

前海开源沪港深蓝筹精选灵活配置混合型  
证券投资基金  
2017 年半年度报告 摘要

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：前海开源基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 28 日

## § 1 重要提示

### 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。本半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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 18 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	前海开源沪港深蓝筹精选混合
基金主代码	001837
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 12 月 8 日
基金管理人	前海开源基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,956,520,050.46 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于中国大陆 A 股市场 and 法律法规或监管机构允许投资的特定范围内的港股市场，通过跨境资产配置，重点投资沪港深股票市场中的支柱行业和蓝筹公司，在严格控制风险的前提下，力争获取超过业绩比较基准的投资收益。
投资策略	<p>本基金的投资策略主要有以下七方面内容：</p> <p>1、大类资产配置</p> <p>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。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各大类资产风险和预期收益率的评估，制定本基金在 A 股、港股、债券、现金等大类资产之间的配置比例。</p> <p>2、行业配置策略</p> <p>本基金根据宏观经济周期、行业发展阶段、市场风格，决定不同行业的配置比例。此外，中国 A 股市场和港股市场的行业结构具有差异性和互补性，本基金通过深入分析两地市场的异同，重点配置 A 股和港股的支柱行业。</p> <p>3、股票投资策略</p> <p>本基金的股票资产主要投资于沪港深蓝筹股票，投资于与沪港深蓝筹主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的 80%。沪港深蓝筹股票是指在上海、深圳或香港证券交易所上市，具有核心竞争力、经营稳健、业绩优良、治理结构健康、财务状况良好的上市公司股票。本基金重点关注：1) 传统行业中的蓝筹公司；2) 符合国家经济结构转型方向的新兴产业中的新蓝筹公司。个股选择主要考虑公司的行业前景、成长空间、行业地位、竞争优势、盈利能力、运营效率、治理结构等。</p> <p>4、债券投资策略</p> <p>本基金将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>5、权证投资策略</p> <p>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</p>

	<p>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>6、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、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>7、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。本基金参与股指期货投资时机和数量的决策建立在对证券市场总体行情的判断和组合风险收益分析的基础上。基金管理人将根据宏观经济因素、政策及法规因素和资本市场因素，结合定性和定量方法，确定投资时机。基金管理人将结合股票投资的总体规模，以及中国证监会的相关限定和要求，确定参与股指期货交易的投资比例。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×35%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×35%+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，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。本基金为跨境证券投资的基金，主要投资于中国大陆 A 股市场和法律法规或监管机构允许投资的特定范围内的港股市场。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、流动性风险、香港市场风险等港股投资所面临的特别投资风险。

## 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	中国银行股份有限公司
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	95566
传真	0755-83181169	010-66594942

## 2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.qhkyfund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的住所

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 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	报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	182,779,424.78
本期利润	549,764,955.17
加权平均基金份额本期利润	0.1631
本期基金份额净值增长率	15.78%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0557
期末基金资产净值	3,816,269,132.81
期末基金份额净值	1.291

