

宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金 2017 年年度报告摘要

2017 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：2018 年 3 月 31 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 2018 年 3 月 30 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 2017 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 | 201,647,640.72 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 | 51,959,394.67 份 | 149,688,246.05 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 | 2017 年 | | 2016 年 | | 2015 年 | |
|---------------|----------------|----------------|----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| | 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 | 宝盈睿丰创新混合 C |
| 本期已实现收益 | -20,614,845.07 | -73,475,359.18 | -25,733,965.06 | -93,387,723.64 | 17,956,692.25 | -156,759,649.00 |
| 本期利润 | -15,048,334.06 | -45,131,189.67 | -33,805,748.81 | -179,857,453.24 | -234,300,999.35 | 149,204,891.33 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.2275 | -0.2040 | -0.3203 | -0.5200 | -0.3751 | 0.2657 |
| 本期基金份额净值增长率 | -14.68% | -15.43% | -21.32% | -21.76% | 82.20% | 69.92% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2017 年末 | | 2016 年末 | | 2015 年末 | |
| | 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 | 宝盈睿丰创新混合 C |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.8204 | -0.8681 | -0.5612 | -0.6184 | -0.3186 | -0.3850 |
| 期末基金资产净值 | 64,657,474.26 | 170,698,010.96 | 125,006,095.37 | 363,490,045.66 | 198,106,943.23 | 833,669,512.99 |
| 期末基金份额净值 | 1.244 | 1.140 | 1.458 | 1.348 | 1.853 | 1.723 |

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、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

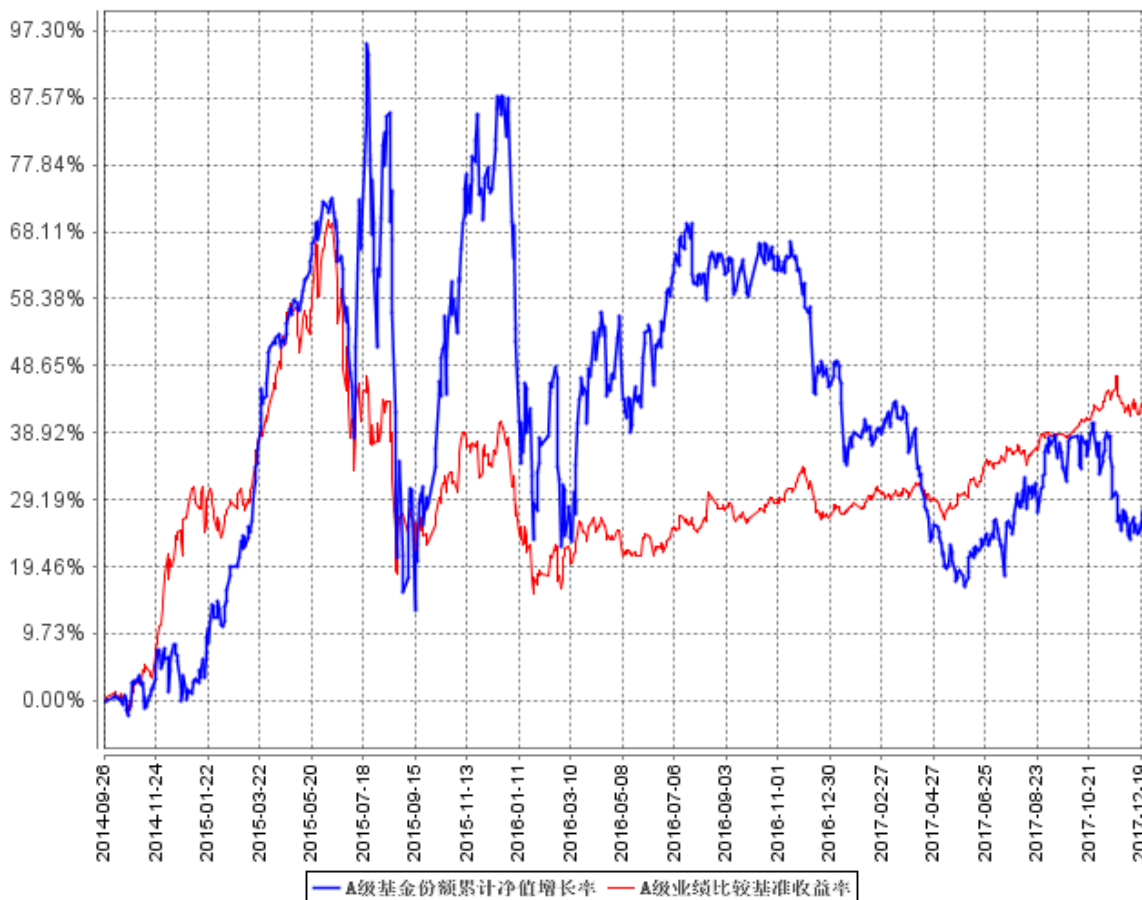
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去三个月 | -9.99% | 1.37% | 2.89% | 0.52% | -12.88% | 0.85% |
| 过去六个月 | 0.73% | 1.36% | 5.94% | 0.45% | -5.21% | 0.91% |
| 过去一年 | -14.68% | 1.23% | 12.43% | 0.42% | -27.11% | 0.81% |
| 过去三年 | 22.32% | 2.20% | 11.21% | 1.09% | 11.11% | 1.11% |
| 自基金合同生效起至今 | 24.40% | 2.14% | 42.78% | 1.09% | -18.38% | 1.05% |

