

# 前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型 证券投资基金 2016 年年度报告

2016 年 12 月 31 日

基金管理人：前海开源基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 30 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 24 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。

本报告中的财务资料已经审计。瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2016 年 10 月 17 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 其他指标.....	12
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	12
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>13</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
4.9 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.....	16
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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.....	17
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.....	17
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>17</b>
6.1 审计报告基本信息.....	17
6.2 审计报告的基本内容.....	17
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>18</b>
7.1 资产负债表.....	18
7.2 利润表.....	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	21
7.4 报表附注.....	22
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>44</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	44
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	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.....	53
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	55
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.....	55

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 .....	56
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 .....	56
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 .....	56
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	56
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	56
8.12 投资组合报告附注 .....	57
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>57</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	57
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	58
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的情况 .....	59
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>59</b>
<b>§11 重大事件揭示 .....</b>	<b>59</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	59
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 .....	59
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	59
11.4 基金投资策略的改变 .....	60
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	60
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 .....	60
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	60
11.8 其他重大事件 .....	61
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>63</b>
<b>§13 备查文件目录 .....</b>	<b>63</b>
13.1 备查文件目录 .....	63
13.2 存放地点 .....	64
13.3 查阅方式 .....	64

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	前海开源沪港深核心资源混合	
基金主代码	003304	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 10 月 17 日	
基金管理人	前海开源基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	334,857,276.13 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	前海开源沪港深核心资源混合 A	前海开源沪港深核心资源混合 C
下属分级基金的交易代码:	003304	003305
报告期末下属分级基金的份额总额	334,707,195.07 份	150,081.06 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过精选投资于核心资源主题相关证券，在合理控制风险并保持基金资产良好流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>本基金的投资策略主要有以下六方面内容：</p> <p>1、大类资产配置</p> <p>在大类资产配置中，本基金综合运用定性和定量的分析手段，在对宏观经济因素进行充分研究的基础上，判断宏观经济周期所处阶段。本基金将依据经济周期理论，结合对证券市场的系统性风险以及未来一段时期内各大类资产风险和预期收益率的评估，制定本基金在股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例。</p> <p>本基金通过对股票等权益类、债券等固定收益类和现金资产分布的实时监控，根据经济运行周期变动、市场利率变化、市场估值、证券市场变化等因素以及基金的风险评估进行灵活调整。在各类资产中，根据其参与市场基本要素的变动，调整各类资产在基金投资组合中的比例。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>(1) 核心资源主题相关股票的界定</p> <p>本基金所称“核心资源”是指能够被企业占有和利用，为企业创造经济价值，进而给企业带来核心竞争力的稀缺资源以及生产或经营条件。以核心资源为主题，本基金将重点配置拥有上述核心资源开发、经营或使用权的上市公司发行的股票。</p> <p>本基金将在拥有上述核心资源的上市公司中，重点关注具有良好发展潜力的核心资源及拥有该资源开发经营权的上市公司。</p>

	<p>(2) 核心资源主题相关股票的投资策略</p> <p>本基金将精选有良好增值潜力的、与核心资源主题相关的上市公司股票构建股票投资组合。</p> <p>(3) 港股通标的股票投资策略</p> <p>本基金可通过沪港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，不使用合格境内机构投资者(QDII)境外投资额度进行境外投资。本基金将遵循核心资源主题相关股票的投资策略，优先将基本面健康、业绩向上弹性较大、具有估值优势的港股纳入本基金的股票投资组合。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>在债券投资策略方面，本基金将以核心资源主题相关债券为主线，在综合研究的基础上实施积极主动的组合管理，采用宏观环境分析和微观市场定价分析两个方面进行债券资产的投资。</p> <p>4、权证投资策略</p> <p>在权证投资方面，本基金根据权证对应公司基本面研究成果确定权证的合理估值，发现市场对股票权证的非理性定价；利用权证衍生工具的特性，通过权证与证券的组合投资，来达到改善组合风险收益特征的目的。</p> <p>5、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金通过对资产支持证券发行条款的分析、违约概率和提前偿付比率的预估，借用必要的数量模型来谋求对资产支持证券的合理定价，在严格控制风险、充分考虑风险补偿收益和市场流动性的条件下，谨慎选择风险调整后收益较高的品种进行投资。</p> <p>本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。</p> <p>6、股指期货投资策略</p> <p>本基金以套期保值为目的，参与股指期货交易。</p>	
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×70%+中证全债指数收益率×30%	
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于中高风险收益的投资品种，其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金，低于股票型基金。本基金如果投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。	
	前海开源沪港深核心资源混合 A	前海开源沪港深核心资源混合 C
下属分级基金的风险收益特征	-	-

### 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	前海开源基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	傅成斌
	联系电话	0755-88601888
	电子邮箱	qhky@qhkyfund.com
客户服务电话	4001666998	95559
传真	0755-83181169	021-62701216

注册地址	深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)	上海市浦东新区银城中路 188 号
办公地址	深圳市福田区深南大道 7006 号万科富春东方大厦 2206	上海市浦东新区银城中路 188 号
邮政编码	518040	200120
法定代表人	王兆华	牛锡明

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.qhkyfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东城区永定门西滨河路 8 号院 7 号楼中海地产广场西塔 5-11 层
注册登记机构	前海开源基金管理有限公司	深圳市福田区深南大道 7006 号万科富春东方大厦 2206

## § 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	2016 年 10 月 17 日(基金合同生效日)-2016 年 12 月 31 日	
	前海开源沪港深核心资源混合 A	前海开源沪港深核心资源混合 C
本期已实现收益	722,484.41	358.01
本期利润	-1,257,388.81	-474.06
加权平均基金份额本期利润	-0.0041	-0.0030
本期加权平均净值利润率	-0.40%	-0.30%
本期基金份额净	-0.40%	-0.40%

值增长率		
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	
期末可供分配利润	-1,320,114.26	-574.45
期末可供分配基金份额利润	-0.0039	-0.0038
期末基金资产净值	333,387,080.81	149,506.61
期末基金份额净值	0.996	0.996
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	
基金份额累计净值增长率	-0.40%	-0.40%

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期末余额和未分配利润中已实现部分期末余额的孰低数。表中的“期末”均指报告期最后一个自然日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

④ 本基金的基金合同于 2016 年 10 月 17 日生效，截至 2016 年 12 月 31 日，本基金成立未满 1 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

前海开源沪港深核心资源混合 A

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
自基金合同生效起至今	-0.40%	0.19%	0.05%	0.51%	-0.45%	-0.32%

前海开源沪港深核心资源混合 C

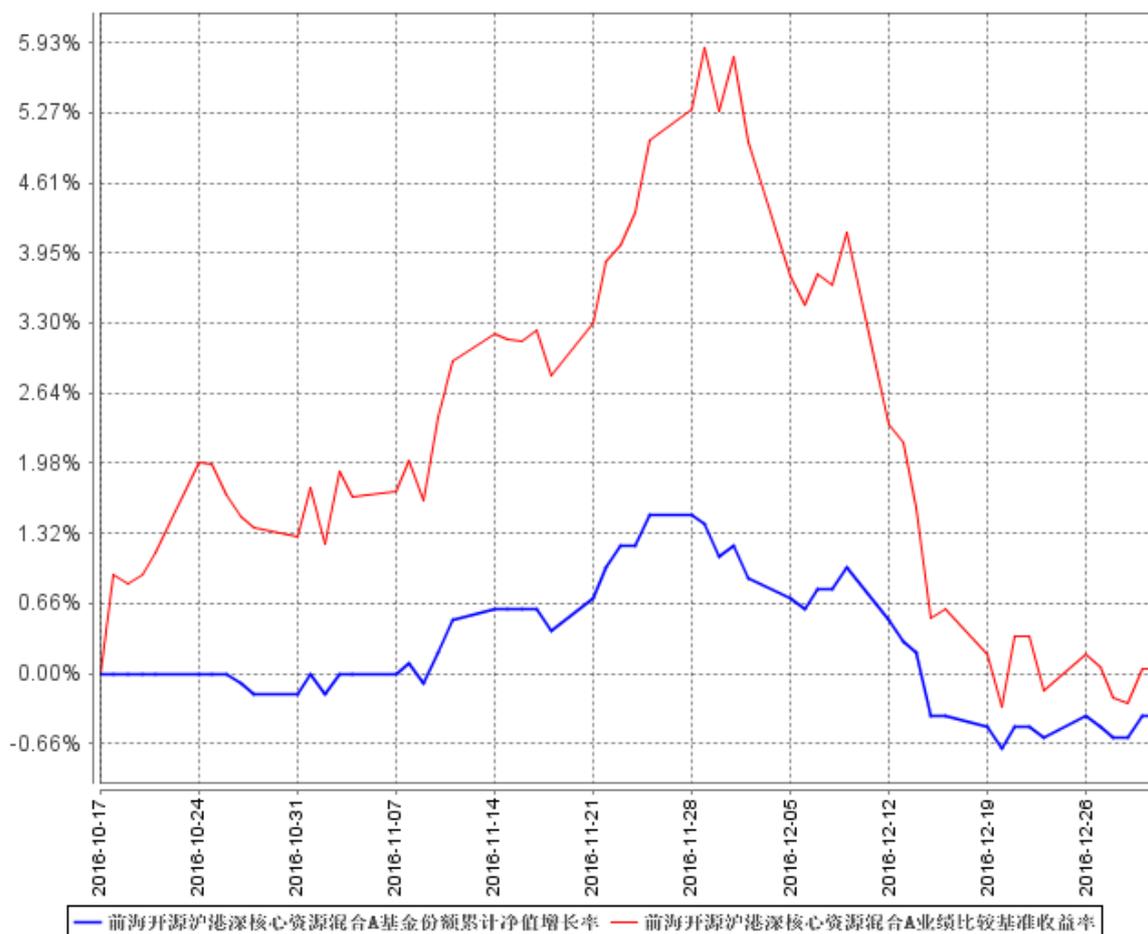
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
自基金合同	-0.40%	0.19%	0.05%	0.51%	-0.45%	-0.32%

