宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金

2015年度报告摘要

2015年12月31日

基金管理人：宝盈基金管理有限公司
基金托管人：广发证券股份有限公司
送出日期：2016年3月26日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人广发证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年3月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

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）为本基金财务会计报告出具了标准无保留意见的审计报告，基金管理人在本报告中对相关事项亦有详细说明，请投资者注意阅读。

本报告期自2015年1月1日起至12月31日止。

§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	590,768,588.29份
基金合同存续期	不定期
下属分级基金的基金简称：	宝盈睿丰创新混合A/B　宝盈睿丰创新混合C
下属分级基金的交易代码：	000794　000796
下属分级基金的前端交易代码	000794　–
下属分级基金的后端交易代码	000795　–
报告期末下属分级基金的份额总额	106,885,196.14份　483,883,392.15份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过相对灵活的资产配置，重点关注具备持续创新能力的上市公司，在严格控制风险的前提下，谋求基金资产的长期，稳定增值。
投资策略	本基金的投资策略分为两个层面：首先，依据基金管理人的大类资产配置策略动态调整基金资产在各大类资产间的分配比例；而后，进行多大类资产中的个股、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	张珊	王玮
	联系电话	0755-83276688	020-87516888-60162
	电子邮箱	zhangshan@byfunds.com	wwos@gf.com.cn
客户服务电话		400-8888-300	–
传真		0755-83516599	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	2015年		2014年9月26日(基金合同生效日)-2014年12月31日	
	宝盈睿丰创新混合A/B	宝盈睿丰创新混合C	宝盈睿丰创新混合A/B	宝盈睿丰创新混合C
本期已实现收益	17,966,692.25	-156,759,648.00	3,208,148.80	18,306,710.27
本期利润	-234,300,999.35	149,204,891.33	2,067,709.21	16,569,454.16
加权平均基金份额本期利润	-0.3751	0.2657	0.0257	0.0291
本期基金份额净值增长率	82.30%	69.92%	1.70%	1.40%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末		2014年末	
期末可供分配基金份额利润	-0.3186	-0.3180	0.0171	0.0139
期末基金资产净值	198,106,943.23	833,689,512.99	70,089,490.00	427,968,239.87
期末基金份额净值	1.853	1.723	1.017	1.014

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	43.98%	2.40%	11.34%	1.08%	32.64%	1.32%
过去六个月	17.16%	3.82%	-9.27%	1.74%	27.22%	2.08%
过去一年	82.20%	2.84%	6.94%	1.61%	75.26%	1.23%
自基金合同生效起至今	85.30%	2.61%	37.30%	1.52%	48.00%	1.09%

宝盈睿丰创新混合C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	43.46%	2.40%	11.34%	1.08%	32.12%	1.32%
过去六个月	16.52%	3.85%	-9.27%	1.74%	19.79%	2.11%
过去一年	69.92%	2.87%	6.94%	1.61%	62.98%	1.26%
自基金合同生效起至今	72.30%	2.63%	37.30%	1.52%	35.00%	1.11%

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

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金合同生效不足3年，至报告期末未进行利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人：宝盈基金管理有限公司是2001年按照证监会“新的治理结构、新的内控体系”标准设立的首批基金管理公司之一，2001年5月10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46只，宝盈鸿利收益混合、宝盈资源优选混合、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、宝盈转型动力混合、宝盈资源先锋灵活配置混合、宝盈年年丰收债券、宝盈先进制造混合、宝盈新兴产业混合、宝盈策略混合、宝盈中证100指数增强A、宝盈医疗健康沪港深股票、宝盈国家安全沪港深股票二十一只基金，公司将守护信仰投资的投资理念，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，公司形成了“研究员－基从事宏观经济、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		
彭敏	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、宝盈祥瑞养老混合型证券投资基金、宝盈新兴产业混合型证券投资基金、宝盈策略混合型证券投资基金、宝盈新经济混合型证券投资基金的基金经理；总经理助理；投资部总监	2014年9月26日	–	14年	彭敏先生，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，万家证券有限责任公司研发中心，财富证券有限责任公司从事投资研究工作。2010年9月起任职于宝盈基金管理有限公司投资部，中国国籍，证券投资基金从业人员资格。
易作兴	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	–	4年	易作兴先生，浙江大学计算机应用硕士，历任浙江大学软件资产集团产业整合及投资经理、中投证券资产管理部专户投资经理/研究员。2014年11月起加入宝盈基金管理有限公司任研究员，基金经理助理，中国国籍，证券投资基金从业人员资格。

