

# 宝盈睿丰创新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：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：2017 年 3 月 27 日

## § 1 重要提示

### 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 2017 年 3 月 24 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为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 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

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	355,422,723.95 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	85,717,424.90 份	269,705,299.05 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	崔瑞娟
	联系电话	0755-83276688	020-87555888
	电子邮箱	zhangj@byfunds.com	cuirj@gf.com.cn
客户服务电话		400-8888-300	95575
传真		0755-83515599	020-87555129

## 2.4 信息披露方式

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

## § 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	2016 年		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	宝盈睿丰创新 混合 A/B

本期已实现收益	-25,733,965.06	-93,387,723.64	17,956,692.25	-156,759,649.00	3,208,148.80	18,306,710.27
本期利润	-33,805,748.81	-179,857,453.24	-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	-0.3203	-0.5200	-0.3751	0.2657	0.0257	0.0281
本期基金份额净值 增长率	-21.32%	-21.76%	82.20%	69.92%	1.70%	1.40%
3.1.2 期末数据 和指标	2016 年末		2015 年末		2014 年末	
期末可供分配基金 份额利润	-0.5612	-0.6184	-0.3186	-0.3850	0.0171	0.0139
期末基金资产净值	125,006,095.37	363,490,045.66	198,106,943.23	833,669,512.99	70,089,490.00	427,968,239.87
期末基金份额净值	1.458	1.348	1.853	1.723	1.017	1.014

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、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

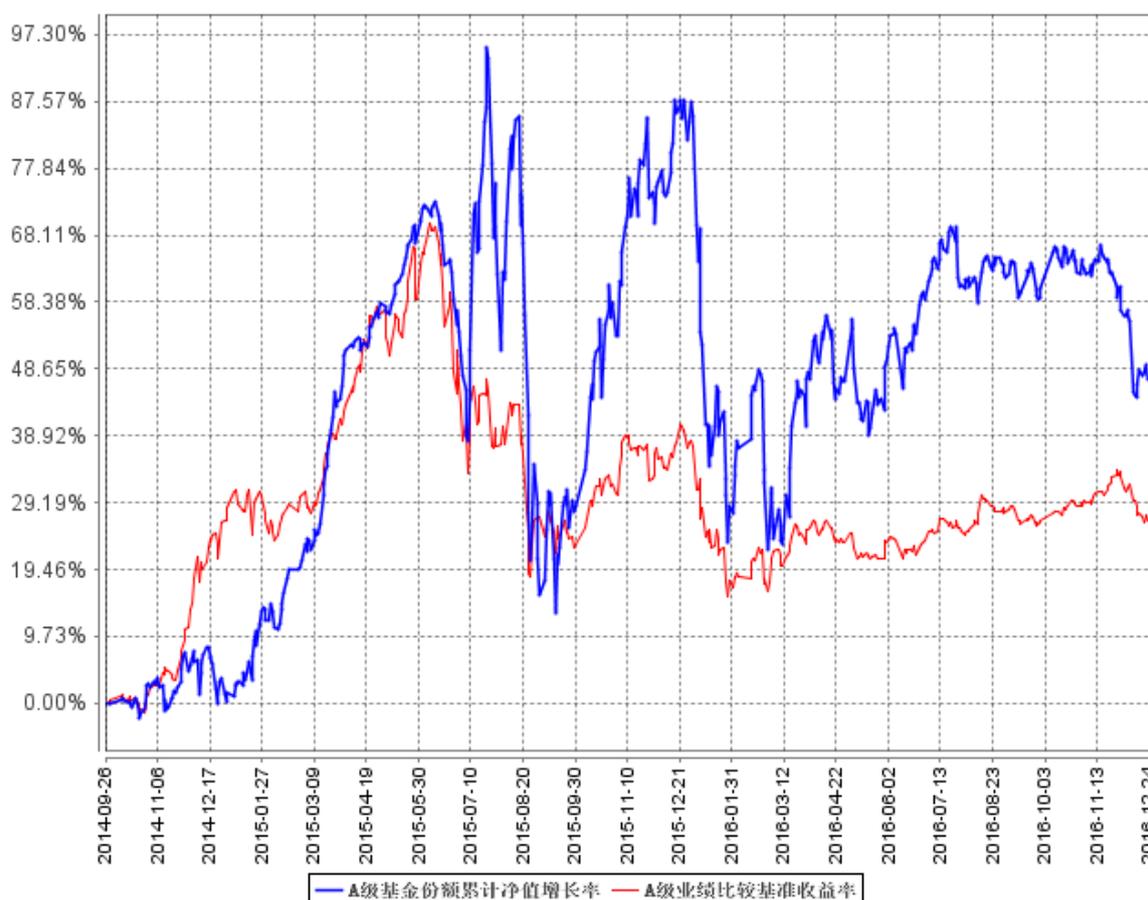
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-9.10%	1.22%	0.34%	0.48%	-9.44%	0.74%
过去六个月	-8.59%	1.13%	2.75%	0.50%	-11.34%	0.63%
过去一年	-21.32%	2.20%	-7.51%	0.91%	-13.81%	1.29%
自基金合同生效起至今	45.80%	2.44%	26.99%	1.29%	18.81%	1.15%