宝盈睿丰创新混合 C

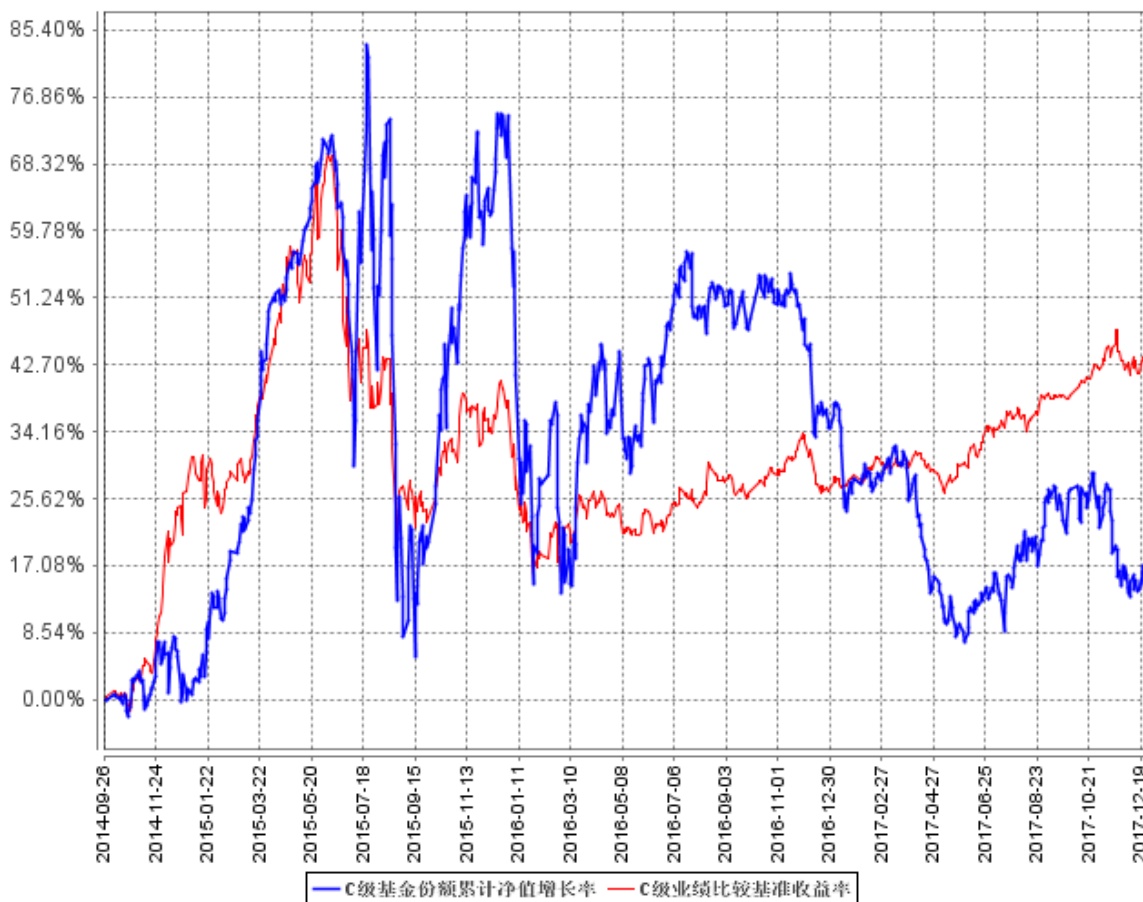
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去三个月 | -10.17% | 1.37% | 2.89% | 0.52% | -13.06% | 0.85% |
| 过去六个月 | 0.35% | 1.36% | 5.94% | 0.45% | -5.59% | 0.91% |
| 过去一年 | -15.43% | 1.23% | 12.43% | 0.42% | -27.86% | 0.81% |
| 过去三年 | 12.43% | 2.20% | 11.21% | 1.09% | 1.22% | 1.11% |
| 自基金合同生效起至今 | 14.00% | 2.15% | 42.78% | 1.09% | -28.78% | 1.06% |

