宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金

【2015】半年度报告摘要

基金管理人:宝盈基金管理有限公司
基金托管人:广发证券股份有限公司
送出日期:2015年8月27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2015年8月26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2015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	3,548,270,597.99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	2,426,346,605.06份	1,121,923,992.93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	王玮
	联系电话	0755-83276688	020-87555888-6052
	电子邮箱	zhang瑾@byfunds.com	wwei@gf.com.cn
客户服务电话		400-8888-300	–
传真		0755-83515699	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(2015年1月1日 – 2015年6月30日)	报告期(2015年1月1日 – 2015年6月30日)
本期已实现收益	117,557,689.44	82,674,344.01
本期利润	53,365,929.62	170,581,370.68
加权平均基金份额本期利润	0.0526	0.2736
本期基金份额净值增长率	54.47%	53.75%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)	
期末可供分配基金份额利润	0.1876	0.1779
期末基金资产净值	3,811,443,129.84	1,749,126,377.44
期末基金份额净值	1.571	1.559

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、本基金合同生效日为2014年9月26日,至披露时点不满一年。

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

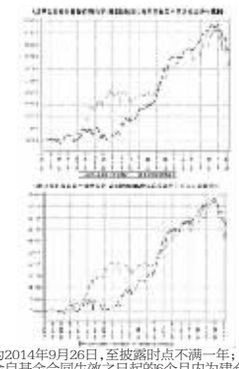
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-6.54%	1.14%	-4.76%	2.27%	-1.78%	-1.13%
过去三个月	7.46%	0.89%	7.67%	1.70%	-0.21%	-0.81%
过去六个月	54.47%	1.14%	17.87%	1.47%	36.60%	-0.33%
自基金合同生效起至今	57.10%	1.24%	51.33%	1.34%	5.77%	-0.10%

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	-6.59%	1.14%	-4.76%	2.27%	-1.83%	-1.13%
过去三个月	7.30%	0.89%	7.67%	1.70%	-0.37%	-0.81%
过去六个月	53.75%	1.14%	17.87%	1.47%	35.88%	-0.33%
自基金合同生效起至今	55.90%	1.24%	51.33%	1.34%	4.57%	-0.10%

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



注:1、本基金合同生效日为2014年9月26日,至披露时点不满一年;
2、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、宝盈新兴产业混合、宝盈转型动力混合、宝盈祥泰养老混合十七只基金,公司格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、宝盈资源优选股票型证券投资基金、宝盈科技30灵活配置混合型证券投资基金、宝盈策略增长股票型证券投基基金、宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;投资部总监	2014年9月26日	–	14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、宝盈资源优选股票型证券投资基金、宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金、宝盈策略增长股票型证券投资基金、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,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、彭敢为首任基金经理,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6月30日。

4.2 管理人对投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 管理人对投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 管理人对投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

2015年上半年A股市场呈现整体牛市氛围,领涨全球,首先以创业板为主的成长股经历了一季度的强势后,二季度依然得到强劲延续,同样的大盘蓝筹走势也极为强劲,上证指数、沪深300、深成指和创业板指分别上涨32.23%、30.17%、26.58%和94.23%,半年度创业板指数整体强于大势,指数和成交量也屡创历史新高。本基金在上半年实现A/B类收益54.47%、C类收益53.75%,为投资者取得了一定的投资收益。

本基金管理人认为,本届政府对中国经济转型的决心毋庸置疑,虽然从实体经济的增速来看,中国经济仍然在持续的下滑调整过程中,政府需要通过各种货币政策工具操作来降低实体经济利率;但是,政府依然能有决心实现稳步的经济增长,同时也大力支持发展新兴产业,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。在过去半年,本基金管理人一直以代表经济增长转型的战略性新兴产业个股作为重点投资标的,虽然结果来看投资收益不能算顶级,但基本能按照本基金管理人的投资理念来执行,虽然在一季度和二季度初能获取较高收益,但是由于6月份市场出现了系统性调整,并没有较好的控制住回撤风险,需要将系统性风险和短期博弈因素考虑进去,整体来说,仍对过去半年所取得的成绩是比较满意的。

