

前海开源中国成长灵活配置混合型证券投资基金 2017 年半年度报告

2017-06-30

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

报告送出日期：2017-08-28

[目录全部展开](#) [目录全部收拢](#)

[重要提示](#)

[基金简介](#)

[基金基本情况](#)

[基金产品说明](#)

[基金管理人和基金托管人](#)

[信息披露方式](#)

[其他相关资料](#)

[主要财务指标和基金净值表现](#)

[主要会计数据和财务指标](#)

[基金净值表现](#)

[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](#)

[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](#)

[管理人报告](#)

[基金管理人及基金经理情况](#)

[基金管理人及其管理基金的经验](#)

[基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介](#)

[管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明](#)

[管理人对报告期内公平交易情况的专项说明](#)

[公平交易制度的执行情况](#)

[异常交易行为的专项说明](#)

[管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明](#)

[报告期内基金投资策略和运作分析](#)

[报告期内基金的业绩表现](#)

[管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望](#)

[管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明](#)

[管理人对报告期内基金利润分配情况的说明](#)

[管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明](#)

[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](#)

[托管人报告](#)

[报告期内本基金托管人遵规守信情况声明](#)

[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](#)

[托管人对半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见](#)

[半年度财务会计报告（未经审计）](#)

[资产负债表](#)

利润表
所有者权益（基金净值）变动表
报表附注
基金基本情况
会计报表的编制基础
遵循企业会计准则及其他有关规定的声明
重要会计政策和会计估计
会计年度
记账本位币
金融资产和金融负债的分类
金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认
金融资产和金融负债的估值原则
金融资产和金融负债的抵销
实收基金
损益平准金
收入/(损失)的确认和计量
费用的确认和计量
基金的收益分配政策
其他重要的会计政策和会计估计
会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明
会计政策变更的说明
会计估计变更的说明
差错更正的说明
税项
重要财务报表项目的说明
银行存款
衍生金融资产/负债
买入返售金融资产
各项买入返售金融资产期末余额
期末买断式逆回购交易中取得的债券
应收利息
其他资产
应付交易费用
其他负债
实收基金
未分配利润
存款利息收入
股票投资收益
股票投资收益——买卖股票差价收入
债券投资收益
债券投资收益项目构成
债券投资收益——买卖债券差价收入
债券投资收益——赎回差价收入
债券投资收益——申购差价收入

资产支持证券投资收益
衍生工具收益
衍生工具收益——买卖权证差价收入
衍生工具收益——其他投资收益
股利收益
公允价值变动收益
其他收入
交易费用
其他费用
或有事项、资产负债表日后事项的说明
或有事项
资产负债表日后事项
关联方关系
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
本报告期与基金发生关联交易的各关联方
本报告期及上年度可比期间的关联方交易
通过关联方交易单元进行的交易
股票交易
权证交易
应支付关联方的佣金
关联方报酬
基金管理费
基金托管费
销售服务费
与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易
各关联方投资本基金的情况
报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
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
由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入
本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况
其他关联交易事项的说明
利润分配情况
利润分配情况——非货币市场基金
期末本基金持有的流通受限证券
因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券
期末持有的暂时停牌等流通受限股票
期末债券正回购交易中作为抵押的债券
银行间市场债券正回购
交易所市场债券正回购
金融工具风险及管理
风险管理政策和组织架构
信用风险
按短期信用评级列示的债券投资
按长期信用评级列示的债券投资

流动性风险
金融资产和金融负债的到期期限分析
市场风险
利率风险
利率风险敞口
利率风险的敏感性分析
外汇风险
外汇风险敞口
外汇风险的敏感性分析
其他价格风险
其他价格风险敞口
其他价格风险的敏感性分析
采用风险价值法管理风险
有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项
投资组合报告
期末基金资产组合情况
报告期末按行业分类的股票投资组合
报告期末按行业分类的股票投资组合
报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细
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
报告期内股票投资组合的重大变动
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
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
买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额
期末按债券品种分类的债券投资组合
期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细
期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细
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
期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细
报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金投资股指期货的投资政策
报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
本期国债期货投资政策
报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本期国债期货投资评价
投资组合报告附注
本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚情况的说明
基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明
期末其他各项资产构成
期末持有的处于转股期的可转换债券明细
期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
投资组合报告附注的其他文字描述部分

基金份额持有人信息

期末基金份额持有人户数及持有人结构

期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

发起式基金发起资金持有份额情况

开放式基金份额变动

重大事件揭示

基金份额持有人大会决议

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

涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

基金投资策略的改变

为基金进行审计的会计师事务所情况

管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金租用证券公司交易单元的有关情况

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

其他重大事件

重大事件揭示

基金份额持有人大会决议

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

涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

基金投资策略的改变

为基金进行审计的会计师事务所情况

管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金租用证券公司交易单元的有关情况

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

其他重大事件

影响投资者决策的其他重要信息

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

影响投资者决策的其他重要信息

备查文件目录

备查文件目录

存放地点

查阅方式

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。

基金托管人交通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。

基金基本情况

项目

数值

基金名称

前海开源中国成长灵活配置混合型证券投资基金

基金简称

前海开源中国成长混合

场内简称

基金主代码

000788

基金运作方式

契约型开放式

基金合同生效日

2014-09-29

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

37,599,721.72

基金合同存续期

不定期

基金产品说明

投资目标

本基金力图把握中国经济可持续发展过程中的投资机会，通过行业配置和精选个股，分享中国经济在科学发展、和谐发展和可持续发展过程中的成果。在严格控制投资风险的前提下，力争获取超越业绩比较基准的稳健收益。

