中原英石灵活配置混合型发起式证券投资基金

2015 年度报告摘要

2015年12月31日

基金管理人：中原英石基金管理有限公司
基金托管人：兴业银行股份有限公司
送出日期：二〇一六年三月二十五日

§1 重要提示及目录

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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年3月11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。

本报告期自2015年2月10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	中原英石灵活配置
基金主代码	000986
基金运作方式	契约型开放式、发起式
基金合同生效日	2015年2月10日
基金管理人	中原英石基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	16,209,168.25份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过优化资产配置和灵活运用多种投资策略，寻找推动经济增长的内在动力，精选具有较高成长性和投资价值的金融工具，在充分控制投资风险的基础下，力争实现持续稳定的投资回报。
投资策略	(一)资产配置策略 本基金采用自上而下的多因素分析方法进行宏观策略研究，对宏观经济方面重大问题、突发事件、重大政策进行及时研究与评估，对影响证券市场的相关因素(政策、资金、利率走向、行业比较、上市公司盈利增长预期、估值水平、市场心理等)进行综合考量，分析和预测证券市场走势和行业热点，预测权益类资产和固定收益类资产的风险收益特征，确定中长期的资产配置方案。在公司投资决策委员会的统一指导下进行大类资产的配置与组合构建，合理确定本基金在股票、债券、股指期货等金融工具上的投资比例，并随着各类金融工具风险收益特征的相对变化，适时动态地调整各金融工具的投资比例，以最大限度地降低投资组合的风险并提高收益。 (二)股票投资策略 本基金采用灵活的股票投资策略，充分挖掘中国经济结构调整和产业升级衍伸的投资机会，关注具有持续高成长性的行业和上市公司，以分享经济增长带来的投资回报。 (三)债券投资策略 本基金债券投资策略主要包括久期策略、收益率曲线策略、类别选择策略、个券选择策略、可转换债券投资策略、中小企业私募债投资策略等。 (四)股指期货投资策略 本基金在股指期货投资中将以控制风险为原则，以套期保值为目的，谨慎参与股指期货投资。本基金通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，对股指期货合约进行估值定价，并与股票现货资产进行匹配，实现多头或空头的套期保值操作。 (五)权证投资策略 本基金将因为上市公司进行增发、配售以及投资分离交易的可转换公司债券等原因被动获得权证，或者在进行套利交易、避险交易以及权证价值严重低估等情形下将投资权证。 本基金的权证投资，是在对权证标的证券进行基本面研究及估值的基础上，结合股价波动率等参数，运用数量化期权定价模型，投资于合理内在价值的权证品种。
业绩比较基准	1年期银行定期存款利率(税后)+2%
风险收益特征	本基金为混合型基金，本基金属于中高风险、中高收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。

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		中原英石基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈吟绮	吴荣
	联系电话	021-38556782	021-52629999-213117
	电子邮箱	disclosure@acfund.com.cn	011693@cib.com.cn
客户服务电话		021-38874600	95561
传真		021-38556677	021-62535823

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.acfund.com.cn
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区花园石桥路33号花旗集团大厦17楼1708室

§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2月10日－2015年12月31日
本期已实现收益	-3,755,873.67
本期利润	-3,628,008.63
加权平均基金份额本期利润	-0.2465
本期基金份额净值增长率	-21.50%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末
期末可供分配基金份额利润	-0.2499
期末基金资产净值	12,725,172.98
期末基金份额净值	0.7850

注：1、本基金基金合同生效日为2015年2月10日，至本报告期末不满一年。

2、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，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、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

4、上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

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	4.39%	1.05%	0.90%	0.01%	3.49%	1.04%
过去六个月	-31.86%	1.71%	1.90%	0.01%	-33.76%	1.70%
自基金合同生效日起至今	-21.50%	1.96%	3.66%	0.01%	-25.16%	1.95%

注：本基金的业绩比较基准为：1年期银行定期存款利率（税后）+2%。

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

中原英石灵活配置混合型发起式证券投资基金
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
（2015年2月10日－2015年12月31日）

注：1、本基金基金合同于2015年2月10日生效，至报告期末不满一年；

2、按照本基金基金合同和招募说明书的约定，本基金建仓期为自基金合同生效之日起的六个月，本报告期末已完成建仓但报告期末距建仓结束不满一年，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合合同约定。

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

中原英石灵活配置混合型发起式证券投资基金
自基金合同生效以来基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图
（2015年2月10日－2015年12月31日）

