

永赢量化灵活配置混合型发起式证券投资基金2015年年度报告

2015年12月31日

基金管理人：永赢基金管理有限公司

基金托管人：华泰证券股份有限公司

送出日期：2016年3月26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。

基金托管人华泰证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年3月23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。

本报告中财务资料经审计。

本报告期自2015年9月1日（基金合同生效日）起至2015年12月31日止。

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	8
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	10
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明.....	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
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.....	15
§6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息.....	15
6.2 审计报告的基本内容.....	15
§7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表.....	17
7.2 利润表.....	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20
7.4 报表附注.....	21
§8 投资组合报告	44
8.1 期末基金资产组合情况.....	44
8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合.....	45
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	46
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	52
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	57
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.....	57
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	57
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.....	57
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.....	57
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	57
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	58
8.12 投资组合报告附注.....	58
§9 基金份额持有人信息	59
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	59
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	59
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.....	59
§10 开放式基金份额变动	60
§11 重大事件揭示	60
11.1 基金份额持有人大会决议.....	60

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	60
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	61
11.4 基金投资策略的改变	61
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	61
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	61
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	61
11.8 其他重大事件	61
§12 影响投资者决策的其他重要信息	62
§13 备查文件目录	62
13.1 备查文件目录	62
13.2 存放地点	63
13.3 查阅方式	63

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	永赢量化灵活配置混合型发起式证券投资基金
基金简称	永赢量化灵活配置混合发起式
基金主代码	001754
交易代码	001754
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年9月1日
基金管理人	永赢基金管理有限公司
基金托管人	华泰证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	123,213,745.72
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过灵活应用多种量化策略，在充分控制基金财产风险和保证基金财产流动性的基础上，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金财产的长期稳健增值。
投资策略	<p>本基金采用多因子选股策略为主，辅以事件驱动以及宏观择时等其他量化策略，力争实现稳定的绝对回报。</p> <p>1、多因子选股策略</p> <p>该策略以对中国股票市场较长期的回测研究为基础，运用量化多因子模型框架，结合定性指标和定量指标，综合考虑上市公司基本经营状况和市场对股票的反应两大因素，通过计算市场上所有股票的管理质量、价值、成长变化、市场情绪以及行业特殊因素等量化因子，将计算结果组合成alpha模型，同时结合风险模型构建股票现货组合。基金经理根据市场状况及变化对各类信息的重要性做出具有一定前瞻性的判断，适时调整各因子类别的具体组成及权重。</p> <p>(1) 基本面因子</p>

管理质量：利用计算横截面多种比率来判断上市公司的报表质量以及管理能力，例如衡量报表质量的应收应付因子，衡量管理能力的周转率、偿债能力、ROA和ROE等因子；

成长变化：通过计算时间序列上各种比率的变化来衡量公司基本面的成长性；

价值：判断公司的股票价格相对于它的内在价值是否合理。由于内在价值无法直接计算，我们通过计算全市场所有公司的利润、销售量、总资产等多种指标来综合间接反映公司的内在价值。

（2）市场因子

市场情绪：从技术面的动量、反转、枢轴突破等指标来衡量投资者情绪；

分析师预测：通过扫描市场上分析师观点的变化来预测市场反应。

2、事件驱动策略

该策略通过对某些公司事件和市场事件的研究，分析事件对股价造成波动的方向，以赚取超额收益。此外，该策略还利用市场上存在的金融产品定价非有效性，实现套利收益。

3、宏观择时策略

该策略通过计算和跟踪多种宏观经济变量和市场变量，运用计量经济学方法对未来大盘走势进行预测。

4、其他投资策略

（1）债券投资策略

出于对流动性、有效利用基金财产的考虑，本基金适时对债券进行投资。通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势等因素，制定久期控制下的投资策略，构造能够提供稳定收益的债券和货币市场工具组合。

（2）金融衍生工具投资策略

在法律法规允许的范围内，本基金可基于谨慎原则运用权证、股票指数期货等相关金融衍生工具对基金投

	投资组合进行管理，以控制投资组合风险、提高投资效率，从而更好地实现本基金的投资目标。
业绩比较基准	95%*沪深300指数收益率+5%*银行活期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，预期风险和预期收益水平高于货币市场基金、债券型基金，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	永赢基金管理有限公司	华泰证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	毛慧
	联系电话	021-51690145
	电子邮箱	maoh@maxwealthfund.com
客户服务电话	021-51690111	95597
传真	021-51690177	025-83387215
注册地址	浙江省宁波市江东区中山东路466号	江苏省南京市江东中路228号
办公地址	上海市浦东新区世纪大道210号21世纪大厦27楼	江苏省南京市江东中路228号
邮政编码	200120	210019
法定代表人	罗维开	吴万善

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.maxwealthfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市世纪大道100号环球金融中心50楼
注册登记机构	永赢基金管理有限公司登记注册中心	上海市世纪大道210号21世纪中心大厦27楼

§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9月1日（基金合同生效日）至2015年12月31日
本期已实现收益	14,593,008.03
本期利润	14,346,110.20
加权平均基金份额本期利润	0.0539
本期加权平均净值利润率	5.35%
本期基金份额净值增长率	6.80%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末
期末可供分配利润	8,371,341.21
期末可供分配基金份额利润	0.0679
期末基金资产净值	131,585,086.93
期末基金份额净值	1.068
3.1.3 累计期末指标	2015年末
基金份额累计净值增长率	6.80%

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，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、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、期末可供分配利润为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。

4、本基金合同生效日为2015年9月1日，截至本报告期末未满一年。

3.2 基金净值表现

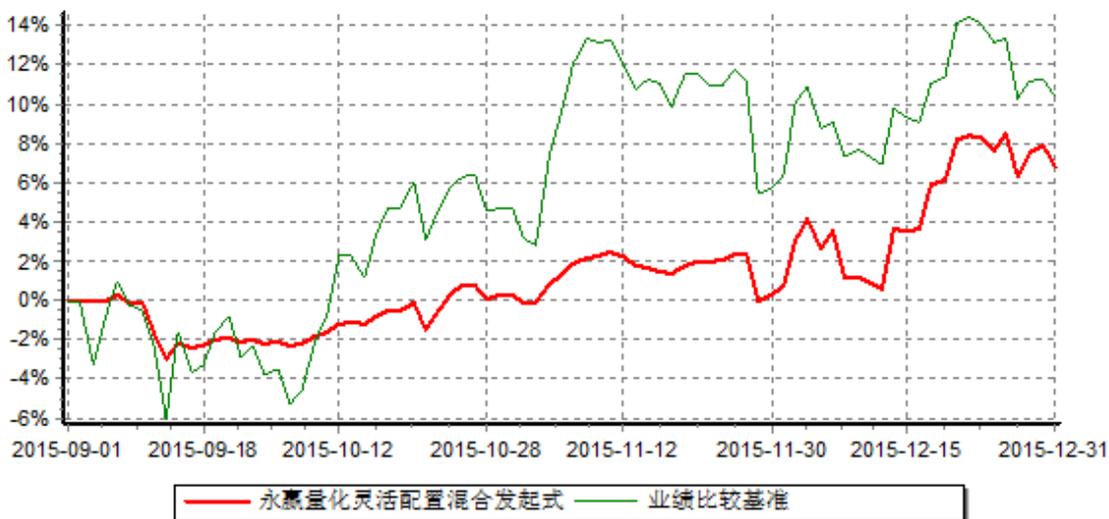
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	9.20%	0.92%	15.65%	1.59%	-6.45%	-0.67%
自基金合同生效日起至今（2015年09月01日-2015年12月31日）	6.80%	0.85%	10.33%	1.71%	-3.53%	-0.86%

