20,972,842.40	4.21
57	000547	航天发展	20,968,248.70	4.21
58	000796	凯撒旅游	20,733,891.70	4.16
59	002123	荣信股份	20,586,927.00	4.13
60	002606	大连电瓷	20,445,568.10	4.11
61	002215	诺普信	20,155,401.87	4.05
62	002100	天康生物	19,991,040.00	4.01
63	600728	佳都科技	19,941,654.00	4.00
64	300016	北陆药业	19,610,493.40	3.94
65	300373	扬杰科技	19,511,655.00	3.92
66	002773	康弘药业	19,292,938.50	3.87

67	300162	雷曼股份	19,213,696.50	3.86
68	002286	保龄宝	19,176,719.40	3.85
69	603456	九洲药业	18,731,385.41	3.76
70	300380	安硕信息	18,448,346.00	3.70
71	002251	步步高	18,312,838.32	3.68
72	603128	华贸物流	18,233,987.08	3.66
73	601336	新华保险	18,077,028.52	3.63
74	603898	好莱客	17,364,623.50	3.49
75	300369	绿盟科技	17,090,501.53	3.43
76	002382	蓝帆医疗	17,028,175.32	3.42
77	600096	云天化	16,991,502.81	3.41
78	300243	瑞丰高材	16,968,509.68	3.41
79	600078	澄星股份	16,811,506.30	3.38
80	002576	通达动力	16,604,691.00	3.33
81	002064	华峰氨纶	16,522,712.17	3.32
82	000966	长源电力	16,463,490.78	3.31
83	300486	东杰智能	16,159,179.58	3.24
84	000801	四川九洲	15,991,261.96	3.21
85	000921	海信科龙	15,937,153.92	3.20
86	002108	沧州明珠	15,775,994.40	3.17
87	000807	云铝股份	15,550,000.79	3.12
88	600358	国旅联合	15,523,591.42	3.12
89	000938	紫光股份	15,092,961.50	3.03
90	600201	金宇集团	14,935,628.91	3.00
91	600837	海通证券	14,919,364.00	3.00
92	002171	楚江新材	14,712,012.15	2.95
93	300089	文化长城	14,704,668.93	2.95
94	600975	新五丰	14,495,313.68	2.91
95	601628	中国人寿	14,256,836.11	2.86
96	300018	中元华电	14,231,995.99	2.86
97	002402	和而泰	13,982,328.42	2.81
98	600055	华润万东	13,965,857.00	2.80
99	002261	拓维信息	13,673,510.08	2.75
100	300078	思创医惠	13,673,270.60	2.75
101	002475	立讯精密	13,554,868.00	2.72
102	002373	千方科技	13,507,086.52	2.71
103	300329	海伦钢琴	13,502,323.00	2.71
104	000042	中洲控股	13,429,644.60	2.70

105	000036	华联控股	13,358,007.00	2.68
106	002715	登云股份	13,168,069.83	2.64
107	600715	松辽汽车	12,938,530.00	2.60
108	300364	中文在线	12,867,629.76	2.58
109	000977	浪潮信息	12,822,150.27	2.57
110	002577	雷柏科技	12,295,261.00	2.47
111	300366	创意信息	12,287,929.00	2.47
112	600171	上海贝岭	12,151,615.72	2.44
113	002612	朗姿股份	12,136,693.00	2.44
114	300071	华谊嘉信	12,051,139.80	2.42
115	300355	蒙草抗旱	12,016,844.04	2.41
116	600015	华夏银行	11,960,049.12	2.40
117	600999	招商证券	11,800,431.80	2.37
118	601233	桐昆股份	11,775,748.18	2.36
119	600420	现代制药	11,602,488.29	2.33
120	300077	国民技术	11,549,609.40	2.32
121	600331	宏达股份	11,511,286.90	2.31
122	300168	万达信息	11,248,783.00	2.26
123	600780	通宝能源	11,156,813.60	2.24
124	600421	仰帆控股	10,767,550.92	2.16
125	300252	金信诺	10,598,202.00	2.13

注：表中“本期累计卖出金额”指卖出成交金额，即成交单价乘以成交数量，不考虑相关交易费用。

8.4.3 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

买入股票成本（成交）总额	4,313,664,237.37
卖出股票收入（成交）总额	3,770,436,175.87

注：买入股票成本（成交）总额与卖出股票收入（成交）总额均按买卖成交总额，即成交单价乘以成交数量计算，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

本基金本报告期末未持有债券投资。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金尚未在基金合同中明确股指期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与股指期货交易。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与国债期货交易。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 报告期内本基金投资的前十名证券发行主体中没有被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内除国联水产（代码：300094）外未受到公开谴责、处罚。