注：1、本基金基金合同生效日为2015年2月10日，至本报告期末未满5年。

2、合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效以来未进行利润分配。

§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

中原英石基金管理有限公司（以下简称"公司"）经中国证券监督管理委员会2012年12月20日证监许可[2012]1719号文件《关于核准设立中原英石基金管理有限公司的批复》批准，由中原证券股份有限公司和安石投资管理有限公司共同发起设立。公司于2013年1月23日在上海市工商行政管理局注册成立，并于2013年1月29日取得中国证券监督管理委员会核发的《基金管理资格证书》。公司注册资本为人民币2亿元，其中中原证券股份有限公司的出资占注册资本的51%，安石投资管理有限公司的出资占注册资本的49%。

目前公司经营范围为基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理等，在投资管理、策略设计、产品设计、客户服务等方面配置了专业团队及集中了优秀资源，力求为客户创造长期持续稳健的回报。截至本报告期末，公司共管理一只证券投资基金：中原英石灵活配置混合型发起式证券投资基金。

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 任职日期	任本基金的基金经理(助理)期限 离任日期	证券从业年限	说明
赵梓峰	本基金的基金经理、兼任投资副总监、研究总监	2015年2月10日	-	22	上海交通大学工学学士，具有证券投资基金从业资格。1993年8月起曾在渣打证券公司上海代表处、法国兴业证券公司上海代表处、元富证券公司上海代表处、凯基(北京)管理咨询公司任研究员、研究主管等职，在上投摩根基金管理有限公司任研究总监、上投摩根成长先锋股票型证券投资基金基金经理(任职期间：2007年3月20日至2011年5月25日)，在中原英石基金管理有限公司任中原英石货币市场基金基金经理(任职时间：2014年9月11日至2015年10月21日)等职。中国国籍。
独孤南薰	本基金的基金经理助理	2015年4月2日	2015年5月28日	12	美国西北大学经济学学士，具有证券投资基金从业资格。2003年10月起曾在台湾凯基证券上海研究部、工银瑞信基金管理有限公司、汇丰晋信基金管理有限公司、安信证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司担任研究员、高级研究员等职。2013年4月加入中原英石基金管理有限公司，先后担任研究员、本基金的基金经理助理。中国国籍。

注：1、基金经理的任职日期和离职日期一般情况下指公司对外公告之日；若该基金经理自本基金基金合同生效之日起即任职，则任职日期指本基金基金合同生效之日；

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。

3、2016年3月18日，本基金管理人发布《中原英石基金管理有限公司关于中原英石灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理变更的公告》，赵梓峰先生自2016年3月17日起不再担任本基金基金经理，除此之外基金经理（或基金经理小组）期后变动（如有）敬请关注基金管理人发布的相关公告。

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有关法律法规、监管部门的相关规定和本基金基金合同的约定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在损害基金份额持有人利益的行为，未发生违法违规或未履行基金合同的情形。

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

在内控制度方面，公司根据相关法律法规制订了规范的投资管理制度和公平交易管理制度，以确保公司管理的不同投资组合得到公平对待，保护投资者合法权益。

在投资决策方面，研究团队为公司所有投资组合提供平等、公平的研究支持，所有投资组合共享公司统一的投资研究平台；严格实行各类资产管理业务之间的业务隔离和人员隔离制度，保证不同投资组合经理之间投资决策的独立性，各投资组合的持仓及交易信息等均有效隔离。在交易执行方面，实行集中交易制度，建立公平的交易分配制度，保证交易在各投资组合间的公正实施。在监控和稽核方面，交易部门在交易执行过程中对公平交易实施一线监控与报告，稽核与风控部对投资交易行为进行持续监督和评估，定期进行公平交易的内部稽核工作，每季度和每年度对不同投资组合的收益率差异以及同向交易和反向交易情况进行分析，加强对公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司公平交易管理的相关制度等的有关规定，从研究分析、投资决策、交易执行、事后稽核等环节进行严格规范，通过系统和人工相结合的方式在投资管理活动各环节贯彻和执行公平交易管理制度，公平对待本基金管理人管理的所有投资组合，未发现不同投资组合之间存在非公平交易的情况。

本报告期内，本基金管理人对不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口（如日内、3日内、5日内）同向交易的交易价差进行分析，分析结果显示本投资组合与公司管理的其他投资组合在同向交易价差方面未出现异常。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发生本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情形，未发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