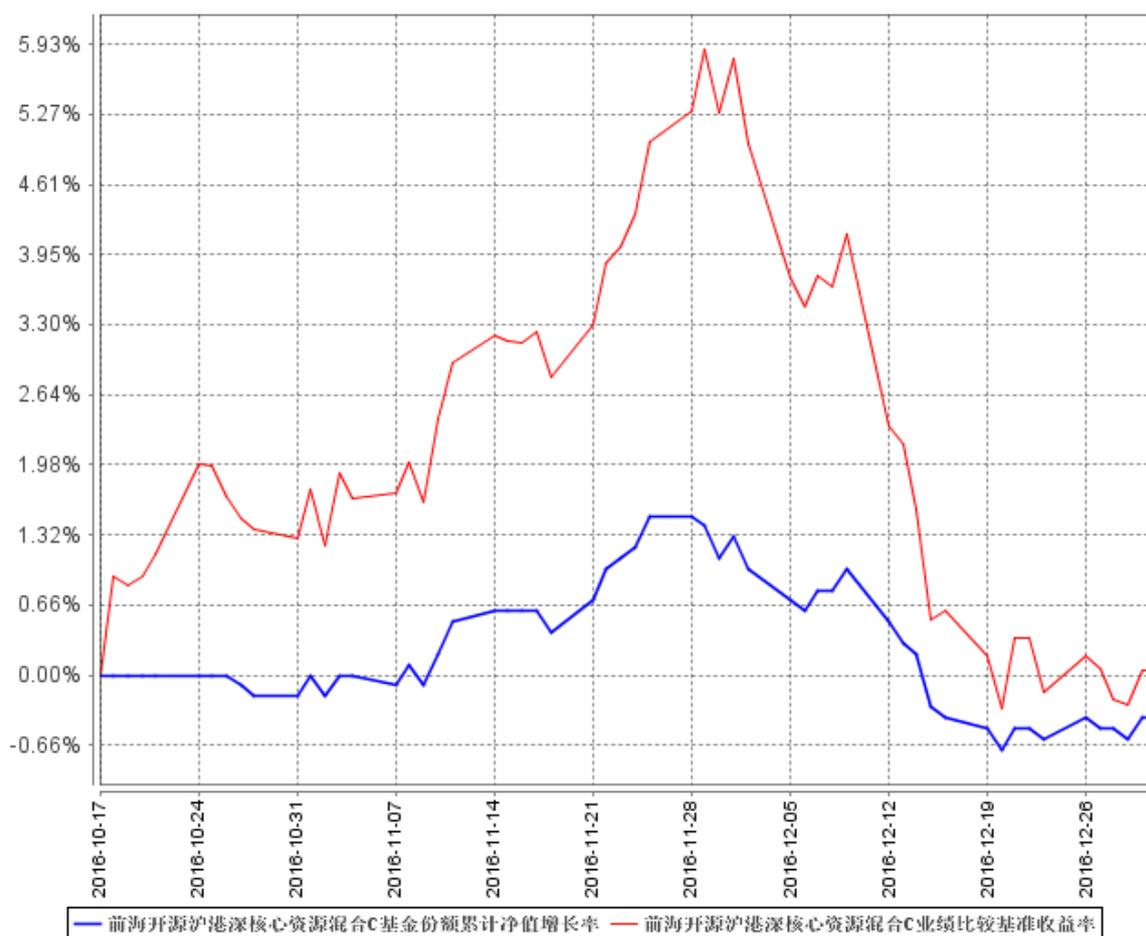


生效起至今					
-------	--	--	--	--	--

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×70%+中证全债指数收益率×30%。

### 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

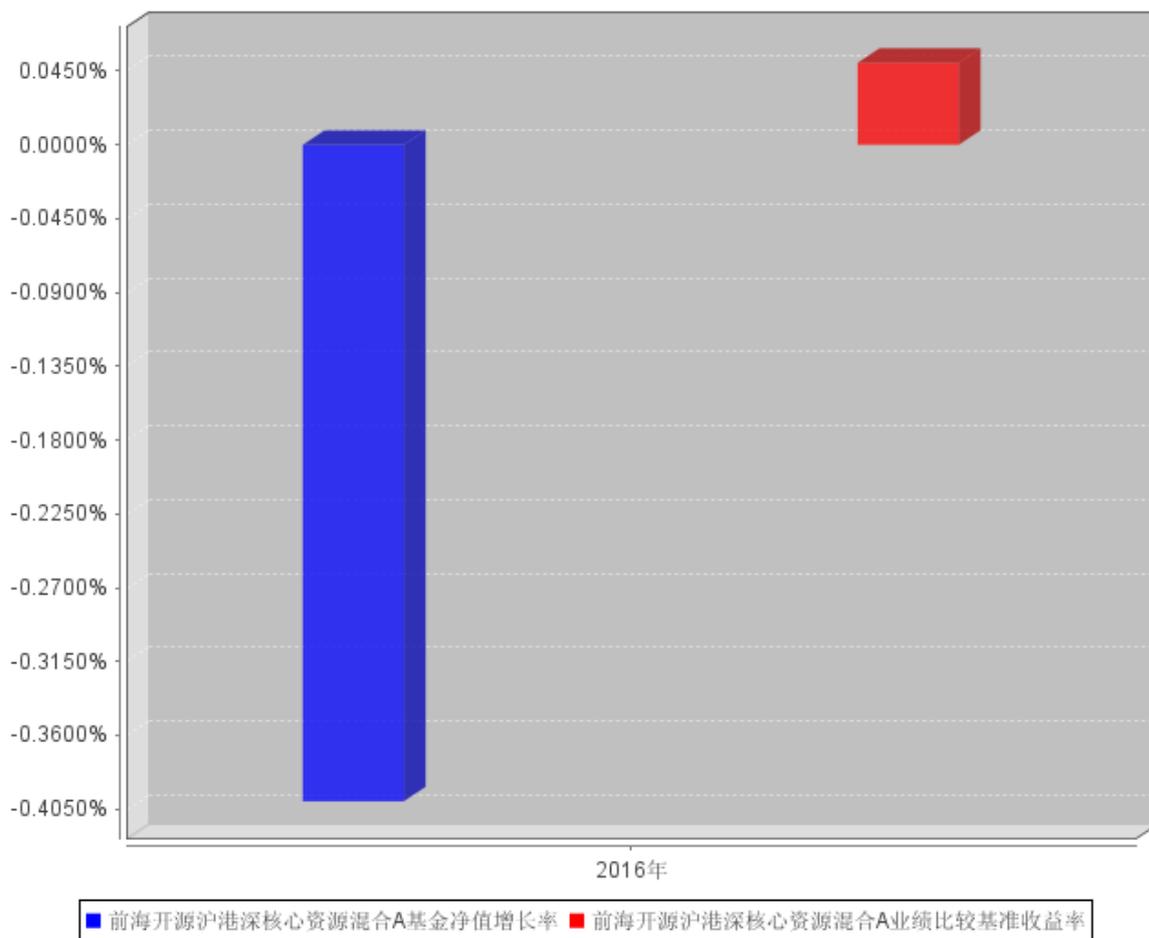


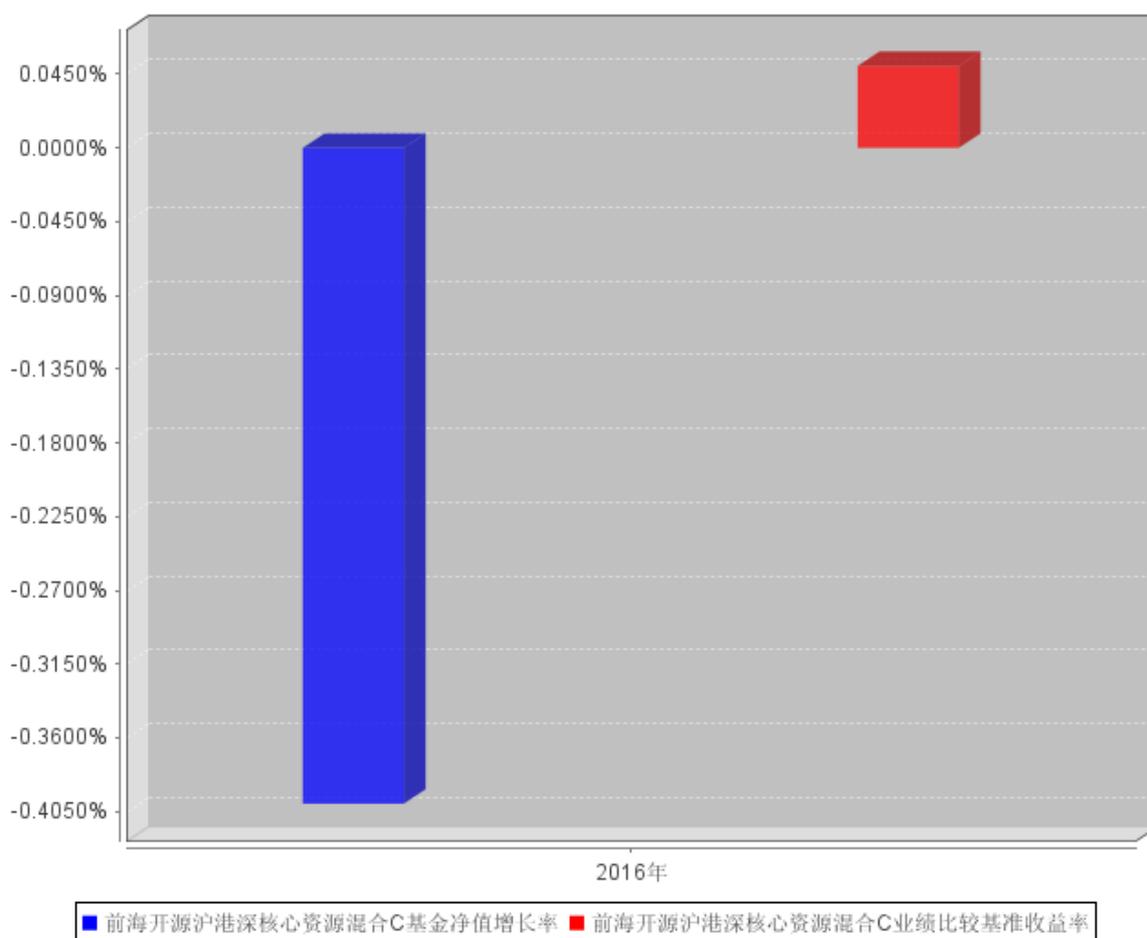


注：①本基金的基金合同于 2016 年 10 月 17 日生效，截至 2016 年 12 月 31 日止，本基金成立未  
满 1 年。

②本基金的建仓期为 6 个月，截至 2016 年 12 月 31 日止，本基金建仓期尚未结束。

### 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：本基金的基金合同于 2016 年 10 月 17 日生效，2016 年本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率按本基金各类基金份额实际存续期计算；截至 2016 年 12 月 31 日，本基金成立未满 1 年。

### 3.3 其他指标

无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

前海开源沪港深核心资源混合 A					
年度	每 10 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
2016	0.0000	0.00	0.00	0.00	
合计	0.0000	0.00	0.00	0.00	

单位：人民币元

前海开源沪港深核心资源混合 C					
年度	每 10 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
2016	0.0000	0.00	0.00	0.00	
合计	0.0000	0.00	0.00	0.00	

注：本基金合同于 2016 年 10 月 17 日生效，截至 2016 年 12 月 31 日，本基金成立未满三年。

## § 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

前海开源基金管理有限公司（以下简称“前海开源基金”）于 2012 年 12 月 27 日经中国证监会批准，2013 年 1 月 23 日注册成立，截至报告期末，注册资本为 2 亿元人民币。其中，开源证券股份有限公司、北京市中盛金期投资管理有限公司、北京长和世纪资产管理有限公司和深圳市和合投信资产管理合伙企业(有限合伙)各持股权 25%。目前，前海开源基金分别在北京、上海设立分公司，在深圳设立华南营销中心；直销中心覆盖珠三角、长三角和京津冀环渤海经济区，为公司的快速发展奠定了组织和区域基础。经中国证监会批准，前海开源基金控股子公司——前海开源资产管理有限公司（以下简称“前海开源资管”）已于 2013 年 9 月 5 日在深圳市注册成立，并于 2013 年 9 月 18 日取得中国证监会核发的《特定客户资产管理业务资格证书》。截至报告期末，前海开源资管的股东结构为：前海开源基金管理有限公司出资 18000 万，占比 100%。

截至报告期末，前海开源基金旗下管理 45 只开放式基金，资产管理规模超过 600 亿元。

#### 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		
吴国清	本基金的基金经理	2016 年 10 月 17 日	-	9 年	吴国清先生，清华大学博士研究生。历任南方基金管理有限公司研究员、基金经理助理、投资经理。2015 年 8 月加入前海开源基金管理有限公司。

注：①对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期，对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

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。

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等

有关法律法规及各项实施准则、《基金合同》和其他有关法律法规的规定，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。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