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

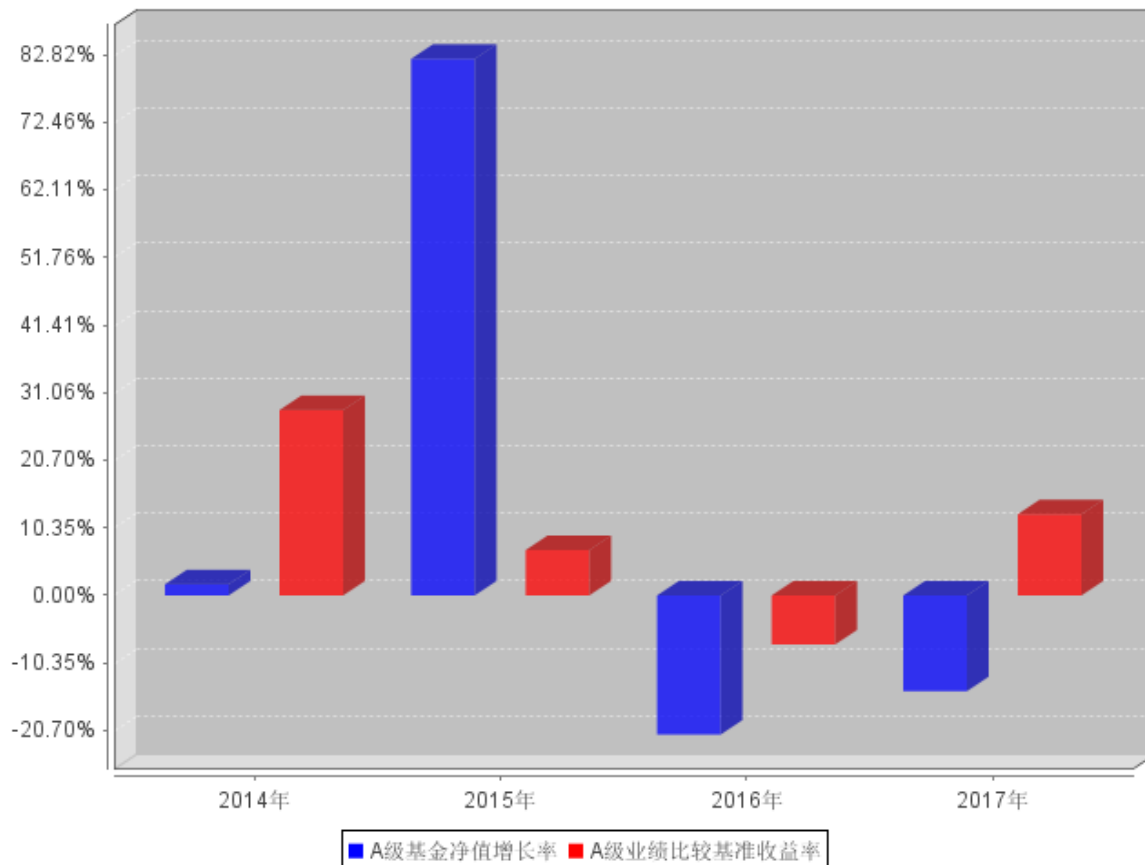


C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

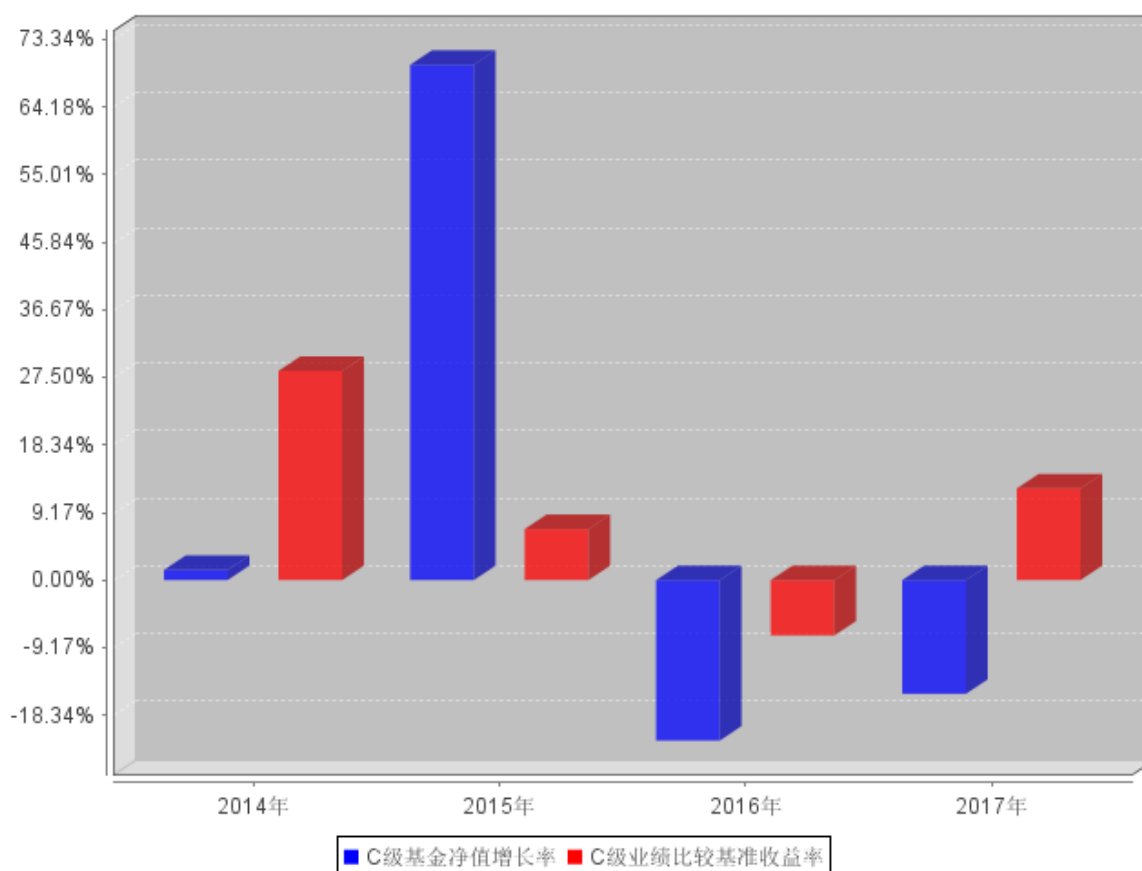


3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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 | | |
| 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。 |
| 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 | 2017 年 7 月 29 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。 |

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. 其他基金经理为非首任基金经理，其“任职日期”指根据公司决定确定的聘任日期，“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期；
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 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

2017 年市场呈现两极分化的结构性行情。一方面，以食品饮料、家电为代表的消费板块、银行保险引领的金融板块持续强势，另一方面，由于政策去杠杆和资金利率的抬升压制整体估值，以创业板为代表的中小市值公司业绩增速下行，股价呈现持续调整态势。同时，随着供给侧改革的推进，上游资源品为代表的周期品产业集中度不断提高，业绩持续超预期向好，但股票走势一波三折，全年总体走势震荡上行。