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。

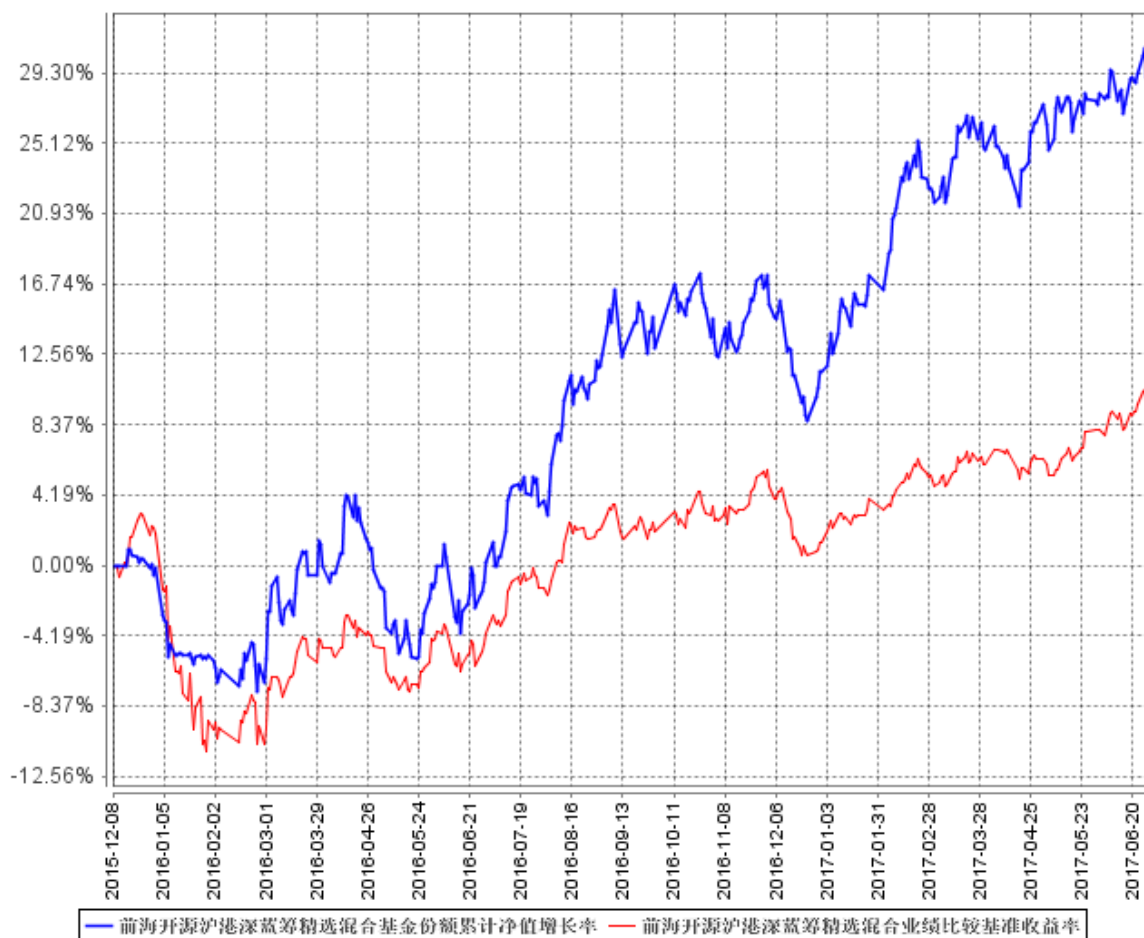
#### 3.2 基金净值表现

##### 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	3.53%	0.77%	3.75%	0.39%	-0.22%	0.38%
过去六个月	15.78%	0.78%	8.42%	0.37%	7.36%	0.41%
过去一年	28.84%	0.86%	14.56%	0.46%	14.28%	0.40%
自基金合同生效起至今	29.10%	0.92%	9.94%	0.69%	19.16%	0.23%

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×35%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×35%+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



## § 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，前海开源基金全资控股子公司——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，注册资本为1.8亿元人民币。截至报告期末，前海开源基金旗下管理58只开放式

基金，资产管理规模超过 620 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		
曲扬	本基金的基金经理、公司董事总经理、国际业务部负责人	2015 年 12 月 8 日	-	9 年	曲扬先生，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、南方全球精选基金经理，2009 年 11 月至 2013 年 1 月担任南方基金香港子公司投资经理助理、投资经理。现任前海开源基金管理有限公司董事总经理、国际业务部负责人。
朱帆	本基金的基金经理助理	2017 年 2 月 7 日	2017 年 3 月 3 日	4 年	朱帆先生，硕士研究生。历任上投摩根基金管理有限公司投资组合经理助理，中国金融信息中心研究员，2015 年 3 月至 2017 年 3 月任前海开源基金管理有限公司研究员、基金经理助理。

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，“离职日期”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遵规守信情况的说明

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、本基金《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。