本基金于2015年2月10日成立，2月27日起开始可以正式交易，在建仓期内，我们采取了谨慎稳妥的建仓策略，一直到第二季度前半段建仓完毕，并取得了一定的正收益。市场在经历了一段表现良好的行情之后，从6月中旬开始出现了较为急速调整，尤其是在调整的后半段，对市场流动性造成了一定的影响，反过来又加大了调整深度。在6月份开始的股市震荡中，虽然我们看到了风险并开始降低仓位，但由于市场调整的速度非常迅速导致流动性缺失，因此对我们仓位调整造成了一定的困难，致使减仓并不能按照计划顺利进行。A股市场在第四季度迎来了反弹。流动性问题基本解决、宏观经济等方面的利空基本出尽，第三季度市场的调整，都为反弹提供了条件。本基金在第四季度初提高了仓位，主要投资于行业和公司基本面改善、前期涨幅不大的个股。考虑到2016年大非解禁等不确定性因素的制约，在第四季度末，本基金控制了仓位。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金的份额净值增长率为-21.50%，同期业绩比较基准收益率为3.66%。

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2016年，市场的不确定因素可能主要来自对股票供给侧变化的预期和以汇率为首的外围市场波动。1月初大非开始可以解禁，对市场心里和资金面的影响程度取决于进一步的监管措施。此外新股发行节奏和注册制进展，也将在一定程度上影响市场情绪。宏观经济预计增速或放缓，传统产业继续处于出清阶段，新兴产业蓬勃发展，但其体量可能依然无法弥补传统产业增速下滑留下的缺口。人民币汇率仍或存在贬值预期，也对A股市场造成一定的压力。市场的有利因素在于"资产荒"或将在一段时间内持续，由于实体经济不振，股市依然是一个可能的资金流入口。我们将继续采取谨慎的投资策略，寻找有估值安全边际的成长股、处于上升期的新兴产业公司、基本面改善的行业等方面的投资机会，并适当的控制仓位，力争给投资者满意的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格按照《中原英石基金管理有限公司基金估值定价与评估制度》和《中原英石基金管理有限公司基金会计业务管理制度》以及相关法律法规的规定，有效地控制基金估值流程。公司估值委员会成员由营运总监负责，成员包括投资组合经理、行业研究员、风控人员、金融工程研究员及基金会计等人员组成，成员由估值所涉及的部门领导指定。上述参与估值流程人员均具有专业胜任能力和相关工作经验且基金经理不参与其管理基金的具体估值业务。本报告期内，参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同的相关约定，本基金本报告期内未进行利润分配，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

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》规定，本基金为发起式基金，自本基金基金合同生效之日起至报告期末本基金合同生效未满三年，不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条。

§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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何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

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 审计报告

本报告期本基金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，注册会计师薛竞、胡逸嵘于2016年3月21日签字出具了标准无保留意见的审计报告。

投资者可通过登载于本基金管理人网站的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：中原英石灵活配置混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2015年12月31日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2015年12月31日
资 产：		
银行存款	7.4.7.1	7,662,305.66
结算备付金		79,304.89
存出保证金		22,445.95
交易性金融资产	7.4.7.2	5,013,206.40
其中：股票投资		4,254,541.00
基金投资		-
债券投资		758,665.40
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	16,554.66
应收股利		-
应收申购款		15,976.03
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		12,809,793.59
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年12月31日
负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		1,624.72
应付管理人报酬		15,551.39
应付托管费		2,591.89
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	14,851.19
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	50,001.42
负债合计		84,620.61
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	16,209,168.25
未分配利润	7.4.7.10	-3,483,995.27
所有者权益合计		12,725,172.98
负债和所有者权益总计		12,809,793.59

