

宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金 2017 年半年度报告摘要

2017 年 6 月 30 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 8 月 24 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。本半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 8 月 23 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 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	294,649,586.02 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	64,769,991.22 份	229,879,594.80 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

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.byfunds.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	宝盈睿丰创新混合 A/B	宝盈睿丰创新混合 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日)	报告期(2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-24,107,734.21	-81,478,918.83
本期利润	-16,779,957.32	-53,215,395.36

加权平均基金份额本期利润	-0.2283	-0.2051
本期基金份额净值增长率	-15.29%	-15.73%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)	
期末可供分配基金份额利润	-0.8783	-0.9164
期末基金资产净值	79,978,323.78	261,169,463.42
期末基金份额净值	1.235	1.136

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
过去一个月	4.48%	0.79%	3.55%	0.44%	0.93%	0.35%
过去三个月	-9.72%	0.99%	3.63%	0.41%	-13.35%	0.58%
过去六个月	-15.29%	1.08%	6.13%	0.38%	-21.42%	0.70%
过去一年	-22.57%	1.10%	9.05%	0.44%	-31.62%	0.66%
自基金合同生效起至今	23.50%	2.26%	34.78%	1.18%	-11.28%	1.08%

宝盈睿丰创新混合 C

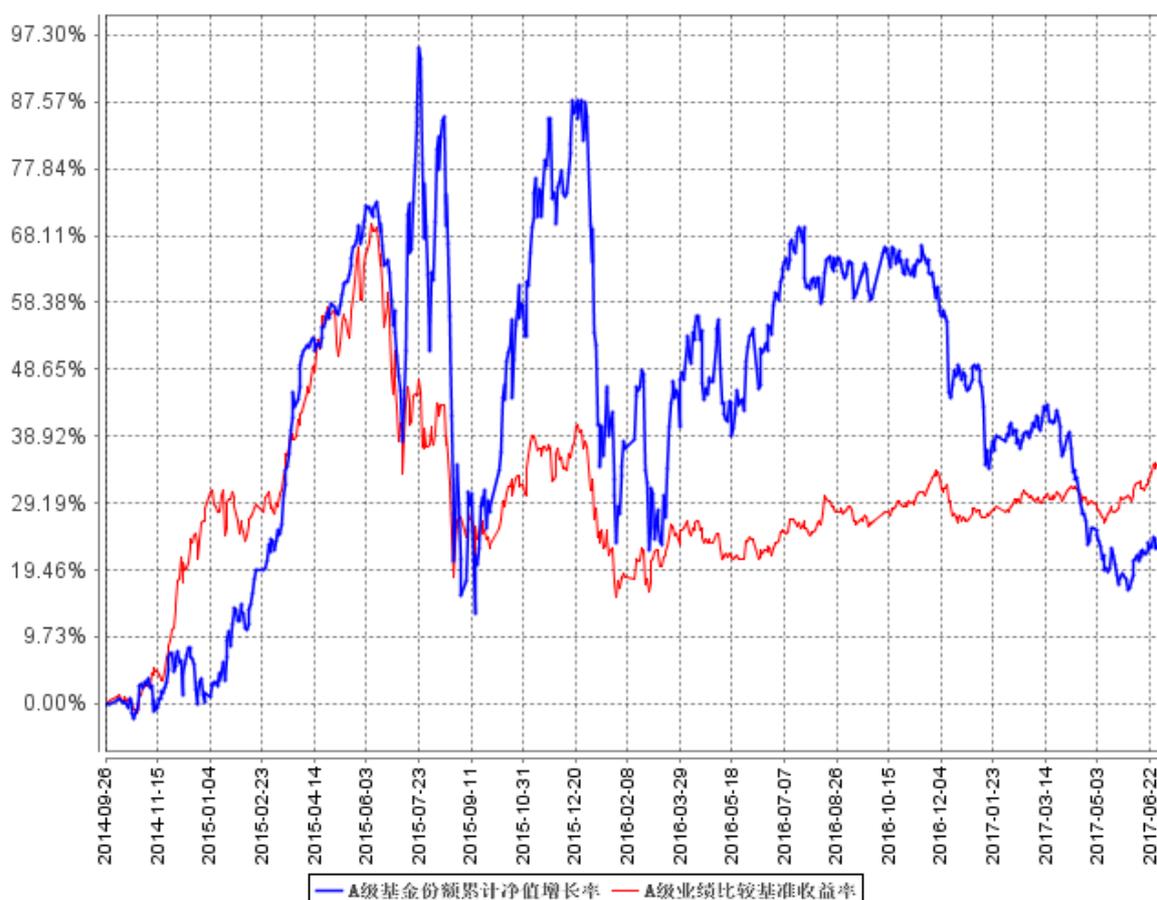
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	4.41%	0.79%	3.55%	0.44%	0.86%	0.35%
过去三个月	-9.98%	0.99%	3.63%	0.41%	-13.61%	0.58%