宝盈睿丰创新混合 C

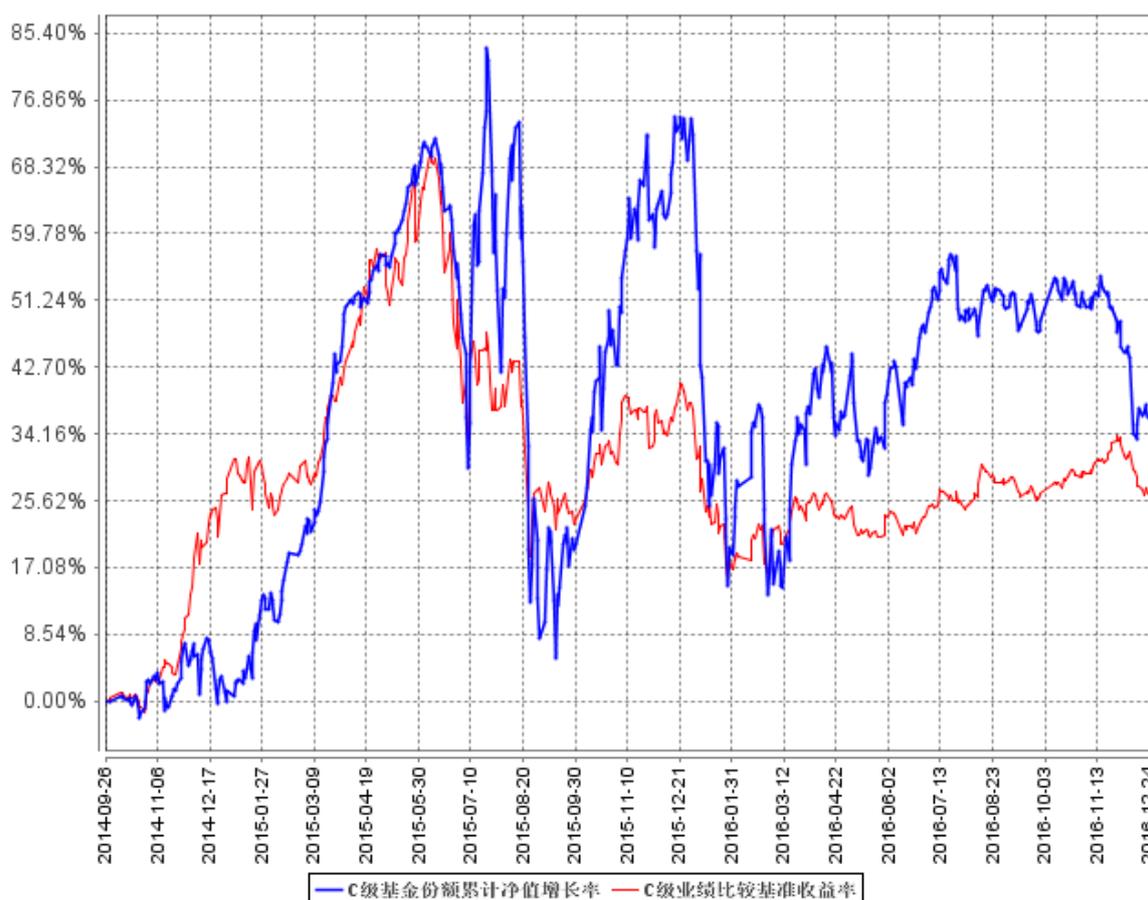
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-9.29%	1.22%	0.34%	0.48%	-9.63%	0.74%
过去六个月	-8.86%	1.13%	2.75%	0.50%	-11.61%	0.63%
过去一年	-21.76%	2.20%	-7.51%	0.91%	-14.25%	1.29%
自基金合同生效起至今	34.80%	2.45%	26.99%	1.29%	7.81%	1.16%