注：1、报告截止日2015年12月31日，基金份额净值0.7850元，基金份额总额16,209,168.25份。

2、本基金基金合同生效日为2015年2月10日，因此本报告实际报告期间为2015年2月10日（基金合同生效日）至2015年12月31日，无上年度末数据（下同）。

3、本摘要中资产负债表和利润表所列附注号为年度报告正文中对应的附注号，投资者欲了解相应附注的内容，应阅读登载于基金管理人网站的年度报告正文。

7.2 利润表

会计主体：中原英石灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2015年2月10日至2015年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2015年2月10日至2015年12月31日
一、收入		-3,074,291.70
1.利息收入		113,236.56
其中：存款利息收入	7.4.7.11	97,156.06
债券利息收入		16,080.50
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）		-3,330,621.84
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-3,375,156.88
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-1,348.00
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	7.4.7.14	-
股利收益	7.4.7.15	45,883.04
3.公允价值变动收益（损失以"-"号填列）	7.4.7.16	127,865.04
4.汇兑收益（损失以"-"号填列）		-
5.其他收入（损失以"-"号填列）	7.4.7.17	15,228.54
减：二、费用		553,716.93
1.管理人报酬		188,765.07
2.托管费		31,460.83
3.销售服务费		-
4.交易费用	7.4.7.18	182,136.03
5.利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6.其他费用	7.4.7.19	151,355.00
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）		-3,628,008.63
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以"-"号填列）		-3,628,008.63

注：1、本基金基金合同生效日为2015年2月10日，因此本报告实际报告期间为2015年2月10日（基金合同生效日）至2015年12月31日，无上年度可比期间数据（下同）。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中原英石灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2015年2月10日至2015年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2015年2月10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)	13,557,227.44	-	13,557,227.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-3,628,008.63	-3,628,008.63
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)	2,651,940.81	144,013.36	2,795,954.17
其中：1.基金申购款	4,854,010.22	332,953.96	5,186,964.18
2.基金赎回款	-2,202,069.41	-188,940.60	-2,391,010.01
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)	16,209,168.25	-3,483,995.27	12,725,172.98

注：本基金基金合同生效日为2015年2月10日，因此本报告实际报告期间为2015年2月10日（基金合同生效日）至2015年12月31日，无上年度可比期间数据（下同）。

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：

宋卫华	宋卫华	何晶晶
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

中原英石灵活配置混合型发起式证券投资基金（以下简称"中原英石灵活配置混合基金"，"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]1392号《关于准予中原英石灵活配置混合型发起式证券投资基金注册的批复》核准，由中原英石基金管理有限公司负责公开募集并担任基金管理人和注册登记机构，兴业银行股份有限公司（以下简称"兴业银行"）担任基金托管人。基金管理人中原英石基金管理有限公司于2015年1月23日至2015年2月5日对符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者、人民币合格境外机构投资者和发起资金提供方以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者公开发售。募集期结束经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具普华永道中天验字(2015)第115号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。本基金基金合同于2015年2月10日正式生效。本基金为契约型开放式、发起式，存续期限不定期。中原英石灵活配置混合基金首次向社会公开发售且扣除认购费用后的募集资本金额共计人民币13,555,569.64元，上述募集资本根据基金份额初始面值人民币1.00元折合为13,555,569.64份基金份额。截至2015年2月9日止，中原英石灵活配置混合基金经注册登记系统确认的募集期间有效认购资金按实际适用年利率计算产生的利息折份额部分共计人民币1,657.80元，按基金份额初始面值人民币1.00元折合为1,657.80份基金份额。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、权证、股指期货、可转换债券、银行存款和债券等资产，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（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金为混合型基金，本基金属于中高风险、中高收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。

本基金的业绩比较基准为：1年期银行定期存款利率（税后）+2%

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（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》、《中原英石灵活配置混合型发起式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。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，开放式基金在基金合同生效后，连续60个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。发起式基金不受上述限制，基金合同生效三年后，若基金资产净值低于两亿元的，基金合同自动终止，在基金合同生效三年后继续存续的，依照上述规定执行。本基金为发起式基金，基金合同生效日为2015年2月10日，于2015年12月31日，本基金基金合同生效尚未满三年，故本财务报表以持续经营为编制基础。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于2015年12月31日的财务状况以及2015年2月10日（基金合同生效日）至2015年12月31日止期间的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依据企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间系2015年2月10日（基金合同生效日）起至2015年12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1、金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具（主要为权证投资）分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

2、金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该等金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益；应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具（主要为权证投资）按如下原则确定公允价值并进行估值：

1、存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

2、存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

3、当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/（累计亏损）。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

1、利息收入

(1)存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

(2)除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含利率后，逐日确认债券利息收入。

(3)买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息收入。

2、投资收益

(1)股票投资收益于交易日按卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

(2)债券投资收益于交易日按卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

(3)衍生工具投资收益于交易日按卖出权证交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

(4)股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

3、公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产/负债的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产/负债卖出或到期时转出计入投资收益。