过去六个月	-15.73%	1.07%	6.13%	0.38%	-21.86%	0.69%
过去一年	-23.19%	1.10%	9.05%	0.44%	-32.24%	0.66%
自基金合同 生效起至今	13.60%	2.27%	34.78%	1.18%	-21.18%	1.09%

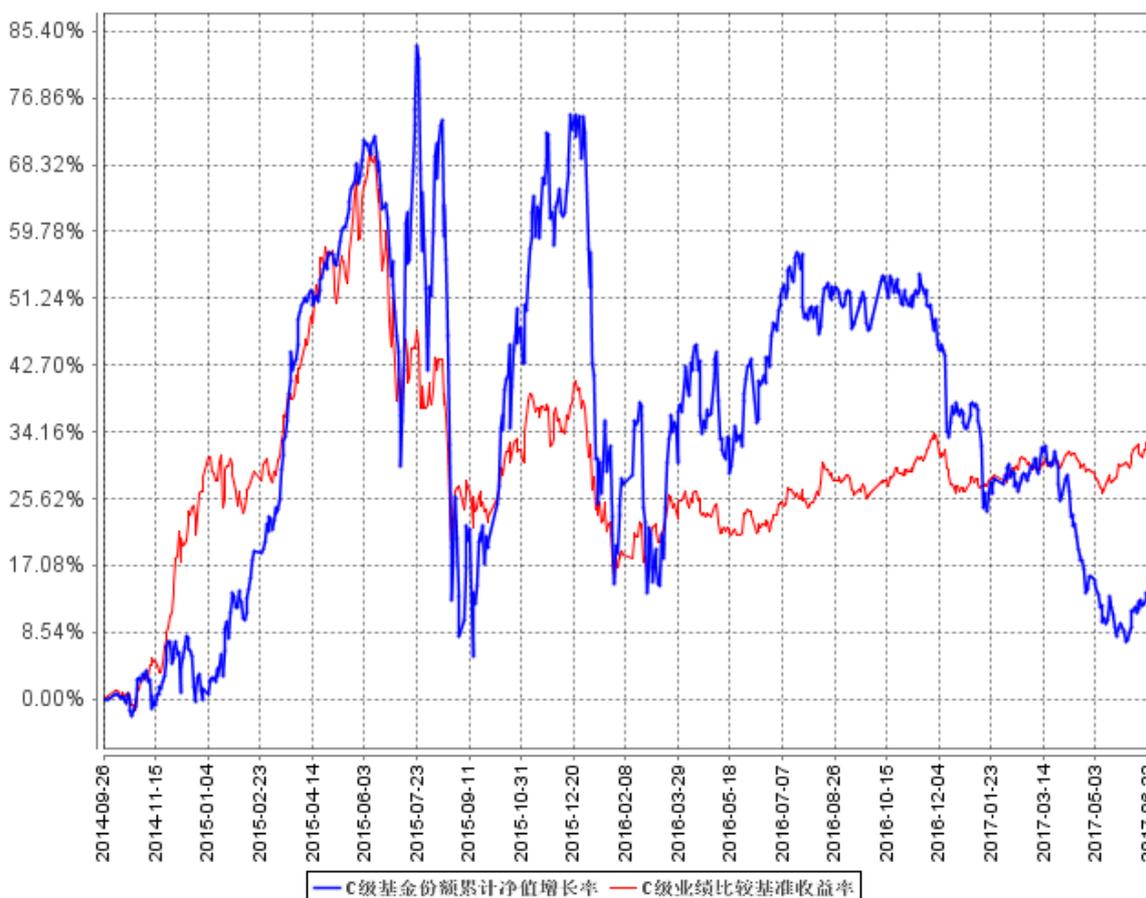
注：本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×65% +中债综合指数收益率（全价）×35%