### 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

基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（2011 年修订）的规定，针对股票市场、债券市场交易等投资管理活动，以及授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动相关的各个环节，制定了《前海开源基金管理有限公司公平交易管理办法》、《前海开源基金管理有限公司异常交易监控管理办法》等公平交易相关的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执行的内部控制，完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

#### 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》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内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没有超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

### 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

2016 年 4 季度，在经济企稳超预期、通胀预期升温、监管去杠杆力度加强、资金面紧张导致基金赎回和收益率上行的恶性循环等多重利空共同的作用下，债市剧烈调整，10 年国债收益率上行幅度一度接近 70BP，信用债和短端收益率整体出现了 100-150BP 的上行。之后尽管随着风险事件的解决及央行维稳资金面债市企稳反弹，但整个季度来看收益率仍出现了较大幅度的上行。操作上，对于固定收益部分，因管理人基于前期对债市的前瞻性分析，在债券投资上比较谨慎。在此期间，债券部分维持相对较低仓位，久期也较短，其余以现金管理为主。股票部分仓位维持在

25-30%之间，主要配置在上证 50 指数品种。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内，A 类基金份额净值增长率为-0.40%，同期业绩比较基准收益率为 0.05%，C 类基金份额净值增长率为-0.40%，同期业绩比较基准收益率为 0.05%。

#### 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 2017 年股市，我们认为风险相对会小于 2016 年，但是整体性的机会还不明显。首先，2017 年经济还将是一个 L 型走势，货币流动性会偏中性，财政政策会相对积极，投资增速受房地产调控影响预计将承压，人民币汇率有继续贬值的趋势，大的宏观经济环境并不乐观。其次，在股市方面，对金融资产风险的监管仍将延续，IPO 在加速，解禁规模居高不下，中小创估值仍然有较大的下降空间。利好的方面，主要在于养老金入市，十九大召开等。因此，我们认为 2017 年仍将是一个充满挑战的年份。在组合投资上，我们相对看好低估值、高分红的上证 50 成分股及其类似品种。

债市方面，上半年因经济基本面有望维持平稳，去杠杆仍将是货币政策的主基调，债市整体上缺乏大的机会。下半年，随着地产销售放缓的负面影响逐步显现，经济可能重新走弱。如果前期去杠杆能取得一定成效，货币政策可能边际放松，届时债市出现趋势性机会的概率增加。基于上述判断，固收部分我们将继续保持谨慎，在趋势性机会出现之前，维持相对短的久期，并关注一些类固收品种。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益的角度出发，依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。公司监察稽核部门按照规定的权限和程序，通过实时监控、现场检查、重点抽查和人员询问等方法，独立地开展基金运作和公司管理的合规性稽核，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事会和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，本基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

(1) 本年度，我公司采取外聘律师和内部专业人士相结合的方式，对各业务部门进行了相关法律法规培训和职业道德培训，进一步提高了我公司从业人员的合规素质和职业道德修养。

(2) 本年度，我公司按照证监会的要求对公司治理、投资、研究、交易、基金会计、注册登记、人力资源、基金销售等主要业务进行定期稽核工作。同时，对信息技术、用户权限、通信管

理与视频监控、基金直销、后台运营、内幕交易防控等相关业务开展了专项稽核工作，检查业务开展的合规性和制度执行的有效性等。

(3) 通过事前合规防范、事中系统控制、事后完善纠偏的方式，全面加强了对公司产品日常投资运作的管理与监控，保证投资符合既定的投资决策程序与业务流程，基金投资组合及个股投资符合比例控制的要求，严格执行分级授权制度，保证基金投资独立、公平。