投资策略

本基金的投资策略主要有以下五方面内容：

1、大类资产配置

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。本基金将依据经济周期理论，结合对各大类资产风险和预期收益率的评估，制定各大类资产之间的配置比例。本基金通过对权益类、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、市场利率变化等因素以及基金的风险评估进行灵活调整。

2、股票投资策略

本基金采取自上而下的宏观分析和自下而上精选个股的投资策略，在遵循本基金资产配置比例限制前提下，确定基金在各类资产具体投资比例。

根据国家产业发展趋势，重点投资代表中国经济未来的信息、科技、医药和消费等投资方向，自下而上精选代表产业发展的龙头公司，在标的遴选过程中充分考虑上市公司的现有业务的壁垒、未来的成长性等因素构建核心股票池，再通过本基金已有的个股筛选打分体

系，构建投资组合，其后根据资产额度的变化，相应进行调整，以期追求超额收益，分享中国经济未来发展的成果。

3、债券投资策略

在债券投资策略方面，本基金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结合进行投资。在宏观环境分析方面，结合对宏观经济、市场利率等因素，定期对投资组合类属资产进行调整，确定不同类属资产的最优权重。

在微观市场定价分析方面，本基金以中长期利率趋势分析为基础，结合经济趋势、货币政策及不同债券品种特征等因素，重点选择流动性较好、风险水平合理债券品种。

4、权证投资策略

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，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。

5、股指期货投资策略

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，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。

基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲风险，利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

基金管理人在进行股指期货投资前将建立股指期货投资决策部门或小组，同时制定投资决策流程和风险控制等制度，经基金管理人董事会批准后执行。

相关法律法规变化时，基金管理人从其最新规定。

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，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。

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

陆志俊

联系电话

0755-88601888

95559

电子邮箱

qhky@qhkyfund.com

luzj@bankcomm.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

信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称

证券日报

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

其他相关资料

项目

名称

办公地址

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

主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

报告期

报告期(2017-01-01 至 2017-06-30)

本期已实现收益

-296,347.20

本期利润

-648,008.20

加权平均基金份额本期利润

-0.0153

本期加权平均净值利润率

-1.38 %

本期基金份额净值增长率

-3.18 %

报告期末

报告期末(2017-06-30)

期末可供分配利润

2,494,396.34

期末可供分配基金份额利润

0.0663

期末基金资产净值

40,094,118.06

期末基金份额净值

1.066

报告期末

报告期末(2017-06-30)

基金份额累计净值增长率

14.62 %

注：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。

基金净值表现

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

净值增长率①

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

过去一个月

3.90 %

0.74 %

3.84 %

0.47 %

0.06 %

0.27 %

过去三个月

-5.58 %

0.97 %

4.30 %

0.44 %

-9.88 %

0.53 %
过去六个月

-3.18 %

0.91 %

7.41 %

0.40 %

-10.59 %

0.51 %

过去一年

-4.74 %

0.75 %

11.30 %

0.48 %

-16.04 %

0.27 %

自基金合同生效起至今

14.62 %

1.73 %

41.43 %

1.27 %

-26.81 %

0.46 %

注：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%。

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

基金管理人及基金经理情况

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。

基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名

职务

任本基金的基金经理期限

证券从业年限

说明

任职日期

离任日期

徐立平

本基金的基金经理、公司执行投资总监

2014-09-29

-

15 年

徐立平先生，清华大学工商管理硕士。历任泰信基金管理有限公司行业研究员，中邮创业基金管理有限公司研究员、基金经理助理。现任前海开源基金管理有限公司执行投资总监。

注：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。

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、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。

管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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。

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。

管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年上半年宏观经济整体运行平稳，预计上半年 GDP 增速维持在 6.9%附近。PMI 连续 10 个月维持在荣枯线 50 以上，显示经济活动仍在扩张区间；但随着 PPI 和工业企业库存高位回落，规模以上企业工业增加值和工业企业利润总额累计同比增速亦从高位开始回落，下半年经济增长的隐忧开始显现。

2017 年 1-5 月份社会消费品零售总额累计增速 10.3%，继续平稳增长；2016 年消费支出占 GDP 的比重达到了 53.6%，消费对 GDP 的贡献超过投资，经济的韧性进一步增强；2017 年 1-5 月份固定资产投资完成额累计同比增速 8.6%，稳中有降；从分项数据看，基建投资前高后低，制造业投资回暖对冲了房地产投资的下滑；受益于国内、欧洲和美国经济复苏及去年同期低基数的影响，进出口两旺，以美元计价的进出口金额上半年累计同比增速达到 13%，其中出口累计同比增速 8.5%，进口累计同比增速则高达 18.9%，净出口对 GDP 的贡献由负转正。

受金融业去杠杆和货币政策由积极变为稳健中性影响，五六月份 M2 同比增速连续两个月分别掉至 9.6%、9.4%；但前六个月的社会融资规模累计值达到 11.17 万亿，大幅高于去年同期值，显示出金融业开始脱虚向实、服务实体经济的导向初见成效；CPI 一直在低位徘徊，央行当前的加息压力不大，但贷款加权平均利率有所上升，显示出在金融业去杠杆的背景下，实际资金成本有所上升。