本基金的重点投资方向为具备持续创新能力的上市公司，本基金管理人认为，从中长期视角看，消费升级和产业创新是未来前景广阔、确定性较强的两大方向。一方面，随着居民可支配收入的增长，消费代际的更迭，以及财富效应的显现，勇于在产品研发、商业模式、业务形态上锐意创新、服务能力不断提升的企业，就能抓住消费升级浪潮，成就伟大的企业。另一方面，新兴产业中引领技术趋势与工艺创新的企业，通过持续的研发投入和产品创新，构筑了越来越宽的护城河，核心竞争力和产业链地位不断加强。基于以上对经济周期、产业方向的认识，遵循本基金的长期投资脉络，本年度重点布局了上述方向的优质个股，从行业来看，本基金重点配置于电子、新能源汽车、高端装备制造、医药、计算机、食品饮料等，阶段性的配置了煤炭、钢铁等周期品。

本基金管理人将继续坚持“自上而下定产业方向，自下而上选优质个股”的投资思路，在上述方向深度研究具备核心竞争力的公司，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。

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 1.244 元，本报告期基金份额净值增长率为-14.68%；截至本报告期末宝盈睿丰创新混合 C 基金份额净值为 1.140 元，本报告期基金份额净值增长率为-15.43%；同期业绩比较基准收益率为 12.43%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 年宏观经济的“稳”超乎市场预期，各项经济数据的波动不仅在很窄的区间内，甚至基本在一致预期的数值上，从数据表象来看，中国经济似乎进入了一个新的平台期。

十九大报告明确提出了中国特色社会主义进入了新时代，这反映了当前的基本面最核心的特

征，从好的方面看，中国经济由高速增长转向高质量发展，虽然量的增长较为平稳，但质的提高明显，因此，如果线性展望 2018 年，经济运行总体平稳，企业的微观盈利持续恢复，产业结构继续优化。

然而，在乐观预期的背后，也不应忽视宏观层面存在星星之火的风险因素，一方面，全球经济复苏的进程不会一帆风顺，18 年将面临更为复杂的海外贸易和货币环境，国内政策是否会出现错判和超调，犹未可知；另一方面，金融是经济的血液，金融去杠杆，继而推进经济去杠杆，对经济和产业的影响难以有效评估，加之盈利增速高位下行，通胀苗头烟云再起，地产未来迷雾重重。由于预测对象发生了较大的变化，我们对这些难以预知的因素保持高度警惕，始终把风险控制放在首位。

当然，从中长期来看，无论周期如何扰动，我们始终认为中国经济具备较强的韧性和广阔的空间，供给侧结构性改革潜力巨大、广阔而多层次的市场、成熟完善的工业体系，消费升级和产业创新这两大趋势将持续推进中国经济的发展和优化。即使宏观层面出现较大的波动，也不改中国产业出清和新产业崛起的时代大潮，产业和企业的分化也不会停止。随着货币政策基调的收紧，过去那种借助融资杠杆，低水平增长的企业将面临瓶颈；环保督查常态化和执行标准从严，依靠低环保投入，污染环境而低质量竞争的企业将被淘汰出局，行业内真正优秀的企业就会脱颖而出。本基金管理人认为，创新是未来成就伟大企业最重要的基因之一，勇于在产品创新、技术研发上持续投入的企业，将构筑越来越宽的护城河，核心竞争力和产业链地位不断加强，具备长期投资价值。

基于以上认识，本基金将在上述方向寻找投资机会，如创新药、电子、计算机互联网、传媒、新能源、先进制造等。同时关注行业集中度提升带来的龙头机会，如地产、化工等板块，适度配置低估值消费蓝筹。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

本基金管理人按照企业会计准则、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。基金托管人根据法律法规要求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委员会，由公司投研、运营的分管领导及研究部、投资部门（权益投资部、固定收益部等）、风险管理部、基金运营部、监察稽核部负责人共同组成，以上人员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历。估值委员会负责制定、修订和完善公司估值政策和程序，

定期评价估值政策和程序修订的适用性。日常基金资产的估值程序，由基金运营部负责执行。对需要进行估值调整的投资品种，管理人启动估值调整程序，并与基金托管人协商一致，必要时征求会计师事务所的专业意见，由估值委员会议定估值方案，基金运营部具体执行。

截止报告期末，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司建立业务合作关系，由其按约定提供有关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

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 2017 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 2017 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(2018)第 20832 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：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产 | 本期末 2017 年 12 月 31 日 | 上年度末 2016 年 12 月 31 日 |
|-----------------|-------------------------|--------------------------|
| 资产： | | |
| 银行存款 | 31,222,233.78 | 26,529,523.17 |
| 结算备付金 | 36,661.66 | 3,773,997.40 |
| 存出保证金 | 397,447.49 | 1,355,902.18 |
| 交易性金融资产 | 207,280,732.56 | 457,969,418.23 |
| 其中：股票投资 | 207,280,732.56 | 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 | 2,057,888.50 | 6,183,346.69 |
| 应收利息 | 6,154.58 | 10,326.87 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | 161,319.26 | 528,047.89 |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 241,162,437.83 | 496,350,562.43 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 | 上年度末 |
| | 2017 年 12 月 31 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 | 3,332,784.28 | 511,036.31 |
| 应付赎回款 | 1,495,052.57 | 4,010,500.52 |
| 应付管理人报酬 | 305,061.06 | 646,129.83 |
| 应付托管费 | 50,843.48 | 107,688.33 |
| 应付销售服务费 | 117,642.71 | 255,024.01 |
| 应付交易费用 | 344,847.32 | 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 | 160,721.19 | 237,798.81 |
| 负债合计 | 5,806,952.61 | 7,854,421.40 |
| 所有者权益： | | |
| 实收基金 | 201,647,640.72 | 355,422,723.95 |
| 未分配利润 | 33,707,844.50 | 133,073,417.08 |
| 所有者权益合计 | 235,355,485.22 | 488,496,141.03 |
| 负债和所有者权益总计 | 241,162,437.83 | 496,350,562.43 |