(4) 全面参与新产品设计、新业务拓展工作，负责日常合同审查，监督客户投诉处理。积极参与证监会新规定出台前的讨论并提出修改建议。

(5) 完成各基金及公司的各项信息披露工作，保证所披露信息的真实性、准确性和完整性；重视媒体监督和投资者关系管理工作。

(6) 按照规定向人民银行报送反洗钱相关报表和报告，按监管要求制定客户洗钱风险划分的标准，并升级了客户洗钱风险划分系统。

本基金管理人承诺将依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会由总经理、督察长、基金事务部、研究部、投资部、监察稽核部、金融工程部、交易部负责人及其他指定相关人员组成。估值委员会成员均具备专业胜任能力和相关从业资格，精通各自领域的理论知识，熟悉相关政策法规，并具有丰富的实践经验。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供固定收益品种的估值数据。

本基金本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未进行利润分配。

#### 4.9 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

2016 年度，基金托管人在前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

### 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

2016 年度，前海开源基金管理有限公司在前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

### 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

2016 年度，由前海开源基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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	瑞华审字【2017】48460051 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	前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金的财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表，2016 年 10 月 17 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日的利润表、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前海开源基金管理有限公司的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会（以下简称“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导致的重大错报。
注册会计师的责任段	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。 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。 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。
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和在财务报表附注中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，公允反映了前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年 10 月 17 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日的经营成果和基金净值变动情况。
注册会计师的姓名	邢向宗   邹菁
会计师事务所的名称	瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)
会计师事务所的地址	北京市东城区永定门西滨河路 8 号院 7 号楼中海地产广场西塔 5-11 层
审计报告日期	2017 年 3 月 23 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日
----	-----	-------------------------

<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	40,868,924.78
结算备付金		3,459,207.63
存出保证金		27,610.82
交易性金融资产	7.4.7.2	241,609,727.00
其中：股票投资		90,747,623.43
基金投资		-
债券投资		96,206,299.20
资产支持证券投资		54,655,804.37
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	46,000,509.00
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	2,190,729.62
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		334,156,708.85
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016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	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		1,987.61
应付管理人报酬		413,558.36
应付托管费		68,926.42
应付销售服务费		13.00
应付交易费用	7.4.7.7	80,636.04
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	55,000.00
负债合计		620,121.43
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	7.4.7.9	334,857,276.13
未分配利润	7.4.7.10	-1,320,688.71
所有者权益合计		333,536,587.42
负债和所有者权益总计		334,156,708.85

注：①报告截止日 2016 年 12 月 31 日，前海开源沪港深核心资源 A 基金份额净值 0.996 元，基金份额总额 334,707,195.07 份，前海开源沪港深核心资源 C 基金份额净值 0.996 元，基金份额总额 150,081.06 份。

②本基金的基金合同于 2016 年 10 月 17 日生效，无上年度末可比数据。

## 7.2 利润表

会计主体：前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 10 月 17 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 10 月 17 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		44,867.66
1.利息收入		1,507,466.74
其中：存款利息收入	7.4.7.11	340,929.24
债券利息收入		634,461.74
资产支持证券利息收入		317,964.09
买入返售金融资产收入		214,111.67
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		518,009.26
其中：股票投资收益	7.4.7.12	516,250.87
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	287.40
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-1,587.41
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-
股利收益	7.4.7.16	3,058.40
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-1,980,705.29
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	96.95
<b>减：二、费用</b>		1,302,730.53
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	958,487.68
2. 托管费	7.4.10.2.2	159,748.01
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	32.83
4. 交易费用	7.4.7.19	99,201.16
5. 利息支出		15,475.85
其中：卖出回购金融资产支出		15,475.85
6. 其他费用	7.4.7.20	69,785.00

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,257,862.87
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,257,862.87

注：本基金的基金合同于 2016 年 10 月 17 日生效，实际报告期间为 2016 年 10 月 17 日（基金合同生效日）到 2016 年 12 月 31 日，无上年度可比期间数据。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 10 月 17 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 10 月 17 日（基金合同生效日）至 2016 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）	260,287,793.58	-	260,287,793.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,257,862.87	-1,257,862.87
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）	74,569,482.55	-62,825.84	74,506,656.71
其中：1. 基金申购款	74,619,553.41	-62,433.01	74,557,120.40
2. 基金赎回款	-50,070.86	-392.83	-50,463.69
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）	334,857,276.13	-1,320,688.71	333,536,587.42

注：本基金的基金合同于 2016 年 10 月 17 日生效，实际报告期间为 2016 年 10 月 17 日（基金合同生效日）到 2016 年 12 月 31 日，无上年度可比期间数据。

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：

蔡颖  
基金管理人负责人

李志祥  
主管会计工作负责人

任福利  
会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

前海开源沪港深核心资源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【2016】965号文《关于准予前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》，由前海开源基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金基金合同》及其他法律法规公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次募集期间为 2016 年 9 月 6 日至 2016 年 10 月 13 日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 260,252,626.81 元，经瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）瑞华验字[2016]02230150 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 10 月 17 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 260,287,793.58 份基金份额，其中认购资金利息折合 35,166.77 份基金份额。本基金的基金管理人为前海开源基金管理有限公司，本基金托管人为交通银行股份有限公司。

### 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颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《前海开源沪港深核心资源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 7.4.4 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。

### 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本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 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自 2016 年 10 月 17 日（基金合同生效日）起至 2016 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、基金投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具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，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；对于支付的价款中包含的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。

对于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；对于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。

当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、资产支持证券投资和衍生工具(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 1) 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 2) 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。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 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损益/(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

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在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确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理费、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 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 12 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；若投资者选择红利再投资方式进行收益分配，收益的计算以权益登记日当日收市后计算的两类基金份额净值为基准转为相应类别的基金份额进行再投资；

(3) 基金收益分配后两类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的两类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 本基金两类基金份额在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同。本基金同一类别的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) 对于证券交易所上市的股票，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、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于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。

(3) 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

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期未发生会计差错更正。

## 7.4.6 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[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》，财政部、国家税务总局、证监会财税[2014]81号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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》、财税[2016]127号《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，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。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(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 2015 年 9 月 8 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，股息红利所得暂免征收个人所得税。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) 对基金通过沪港通投资香港联交所上市股票取得的转让差价所得，自 2014 年 11 月 17 日起至 2017 年 11 月 16 日止，暂免征收个人所得税。对基金通过深港通投资香港联交所上市股票取得的转让差价所得，自 2016 年 12 月 5 日起至 2019 年 12 月 4 日止，暂免征收个人所得税。对基金通过港股通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。对基金通过沪港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(5) 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。基金通过港股通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

## 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	
	2016 年 12 月 31 日	
活期存款		20,868,924.78
定期存款		20,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月		-
存款期限 3 个月以上		20,000,000.00
其他存款		-
合计：		40,868,924.78

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2016 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	91,336,768.34	90,747,623.43	-589,144.91	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	87,621,802.73	86,266,299.20	-1,355,503.53
	银行间市场	9,976,056.85	9,940,000.00	-36,056.85
	合计	97,597,859.58	96,206,299.20	-1,391,560.38
资产支持证券	54,655,804.37	54,655,804.37	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	243,590,432.29	241,609,727.00	-1,980,705.29	

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

### 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

单位：人民币元

项目	本期末	
	2016 年 12 月 31 日	

	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券—银行间	46,000,509.00	-
合计	46,000,509.00	-

#### 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 2016年12月31日
应收活期存款利息	5,980.97
应收定期存款利息	65,000.00
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,556.60
应收债券利息	1,918,171.88
应收买入返售证券利息	60,276.56
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	139,743.61
合计	2,190,729.62

注：“其他”为应收结算保证金利息和应收资产支持证券利息。

#### 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 2016年12月31日
交易所市场应付交易费用	79,357.04
银行间市场应付交易费用	1,279.00
合计	80,636.04

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-

预提费用	55,000.00
合计	55,000.00

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

前海开源沪港深核心资源混合 A		
项目	本期 2016 年 10 月 17 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	260,124,485.86	260,124,485.86
本期申购	74,590,513.27	74,590,513.27
本期赎回(以“-”号填列)	-7,804.06	-7,804.06
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	334,707,195.07	334,707,195.07

金额单位：人民币元

前海开源沪港深核心资源混合 C		
项目	本期 2016 年 10 月 17 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	163,307.72	163,307.72
本期申购	29,040.14	29,040.14
本期赎回(以“-”号填列)	-42,266.80	-42,266.80
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	150,081.06	150,081.06

注：申购含红利再投、转换入份（金）额；赎回含转换出份（金）额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

前海开源沪港深核心资源混合 A			
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	722,484.41	-1,979,873.22	-1,257,388.81
本期基金份额交易产生的变动数	15,407.60	-78,133.05	-62,725.45

其中：基金申购款	15,407.48	-78,065.94	-62,658.46
基金赎回款	0.12	-67.11	-66.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	737,892.01	-2,058,006.27	-1,320,114.26