注：1、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；

2、本基金业绩比较基准为95%*沪深300指数收益率+5%*银行活期存款利率（税后）。

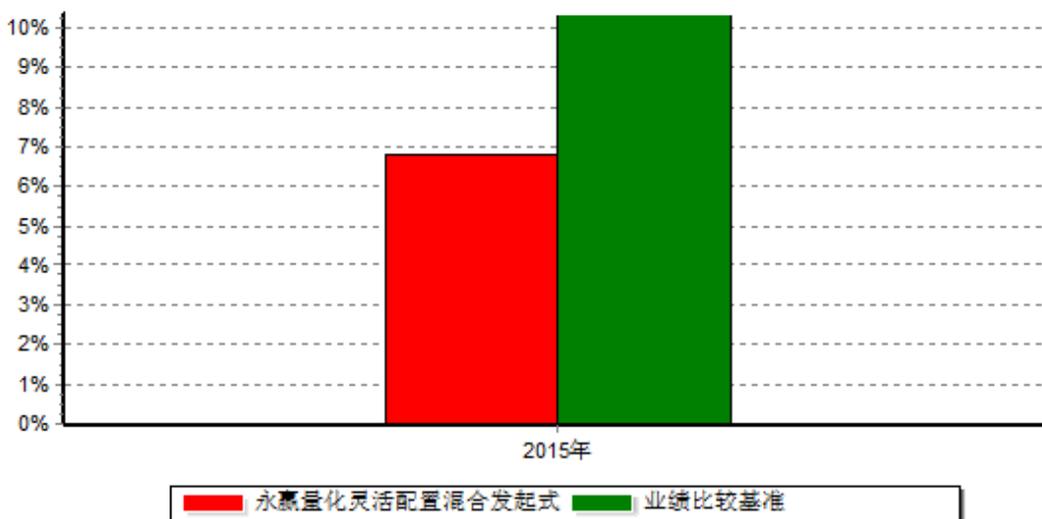
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、本基金合同生效日为2015年9月1日，截至本报告期末本基金合同生效未满一年。

2、本基金的建仓期为自基金合同生效日起6个月，截至本报告期末，本基金尚处于建仓期。

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



注：图中列示的2015年度基金净值增长率按该年度本基金实际存续期9月1日（基金合同生效日）起至12月31日止计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金的合同生效日为2015年9月1日，截至2015年12月31日，本基金未进行过利润分配。

§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

本基金管理人----永赢基金管理有限公司于2013年10月8日取得了中国证监会《关于核准设立永赢基金管理有限公司的批复》（证监许可〔2013〕1280号），随后，本基金管理人于2013年10月11日取得商务部《中华人民共和国外商投资企业批准证书》（商外资资审字〔2013〕0008号），并于2013年11月7日在国家工商行政管理总局注册成立。此后，于2013年11月12日取得中国证监会核发的《基金管理资格证书》（编号A087）。

截止2015年12月31日，本基金管理人共管理4只开放式证券投资基金，即永赢货币市场基金、永赢量化混合型发起式证券投资基金、永赢量化灵活配置混合型发起式证券投资基金、永赢稳益债券型证券投资基金。

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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张大木	总经理	2015年9月1	—	14	硕士，14年金融行业投资

	助理兼 量化投 资总监	日			研究经验，曾任美国沃顿商学院高级数据分析师；巴克莱全球投资公司（BGI）投资分析员；博时基金管理有限公司投资经理兼量化分析师。现任永赢基金管理有限公司总经理助理兼量化投资总监。
--	-------------------	---	--	--	--

注：1、任职时间和离任日期一般情况下指本基金管理人作出决定之日；若该基金经理自基金合同生效日期即任职，则任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《永赢量化灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

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

为了公平对待投资人，保护投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行，本基金管理人根据《证券投资基金法》、《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》等法律法规和内部制度，制定和修订了《公平交易制度》。

通过组织结构的设置、工作制度、流程和技术手段全面落实公平交易原则在具体业务（包括研究分析、投资决策、交易执行等）环节中的实现，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。同时，通过对投资交易行为的日常监控和事后分析评估来加强对公平交易过程和结果的监督。

在研究分析方面，本基金管理人建立了规范、完善的研究管理平台，规范了研究人员的投资建议、研究报告的发布流程，使各投资组合经理在获取投资建议的及时性、准确性及深度等方面得到公平对待。

在投资决策方面，首先，本基金管理人建立健全投资授权制度，明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限。投资决策委员会和投资总监等管理机构和人员不得对投资经理在授权范围内的投资活动进行干预。投资经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作必须经过严格的审批程序；其次，本基金管理人建立投资组合投资信息的管理及保密制度，除分管投资副总及投资总监等因业务管理的需要外，不同投资经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离；另外，本基金管理人还建立机制要求公募投资经理与特定客户资产投资经理互相隔离，且不能互相授权投资事宜。

在交易执行方面，本基金管理人设立了独立于投资管理职能的交易部，通过实行集中交易制度和公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会；此外，本基金管理人对于可能导致涉嫌不公平交易和利益输送的反向交易行为也制定并落实了严格的管理：（1）对于交易所公开竞价的同向交易，交易部按照“时间优先、价格优先”的原则，采取“未委托数量比例法”，通过系统的公平交易模块实现公平交易；（2）对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以本基金管理人名义进行的交易，各投资经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，交易部按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；（3）对于银行间市场的现券交易，交易部在银行间市场开展独立、公平的询价，并由监察稽核部对交易价格的公允性（根据市场公认的第三方信息）、交易对手和交易方式进行事后审核，确保交易得到公平和公允的执行。对于由于特殊原因不能参与以上提到的公平交易程序的交易指令，投资经理须提出申请并阐明具体原因，交由交易总监及监察稽核总监进行严格的公平性审核；（4）严格禁止同一投资组合或不同投资组合之间在同一交易日内进行反向交易（除完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合或严格依据量化模型进行投资的组合外）。确因投资组合的投资策略或流动性等需要而发生的不同投资组合之间的同日反向交易，相关投资经理须向风险管理委员会提供决策依据并留存记录备查。