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，宝盈睿丰创新混合 A/B 基金份额净值 1.244 元，基金份额总额 51,959,394.67 份；宝盈睿丰创新混合 C 基金份额净值 1.140 元，基金份额总额 149,688,246.05 份。宝盈睿丰创新混合份额总额合计为 201,647,640.72 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 |
|------------------------|---|--|
| 一、收入 | -45,546,416.25 | -184,437,101.31 |
| 1. 利息收入 | 290,889.02 | 516,178.35 |
| 其中：存款利息收入 | 290,889.02 | 516,178.35 |
| 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） | -80,044,127.78 | -94,323,784.44 |
| 其中：股票投资收益 | -82,098,443.44 | -96,061,467.68 |
| 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 | 2,054,315.66 | 1,737,683.24 |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 33,910,680.52 | -94,541,513.35 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | - | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 296,141.99 | 3,912,018.13 |
| 减：二、费用 | 14,633,107.48 | 29,226,100.74 |
| 1. 管理人报酬 | 5,388,465.33 | 9,774,678.63 |
| 2. 托管费 | 898,077.53 | 1,629,113.15 |

| | | |
|----------------------------|-----------------------|------------------------|
| 3. 销售服务费 | 2,170,236.38 | 3,923,227.53 |
| 4. 交易费用 | 5,798,128.24 | 13,509,381.43 |
| 5. 利息支出 | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | - | - |
| 6. 其他费用 | 378,200.00 | 389,700.00 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | -60,179,523.73 | -213,663,202.05 |
| 减：所得税费用 | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | -60,179,523.73 | -213,663,202.05 |

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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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） | 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） | - | -60,179,523.73 | -60,179,523.73 |
| 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） | -153,775,083.23 | -39,186,048.85 | -192,961,132.08 |
| 其中：1. 基金申购款 | 137,511,279.23 | 32,889,787.97 | 170,401,067.20 |
| 2. 基金赎回款 | -291,286,362.46 | -72,075,836.82 | -363,362,199.28 |
| 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） | 201,647,640.72 | 33,707,844.50 | 235,355,485.22 |
| 项目 | 上年度可比期间 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 |

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(以下简称“宝盈基金公司”) | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 广发证券股份有限公司(以下简称“广发证券”) | 基金托管人、基金销售机构 |
| 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 2017年1月1日至2017年12月31日 | | 上年度可比期间 2016年1月1日至2016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 | 3,796,361,379.77 | 100.00% | 8,893,383,176.87 | 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 2017年1月1日至2017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 | 3,459,623.98 | 100.00% | 344,847.32 | 100.00% |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 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% |

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 2017年1月1日至2017年 12月31日 | 上年度可比期间 2016年1月1日至2016年 12月31日 |
|-----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| | 当期发生的基金应支付的管理费 | 5,388,465.33 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 2,120,417.32 | 3,643,807.41 |

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。

7.4.5.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017年 12月31日 | 上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12 月31日 |
|----|---------------------------------|--------------------------------------|
| | | |

| | | |
|----------------|------------|--------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 898,077.53 | 1,629,113.15 |
|----------------|------------|--------------|

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 2017年1月1日至2017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 |
| 宝盈基金公司 | - | 437,889.55 | 437,889.55 |
| 广发证券 | - | 895,027.91 | 895,027.91 |
| 合计 | - | 1,332,917.46 | 1,332,917.46 |
| 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 |
| 宝盈基金公司 | - | 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 |

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.80%。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 0.80%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 X0.80%/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固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固有资金投资。

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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 | | 上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 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 | 31,222,233.78 | 245,895.78 | 26,529,523.17 | 426,765.45 |

注：本基金的银行存款由基金托管人广发证券保管，银行存款账户开立在中国建设银行股份有限公司，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（2017 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 | 2018 年 8 月 15 日 | 非公开发行 流通受限 | 46.80 | 8.62 | 535,546 | 10,020,605.40 | 4,616,406.52 | - |
| 300664 | 鹏鹞环保 | 2017 年 12 月 28 日 | 2018 年 1 月 5 日 | 新股流通 受限 | 8.88 | 8.88 | 3,640 | 32,323.20 | 32,323.20 | - |
| 603161 | 科华控股 | 2017 年 12 月 28 日 | 2018 年 1 月 5 日 | 新股流通 受限 | 16.75 | 16.75 | 1,239 | 20,753.25 | 20,753.25 | - |
| 002923 | 润都股份 | 2017 年 12 月 28 日 | 2018 年 1 月 5 日 | 新股流通 受限 | 17.01 | 17.01 | 954 | 16,227.54 | 16,227.54 | - |
| 603080 | 新疆火炬 | 2017 年 12 月 25 日 | 2018 年 1 月 3 日 | 新股流通 受限 | 13.60 | 13.60 | 1,187 | 16,143.20 | 16,143.20 | - |

注：1、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份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股份，自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过其持有该次非公开发行股份数量的 50%；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。此外，本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受