在全国各地严厉的房地产调控政策影响下，房地产交易量迅速回落，价格趋于稳定，资产泡沫扩大的势头得到遏制，贸易经常账户差额重新回到顺差；同时由于美元的疲软，中美利差继续扩大，人民币币值稳中有升，资产外逃的势头得到有效遏制，为进出口贸易创造了良好的环境。

A 股上半年结构分化严重，业绩稳定、估值低、分红率高的白马蓝筹股受到了市场的追捧，家电、食品饮料及银行涨幅居前，对流动性敏感的国防军工、传媒及计算机等估值较高的行业跌幅居前。

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-3.18%，同期业绩比较基准增长率为 7.41%。

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 年下半年，我们认为宏观经济将继续维持 L 型走势，随着上游原材料及中游制造业景气度往下游的传导，中下游企业的盈利有望进一步回升，A 股亦将维持震荡上行的格局。

我们认为 TMT 行业经历了长达两年的“杀估值”的过程，当前估值已经处于相对合理的位置，部分业绩增速稳健的个股 PEG 已经明显小于 1，已经具有了良好的中长期投资价值；对于国企改革预期明确的军工股，我们亦将坚持中长期持有；而受益于美元弱势，伦敦金的价格底部在不断抬高，可以预期上半年贵金属类公司业绩将持续改善，我们亦中长期看好。

我们认为 2017 年下半年 A 股仍然具有较好的结构性投资机会，我们仍将维持合理的仓位，精选业绩增速与估值合理匹配的个股，努力为基金持有人带来良好的投资回报。

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。

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。

管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

-

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的情形。

本基金本报告期内，2017年3月8日至2017年5月31日，连续56个工作日基金资产低于五千万元。

报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，基金托管人在前海开源中国成长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。

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，前海开源基金管理有限公司在前海开源中国成长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。

托管人对半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告期内，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中国成长灵活配置混合型证券投资基金的半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。

资产负债表

会计主体：前海开源中国成长灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017-06-30

单位：人民币元

资产

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

资产：

银行存款

7,868,647.88

2,915,469.55

结算备付金

27,898.38

158,709.74

存出保证金

22,373.79

46,870.44

交易性金融资产

32,456,076.53

51,070,024.03

其中：股票投资

32,456,076.53

51,070,024.03

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
579.47	
677.33	
-	应收股利
-	
-	
-	应收申购款
3,886.91	
52,100.05	
-	递延所得税资产
-	
-	
-	其他资产
-	
-	
-	资产总计
40,379,462.96	
54,243,851.14	
-	负债和所有者权益
-	本期末
2017-06-30	
-	上年度末
2016-12-31	
-	负债：
-	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

13,287.04

35,776.42

应付管理人报酬

52,297.25

70,110.16

应付托管费

8,716.19

11,685.03

应付销售服务费

-

-

应付交易费用

32,155.24

73,866.21

应交税费

-

-

应付利息

-

-

应付利润

-

-

递延所得税负债

-

-

其他负债

178,889.18

250,061.12

负债合计

285,344.90

441,498.94

所有者权益：

-

-

实收基金

37,599,721.72

48,855,999.29

未分配利润

2,494,396.34

4,946,352.91

所有者权益合计

40,094,118.06

53,802,352.20

负债和所有者权益总计

40,379,462.96

54,243,851.14

注：注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日,基金份额净值 1.066 元,基金份额总额 37,599,721.72 份。

利润表

会计主体：前海开源中国成长灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017-01-01 至 2017-06-30

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

一、收入

-49,610.91

-4,331,827.72

1.利息收入

16,158.11

42,132.94

其中：存款利息收入

16,158.11

42,132.94

 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）
182,148.37
-8,575,510.18
其中：股票投资收益
81,117.59
-8,960,391.64
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
101,030.78
384,881.46
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）
-351,661.00
4,166,867.38
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）
-
-
5.其他收入（损失以“-”号填列）
103,743.61
34,682.14
减：二、费用
598,397.29
1,246,827.28
1. 管理人报酬
349,476.56
461,631.80
2. 托管费

58,246.13

76,938.68

3. 销售服务费

-

-

4. 交易费用

160,290.42

632,733.23

5. 利息支出

-

-

其中：卖出回购金融资产支出

-

-

6. 其他费用

30,384.18

75,523.57

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）

-648,008.20

-5,578,655.00

减：所得税费用

-

-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）

-648,008.20

-5,578,655.00

所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：前海开源中国成长灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017-01-01 至 2017-06-30

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

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）

54,934,178.40

6,514,555.19

53,802,352.20

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）

-

-648,008.20

-648,008.20

三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）

-11,256,277.57

-1,803,948.37

-13,060,225.94

其中：1.基金申购款

13,851,191.97

609,353.43

14,460,545.40

2.基金赎回款

-25,107,469.54

-2,413,301.80

-27,520,771.34

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）

37,599,721.72

2,494,396.34

40,094,118.06

项目

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

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）

48,926,425.18

11,247,256.14

60,173,681.32

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）

-

-5,578,655.00

-5,578,655.00

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）

6,007,753.22

845,954.05

6,853,707.27

其中：1.基金申购款

17,572,345.68

1,746,688.77

19,319,034.45

2.基金赎回款

-11,564,592.46

-900,734.72

-12,465,327.18

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）

54,934,178.40

6,514,555.19

53,802,352.20

本报告第 6.1 页至第 6.4 页财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：蔡颖 主管会计工作负责人：何璁 会计机构负责人：任福利