在日常监控和事后分析评估方面，监察稽核部开展日内和定期的工作对公平交易执行情况作整体监控和效果评估。其中日常监控包括了日内不定点对交易系统的抽查监控；对非公开发行股票申购、以本基金管理人名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程进行审核和监控；以及对银行间交易过程中投资组合与交易对手之间议价交易的交易方式和交易价格的公允性进行审查。事后分析评估上，监察稽核部在每个季度的《公平交易报告》中，对不同组合间同一投资标的、临近交易日的同向交易和反向交易的合理性开展分析评估。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人

规定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等，并重视交易执行环节的公平交易措施，以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统内的公平交易模块，以尽可能确保公平对待各投资组合。

本基金管理人交易部和监察稽核部进行日常投资交易行为监控，监察稽核部负责对各账户公平交易进行事后分析，于每季度分别对所管理的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同向交易的交易价差进行分析，通过分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

报告期内本基金管理人严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，未发现任何违反公平交易的行为。本报告期内，公平交易制度执行情况良好。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

自本基金成立至2015年末，A股市场震荡上扬，个股热点较为活跃。在此背景下，采用量化选股策略的产品体现出较好的选股及风险控制能力。

在本报告期内，本基金遵循稳健原则，在成立之后逐步建仓。由于建仓期间基准指数出现较大幅度反弹，基金单位净值增长未能超越基准指数，但剔除建仓因素影响后，本基金选股策略筛选出的股票组合表现优异，收益率明显超越基准指数。因此，本基金建仓完成后，逐步缩小与基准指数之间的差距，体现了本基金投资策略的有效性。

未来，我们将继续保持谨慎，灵活配置基金资产，在进一步有效控制产品风险的前提下，保证本产品的平衡运行。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金自2015年9月1日（基金合同生效日）至2015年12月31日的净值增长率为6.80%，同期业绩比较基准收益率为10.33%。

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，中国经济将迎接经济结构转型、改变增长模式的挑战。美联储加息将吸引国际逐利资本从新兴市场回流美国，新兴市场受此影响面临动荡。结合宽松的货币政策与注册制带来的压力，2016年A股市场不确定性增加，较大概率将维持区间震荡。期间，严格控制投资风险，重点把握阶段性及结构性机会将是较好的选择。在此背景下，通过量化模型选股分散个股风险，动态捕捉市场机会的量化灵活配置策略具有独特的优势。未来，我们将在严格控制本基金投资风险的前提下审慎决策，灵活配置基金资产，保证本基金的稳健运行。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2015年,本基金管理人的内部监察稽核工作以保障合规运作和投资者合法权益为出发点,坚持独立、客观、公正的原则,持续开展了系列检查、合规培训、制度修订等工作。

本报告期内,本基金管理人的监察稽核工作主要包括:

1.内部检查。2015年内,开展了业务部门的例行内审,针对投研人员行为操守的专项检查和其他专项审查。

2.合规培训。2015年是我国资管市场快速增长的一年,各类新的法律法规监管要求层出不穷。在这样的背景下本基金管理人在本年度内共组织了多次不同层次的合规培训。培训内容包含最新法律法规以及监管精神的解读、核心业务条线所面临的主要风险点及其防范等内容,加深了员工合规意识,深化员工对于法律法规的理解。

本报告期内,本基金管理人未发现本基金在投资运作等方面存在与法律法规或基金合同约定相违背的情况。本基金管理人将继续坚持确保基金份额持有人的利益不受损害的原则,以科学的风险管理为基础,积极有效的开展监察稽核工作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定,设有估值委员会,并制定了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督,确保基金估值的公允与合理。报告期内相关基金估值政策由托管银行进行复核。本基金管理人估值委员会由分管运营副总经理负责,成员包括总经理、督察长、分管投资的副总经理、分管运营的副总经理、基金运营部负责人、监察稽核部负责人,均具有丰富的行业分析、会计核算等证券投资基金行业从业经验及专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况,可向估值委员会报告并提出相关意见和建议,但不参与最终估值决策。参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突,一切以投资者利益最大化为最高准则。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配,符合相关法规及基金合同的规定。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

本报告期内,未发生会计师事务所出具非标准审计报告的情形。

4.10 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

本报告期内,本基金未发生基金持有人数或基金资产净值预警的情形。

§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，本基金托管人在对永赢量化灵活配置混合型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规的规定和基金合同、托管协议的相关约定，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，本基金托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定，对本基金的管理人永赢基金管理有限公司在本基金的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金的管理人--永赢基金管理有限公司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

本基金托管人依法对永赢基金管理有限公司编制和披露的永赢量化灵活配置混合型发起式证券投资基金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

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2016）审字第61090672_B03号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	永赢量化灵活配置混合型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的永赢量化灵活配置混合型发起

	式证券投资基金财务报表,包括2015年12月31日的资产负债表和2015年9月1日(基金合同生效日)至2015年12月31日的利润表及所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是基金管理人永赢基金管理有限公司的责任。这种责任包括:(1)按照企业会计准则的规定编制财务报表,并使其实现公允反映;(2)设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p>
审计意见段	我们认为,上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了永赢量化灵活配置混合型发起式证券投资基金2015年12月31日的财务状况以及2015年9月1日(基金合同生效日)至2015年12月31日的经营成果和净值变动情况。
注册会计师的姓名	郭杭翔、濮晓达
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)

会计师事务所的地址	上海市世纪大道100号环球金融中心50楼
审计报告日期	2016-03-24

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：永赢量化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	27,887,218.69
结算备付金		16,709,959.89
存出保证金		414,660.12
交易性金融资产	7.4.7.2	89,349,325.91
其中：股票投资		89,349,325.91
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	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	10,525.37
应收股利		—
应收申购款		110,700.94
递延所得税资产		—
其他资产	7.4.7.6	—
资产总计		134,482,390.92
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		1,346,310.80
应付管理人报酬		227,916.35
应付托管费		30,388.86
应付销售服务费		—
应付交易费用	7.4.7.7	1,154,305.57
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	138,382.41
负债合计		2,897,303.99
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	123,213,745.72
未分配利润	7.4.7.10	8,371,341.21
所有者权益合计		131,585,086.93
负债和所有者权益总计		134,482,390.92

注：1、报告截止日2015年12月31日，基金份额净值1.068元，基金份额总额123,213,745.72份。

2、本财务报表的实际编制期间为2015年9月1日(基金合同生效日)至2015年12月31日。

7.2 利润表

会计主体：永赢量化灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2015年9月1日（基金合同生效日）至2015年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
----	-----	----

		2015年9月1日（基金合同生效日）至2015年 12月31日
一、收入		18,105,720.91
1.利息收入		1,055,495.53
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,055,495.53
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）		16,832,566.56
其中：股票投资收益	7.4.7.12	16,773,097.30
基金投资收益		—
债券投资收益	7.4.7.13	—
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	59,469.26
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-246,897.83
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	464,556.65
减：二、费用		3,759,610.71
1. 管理人报酬		1,342,866.66
2. 托管费		179,048.91
3. 销售服务费		—
4. 交易费用	7.4.7.18	2,102,295.30
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	135,399.84

三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		14,346,110.20
减：所得税费用		—
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		14,346,110.20