让的股份。

2、本基金持有的流通受限股票“中文在线”（证券代码：300364）包含其非公开发行锁定期内根据权益分配方案以资本公积金转增获得的 321,430.50 股（根据中文在线 2017 年度权益分派实施公告，中文在线以 2017 年 4 月 12 日的总股本 284,752,577 股为基数，向全体股东每 10 股派发现金股利 0.4 元人民币（含税）；同时以资本公积金向全体股东每 10 股转增 15 股，除权除息日为 2017 年 8 月 1 日。）

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 |
|--------|------|---------------------|------|------------|--------------------|----------------|-----------|---------------|---------------|----|
| 300383 | 光环新网 | 2017 年 11 月 7 日 | 重大事项 | 12.12 | 2018 年 3 月 19 日 | 14.51 | 1,000,000 | 15,505,355.00 | 12,120,000.00 | - |
| 300364 | 中文在线 | 2017 年 12 月 28 日 | 重大事项 | 9.23 | 2018 年 1 月 5 日 | 10.00 | 35,545 | 665,092.75 | 328,080.35 | - |
| 300730 | 科创信息 | 2017 年 12 月 25 日 | 临时停牌 | 41.55 | 2018 年 1 月 2 日 | 45.71 | 821 | 6,863.56 | 34,112.55 | - |

注：本基金截至 2017 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 | 207,280,732.56 | 85.95 |

| | | | |
|---|-------------------|----------------|--------|
| | 其中：股票 | 207,280,732.56 | 85.95 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 31,258,895.44 | 12.96 |
| 8 | 其他各项资产 | 2,622,809.83 | 1.09 |
| 9 | 合计 | 241,162,437.83 | 100.00 |

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 150,785,723.98 | 64.07 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 16,143.20 | 0.01 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 17,942.76 | 0.01 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 16,144,112.55 | 6.86 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | 3,106,000.00 | 1.32 |
| 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 | 28,705,323.20 | 12.20 |
| 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 | 8,505,486.87 | 3.61 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 207,280,732.56 | 88.07 |

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 | 002573 | 清新环境 | 1,000,000 | 22,730,000.00 | 9.66 |
| 2 | 600388 | 龙净环保 | 1,200,000 | 20,760,000.00 | 8.82 |
| 3 | 002294 | 信立泰 | 384,928 | 17,394,896.32 | 7.39 |
| 4 | 002384 | 东山精密 | 600,000 | 17,076,000.00 | 7.26 |
| 5 | 002635 | 安洁科技 | 600,000 | 15,654,000.00 | 6.65 |
| 6 | 300383 | 光环新网 | 1,000,000 | 12,120,000.00 | 5.15 |
| 7 | 600498 | 烽火通信 | 404,126 | 11,650,952.58 | 4.95 |
| 8 | 000100 | TCL 集团 | 2,500,000 | 9,750,000.00 | 4.14 |
| 9 | 600867 | 通化东宝 | 420,000 | 9,613,800.00 | 4.08 |
| 10 | 300558 | 贝达药业 | 140,000 | 8,860,600.00 | 3.76 |

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 | 600297 | 广汇汽车 | 57,333,185.54 | 11.74 |
| 2 | 002766 | 索菱股份 | 52,159,809.34 | 10.68 |
| 3 | 600399 | 抚顺特钢 | 47,675,362.03 | 9.76 |
| 4 | 002138 | 顺络电子 | 47,037,343.31 | 9.63 |
| 5 | 603716 | 塞力斯 | 41,582,006.26 | 8.51 |
| 6 | 300473 | 德尔股份 | 36,967,572.50 | 7.57 |
| 7 | 002343 | 慈文传媒 | 35,831,416.42 | 7.34 |
| 8 | 002419 | 天虹股份 | 35,020,356.82 | 7.17 |
| 9 | 601369 | 陕鼓动力 | 33,679,404.78 | 6.89 |
| 10 | 000425 | 徐工机械 | 33,343,226.37 | 6.83 |
| 11 | 600031 | 三一重工 | 32,348,407.44 | 6.62 |
| 12 | 002353 | 杰瑞股份 | 31,277,969.30 | 6.40 |
| 13 | 600809 | 山西汾酒 | 30,731,276.75 | 6.29 |
| 14 | 002635 | 安洁科技 | 30,615,303.18 | 6.27 |
| 15 | 002573 | 清新环境 | 29,326,640.00 | 6.00 |
| 16 | 603703 | 盛洋科技 | 29,313,565.64 | 6.00 |
| 17 | 600884 | 杉杉股份 | 28,525,848.07 | 5.84 |
| 18 | 603979 | 金诚信 | 28,514,272.08 | 5.84 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 19 | 002434 | 万里扬 | 28,384,154.61 | 5.81 |
| 20 | 000980 | 众泰汽车 | 28,360,916.87 | 5.81 |
| 21 | 002813 | 路畅科技 | 28,142,180.18 | 5.76 |
| 22 | 002094 | 青岛金王 | 28,020,379.55 | 5.74 |
| 23 | 600388 | 龙净环保 | 27,908,393.02 | 5.71 |
| 24 | 000960 | 锡业股份 | 26,475,617.95 | 5.42 |
| 25 | 002543 | 万和电气 | 26,027,869.98 | 5.33 |
| 26 | 002384 | 东山精密 | 25,662,186.93 | 5.25 |
| 27 | 300385 | 雪浪环境 | 24,275,438.88 | 4.97 |
| 28 | 601699 | 潞安环能 | 24,066,656.46 | 4.93 |
| 29 | 300433 | 蓝思科技 | 22,429,572.81 | 4.59 |
| 30 | 600718 | 东软集团 | 21,936,167.35 | 4.49 |
| 31 | 600498 | 烽火通信 | 21,570,813.04 | 4.42 |
| 32 | 002356 | 赫美集团 | 21,354,573.69 | 4.37 |
| 33 | 300567 | 精测电子 | 21,259,166.34 | 4.35 |
| 34 | 000959 | 首钢股份 | 21,119,689.30 | 4.32 |
| 35 | 600188 | 兖州煤业 | 19,537,188.00 | 4.00 |
| 36 | 600702 | 舍得酒业 | 19,357,056.15 | 3.96 |
| 37 | 002101 | 广东鸿图 | 19,228,462.28 | 3.94 |
| 38 | 600754 | 锦江股份 | 19,089,875.75 | 3.91 |
| 39 | 002027 | 分众传媒 | 18,868,208.57 | 3.86 |
| 40 | 300362 | 天翔环境 | 18,546,557.72 | 3.80 |
| 41 | 300426 | 唐德影视 | 18,460,305.66 | 3.78 |
| 42 | 601989 | 中国重工 | 18,458,530.00 | 3.78 |
| 43 | 600079 | 人福医药 | 18,373,666.93 | 3.76 |
| 44 | 300365 | 恒华科技 | 17,716,494.34 | 3.63 |
| 45 | 002614 | 奥佳华 | 17,555,995.31 | 3.59 |
| 46 | 002294 | 信立泰 | 16,952,729.36 | 3.47 |
| 47 | 603006 | 联明股份 | 16,930,775.88 | 3.47 |
| 48 | 300098 | 高新兴 | 16,835,008.52 | 3.45 |
| 49 | 600089 | 特变电工 | 16,729,448.34 | 3.42 |
| 50 | 600766 | 园城黄金 | 16,656,300.00 | 3.41 |
| 51 | 002609 | 捷顺科技 | 16,628,663.57 | 3.40 |
| 52 | 002174 | 游族网络 | 15,890,466.06 | 3.25 |
| 53 | 300383 | 光环新网 | 15,505,355.00 | 3.17 |
| 54 | 002051 | 中工国际 | 15,039,717.44 | 3.08 |

