宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金 2018年年度报告摘要

2018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:2019年3月29日

§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2019年3月28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2018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	179,546,790.76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	44,479,558.69份	135,067,232.07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	020-66338888
	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	2018年		2017年		2016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	-13,497,239.40	-38,398,615.57	-20,614,845.07	-73,475,359.18	-25,733,965.06	-93,387,723.64
本期利润	-9,482,853.23	-26,383,257.18	-15,048,334.06	-45,131,189.67	-33,805,748.81	-179,857,453.24
加权平均基金份额本期利润	-0.2126	-0.1958	-0.2275	-0.2040	-0.3203	-0.5200
本期基金份额净值增长率	-17.44%	-17.98%	-14.68%	-15.43%	-21.32%	-21.76%
3.1.2 期末数据和指标	2018年末		2017年末		2016年末	
期末可供分配基金份额利润	-1.1216	-1.1504	-0.8204	-0.8681	-0.5612	-0.6184
期末基金资产净值	45,686,366.23	126,229,998.21	64,657,474.26	170,698,010.96	125,006,095.37	363,490,045.66
期末基金份额净值	1.027	0.935	1.244	1.140	1.458	1.348

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

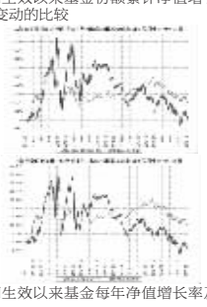
宝盈睿丰创新混合A/B

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	-6.12%	2.13%	-7.47%	1.06%	1.35%	1.07%
过去六个月	-12.97%	1.99%	-8.40%	0.97%	-4.57%	1.02%
过去一年	-17.44%	1.89%	-15.47%	0.87%	-1.97%	1.02%
过去三年	-44.58%	1.82%	-12.10%	0.77%	-32.48%	1.05%
自基金合同生效起至今	2.70%	2.08%	20.68%	1.05%	-17.98%	1.03%

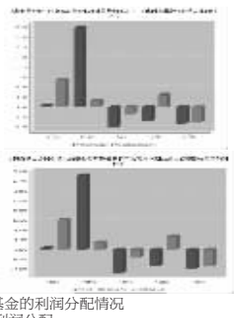
宝盈睿丰创新混合C

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	-6.22%	2.14%	-7.47%	1.06%	1.25%	1.08%
过去六个月	-13.18%	2.00%	-8.40%	0.97%	-4.78%	1.03%
过去一年	-17.98%	1.89%	-15.47%	0.87%	-2.51%	1.02%
过去三年	-45.73%	1.82%	-12.10%	0.77%	-33.63%	1.05%
自基金合同生效起至今	-6.50%	2.09%	20.68%	1.05%	-27.18%	1.04%

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



3.2.3 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



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)、宝盈盈泰纯债债券、宝盈人工智能股票、宝盈安泰短债债券二十五只基金,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	本基金基金经理	2017年1月5日	–	8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、宝盈策略增长混合型证券投资基金基金经理。中国国籍,证券投资基金从业人员资格。
杨思亮	本基金、宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2018年3月3日	–	7年	杨思亮先生,中央财经大学国际金融硕士。2011年6月至2014年4月在大成基金管理有限公司研究部担任研究员;2014年4月至2015年4月在大成创新资本管理有限公司专户投资部担任投资经理助理;2015年4月加入宝盈基金管理有限公司,先后担任研究部研究员、专户投资部投资经理助理。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;

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2018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组合同日同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行监控, 同时对不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析,形成《公平交易分析报告》,并要求相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释。

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

2018年A股市场呈现典型的熊市特征,主要指数跌幅明显,上证综指/中小板指/创业板指累计下跌24.6%/37.8%/28.7%。内外交困的环境下,三座大山将A股拖入了熊市,去杠杆收缩了市场流动性且恶化了市场微观结构,贸易战爆发打击了市场对中国科技产业长期未来的信心, 宏观经济下行预期又恶化了企业的盈利前景。从行业层面,无论是以食品饮料、家电为代表的消费板块,还是弱周期的医药、军工、传媒等板块,或有基本面利空,或有行业政策扰动,持续调整。银行、地产、券商、周期等经济敏感型行业跌幅明显,在质押融资高压下,部分券商甚至跌破净资产。弱势环境中,亮点在部分科技成长龙头,如医疗信息化、云计算、创新药服务产业链,走出了相对独立的向好行情,符合我们年初展望中对于未来创新主导方向的认识和判断。