注：本财务报表的实际编制期间为2015年9月1日(基金合同生效日)至2015年12月31日。

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：永赢量化灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2015年9月1日(基金合同生效日)至2015年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2015年9月1日(基金合同生效日)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)	302,140,249.57	—	302,140,249.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	14,346,110.20	14,346,110.20
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)	-178,926,503.85	-5,974,768.99	-184,901,272.84
其中：1.基金申购款	799,662.25	53,033.04	852,695.29
2.基金赎回款	-179,726,166.10	-6,027,802.03	-185,753,968.13
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)	123,213,745.72	8,371,341.21	131,585,086.93

注：本财务报表的实际编制期间为2015年9月1日(基金合同生效日)至2015年12月31日。

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：

宋宜农

田中甲

田中甲

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

永赢量化灵活配置混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”），系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[2015]1700号文《关于准予永赢量化灵活配置混合型发起式证券投资基金注册的批复》的核准，由永赢基金管理有限公司作为管理人自2015年8月17日至2015年8月28日止期间向社会公开发行募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2015）验字第61090672_B11号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2015年9月1日正式生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币302,044,785.92元，募集资金在募集期间产生的利息为人民币95,463.65元，以上实收基金（本息）共计人民币302,140,249.57元，折合302,140,249.57份基金份额。本基金的基金管理人及注册登记机构为永赢基金管理有限公司，基金托管人为华泰证券股份有限公司。

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（国债、金融债、企业/公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、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（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金股票资产的投资比例占基金资产的0-95%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。本基金参与股指期货交易后，应符合法律法规规定和基金合同约定的投资限制并遵守相关期货交易所的业务规则。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{沪深300指数收益率} + 5\% \times \text{银行活期存款利率（税后）}$ 。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）

编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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9月1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照企业会计准则、《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9月1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

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金目前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主要包括股票投资、债券投资和衍生工具；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方(转入方)；本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(4) 股指期货

买入或卖出股指期货投资于成交日确认为股指期货投资。股指期货初始合约价值按成交金额确认；

股指期货平仓于成交日确认衍生工具投资收益，股指期货的初始合约价值按移动加权平均法于成交日结转；

(5) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(6) 回购协议

基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

(1) 存在活跃市场的金融工具

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。估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，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。有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值的，应对最近交易的市价进行调整，确定公允价值。

(2)不存在活跃市场的金融工具

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。本基金采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得/(损失)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确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，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)存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期

存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2)债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3)资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4)买入返售金融资产收入，按买入返售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；

(5)股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6)债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7)权证投资收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8)股指期货投资收益/(损失)于平仓日确认，并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账；

(9)股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(10)公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(11)其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

(1)基金管理费按前一日基金资产净值的1.50%的年费率逐日计提；

(2)基金托管费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率逐日计提；

(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。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，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6次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于该次收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的20%，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 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 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)对于特殊事项停牌股票，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》，本基金参考《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票进行估值；

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值；

(3)在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关

于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供；

(4)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

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

7.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税字[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》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

7.4.6.2 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[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》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支

付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，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，暂不征收企业所得税。

7.4.6.3 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[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》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《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》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金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，暂减按25%计入应纳税所得额；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《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》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日
活期存款	27,887,218.69
定期存款	—
其中：存款期限1-3个月	—

其他存款	—
合计	27,887,218.69

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	89,596,223.74	89,349,325.91	-246,897.83
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	—	—
	银行间市场	—	—
	合计	—	—
资产支持证券	—	—	—
基金	—	—	—
其他	—	—	—
合计	89,596,223.74	89,349,325.91	-246,897.83

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日

应收活期存款利息	9,473.66
应收定期存款利息	—
应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	846.45
应收债券利息	—
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	205.26
合计	10,525.37

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日
交易所市场应付交易费用	1,154,305.57
银行间市场应付交易费用	—
合计	1,154,305.57

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	3,382.57
预提费用	134,999.84
合计	138,382.41

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2015年9月1日（基金合同生效日）至2015年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	302,140,249.57	302,140,249.57
本期申购	799,662.25	799,662.25
本期赎回（以“-”号填列）	-179,726,166.10	-179,726,166.10
本期末	123,213,745.72	123,213,745.72

注：本基金自2015年8月17日至2015年8月28日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币302,044,785.92元。根据《永赢量化灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币95,463.65元在本基金成立后，折算为95,463.65份基金份额，划入基金份额持有人账户。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	—	—	—
本期利润	14,593,008.03	-246,897.83	14,346,110.20
本期基金份额交易产生的变动数	-4,096,629.36	-1,878,139.63	-5,974,768.99
其中：基金申购款	51,167.19	1,865.85	53,033.04
基金赎回款	-4,147,796.55	-1,880,005.48	-6,027,802.03
本期已分配利润	—	—	—
本期末	10,496,378.67	-2,125,037.46	8,371,341.21

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2015年9月1日(基金合同生效日)至2015年12月31日
活期存款利息收入	1,048,427.79
定期存款利息收入	—

其他存款利息收入	—
结算备付金利息收入	6,040.98
其他	1,026.76
合计	1,055,495.53

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2015年9月1日(基金合同生效日)至2015年12月31日
卖出股票成交总额	671,119,067.06
减：卖出股票成本总额	654,345,969.76
买卖股票差价收入	16,773,097.30

7.4.7.13 债券投资收益**7.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入**

本基金本报告期无债券投资收益。

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2015年9月1日(基金合同生效日)至2015年12月31日
股票投资产生的股利收益	59,469.26
基金投资产生的股利收益	—
合计	59,469.26

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期
	2015年9月1日(基金合同生效日)至2015年12月31日

1.交易性金融资产	-246,897.83
——股票投资	-246,897.83
——债券投资	—
——资产支持证券投资	—
——基金投资	—
——贵金属投资	—
——其他	—
2.衍生工具	—
——权证投资	—
3.其他	—
合计	-246,897.83

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2015年9月1日(基金合同生效日)至2015年12月31日
基金赎回费收入	464,556.65
合计	464,556.65

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2015年9月1日(基金合同生效日)至2015年12月31日
交易所市场交易费用	2,102,295.30
银行间市场交易费用	—
合计	2,102,295.30

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2015年9月1日(基金合同生效日)至2015年12月31日

审计费用	50,000.00
信息披露费	84,999.84
开户费用	400.00
合计	135,399.84

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
永赢基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
华泰证券股份有限公司("华泰证券")	基金托管人、基金代销机构
宁波银行股份有限公司("宁波银行")	基金管理人的股东、基金代销机构
利安资金管理公司	基金管理人的股东
员工股东	基金管理人的股东
华泰期货有限公司("华泰期货")	基金托管人的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2015年9月1日(基金合同生效日)至2015年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华泰证券股份 有限公司	1,415,061,260.56	100.00%

7.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 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9月1日(基金合同生效日)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
华泰证券股份有限公司	1,305,643.70	100.00%	1,154,305.57	100.00%