### 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



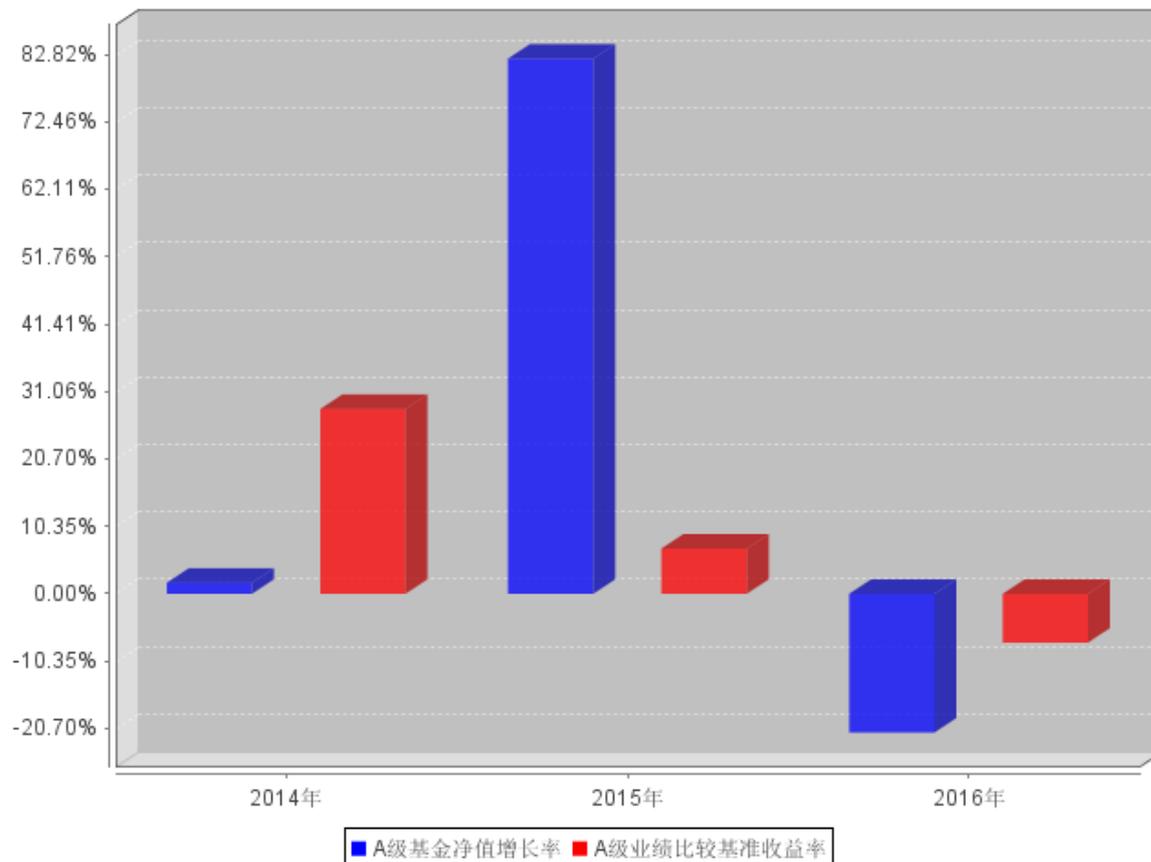
C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



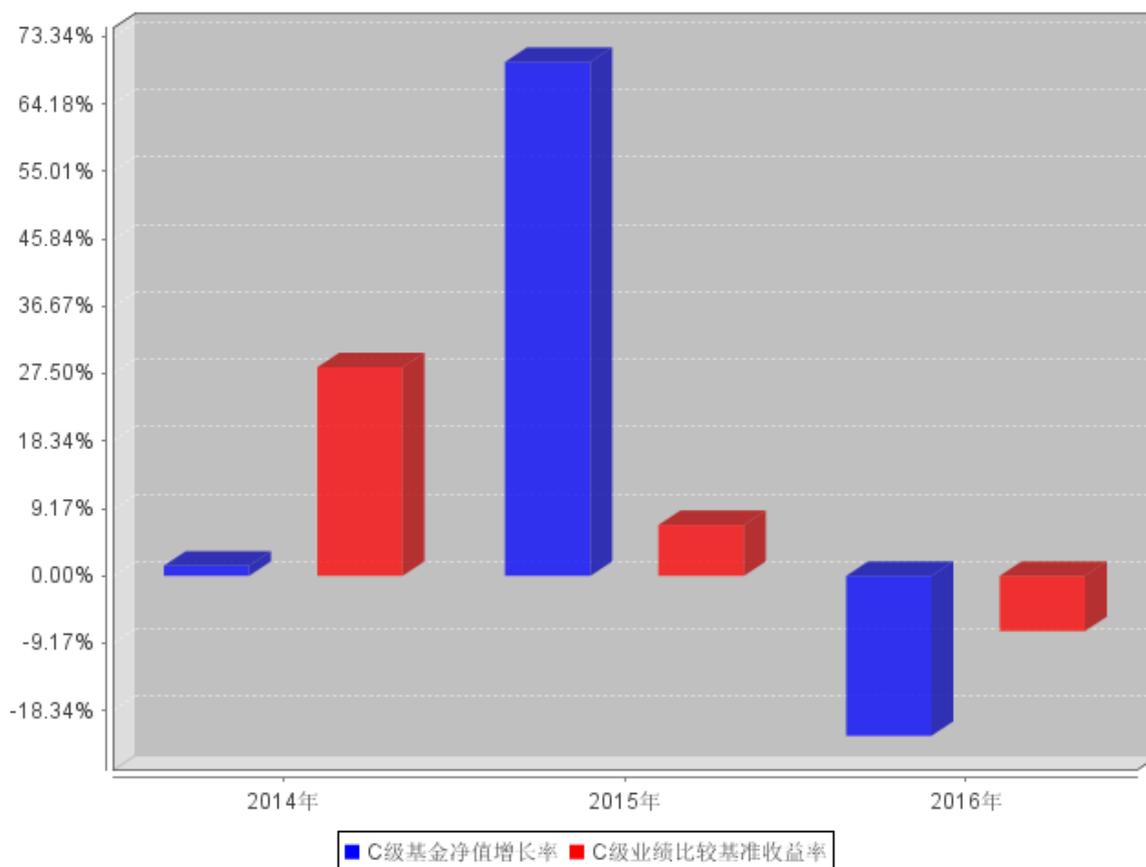
注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起的 6 个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同中的相关约定。