本基金基于长期视野,重点投资方向为具备持续创新能力的上市公司。在相对景气度较好的细分子行业中寻找基本面优异的上市公司长期持有,是本基金主要策略。本报告期内我们仍然延续前期的配置思路,重点持仓个股分布于医疗信息化龙头、云计算互联网、创新药产业链、新能源汽车中游等方向。从市场表现来看,这些方向的个股表现强劲。需要反思的是,虽然在年度展望中,本基金管理人对宏观层面的风险因素予以高度关注,对18年复杂的海外贸易和货币环境做出了相对谨慎的预测, 但对于政策错判和超调的可能性仍然估计不足。即使选择的板块和龙头个股相对强势,基金表现超越指数和基准,但不可避免依然受到系统性风险的拖累,未能给持有人带来正收益。

从长期来看,我们仍然相信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增长,消费代际更迭,勇于在产品研发、商业模式、业务形态上锐意创新、提升能力的企业,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,具备长期投资价值。特别是在这一轮大洗牌后,优质的龙头公司将享受行业集中度上升红利。

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1.027元, 本报告期基金份额净值增长率为-17.44%;截至本报告期末宝盈睿丰创新混合C基金份额净值为0.935元,本报告期基金份额净值增长率为-17.98%;同期业绩比较基准收益率为-15.47%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望19年,我们在18年四季报中已经明确提出:不同于市场预期,19年反而是确定性向好的一年, 各种利空已经充分反映, 宏观经济预期趋于明确,市场将告别动荡与波折。

宏观经济方面,我们认为18年经济下行既有周期性原因,更有结构性原因。在流动性紧缩、产业政策变动、贸易战冲击、需求前景不确定的压制下,经济内生动力可能是被压制的。随着流动性总体宽松、地方政府融资条件缓和、基建对冲、产业政策落地的驱动和外围环境的改善,19年宏观经济运行并不一定会按照市场预期的方向下行,更多可能是总体趋稳、预期明确的态势。

证券市场方面,我们倾向于市场将告别18年的单边下跌,迎来结构性向好的行情,不可否认的是,18年A股市场的结构恶化对实体经济形成了一定的拖累, 既不利于发挥资本市场直接融资、为产业升级优化资源配置的功能,也不利于社会整体的消费与投资。放松资本市场管制、鼓励金融企业为民营企业融资、推出科创板, 政策已经为证券市场的定位和未来指明了方向。

行业走势方面,我们认为在经济趋稳、流动性宽松的大背景下,市场机会是多维的,对经济趋稳敏感的部分周期性行业、受益于财富效应和消费升级的新兴消费、迎来创新周期的科技行业,都会有不错的表现。