注：上述佣金按市场佣金率计算，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。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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年9月1日(基金合同生效日)至2015年12月31日	
	当期发生的基金应支付的管理费	1,342,866.66
其中：支付销售机构的客户维护费	623,630.29	

注：应支付基金管理人永赢基金的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%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×1.50%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2015年9月1日(基金合同生效日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	179,048.91

注：应支付基金托管人华泰证券股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值0.20%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×0.20%/当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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：份

项目	本期
	2015年9月1日(基金合同生效日)至2015年12月31日
基金合同生效日(2015年9月1日)持有的基金份额	10,004,850.00
期初持有的基金份额	—
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	—
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	—
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	—
期末持有的基金份额	10,004,850.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	8.12%

7.4.10.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末

	2015年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
员工股东	988.73	0.00%

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

本基金本报告期末无关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期末存放于华泰期货的结算备付金金额为人民币15,000,000.00元。

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本报告期末未进行利润分配。

7.4.12 期末（2015年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额
000929	兰州黄河	2015-10-09	重大事项	12.50		—	36,800	448,211.44	460,000.00
002231	奥维通信	2015-12-03	重大事项	16.36	2016-03-17	16.00	25,500	416,968.20	417,180.00
60167	滨化	2015-	重大事项	8.02	2016-	7.22	21,200	167,857.14	170,024.00

8	股份	12-31			01-05		0		
00256 7	唐人 神	2015- 11-23	重大事项	12.84	2016- 02-25	11.56	6,900	72,783.71	88,596.00
00208 2	栋梁 新材	2015- 09-18	重大事项	10.21	2016- 03-23	11.23	7,200	76,980.00	73,512.00

注：本基金截至2015年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2015年12月31日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2015年12月31日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只混合型基金，通过灵活应用多种量化策略，在充分控制基金财产风险和保证基金财产流动性的基础上，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金财产的长期稳健增值。本基金管理人已制定针对以上金融工具风险的管理政策和控制制度，并且形成了由本基金管理人在公司层面建立的风险控制委员会以及在董事会层面建立的审计及风险管理委员会负责对与所投资金融工具相关的风险类型、管理政策和各种投资限制的定期回顾、评估和修改，本基金管理人监察稽核部负责具体落实和日常跟踪的工作机制。本基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。本基金面临的主要风险包括：信用风险、流动性风险和市场风险。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在中国工商银行股份有限公司，因而与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，因此违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于2015年12月31日，本基金未持有债券投资。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的10%。本基金所持证券部分在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注7.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。

于2015年12月31日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格

因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末2015 年12月31日	1个月以 内	1-3 个月	3个月 -1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	27,887,2 18.69	—	—	—	—	—	27,887,2 18.69
结算备付金	1,709,95 9.89	—	—	—	—	15,000,0 00.00	16,709,9 59.89
存出保证金	414,660. 12	—	—	—	—	—	414,660. 12
交易性金融 资产	—	—	—	—	—	89,349,3 25.91	89,349,3 25.91
应收利息	—	—	—	—	—	10,525.3 7	10,525.3 7
应收申购款	—	—	—	—	—	110,700. 94	110,700. 94
资产总计	30,011,8 38.70	—	—	—	—	104,470, 552.22	134,482, 390.92
负债							
应付赎回款	—	—	—	—	—	1,346,31	1,346,31

						0.80	0.80
应付管理人 报酬	—	—	—	—	—	227,916. 35	227,916. 35
应付托管费	—	—	—	—	—	30,388.8 6	30,388.8 6
应付交易费 用	—	—	—	—	—	1,154,30 5.57	1,154,30 5.57
其他负债	—	—	—	—	—	138,382. 41	138,382. 41
负债总计	—	—	—	—	—	2,897,30 3.99	2,897,30 3.99
利率敏感度 缺口	30,011,8 38.70	—	—	—	—	101,573, 248.23	131,585, 086.93

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2015年12月31日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配

置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

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（国债、金融债、企业/公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、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（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金股票资产的投资比例占基金资产的0-95%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	89,349,325.91	67.90
交易性金融资产-基金投资	—	—
交易性金融资产-贵金属投资	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—
其他	—	—
合计	89,349,325.91	67.90

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于2015年12月31日，本基金尚不存在足够的经验数据，因此无法对本基金资产净值于市场价格风险的敏感性作定量分析。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值

7.4.14.1.1 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贷款和应收款项以及其他金融负债，

其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

7.4.14.1.2以公允价值计量的金融工具

7.4.14.1.2.1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人民币88,140,013.91元，属于第二层次的余额为人民币1,209,312.00元，无属于第三层次的余额。

7.4.14.1.2.2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、可转换债券、资产支持证券和私募债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别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不将相关股票和债券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或第三层次。

7.4.14.1.2.3第三层次公允价值余额和本期变动金额

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工具第三层次公允价值本期未发生变动。

7.4.14.2承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.14.3其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.14.4财务报表的批准

本财务报表已于2016年3月24日经本基金的基金管理人批准。

§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	89,349,325.91	66.44
	其中：股票	89,349,325.91	66.44

2	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	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	44,597,178.58	33.16
7	其他各项资产	535,886.43	0.40
8	合计	134,482,390.92	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	56,956.00	0.04
B	采矿业	1,536,471.44	1.17
C	制造业	37,342,432.75	28.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,212,653.50	4.72
E	建筑业	2,103,904.00	1.60
F	批发和零售业	6,460,788.37	4.91
G	交通运输、仓储和邮政业	2,238,998.00	1.70
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,510,347.08	3.43
J	金融业	18,874,383.80	14.34
K	房地产业	3,417,454.90	2.60
L	租赁和商务服务业	613,843.00	0.47
M	科学研究和技术服务业	511,756.00	0.39
N	水利、环境和公共设施管理业	516,809.00	0.39

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	1,704,948.00	1.30
S	综合	3,247,580.07	2.47
	合计	89,349,325.91	67.90

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600212	江泉实业	262,113	3,247,580.07	2.47
2	600116	三峡水利	149,200	3,237,640.00	2.46
3	600531	豫光金铅	194,500	3,213,140.00	2.44
4	000001	平安银行	262,000	3,141,380.00	2.39
5	600562	国睿科技	50,100	3,115,719.00	2.37
6	600518	康美药业	181,400	3,074,730.00	2.34
7	600312	平高电气	156,700	3,055,650.00	2.32
8	600529	山东药玻	154,400	2,984,552.00	2.27
9	600753	东方银星	85,000	2,907,000.00	2.21
10	601166	兴业银行	145,400	2,481,978.00	1.89
11	601009	南京银行	109,834	1,944,061.80	1.48
12	300295	三六五网	34,000	1,686,400.00	1.28
13	601998	中信银行	216,700	1,564,574.00	1.19
14	600291	西水股份	47,100	1,371,081.00	1.04
15	601988	中国银行	311,000	1,247,110.00	0.95
16	601318	中国平安	34,400	1,238,400.00	0.94
17	002736	国信证券	57,000	1,125,750.00	0.86
18	000719	大地传媒	50,905	1,038,462.00	0.79
19	600597	光明乳业	64,700	1,030,024.00	0.78