单位：人民币元

前海开源沪港深核心资源混合 C			
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	358.01	-832.07	-474.06
本期基金份额交易产生的变动数	-8.91	-91.48	-100.39
其中：基金申购款	0.72	224.73	225.45
基金赎回款	-9.63	-316.21	-325.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	349.10	-923.55	-574.45

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016年10月17日(基金合同生效日)至2016年12月31日
活期存款利息收入	89,238.35
定期存款利息收入	244,055.56
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	6,300.66
其他	1,334.67
合计	340,929.24

注：“其他”为申购款利息收入及结算保证金利息收入。

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016年10月17日(基金合同生效日)至2016年12月31日
卖出股票成交总额	9,136,552.24
减：卖出股票成本总额	8,620,301.37
买卖股票差价收入	516,250.87

### 7.4.7.13 债券投资收益

#### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2016年10月17日(基金合同生效日)至2016年12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	287.40
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	287.40

#### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年10月17日(基金合同生效日)至2016年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	20,044,712.33
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	19,999,712.60
减：应收利息总额	44,712.33
买卖债券差价收入	287.40

#### 7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

#### 7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券申购差价收入。

#### 7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年10月17日(基金合同生效日)至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
卖出资产支持证券成交总额	5,545,635.62	-
减：卖出资产支持证券成本总额	5,358,587.41	-



减：应收利息总额	188,635.62	-
资产支持证券投资收益	-1,587.41	-

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

##### 7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

##### 7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无贵金属买卖差价收入。

##### 7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属赎回差价收入。

##### 7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属申购差价收入。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

##### 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无买卖权证差价收入。

##### 7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

本基金本报告期内无其他衍生工具投资收益。

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2016年10月17日(基金合同生效日)至2016年12月31日
股票投资产生的股利收益	3,058.40
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,058.40

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
------	----

	2016年10月17日(基金合同生效日)至2016年12月31日
1. 交易性金融资产	-1,980,705.29
——股票投资	-589,144.91
——债券投资	-1,391,560.38
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-1,980,705.29

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年10月17日(基金合同生效日)至2016年12月31日
基金赎回费收入	91.80
基金转换费收入	5.15
合计	96.95

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年10月17日(基金合同生效日)至2016年12月31日
交易所市场交易费用	98,826.16
银行间市场交易费用	375.00
合计	99,201.16

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年10月17日(基金合同生效日)至2016年12月31日
审计费用	40,000.00
信息披露费	15,000.00
汇划费	2,385.00
其他	12,400.00
合计	69,785.00

注：“其他”为证券账户开户费及基金份额持有人大会公证费用。

## 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，本基金无或有事项。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金于 2017 年 1 月 19 日发布《前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，自 2017 年 1 月 19 日起，本基金的管理费年费率调整为 0.60%，托管费年费率调整为 0.10%。

## 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
前海开源基金管理有限公司（“前海开源基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金托管人
开源证券股份有限公司（“开源证券”）	基金管理人股东
北京市中盛金期投资管理有限公司	基金管理人股东
北京长和世纪资产管理有限公司	基金管理人股东
深圳市和合投信资产管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
前海开源资产管理有限公司	基金管理人的子公司

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。

## 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

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 7.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内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

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 7.4.10.1.4 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。

### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行交易，无佣金产生。

### 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
	2016年10月17日(基金合同生效日)至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	958,487.68
其中：支付销售机构的客户维护费	-

注：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。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月首日前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

本基金管理人按照与基金代销机构签订的基金销售协议约定，依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，客户维护费从基金管理费中列支。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2016年10月17日(基金合同生效日)至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	159,748.01

注：本基金的托管费按前一日资产净值的 0.25% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节

假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

1、本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.10%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务。

销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.10% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付。销售服务费由登记机构代收并按照相关合同规定支付给基金销售机构。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

2、本报告期内，本基金关联方未从本基金获得销售服务费。

#### 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

本基金本报告期内与关联方无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

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 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

本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 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

单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 10 月 17 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	20,868,924.78	89,238.35	-	-

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行股份有限公司保管，按适用利率或约定利率计息。

**7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销证券。

**7.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

**7.4.11 利润分配情况**

本基金本报告期内未进行利润分配。

**7.4.12 期末（2016 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**

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601375	中原证券	2016 年 12 月 20 日	2017 年 1 月 3 日	新股流通受限	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	-
603877	太平鸟	2016 年 12 月 29 日	2017 年 1 月 9 日	新股流通受限	21.30	21.30	3,180	67,734.00	67,734.00	-
603035	常熟汽饰	2016 年 12 月 27 日	2017 年 1 月 5 日	新股流通受限	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04	-
002840	华统股份	2016 年 12 月 29 日	2017 年 1 月 10 日	新股流通受限	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-
002838	道恩股份	2016 年 12 月 28 日	2017 年 1 月 6 日	新股流通受限	15.28	15.28	682	10,420.96	10,420.96	-
300586	美联新材	2016 年 12 月 26 日	2017 年 1 月 4 日	新股流通受限	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-
300591	万里马	2016 年 12 月 30 日	2017 年 1 月 10 日	新股流通受限	3.07	3.07	2,396	7,355.72	7,355.72	-

**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（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000750	国海证券	2016年12月15日	重大事项	6.97	2017年1月20日	6.27	162,500	1,176,027.16	1,132,625.00	-
000166	申万宏源	2016年12月21日	重大事项	6.25	2017年1月26日	6.29	179,000	1,155,303.11	1,118,750.00	-

**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 2016 年 12 月 31 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

**7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

**7.4.13 金融工具风险及管理**

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要是信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

**7.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以监察及风险控制委员会、督察长、风险控制委员会、监察稽核部、金融工程部和相关业务部门构成的多层级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立监察及风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；本基金的基金管理人设立督察长制度，积极对公司各项制度、业务的合法合规性及内部控制制度的执行情况进行监察、稽核，定期和不定期向董事会报告公司内部风险控制执行情况；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部、金融工程部负责，协调并与各部

门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。

本基金的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。

#### 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。本基金的银行存款由基金托管人保管，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，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。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级，通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，且通过分散化投资以分散信用风险。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	9,940,000.00	-
合计	9,940,000.00	-

注：未评级债券为国债、央票及政策性金融债等。债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

##### 7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
--------	--------------------	---------------------



AAA	853,699.20	-
AAA 以下	69,467,000.00	-
未评级	15,945,600.00	-
合计	86,266,299.20	-

注：未评级债券为国债、央票及政策性金融债等。债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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制的投资品种比例等。本基金所持大部分证券在证券交易所或银行间同业市场交易，除在“期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制的情况外，其余均能及时变现。

### 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

和债券投资等。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	40,868,924.78	-	-	-	40,868,924.78
结算备付金	3,459,207.63	-	-	-	3,459,207.63
存出保证金	27,610.82	-	-	-	27,610.82
交易性金融资产	25,885,600.00	70,320,699.20	-	-145,403,427.80	241,609,727.00
买入返售金融资产	46,000,509.00	-	-	-	46,000,509.00
应收利息	-	-	-	2,190,729.62	2,190,729.62
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	116,241,852.23	70,320,699.20	-	-147,594,157.42	334,156,708.85
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,987.61	1,987.61
应付管理人报酬	-	-	-	413,558.36	413,558.36
应付托管费	-	-	-	68,926.42	68,926.42
应付销售服务费	-	-	-	13.00	13.00
应付交易费用	-	-	-	80,636.04	80,636.04
其他负债	-	-	-	55,000.00	55,000.00
负债总计	-	-	-	620,121.43	620,121.43
利率敏感度缺口	116,241,852.23	70,320,699.20	-	-146,974,035.99	333,536,587.42

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016年12月31日）	上年度末（2015年12月31日）
	基准点利率增加0.25%	-298,889.64	-
	基准点利率减少0.25%	300,713.13	

#### 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化而发生波动的风险。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。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 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 2016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	90,747,623.43	27.21
交易性金融资产-基金投资	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-
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	90,747,623.43	27.21

##### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	若其他市场变量保持不变,对市场价格敏感的权益性投资的市场价格上升或下降5%		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016年12月31日）	上年度末（2015年12月31日）
	权益性投资的市场价格上升5%	4,248,901.00	-
权益性投资的市场价格下降5%	-4,248,901.00	-	

##### 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

#### 7.4.14 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 2016 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 88,258,541.21 元，属于第二层次的余额为 153,351,185.79 元，属于第三层次的余额为 0.00 元。

##### (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和债券，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，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还是第三层次。

##### (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 2016 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	90,747,623.43	27.16
	其中：股票	90,747,623.43	27.16
2	固定收益投资	150,862,103.57	45.15
	其中：债券	96,206,299.20	28.79
	资产支持证券	54,655,804.37	16.36
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	46,000,509.00	13.77
	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	44,328,132.41	13.27
7	其他各项资产	2,218,340.44	0.66
8	合计	334,156,708.85	100.00