7.4.4.10 费用的确认和计量

1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提。

2、本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。

3、卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

4、其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响每万份基金净收益小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为8次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的10%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2)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），按照中证指数有限公司根据《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》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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中证指数有限公司根据《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。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期未发生重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年9月18日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、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》及其他相关税务法规和实务操作，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，不缴纳营业税。

2. 对证券投资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，暂不缴纳企业所得税。

3. 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴个人所得税，个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，于2015年9月8日前暂减按25%计入应纳税所得额，自2015年9月8日起暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

4.对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

5.对于基金从事A股买卖，出让方按0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。

6.基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免予缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中原英石基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
兴业银行股份有限公司	基金托管人
中原证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
安石投资管理有限公司	基金管理人的股东

注：下述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年2月10日至2015年12月31日 成交金额	占当期股票成交总额的比例
中原证券股份有限公司	24,429,181.98	18.32%

7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.3 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2月10日至2015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
中原证券股份有限公司	17,664.09	16.83%	6,436.91	43.34%

注：1、交易佣金的计算方式：以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

2、上述交易佣金比率按市场佣金率计算，在合理商业条款范围内并符合行业标准。

3、本基金管理人因此从关联方获得的其他业务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年2月10日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	188,765.07
其中：支付销售机构的客户维护费	3,564.12

注：支付基金管理人中原英石基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提，每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：每日应计提的基金管理费=前一日的基金资产净值×1.50%÷当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年2月10日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	31,460.83

注：支付基金托管人兴业银行股份有限公司本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提，每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：每日应计提的基金托管费=前一日的基金资产净值×0.25%÷当年天数。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本报告期内，本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：人民币元

项目	本期 2015年2月10日至2015年12月31日
基金合同生效日（2015年2月10日）持有的基金份额	10,001,375.14
报告期初持有的基金份额	-
报告期间申购/买入总份额	-
报告期间因拆分变动份额	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-
报告期末持有的基金份额	10,001,375.14
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	61.70%

注：本基金管理人按照本基金基金合同、招募说明书的约定费率进行认购、申购和赎回，不享有比其他投资人更优惠的费率。

7.4.8.4.2 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

报告期末，其他关联方均未投资本基金。

7.4.8.5 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 2015年2月10日至2015年12月31日 期末余额	当期利息收入
兴业银行股份有限公司	7,662,305.66	70,032.02

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。除上表列示的金额外，本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，2015年2月10日（基金合同生效日）至2015年12月31日止期间获得的备付金利息收入为人民币952.48元，2015年12月31日结算备付金余额为人民币79,304.89元。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内，本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本报告期内，本基金无其他关联交易事项。

7.4.9 期末（2015年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本报告期末（2015年12月31日），本基金未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限的证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本报告期末（2015年12月31日），本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2015年12月31日止，本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2015年12月31日止，本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于2015年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为4,254,541.00元，属于第二层次的余额为758,665.40元，无属于第三层次的余额。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。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），本基金于2015年3月25日起改为采用中证指数有限公司根据《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（附注7.4.5.2），并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2015年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§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	4,254,541.00	33.21
	其中：股票	4,254,541.00	33.21
2	固定收益投资	758,665.40	5.92
	其中：债券	758,665.40	5.92
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	7,741,610.55	60.44
7	其他各项资产	54,976.64	0.43
8	合计	12,809,793.59	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,686,328.00	21.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	331,200.00	2.60
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	1,228,218.00	9.65
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	8,795.00	0.07
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	4,254,541.00	33.43

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	600807	天业股份	50,800	879,348.00	6.91
2	002171	楚江新材	32,600	781,748.00	6.14
3	000823	超声电子	62,000	722,300.00	5.68
4	002335	科华恒盛	10,700	513,600.00	4.04
5	600510	黑牡丹	29,000	348,870.00	2.74
6	300207	欣旺达	12,300	345,630.00	2.72
7	000939	凯迪生态	23,000	331,200.00	2.60
8	002180	艾派克	7,000	323,050.00	2.54
9	300492	山鼎设计	500	8,795.00	0.07