### 4.3.2 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

2017 年上半年尽管受到金融监管加强、美国加息影响，但资金配置权益资产的意愿强烈，A 股市场和港股市场震荡上升。本基金持仓以港股为主，重点配置了 TMT、医药、消费、金融等行业股票。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内，基金份额净值增长率为 15.78%，同期业绩比较基准收益率为 8.42%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中国经济目前处于转型阶段，增速趋于平稳，结构持续改善。展望三季度，加息周期中权益市场配置价值在提升，处于估值洼地的港股市场更加具有吸引力。本基金持仓将以持续稳定增长的蓝筹股票为主，力争获得持续稳定的超额回报。

## 4.6 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。估值委员会由执行董事长、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。

#### **4.7 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。

#### **4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

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**

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在前海开源沪港深蓝筹精选灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

## 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：前海开源沪港深蓝筹精选灵活配置混合型证券投资基金  
报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	148,795,602.38	502,372,692.10
结算备付金	3,914,586.80	130,370,526.18
存出保证金	-	23,466.19
交易性金融资产	3,613,838,686.77	3,186,397,311.96
其中：股票投资	3,613,838,686.77	3,186,397,311.96
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	32,408,075.22	42,480,610.78
应收利息	57,375.74	106,842.75
应收股利	26,636,795.05	-
应收申购款	2,501,156.69	249,669.41
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	3,828,152,278.65	3,862,001,119.37
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2017 年 6 月 30 日</b>	<b>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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	19.20
应付赎回款	3,798,007.76	392,164,850.80
应付管理人报酬	5,157,078.21	5,075,649.38
应付托管费	859,513.04	845,941.55
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,739,852.72	3,001,811.86
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	328,694.11	992,789.10
负债合计	11,883,145.84	402,081,061.89
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	2,956,520,050.46	3,102,060,879.09
未分配利润	859,749,082.35	357,859,178.39
所有者权益合计	3,816,269,132.81	3,459,920,057.48
负债和所有者权益总计	3,828,152,278.65	3,862,001,119.37

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.291 元，基金份额总额 2,956,520,050.46 份。

## 6.2 利润表

会计主体：前海开源沪港深蓝筹精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>	597,541,499.33	24,295,776.54
1.利息收入	1,621,217.52	639,656.43
其中：存款利息收入	1,621,217.52	593,517.88
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	-	46,138.55
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	220,255,830.67	-2,565,723.41
其中：股票投资收益	172,083,113.10	-12,428,490.64
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	48,172,717.57	9,862,767.23
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	366,985,530.39	25,795,077.08
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	8,678,920.75	426,766.44
<b>减：二、费用</b>	<b>47,776,544.16</b>	<b>12,362,126.95</b>
1. 管理人报酬	30,896,153.67	4,956,796.76
2. 托管费	5,149,358.98	826,132.74
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	11,496,148.55	6,388,858.97
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	234,882.96	190,338.48
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>549,764,955.17</b>	<b>11,933,649.59</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>549,764,955.17</b>	<b>11,933,649.59</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：前海开源沪港深蓝筹精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 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）	3,102,060,879.09	357,859,178.39	3,459,920,057.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	549,764,955.17	549,764,955.17
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）	-145,540,828.63	-47,875,051.21	-193,415,879.84

其中：1.基金申购款	2,662,974,878.86	625,452,568.44	3,288,427,447.30
2.基金赎回款	-2,808,515,707.49	-673,327,619.65	-3,481,843,327.14
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）	2,956,520,050.46	859,749,082.35	3,816,269,132.81
项目	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30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）	149,164,559.64	-326,214.05	148,838,345.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	11,933,649.59	11,933,649.59
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）	1,229,165,983.02	-8,467,733.50	1,220,698,249.52
其中：1.基金申购款	1,322,608,238.10	-11,548,463.85	1,311,059,774.25
2.基金赎回款	-93,442,255.08	3,080,730.35	-90,361,524.73
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）	1,378,330,542.66	3,139,702.04	1,381,470,244.70