## 8.2 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	184,084.00	0.06
B	采矿业	652,488.00	0.20
C	制造业	17,289,857.27	5.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,707,334.70	0.51
E	建筑业	3,725,528.23	1.12
F	批发和零售业	835,369.00	0.25
G	交通运输、仓储和邮政业	2,401,875.00	0.72
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	662,376.00	0.20
J	金融业	61,719,493.23	18.50
K	房地产业	655,276.00	0.20
L	租赁和商务服务业	73,866.00	0.02
M	科学研究和技术服务业	395,520.00	0.12
N	水利、环境和公共设施管理业	83,148.00	0.02
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	361,408.00	0.11
S	综合	-	-
	合计	90,747,623.43	27.21

### 8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未通过沪港通机制投资港股。

### 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	002142	宁波银行	503,000	8,369,920.00	2.51
2	000001	平安银行	869,800	7,915,180.00	2.37
3	600036	招商银行	223,900	3,940,640.00	1.18
4	600015	华夏银行	356,173	3,864,477.05	1.16
5	601628	中国人寿	159,400	3,839,946.00	1.15
6	601988	中国银行	1,083,100	3,725,864.00	1.12
7	601166	兴业银行	227,700	3,675,078.00	1.10
8	601336	新华保险	83,631	3,661,365.18	1.10
9	601318	中国平安	102,900	3,645,747.00	1.09
10	601288	农业银行	1,166,900	3,617,390.00	1.08
11	601601	中国太保	116,700	3,240,759.00	0.97
12	000776	广发证券	68,800	1,159,968.00	0.35
13	000750	国海证券	162,500	1,132,625.00	0.34
14	000166	申万宏源	179,000	1,118,750.00	0.34
15	000783	长江证券	107,700	1,101,771.00	0.33
16	601211	国泰君安	54,100	1,005,719.00	0.30
17	002500	山西证券	82,600	992,852.00	0.30
18	601901	方正证券	128,300	975,080.00	0.29
19	600109	国金证券	74,000	964,220.00	0.29
20	601688	华泰证券	52,600	939,436.00	0.28
21	601555	东吴证券	70,400	934,208.00	0.28
22	600958	东方证券	58,800	913,164.00	0.27

23	600999	招商证券	53,800	878,554.00	0.26
24	600191	华资实业	33,000	459,360.00	0.14
25	603288	海天味业	15,600	457,548.00	0.14
26	600429	三元股份	57,900	454,515.00	0.14
27	600298	安琪酵母	25,400	452,628.00	0.14
28	603369	今世缘	33,500	439,520.00	0.13
29	601800	中国交建	27,700	420,763.00	0.13
30	002482	广田集团	45,000	416,250.00	0.12
31	600600	青岛啤酒	13,800	406,272.00	0.12
32	002051	中工国际	17,700	405,684.00	0.12
33	601117	中国化学	57,900	391,983.00	0.12
34	600284	浦东建设	29,400	387,786.00	0.12
35	300197	铁汉生态	30,000	380,400.00	0.11
36	000568	泸州老窖	11,300	372,900.00	0.11
37	600039	四川路桥	77,400	366,876.00	0.11
38	002302	西部建设	47,700	354,888.00	0.11
39	000848	承德露露	31,200	349,128.00	0.10
40	000858	五粮液	10,100	348,248.00	0.10
41	002304	洋河股份	4,900	345,940.00	0.10
42	600970	中材国际	48,700	345,283.00	0.10
43	002325	洪涛股份	41,400	331,614.00	0.10
44	000869	张裕A	8,700	313,200.00	0.09
45	601886	江河集团	29,400	313,110.00	0.09
46	300284	苏交科	15,000	312,000.00	0.09
47	000729	燕京啤酒	43,800	304,410.00	0.09
48	002557	洽洽食品	18,900	303,534.00	0.09
49	600477	杭萧钢构	29,400	295,470.00	0.09
50	000895	双汇发展	13,800	288,834.00	0.09
51	600986	科达股份	18,200	277,368.00	0.08
52	601766	中国中车	21,100	206,147.00	0.06
53	600072	钢构工程	11,600	201,144.00	0.06
54	600320	振华重工	38,900	198,390.00	0.06
55	600582	天地科技	39,300	195,321.00	0.06
56	600031	三一重工	31,100	189,710.00	0.06
57	600967	北方创业	13,800	187,266.00	0.06
58	601608	中信重工	33,000	185,130.00	0.06
59	600519	贵州茅台	500	167,075.00	0.05
60	600458	时代新材	11,400	161,310.00	0.05
61	601106	中国一重	29,400	159,054.00	0.05

62	600835	上海机电	7,800	152,256.00	0.05
63	300266	兴源环境	2,600	142,688.00	0.04
64	600038	中直股份	2,600	125,892.00	0.04
65	600420	现代制药	3,800	125,856.00	0.04
66	600012	皖通高速	7,400	122,026.00	0.04
67	601989	中国重工	16,200	114,858.00	0.03
68	000425	徐工机械	33,600	113,568.00	0.03
69	002252	上海莱士	4,900	113,141.00	0.03
70	002419	天虹商场	7,500	112,650.00	0.03
71	300201	海伦哲	13,800	111,642.00	0.03
72	002678	珠江钢琴	7,500	111,600.00	0.03
73	002277	友阿股份	7,500	107,700.00	0.03
74	601375	中原证券	26,695	106,780.00	0.03
75	002269	美邦服饰	21,300	106,713.00	0.03
76	000989	九芝堂	4,900	106,379.00	0.03
77	002301	齐心集团	4,900	106,330.00	0.03
78	002648	卫星石化	8,700	106,314.00	0.03
79	601233	桐昆股份	7,400	106,264.00	0.03
79	600827	百联股份	7,400	106,264.00	0.03
80	002111	威海广泰	4,900	104,860.00	0.03
81	000690	宝新能源	11,300	104,751.00	0.03
82	000768	中航飞机	4,900	104,174.00	0.03
83	002595	豪迈科技	4,900	103,145.00	0.03
84	002262	恩华药业	4,900	102,410.00	0.03
85	002002	鸿达兴业	13,800	101,292.00	0.03
86	600009	上海机场	3,800	100,776.00	0.03
87	000898	鞍钢股份	19,900	100,296.00	0.03
88	000709	河钢股份	30,000	100,200.00	0.03
89	000825	太钢不锈	25,200	99,288.00	0.03
90	002203	海亮股份	12,300	99,138.00	0.03
91	002689	远大智能	13,800	97,842.00	0.03
92	000882	华联股份	21,300	97,341.00	0.03
93	000767	漳泽电力	25,200	97,020.00	0.03
94	000726	鲁泰A	7,500	96,075.00	0.03
95	000501	鄂武商A	4,900	95,648.00	0.03
96	002531	天顺风能	13,800	94,944.00	0.03
97	000828	东莞控股	7,500	94,350.00	0.03
98	000022	深赤湾A	4,900	93,247.00	0.03
99	002041	登海种业	4,900	92,512.00	0.03



100	300498	温氏股份	2,600	91,572.00	0.03
101	000778	新兴铸管	17,700	91,509.00	0.03
102	000900	现代投资	11,300	91,191.00	0.03
103	600332	白云山	3,800	91,124.00	0.03
104	000876	新希望	11,300	90,965.00	0.03
105	000966	长源电力	15,000	90,600.00	0.03
105	002345	潮宏基	7,500	90,600.00	0.03
106	601003	柳钢股份	19,000	90,440.00	0.03
107	002275	桂林三金	4,900	90,013.00	0.03
108	002399	海普瑞	4,900	89,278.00	0.03
109	002470	金正大	11,300	89,270.00	0.03
110	002520	日发精机	7,500	88,875.00	0.03
111	600143	金发科技	11,400	88,692.00	0.03
112	603298	杭叉集团	3,641	88,403.48	0.03
113	002242	九阳股份	4,900	88,347.00	0.03
114	000852	石化机械	8,100	87,804.00	0.03
115	000156	华数传媒	4,900	87,759.00	0.03
116	000088	盐田港	12,300	87,699.00	0.03
117	002385	大北农	12,300	87,330.00	0.03
118	002517	恺英网络	2,600	87,256.00	0.03
119	001896	豫能控股	8,700	87,087.00	0.03
120	603001	奥康国际	3,800	87,020.00	0.03
121	300204	舒泰神	4,900	86,877.00	0.03
122	002128	露天煤业	10,100	86,860.00	0.03
123	000572	海马汽车	16,200	86,832.00	0.03
124	600098	广州发展	7,735	86,786.70	0.03
125	000650	仁和药业	12,300	86,715.00	0.03
126	000732	泰禾集团	4,900	86,681.00	0.03
127	000883	湖北能源	18,900	86,562.00	0.03
128	600983	惠而浦	7,400	86,284.00	0.03
129	000539	粤电力A	16,200	86,184.00	0.03
130	002042	华孚色纺	7,500	85,950.00	0.03
131	600897	厦门空港	3,800	85,918.00	0.03
132	600567	山鹰纸业	23,700	85,794.00	0.03
133	002498	汉缆股份	19,900	85,570.00	0.03
134	002543	万和电气	4,900	85,260.00	0.03
135	002588	史丹利	7,500	85,125.00	0.03
136	002603	以岭药业	4,900	84,476.00	0.03
137	600062	华润双鹤	3,800	84,474.00	0.03