注：此处为 PDF 文件中的章节数或者页数。

报表附注

基金基本情况

前海开源中国成长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【2014】872号文《关于准予前海开源中国成长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》、《前海开源中国成长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 2014 年 9 月 1 日至 2014 年 9 月 25 日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 824,771,514.27 元，经瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）瑞华验字[2014]第 02030033 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《前海开源中国成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2014 年 9 月 29 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 825,163,736.89 份基金份额，其中认购资金利息折合 392,222.62 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。

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》、《前海开源中国成长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。

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。

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。

会计年度

-

记账本位币

-

金融资产和金融负债的分类

-
金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

-
金融资产和金融负债的估值原则

-
金融资产和金融负债的抵销

-
实收基金

-
损益平准金

-
收入/(损失)的确认和计量

-
费用的确认和计量

-
基金的收益分配政策

-
其他重要的会计政策和会计估计

-
会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

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。

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。

差错更正的说明
本基金本报告期未发生会计差错更正。

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》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)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。

重要财务报表项目的说明

银行存款

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

活期存款

7,868,647.88

-

定期存款

-

-

其中：存款期限 1-3 个月

-

-

其他存款

-

-

合计

7,868,647.88

2,915,469.55

交易性金融资产

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

成本

公允价值

公允价值变动

股票

34,391,514.87

32,456,076.53

-1,935,438.34

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

34,391,514.87

32,456,076.53

-1,935,438.34

项目

上年度末

2016-12-31

成本

公允价值

公允价值变动

股票

-

-

-

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

-

-

-

衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

合同/名义金额

公允价值

备注

资产

负债

利率衍生工具

-

-

-

-

货币衍生工具

-

-

-

-

权益衍生工具

-

-

-

-

其他衍生工具

-

-

-

-

合计

-

-

-

-

项目

上年度末

2016-12-31

合同/名义金额

公允价值

备注

资产

负债

利率衍生工具

-

-

-

-

货币衍生工具

-

-

-

-

权益衍生工具

-

-

-

-

其他衍生工具

-

-

-

-

合计

-

-

-

-

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

买入返售金融资产

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

2017-06-30

账面余额

其中：买断式逆回购

项目

上年度末

2016-12-31

账面余额

其中：买断式逆回购

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

期末买断式逆回购交易中取得的债券

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

债券代码

债券名称

约定返售日

估值单价

数量（张）

估值总额

其中：已出售或再质押总额

项目

上年度末

2016-12-31

债券代码

债券名称

约定返售日

估值单价

数量（张）

估值总额

其中：已出售或再质押总额

注：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。

应收利息

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

应收活期存款利息

559.04

-

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

11.34

-

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

9.09

-

合计

579.47

677.33

注：注：“其他”为应收结算保证金利息。

其他资产

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

上年度末
2016-12-31
其他应收款

-

-

待摊费用

-

-

合计

-

-

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

应付交易费用

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

交易所市场应付交易费用

32,155.24

-

银行间市场应付交易费用

-

-

合计

32,155.24

73,866.21

其他负债

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

应付券商交易单元保证金

-

-

应付赎回费

-

-

预提费用

178,889.18

-

合计
178,889.18
250,061.12
实收基金
单位：人民币元
项目
本期
2017-01-01 至 2017-06-30

基金份额（份）
账面金额
上年度末
48,855,999.29
48,855,999.29
本期申购
13,851,191.97
13,851,191.97
本期赎回（以“-”号填列）
-25,107,469.54
-25,107,469.54
本期末
37,599,721.72
37,599,721.72

注：注：申购含红利再投、转换入份（金）额；赎回含转换出份（金）额。

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
16,522,761.12
-11,576,408.21
4,946,352.91
本期利润
-296,347.20
-351,661.00
-648,008.20
本期基金份额交易产生的变动数
-3,883,581.75
2,079,633.38
-1,803,948.37
其中：基金申购款
3,925,086.42
-3,315,732.99