### 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



C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

本基金合同生效日为 2014 年 9 月 26 日，自基金合同生效日至本报告期末未进行分配利润。

## § 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、宝盈互联网沪港深混合二十二只基金，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；权益投资部总监	2014 年 9 月 26 日	-	15 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权益投资部。中国国籍，证券投资基金从业人员资格。
易祚兴	本基金、宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金、宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金、宝盈互联网沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2016 年 6 月 30 日	-	5 年	易祚兴先生，浙江大学计算机应用硕士。曾任浙江天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，自 2014 年 11 月加入宝盈基金管理有限公司，历任研究部研究员；宝盈策略增长混合型证券投资基金、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、宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金、宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金基金经

					理助理。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、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	2015 年 1 月 30 日	2016 年 3 月 26 日	5 年	易祚兴先生，浙江大学计算机应用硕士。历任浙江天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. 彭敢为首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写；

2. 易祚兴为非首任基金经理，其“任职日期”指根据公司决定确定的聘任日期；

3. 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 2016 年 12 月 31 日。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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合同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性解释。

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，对于异常交易发生前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

2016 年股票市场在熔断下跌后缓步回升，全年上证指数下跌 12.31%，沪深 300 指数下跌 11.28%，深成指下跌 19.64%，同期，中小板指数跌幅为 22.89%，创业板指数跌幅为 27.71%。

本基金管理人认为，转变经济增长方式、提升经济发展质量，已成全国上下之共识，政府在政策方面予以各种鼓励和支持，企业和实体亦通过技术创新、产业升级加快这一进程。从政策效果来说虽然短期难以看到经济结构明显改观，反腐深入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，实体经济形势依然严峻，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，经济发展始终作为政府的第一要务，足够的市场深度和政府资源动员能力给经济发展带来了源源不断的动力，在这个激烈变革的时代，需要耐心寻找产业转型新的方向和政府职能转变后带来的新机遇。同时，本基金管理人过去梳理了一线城

市和准一线城市的经济结构和人才结构，整体来说这梯度的城市代表着中国未来的经济转型希望，也是上市公司最集中的区域，已经不少公司逐渐借助资本的力量逐渐成为全国 500 强企业或者行业龙头，研发投入也是逐年加大，也有一种新的现象就是不少国内上市公司加大走出去力度，未来将会有更多的公司出海，这也是经济转型的一大契机。

回顾 2016 年，A 股经历了熔断大幅下跌，二季度后逐步企稳回升。本基金重点配置了计算机、电子、传媒、化工、军工等方向。

#### 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-21.32%，同期业绩比较基准收益率是-7.51%。

宝盈睿丰创新混合 C：本基金在本报告期内净值增长率是-21.76%，同期业绩比较基准收益率是-7.51%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 年三季度以来，中国经济在供给侧改革、地产和汽车拉动等因素的刺激下，呈现了补库存和需求回升的共振局面，我们认为，2017 年宏观经济的主线仍然是“稳中有进”，既不会出现周期大幅向上的复苏，也不会出现经济下台阶的衰退。从政策的角度，控制资产泡沫，鼓励“脱虚向实”是主基调。

基于以上判断，我们认为 A 股上市公司盈利增速仍处于回升通道，政策收紧和 IPO 放开将导致无基本面支撑的高估值公司逐步回归正常水平，关注企业盈利将是全年的主线，这些企业大多数分布于机械、电子、化工、家电等行业。另一方面，随着成长股估值调整至合理水平，以 TMT 为代表的部分优质成长股龙头的行业地位提升，核心竞争力强化，也将迎来中长期上涨的良好局面。

因此，我们将坚持“自上而下定方向，自下而上选个股”的投资思路，一方面，紧盯宏观经济的趋势拐点和政策可能发生的变化，努力规避由此带来的波动。另一方面，通过自下而上选取基本面优秀的公司，为客户创造长期的稳健回报。

#### 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，由权益投资部、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。权益投资部、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。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### **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**

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 2016 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

本基金 2016 年年度财务会计报告经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师签字出具了普华永道中天审字(2017)第 20374 号“标准无保留意见的审计报告”，投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

## § 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：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	26,529,523.17	76,854,432.44
结算备付金	3,773,997.40	3,973,929.30
存出保证金	1,355,902.18	3,645,508.00
交易性金融资产	457,969,418.23	964,358,164.58
其中：股票投资	457,969,418.23	964,358,164.58
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	6,183,346.69	58,735.98
应收利息	10,326.87	19,336.24
应收股利	-	-
应收申购款	528,047.89	9,560,659.75