138	600959	江苏有线	7,400	83,620.00	0.03
139	002426	胜利精密	10,100	83,527.00	0.03
139	002437	誉衡药业	10,100	83,527.00	0.03
140	600629	华建集团	4,000	83,520.00	0.03
141	000005	世纪星源	12,300	83,148.00	0.02
142	002011	盾安环境	8,700	82,824.00	0.02
143	600824	益民集团	11,400	82,536.00	0.02
144	601633	长城汽车	7,400	81,844.00	0.02
145	000089	深圳机场	10,100	80,800.00	0.02
146	000761	本钢板材	15,000	80,700.00	0.02
147	600508	上海能源	7,400	80,364.00	0.02
147	600188	兖州煤业	7,400	80,364.00	0.02
148	600398	海澜之家	7,400	79,846.00	0.02
149	601333	广深铁路	15,600	79,092.00	0.02
150	601965	中国汽研	7,400	78,810.00	0.02
151	300307	慈星股份	7,500	78,600.00	0.02
152	002131	利欧股份	4,900	78,155.00	0.02
153	002191	劲嘉股份	7,500	78,075.00	0.02
154	601880	大连港	27,700	77,560.00	0.02
155	000600	建投能源	8,700	77,256.00	0.02
156	600507	方大特钢	11,400	77,178.00	0.02
157	002158	汉钟精机	7,500	77,175.00	0.02
158	002563	森马服饰	7,500	77,025.00	0.02
159	601933	永辉超市	15,600	76,596.00	0.02
160	002653	海思科	4,900	76,587.00	0.02
161	601566	九牧王	4,300	76,067.00	0.02
162	300043	星辉娱乐	7,500	76,050.00	0.02
163	601801	皖新传媒	4,300	75,551.00	0.02
164	600035	楚天高速	12,200	75,152.00	0.02
165	600795	国电电力	23,700	75,129.00	0.02
166	600329	中新药业	4,300	74,992.00	0.02
167	600221	海南航空	23,000	74,980.00	0.02
168	000536	华映科技	4,900	74,823.00	0.02
169	000601	韶能股份	8,700	74,733.00	0.02
170	600723	首商股份	7,800	74,334.00	0.02
171	600873	梅花生物	11,400	74,328.00	0.02
172	600350	山东高速	11,400	73,872.00	0.02
173	000062	深圳华强	2,600	73,866.00	0.02
174	000863	三湘股份	8,700	73,863.00	0.02

175	000541	佛山照明	7,500	73,800.00	0.02
176	601636	旗滨集团	19,000	73,720.00	0.02
177	002445	中南文化	4,900	73,549.00	0.02
178	600688	上海石化	11,400	73,416.00	0.02
179	601588	北辰实业	17,600	73,392.00	0.02
180	600317	营口港	21,100	73,217.00	0.02
181	600033	福建高速	21,100	73,006.00	0.02
182	600585	海螺水泥	4,300	72,928.00	0.02
183	600176	中国巨石	7,400	72,816.00	0.02
184	601126	四方股份	7,400	72,002.00	0.02
185	002267	陕天然气	7,500	71,925.00	0.02
186	600352	浙江龙盛	7,800	71,838.00	0.02
187	600971	恒源煤电	11,400	71,478.00	0.02
188	600252	中恒集团	15,600	71,448.00	0.02
189	600017	日照港	17,600	71,280.00	0.02
190	601339	百隆东方	11,400	71,136.00	0.02
191	600428	中远海特	11,600	70,992.00	0.02
192	601139	深圳燃气	7,800	70,902.00	0.02
193	600569	安阳钢铁	23,700	70,863.00	0.02
194	600863	内蒙华电	23,000	70,840.00	0.02
195	600787	中储股份	7,800	70,746.00	0.02
196	603993	洛阳钼业	19,000	70,680.00	0.02
197	600018	上港集团	13,800	70,656.00	0.02
198	002238	天威视讯	4,820	70,613.00	0.02
199	601000	唐山港	17,600	70,576.00	0.02
199	600157	永泰能源	17,600	70,576.00	0.02
200	600736	苏州高新	7,800	70,434.00	0.02
201	300004	南风股份	4,900	70,217.00	0.02
202	600020	中原高速	15,600	70,044.00	0.02
203	000665	湖北广电	4,900	69,972.00	0.02
204	601018	宁波港	13,800	69,828.00	0.02
204	601107	四川成渝	13,800	69,828.00	0.02
205	000046	泛海控股	7,500	69,675.00	0.02
206	600550	保变电气	11,400	69,654.00	0.02
207	000722	湖南发展	4,900	69,629.00	0.02
208	601992	金隅股份	15,600	69,576.00	0.02
209	600269	赣粤高速	13,800	69,414.00	0.02
210	600307	酒钢宏兴	25,400	69,342.00	0.02
211	600022	山东钢铁	27,700	69,250.00	0.02

212	600724	宁波富达	11,600	69,020.00	0.02
213	603218	日月股份	1,652	68,805.80	0.02
214	600741	华域汽车	4,300	68,585.00	0.02
215	000967	盈峰环境	4,900	68,502.00	0.02
216	600726	华电能源	13,800	68,310.00	0.02
217	300145	中金环境	2,600	67,860.00	0.02
217	600674	川投能源	7,800	67,860.00	0.02
218	002023	海特高新	4,900	67,816.00	0.02
219	603877	太平鸟	3,180	67,734.00	0.02
220	600220	江苏阳光	15,600	67,704.00	0.02
221	601898	中煤能源	11,600	67,396.00	0.02
222	601666	平煤股份	13,800	67,206.00	0.02
223	600808	马钢股份	23,700	67,071.00	0.02
224	600377	宁沪高速	7,800	66,690.00	0.02
225	000919	金陵药业	4,900	66,297.00	0.02
226	600010	包钢股份	23,700	66,123.00	0.02
227	002293	罗莱生活	4,900	65,905.00	0.02
228	601258	庞大集团	23,700	65,649.00	0.02
229	601929	吉视传媒	15,600	65,364.00	0.02
230	002152	广电运通	4,900	65,072.00	0.02
231	600757	长江传媒	7,800	64,818.00	0.02
232	601179	中国西电	11,600	64,728.00	0.02
233	000999	华润三九	2,600	64,298.00	0.02
234	600780	通宝能源	11,600	64,148.00	0.02
235	600008	首创股份	15,600	64,116.00	0.02
236	300267	尔康制药	4,900	63,945.00	0.02
237	601016	节能风电	7,200	63,720.00	0.02
238	601098	中南传媒	3,800	63,308.00	0.02
239	600125	铁龙物流	7,800	63,024.00	0.02
240	600023	浙能电力	11,600	62,988.00	0.02
241	600270	外运发展	3,800	62,852.00	0.02
242	600210	紫江企业	11,600	62,756.00	0.02
243	600618	氯碱化工	4,300	62,737.00	0.02
244	600509	天富能源	8,200	61,254.00	0.02
245	600004	白云机场	4,300	60,587.00	0.02
246	600869	智慧能源	7,800	60,372.00	0.02
247	600613	神奇制药	4,300	60,329.00	0.02
248	600177	雅戈尔	4,300	60,114.00	0.02
249	600180	瑞茂通	4,300	58,222.00	0.02

250	601158	重庆水务	7,800	57,954.00	0.02
251	600583	海油工程	7,800	57,564.00	0.02
252	601872	招商轮船	11,600	57,304.00	0.02
253	600572	康恩贝	7,800	57,018.00	0.02
254	600261	阳光照明	7,800	56,316.00	0.02
255	601111	中国国航	7,800	56,160.00	0.02
256	600811	东方集团	7,800	55,770.00	0.02
257	601908	京运通	7,800	55,536.00	0.02
258	600823	世茂股份	7,800	54,756.00	0.02
259	603416	信捷电气	1,076	53,886.08	0.02
260	601515	东风股份	4,300	51,471.00	0.02
261	600611	大众交通	7,800	51,246.00	0.02
262	600717	天津港	4,900	49,392.00	0.01
263	600236	桂冠电力	7,800	47,580.00	0.01
264	300582	英飞特	1,359	35,157.33	0.01
265	603886	元祖股份	1,929	34,143.30	0.01
266	601238	广汽集团	1,300	30,121.00	0.01
267	603239	浙江仙通	924	29,059.80	0.01
268	002835	同为股份	1,126	24,220.26	0.01
269	603035	常熟汽饰	2,316	24,179.04	0.01
270	600612	老凤祥	500	18,615.00	0.01
271	601021	春秋航空	500	18,370.00	0.01
272	603929	亚翔集成	2,193	15,592.23	0.00
273	002840	华统股份	1,814	11,881.70	0.00
274	002838	道恩股份	682	10,420.96	0.00
275	300586	美联新材	1,006	9,355.80	0.00
276	300591	万里马	2,396	7,355.72	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	002142	宁波银行	9,450,571.00	2.83
2	000001	平安银行	8,901,622.00	2.67
3	600036	招商银行	4,287,192.00	1.29
4	600015	华夏银行	4,023,637.13	1.21

