

**金奥7号2015年年度报告**

**2015年12月31日**

资产管理人：苏州奥普雷斯资产管理有限公司

资产托管人：中信建投证券股份有限公司

报告送出日期：二〇一六年四月二十五日

## § 1 基金产品概况

### 1.1 基金基本情况

基金名称	金奥7号
基金编号	S38660
基金运作方式	
基金合同生效日	2015年06月09日
基金管理人	苏州奥普雷斯资产管理有限公司
基金托管人	中信建投证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	1550000份
基金合同存续期(个月)	0

### 1.2 基金产品说明

投资目标	
投资策略	
业绩比较基准	无
风险收益特征	

### 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	苏州奥普雷斯资产管理有限公司	中信建投证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李新愿
	联系电话	010-65608543
	电子邮箱	<a href="mailto:lixinyuan@csc.com.cn">lixinyuan@csc.com.cn</a>
传真		010-85130975
注册地址		北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址		北京东城区朝内大街188号
邮政编码		100000
法定代表人		王常青

## 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		
外包机构	中信建投证券股份有限公司	北京东城区朝内大街188号

## § 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

金额单位：人民币元

2.1.1 期间数据和指标	2015年06月09日-2015年12月31日	2014年06月09日-2014年12月31日	2013年06月09日-2013年12月31日
	本期已实现收益	-1,517,671.10	—
本期利润	-1,517,671.10	—	—
2.1.2 期末数据和指标	2015年末	2014年末	2013年末
	期末可供分配利润	-1,517,671.10	—
期末可供分配基金份额利润	-0.9791	—	—
期末基金资产净值	32,328.90	—	—
期末基金份额净值	0.0209	—	—
2.1.3 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	-97.91%	—

### 2.2 基金净值表现

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
当年	-97.91%			
自基金合同生效起至今	-97.91%			

### 2.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每份基金份额 分红数	现金形式发放 总额	再投资形式发 放总额	年度利润分配 合计	备注
2015年	—	—	—	—	
合计	—	—	—	—	

### § 3 基金份额变动

#### 3.1、基金份额变动

项目	份额数（份）
报告期期初基金份额总额	1,550,000.00
报告期基金总申购份额	—
减：报告期期间基金总赎回份额	—
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	1,550,000.00

### § 4 管理人说明的其他情况

#### 4.1、管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

运作期内遵守相关法律法规

#### 4.2 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.2.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本产品主要投资为期权产品

##### 4.2.2 报告期内基金的业绩表现

因在下半年收到股市大幅波动影响，本产品投资为高风险期权产品，业绩表现不佳。

#### 4.3管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经济基本面向好，证券行业处于高速发展中

#### 4.4 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

根据规定进行稽核工作

#### 4.5 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

符合估值程序

#### 4.6 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

未分配利润

## § 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

在本报告期内，本基金托管人在托管基金过程中，严格遵守了基金合同和其他有关法律法规的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

在本报告期内，托管人按照相关法律法规、基金合同和其他有关规定，对本基金的资产净值计算、基金费用等方面进行了认真的复核，对本产品的投资运作进行了监督，未发现产品管理人有关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

本托管人复核了本年度报告中的财务指标、净值表现的相关内容，所复核内容真实、准确和完整。

## § 6 年度财务报表

### 6.1 资产负债表

会计主体：金奥7号

报告截止日：2015年12月31日

单位：人民币元

资 产	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
资 产：		
银行存款	34,674.32	—
结算备付金	—	—
存出保证金	—	—

交易性金融资产	—	—
其中：股票投资	—	—
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	—	—
买入返售金融资产	—	—
应收证券清算款	—	—
应收利息	3.74	—
应收股利	—	—
应收申购款	—	—
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	34,678.06	—
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2015年12月31日</b>	<b>2014年12月31日</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	—	—
应付托管费	1,174.58	—
应付销售服务费	—	—
应付交易费用	—	—
应交税费	—	—
应付利息	—	—
应付利润	—	—

递延所得税负债	—	—
其他负债	1,174.58	—
负债合计	2,349.16	—
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	1,550,000.00	—
未分配利润	-1,517,671.10	—
所有者权益合计	32,328.90	—
负债和所有者权益总计	34,678.06	—

## 6.2 利润表

会计主体：金奥7号

本报告期：2015年06月09日至2015年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2015年06月09日至2015年12 月31日	上年度可比期间 2014年6月9日至2014 年12月31日
一、收入	178.06	—
1.利息收入	178.06	—
其中：存款利息收入	178.06	—
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）	—	—
其中：股票投资收益	—	—
基金投资收益	—	—
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	—	—
股利收益	—	—
其他投资收益		
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	—	—
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	—	—
<b>减：二、费用</b>	<b>1,517,849.16</b>	<b>—</b>
1. 管理人报酬	15,500.00	—
2. 托管费	1,174.58	—
3. 销售服务费	—	—
4. 外包服务费	1,174.58	—
5. 交易费用	1,500,000.00	—
6. 利息支出	—	—
其中：卖出回购金融资产支出	—	—
7. 其他费用	—	—
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>-1,517,671.10</b>	<b>—</b>
减：所得税费用	—	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>-1,517,671.10</b>	<b>—</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：金奥7号

本报告期：2015年06月09日至2015年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期		
	2015年06月09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)	1,550,000.00	—	1,550,000.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	-1,517,671.10	-1,517,671.10
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)	1,550,000.00	-1,517,671.10	32,328.90
项 目	上年度可比期间 2014年6月9日至2014年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	—	—	—
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

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	—	—
	其中：普通股	—	—
	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	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	货币市场工具	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	34,674.32	99.99
8	其他各项资产	3.74	0.01
9	合计	34,678.06	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	—	—
D	电力、热力、燃气及水生产和供	—	—

	应业		
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	—	—
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	—	—
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	—	—

托管人仅对报告中财务数据进行复核，经复核财务数据无误。