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本基金管理人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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	002450	康得新	1,655,986.00	13.01
2	600373	中文传媒	1,497,888.98	11.77
3	600580	卧龙电气	1,381,639.00	10.86
4	600885	宏发股份	1,331,432.00	10.46
5	000301	东方市场	1,270,484.00	9.98
6	600835	上海机电	1,204,340.00	9.46
7	000918	嘉凯城	1,092,080.00	8.58
8	601318	中国平安	988,160.00	7.77
9	002065	东华软件	978,378.00	7.69
10	002250	联化科技	935,533.00	7.35
11	002701	奥瑞金	925,493.00	7.27
12	002185	华天科技	922,617.00	7.25
13	300090	盛运环保	919,168.00	7.22
14	000977	浪潮信息	918,528.00	7.22
15	002538	司尔特	917,707.92	7.21
16	600335	国机汽车	916,048.00	7.20
17	300113	顺网科技	888,060.00	6.98
18	002508	老板电器	856,994.34	6.73
19	000958	东方能源	843,025.00	6.62
20	600525	长园集团	841,258.68	6.61
21	000970	中科三环	835,890.19	6.57
22	000400	许继电气	823,368.00	6.47
23	000030	富奥股份	816,589.75	6.42
24	002630	华西能源	814,941.00	6.40
25	002496	辉丰股份	807,277.75	6.34
26	300082	奥克股份	803,489.40	6.31
27	000417	合肥百货	788,902.00	6.20
28	000703	恒逸石化	788,146.54	6.19
29	002171	楚江新材	772,957.00	6.07
30	000782	美达股份	772,450.00	6.07
31	000823	超声电子	770,600.00	6.06
32	002309	中利科技	758,728.00	5.96
33	601678	滨化股份	749,456.00	5.89
34	002518	科士达	741,187.00	5.82
35	002230	科大讯飞	734,640.00	5.77
36	600807	天业股份	729,647.86	5.73
37	002267	陕天然气	722,964.96	5.68
38	000885	同力水泥	719,631.00	5.66
39	300274	阳光电源	715,997.00	5.63
40	002179	中航光电	713,605.00	5.61
41	002563	森马服饰	705,945.00	5.55
42	002454	松芝股份	703,238.02	5.53
43	300389	艾比森	689,657.00	5.42
44	600048	保利地产	673,679.00	5.29
45	600409	三友化工	668,342.00	5.25
46	002050	三花股份	667,000.00	5.24
47	600837	海通证券	660,522.00	5.19
48	300273	和佳股份	658,714.00	5.18
49	600270	外运发展	653,983.00	5.14
50	002462	嘉事堂	650,598.00	5.11
51	600153	建发股份	644,343.00	5.06
52	600351	亚宝药业	642,232.87	5.05
53	000488	晨鸣纸业	639,754.89	5.03
54	002601	佰利联	639,400.84	5.02
55	600115	东方航空	637,944.00	5.01
56	600066	宇通客车	634,843.00	4.99
57	603188	亚邦股份	634,490.00	4.99
58	002595	豪迈科技	625,621.00	4.92
59	000910	大亚科技	621,700.00	4.89
60	601555	东吴证券	613,078.00	4.82
61	002475	立讯精密	604,264.00	4.75
62	002585	双星新材	603,301.94	4.74
63	000550	江铃汽车	593,899.00	4.67
64	002572	索菲亚	592,050.63	4.65
65	000712	锦龙股份	590,826.00	4.64
66	002056	横店东磁	577,589.29	4.54
67	000949	新乡化纤	573,567.00	4.51
68	601877	正泰电器	564,908.00	4.44
69	600150	中国船舶	555,185.00	4.36
70	000826	启迪桑德	531,814.00	4.18
71	002472	双环传动	507,820.00	3.99
72	000651	格力电器	503,472.00	3.96
73	002367	康力电梯	500,892.50	3.94
74	002322	理工监测	445,201.00	3.50
75	002324	普利特	424,950.00	3.34
76	002007	华兰生物	420,553.00	3.30
77	000748	长城信息	388,450.00	3.05
78	600970	中材国际	377,754.00	2.97
79	600510	黑牡丹	375,242.00	2.95
80	002620	瑞和股份	374,002.00	2.94
81	002335	科华恒盛	373,748.00	2.94
82	002180	艾派克	371,870.00	2.92
83	000939	凯迪生态	368,230.00	2.89
84	300174	元力股份	367,417.00	2.89
85	000061	农 产 品	365,563.00	2.87
86	600094	大名城	363,600.00	2.86
87	002521	齐峰新材	363,309.00	2.86
88	300207	欣旺达	359,720.00	2.83
89	600487	亨通光电	355,731.00	2.80
90	000957	中通客车	354,952.00	2.79
91	002531	天顺风能	353,676.00	2.78
92	300007	汉威电子	352,439.00	2.77
93	600705	中航资本	349,254.00	2.74
94	002729	好利来	340,816.00	2.68
95	600990	四创电子	339,750.00	2.67
96	300199	翰宇药业	335,808.00	2.64
97	600703	三安光电	306,414.00	2.41
98	300353	东土科技	296,854.00	2.33
99	002449	国星光电	296,659.00	2.33
100	002283	天润曲轴	287,775.99	2.26
101	601688	华泰证券	281,703.00	2.21
102	601328	交通银行	279,680.00	2.20
103	300050	世纪鼎利	278,514.00	2.19
104	002294	信立泰	277,109.00	2.18

