宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金

【2014】年度报告摘要

基金管理人:宝盈基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
送出日期:2015年3月28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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年3月27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2014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	宝盈核心优势混合	
基金主代码	213006	
交易代码	213006	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2009年3月17日	
基金管理人	宝盈基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	4,949,278,284.37份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称;	宝盈核心优势混合A	宝盈核心优势混合C
下属分级基金的交易代码;	213006	000241
报告期末下属分级基金的份额总额	4,793,114,116.67份	156,164,167.70份

2.2 基金产品说明

投资目标	基于中国经济处于宏观变革期以及对资本市场未来持续、健康增长的预期,本基金根据研究部的估值模型,选出各个行业中具有竞争优势、具有领先优势、具有技术优势、具有垄断优势、具有管理优势的龙头企业,建立股票池。在基于各行业配置相对均衡的基础上,对于景气度提高的行业给予适当倾斜,以构造出相对均衡的不同风格类资产组合,同时结合公司调研、行业布局、风险因子等深入分析,对资产配置进行适度调整,努力控制投资组合的市场适应性,在严格控制投资风险的前提下保持基金资产持续增值,并力争创造超越业绩基准的主动管理回报。
投资策略	1.资产配置策略 本基金根据宏观经济运行状况、财政、货币政策、国家产业政策及证券监管政策调整情况、市场资金环境等因素,决定股票、债券及现金的配置比例。 2.股票投资策略 根据公司的基本面情况,根据研究部的估值模型,选出各个行业中具有竞争优势、具有领先优势、具有技术优势、具有垄断优势、具有管理优势的企业,建立股票池。本基金在构建投资组合时,强调两端投资,价值与成长性能平衡,兼顾价值与成长型股票,以均衡资产混合策略建立动力资产组合,努力克服单一风格投资所带来的局限性,这样可以较好规避组合市场适应性、一定程度上能够排除对景气误判概率,以求多空环境中都能创造主动管理回报。 3.债券投资策略 本基金的债券投资采取主动投资策略,运用利率预测、久期管理、收益率曲线预测、相对价值评估、收益率利差策略、套利交易策略以及利用正逆回购进行杠杆操作等积极的投资策略,力求获得超过债券市场的收益。
业绩比较基准	沪深300指数×65%+上证国债指数×35%
风险收益特征	本基金是一只灵活配置混合型基金,属于证券投资基金中的较高风险较高收益品种,本基金的风险与预期收益都要低于股票型基金,高于保本基金和债券型基金。按照风险收益配比原则对投资组合进行严格的风险管理,在风险预算范围内追求收益最大化。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张瑾	王永民
	联系电话	0755-83276688	010-66594896
	电子邮箱	zhangj@byfunds.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-8888-300	95566
传真		0755-83515999	010-66594942

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、基金托管人住所

§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	2014年		2013年		2012年
	宝盈核心优势混合A	宝盈核心优势混合C	宝盈核心优势混合A	宝盈核心优势混合C	宝盈核心优势混合A
本期已实现收益	1,358,988,274.22	38,323,774.46	226,491,190.90	237,009.67	-5,389,600.12
本期利润	2,148,789,015.90	55,282,138.26	258,785,808.26	89,822.78	1,358,655.48
加权平均基金份额本期利润	0.7500	0.6896	0.3059	0.0299	0.0125
本期基金份额净值增长率	80.11%	77.98%	56.40%	8.56%	-0.01%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末		2013年末		2012年末
期末可供分配基金份额利润	0.1977	0.1926	0.0257	0.0251	-0.3015
期末基金资产净值	7,206,242,829.54	233,748,101.27	1,687,923,175.53	7,489,924.96	89,351,929.39
期末基金份额净值	1.5035	1.4968	1.0467	1.0461	0.6985
3.1.3 累计期末指标	2014年末		2013年末		2012年末
基金份额累计净值增长率	136.97%	93.22%	31.56%	8.56%	-15.88%

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。
4.基金于2013年8月1日起增加收取销售服务费的C类收费模式,其对应的基金份额简称"宝盈核心优势混合C"。