2015年上半年依然延续了成长风格强劲走势,且小市值股票遭到跟风热炒,同时,大盘蓝依然坚挺,上证指数接连创出7年新高,虽然整个季度市场表象上与基金管理人的理念基本吻合,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,也未能将提前布局的优质成长股收益最大化等,但从整体结果来看,较为理想。半年末主要持仓集中在环保、TMT、医药、军工、新能源等方向。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

宝盈睿丰创新混合A/B:截至本报告期末,本基金的份额净值为1.571元,本基金在本报告期内净值增长率是54.47%,同期业绩比较基准收益率是17.87%。

宝盈睿丰创新混合C:截至本报告期末,本基金的份额净值为1.559元,本基金在本报告期内净值增长率是53.75%,同期业绩比较基准收益率是17.87%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2015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。而油价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下行过快的局面下,依然能看出强有力的转型决心。

从市场来看,上半年股票市场的火爆吸引了大量社会资金跑步奔向股市,并带来明显的泡沫。六月中旬开始的快速调整让投资者对未来的市场走势产生恐惧,市场情绪低迷,空头控制了短期市场。但基金管理人认为,2014年以来的牛市的基因仍在,首先宽松的货币政策也在边际上未必能产生上半年那种持续宽松,但仍有继续宽松的空间,而且中期内不可能紧缩。其次从制度红利来看,中国政府对资本市场和国企治理的决心已仍庸置疑,沪港通、深港通、证券法修改及注册制等都是资本市场已发生或即将发生的重大影响意义的事件;同时国企治理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,尽管短期内,由于股价巨大的调整会伤害投资者的信心,但互联网金融、互联网医疗、互联网能源以及互联网农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。最后,在预期稳定的情况下,居民大类资产配置从储蓄、房产、其他理财产品向股权转移的趋势不大可能发生转变。中国自加入世贸以来积累了巨大的财富,财富的重新转移配置是股票市场最大的牛市因素。

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、"互联网+"创新显著低于预期甚至失败。

基金管理人认为,从行为金融学来看,2015下半年市场的走势可能仍然会显著偏离市场的一致判断,我们在检视目前市场的一些共识的时候更需要考察这些共识的基础和条件,而从这些条件来看,市场的一些共识并不是那么靠得住的。二季度,头两个月的市场走势强劲,创新高速度超市场预期,同时,6月份的加速调整回落也让市场参与者顿时惊慌失措,总之,本轮牛市中叠加了杠杆因素,是大多数市场参与者没有经历过的,我们一方面对全年市场保持积极乐观态度,尤其是优质新兴成长股需要重视其新商业模式、新技术及逐步体现业绩叠加对市场产生正反馈带来的投资机会,另一方面,也需要关注杠杆融资获利盘带来的短期冲击,国内资本市场已经逐步完善,金融衍生品会越来越丰富,会让市场投资手段多样化的同时,也必然会带来较大的波动,需要重视博弈的因素。

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,一类是市场博弈赚图形的钱,我的收益图是他人的亏损。在这个充分竞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,最后必然超越市场涨幅,在无法判别市场风向的市场,挑选最强健的猪。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重要的部分。而目前传统产业在中国股票市场中的市值比率并不低,而估值在经历过去一个季度的大幅上涨之后与国际水平相比并不具有显著的优势。

因此,管理人判断2015年下半年市场将面临几年来最为复杂多变的局面。理念比对市场的判断会更有价值,我们坚持看好新蓝筹(有别于传统钢铁水泥类产业的新产业蓝筹)、新成长(面向未来的快速增长行业和新兴产业)、新主题(收购兼并行业整合)。基金管理人在2015年三季度将按照上述思路来操作,在优选成长股的同时,利用市场调整期间布局优质新蓝筹股,实现长期均衡配置。