| | | | | |
|----|--------|--------|---------------|------|
| 55 | 600977 | 中国电影 | 14,065,354.53 | 2.88 |
| 56 | 300315 | 掌趣科技 | 13,847,551.74 | 2.83 |
| 57 | 002273 | 水晶光电 | 13,286,468.92 | 2.72 |
| 58 | 002196 | 方正电机 | 13,142,887.43 | 2.69 |
| 59 | 601818 | 光大银行 | 13,072,250.00 | 2.68 |
| 60 | 300124 | 汇川技术 | 13,025,182.58 | 2.67 |
| 61 | 601595 | 上海电影 | 11,162,136.00 | 2.28 |
| 62 | 000905 | 厦门港务 | 10,791,841.00 | 2.21 |
| 63 | 601628 | 中国人寿 | 10,779,119.00 | 2.21 |
| 64 | 603626 | 科森科技 | 10,710,804.00 | 2.19 |
| 65 | 000100 | TCL 集团 | 10,635,864.00 | 2.18 |
| 66 | 000049 | 德赛电池 | 10,367,953.84 | 2.12 |
| 67 | 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 | 600297 | 广汇汽车 | 58,912,222.25 | 12.06 |
| 2 | 002766 | 索菱股份 | 54,628,446.26 | 11.18 |
| 3 | 000058 | 深赛格 | 45,799,282.49 | 9.38 |
| 4 | 002138 | 顺络电子 | 45,498,710.84 | 9.31 |
| 5 | 300038 | 梅泰诺 | 44,975,642.20 | 9.21 |
| 6 | 300525 | 博思软件 | 44,012,612.86 | 9.01 |
| 7 | 002655 | 共达电声 | 43,567,067.22 | 8.92 |
| 8 | 600399 | 抚顺特钢 | 43,550,756.59 | 8.92 |
| 9 | 603703 | 盛洋科技 | 43,110,825.54 | 8.83 |
| 10 | 002617 | 露笑科技 | 41,851,740.60 | 8.57 |
| 11 | 300118 | 东方日升 | 39,590,431.45 | 8.10 |
| 12 | 300071 | 华谊嘉信 | 39,104,844.98 | 8.01 |
| 13 | 300456 | 耐威科技 | 37,424,630.01 | 7.66 |
| 14 | 300236 | 上海新阳 | 37,129,264.04 | 7.60 |
| 15 | 600809 | 山西汾酒 | 36,036,034.92 | 7.38 |
| 16 | 002419 | 天虹股份 | 34,521,667.50 | 7.07 |
| 17 | 002353 | 杰瑞股份 | 33,403,090.39 | 6.84 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 18 | 600884 | 杉杉股份 | 32,199,885.49 | 6.59 |
| 19 | 002343 | 慈文传媒 | 32,095,114.90 | 6.57 |
| 20 | 000425 | 徐工机械 | 32,041,733.85 | 6.56 |
| 21 | 603716 | 塞力斯 | 31,654,140.04 | 6.48 |
| 22 | 000980 | 众泰汽车 | 30,378,402.86 | 6.22 |
| 23 | 601699 | 潞安环能 | 30,114,898.35 | 6.16 |
| 24 | 600031 | 三一重工 | 29,977,282.99 | 6.14 |
| 25 | 300473 | 德尔股份 | 29,933,328.79 | 6.13 |
| 26 | 601369 | 陕鼓动力 | 28,187,195.22 | 5.77 |
| 27 | 300348 | 长亮科技 | 27,672,843.57 | 5.66 |
| 28 | 002094 | 青岛金王 | 27,212,837.54 | 5.57 |
| 29 | 002543 | 万和电气 | 26,347,353.86 | 5.39 |
| 30 | 603979 | 金诚信 | 26,121,631.20 | 5.35 |
| 31 | 002434 | 万里扬 | 25,265,384.10 | 5.17 |
| 32 | 000960 | 锡业股份 | 24,134,466.10 | 4.94 |
| 33 | 300433 | 蓝思科技 | 23,528,630.40 | 4.82 |
| 34 | 300567 | 精测电子 | 22,765,185.67 | 4.66 |
| 35 | 002813 | 路畅科技 | 22,113,071.67 | 4.53 |
| 36 | 600718 | 东软集团 | 21,719,067.97 | 4.45 |
| 37 | 000959 | 首钢股份 | 20,363,533.79 | 4.17 |
| 38 | 002356 | 赫美集团 | 19,978,494.04 | 4.09 |
| 39 | 600702 | 舍得酒业 | 19,276,209.37 | 3.95 |
| 40 | 600188 | 兖州煤业 | 18,918,754.67 | 3.87 |
| 41 | 300362 | 天翔环境 | 18,860,045.30 | 3.86 |
| 42 | 600754 | 锦江股份 | 18,797,185.86 | 3.85 |
| 43 | 002027 | 分众传媒 | 18,542,066.00 | 3.80 |
| 44 | 300426 | 唐德影视 | 18,203,201.75 | 3.73 |
| 45 | 002614 | 奥佳华 | 17,789,708.84 | 3.64 |
| 46 | 600079 | 人福医药 | 17,115,645.78 | 3.50 |
| 47 | 300365 | 恒华科技 | 16,683,377.16 | 3.42 |
| 48 | 002101 | 广东鸿图 | 16,611,779.13 | 3.40 |
| 49 | 603006 | 联明股份 | 16,497,988.84 | 3.38 |
| 50 | 601989 | 中国重工 | 16,044,833.72 | 3.28 |
| 51 | 002609 | 捷顺科技 | 16,017,973.40 | 3.28 |
| 52 | 002174 | 游族网络 | 15,868,383.16 | 3.25 |
| 53 | 600766 | 园城黄金 | 15,840,654.66 | 3.24 |
| 54 | 300385 | 雪浪环境 | 14,971,832.62 | 3.06 |
| 55 | 002273 | 水晶光电 | 14,658,959.84 | 3.00 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 56 | 300315 | 掌趣科技 | 14,367,389.86 | 2.94 |
| 57 | 600089 | 特变电工 | 14,141,009.43 | 2.89 |
| 58 | 002384 | 东山精密 | 13,674,581.47 | 2.80 |
| 59 | 600977 | 中国电影 | 13,296,333.67 | 2.72 |
| 60 | 300124 | 汇川技术 | 13,116,893.73 | 2.69 |
| 61 | 601818 | 光大银行 | 12,757,500.00 | 2.61 |
| 62 | 300098 | 高新兴 | 12,564,783.34 | 2.57 |
| 63 | 002635 | 安洁科技 | 12,124,846.50 | 2.48 |
| 64 | 002051 | 中工国际 | 11,683,310.89 | 2.39 |
| 65 | 603626 | 科森科技 | 11,455,757.00 | 2.35 |
| 66 | 601595 | 上海电影 | 11,293,165.00 | 2.31 |
| 67 | 002196 | 方正电机 | 11,149,930.12 | 2.28 |
| 68 | 601628 | 中国人寿 | 11,038,654.00 | 2.26 |
| 69 | 600566 | 济川药业 | 10,854,074.36 | 2.22 |
| 70 | 600498 | 烽火通信 | 10,832,773.97 | 2.22 |
| 71 | 300364 | 中文在线 | 10,741,742.47 | 2.20 |
| 72 | 000049 | 德赛电池 | 10,589,199.20 | 2.17 |
| 73 | 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。

