

私募基金信息披露年度报表

1、基金产品概况

1.1 基金基本情况

基金名称	清水源国君基金
基金编号	S22846
基金运作方式	开放式
基金合同生效日期	2015-01-12
基金管理人	深圳清水源投资管理有限公司
基金托管人	国泰君安证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	40143598.63
基金合同存续期	5 年

1.2 基金产品说明

投资目标	在深入研究的基础上构建投资组合，在严格控制投资风险的前提下，力求获得长期稳定的投资回报
投资策略	本基金将根据宏观经济分析和整体市场估值水平的变化自上而下的进行资产配置，在降低市场风险的同时追求更高收益
业绩比较基准（如有）	本基金业绩比较基准为同期沪深 300 指数。如果相关法律、行政法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，经基金管理人与基金托管人协商，本基金可以在基金业协会备案后变更业绩比较基准并及时公告。
风险收益特征	基于本基金的投资范围及投资策略，本基金不承诺保本及最低收益，属预期风险较高、预期收益较高的投资品种，适合具有风险识别、评估、承受能力的合格投资者

1.3 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	深圳清水源投资管理有限公司		国泰君安证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名		吴冬悦
	联系电话		021-38677819
	电子邮箱		wudongyue@gtjas.com
传真			021-38677819
注册地址	广东省深圳市福田区彩田瑰丽福景大厦 3 号楼 5 层 509		上海市浦东新区商城路 618 号
办公地址	广东省深圳市福田区福中三路 1006 号诺德金融中心 5G		上海市浦东新区银城中路 68 号 32 层
邮政编码			200120
法定代表人	张小川		杨德红

#### 1.4 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所		
注册登记机构	国泰君安证券股份有限公司	上海市浦东新区银城中路 68 号 32 层
外包机构	国泰君安证券股份有限公司	上海市浦东新区银城中路 68 号 32 层

## 2、主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 2.1 主要会计数据和财务指标

清水源国君基金			
期间数据和指标	2015 年	2014 年	2013 年
本期已实现收益	-2693034.93	-	-
本期利润	-2816925.00	-	-
期末数据和指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
期末可供分配利润	110254.10	-	-

期末可供分配基金份额利润	0.0027	-	-
期末基金资产净值	44449251.73	-	-
期末基金份额净值	1.107	-	-
累计期末指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
基金份额累计净值增长率	10.70%	0.00%	0.00%

### 2.2 基金净值表现

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	备注
当年	10.70%	2.35%	5.20%	2.50%	清水源国君基金
自基金合同生效起至今	10.70%	2.35%	5.20%	2.50%	清水源国君基金

注：

净值增长率=（期末累计净值-期初累计净值）/期初累计净值

当年净值增长率=（本年度末累计净值-上年度末累计净值）/上年度末累计净值

### 2.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

### 3、基金份额变动情况

单位：份  
清水源国君基金

报告期期初基金份额总额	42500000.00
报告期期间基金总申购份额	17718598.63
减：报告期期间基金总赎回份额	20075000.00
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	40143598.63

#### 4、管理人说明的其他情况

（如报告期内高管、基金经理及其关联基金经验、基金运作合规守信情况、基金投资策略和业绩表现、对宏观经济、证券市场及其行业走势展望、内部基金监察稽核工作、基金估值程序、基金运作情况和运用杠杆情况、投资收益分配和损失承担情况、会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项、对本基金持有人数或基金资产净值预警情形、可能存在的利益冲突等）

##### 1) 基金运作合规守信情况：

本报告期内，本基金管理人严格遵守《私募投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规、基金合同等规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。

报告期内，本基金运作中发现个别监督指标不符合本基金合同的约定，本管理人在报告期内进行了调整，未存在损害份额持有人利益的行为。

##### 2) 基金估值程序：

截止到报告期末，本管理人委托国泰君安证券股份有限公司为本基金提供估值核算服务。对于与基金资产有关的估值与会计核算问题，经相关当事人在平等基础上充分讨论后，达成一致意见。