递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	496,350,562.43	1,058,470,766.29
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2016年12月31日</b>	<b>2015年12月31日</b>
<b>负 债:</b>		
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	511,036.31	8,675,811.62
应付赎回款	4,010,500.52	13,565,192.08
应付管理人报酬	646,129.83	1,263,135.98
应付托管费	107,688.33	210,522.66
应付销售服务费	255,024.01	533,372.03
应付交易费用	2,086,243.59	2,273,380.38
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	237,798.81	172,895.32
负债合计	7,854,421.40	26,694,310.07
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	355,422,723.95	590,768,588.29
未分配利润	133,073,417.08	441,007,867.93
所有者权益合计	488,496,141.03	1,031,776,456.22
负债和所有者权益总计	496,350,562.43	1,058,470,766.29

注：报告期截止日 2016 年 12 月 31 日，宝盈睿丰创新基金 A/B 类基金份额净值 1.458 元，基金份额总额 85,717,424.90 份；宝盈睿丰创新基金 C 类基金份额净值 1.348 元，基金份额总额

269,705,299.05 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 355,422,723.95 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016 年12月31日	2015年1月1日至2015 年12月31日
<b>一、收入</b>	-184,437,101.31	-34,321,916.84
1.利息收入	516,178.35	9,399,407.87
其中：存款利息收入	516,178.35	3,994,129.14
债券利息收入	-	3,078,593.50
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	2,326,685.23
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-94,323,784.44	-123,060,736.19
其中：股票投资收益	-96,061,467.68	-93,252,329.96
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-32,100,754.34
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	1,737,683.24	2,292,348.11
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-94,541,513.35	53,706,848.73
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	3,912,018.13	25,632,562.75
<b>减：二、费用</b>	29,226,100.74	50,774,191.18
1. 管理人报酬	9,774,678.63	27,198,448.95

2. 托管费	1,629,113.15	4,533,074.84
3. 销售服务费	3,923,227.53	6,635,383.19
4. 交易费用	13,509,381.43	11,819,614.14
5. 利息支出	-	208,670.06
其中：卖出回购金融资产支出	-	208,670.06
6. 其他费用	389,700.00	379,000.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>-213,663,202.05</b>	<b>-85,096,108.02</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>-213,663,202.05</b>	<b>-85,096,108.02</b>

### 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	590,768,588.29	441,007,867.93	1,031,776,456.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-213,663,202.05	-213,663,202.05
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）	-235,345,864.34	-94,271,248.80	-329,617,113.14
其中：1. 基金申购款	973,057,409.48	392,668,638.36	1,365,726,047.84
2. 基金赎回款	-1,208,403,273.82	-486,939,887.16	-1,695,343,160.98
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）	355,422,723.95	133,073,417.08	488,496,141.03



### 7.4.2.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需说明的会计差错更正。

### 7.4.3 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、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) 于 2016 年 5 月 1 日前，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。对证券投资基金 管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。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) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、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，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。

### 7.4.4 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	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	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。

## 7.4.5 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.5.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.5.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015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	8,893,383,176.87	100.00%	8,048,211,095.12	100.00%

#### 7.4.5.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016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	8,104,535.52	100.00%	2,086,243.59	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 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%

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。

### 7.4.5.2 关联方报酬

#### 7.4.5.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	9,774,678.63	27,198,448.95
其中：支付销售机构的客户维护费	3,643,807.41	3,612,776.94

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 X1.5%/当年天数。

#### 7.4.5.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,629,113.15	4,533,074.84

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 X0.25%/当年天数。

#### 7.4.5.2.3 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		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 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
宝盈基金	-	923,329.52	923,329.52
广发证券	-	1,380,032.00	1,380,032.00
合计	-	2,303,361.52	2,303,361.52
获得销售服务费的 各关联方名称	上年度可比期间		
	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
宝盈基金	-	3,588,478.98	3,588,478.98
广发证券	-	2,146,538.41	2,146,538.41
合计	-	5,735,017.39	5,735,017.39

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。

#### 7.4.5.3 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。

#### 7.4.5.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.5.4.1 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。

##### 7.4.5.4.2 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

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。

#### 7.4.5.5 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		上年度可比期间	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		2015 年 1 月 1 日至 2015 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	26,529,523.17	426,765.45	76,854,432.44	3,455,834.55

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。

#### 7.4.5.6 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。

#### 7.4.5.7 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。

## 7.4.6 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

### 7.4.6.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 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
300364	中文在线	2016 年 8 月 12 日	2017 年 8 月 14 日	非公开发行	46.80	39.52	428,231	20,041,210.80	16,923,689.12	-

注：宝盈睿丰创新基金可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

### 7.4.6.2 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
002617	露笑科技	2016 年 12 月 23 日	重大事项	14.63	2017 年 1 月 23 日	15.60	2,854,075	44,216,569.75	41,755,117.25	-
300450	先导智能	2016 年 11 月 15 日	重大事项	31.21	2017 年 2 月 8 日	33.00	200,000	6,733,060.00	6,242,000.00	-

注：本基金截至 2016 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。

### 7.4.6.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.6.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的余额。

#### 7.4.6.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事证券交易所债券正回购交易形成的余额。

## § 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	457,969,418.23	92.27
	其中：股票	457,969,418.23	92.27
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	30,303,520.57	6.11
7	其他各项资产	8,077,623.63	1.63
8	合计	496,350,562.43	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	3,776,000.00	0.77
B	采矿业	-	-
C	制造业	276,647,520.23	56.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
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	78,185,591.70	16.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	80,562,507.18	16.49