2015 年 12 月 21 日，深交所发布《关于对湛江国联水产开发股份有限公司及相关当事人给予通报批评的决定》。湛江国联水产开发股份有限公司（以下简称“国联水产”）及相关当事人存在以下违规行为：国联水产披露的 2014 年度业绩快报的财务数据与 2014 年年报披露的财务数据相比，净利润相差较大，且业绩快报修正公告的披露时间严重滞后。国联水产董事长李忠、董事兼总经理陈汉、董事兼副总经理、时任财务总监吴丽青未能恪尽职守、履行诚信勤勉义务，上述

行为均违反了《创业板股票上市规则（2014 年修订）》相关规定，相关当事人对上市公司的违规行为负有重要责任。鉴于上述违规事实和情节，深交所对上市公司及相关当事人做出通报批评的处分，并记入上市公司诚信档案，向社会公布。

此次事件短期内对上市公司的上一年度经营业绩产生了影响，但对当季不产生影响，并且从长期看，不影响公司的后续发展和战略规划。

我们关注到此事是公司管理细节上的问题，确实需要改进，但并不影响我们继续看好公司的长期投资价值，因此在通报批评决定下达后未做减持。

8.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,645,508.00
2	应收证券清算款	58,735.98
3	应收股利	-
4	应收利息	19,336.24
5	应收申购款	9,560,659.75
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,284,239.97

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末前十名股票中不存在流通受限的股票。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项与合计项之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人	户均持有的	持有人结构
------	-----	-------	-------

	户数 (户)	基金份额	机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
宝盈睿丰创新混合 A/B	6,132	17,430.72	924,784.47	0.87%	105,960,411.67	99.13%
宝盈睿丰创新混合 C	11,764	41,132.56	202,077,976.19	41.76%	281,805,415.96	58.24%
合计	17,896	33,011.21	203,002,760.66	34.36%	387,765,827.63	65.64%

注：1、本基金采用分级模式核算，机构/个人投资者持有基金份额占总份额比例的计算中分母采用各自级别的基金份额来计算。

2、户均持有的基金份额合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	宝盈睿丰创新混合 A/B	37,431.13	0.0350%
	宝盈睿丰创新混合 C	758.14	0.0002%
	合计	38,189.27	0.0065%

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	宝盈睿丰创新混合 A/B	0
	宝盈睿丰创新混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	宝盈睿丰创新混合 A/B	0
	宝盈睿丰创新混合 C	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	宝盈睿丰创新混	宝盈睿丰创新混
----	---------	---------

	合 A/B	合 C
基金合同生效日（2014 年 9 月 26 日）基金份额总额	85,899,566.53	775,547,215.40
本报告期期初基金份额总额	68,911,710.02	422,118,209.89
本报告期基金总申购份额	3,089,171,902.56	2,887,930,835.17
减：本报告期基金总赎回份额	3,051,198,416.44	2,826,165,652.91
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	106,885,196.14	483,883,392.15

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、报告期内基金管理人重大人事变动情况如下：

2015 年 3 月 21 日，本基金管理人发布关于董事长（法定代表人）变更的公告，李文众先生任宝盈基金管理有限公司董事长（法定代表人），李文众先生基金行业任职资格核准文号为：证监许可（2015）409 号。李建生女士退休，不再担任董事长（法定代表人）职务。截止至报告期末，基金管理人已完成办理法定代表人工商变更登记等相关手续。

2、报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金管理人的基金投资策略遵循本基金《基金合同》中规定的投资策略，未发生显著改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未发生改聘会计师事务所情况。本报告期应支付普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计费 70,000 元，目前事务所已连续 2 年为本基金提供审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

在本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
广发证券	2	8,048,211,095.12	100.00%	7,240,459.03	100.00%	-

注：1、基金管理人选择使用基金专用交易席位的证券经营机构的选择标准为：

- (1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币。
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。
- (3) 经营行为规范，最近两年未发生重大违规行为而受到中国证监会处罚。
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务。
- (6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务。

基金管理人根据以上标准进行评估后确定证券经营机构的选择，与被选择的券商签订证券交易席位租用协议。

2、席位变更情况

(1) 租用交易单元情况

本基金本报告期内无租用交易单元情况。

(2) 退租交易单元情况

本基金本报告期内无退租交易单元情况。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
广发证券	909,641,117.80	100.00%	33,872,200,000.00	100.00%	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加上海天天基金销售有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 1 月 8 日
2	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2015 年 1 月 23 日
3	宝盈基金管理有限公司关于从业人员在子公司兼职情况的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 1 月 28 日
4	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2015 年 1 月 28 日
5	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加中信建投证券股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 2 月 12 日
6	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 2 月 12 日
7	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加长江证券股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 2 月 12 日
8	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 3 月 3 日
9	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加光大证券股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 3 月 6 日
10	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 3 月 10 日
11	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 3 月 17 日
12	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 3 月 19 日
13	宝盈基金管理有限公司关于增加中国国际金融有限公司为旗下基金代销机构并参加相关费率优惠活动的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 3 月 20 日
14	宝盈基金管理有限公司关于增加上海好买基金销售有限公司为旗下基金代销机构及参与申购费率优惠活动的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 3 月 20 日