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

宝盈核心优势混合A

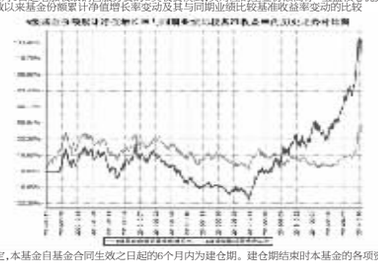
3.1.1 期间数据和指标	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	28.12%	1.54%	27.75%	1.07%	0.37%	0.47%
过去六个月	56.65%	1.25%	39.10%	0.86%	17.55%	0.39%
过去一年	80.11%	1.31%	33.64%	0.79%	46.47%	0.52%
过去三年	181.66%	1.26%	37.23%	0.84%	144.43%	0.42%
过去五年	96.75%	1.22%	8.24%	0.88%	88.51%	0.34%
自基金合同生效起至今	136.97%	1.22%	48.48%	0.95%	88.49%	0.27%

宝盈核心优势混合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	27.87%	1.54%	27.75%	1.07%	0.12%	0.47%
过去六个月	55.85%	1.25%	39.10%	0.86%	16.75%	0.39%
过去一年	77.98%	1.31%	33.64%	0.79%	44.34%	0.52%
自基金合同生效起至今	93.22%	1.36%	37.50%	0.77%	55.72%	0.59%

注:本基金于2013年8月1日起增加收取销售服务费的C类收费模式,其对应的基金份额简称"宝盈核心优势混合C"。

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



注:1.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。
2.本基金于2013年8月1日起增加收取销售服务费的C类收费模式,其对应的基金份额简称"宝盈核心优势混合C"。

3.2.3 过去五年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

注:1.本基金合同生效日为2009年3月17日,合同生效日当年,本基金的收益率和业绩比较基准收益率是按实际存续期计算,不按整个自然年度折算。
2.本基金于2013年8月1日起增加收取销售服务费的C类收费模式,其对应的基金份额简称"宝盈核心优势混合C"。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

宝盈核心优势混合A					
年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2014	2.5500	400,216,351.90	309,935,411.81	710,151,763.71	
2013	0.4500	26,433,777.76	21,603,961.34	48,037,739.10	
2012	-	-	-	-	-
合计	3.0000	426,650,129.66	331,539,373.15	758,189,502.81	

单位:人民币元

宝盈核心优势混合C					
年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2014	2.4500	15,404,859.00	4,111,514.21	19,516,373.21	
2013	0.4500	98,556.70	89,919.02	188,475.72	
2012	-	-	-	-	-
合计	2.9000	15,503,415.70	4,201,433.23	19,704,848.93	

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人:宝盈基金管理有限公司是2001年按照证监会"新的治理结构、新的内控体系"标准设立的首批基金管理公司之一,2001年5月18日成立,注册资本为人民币1亿元,注册地在深圳。公司目前管理基金鸿阳、宝盈鸿利收益混合、宝盈泛沿海增长股票、宝盈策略增长股票、宝盈增强收益债券、宝盈资源优选股票、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、宝盈先进制造混合十四只基金,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		
王茹远	本基金基金经理兼宝盈策略增长股票型证券投资基金基金经理	2012年6月30日	2014年10月17日	6年	王茹远女士,计算机科学硕士。2007年12月至2011年7月就职于海通证券股份有限公司,担任首席分析师。2011年7月加入宝盈基金管理有限公司,担任核心研究员、中国国籍,证券投资基金从业人员资格。
张小仁	本基金基金经理、宝盈鸿利收益证券投资基金基金经理、宝盈先进制造灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2014年9月26日	-	7年	张小仁先生,中山大学经济学硕士。2007年7月加入宝盈基金管理有限公司,历任研究部核心研究员、宝盈泛沿海区域增长股票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.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,"离任日期"指根据公司决定确定的解聘日期;
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2014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 公平交易制度和执行方法

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

在"一路一带"去产能、部分城市房地产销量回暖预期下,市场提升了对未来经济回升的预期,加上经济自2011年开始连续三年趋势性下降后,过剩产能有一定程度的出清,也逐步释放了供给收缩带来的经营好转,但宏观经济仍未摆脱下行态势,PMI等领先指标显示,宏观经济在降息之后还未出现明显改观。如中央文件所言,中国经济目前处于经济增长的换挡期、结构调整的阵痛期以及前期刺激政策的消化期等三期叠加。中国经济的结构性问题仍需时间和智慧来解决,绝非易事。我们认为,长期来注点应该主要在改革的落实和受益于经济改革调结构的品种。