M	科学研究和技术服务业	1,874,110.00	0.38
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	16,923,689.12	3.46
S	综合	-	-
	合计	457,969,418.23	93.75

### 8.3 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	000058	深赛格	4,361,800	48,110,654.00	9.85
2	300038	梅泰诺	1,072,612	46,916,048.88	9.60
3	300525	博思软件	519,966	44,171,111.70	9.04
4	300118	东方日升	2,623,957	43,111,613.51	8.83
5	300456	耐威科技	828,047	42,172,433.71	8.63
6	002617	露笑科技	2,854,075	41,755,117.25	8.55
7	002655	共达电声	2,961,709	41,523,160.18	8.50
8	300236	上海新阳	875,145	33,693,082.50	6.90
9	300071	华谊嘉信	3,291,263	32,451,853.18	6.64
10	300348	长亮科技	1,102,800	27,393,552.00	5.61

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于宝盈基金管理有限公司 <http://www.byfunds.com> 网站的年度报告正文。

### 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	300084	海默科技	119,600,243.57	11.59
2	300071	华谊嘉信	115,427,976.39	11.19
3	300458	全志科技	100,307,005.79	9.72
4	300038	梅泰诺	97,009,782.30	9.40
5	002655	共达电声	75,446,853.82	7.31
6	002368	太极股份	71,025,597.05	6.88
7	002102	冠福股份	70,495,894.37	6.83
8	002712	思美传媒	68,958,310.96	6.68
9	603636	南威软件	68,085,412.55	6.60
10	300298	三诺生物	67,410,621.31	6.53
11	300456	耐威科技	66,765,469.78	6.47
12	000971	高升控股	63,819,952.08	6.19
13	002617	露笑科技	61,975,202.18	6.01
14	300317	珈伟股份	61,777,076.69	5.99
15	300207	欣旺达	61,109,637.32	5.92
16	603729	龙韵股份	58,935,411.77	5.71
17	002675	东诚药业	58,704,755.79	5.69
18	000058	深赛格	55,956,080.11	5.42
19	603308	应流股份	55,183,219.45	5.35
20	300440	运达科技	53,839,203.74	5.22
21	300420	五洋科技	53,299,833.48	5.17
22	300257	开山股份	52,802,198.17	5.12
23	002806	华锋股份	52,129,951.64	5.05
24	600173	卧龙地产	50,340,279.34	4.88
25	300463	迈克生物	49,217,172.95	4.77
26	300525	博思软件	46,808,686.11	4.54
27	000892	星美联合	46,577,729.29	4.51
28	002449	国星光电	46,524,721.48	4.51

29	300348	长亮科技	44,138,195.41	4.28
30	300364	中文在线	42,246,568.80	4.09
31	300118	东方日升	42,241,775.18	4.09
32	300094	国联水产	39,441,988.75	3.82
33	300404	博济医药	38,653,183.66	3.75
34	000688	建新矿业	38,362,749.25	3.72
35	600597	光明乳业	37,053,689.44	3.59
36	600057	象屿股份	36,601,204.31	3.55
37	300033	同花顺	36,548,209.05	3.54
38	300236	上海新阳	35,947,862.21	3.48
39	002131	利欧股份	35,833,638.40	3.47
40	002341	新纶科技	35,146,423.02	3.41
41	603300	华铁科技	34,230,836.22	3.32
42	002260	德奥通航	33,906,606.04	3.29
43	002659	中泰桥梁	33,191,327.65	3.22
44	002343	慈文传媒	32,551,189.56	3.15
45	002445	中南文化	31,539,929.76	3.06
46	300252	金信诺	30,461,661.50	2.95
47	002188	巴士在线	29,960,986.05	2.90
48	000612	焦作万方	29,868,714.85	2.89
49	000636	风华高科	29,680,083.40	2.88
50	600458	时代新材	29,128,781.57	2.82
51	300088	长信科技	28,834,572.60	2.79
52	600383	金地集团	28,609,603.65	2.77
53	600856	中天能源	27,173,608.58	2.63
54	000581	威孚高科	26,692,861.10	2.59
55	603128	华贸物流	25,935,983.93	2.51
56	603339	四方冷链	25,830,616.25	2.50

57	002587	奥拓电子	25,809,593.20	2.50
58	300367	东方网力	25,761,428.60	2.50
59	002580	圣阳股份	25,431,338.65	2.46
60	000558	莱茵体育	24,711,529.81	2.40
61	002745	木林森	24,471,411.14	2.37
62	600828	茂业商业	24,158,329.02	2.34
63	002513	*ST 蓝丰	24,017,531.14	2.33
64	300326	凯利泰	23,438,650.90	2.27
65	002366	台海核电	23,437,330.54	2.27
66	300318	博晖创新	23,285,108.07	2.26
67	002657	中科金财	22,705,804.00	2.20
68	600489	中金黄金	22,419,970.92	2.17
69	300291	华录百纳	21,816,025.39	2.11
70	002481	双塔食品	21,669,035.11	2.10
71	002041	登海种业	21,029,206.56	2.04
72	000021	深科技	20,960,444.56	2.03
73	600990	四创电子	20,884,028.01	2.02