609,353.43

基金赎回款

-7,808,668.17

5,395,366.37

-2,413,301.80

本期已分配利润

-

-

-

本期末

12,342,832.17

-9,848,435.83

2,494,396.34

存款利息收入

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

活期存款利息收入

15,077.67

-

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

572.51

-

其他

507.93

-

合计

16,158.11

42,132.94

注：注：“其他”为申购款利息收入及结算保证金利息收入。

股票投资收益

股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

卖出股票成交总额

66,412,739.49

-

减：卖出股票成本总额

66,331,621.90

-

买卖股票差价收入

81,117.59

-

债券投资收益

债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入

-

-

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

-

-

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额

-

-

减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额

-

-

减：应收利息总额

-

-

买卖债券差价收入

-

-

注：本基金本报告期内无债券买卖差价收入。

债券投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

赎回基金份额对价总额

-

-

减：现金支付赎回款总额

-

-

减：赎回债券成本总额

-

-

减：赎回债券应收利息总额

-

-

赎回差价收入

-

-

注：本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

债券投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

申购基金份额对价总额

-

-

减：现金支付申购款总额

-

-

减：申购债券成本总额

-

-

减：申购债券应收利息总额

-

-

申购差价收入

-

-

注：本基金本报告期内无债券申购差价收入。

资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

卖出资产支持证券成交总额

-

-

减：卖出资产支持证券成本总额

-

-

减：应收利息总额

-

-

资产支持证券投资收益

-

-

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

衍生工具收益

衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

卖出权证成交总额

-

-

减：卖出权证成本总额

-

-
买卖权证差价收入

-
-

注：本基金本报告期内无买卖权证差价收入。

衍生工具收益——其他投资收益

项目

本期收益金额

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间收益金额

2016-01-01 至 2016-06-30

注：本基金本报告期内无其他衍生工具投资收益。

股利收益

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

股票投资产生的股利收益

101,030.78

-

基金投资产生的股利收益

-
-

合计

101,030.78

384,881.46

公允价值变动收益

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

1.交易性金融资产

-351,661.00

-

——股票投资

-351,661.00

-

——债券投资

-

-

——资产支持证券投资

-

-

——基金投资

-

-

——贵金属投资

-

-

——其他

-

-

2.衍生工具

-

-

——权证投资

-

-

3.其他

-

-

合计

-351,661.00

4,166,867.38

其他收入

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

基金赎回费收入

103,479.53

-

基金转换费收入

264.08

-

合计

103,743.61

34,682.14

交易费用

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

交易所市场交易费用

160,290.42

-

银行间市场交易费用

-

-

合计

160,290.42

632,733.23

其他费用

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

审计费用

24,795.19

-

信息披露费

4,093.99

-

汇划费

1,195.00

-

其他

300.00

-

合计

30,384.18

75,523.57

注：注：“其他”为年度报告审计询证费。

或有事项、资产负债表日后事项的说明

或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无资产负债表日后事项。

关联方关系

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

交通银行股份有限公司（“交通银行”）

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

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。

本报告期及上年度可比期间的关联方交易

-

通过关联方交易单元进行的交易

股票交易

单位：人民币元

关联方名称

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

成交金额

占当期股票成交总额的比例

成交金额

占当期股票成交总额的比例

注：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。

权证交易

单位：人民币元

关联方名称

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

成交金额

占当期股票成交总额的比例

成交金额

占当期股票成交总额的比例

注：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。

应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

当期佣金

占当期佣金总量的比例

期末应付佣金余额

占期末应付佣金总额的比例

关联方名称

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

当期佣金

占当期佣金总量的比例

期末应付佣金余额

占期末应付佣金总额的比例

注：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。

关联方报酬

基金管理费

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

当期发生的基金应支付的管理费

349,476.56

461,631.80

其中：支付销售机构的客户维护费

106,407.29

204,856.94

注：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：

$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$

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起 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。

基金托管费

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

当期发生的基金应支付的托管费

58,246.13

76,938.68

注：注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 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首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

当期发生的基金应支付的销售服务费

获得销售服务费的各关联方名称

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

当期应支付的销售服务费

注：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。

与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

银行间市场交易的各关联方名称

债券交易金额

基金逆回购

基金正回购

基金买入

基金卖出

交易金额

利息收入

交易金额

利息支出

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

银行间市场交易的各关联方名称

债券交易金额

基金逆回购

基金正回购

基金买入

基金卖出

交易金额

利息收入

交易金额

利息支出

注：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。

各关联方投资本基金的情况

报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

基金合同生效日（2014-09-29）持有的基金份额

-

-

报告期初持有的基金份额

-

-

报告期间申购/买入总份额

-

-

报告期间因拆分变动份额

-

-

减：期间赎回/卖出总份额

-

-

报告期末持有的基金份额

-

-

报告期末持有的基金份额占基金总份额比例

-%

-%

注：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。

报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

项目

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

持有的基金份额

持有的基金份额占基金总份额的比例

持有的基金份额

持有的基金份额占基金总份额的比例

注：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。

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

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

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

7,868,647.88

15,077.67

3,143,581.42

36,328.44

注：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。

本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

关联方名称

证券代码

证券名称

发行方式

基金在承销期内买入

数量（单位：股/张）

总金额

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

关联方名称

证券代码

证券名称

发行方式

基金在承销期内买入

数量（单位：股/张）

总金额

注：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。

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。

利润分配情况

利润分配情况——非货币市场基金

单位：人民币元

序号

权益登记日

除息日

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

本期利润分配合计

备注

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

期末（2017-06-30）本基金持有的流通受限证券

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

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

受限证券类别：债券

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

注：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。

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

601989

中国重工

2017-05-31

资产重组

6.46

-

-

449,102

3,297,000.49

2,901,198.92

-

注：注：本基金本报告期末持有的暂时停牌等流通受限股票的复牌情况，统计截止日期为2017年8月18日。

期末债券正回购交易中作为抵押的债券

银行间市场债券正回购

-

金额单位：人民币元

债券代码

债券名称

回购到期日

期末估值单价

数量（张）

期末估值总额

注：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。

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。

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。

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次风险管理架构体系。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。

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同责任，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。