20	000666	经纬纺机	34,201	1,027,740.05	0.78
21	600015	华夏银行	84,500	1,025,830.00	0.78
22	601668	中国建筑	150,100	951,634.00	0.72
23	600184	光电股份	32,500	939,575.00	0.71
24	000728	国元证券	40,300	910,377.00	0.69
25	000404	华意压缩	97,300	909,755.00	0.69
26	000966	长源电力	55,200	832,968.00	0.63
27	603167	渤海轮渡	66,700	828,414.00	0.63
28	600030	中信证券	42,200	816,570.00	0.62
29	600109	国金证券	46,700	752,804.00	0.57
30	002726	龙大肉食	46,800	710,892.00	0.54
31	002047	宝鹰股份	62,900	706,996.00	0.54
32	000166	申万宏源	62,500	669,375.00	0.51
33	600757	长江传媒	60,700	666,486.00	0.51
34	600322	天房发展	120,400	645,344.00	0.49
35	000544	中原环保	33,118	637,521.50	0.48
36	600686	金龙汽车	32,800	629,432.00	0.48
37	600798	宁波海运	91,100	623,124.00	0.47
38	600837	海通证券	38,200	604,324.00	0.46
39	603366	日出东方	55,700	590,420.00	0.45
40	300123	太阳鸟	36,909	585,007.65	0.44
41	000686	东北证券	32,400	567,000.00	0.43
42	600657	信达地产	79,882	555,179.90	0.42
43	600886	国投电力	61,300	511,855.00	0.39
44	000709	河钢股份	152,000	506,160.00	0.38
45	600566	济川药业	18,200	503,412.00	0.38
46	002695	煌上煌	13,200	490,908.00	0.37
47	600830	香溢融通	35,500	487,415.00	0.37
48	600741	华域汽车	28,844	486,309.84	0.37
49	603017	中衡设计	10,400	482,248.00	0.37

50	600376	首开股份	37,900	473,750.00	0.36
51	601006	大秦铁路	54,800	472,376.00	0.36
52	600050	中国联通	76,400	472,152.00	0.36
53	000415	渤海租赁	52,100	469,942.00	0.36
54	300157	恒泰艾普	37,964	463,540.44	0.35
55	000929	兰州黄河	36,800	460,000.00	0.35
56	600713	南京医药	43,700	457,102.00	0.35
57	002063	远光软件	20,100	424,914.00	0.32
58	002231	奥维通信	25,500	417,180.00	0.32
59	601607	上海医药	20,907	416,258.37	0.32
60	600208	新湖中宝	86,600	413,082.00	0.31
61	600874	创业环保	38,900	410,395.00	0.31
62	600643	爱建集团	27,800	407,270.00	0.31
63	600335	国机汽车	20,600	386,044.00	0.29
64	600999	招商证券	17,400	377,580.00	0.29
65	002410	广联达	20,500	372,690.00	0.28
66	600289	亿阳信通	18,700	368,390.00	0.28
67	000919	金陵药业	21,300	366,360.00	0.28
68	000521	美菱电器	49,500	361,350.00	0.27
69	000656	金科股份	66,400	350,592.00	0.27
70	002507	涪陵榨菜	18,600	349,122.00	0.27
71	000603	盛达矿业	19,200	346,560.00	0.26
72	600681	万鸿集团	25,600	336,640.00	0.26
73	600027	华电国际	47,600	323,680.00	0.25
74	002179	中航光电	8,500	322,660.00	0.25
75	000411	英特集团	12,000	319,080.00	0.24
76	600026	中海发展	34,100	315,084.00	0.24
77	600782	新钢股份	54,400	307,360.00	0.23
78	000338	潍柴动力	31,600	305,256.00	0.23
79	600764	中电广通	15,392	303,530.24	0.23

80	600295	鄂尔多斯	30,400	300,656.00	0.23
81	600743	华远地产	44,300	300,354.00	0.23
82	601899	紫金矿业	84,400	297,088.00	0.23
83	600723	首商股份	26,600	295,526.00	0.22
84	000739	普洛药业	34,500	282,900.00	0.21
85	600077	宋都股份	38,200	277,714.00	0.21
86	600894	广日股份	13,800	275,862.00	0.21
87	600203	福日电子	20,000	274,200.00	0.21
88	300167	迪威视讯	12,800	274,176.00	0.21
89	600795	国电电力	65,800	258,594.00	0.20
90	000069	华侨城A	29,000	255,200.00	0.19
91	600537	亿晶光电	17,000	254,660.00	0.19
92	600320	振华重工	41,900	250,143.00	0.19
93	002501	利源精制	19,400	244,052.00	0.19
94	000915	山大华特	6,900	242,604.00	0.18
95	000550	江铃汽车	8,000	239,840.00	0.18
96	002396	星网锐捷	9,700	234,255.00	0.18
97	600792	云煤能源	37,400	233,376.00	0.18
98	002187	广百股份	14,200	232,312.00	0.18
99	000823	超声电子	19,300	224,845.00	0.17
100	002610	爱康科技	18,200	220,584.00	0.17
101	300255	常山药业	12,500	218,875.00	0.17
102	000540	中天城投	23,500	214,320.00	0.16
103	300399	京天利	3,800	213,066.00	0.16
104	000422	湖北宜化	26,400	205,128.00	0.16
105	002745	木林森	4,800	196,464.00	0.15
106	600169	太原重工	34,000	195,160.00	0.15
107	300199	翰宇药业	7,900	194,577.00	0.15
108	600104	上汽集团	9,100	193,102.00	0.15
109	600889	南京化纤	11,900	188,853.00	0.14

110	600823	世茂股份	15,300	187,119.00	0.14
111	000630	铜陵有色	52,200	186,876.00	0.14
112	603123	翠微股份	17,000	186,490.00	0.14
113	600601	方正科技	29,300	181,074.00	0.14
114	603100	川仪股份	9,800	177,772.00	0.14
115	601678	滨化股份	21,200	170,024.00	0.13
116	600582	天地科技	24,700	168,701.00	0.13
117	300110	华仁药业	11,800	165,318.00	0.13
118	601088	中国神华	11,000	164,670.00	0.13
119	600054	黄山旅游	6,900	162,909.00	0.12
120	000851	高鸿股份	10,400	162,552.00	0.12
121	000725	京东方A	53,600	159,192.00	0.12
122	600835	上海机电	5,100	154,581.00	0.12
123	000683	远兴能源	27,600	152,904.00	0.12
124	600488	天药股份	20,400	150,348.00	0.11
125	601218	吉鑫科技	21,500	150,285.00	0.11
126	300377	赢时胜	1,800	147,906.00	0.11
127	601168	西部矿业	19,900	147,061.00	0.11
128	600790	轻纺城	17,700	143,901.00	0.11
129	000830	鲁西化工	19,900	137,907.00	0.10
130	600987	航民股份	10,300	135,136.00	0.10
131	002056	横店东磁	4,800	134,928.00	0.10
132	600761	安徽合力	9,900	132,165.00	0.10
133	002649	博彦科技	2,300	129,444.00	0.10
134	603606	东方电缆	7,300	128,553.00	0.10
135	600426	华鲁恒升	8,500	122,655.00	0.09
136	600765	中航重机	6,000	117,840.00	0.09
137	002302	西部建设	6,600	117,612.00	0.09
138	000758	中色股份	7,900	117,552.00	0.09
139	600778	友好集团	9,500	116,565.00	0.09