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



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。

§ 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、宝盈消费主题混合（由原基金鸿阳转型而来）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	2017 年 1 月 4 日	16 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和宝盈资源优选混合型证券投资基金基金经理	2016 年 6 月 30 日	-	6 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。
朱建明	本基金、宝盈策略增长混合型证券投资基金基金经理	2017 年 1 月 5 日	-	7 年	朱建明先生，中国人民银行研究生部金融学硕士。2010 年 7 月至 2011 年 3 月任职于瀚信资产管理有限公司，担任研究员；自 2011 年 5 月加入宝盈基金管理有限公司，历任研究部研究员、专户投资部投资经理。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，“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期；

2、其他均非首任基金经理，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 2017 年 6 月 30 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。

4.3.2 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

本基金管理人认为，中国经济处于短期需求平稳回升的小周期，从中长期看，供给侧结构性改革带来的增长潜力依然很大。广阔而多层次的市场，成熟完善的工业体系，叠加消费升级的终端需求，中国经济中长期具备较强的韧性和乐观的前景。企业盈利无论短期和中长期都处于持续增长的通道。

从二季度市场表现来看，由于流动性变化和监管加强，市场对于经济前景悲观，出现了明显的风格分化和避险情绪，以大消费和低估值蓝筹为代表的大股票持续强势，以创业板为代表的高估值成长股面临着业绩和估值的双重压力。同时，A 股市场制度性建设逐步落实，资本市场“四梁八柱”的监管框架成型，强监管态势持续发酵，投融资功能回归成为主线。另一方面，由于沪港通深港通的开通，海外资金入市，成熟投资者的进入逐步改变投资者结构和市场资金格局，导致市场风格与国际市场的投资风格对接。A 股出现了一定程度上的“美股化”。

本基金重点布局了年报和季报盈利预期较好的优质个股和龙头公司，重点配置了电子、新能源汽车与汽车零部件、机械、食品饮料等板块。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末宝盈睿丰创新混合 A/B 基金份额净值为 1.235 元，本报告期基金份额净值增长率为-15.29%，同期业绩比较基准收益率为 6.13%；

截至本报告期末宝盈睿丰创新混合 C 基金份额净值为 1.136 元，本报告期基金份额净值增长率为-15.73%，同期业绩比较基准收益率为 6.13%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金管理人认为，2017 年宏观经济的主线仍然是“稳中有进”，既不会出现大幅度向上的周期性复苏，也难以出现经济增速下台阶的系统性衰退。虽然 4 月份中央提出了影响深远的金融去杠杆，市场对于经济增长的未来和流动性前景作出了较为悲观的预测和反应，但我们认为中央作出的去杠杆决策，主要针对现有金融体系过度监管套利和多层嵌套，不健康的金融运转机制虚增实体经济的融资成本，削弱中国企业的竞争力。政策着力点正是控制资产泡沫，鼓励“脱虚向实”，中长期看反而有利于实体经济的盈利增长。短期来看，由于加杠杆得到一定程度上的抑制，央行对于流动性的总基调仍然是保持稳健中性，保持流动性松紧适度，短期流动性可能也进入了一个边际宽松的新阶段。

从终端需求来看，本基金管理人对于房地产市场保持密切关注，中央明确提出“房子是用来住的，而不是用来炒的”，未来几年地产调控将常态化，因此我们大胆假设未来房地产的公共品属性将加强，由房地产市场带来的经济周期性波幅将显著收窄，由此引发的地产调控和基建对冲等政策手段也将减少，如果此种假设实现的概率逐步加大，那么对于终端需求的稳定将意义深远。从企业部门投资来看，上半年数据显示制造业投资仍然在底部徘徊，企业部门的投资意愿持续低迷。随着全球经济复苏和人民币汇率稳定，外需也会持续向好，叠加中国居民的消费升级和财富效应，消费和服务的占比将进一步提升。总体来讲，中国经济可能进入了一个中周期较为稳定的新阶段。

基于以上对于经济前景和流动性的判断，本基金管理人认为 A 股上市公司盈利增速将处于回升通道，金融市场强监管和 IPO 放开的政策导向，无基本面支撑的高估值公司的估值水平将逐步回归合理水平，关注企业盈利将是全年的主线。盈利较好的公司大多数分布于家电、食品饮料等大消费板块，以及电子、汽车和部分机械制造业，以煤炭、钢铁、有色、建材和化工等部分上游资源品随着价格的回升，盈利也出现了显著恢复。另一方面，过去五年中国经济持续调整，不仅产业结构得到优化，也重塑了行业内的竞争格局，大量缺乏核心竞争力和产业链地位的企业被淘汰出局，行业竞争寡头化日益显著，龙头企业的竞争力进一步增强，在产业链上的议价能力和盈利水平将显著提高。