本基金将继续重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 管理人对投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。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2015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:2015年6月30日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
资 产:			
银行存款	6.4.7.1	3,930,201,364.38	13,952,152.85
结算备付金		64,789,105.20	707,492.79
存出保证金		1,110,352.81	1,114,936.26
交易性金融资产	6.4.7.2	1,783,270,998.78	488,180,670.79
其中:股票投资		1,555,475,771.58	461,323,140.79
基金投资		–	–
债券投资		227,795,227.20	26,857,530.00
资产支持证券投资		–	–
贵金属投资		–	–
衍生金融资产	6.4.7.3	–	–
买入返售金融资产	6.4.7.4	–	–
应收证券清算款		26,823,377.47	6,550,575.21
应收利息	6.4.7.5	6,997,285.79	457,336.26
应收股利		–	–
应收申购款		1,946,595.24	2,858,329.57
递延所得税资产		–	–
其他资产	6.4.7.6	–	–
资产总计		5,815,139,079.67	513,821,483.73
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年6月30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	6.4.7.3	–	–
卖出回购金融资产款		–	–
应付证券清算款		35,934,168.70	8,222,969.65
应付赎回款		206,114,100.52	5,422,133.17
应付管理人报酬		7,704,300.95	685,035.57
应付托管费		1,284,050.18	114,172.61
应付销售服务费		1,311,850.32	313,909.83
应付交易费用	6.4.7.7	1,791,856.72	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	6.4.7.8	429,245.00	87,531.02
负债合计		254,569,572.39	15,763,753.86
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	3,548,270,597.99	491,029,919.91
未分配利润	6.4.7.10	2,012,298,909.29	7,027,809.96
所有者权益合计		5,560,569,507.28	498,057,729.87
负债和所有者权益总计		5,815,139,079.67	513,821,483.73

注:报告期截止日2015年6月30日,宝盈睿丰创新基金A/B类基金份额净值1.571元,基金份额总额2,426,346,605.06份;宝盈睿丰创新基金C类基金份额净值1.559元,基金份额总额1,121,923,992.93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3,548,270,597.99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:2015年1月1日至2015年6月30日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
一、收入		252,958,654.07
1.利息收入		7,943,809.60
其中:存款利息收入	6.4.7.11	2,842,846.88
债券利息收入		2,774,277.49
资产支持证券利息收入		–
买入返售金融资产收入		2,326,685.23
其他利息收入		–
2.投资收益(损失以"-"填列)		218,254,409.01
其中:股票投资收益	6.4.7.12	245,010,654.33
基金投资收益		–
债券投资收益	6.4.7.13	-28,897,260.54
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	–
贵金属投资收益	6.4.7.14	–
衍生工具收益	6.4.7.15	–
股利收益	6.4.7.16	2,141,015.22
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	6.4.7.17	23,722,266.85
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		–
5.其他收入(损失以"-"号填列)	6.4.7.18	3,038,168.61
减:二、费用		29,004,353.77
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	18,662,449.15
2. 托管费	6.4.10.2.2	3,110,408.21
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	3,641,494.22
4. 交易费用	6.4.7.19	3,198,311.83
5. 利息支出		208,670.06
其中:卖出回购金融资产支出		208,670.06
6. 其他费用	6.4.7.20	183,020.30
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		223,954,300.30
减:所得税费用		–
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		223,954,300.30

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:2015年1月1日至2015年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015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)	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)	–	223,954,300.30	223,954,300.30
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)	3,057,240,678.08	1,781,316,799.03	4,838,557,477.11
其中:1.基金申购款	3,929,011,029.48	2,169,078,565.73	6,098,089,595.21
2.基金赎回款	-871,770,351.40	-387,761,766.70	-1,259,532,118.10
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)	3,548,270,597.99	2,012,298,909.29	5,560,569,507.28

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:

汪钦 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

6.4 报表附注

6.4.1 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]第887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569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、赎回时收取后端认购/申购费用和赎回费用的,称为B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,且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(包含中小板、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0%–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%。

6.4.2 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6.4.4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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2015年上半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6月30日的财务状况以及2015年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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

除财务报表附注6.4.5.2之外,本基金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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 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),鉴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第三方估值机构根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于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。

自2015年3月27日起,本公司对旗下证券投资基金持有的在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)的估值方法进行调整,采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。2015年3月27日,相关调整对前一估值日基金资产净值的影响不超过0.5%。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 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,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。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,暂减按25%计入应纳税所得额。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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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(以下简称"宝盈基金公司")	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(以下简称"广发证券")	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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券	2,394,772,857.49	100.00%

6.4.8.1.2 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
广发证券	710,009,033.80	100.00%

6.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
广发证券	33,872,200,000.00	100.00%

6.4.8.1.4 权证交易

无。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015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	2,124,625.90	100.00%	1,791,856.72	100.00%

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	18,662,449.15
其中:支付销售机构的客户维护费	1,746,225.03

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。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	3,110,408.21

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。

6.4.8.2.3 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 |