140	300183	东软载波	4,300	115,971.00	0.09
141	600810	神马股份	12,200	111,386.00	0.08
142	002323	雅百特	2,900	108,634.00	0.08
143	600499	科达洁能	4,600	104,098.00	0.08
144	000949	新乡化纤	19,100	101,421.00	0.08
145	000726	鲁泰 A	7,400	100,048.00	0.08
146	603099	长白山	4,200	98,700.00	0.08
147	000536	华映科技	6,500	95,810.00	0.07
148	600858	银座股份	8,500	94,010.00	0.07
149	002440	闰土股份	4,900	93,345.00	0.07
150	601028	玉龙股份	9,900	92,763.00	0.07
151	600973	宝胜股份	5,800	89,726.00	0.07
152	002567	唐人神	6,900	88,596.00	0.07
153	600801	华新水泥	10,500	85,575.00	0.07
154	002597	金禾实业	7,600	83,600.00	0.06
155	603609	禾丰牧业	5,900	80,063.00	0.06
156	601313	江南嘉捷	5,100	79,968.00	0.06
157	000632	三木集团	7,700	78,463.00	0.06
158	600458	时代新材	4,400	77,880.00	0.06
159	600875	东方电气	5,600	76,328.00	0.06
160	002087	新野纺织	8,900	75,739.00	0.06
161	002082	栋梁新材	7,200	73,512.00	0.06
162	603188	亚邦股份	3,100	69,378.00	0.05
163	300180	华峰超纤	4,100	61,131.00	0.05
164	002225	濮耐股份	7,700	58,905.00	0.04
165	000525	红太阳	3,400	57,596.00	0.04
166	600398	海澜之家	4,100	57,236.00	0.04
167	600097	开创国际	2,900	56,956.00	0.04
168	000652	泰达股份	6,700	47,771.00	0.04
169	002157	正邦科技	2,300	46,230.00	0.04

170	002394	联发股份	2,400	44,712.00	0.03
171	000786	北新建材	3,400	40,460.00	0.03
172	000639	西王食品	2,000	33,840.00	0.03
173	300012	华测检测	1,200	29,508.00	0.02
174	300389	艾比森	90	4,410.90	0.00
175	600316	洪都航空	83	1,937.22	0.00
176	600804	鹏博士	72	1,707.84	0.00
177	600557	康缘药业	50	1,251.00	0.00
178	000418	小天鹅 A	31	744.00	0.00
179	600056	中国医药	43	715.09	0.00
180	000860	顺鑫农业	20	426.00	0.00

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	601009	南京银行	21,871,727.40	16.62
2	601998	中信银行	16,895,553.61	12.84
3	000001	平安银行	15,585,464.36	11.84
4	601166	兴业银行	12,048,821.30	9.16
5	601818	光大银行	11,668,340.82	8.87
6	601169	北京银行	10,740,905.00	8.16
7	600015	华夏银行	8,009,092.39	6.09
8	600316	洪都航空	7,772,041.94	5.91
9	000719	大地传媒	7,664,114.02	5.82
10	601328	交通银行	6,845,066.27	5.20
11	600016	民生银行	6,832,446.00	5.19
12	000666	经纬纺机	6,615,613.76	5.03
13	601988	中国银行	6,372,761.49	4.84
14	601318	中国平安	6,331,447.99	4.81

15	600036	招商银行	6,121,530.98	4.65
16	601668	中国建筑	6,073,470.00	4.62
17	000686	东北证券	5,657,951.10	4.30
18	000563	陕国投 A	5,462,130.71	4.15
19	600030	中信证券	5,374,137.52	4.08
20	600197	伊力特	5,318,063.19	4.04
21	600879	航天电子	5,240,687.46	3.98
22	600747	大连控股	5,151,901.00	3.92
23	000404	华意压缩	5,107,014.86	3.88
24	600531	豫光金铅	4,977,314.98	3.78
25	000166	申万宏源	4,932,390.01	3.75
26	000928	中钢国际	4,907,030.78	3.73
27	601398	工商银行	4,878,296.00	3.71
28	600132	重庆啤酒	4,759,657.04	3.62
29	300123	太阳鸟	4,679,220.80	3.56
30	002736	国信证券	4,580,969.96	3.48
31	600837	海通证券	4,442,587.91	3.38
32	000521	美菱电器	4,414,649.41	3.36
33	000338	潍柴动力	4,408,607.00	3.35
34	600551	时代出版	4,317,603.50	3.28
35	600830	香溢融通	4,306,793.81	3.27
36	600681	万鸿集团	4,273,152.87	3.25
37	600597	光明乳业	4,246,675.35	3.23
38	603167	渤海轮渡	4,229,987.00	3.21
39	000415	渤海租赁	4,102,090.98	3.12
40	600291	西水股份	4,059,855.38	3.09
41	000665	湖北广电	4,025,459.74	3.06
42	000926	福星股份	4,023,860.29	3.06
43	000544	中原环保	3,960,802.50	3.01
44	002297	博云新材	3,804,652.06	2.89

45	600199	金种子酒	3,780,826.69	2.87
46	000418	小天鹅 A	3,773,007.59	2.87
47	600529	山东药玻	3,717,896.14	2.83
48	000783	长江证券	3,644,735.34	2.77
49	000333	美的集团	3,630,950.51	2.76
50	000429	粤高速 A	3,611,020.00	2.74
51	601939	建设银行	3,522,929.00	2.68
52	600312	平高电气	3,372,710.18	2.56
53	000411	英特集团	3,325,433.15	2.53
54	000728	国元证券	3,286,640.99	2.50
55	000966	长源电力	3,246,897.23	2.47
56	000951	中国重汽	3,176,087.74	2.41
57	600116	三峡水利	3,158,760.00	2.40
58	600757	长江传媒	3,153,422.07	2.40
59	600753	东方银星	3,140,116.00	2.39
60	600212	江泉实业	3,135,896.30	2.38
61	600562	国睿科技	3,129,007.86	2.38
62	600518	康美药业	3,127,141.00	2.38
63	600027	华电国际	3,021,990.99	2.30
64	600295	鄂尔多斯	3,008,898.45	2.29
65	000709	河钢股份	3,001,514.00	2.28
66	601601	中国太保	2,972,949.23	2.26
67	600886	国投电力	2,905,471.00	2.21
68	600823	世茂股份	2,859,142.24	2.17
69	600831	广电网络	2,827,324.87	2.15
70	002507	涪陵榨菜	2,799,396.34	2.13
71	600713	南京医药	2,798,858.62	2.13
72	002620	瑞和股份	2,795,915.00	2.12
73	300295	三六五网	2,784,635.10	2.12
74	002238	天威视讯	2,683,985.85	2.04