本基金管理人将继续坚持“自上而下定方向，自下而上选个股”的投资思路，深度研究具备长期成长空间和核心竞争力的公司，在合理的估值水平买入且秉承长期持有的理念，为客户创造长期的稳健回报。展望下半年，本基金将重点关注高增长且估值合理的优质个股，如受益于新产品周期的电子、新能源汽车和汽车零部件，下半年迎来盈利释放且市场预期差较大的传媒、医药等行业，同时阶段性关注低估值高盈利板块如煤炭、钢铁等中上游板块和食品饮料等大消费板块。

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各方之间不存在任何重大利益冲突。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

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 托管人对本半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 2017 年半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 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：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	21,726,620.18	26,529,523.17
结算备付金	2,154,804.07	3,773,997.40
存出保证金	1,072,774.22	1,355,902.18
交易性金融资产	319,101,879.86	457,969,418.23
其中：股票投资	319,101,879.86	457,969,418.23
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	69,589.57	6,183,346.69
应收利息	13,908.40	10,326.87
应收股利	-	-
应收申购款	109,619.61	528,047.89
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	344,249,195.91	496,350,562.43
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2017 年 6 月 30 日	2016 年 12 月 31 日
负 债：		

短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	511,036.31
应付赎回款	1,141,156.76	4,010,500.52
应付管理人报酬	421,262.35	646,129.83
应付托管费	70,210.41	107,688.33
应付销售服务费	172,274.03	255,024.01
应付交易费用	911,271.69	2,086,243.59
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	385,233.47	237,798.81
负债合计	3,101,408.71	7,854,421.40
所有者权益：		
实收基金	294,649,586.02	355,422,723.95
未分配利润	46,498,201.18	133,073,417.08
所有者权益合计	341,147,787.20	488,496,141.03
负债和所有者权益总计	344,249,195.91	496,350,562.43

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，宝盈睿丰创新混合 A/B 基金份额净值 1.235 元，基金份额总额 64,769,991.22 份；宝盈睿丰创新混合 C 基金份额净值 1.136 元，基金份额总额 229,879,594.8 份。宝盈睿丰创新混合份额总额合计为 294,649,586.02 份。

6.2 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入	-60,599,521.09	-154,737,383.66
1.利息收入	190,627.17	296,279.08
其中：存款利息收入	190,627.17	296,279.08
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-96,518,266.38	-97,165,464.56
其中：股票投资收益	-98,042,549.89	-98,909,781.40
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	1,524,283.51	1,744,316.84
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	35,591,300.36	-60,956,283.16
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	136,817.76	3,088,084.98
减：二、费用	9,395,831.59	12,675,141.67
1. 管理人报酬	3,113,773.56	5,164,749.40
2. 托管费	518,962.26	860,791.59
3. 销售服务费	1,270,608.62	2,104,461.19
4. 交易费用	4,299,807.45	4,352,150.23
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	192,679.70	192,989.26
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-69,995,352.68	-167,412,525.33

减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-69,995,352.68	-167,412,525.33

6.3 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 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）	355,422,723.95	133,073,417.08	488,496,141.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-69,995,352.68	-69,995,352.68
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）	-60,773,137.93	-16,579,863.22	-77,353,001.15
其中：1.基金申购款	90,901,626.31	23,123,134.34	114,024,760.65
2.基金赎回款	-151,674,764.24	-39,702,997.56	-191,377,761.80
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）	294,649,586.02	46,498,201.18	341,147,787.20
项目	上年度可比期间		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 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）	-	-167,412,525.33	-167,412,525.33

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)	-176,681,391.28	-63,357,017.37	-240,038,408.65
其中：1.基金申购款	713,766,481.93	258,542,151.79	972,308,633.72
2.基金赎回款	-890,447,873.21	-321,899,169.16	-1,212,347,042.37
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)	414,087,197.01	210,238,325.23	624,325,522.24

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

 张啸川 丁宁 何瑜
 基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.2.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计政策变更。