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

\_\_\_\_\_  
蔡颖

基金管理人负责人

\_\_\_\_\_  
何隽

主管会计工作负责人

\_\_\_\_\_  
任福利

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

前海开源沪港深蓝筹精选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【2015】1986号文《关于准予前海开源

沪港深蓝筹精选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》、《前海开源沪港深蓝筹精选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 2015 年 9 月 21 日至 2015 年 12 月 4 日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 287,795,382.66 元，经瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）瑞华验字[2016]02230086 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《前海开源沪港深蓝筹精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 12 月 8 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 287,846,858.20 份基金份额，其中认购资金利息折合 51,475.54 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，本基金托管人为中国银行股份有限公司。

#### **6.4.2 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》、《前海开源沪港深蓝筹精选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 6.4.4 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。

#### **6.4.3 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。

#### **6.4.4 重要会计政策和会计估计**

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **6.4.5.1 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。

##### **6.4.5.2 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。

##### **6.4.5.3 差错更正的说明**

本基金本报告期未发生会计差错更正。

## 6.4.6 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。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
活期存款	148,795,602.38
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	148,795,602.38

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	3,138,900,034.37	3,613,838,686.77	474,938,652.40
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	3,138,900,034.37	3,613,838,686.77	474,938,652.40

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 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。

#### 6.4.7.4.2 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。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应收活期存款利息	31,701.01
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	25,576.11
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	98.62
合计	57,375.74

注：“其他”为应收结算保证金利息。

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,739,852.72
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,739,852.72

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	5,544.64
预提费用	323,149.47
合计	328,694.11

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,102,060,879.09	3,102,060,879.09
本期申购	2,662,974,878.86	2,662,974,878.86
本期赎回(以“-”号填列)	-2,808,515,707.49	-2,808,515,707.49
- 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	2,956,520,050.46	2,956,520,050.46

注：申购含红利再投、转换入份（金）额；赎回含转换出份（金）额。

#### 6.4.7.10 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
上年度末	-5,095,183.94	362,954,362.33	357,859,178.39
本期利润	182,779,424.78	366,985,530.39	549,764,955.17
本期基金份额交易产生的变动数	-12,870,545.39	-35,004,505.82	-47,875,051.21
其中：基金申购款	64,882,826.36	560,569,742.08	625,452,568.44
基金赎回款	-77,753,371.75	-595,574,247.90	-673,327,619.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	164,813,695.45	694,935,386.90	859,749,082.35

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
	活期存款利息收入
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	254,251.25
其他	122,444.37
合计	1,621,217.52

注：“其他”为申购款利息收入及结算保证金利息收入。

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	2,961,782,281.07
减：卖出股票成本总额	2,789,699,167.97
买卖股票差价收入	172,083,113.10

### 6.4.7.13 债券投资收益

#### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期内无债券投资收益

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内无债券买卖差价收入。

#### 6.4.7.13.3 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。

#### 6.4.7.13.4 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。

#### 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

### 6.4.7.14 贵金属投资收益

#### 6.4.7.14.1 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。

#### 6.4.7.14.2 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买卖贵金属差价收入。

#### 6.4.7.14.3 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。

#### 6.4.7.14.4 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。

**6.4.7.15 衍生工具收益****6.4.7.15.1 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。

**6.4.7.15.2 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。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	48,172,717.57
基金投资产生的股利收益	-
合计	48,172,717.57

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
1. 交易性金融资产	366,985,530.39
——股票投资	366,985,530.39
——债券投资	-
——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	366,985,530.39

**6.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	7,472,278.77
基金转换费收入	1,206,641.98
合计	8,678,920.75

### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	11,496,148.55
银行间市场交易费用	-
合计	11,496,148.55

### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	198,354.28
汇划费	11,533.49
其他	200.00
合计	234,882.96

注：“其他”为年度报告审计询证费。

## 6.4.8 关联方关系

### 6.4.8.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.8.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金代销机构
开源证券股份有限公司（“开源证券”）	基金管理人股东、基金代销机构
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

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.9.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 6.4.9.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.9.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.9.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.9.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行交易，无佣金产生。