15	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 3 月 20 日
16	宝盈基金管理有限公司关于增加深圳众禄基金销售有限公司为旗下基金代销机构及参与申购费率优惠活动的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 3 月 20 日
17	宝盈基金管理有限公司关于增加万银财富（北京）基金销售有限公司为旗下基金代销机构及参与申购费率优惠活动的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 3 月 20 日
18	宝盈基金管理有限公司关于董事长（法定代表人）变更的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 3 月 21 日
19	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 3 月 24 日
20	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 3 月 25 日
21	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 3 月 28 日
22	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2015 年 4 月 2 日
23	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 4 月 3 日
24	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 4 月 4 日
25	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2015 年 4 月 8 日
26	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 4 月 9 日
27	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 4 月 14 日
28	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 4 月 16 日
29	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 4 月 18 日

30	宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金投资基金托管人承销证券的关联交易公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2015 年 4 月 21 日
31	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 4 月 22 日
32	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 4 月 23 日
33	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加深圳众禄基金销售有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 4 月 24 日
34	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 4 月 25 日
35	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 5 月 8 日
36	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 5 月 12 日
37	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 5 月 13 日
38	宝盈基金管理有限公司关于增加平安银行股份有限公司为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 5 月 15 日
39	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 5 月 19 日
40	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 5 月 20 日
41	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 5 月 21 日
42	宝盈基金管理有限公司关于从业人员在子公司兼职情况的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2015 年 5 月 22 日
43	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 5 月 22 日
44	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 5 月 26 日

45	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 5 月 27 日
46	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 6 月 3 日
47	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 6 月 11 日
48	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 6 月 12 日
49	宝盈基金管理有限公司关于从业人员在子公司兼职情况的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2015 年 6 月 17 日
50	宝盈基金管理有限公司关于子公司中铁宝盈资产管理有限公司办公地址变更的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2015 年 6 月 17 日
51	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 6 月 19 日
52	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 6 月 20 日
53	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 6 月 24 日
54	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 6 月 26 日
55	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 6 月 27 日
56	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 6 月 30 日
57	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行股份有限公司网上银行、手机银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 6 月 30 日
58	宝盈基金管理有限公司关于新增上海基煜基金销售有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 7 月 1 日
59	关于增加中国银行股份有限公司代销宝盈基金管理有限公司旗下部分基金的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2015 年 7 月 1 日

60	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2015年7月2日
61	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2015年7月3日
62	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加第一创业证券股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2015年7月3日
63	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015年7月4日
64	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015年7月7日
65	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015年7月8日
66	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015年7月9日
67	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2015年7月10日
68	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2015年7月11日
69	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015年7月14日
70	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015年7月18日
71	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015年7月22日
72	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015年7月28日
73	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加信达证券股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015年8月4日
74	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015年8月4日

	的提示性公告		
75	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加长城证券股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 8 月 4 日
76	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加中信建投证券股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 8 月 4 日
77	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加平安证券有限责任公司费率优惠活动的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 8 月 12 日
78	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 8 月 12 日
79	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 8 月 15 日
80	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 8 月 18 日
81	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 8 月 19 日
82	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 8 月 25 日
83	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2015 年 8 月 26 日
84	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 8 月 27 日
85	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 8 月 28 日
86	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2015 年 9 月 2 日
87	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 9 月 7 日
88	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 9 月 9 日
89	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持	中国证券报 证券时报 上	2015 年 9 月 10 日

	有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	海证券报 证券日报	
90	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加上海好买基金销售有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015年9月14日
91	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加国泰君安证券股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015年9月25日
92	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加招商证券股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015年9月25日
93	宝盈基金管理有限公司关于增加上海汇付金融服务有限公司为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015年9月30日
94	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015年10月13日
95	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015年10月21日
96	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015年10月22日
97	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015年10月24日
98	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015年10月28日
99	宝盈基金管理有限公司关于调整周净值短信服务形式的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015年11月3日
100	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015年11月7日
101	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015年11月12日
102	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015年11月13日
103	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015年11月21日
104	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持	中国证券报 证券时报 上	2015年11月28日

	有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	海证券报 证券日报	
105	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 12 月 18 日
106	宝盈基金管理有限公司关于旗下部分基金在指数熔断机制下调整开放时间的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 12 月 31 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

中国证监会批准宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金设立的文件。

《宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。

《宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金基金托管协议》。

宝盈基金管理有限公司批准成立批件、营业执照和公司章程。

本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告。

13.2 存放地点

基金管理人办公地址：广东省深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 10 层

基金托管人办公地址：广州市天河区天河北路 183-187 号大都会广场 5 楼、7 楼、18 楼、19 楼、36 楼、38 楼、39 楼、41 楼、42 楼、43 楼和 44 楼

13.3 查阅方式

上述备查文件文本存放在基金管理人和基金托管人的办公场所，在办公时间内基金持有人可免费查阅。

宝盈基金管理有限公司
2016 年 3 月 26 日