6.4.2.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计估计变更。

6.4.2.3 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。

6.4.3 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。

6.4.4 关联方关系

6.4.4.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.4.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.5 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.5.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.5.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30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	2,840,520,668.90	100.00%	2,822,489,884.67	100.00%

6.4.5.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30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	2,588,567.98	100.00%	911,271.69	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30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	2,572,133.09	100.00%	1,185,724.00	100.00%

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

6.4.5.2 关联方报酬

6.4.5.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年 6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016 年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,113,773.56	5,164,749.40

其中：支付销售机构的客户维护费	1,187,715.97	1,788,519.08
-----------------	--------------	--------------

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。

6.4.5.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	518,962.26	860,791.59

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。

6.4.5.2.3 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		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 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	-	294,130.89	294,130.89
广发证券	-	496,707.79	496,707.79
合计	-	790,838.68	790,838.68
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 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	-	629,290.70	629,290.70

广发证券	-	683,010.85	683,010.85
合计	-	1,312,301.55	1,312,301.55

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。

6.4.5.3 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。

6.4.5.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.5.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.5.4.2 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

报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.5.5 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	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 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	21,726,620.18	157,320.95	67,263,140.96	256,669.63

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。

6.4.5.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末未参与关联方承销证券。

6.4.5.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无需披露其他关联交易事项。

6.4.6 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.6.1 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

6.4.12.1.1 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		非公开发行	46.80	33.43	428,231	20,041,210.80	14,315,762.33	-
002879	长缆科技	2017年6月5日	2017年7月7日	新股流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017年6月15日	2017年7月17日	新股流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
603933	睿能科技	2017年6月28日	2017年7月6日	新股流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-
603305	旭升股份	2017年6月30日	2017年7月10日	新股流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
300670	大烨智能	2017年6月26日	2017年7月3日	新股流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
300672	国科微	2017年6月30日	2017年7月12日	新股流通受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-
603331	百达精工	2017年6月27日	2017年7月5日	新股流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
300671	富满电子	2017年6月27日	2017年7月5日	新股流通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
603617	君禾股份	2017年6月23日	2017年7月3日	新股流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-

注：宝盈睿丰创新基金可使用以基金名义开设的股票账户参与认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.6.2 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	复牌开盘价	数量 (股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002766	索菱股份	2017年5月15日	重大事项	35.57	2017年8月15日	16.75	500,175	16,987,899.17	17,791,224.75	-
300364	中文在线	2017年2月13日	重大事项	33.43	-	-	96,500	3,583,911.00	3,225,995.00	-

注：本基金截至 2017 年 6 月 30 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。

6.4.6.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.6.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购交易余额。

6.4.6.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购交易余额。

6.4.7 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	319,101,879.86	92.70
	其中：股票	319,101,879.86	92.70
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	23,881,424.25	6.94
7	其他各项资产	1,265,891.80	0.37
8	合计	344,249,195.91	100.00

7.2 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（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	210,255,050.78	61.63
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	51,414,247.62	15.07
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	2,735,639.62	0.80
J	金融业	10,979,943.49	3.22
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	43,716,998.35	12.81
S	综合	-	-
	合计	319,101,879.86	93.54

7.3 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	600297	广汇汽车	4,460,000	33,583,800.00	9.84
2	002635	安洁科技	729,500	26,422,490.00	7.75
3	300433	蓝思科技	749,920	21,815,172.80	6.39
4	600809	山西汾酒	600,000	20,814,000.00	6.10
5	600884	杉杉股份	1,179,956	19,433,875.32	5.70
6	002614	奥佳华	1,048,600	19,063,548.00	5.59
7	603716	塞力斯	183,838	17,830,447.62	5.23
8	002766	索菱股份	500,175	17,791,224.75	5.22
9	600079	人福医药	900,000	17,658,000.00	5.18
10	300364	中文在线	524,731	17,541,757.33	5.14

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> 网站的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动**7.4.1 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	600297	广汇汽车	57,333,185.54	11.74
2	002766	索菱股份	52,159,809.34	10.68
3	002138	顺络电子	47,037,343.31	9.63
4	603716	塞力斯	41,582,006.26	8.51
5	300473	德尔股份	36,967,572.50	7.57
6	002419	天虹股份	35,020,356.82	7.17
7	601369	陕鼓动力	33,679,404.78	6.89