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 | 1,799,241,789.94 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 2,001,729,556.43 |

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

本基金本报告期末未投资国债期货。

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。

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 | 397,447.49 |
| 2 | 应收证券清算款 | 2,057,888.50 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 6,154.58 |
| 5 | 应收申购款 | 161,319.26 |
| 6 | 其他应收款 | - |

| | | |
|---|------|--------------|
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 2,622,809.83 |

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 | 300383 | 光环新网 | 12,120,000.00 | 5.15 | 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 | 3,599 | 14,437.18 | - | - | 51,959,394.67 | 100.00% |
| 宝盈睿丰创新混合 C | 10,338 | 14,479.42 | 8.22 | 0.00% | 149,688,237.83 | 100.00% |
| 合计 | 13,937 | 14,468.51 | 8.22 | 0.00% | 201,647,632.50 | 100.00% |

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 | 1,804.89 | 0.0035% |
| | 宝盈睿丰创新混合 C | 25,819.11 | 0.0172% |

| | | | |
|--|----|-----------|---------|
| | 合计 | 27,624.00 | 0.0137% |
|--|----|-----------|---------|

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 | 15,919,994.97 | 121,591,284.26 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 49,678,025.20 | 241,608,337.26 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 51,959,394.67 | 149,688,246.05 |

§ 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) 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。

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 60,000 元，目前事务所已连续 4 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 | 3,796,361,379.77 | 100.00% | 3,459,623.98 | 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、席位变更情况

本基金本报告期内无租用和退租交易单元。

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

2018 年 3 月 31 日