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

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

A-1

0.00

0.00

A-1 以下
0.00
0.00
未评级
0.00
0.00
合计

-
-

注：本基金本报告期末未持有短期信用评级的债券。

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

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

AAA

0.00

0.00

AAA 以下

0.00

0.00

未评级

0.00

0.00

合计

0.00

0.00

注：本基金本报告期末未持有长期信用评级的债券。

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、组合在短期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。

金融资产和金融负债的到期期限分析

单位：人民币元

本期末

2017-06-30

合计

资产

资产总计

-

负债

负债总计

-

流动性净额

-

上年度末

2016-12-31

合计

资产

资产总计

-

负债

负债总计

-

流动性净额

-

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。

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。

利率风险敞口

单位：人民币元

本期末

2017-06-30

1年以内

不计息

合计

资产	
银行存款	
7,868,647.88	
-	
7,868,647.88	
结算备付金	
27,898.38	
-	
27,898.38	
存出保证金	
22,373.79	
-	
22,373.79	
交易性金融资产	
-	
32,456,076.53	
32,456,076.53	
应收利息	
-	
579.47	
579.47	
应收申购款	
-	
3,886.91	
3,886.91	
其他资产	
-	
-	
-	
资产总计	
7,918,920.05	
32,460,542.91	
40,379,462.96	
负债	
应付赎回款	
-	
13,287.04	
13,287.04	
应付管理人报酬	
-	
52,297.25	
52,297.25	
应付托管费	
-	

8,716.19
8,716.19
应付交易费用
-
32,155.24
32,155.24
其他负债
-
178,889.18
178,889.18
负债总计
-
285,344.90
285,344.90
利率敏感度缺口
7,918,920.05
32,175,198.01
40,094,118.06
上年度末
2016-12-31
1年以内
不计息
合计
资产
银行存款
2,915,469.55
-
2,915,469.55
结算备付金
158,709.74
-
158,709.74
存出保证金
46,870.44
-
46,870.44
交易性金融资产
-
51,070,024.03
51,070,024.03
应收利息
-
677.33
677.33

应收申购款	
-	
52,100.05	
52,100.05	
其他资产	
-	
-	
-	
资产总计	
3,121,049.73	
51,122,801.41	
54,243,851.14	
负债	
应付赎回款	
-	
35,776.42	
35,776.42	
应付管理人报酬	
-	
70,110.16	
70,110.16	
应付托管费	
-	
11,685.03	
11,685.03	
应付交易费用	
-	
73,866.21	
73,866.21	
其他负债	
-	
250,061.12	
250,061.12	
负债总计	
-	
441,498.94	
441,498.94	
利率敏感度缺口	
3,121,049.73	
50,681,302.47	
53,802,352.20	

注：注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值,并按照合约规定的重新定价日期或到期日孰早者进行分类。

利率风险的敏感性分析

假设

-

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

2017-06-30

上年度末

2016-06-30

注：本基金本报告期末未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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，因此无重大外汇风险。

外汇风险敞口

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

美元折合人民币

港币折合人民币

其他币种折合人民币

合计

以外币计价的资产

资产合计

-

-

-

-

以外币计价的负债

负债合计

-

-

-

-

资产负债表外汇风险敞口净额

-

-

-

-

项目

上期末

2016-06-30

美元折合人民币

港币折合人民币
其他币种折合人民币
合计
以外币计价的资产
资产合计

-
-
-
-

以外币计价的负债
负债合计

-
-
-
-

资产负债表外汇风险敞口净额

-
-
-
-

外汇风险的敏感性分析
假设

-

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

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

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。

其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-06-30

公允价值

占基金资产净值比例 (%)

公允价值

占基金资产净值比例 (%)

交易性金融资产—股票投资

32,456,076.53

80.95

51,070,024.03

94.92

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

32,456,076.53

80.95

51,070,024.03

94.92

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

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

权益性投资的市场价格上升 5%

1,756,729.03

2,851,125.42

权益性投资的市场价格下降 5%

-1,756,729.03

-2,851,125.42

采用风险价值法管理风险

-

假设

-

-

分析

风险价值（金额单位：人民币元）

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

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 29,554,877.61 元，属于第二层次的余额为 2,901,198.92 元，无属于第三层次的余额；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 49,908,815.03 元，属于第二层次的余额为 1,161,209.00 元，无属于第三层次的余额。

(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。

期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号

项目

金额（元）

占基金总资产的比例（%）

1

权益类投资

32,456,076.53

80.38

其中：股票

32,456,076.53

80.38

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

7,896,546.26

19.56

7

其他各项资产

26,840.17

0.07

8

合计

40,379,462.96

100.00

报告期末按行业分类的股票投资组合

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

7,498,880.55

18.70

C

制造业

14,256,874.46

35.56

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

377,883.90

0.94

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

6,813,926.21

16.99

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

478,192.00

1.19

R

文化、体育和娱乐业

3,030,319.41

7.56

S

综合

-

-

合计

32,456,076.53

80.95

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（人民币）

占基金资产净值比例（%）

A 基础材料

-

-

B 消费者非必需品

-

-

C 消费者常用品

-

-

D 能源

-

-

E 金融

-

-

F 医疗保健

-

-

G 工业

-

-

H 信息技术

-

-

I 电信服务

-

-

J 公用事业

-
-
注：本基金本报告期末未通过港股通机制投资港股。

期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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（元）