注：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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600373	中文传媒	1,695,877.00	13.33
2	002450	康得新	1,481,978.96	11.65
3	000301	东方市场	1,288,906.22	10.13
4	600885	宏发股份	1,154,779.73	9.07
5	002065	东华软件	1,078,093.00	8.47
6	600580	卧龙电气	1,060,775.00	8.34
7	000918	嘉凯城	1,039,173.00	8.17
8	600335	国机汽车	999,032.00	7.85
9	300273	和佳股份	982,281.00	7.72
10	601318	中国平安	945,856.00	7.43
11	601678	滨化股份	929,739.00	7.31
12	600525	长园集团	894,358.44	7.03
13	002508	老板电器	889,118.55	6.99
14	600835	上海机电	887,676.50	6.98
15	300090	盛运环保	871,376.00	6.85
16	002267	陕天然气	848,946.00	6.67
17	000703	恒逸石化	836,602.71	6.57
18	002701	奥瑞金	829,274.00	6.52
19	002630	华西能源	819,455.00	6.44
20	002454	松芝股份	816,092.00	6.41
21	600153	建发股份	808,678.00	6.35
22	002563	森马服饰	770,855.00	6.06
23	002518	科士达	738,300.00	5.80
24	002472	双环传动	737,458.00	5.80
25	002250	联化科技	710,188.00	5.58
26	000977	浪潮信息	708,343.80	5.57
27	300274	阳光电源	707,276.00	5.56
28	002309	中利科技	703,322.00	5.53
29	000030	富奥股份	695,358.07	5.46
30	002179	中航光电	691,750.00	5.44
31	002230	科大讯飞	687,419.70	5.40
32	600048	保利地产	676,837.00	5.32
33	000712	锦龙股份	656,820.00	5.16
34	600115	东方航空	652,884.00	5.13
35	002496	辉丰股份	644,056.00	5.06
36	002538	司尔特	638,838.00	5.02
37	002601	佰利联	635,396.00	4.99
38	600409	三友化工	633,906.00	4.98
39	600837	海通证券	633,220.00	4.98
40	000651	格力电器	629,507.00	4.95
41	000488	晨鸣纸业	628,567.75	4.94
42	000910	大亚科技	625,383.00	4.91
43	600351	亚宝药业	622,412.00	4.89
44	002185	华天科技	611,935.06	4.81
45	002462	嘉事堂	608,160.00	4.78
46	000949	新乡化纤	607,362.00	4.77
47	002475	立讯精密	603,816.00	4.75
48	300113	顺网科技	601,463.00	4.73
49	002367	康力电梯	595,041.00	4.68
50	600150	中国船舶	589,730.00	4.63
51	601877	正泰电器	589,716.00	4.63
52	000550	江铃汽车	582,762.00	4.58
53	000417	合肥百货	580,312.00	4.56
54	002585	双星新材	574,721.20	4.52
55	002572	索菲亚	573,696.00	4.51
56	002056	横店东磁	569,737.00	4.48
57	600270	外运发展	557,220.00	4.38
58	300082	奥克股份	549,007.98	4.31
59	601555	东吴证券	545,856.00	4.29
60	002050	三花股份	541,720.00	4.26
61	000970	中科三环	540,085.00	4.24
62	600990	四创电子	518,740.00	4.08
63	600066	宇通客车	496,642.00	3.90
64	000400	许继电气	481,526.00	3.78
65	603188	亚邦股份	476,360.00	3.74
66	000958	东方能源	464,777.00	3.65
67	002324	普利特	454,524.00	3.57
68	000782	美达股份	447,052.00	3.51
69	002322	理工监测	438,207.00	3.44
70	600970	中材国际	435,512.00	3.42
71	300007	汉威电子	433,495.00	3.41
72	002595	豪迈科技	428,720.00	3.37
73	002007	华兰生物	428,374.00	3.37
74	300389	艾比森	423,408.86	3.33
75	000885	同力水泥	418,037.00	3.29
76	000826	启迪桑德	403,920.00	3.17
77	002729	好利来	401,844.00	3.16
78	600487	亨通光电	395,791.00	3.11
79	000061	农 产 品	392,033.00	3.08
80	002531	天顺风能	385,152.00	3.03
81	002620	瑞和股份	383,476.00	3.01
82	600705	中航资本	368,234.00	2.89
83	300174	元力股份	366,660.00	2.88
84	000748	长城信息	362,350.00	2.85
85	002521	齐峰新材	361,700.00	2.84
86	600094	大名城	347,784.00	2.73
87	002294	信立泰	347,698.00	2.73
88	000957	中通客车	327,084.00	2.57
89	002283	天润曲轴	321,598.00	2.53
90	300353	东土科技	319,949.00	2.51
91	601688	华泰证券	316,004.00	2.48
92	600703	三安光电	307,380.00	2.42
93	300050	世纪鼎利	300,904.00	2.36
94	002449	国星光电	293,359.00	2.31
95	601328	交通银行	286,220.00	2.25