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票。

2、买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出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	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300084	海默科技	118,087,618.89	11.45
2	300458	全志科技	98,920,430.19	9.59
3	300071	华谊嘉信	95,849,212.14	9.29
4	002368	太极股份	85,214,007.93	8.26
5	002102	冠福股份	79,621,806.84	7.72

6	300252	金信诺	78,170,352.25	7.58
7	000971	高升控股	73,337,689.07	7.11
8	603636	南威软件	70,317,568.18	6.82
9	002522	浙江众成	66,451,538.79	6.44
10	002675	东诚药业	66,293,979.98	6.43
11	300094	国联水产	65,971,578.41	6.39
12	002712	思美传媒	64,535,736.62	6.25
13	300298	三诺生物	64,074,417.52	6.21
14	300317	珈伟股份	63,027,622.61	6.11
15	603729	龙韵股份	62,746,379.26	6.08
16	300463	迈克生物	62,118,561.62	6.02
17	300420	五洋科技	60,639,671.29	5.88
18	300207	欣旺达	59,774,475.98	5.79
19	603308	应流股份	58,361,145.34	5.66
20	002806	华锋股份	54,206,600.06	5.25
21	002773	康弘药业	53,818,088.23	5.22
22	300038	梅泰诺	51,361,867.78	4.98
23	300440	运达科技	49,915,120.79	4.84
24	300257	开山股份	49,357,303.22	4.78
25	600057	象屿股份	48,559,387.04	4.71
26	002449	国星光电	48,019,893.64	4.65
27	600173	卧龙地产	46,537,670.31	4.51
28	002341	新纶科技	45,878,441.30	4.45
29	300326	凯利泰	42,870,123.46	4.15
30	002053	云南能投	42,052,484.02	4.08
31	002445	中南文化	40,117,302.96	3.89
32	000892	星美联合	39,738,127.66	3.85
33	000688	建新矿业	39,643,081.75	3.84

34	300367	东方网力	39,409,208.76	3.82
35	600597	光明乳业	38,586,495.83	3.74
36	600711	盛屯矿业	36,878,963.83	3.57
37	300033	同花顺	36,775,802.88	3.56
38	002659	中泰桥梁	36,634,207.99	3.55
39	002131	利欧股份	35,858,515.85	3.48
40	300404	博济医药	35,402,965.04	3.43
41	300088	长信科技	35,209,303.74	3.41
42	300170	汉得信息	34,270,503.68	3.32
43	002260	德奥通航	34,036,903.58	3.30
44	603128	华贸物流	33,195,705.50	3.22
45	300047	天源迪科	32,796,630.81	3.18
46	603300	华铁科技	31,910,284.40	3.09
47	002215	诺普信	31,401,478.52	3.04
48	600458	时代新材	31,148,751.06	3.02
49	002513	*ST 蓝丰	31,045,719.27	3.01
50	600383	金地集团	30,945,620.00	3.00
51	002343	慈文传媒	30,753,118.31	2.98
52	000636	风华高科	30,411,324.68	2.95
53	000612	焦作万方	30,085,653.46	2.92
54	002188	巴士在线	30,080,784.88	2.92
55	002518	科士达	29,451,048.34	2.85
56	600975	新五丰	29,436,220.78	2.85
57	002587	奥拓电子	29,242,293.69	2.83
58	600856	中天能源	28,401,901.40	2.75
59	000581	威孚高科	28,082,154.43	2.72
60	002655	共达电声	27,981,860.00	2.71
61	002373	千方科技	27,478,732.20	2.66

62	002098	浔兴股份	27,328,866.83	2.65
63	300318	博晖创新	26,013,788.39	2.52
64	002745	木林森	25,824,075.70	2.50
65	000681	视觉中国	25,427,875.41	2.46
66	603339	四方冷链	25,357,183.70	2.46
67	002580	圣阳股份	25,071,706.03	2.43
68	000558	莱茵体育	25,062,455.58	2.43
69	600828	茂业商业	24,283,866.36	2.35
70	300078	思创医惠	23,877,921.22	2.31
71	002047	宝鹰股份	23,537,058.99	2.28
72	002366	台海核电	23,358,388.11	2.26
73	300005	探路者	23,260,760.35	2.25
74	600990	四创电子	23,198,862.69	2.25
75	300322	硕贝德	23,190,520.84	2.25
76	002549	凯美特气	23,130,115.29	2.24
77	300291	华录百纳	22,954,997.81	2.22
78	600489	中金黄金	22,786,743.81	2.21
79	300364	中文在线	22,755,722.16	2.21
80	600198	大唐电信	22,541,339.17	2.18
81	002657	中科金财	22,270,723.62	2.16
82	000021	深科技	21,537,711.52	2.09
83	300446	乐凯新材	21,385,575.49	2.07
84	002481	双塔食品	21,247,878.12	2.06

注：1、卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

2、卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 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	4,300,141,438.40
--------------	------------------