2014年市场风格变化剧烈,2014年1-3季度,上证指数上涨12.7%,创业板指数上涨17.8%;而4季度风格完全逆转,4季度单季度上证指数上涨37.2%,创业板指数则下跌35.7%。本基金在一至三季度保持以成长股为主的组合,在四季度及时调整结构,重点加仓了金融板块,全年看表现良好。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

宝盈核心优势混合A:本基金在本报告期内净值增长率是80.11%,同期业绩比较基准收益率是33.64%。

宝盈核心优势混合C:本基金在本报告期内净值增长率是77.98%,同期业绩比较基准收益率是33.64%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来,由于中国经济在资本、人力等方面都遇到一定瓶颈,加上经济基数已经比较庞大,国内经济增长率中枢的下行是大概率事件。

资金层面,由于国内价格水平处于持续收缩的过程中,下一阶段的货币政策仍将趋中偏松,但更要关注实际资金成本的下降情况。政策层面,由于经济并未显著改善,稳增长的政策仍将可期。经济层面,随着一系列改革的推出,未来某一时段的经济好转可能会超出市场预期。在改革红利逐步释放、流动性宽松、牛市预期已经形成的背景下,15年A股市场仍将反复活跃。

展望中长期,随使中国经济进一步恢复活力的依然是不断崛起的新兴产业。未来挖掘真正具有长期成长空间的优秀企业,仍是主要的任务。重点关注的行业但还两大部分,一是经济在未来某一时段的超预期好转,而这种情况在市场上表现为偏反方成长前景的企业,主要是互联网、军工、先进制造。同时,与资本市场相关的政策预计仍较多,市场的波动可能会加大。

我们将严格按照基金合同的规定,继续努力尽责地做好本基金的管理工作,尽力为投资者谋取较好的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设立估值工作小组,由投资部、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能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。投资部、研究部、固定收益部、专户投资部负责定期对经济环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生影响证券价格的重大事件以及估值政策和程序进行评价;量化投资部负责对估值模型及方法进行筛选,选择最具适用性的估值模型及参数,并负责估值模型的选择及测算;基金运营部负责进行日常估值,并与托管行的估值结果核对一致;监察稽核部负责审核估值政策和程序的一致性、监督估值委员会工作流程中的风险控制,并负责估值调整事项的信息披露工作。

上述参与估值流程的本基金管理人、本基金托管人和本基金聘请的会计师事务所各方不存在任何重大利益冲突。基金经理不参与决定本基金估值的程序。本基金未接受任何已签约的与估值相关的任何定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金收益分配原则:当基金实现可分配收益达到0.04元或者当基金净值达到1.10元或以上时,且满足法定分红条件时,即实施收益分配;在符合有关基金分红条件的前提下,基金收益分配每年至少分配1次,基金收益分配每年至多12次;年度分红12次后,如果再次达到分红条件,收益分配滚存到下一年度实施;全年基金收益分配比例不得低于年度基金已实现净收益的60%,基金合同生效不满三个月,收益可不分配;基金当期收益先弥补前期亏损后,方可进行当期收益分配;基金收益分配后每份基金份额的净值不能低于面值。

根据相关法律法规和基金合同要求以及基金实际运作情况,报告期内本基金共进行了12次收益分配:

1.本基金管理人于2014年2月11日发布公告,以2014年1月24日可供分配利润为基准,每10份A/C类基金份额派发红利0.20元,符合相关法律法规的有关规定以及基金合同、招募说明书的有关约定;

2.本基金管理人于2014年2月21日发布公告,以2014年2月13日可供分配利润为基准,每10份A/C类基金份额派发红利0.20元,符合相关法律法规的有关规定以及基金合同、招募说明书的有关约定;

3.本基金管理人于2014年3月6日发布公告,以2014年2月26日可供分配利润为基准,每10份A/C类基金份额派发红利0.50元,符合相关法律法规的有关规定以及基金合同、招募说明书的有关约定;

4.本基金管理人于2014年3月20日发布公告,以2014年3月12日可供分配利润为基准,每10份A/C类基金份额派发红利0.20元,符合相关法律法规的有关规定以及基金合同、招募说明书的有关约定;