注：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

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	70,460,706.99
卖出股票的收入（成交）总额	62,960,085.25

注："买入股票成本"或"卖出股票收入"均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	758,665.40	5.96
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	758,665.40	5.96

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019509	15国债09	7,570	758,665.40	5.96

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持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

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

根据本基金基金合同的约定，本基金不进行国债期货交易。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

根据本基金基金合同的约定，本基金不进行国债期货交易。

8.11.3 本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同的约定，本基金不进行国债期货交易。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责处罚的情况。

8.12.2本报告期内，本基金投资的前十名股票中没有出现超出基金合同规定备选股票库的情形。

8.12.3 期末其他各项资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	22,445.95
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	16,554.66
5	应收申购款	15,976.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	54,976.64

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§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

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 持有份额	机构投资者 占总份额比例	个人投资者 持有份额	个人投资者 占总份额比例
484	33,490.02	10,001,375.14	61.70%	6,207,793.11	38.30%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	236,863.60	1.46%

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情况

项目	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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,001,375.14	61.70%	10,001,375.14	61.70%	3年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,001,375.14	61.70%	10,001,375.14	61.70%	-

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年2月10日）基金份额总额	13,557,227.44
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	4,854,010.22
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	2,202,069.41
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	16,209,168.25

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

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、基金管理人的重大人事变动情况

本报告期内基金管理人未发生重大人事变动。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日（2015年2月10日）起聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，本报告期内本基金未改聘为其提供审计服务的会计师事务所。本报告期内应支付的审计费用为人民币伍万元整。

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

本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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 成交金额	股票交易 占股票成交总额比例	应支付该券商的佣金 佣金	应支付该券商的佣金 占当期佣金总量的比例	备注
国海证券	1	22,939,983.34	17.20%	16,443.37	15.67%	
海通证券	1	38,171,439.03	28.62%	27,281.46	25.99%	
兴业证券	1	32,475,356.85	24.35%	29,584.24	28.19%	
招商证券	1	15,365,821.04	11.52%	13,988.83	13.33%	
中原证券	2	24,429,181.98	18.32%	17,664.09	16.83%	

注：1、交易单元的选择标准和程序

拟被基金管理人租用交易单元的券商应符合以下标准：

（1）市场形象及财务状况良好。

（2）经营行为规范，内控制度健全，最近一年未因发生重大违规行为而受到国家监管部门的处罚。

（3）内部管理规范、严格，具备能够满足基金高效、安全运作的通讯条件。

（4）研究实力较强，具有专门的研究机构和专职研究人员，能及时、定期、全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析的研究报告及周到的信息服务。

根据上述标准进行考察后，由基金管理人的投资决策委员会确定租用券商的交易单元，并由基金管理人与被选择的券商签订协议。

2、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况

上述交易单元均为在本报告期内新增。

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

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易 成交金额	债券交易 占债券成交总额比例	债券回购交易 成交金额	债券回购交易 占债券回购成交总额比例	权证交易 成交金额	权证交易 占权证成交总额比例
国海证券	759,876.50	52.94%	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中原证券	675,348.00	47.06%	-	-	-	-

中原英石基金管理有限公司
二〇一六年三月二十五日