#### 6.4.9.2 关联方报酬

##### 6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年 6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	30,896,153.67	4,956,796.76
其中：支付销售机构的客户维护费	94,720.11	137,286.92

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

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

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。

##### 6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
当期发生的基金应支付的托管费	5,149,358.98		826,132.74	

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。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

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

#### 6.4.9.2.3 销售服务费

本报告期内及上年度可比期间内关联方未从本基金获得销售服务费。

#### 6.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内与关联方无银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.9.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.9.4.2 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

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 6.4.9.5 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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	148,795,602.38	1,244,521.90	121,487,911.71	396,806.57

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

#### 6.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.9.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间内无其他关联交易事项。

#### 6.4.10 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.10.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发或增发而持有流通受限证券。

##### 6.4.10.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有流通受限的股票。

##### 6.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.10.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 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。

###### 6.4.10.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 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。

#### 6.4.11 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 2017 年 6 月 30 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 3,613,838,686.77 元，属于第二层次的余额为 0 元，属于第三层次的余额为 0 元。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 3,186,397,311.96 元，属于第二层次的余额为 0 元，属于第三层次的余额为 0 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 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2016 年 12 月 31 日：同)。

(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。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 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	3,613,838,686.77	94.40
	其中：股票	3,613,838,686.77	94.40
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	152,710,189.18	3.99
7	其他各项资产	61,603,402.70	1.61

8	合计	3,828,152,278.65	100.00
---	----	------------------	--------

注：权益投资中通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 3,613,838,686.77 元，占资产净值比例 94.70%。

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内投资的股票。

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
原材料	97,863,881.85	2.56
非日常生活消费品	356,715,120.00	9.35
医疗保健	339,330,855.98	8.89
金融	1,775,495,043.46	46.52
信息技术	805,945,894.67	21.12
电信业务	83,140,486.98	2.18
公用事业	155,347,403.83	4.07
合计	3,613,838,686.77	94.70

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	0700	腾讯控股	1,513,900	366,853,189.37	9.61
2	2238	广汽集团	30,000,000	356,715,120.00	9.35
3	1398	工商银行	67,261,000	307,647,670.72	8.06
4	0939	建设银行	57,659,000	302,762,565.64	7.93
5	3888	金山软件	15,868,000	280,263,345.30	7.34
6	0005	汇丰控股	3,857,200	243,213,385.39	6.37
7	2328	中国财险	21,126,000	239,097,240.08	6.27
8	0570	中国中药	58,978,000	230,346,835.92	6.04

9	2018	瑞声科技	1,875,000	158,829,360.00	4.16
10	0371	北控水务集团	29,536,000	155,347,403.83	4.07

注：所用证券代码使用当地市场代码。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例（%）
1	1398	工商银行	272,929,387.31	7.89
2	0939	建设银行	244,492,768.74	7.07
3	2328	中国财险	236,465,614.20	6.83
4	0005	汇丰控股	206,314,417.85	5.96
5	0570	中国中药	150,375,940.57	4.35
6	1288	农业银行	145,941,294.20	4.22
7	0371	北控水务集团	136,616,931.44	3.95
8	0494	利丰	132,715,470.36	3.84
9	1336	新华保险	122,989,397.61	3.55
10	0700	腾讯控股	120,759,249.54	3.49
11	2238	广汽集团	100,300,588.27	2.90
12	2018	瑞声科技	82,344,417.18	2.38
13	0698	通达集团	82,131,235.80	2.37
14	3968	招商银行	80,809,776.31	2.34
15	2357	中航科工	77,959,409.66	2.25
16	3888	金山软件	62,463,895.93	1.81
17	0981	中芯国际	60,622,806.98	1.75
18	2388	中银香港	53,578,088.71	1.55
19	0883	中国海洋石油	51,036,841.51	1.48
20	0874	白云山	46,788,960.07	1.35