75	600999	招商证券	2,663,944.68	2.02
76	601288	农业银行	2,648,632.00	2.01

注：买入金额按买入成交金额（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	601009	南京银行	20,290,204.22	15.42
2	601998	中信银行	16,063,261.28	12.21
3	000001	平安银行	12,423,419.53	9.44
4	601818	光大银行	11,604,280.00	8.82
5	601169	北京银行	11,275,057.40	8.57
6	601166	兴业银行	9,943,606.85	7.56
7	600316	洪都航空	7,629,236.74	5.80
8	600015	华夏银行	7,118,998.99	5.41
9	600016	民生银行	7,013,077.00	5.33
10	601328	交通银行	6,984,829.14	5.31
11	000666	经纬纺机	6,822,016.95	5.18
12	000719	大地传媒	6,548,056.57	4.98
13	600036	招商银行	6,031,385.30	4.58
14	000563	陕国投 A	5,975,192.50	4.54
15	600197	伊力特	5,611,499.44	4.26
16	600747	大连控股	5,428,715.50	4.13
17	600879	航天电子	5,387,632.54	4.09
18	601318	中国平安	5,287,176.00	4.02
19	601668	中国建筑	5,146,471.00	3.91
20	000686	东北证券	5,120,085.96	3.89
21	601988	中国银行	5,050,884.00	3.84
22	601398	工商银行	4,977,533.00	3.78
23	000928	中钢国际	4,920,536.05	3.74

24	600030	中信证券	4,821,212.00	3.66
25	600132	重庆啤酒	4,641,899.63	3.53
26	000926	福星股份	4,341,537.35	3.30
27	000404	华意压缩	4,294,777.86	3.26
28	000166	申万宏源	4,282,402.83	3.25
29	000665	湖北广电	4,257,030.00	3.24
30	600551	时代出版	4,178,095.60	3.18
31	600830	香溢融通	4,139,068.00	3.15
32	000338	潍柴动力	4,115,502.39	3.13
33	000521	美菱电器	4,093,197.00	3.11
34	300123	太阳鸟	4,062,501.91	3.09
35	002297	博云新材	3,897,691.41	2.96
36	600199	金种子酒	3,882,026.33	2.95
37	600837	海通证券	3,827,065.84	2.91
38	600681	万鸿集团	3,814,371.00	2.90
39	000418	小天鹅 A	3,778,638.82	2.87
40	000429	粤高速 A	3,729,491.52	2.83
41	000783	长江证券	3,698,078.40	2.81
42	000415	渤海租赁	3,654,700.08	2.78
43	000333	美的集团	3,638,001.53	2.76
44	601939	建设银行	3,525,588.00	2.68
45	002736	国信证券	3,522,890.52	2.68
46	603167	渤海轮渡	3,456,436.80	2.63
47	000544	中原环保	3,401,014.84	2.58
48	000951	中国重汽	3,308,623.47	2.51
49	600597	光明乳业	3,270,521.30	2.49
50	000411	英特集团	3,063,299.00	2.33
51	600291	西水股份	3,018,634.00	2.29
52	601601	中国太保	2,970,095.52	2.26
53	002620	瑞和股份	2,880,279.00	2.19

54	600295	鄂尔多斯	2,872,815.56	2.18
55	600831	广电网络	2,832,986.54	2.15
56	600804	鹏博士	2,743,935.00	2.09
57	600027	华电国际	2,674,362.35	2.03
58	600823	世茂股份	2,660,559.46	2.02
59	000100	TCL 集团	2,642,539.00	2.01
60	002238	天威视讯	2,640,267.10	2.01

注：卖出金额按卖出成交金额（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	743,942,193.50
卖出股票的收入（成交）总额	671,119,067.06

注：买入股票成本、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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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

本基金本报告期内未投资股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金采用灵活配置策略，可利用股指期货调节系统性风险。

在报告期内，本基金管理人密切关注市场动态，考虑到当前股指期货市场的流动性较为匮乏，且基差长期处于贴水水平，暂未进行股指期货交易，符合既定的投资政策和投资目标。

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

本基金本报告期内未投资国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

8.12.2 基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

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	414,660.12
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	10,525.37
5	应收申购款	110,700.94
6	其他应收款	—

7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	535,886.43

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的情况。

§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		个人投资者	
		持有 份额	占总份 额比例	持有 份额	占总份 额比例
2,683	45,923.87	10,315,146.84	8.37%	112,898,598.88	91.63%

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	988.73	0.00%

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
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	10,004,850.00	8.12%	10,004,850.00	8.12%	自合同生效之日起不少于三年
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	988.73	0.00%	—	—	
其他	—	—	—	—	
合计	10,005,838.73	8.12%	10,004,850.00	8.12%	

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2015年9月1日)基金份额总额	302,140,249.57
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	799,662.25
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	179,726,166.10
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	123,213,745.72

§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，本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本基金管理人、基金财产及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，本基金管理人的基金投资策略严格遵循本基金《基金合同》及《招募说明书》中披露的基本投资策略，未发生显著的改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自合同生效日起聘请安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务。报告期内本基金未改聘会计师事务所。报告期内应支付给聘任会计师事务所的报酬为50,000.00元，

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

本报告期内未发生基金管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况。

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		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占股票成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰证券	2	1,415,061,260.56	100.00%	1,305,643.70	100.00%	

注：根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力的基础上，选择基金专用交易席位，并由本基金管理人董事会授权管理层批准。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	永赢量化灵活配置混合型发起式	中国证券报、上海证券报、	2015-08-13

	证券投资基金份额发售公告	证券时报、公司网站	
2	永赢基金关于新增上海天天基金销售有限公司为永赢量化灵活配置混合型发起式证券投资基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-08-20
3	永赢基金管理有限公司关于永赢量化灵活配置混合型发起式证券投资基金提前结束募集的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-08-26
4	永赢量化灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同生效公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-09-02
5	永赢基金关于新增上海陆金所为销售机构及同时参加陆金所费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-09-25
6	永赢基金关于新增中信建投证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-11-19
7	永赢量化灵活配置混合型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回业务公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-11-27

§12 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1.中国证监会核准永赢量化灵活配置混合型发起式证券投资基金募集的文件；
- 2.《永赢量化灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3.《永赢量化灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书》；
- 4.《永赢量化灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议》；
- 5.基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6.基金托管人业务资格批件、营业执照。

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

13.3 查阅方式

投资者可在办公时间亲临上述存放地点免费查阅，也可在本基金管理人的网站进行查阅，查询网址：www.maxwealthfund.com。

如有疑问，可以向本基金管理人永赢基金管理有限公司咨询。

客户服务电话：021-51690111

永赢基金管理有限公司

二〇一六年三月二十六日