经过本轮冲击,全社会从上至下更加意识到创新的至关重要,创新将是未来成就伟大企业最重要的基因之一,由此带来的政策倾斜和资源集中,创新性龙头企业将具备长期的投资价值。本基金主要的投资方向坚持于基于产业逻辑寻找创新方向的成长龙头,因此,我们不会盲目追逐市场热点,坚持创新方向长期持股,仍然集中于医疗信息化龙头、云计算互联网、创新药产业链、人工智能和金融科技龙头、具备全球竞争力的CDMO龙头和新能源汽车中游等方向。同时,根据经济环境的变化,适当配置可选消费龙头、具备行业龙头地位的周期龙头, 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2018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2018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(2019)第20995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: 2018年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
资 产:		
银行存款	11,876,606.91	31,222,233.78
结算备付金	345,177.31	36,661.66
存出保证金	163,244.12	397,447.49
交易性金融资产	159,040,641.79	207,280,732.56
其中:股票投资	159,040,641.79	207,280,732.56
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	2,085,819.32	2,057,888.50
应收利息	3,947.69	6,154.58
应收股利	–	–
应收申购款	102,495.94	161,319.26
递延所得税资产	–	–
其他资产	–	–
资产总计	173,617,933.08	241,162,437.83
负债和所有者权益	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017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	893,441.15	3,332,784.28
应付赎回款	77,951.63	1,495,052.57
应付管理人报酬	221,522.57	305,061.06
应付托管费	36,920.43	50,843.48
应付销售服务费	86,469.17	117,642.71
应付交易费用	225,258.05	344,847.32
应交税费	–	–
应付利息	–	–
应付利润	–	–
递延所得税负债	–	–
其他负债	160,005.64	160,721.19
负债合计	1,701,568.64	5,806,952.61
所有者权益:		
实收基金	179,546,790.76	201,647,640.72
未分配利润	-7,630,426.32	33,707,844.50
所有者权益合计	171,916,364.44	235,355,485.22
负债和所有者权益总计	173,617,933.08	241,162,437.83

注:报告截止日2018年12月31日,基金份额总额179,546,790.76份,其中A/B类基金份额净值为1.027元, 基金份额为44,479,558.69份;C类基金份额净值为0.935元,基金份额为135,067,232.07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:2018年1月1日至2018年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
一、收入	-29,400,934.02	-45,546,416.25
1.利息收入	133,448.40	290,889.02
其中:存款利息收入	133,448.40	290,889.02
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)	-45,854,041.19	-80,044,127.78
其中:股票投资收益	-47,052,189.44	-82,098,443.44
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	1,198,148.25	2,054,315.66
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	16,029,744.56	33,910,680.52
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	–	–
5.其他收入(损失以“-”号填列)	289,914.21	296,141.99
减:二、费用	6,465,176.39	14,633,107.48
1. 管理人报酬	2,895,286.11	5,388,465.33
2. 托管费	482,547.68	898,077.53
3. 销售服务费	1,133,075.49	2,170,236.38
4. 交易费用	1,576,067.11	5,798,128.24
5. 利息支出	–	–
其中:卖出回购金融资产支出	–	–
6. 税金及附加	–	–
7. 其他费用	378,200.00	378,200.00
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-35,866,110.41	-60,179,523.73
减:所得税费用	–	–
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	-35,866,110.41	-60,179,523.73

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:2018年1月1日至2018年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018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)	201,647,640.72	33,707,844.50	235,355,485.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	-35,866,110.41	-35,866,110.41
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)	-22,100,849.96	-5,472,160.41	-27,573,010.37
其中:1.基金申购款	84,820,667.73	3,429,715.72	88,250,383.45
2.基金赎回款	-106,921,517.69	-8,901,876.13	-115,823,393.82
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)	179,546,790.76	-7,630,426.32	171,916,364.44
项目	上年度可比期间 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

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:

_____杨凯_____ _____彭玖雯_____ _____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

7.4 报表附注

7.4.1 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。

7.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.2.1 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。

7.4.2.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无须说明的会计估计变更。

7.4.2.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须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[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》、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》、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》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 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。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。

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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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 2018年1月1日至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	1,044,844,848.27	100.00%	3,796,361,379.77	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 2018年1月1日至2018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	962,164.23	100.00%	225,258.05	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 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%

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 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,895,286.11	5,388,465.33
其中:支付销售机构的客户维护费	1,292,016.62	2,120,417.32

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 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	482,547.68	898,077.53

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 2018年1月1日至2018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	–	74,952.08	74,952.08
广发证券	–	535,460.97	535,460.97
合计	–	610,413.05	610,413.05
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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

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

无。

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

无。

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

无。

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 2018年1月1日至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	11,876,606.91	122,273.86	31,222,233.78	245,895.78

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

无。

7.4.5.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.6 期末(2018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

无。

7.4.6.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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

无。

7.4.6.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.7 有助于理解和分析会计