5.本基金管理人于2014年7月11日发布公告,以2014年7月3日可供分配利润为基准,每10份A/C类基金份额派发红利0.20元,符合相关法律法规的有关规定以及基金合同、招募说明书的有关约定;

6.本基金管理人于2014年8月6日发布公告,以2014年7月29日可供分配利润为基准,每10份A/C类基金份额派发红利0.20元,符合相关法律法规的有关规定以及基金合同、招募说明书的有关约定;

7.本基金管理人于2014年8月15日发布公告,以2014年8月8日可供分配利润为基准,每10份A类基金份额派发红利0.20元,每10份C类基金份额派发红利0.10元,符合相关法律法规的有关规定以及基金合同、招募说明书的有关约定;

8.本基金管理人于2014年8月26日发布公告,以2014年8月20日可供分配利润为基准,每10份A/C类基金份额派发红利0.06元,符合相关法律法规的有关规定以及基金合同、招募说明书的有关约定。

9.本基金管理人于2014年9月9日发布公告,以2014年9月1日可供分配利润为基准,每10份A/C类基金份额派发红利0.10元,符合相关法律法规的有关规定以及基金合同、招募说明书的有关约定。

10.本基金管理人于2014年9月19日发布公告,以2014年9月11日可供分配利润为基准,每10份A/C类基金份额派发红利0.30元,符合相关法律法规的有关规定以及基金合同、招募说明书的有关约定。

11.本基金管理人于2014年10月10日发布公告,以2014年9月24日可供分配利润为基准,每10份A/C类基金份额派发红利0.30元,符合相关法律法规的有关规定以及基金合同、招募说明书的有关约定。

12.本基金管理人已于2014年10月23日发布公告,以2014年10月14日可供分配利润为基准,每10份A/C类基金份额派发红利0.10元,符合相关法律法规的有关规定以及基金合同、招募说明书的有关约定。

本报告期末宝盈核心优势混合A可供分配基金份额利润0.1977元,基金份额净值1.5035元,宝盈核心优势混合C可供分配基金份额利润0.1926元,基金份额净值1.4968元,符合利润分配条件,但2014年度本基金分红次数已达到12次,根据合同约定本基金年度分红12次后,如果再次达到分红条件,收益分配滚存到下一年度实施。本基金已实现尚未分配的可供分配收益部分,将严格按照基金合同的约定适时向投资者予以分配。

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,中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在对宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金(以下称"本基金")的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据核对无误。(注:财务会计报告中的"金融工具风险管理"部分未在托管人复核范围内。)

§6 审计报告

本基金2014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(2015)第20691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:宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金
报告截止日:2014年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
资产:		
银行存款	281,110,040.20	133,759,172.53
结算备付金	12,825,904.10	6,667,190.50
存出保证金	1,282,939.77	747,146.47
交易性金融资产	7,222,486,263.77	1,436,956,067.11
其中:股票投资	6,080,771,091.89	1,175,123,567.11
基金投资	-	-
债券投资	1,141,715,171.88	261,832,500.00
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	-	99,640,169.82
应收证券清算款	36,272,090.19	965,835.40
应收利息	12,224,153.27	2,329,404.42
应收股利	-	-
应收申购款	69,747,139.95	32,295,548.85
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	7,635,948,531.25	1,713,360,535.10
负债和所有者权益	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013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	38,070,972.75	7,331,038.77
应付赎回款	140,852,336.56	4,623,217.77
应付管理人报酬	8,033,989.72	1,911,354.29
应付托管费	1,338,998.28	318,559.08
应付销售服务费	237,801.60	8,578.81
应付交易费用	6,754,516.65	3,497,903.53
应交税费	70,261.60	70,261.60
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	598,723.28	186,520.76
负债合计	195,957,600.44	17,947,434.61
所有者权益:		
实收基金	4,949,278,284.37	1,619,728,916.65
未分配利润	2,490,712,646.44	75,684,183.84
所有者权益合计	7,439,990,930.81	1,695,413,100.49
负债和所有者权益总计	7,635,948,531.25	1,713,360,535.10

注:报告截止日2014年12月31日,基金份额总额4,949,278,284.37份,其中宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金A类基金份额净值为5,150,35元,基金份额为4,793,114,116.67份;宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金C类基金份额净值为14,9968元,基金份额为156,164,167.70份。