卖出股票收入（成交）总额	4,615,927,203.72
--------------	------------------

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。

## 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。

## 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 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	1,355,902.18
2	应收证券清算款	6,183,346.69
3	应收股利	-
4	应收利息	10,326.87
5	应收申购款	528,047.89
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,077,623.63

### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002617	露笑科技	41,755,117.25	8.55	重大事项

### 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 户数 (户)	户均持有的基金份 额	持有人结构			
			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	4,803	17,846.64	6.73	0.00%	85,717,418.17	100.00%
宝盈睿丰创新 混合 C	13,704	19,680.77	15,346,617.73	5.69%	254,358,681.32	94.31%
合计	18,507	19,204.77	15,346,624.46	4.32%	340,076,099.49	95.68%

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	32,868.59	0.0383%
	宝盈睿丰创新 混合 C	215,257.74	0.0798%
	合计	248,126.33	0.0698%

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	10~50
	合计	10~50

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	宝盈睿丰创新	宝盈睿丰创新
	混合 A/B	混合 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	106,885,196.14	483,883,392.15
本报告期基金总申购份额	103,963,545.19	869,093,864.29
减:本报告期基金总赎回份额	125,131,316.43	1,083,271,957.39
本报告期期末基金份额总额	85,717,424.90	269,705,299.05

## § 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、报告期内本基金管理人重大人事变动情况如下：

(1) 2016 年 4 月 27 日，宝盈基金管理有限公司第四届董事会第二十一临时会议，同意储诚忠辞去副总经理职务。本基金管理人已按规定向中国证券监督管理委员会深圳证监局以及中国证券投资基金业协会报备，并发布基金行业高级管理人员变更公告。

(2) 2016 年 8 月 4 日，宝盈基金管理有限公司第四届董事会第二十二临时会议，同意杨凯辞去副总经理职务。本基金管理人已按规定向中国证券监督管理委员会深圳证监局以及中国证券投资基金业协会报备，并发布基金行业高级管理人员变更公告。

(3) 2016 年 12 月 3 日，本基金管理人发布关于基金行业高级管理人员变更公告，葛俊杰先

生任宝盈基金管理有限公司副总经理。该变更事项已按规定向中国证券监督管理委员会深圳证监局报告以及向中国证券投资基金业协会报备。

(4) 2016 年 9 月 27 日, 宝盈基金管理有限公司董事马宏变更为张栋, 本基金管理人已按规定报中国证监会备案。

2、报告期内本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 3 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

1、报告期内基金管理人收到中国证券监督管理委员会《关于对宝盈基金管理有限公司采取暂停办理相关业务措施的决定》, 责令公司进行整改, 并暂停办理公募基金产品注册申请 3 个月, 对相关责任人采取行政监管措施。公司高度重视, 通过对公司内部控制和风险管理工作进行全面梳理, 针对性的制定、实施整改措施, 并向中国证监会及深圳证监局提交整改报告, 深圳证监局已完成现场整改验收。

2、2016 年 9 月中国证券业协会发布公告, 本基金由于提供有效报价但未参与申购, 被列入首次公开发行股票配售对象黑名单, 黑名单起止日期为 2016 年 9 月 8 日至 2017 年 3 月 7 日。事件发生后, 公司及时就相关问题进行了自查并制定了整改措施, 以确保不再发生类似事件。

3、2016 年 11 月, 托管人广发证券股份有限公司收到中国证监会《行政处罚决定书》((2016)128 号)。中国证监会因公司未按规定审查、了解客户真实身份违法违规行为对公司责令改正, 给予警告, 没收违法所得 6,805,135.75 元, 并处以 20,415,407.25 元罚款。

广发证券对上述问题积极进行整改。在监管部门加大对两融业务检查与处罚力度后, 广发证券自 2015 年 2 月起已暂停代销伞型信托产品, 并于 5 月 26 日起组织了全公司针对伞型信托以及场外配资的自查。按照中国证监会、中国证券业协会关于规范外部系统接入、严查场外配资行为并加强账户实名制管理的统一部署和要求, 广发证券自 2015 年 6 月中旬开始, 在监管部门的指

导下先后开展了多次外部信息系统接入自查。首次全面自查于 2015 年 6 月 17 开始，6 月下旬提交了自查报告并将核查数据上报证监会机构部监管系统。首次自查结束后，公司继续加大排查力度，7 月下旬根据监管部门以及杭州恒生网络技术服务有限责任公司（以下简称恒生）和上海铭创软件技术有限公司（以下简称铭创）等公司提供的疑似外接系统客户数据开展了第二次自查，按要求提交了报告和核查数据。被立案调查后，公司再次针对第三方信息系统接入等问题组织进行全面的自查反思和整改，制定了违规账户认定指引，认真做好剩余账户的识别和清理工作，对于经过清理确认违规的账户，公司采取了限制买入、限制资金转入的“双限”措施，并切断外部接入。

除上述情况外，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		28,893,383,176.87	100.00%	8,104,535.52	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，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**

本报告期本基金租用证券公司交易单元未进行其他证券投资。

宝盈基金管理有限公司

2017 年 3 月 27 日