1、本基金成立前，本管理人协调本基金其他当事人商定本基金的估值与会计核算方法。

2、在本基金的存续期内，本基金管理人定期评估基金估值与会计核算方法的合理性。

3、在本基金的运作过程中，经济环境未发生重大变化且对基金资产的估值产生重大影响的，由本管理人协调本基金其他当事人采取必要措施，调整估值方法。

##### 3) 基金投资收益分配和损失承担情况：

本基金本报告期内未进行利润分配。

##### 4) 基金运作情况和运用杠杆情况：

本基金无运用杠杆情况。本基金本报告期初基金单位净值 1.000 元，本报告期末基金单位净值 1.107 元，本报告期内基金单位净值增长率为 10.70%。

#### 5、托管人报告

##### 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

报告期内，国泰君安证券股份有限公司（以下称“托管人”）在本基金的托管过程中，严格遵守《私募投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规、基金合同等有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了托管人应尽的义务。

## 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，托管人根据《私募投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规、基金合同等规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督。

报告期内，管理人在本基金的净值计算、基金份额申购赎回价格、基金费用开支及利润分配等情况上，托管人未发现管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，托管人对本基金的投资运作情况进行了监督，发现个别监督指标不符合本基金合同的约定，托管人已及时通知管理人。管理人在报告期内进行了调整。

## 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

报告期内，托管人对管理人所编制和披露的本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、份额变动情况、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、年度财务报表

## 6.1 资产负债表

单位：元

资产	本期末 2015-12-31	上年度末 2014-12-31
<b>资产：</b>		
银行存款	31517.00	—
结算备付金	1306.20	—
存出保证金	90014.56	—
交易性金融资产	25424379.45	—

其中：股票投资	13399111.00	-
基金投资	12025268.45	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	19100191.00	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	946.51	-
应收股利	68690.21	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	45487.50	-
资产总计	44762532.43	-
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2015-12-31</b>	<b>上年度末 2014-12-31</b>
<b>负债：</b>		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	302008.34	-
应付托管费	7514.91	-

应付运营服务费	3757.45	-
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	-	-
应付投资顾问费	-	-
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	-	-
负债合计	313280.70	-
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	40143598.63	-
未分配利润	4305653.10	-
所有者权益合计	44449251.73	-
负债和所有者权益总计	44762532.43	-

## 6.2 利润表

单位：元

项目	本期	上年度可比期间
	2015-01-12 至 2015-12-31	2014-01-01 至 2014-12-31
一、收入	541958.72	-
1. 利息收入	170285.74	-
其中：存款利息收入	81691.42	-
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	88594.32	-
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	495563.05	-
其中：股票投资收益	19578224.33	-
基金投资收益	320084.63	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-20121880.00	-
股利收益	719134.09	-
其他收益	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”填列）	-123890.07	-
4. 汇兑收益（损失以“-”填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”填列）	-	-
<b>减：二、费用</b>	3358883.72	-
1. 管理人报酬	2271610.69	-
2. 托管费	129031.34	-
3. 销售服务费	-	-
4. 外包服务费	64515.84	-
5. 投资顾问费	-	-
6. 交易费用	892059.75	-
7. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
8. 其他费用	1666.10	-
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	-2816925.00	-



减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-2816925.00	-

### 6.3 所有者权益变动表

单位：元

项目	本期		
	2015-01-12 至 2015-12-31		
	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）	42500000.00	-	42500000.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-2816925	-2816925.00
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）	-2356401.37	7122578.10	4766176.73
其中：1. 基金申购款	17718598.63	8548728.10	26267326.73
2. 基金赎回款	-20075000.00	-1426150	-21501150.00
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）	40143598.63	4305653.1	44449251.73
项目	上年度可比期间		
	2014-01-01 至 2014-12-31		
	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）	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-	-
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）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
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）	-	-	-

## 7、期末投资组合情况

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：元

序号	项目	金额	占基金总资产的
		（元）	比例（%）
1	权益投资	13399111.00	29.93
	其中：普通股	13399111.00	29.93
	存托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-

	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	19100191.00	42.67
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	12025268.45	26.86
7	银行存款和结算备付金合计	122837.76	0.27
8	其他	115124.22	0.26
	合计	44762532.43	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：元

序号	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	389480.00	0.88
C	制造业	8953788.00	20.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	177710.00	0.40
F	批发和零售业	349943.00	0.79
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	431760.00	0.97

I	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
J	金融业	428340.00	0.96
K	房地产业	2138540.00	4.81
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
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	529550.00	1.19
S	综合	—	—
X	港股通	—	—
Y	其他	—	—
	合计	13399111.00	30.14