占基金资产净值比例（%）

1

002241

歌尔股份

150,800

2,907,424.00

7.25

2

601989

中国重工

449,102

2,901,198.92

7.24

3

000768

中航飞机

144,800

2,670,112.00

6.66

4

002155

湖南黄金

277,893

2,659,436.01

6.63

5

002555

三七互娱

102,429

2,619,109.53

6.53

6

600489

中金黄金
252,727
2,534,851.81
6.32
7
600685
中船防务
91,045
2,492,812.10
6.22
8
600547
山东黄金
79,661
2,304,592.73
5.75
9
002343
慈文传媒
59,400
2,248,884.00
5.61
10
002174
游族网络
50,843
1,614,773.68
4.03
11
002439
启明星辰
75,100
1,396,860.00
3.48
12
300166
东方国信
88,100
1,183,183.00
2.95
13
002456
欧菲光
44,908

815,978.36

2.04

14

300144

宋城演艺

37,443

781,435.41

1.95

15

300244

迪安诊断

15,200

478,192.00

1.19

16

002572

索菲亚

10,630

435,830.00

1.09

17

002475

立讯精密

14,751

431,319.24

1.08

18

300072

三聚环保

11,488

425,630.40

1.06

19

002635

安洁科技

10,900

394,798.00

0.98

20

300115

长盈精密

13,407

391,216.26

0.98

21
300136
信维通信
9,759
390,555.18

0.97
22
000028
国药一致
4,671
377,883.90

0.94
报告期内股票投资组合的重大变动
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
002268
卫 士 通
3,481,334.33
6.47

2
300113
顺网科技
3,138,114.53
5.83

3
000768
中航飞机
3,088,491.48
5.74

4
002241
歌尔股份
2,719,718.00
5.06

5
002555
三七互娱
2,657,894.72

4.94
6
002343
慈文传媒
2,370,184.20
4.41
7
600489
中金黄金
2,294,435.00
4.26
8
002739
万达院线
2,240,662.00
4.16
9
000728
国元证券
2,053,656.00
3.82
10
002456
欧菲光
1,902,474.00
3.54
11
300207
欣旺达
1,795,866.02
3.34
12
300406
九强生物
1,765,147.00
3.28
13
300115
长盈精密
1,755,026.44
3.26
14
002174
游族网络

1,594,668.16

2.96

15

002475

立讯精密

1,530,719.43

2.85

16

300144

宋城演艺

1,516,952.41

2.82

17

002439

启明星辰

1,443,098.00

2.68

18

300136

信维通信

1,322,801.26

2.46

19

600071

凤凰光学

1,299,543.00

2.42

20

300166

东方国信

1,191,621.42

2.21

21

002155

湖南黄金

1,093,003.00

2.03

注：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。

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

000728

国元证券

5,446,998.60

10.12

2

300072

三聚环保

4,434,429.66

8.24

3

002572

索菲亚

3,534,833.83

6.57

4

601555

东吴证券

3,514,076.36

6.53

5

600779

水井坊

3,275,017.47

6.09

6

002268

卫士通

3,223,493.28

5.99

7

601688

华泰证券

3,154,060.00

5.86

8

300113

顺网科技

3,057,872.41

5.68

9

600547

山东黄金
2,437,344.52
4.53
10
002739
万达院线
2,424,160.32
4.51
11
600702
沱牌舍得
2,324,475.56
4.32
12
600685
中船防务
2,270,796.84
4.22
13
601069
西部黄金
2,255,638.75
4.19
14
600519
贵州茅台
2,252,754.55
4.19
15
600071
凤凰光学
1,898,902.73
3.53
16
600489
中金黄金
1,701,479.46
3.16
17
000568
泸州老窖
1,640,694.34
3.05
18

600998
九州通
1,630,699.65
3.03
19
300406
九强生物
1,574,265.00
2.93
20
300207
欣旺达
1,524,384.00
2.83
21
002456
欧菲光
1,402,937.34
2.61
22
300115
长盈精密
1,330,248.00
2.47
23
002475
立讯精密
1,214,562.00
2.26
24
300136
信维通信
1,148,467.00
2.13
25
000799
酒鬼酒
1,142,232.00
2.12
26
000776
广发证券
1,092,837.78
2.03

27

300347

泰格医药

1,077,122.00

2.00

注：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。

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

48,069,335.40

卖出股票收入（成交）总额

66,412,739.49

注：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。

期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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
序号

贵金属代码

贵金属名称

数量（份）

公允价值（元）

占基金资产净值比例（%）

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码

名称

持仓量（买/卖）

合约市值

公允价值变动

风险说明

公允价值变动总额合计

-

股指期货投资本期收益

-

股指期货投资本期公允价值变动

-

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

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。

报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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。

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码

名称

持仓量（买/卖）

合约市值(元)

公允价值变动(元)

风险指标说明

公允价值变动总额合计(元)

-

国债期货投资本期收益（元）

-

国债期货投资本期公允价值变动(元)

-

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

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。

投资组合报告附注

本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚情况的说明

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。

基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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。