8	000425	徐工机械	33,343,226.37	6.83
9	002353	杰瑞股份	31,277,969.30	6.40
10	603703	盛洋科技	29,313,565.64	6.00
11	002343	慈文传媒	28,655,519.42	5.87
12	603979	金诚信	28,514,272.08	5.84
13	002434	万里扬	28,384,154.61	5.81
14	000980	众泰汽车	28,360,916.87	5.81
15	002813	路畅科技	28,142,180.18	5.76
16	002094	青岛金王	28,020,379.55	5.74
17	600031	三一重工	28,011,985.44	5.73
18	000960	锡业股份	26,475,617.95	5.42
19	002543	万和电气	26,027,869.98	5.33
20	600884	杉杉股份	24,635,308.07	5.04
21	002635	安洁科技	23,933,650.18	4.90
22	300433	蓝思科技	22,429,572.81	4.59
23	600399	抚顺特钢	22,343,988.46	4.57
24	002356	赫美集团	21,354,573.69	4.37
25	300567	精测电子	21,259,166.34	4.35
26	600809	山西汾酒	19,560,230.75	4.00
27	600702	沱牌舍得	19,357,056.15	3.96
28	002101	广东鸿图	19,228,462.28	3.94
29	002027	分众传媒	18,868,208.57	3.86
30	300362	天翔环境	18,546,557.72	3.80
31	300426	唐德影视	18,460,305.66	3.78
32	601989	中国重工	18,458,530.00	3.78
33	600079	人福医药	18,373,666.93	3.76
34	300365	恒华科技	17,716,494.34	3.63
35	002614	奥佳华	17,555,995.31	3.59

36	603006	联明股份	16,930,775.88	3.47
37	600089	特变电工	16,729,448.34	3.42
38	600766	园城黄金	16,656,300.00	3.41
39	002609	捷顺科技	16,628,663.57	3.40
40	002174	游族网络	15,890,466.06	3.25
41	002051	中工国际	15,039,717.44	3.08
42	002384	东山精密	14,889,476.03	3.05
43	600977	中国电影	14,065,354.53	2.88
44	300315	掌趣科技	13,847,551.74	2.83
45	002273	水晶光电	13,286,468.92	2.72
46	002196	方正电机	13,142,887.43	2.69
47	601818	光大银行	13,072,250.00	2.68
48	300124	汇川技术	13,025,182.58	2.67
49	601595	上海电影	11,162,136.00	2.28
50	000905	厦门港务	10,791,841.00	2.21
51	601628	中国人寿	10,779,119.00	2.21
52	603626	科森科技	10,710,804.00	2.19
53	000049	德赛电池	10,367,953.84	2.12
54	000959	首钢股份	10,355,511.30	2.12
55	300552	万集科技	10,152,825.54	2.08

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”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 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	000058	深赛格	45,799,282.49	9.38

2	002138	顺络电子	45,498,710.84	9.31
3	300038	梅泰诺	44,975,642.20	9.21
4	300525	博思软件	44,012,612.86	9.01
5	002655	共达电声	43,567,067.22	8.92
6	603703	盛洋科技	43,110,825.54	8.83
7	002617	露笑科技	41,851,740.60	8.57
8	300118	东方日升	39,590,431.45	8.10
9	300071	华谊嘉信	39,104,844.98	8.01
10	002766	索菱股份	38,656,277.22	7.91
11	300456	耐威科技	37,424,630.01	7.66
12	300236	上海新阳	37,129,264.04	7.60
13	002419	天虹股份	34,521,667.50	7.07
14	002353	杰瑞股份	33,403,090.39	6.84
15	000425	徐工机械	32,041,733.85	6.56
16	000980	众泰汽车	30,378,402.86	6.22
17	600031	三一重工	29,977,282.99	6.14
18	300473	德尔股份	29,933,328.79	6.13
19	300348	长亮科技	27,672,843.57	5.66
20	002094	青岛金王	27,212,837.54	5.57
21	002543	万和电气	26,347,353.86	5.39
22	603979	金诚信	26,121,631.20	5.35
23	002434	万里扬	25,265,384.10	5.17
24	600297	广汇汽车	24,904,647.05	5.10
25	000960	锡业股份	24,134,466.10	4.94
26	600399	抚顺特钢	23,640,194.50	4.84
27	300567	精测电子	22,765,185.67	4.66
28	002813	路畅科技	22,113,071.67	4.53
29	002356	赫美集团	19,978,494.04	4.09