注：①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。

②所用证券代码使用当地市场代码。

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例 (%)
1	0700	腾讯控股	222,272,999.85	6.42
2	2357	中航科工	181,688,696.23	5.25
3	0939	建设银行	123,984,539.39	3.58
4	1398	工商银行	121,574,427.20	3.51
5	2382	舜宇光学科技	116,323,915.46	3.36
6	0388	香港交易所	109,922,734.88	3.18
7	0494	利丰	108,486,845.94	3.14
8	2628	中国人寿	96,964,853.06	2.80
9	0005	汇丰控股	96,165,359.75	2.78
10	0728	中国电信	94,674,214.26	2.74
11	6837	海通证券	92,833,028.91	2.68
12	1099	国药控股	89,589,650.68	2.59
13	0392	北京控股	83,997,843.12	2.43
14	3968	招商银行	83,747,655.40	2.42
15	0698	通达集团	83,181,796.63	2.40
16	2238	广汽集团	80,720,952.24	2.33
17	0857	中国石油股份	73,831,067.15	2.13
18	0941	中国移动	72,416,764.86	2.09
19	6886	HTSC	66,385,281.55	1.92
20	2018	瑞声科技	62,936,128.64	1.82

注：①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。

②所用证券代码使用当地市场代码。

### 7.4.3 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	2,850,155,012.39
卖出股票收入（成交）总额	2,961,782,281.07

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。

## 7.5 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。

## 7.6 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。

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 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。

## 7.9 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。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 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。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 7.11.2 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。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 7.12.2

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。

### 7.12.3 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	-
2	应收证券清算款	32,408,075.22
3	应收股利	26,636,795.05
4	应收利息	57,375.74
5	应收申购款	2,501,156.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	61,603,402.70

### 7.12.4 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可转换债券。

### 7.12.5 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。

### 7.12.6 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。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 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
21,473	137,685.47	2,725,939,511.33	92.20%	230,580,539.13	7.80%

### 8.3 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	223,074.23	0.01%

### 8.4 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、基金投资和研究部负责人、本基金基金经理未持有本开放式基金份额。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年12月8日）基金份额总额	287,846,858.20
本报告期期初基金份额总额	3,102,060,879.09
本报告期基金总申购份额	2,662,974,878.86
减：本报告期基金总赎回份额	2,808,515,707.49
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	2,956,520,050.46

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。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 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。

### 10.3 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。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 10.5 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。

### 10.6 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。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 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	
申万宏源	2	4,783,480,726.14	82.30%	3,826,797.46	82.30%	-
平安证券	1	1,028,456,567.32	17.70%	822,758.70	17.70%	-
山西证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-

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。

### 10.7.2 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
申万宏源	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-

本基金本报告期内租用证券公司交易单元未进行其他证券投资。

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170101-20170222	753,688,497.40	80,063,250.60	464,751,748.00	369,000,000.00	12.48%
个人	-	-	-	-	-	-	-

-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险						
<p>1. 巨额赎回风险</p> <p>(1) 本基金单一投资者所持有的基金份额占比较大，单一投资者的巨额赎回，可能导致基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，对本基金的投资运作及净值表现产生较大影响；</p> <p>(2) 单一投资者大额赎回时容易造成本基金发生巨额赎回。在发生巨额赎回情形时，在符合基金合同约定情况下，如基金管理人认为有必要，可延期办理本基金的赎回申请，投资者可能面临赎回申请被延期办理的风险；如果连续 2 个开放日以上（含）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；</p> <p>2. 转换运作方式或终止基金合同的风险</p> <p>单一投资者巨额赎回后，若本基金连续 60 个工作日基金份额持有人低于 200 人或基金资产净值低于 5000 万情形的，基金管理人应当向中国证监会提出解决方案，或按基金合同约定，转换运作方式或终止基金合同，其他投资者可能面临基金转换运作方式或终止基金合同的风险；</p> <p>3. 流动性风险</p> <p>单一投资者巨额赎回可能导致本基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；</p> <p>4. 巨额赎回可能导致基金资产规模过小，导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略。</p>						

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

前海开源基金管理有限公司  
2017 年 8 月 28 日