5	601166	兴业银行	3,970,584.00	1.19
6	601988	中国银行	3,968,247.00	1.19
7	601288	农业银行	3,954,224.00	1.19
8	601336	新华保险	3,858,337.62	1.16
9	601628	中国人寿	3,840,181.00	1.15
10	601318	中国平安	3,827,586.69	1.15
11	601601	中国太保	3,609,899.49	1.08
12	000776	广发证券	1,343,819.00	0.40
13	000783	长江证券	1,322,567.00	0.40
14	000750	国海证券	1,315,703.00	0.39
15	000166	申万宏源	1,292,132.30	0.39
16	002500	山西证券	1,285,146.00	0.39
17	601688	华泰证券	1,098,306.00	0.33
18	601555	东吴证券	1,059,862.00	0.32
19	601211	国泰君安	1,055,808.00	0.32
20	600109	国金证券	1,054,567.00	0.32

注：买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，买入金额按成交金额（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	002142	宁波银行	1,045,944.00	0.31
2	000001	平安银行	977,768.00	0.29
3	600036	招商银行	313,843.00	0.09
4	600015	华夏银行	311,580.00	0.09
5	601628	中国人寿	304,881.00	0.09
6	601166	兴业银行	291,046.00	0.09
7	601988	中国银行	288,972.00	0.09
8	601336	新华保险	288,048.00	0.09
9	601288	农业银行	286,332.00	0.09
10	601318	中国平安	280,176.00	0.08
11	601601	中国太保	267,445.00	0.08
12	002831	裕同科技	159,367.00	0.05
13	000776	广发证券	154,652.00	0.05
14	000750	国海证券	146,680.00	0.04

15	000783	长江证券	145,408.00	0.04
16	000166	申万宏源	143,736.00	0.04
17	002500	山西证券	136,542.00	0.04
18	603928	兴业股份	88,857.60	0.03
19	601901	方正证券	80,463.00	0.02
20	600999	招商证券	79,333.00	0.02

注：卖出包括二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，卖出金额按成交金额（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

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	99,957,069.71
卖出股票收入（成交）总额	9,136,552.24

注：买入股票成本、卖出股票收入均按照买卖成交金额（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	15,945,600.00	4.78
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	69,467,000.00	20.83
5	企业短期融资券	9,940,000.00	2.98
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	853,699.20	0.26
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	96,206,299.20	28.84

### 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	112381	16 华联债	200,000	20,162,000.00	6.04
2	136350	16 海怡 02	200,000	19,782,000.00	5.93

3	112430	16 宝龙 03	200,000	19,774,000.00	5.93
4	019546	16 国债 18	160,000	15,945,600.00	4.78
5	011641005	16 鞍钢 SCP005	100,000	9,940,000.00	2.98

### 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	142430	君创 A2	300,000	30,000,000.00	8.99
2	142399	聚信四优 A1	200,000	15,746,000.00	4.72
3	131814	聚信贰 A2	100,000	8,909,804.37	2.67

### 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投资股指期货。

#### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期，本基金没有投资股指期货。

### 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

本报告期，本基金没有投资国债期货。

#### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

#### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本报告期，本基金没有投资国债期货。



## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

本报告编制日前一年内，中国人寿保险股份有限公司（以下简称“中国人寿”）因违反《中华人民共和国保险法》相关规定收到《中国保险监督管理委员会行政处罚决定书》。

中国人寿的投资已执行内部严格的投资决策程序，符合法律法规、基金合同和公司制度的规定，不存在损害投资者利益的情况。

### 8.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	27,610.82
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,190,729.62
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,218,340.44

### 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。

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 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

份额级别	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
前海开源沪港深核心资源混合 A	29	11,541,627.42	334,092,456.14	99.82%	614,738.93	0.18%
前海开源沪港深核心资源混合 C	242	620.17	0.00	0.00%	150,081.06	100.00%
合计	271	1,235,635.71	334,092,456.14	99.77%	764,819.99	0.23%

注：① 分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数(即期末基金份额总额)。

② 户均持有的基金份额合计=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

## 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	前海开源沪港深核心资源混合 A	0.00	0.00%
	前海开源沪港深核心资源混合 C	1,324.42	0.88%
	合计	1,324.42	0.00%

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 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的情况

本报告期末基金管理人的高级管理人员、基金投资和部门负责人及本基金基金经理未持有本开放式基金份额。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	前海开源沪港深 核心资源混合 A	前海开源沪港深 核心资源混合 C
基金合同生效日（2016 年 10 月 17 日）基金 份额总额	260,124,485.86	163,307.72
本报告期期初基金份额总额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购 份额	74,590,513.27	29,040.14
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎 回份额	7,804.06	42,266.80
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变 动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	334,707,195.07	150,081.06

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 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

本报告期内，基金管理人无重大人事变动；

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

## 11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期未改变投资策略。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金提供审计服务的会计师事务所为瑞华会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内未发生变更。

## 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

本报告期基金管理人、托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚的情形。

## 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	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
财达证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	4	108,514,605.53	100.00%	79,357.04	100.00%	-

注：根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，我公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序：

#### A：选择标准

- 1、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；
- 2、公司具有较强的研究能力，能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告；
- 3、公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；
- 4、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。

#### B：选择流程

公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比，并根据评比的结果选择席位：

- 1、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座；

- 2、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实，投资建议是否准确；
- 3、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

### 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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
财达证券	20,075,950.68	23.12%	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	40,728,252.05	46.91%	-	-	-	-
中信证券	26,015,991.78	29.97%	735,200,000.00	100.00%	-	-

### 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	前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金招募说明书	证券时报	2016年9月3日
2	前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金基金份额发售公告	证券时报	2016年9月3日
3	前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金基金合同内容摘要	证券时报	2016年9月3日
4	前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金提前结束募集的公告	证券时报	2016年10月13日
5	前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金基金合同生效公告	证券时报	2016年10月18日
6	前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加创金启富为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告	证券时报	2016年10月19日
7	前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加电盈	证券时报	2016年10月20日

	基金为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告		
8	关于前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金参与部分代销机构费率优惠活动的公告	证券时报	2016 年 10 月 28 日
9	前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定投业务的公告	证券时报	2016 年 10 月 28 日
10	前海开源基金管理有限公司关于华融金融费率调整的公告	证券时报	2016 年 11 月 7 日
11	前海开源基金管理有限公司关于钱景财富费率调整的公告	证券时报	2016 年 11 月 7 日
12	前海开源基金管理有限公司关于新浪仓石费率调整的公告	证券时报	2016 年 11 月 11 日
13	前海开源基金管理有限公司关于广源达信费率调整的公告	证券时报	2016 年 11 月 11 日
14	前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加平安证券为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告	证券时报	2016 年 12 月 8 日
15	关于以通讯方式召开前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告	证券时报	2016 年 12 月 14 日
16	前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加宜信普泽为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告	证券时报	2016 年 12 月 15 日
17	关于以通讯方式召开前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	证券时报	2016 年 12 月 15 日
18	关于以通讯方式召开前海开源沪港深核心资源灵活配置	证券时报	2016 年 12 月 16 日

	混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告		
19	前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金圣诞节假期暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	证券时报	2016 年 12 月 23 日
20	前海开源基金管理有限公司关于北京微动费率调整的公告	证券时报	2016 年 12 月 28 日
21	前海开源基金管理有限公司关于泰诚财富费率调整的公告	证券时报	2016 年 12 月 28 日
22	前海开源基金管理有限公司关于调整旗下部分基金通过蛋卷基金定投申购起点金额的公告	证券时报	2016 年 12 月 28 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，基金管理人发起并以通讯方式组织召开了本基金的基金份额持有人大会，会议拟对《关于调整前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金管理费率、托管费率和赎回费率有关事项的议案》进行审议和表决，会议投票时间自 2016 年 12 月 14 日起，至 2017 年 1 月 16 日 17:00 止。议案具体内容和持有人大会生效情况详见基金管理人在中国证监会指定媒介发布的相关公告。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- (1) 中国证券监督管理委员会批准前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金设立的文件
- (2) 《前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- (3) 《前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

- (4) 《前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
- (5) 基金管理人业务资格批件和营业执照
- (6) 前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

### 13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

### 13.3 查阅方式

- (1) 投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件；
- (2) 投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人前海开源基金管理有限公司，客户服务电话：4001-666-998（免长途话费）；
- (3) 投资者可访问本基金管理人公司网站，网址：[www.qhkyfund.com](http://www.qhkyfund.com)。

前海开源基金管理有限公司  
2017年3月30日