7.2 利润表

会计主体:宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金
本报告期:2014年1月1日至2014年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
一、收入	2,298,526,484.14	289,709,704.22
1.利息收入	16,953,903.57	1,931,328.06
其中:存款利息收入	2,272,180.65	733,781.45
债券利息收入	12,269,848.35	982,297.86
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	2,411,874.57	215,248.75
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	1,468,546,885.27	254,563,483.08
其中:股票投资收益	1,136,080,846.80	252,249,200.02
基金投资收益	-	-
债券投资收益	306,705,389.06	-813,135.30
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	25,760,649.41	3,127,418.36
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	806,759,105.48	32,147,430.47
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	6,266,589.82	1,067,462.61
减:二、费用	94,455,329.98	30,834,073.18
1.管理人报酬	50,710,182.41	12,088,314.84
2.托管费	8,451,697.05	2,014,719.20
3.销售服务费	1,375,319.67	19,032.33
4.交易费用	32,601,912.68	16,297,794.09
5.利息支出	858,759.51	-
其中:卖出回购金融资产支出	858,759.51	-
6.其他费用	457,458.66	414,212.72
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	2,204,071,154.16	258,875,631.04
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	2,204,071,154.16	258,875,631.04

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金
本报告期:2014年1月1日至2014年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1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)	1,619,728,916.65	75,684,183.84	1,695,413,100.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,204,071,154.16	2,204,071,154.16
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)	3,329,549,367.72	940,625,445.36	4,270,174,813.08
其中:1.基金申购款	7,489,993,980.07	1,811,450,147.37	9,301,444,127.44
2.基金赎回款	-4,160,444,612.35	-870,824,702.01	-5,031,269,314.36
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)	-	-729,668,136.92	-729,668,136.92
五、期末所有者权益(基金净值)	4,949,278,284.37	2,490,712,646.44	7,439,990,930.81
项目	上年度可比期间 2013年1月1日至2013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)	127,918,776.39	-38,566,847.00	89,351,929.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	258,875,631.04	258,875,631.04
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)	1,491,810,140.26	-96,398,385.38	1,395,411,754.88
其中:1.基金申购款	2,415,810,718.59	-150,757,563.55	2,265,053,155.04
2.基金赎回款	-924,000,578.33	54,359,178.17	-869,641,400.16
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)	-	-48,226,214.82	-48,226,214.82
五、期末所有者权益(基金净值)	1,619,728,916.65	75,684,183.84	1,695,413,100.49

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:
王玫 胡坤 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 基金基本情况

宝盈核心优势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?2009]第5号《关于核准宝盈核心优势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《宝盈核心优势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776,417,611.14元,业经德勤华永会计师事务所有限公司德师京报验字(09)第0003号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2009年3月17日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为776,687,900.16份基金份额,其中认购资金利息折合?70,289.02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,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《宝盈核心优势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基本面良好、投资价值较高的上市公司股票,以及债券、权证和其他中国证监会允许基金投资的金融工具。基金的投资组合比例为:股票资产占基金总资产的比例为30%-80%;债券为15%-65%,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%。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数X65%+上证国债指数X35%。

根据《关于"宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金增加收费模式并修改基金合同的公告》,本基金自2013年8月1日起实施分级、根据申购费用、赎回费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取前端申购费用的,为本基金A类基金份额;不收取申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的,为本基金C类基金份额。

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日及以后期间颁布的《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3号-年度报告和半年度报告》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《宝盈核心优势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2014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2014年12月31日的财务状况以及2014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

财政部于2014年颁布《企业会计准则第39号——公允价值计量》、《企业会计准则第40号——合营安排》、《企业会计准则第41号——在其他主体中权益的披露》和修订后的《企业会计准则第2号——长期股权投资》、《企业会计准则第9号——职工薪酬》、《企业会计准则第30号——财务报表列报》、《企业会计准则第33号——合并财务报表》以及《企业会计准则第37号——金融工具列报》,要求除《企业会计准则第37号——金融工具列报》自2014年度财务报表起施行外,其他准则自2014年7月1日起施行。上述准则对本基金本报告期无重大影响。

7.4.4.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(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、股权的股息、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,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。自2013年1月1日起,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