注：1.本基金基金经理为首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写；
2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定，证券从业年限的计算截至2015年12月31日。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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，尤其是同一位投资经合给投资管理的不同投资组合同日同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行监控，同时对不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析评估，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，并记期特价平交易分析报告，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投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年股票市场走势波澜壮阔，上半年呈现创业板带动中小板，主板快速上涨行情，6则8月份又快速回落，9月后则年底又企稳反弹；全年，上证指数涨幅9.41%，沪深300涨幅5.58%，创成指涨幅14.96%，同期，创业板指数涨幅84.41%，中小板指数涨幅为53.7%；整体来看中小板、创业板在2015年呈现牛市特征。本基金在2015年实现收益显著高于比较基准，为基金持有人获取了较为丰厚的收益。

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

从改革开放三十多年的经济发展历程来看，不要去预测政府对发展经济作为第一要务的决心，也不要去轻易判断经济会断崖式下跌或者硬着陆等，我们需要积极的去适应当前经济转型的新常态，需要有耐心的寻找产业转型的方向和政府影响转变至积极的机遇。总之，我们始终抱持变革的前行代，必然伴随着社会行为及市场主体发生着相应的改动行为，我们相信当前的一切艰苦可以是一个探索的自然净化过程，我们需要的是一种坚持的信念。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

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

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

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

从我们分析来看，A股经历了三年的牛市上升通道，主要核心逻辑主要在如下几点：（1）中国的经济结构正在发生近30年来前所未有的变化，新技术、新商业模式的出现正在改变生产和生活方式，并且这种变化将在未来很长的时间内持续，在注册制改革开始以后，通过廉价整合及鼓励上市等资本运作方式给市场带来了不少新股，新龙头和大幅投资热点，市场参与热情高涨，新增资金入市积极，在我们看来，这三年A股市场赚钱者这个时代的财富特征，这种需要新增长，虽然市场整体进行调序新进的改革尝试，但是新一代的企业家和主动适合时代发展趋势的企业家正在成为市场新的主力龙头，互联网金融、数字营销、新媒体、机器人等都从市场走进概念变成了较为成熟的板块，带来了巨大的财富效应和社会效应；我们坚信一个大时代的变迁不会是短期三年能完成变迁的，从国外发达经济体的转型之路来看也是一个较为长期充满波折的长期过程，在过去的2015年经历了被阐杠调的疯跌行情，从另一种角度也可以体现为大变革时代的一种显著特征。

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

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

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

目前来看，市场的悲观因素反应较为充分，而市场积极的因素在累积，即G20会议带来的全球宏观政策的协调，美联储加息政策的变化，两会前后十三五规划的讨论，国家以信给铜改革为核心的国有企业改革措施的落实等等，所以在目前阶段，虽然市场信心较弱，但在经历多次下跌后，市场目前所处的位置具有较好的风险收益比，即使从市场波动来看，考虑到目前市场与历史较低比较和对偏低的位置，个人判断今年仍然存在一轮趋势性上涨的机会，投资的热点可能集中在周期性股票的博弈机会，国企改革带来的国企控股优质公司的变革，成长股方面，体育传媒等新兴消费服务业，以云计算大数据为核心的科技产业，以VR等技术变革为中心的新技术产业会有持续的盈利机会。

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

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

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

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

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照新会计准则，中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金持有的投资品种进行估值。会计师事务所就我司所采用的相关估值模型，假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。基金托管人负责对基金管理公司采用的估值政策和程序进行核查，并对估值结果及净值计算进行复核。

本基金管理人设立估值工作小组，由投资部、研究部、固定收益部、专户投资部、量化投资部、监察稽核部等门人员组成。相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历。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，公允反映，估值政策和程序经定收益展，专户投资部负责定期对投资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调整；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。本基金未提变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，完全采取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，在各个重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本报告期内，宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对宝盈基金管理有限公司编制和披露的宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金2015年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

本基金2015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(2016)第22197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：2015年12月31日