30	002343	慈文传媒	19,342,623.00	3.96
31	300362	天翔环境	18,860,045.30	3.86
32	002027	分众传媒	18,542,066.00	3.80
33	603716	塞力斯	16,719,573.44	3.42
34	300365	恒华科技	16,683,377.16	3.42
35	002101	广东鸿图	16,611,779.13	3.40
36	603006	黎明股份	16,497,988.84	3.38
37	601989	中国重工	16,044,833.72	3.28
38	002609	捷顺科技	16,017,973.40	3.28
39	002174	游族网络	15,868,383.16	3.25
40	600766	园城黄金	15,840,654.66	3.24
41	002273	水晶光电	14,658,959.84	3.00
42	300315	掌趣科技	14,367,389.86	2.94
43	600089	特变电工	14,141,009.43	2.89
44	600977	中国电影	13,296,333.67	2.72
45	300124	汇川技术	13,116,893.73	2.69
46	601818	光大银行	12,757,500.00	2.61
47	002051	中工国际	11,683,310.89	2.39
48	603626	科森科技	11,455,757.00	2.35
49	601595	上海电影	11,293,165.00	2.31
50	002196	方正电机	11,149,930.12	2.28
51	601369	陕鼓动力	11,094,346.02	2.27
52	600702	沱牌舍得	11,080,037.00	2.27
53	600566	济川药业	10,854,074.36	2.22
54	300552	万集科技	10,225,726.91	2.09

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。

7.4.3 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	1,382,850,285.82
卖出股票收入（成交）总额	1,459,253,418.40

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

7.5 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。

7.6 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。

7.7 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。

7.8 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投资贵金属。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

7.12.2

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。

7.12.3 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	1,072,774.22
2	应收证券清算款	69,589.57
3	应收股利	-
4	应收利息	13,908.40
5	应收申购款	109,619.61
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,265,891.80

7.12.4 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。

7.12.5 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	002766	索菱股份	17,791,224.75	5.22	重大事项
2	300364	中文在线	17,541,757.33	5.14	重大事项 (含非公开发行)

7.12.6 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

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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	4,825	13,423.83	6.73	0.00%	64,769,984.49	100.00%
宝盈睿丰创新混合 C	12,760	18,015.64	39,556,970.25	17.21%	190,322,624.55	82.79%
合计	17,585	16,755.73	39,556,976.98	13.43%	255,092,609.04	86.57%

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。

8.2 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	31,373.08	0.0484%
	宝盈睿丰创新混合 C	28,608.41	0.0124%
	合计	59,981.49	0.0204%

8.3 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	宝盈睿丰创新混合	0

开放式基金	A/B	
	宝盈睿丰创新混合 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	宝盈睿丰创新 混合 A/B	宝盈睿丰创 新混合 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	85,717,424.90	269,705,299.05
本报告期基金总申购份额	8,180,266.26	82,721,360.05
减：本报告期基金总赎回份额	29,127,699.94	122,547,064.30
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	64,769,991.22	229,879,594.80

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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）根据宝盈基金管理有限公司第四届董事会第六次现场会议决议，同意张新元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，并发布基金行业高级管理人员变更公告。

（2）根据宝盈基金管理有限公司第四届董事会第二十六次临时会议决议，同意汪钦辞去总经理职务，在新聘总经理聘任到位之前，暂由公司董事长李文众先生代为履行公司总经理相关职责。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报告以及向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）根据宝盈基金管理有限公司第五届董事会第一次现场会议决议，同意张啸川先生任宝盈基金管理有限公司总经理，丁宁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，并发布基金行

业高级管理人员变更公告。

(4) 宝盈基金管理有限公司原独立董事贺颖奇、屈文洲先生任职届满，不再担任公司独立董事。根据宝盈基金管理有限公司股东会 2017 年第一次现场会议，同意张苏彤、廖振中和王艳艳担任宝盈基金管理有限公司独立董事，拟任公司总经理张啸川先生担任宝盈基金管理有限公司经营管理层董事，同意刘郁飞担任宝盈基金管理有限公司股东监事、魏玲玲和汪兀担任宝盈基金管理有限公司职工监事。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报告以及向中国证券投资基金业协会报备。

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。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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。

10.4 基金投资策略的改变

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。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内未发生改聘会计师事务所情况。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	2,840,520,668.90	100.00%	2,588,567.98	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、交易单元变更情况

本基金本报告期内无租用和退租交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期内无租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 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。

宝盈基金管理有限公司

2017 年 8 月 24 日