单位：人民币元

资 产	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
资 产：		
银行存款	76,854,432.44	13,962,152.85
结算备付金	3,973,929.30	707,492.79
存出保证金	3,646,508.00	1,114,936.26
交易性金融资产	964,358,164.58	488,180,670.79
其中：股票投资	964,358,164.58	461,323,140.79
基金投资	–	–
债券投资	–	26,857,530.00
资产支持证券投资	–	–
贵金属投资	–	–
衍生金融资产	–	–
买入返售金融资产	–	–
应收证券清算款	58,735.98	6,550,575.21
应收利息	19,336.24	857,326.26
应收股利	–	–
应收申购款	9,560,669.75	2,858,329.57
递延所得税资产	–	–
其他资产	–	–
资产总计	1,058,470,766.29	513,821,483.73
负债和所有者权益	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
负 债：		
短期借款	–	–
交易性金融负债	–	–
衍生金融负债	–	–
卖出回购金融资产款	–	–
应付证券清算款	8,675,811.62	8,222,989.85
应付赎回款	3,566,192.08	5,422,133.17
应付管理人报酬	1,263,135.98	685,035.57
应付托管费	210,522.66	114,172.61
应付销售服务费	533,372.03	313,909.93
应付交易费用	2,273,380.38	918,002.01
应交税费	–	–
应付利息	–	–
应付利润	–	–
递延所得税负债	–	–
其他负债	172,895.32	87,531.02
负债合计	26,694,310.07	16,763,753.16
所有者权益：		
实收基金	590,768,588.29	491,029,919.91
未分配利润	441,007,867.93	7,027,809.96
所有者权益合计	1,031,776,456.22	498,057,729.87
负债和所有者权益总计	1,058,470,766.29	513,821,483.73

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

7.2 利润表

会计主体：宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015年1月1日至2015年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年9月26日(基金合同生效日)至2014年12月31日
一、收入	-34,321,916.84	24,915,354.10
1.利息收入	9,399,407.17	676,971.35
其中：存款利息收入	3,994,129.14	361,414.81
债券利息收入	3,078,583.50	121,708.10
资产支持证券利息收入	–	–
买入返售金融资产收入	2,326,685.23	193,848.37
其他利息收入	–	–
2.投资收益（损失以“-”填列）	-123,060,736.19	26,682,891.46
其中：股票投资收益	-93,252,329.96	26,537,913.63
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	2,292,348.11	114,977.82
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	53,706,848.73	-2,877,695.79
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	–	–
5.其他收入（损失以“-”号填列）	25,032,562.75	463,087.00
减：二、费用	50,774,191.18	6,278,089.03
1. 管理人报酬	27,198,448.96	2,750,733.20
2. 托管费	4,533,074.84	458,455.54
3. 销售服务费	6,635,383.19	1,292,794.67
4. 交易费用	11,819,614.14	1,622,095.72
5. 利息支出	208,670.06	18,111.60
其中：卖出回购金融资产支出	208,670.06	18,111.60
6. 其他费用	379,000.00	135,900.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-85,096,108.02	18,637,163.37
减：所得税费用	–	–
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-85,096,108.02	18,637,163.37

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015年1月1日至2015年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	491,029,919.91	7,027,809.96	498,057,729.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	–	-85,096,108.02	-85,096,108.02
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	99,738,668.38	519,076,165.99	618,814,834.37
其中：1.基金申购款	5,977,102,737.73	3,245,892,614.67	9,222,995,352.40
2.基金赎回款	-5,877,364,069.35	-2,726,816,448.68	-8,604,180,520.03
四、本期向持基份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	–	–	–
五、期末所有者权益（基金净值）	590,768,588.29	441,007,867.93	1,031,776,456.22
项目	上年度可比期间 2014年9月26日基金合同生效日至2014年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	861,446,781.93	–	861,446,781.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	–	18,637,163.37	18,637,163.37
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-370,416,862.02	-11,609,353.41	-382,026,215.43
其中：1.基金申购款	112,609,866.76	3,260,206.22	115,870,072.98
2.基金赎回款	-483,026,728.78	-14,869,559.63	-497,896,288.41
四、本期向持基份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	–	–	–
五、期末所有者权益（基金净值）	491,029,919.91	7,027,809.96	498,057,729.87

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

_____汪钦_____　_____胡坤_____　_____何敏_____

基金管理人负责人　主管会计工作负责人　会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会以下简称“中国证监会”证监许可[2014]885号《关于核准宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》核准，由宝盈基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集861,446,781.93元，业经普华永道中天会计师事务所特殊普通合伙）普华永道中天验字(2014)第1469号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2014年9月26日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为861,446,781.93份基金份额。本基金的基金管理人为宝盈基金管理有限公司，基金托管人为广发证券股份有限公司。

根据《宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书》并报中国证监会备案，本基金根据认购/申购费用、赎回费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取前端认购/申购费用，赎回时收取赎回费用的，称为A类基金份额；在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用，赎回时收取赎回费用并从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为C类基金份额。本基金A/B类基金份额和C类基金份额分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额，但各类别基金份额之间不能相互转换。

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

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后颁布颁布的《企业会计准则－基本准则》、各项具体会计准则及相关规定以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第39号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金协会以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

7.4.4 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

7.4.4.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.4.2 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外），基于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息，本基金本报告期改为采用中证指数有限公司提供的证券估值全收益价格作为估值日相关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准）所独立提供的估值结果确定公允价值。