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

22,373.79

2

应收证券清算款

-

3

应收股利

-

4

应收利息

579.47

5

应收申购款

3,886.91

6

其他应收款

-

7

待摊费用

-

8

其他

-

9

合计

26,840.17

期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有可转换债券。

期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号

股票代码

股票名称

流通受限部分的公允价值

占基金资产净值比例（%）

流通受限情况说明

1

601989

中国重工

2,901,198.92

7.24

资产重组

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。

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

1,372

27,405.04

106,508.59

0.28 %

37,493,213.13

99.72 %

期末上市基金前十名持有人

序号

持有人名称

持有份额（份）

占上市总份额比例

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

585,325.31

1.56 %

期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目

持有基金份额总量的数量区间（万份）

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金

10~50

本基金基金经理持有本开放式基金

0

发起式基金发起资金持有份额情况

项目

持有份额总数

持有份额占基金总份额比例

发起份额总数

发起份额占基金总份额比例

发起份额承诺持有期限

基金管理人固有资金

-

-%

-

-%

-

基金管理人高级管理人员

-

-%

-

-%

-

基金经理等人员

-

-%

-

-%

-

基金管理人股东

-

-%

-

-%

-

其他

-

-%

-

-%

-

合计

-

-%

-

-%

-

开放式基金份额变动

单位：份

项目

数值

基金合同生效日（2014-09-29）的基金份额总额

825,163,736.89

本报告期期初基金份额总额

48,855,999.29

本报告期期间基金总申购份额

13,851,191.97

减：本报告期期间基金总赎回份额

25,107,469.54

本报告期期间基金拆分变动份额

-

本报告期期末基金份额总额

37,599,721.72

注：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。

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。

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。

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。

基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

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。

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。

基金租用证券公司交易单元的有关情况

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

基金交易

债券交易

债券回购交易

权证交易

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

成交金额

占当期基金成交总额的比例

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

佣金

占当期佣金总量的比例

光大证券

1

43,070,496.94

37.62 %

-

-%

-

-%

-

-%

-

-%

31,497.45

37.62 %

-

渤海证券

1

37,801,606.77

33.02 %

-

-%

-

-%

-

-%

-

-%

27,644.39

33.02 %

-

国泰君安

2

33,609,971.18

29.36 %

-

-%

-

-%

-

-%

-

-%

24,578.74

29.36 %

-

山西证券

2

-

-%

-

-%

-
-%

-
-%

-
-%

-
-%

-
-%

-
-%

-
-%

-
-%

-
-%

-
-%

-
-%

-
-%

-
-%

-
-%

-
-%

-
-%

-
-%

-
-%

-
-%

-
-%

-
-%

-
-%

-
-%

-
-%

-
-%

兴业证券

2

-
-%

-
-%

-
-%

-
-%

-
-%

-
-%

-
-%

-
-%

-
-%

-
-%

-
-%

-
-%

-
-%

-
-%

-
-%

-
-%

-
-%

-
-%

-
-%

-
-%

中信证券

2

-
-%

-
-%

-
-%

-
-%

-
-%

-%

-

-%

-

-%

-

-%

-

-%

-

万联证券

2

-

-%

-

-%

-

-%

-

-%

-

-%

-

-%

-

财达证券

2

-

-%

-

-%

-

-%

-

-%

-

-%

-

-%

-

注：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。 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。

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

前海开源基金管理有限公司旗下基金 2016 年度最后一个交易日基金资产净值、基金份额净值及基金份额累计净值公告

证券日报、基金管理人的官方网站

2017-01-03

2

前海开源基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告

证券日报、基金管理人的官方网站

2017-01-17

3

前海开源中国成长灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第 4 季度报告

证券日报、基金管理人的官方网站

2017-01-20

4

前海开源基金管理有限公司关于旗下基金继续参与交通银行费率优惠活动的公告

证券日报、基金管理人的官方网站

2017-02-23

5

前海开源基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加蚂蚁基金申购补差费率优惠活动的公告

证券日报、基金管理人的官方网站

2017-02-23

6

前海开源基金管理有限公司关于开源证券费率调整的公告

证券日报、基金管理人的官方网站

2017-02-24

7

前海开源基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告
证券日报、基金管理人的官方网站

2017-03-23

8

前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加西南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
证券日报、基金管理人的官方网站

2017-03-29

9

前海开源中国成长灵活配置混合型证券投资基金 2016 年年度报告摘要
证券日报、基金管理人的官方网站

2017-03-30

10

前海开源中国成长灵活配置混合型证券投资基金 2016 年年度报告
基金管理人的官方网站

2017-03-30

11

前海开源基金管理有限公司关于旗下基金继续参与中国工商银行申购费率优惠活动的公告
证券日报、基金管理人的官方网站

2017-03-31

12

前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加万得投顾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
证券日报、基金管理人的官方网站

2017-04-11

13

前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加格上富信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
证券日报、基金管理人的官方网站

2017-04-17

14

前海开源基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告
证券日报、基金管理人的官方网站

2017-04-19

15

前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加乾道金融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
证券日报、基金管理人的官方网站

2017-04-20

16

前海开源基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告
证券日报、基金管理人的官方网站

2017-04-20

17

前海开源中国成长灵活配置混合型证券投资基金 2017 年第 1 季度报告
证券日报、基金管理人的官方网站

2017-04-21

18

前海开源基金管理有限公司关于旗下基金继续参与交通银行费率优惠活动的公告
证券日报、基金管理人的官方网站

2017-04-24

19

前海开源基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告
证券日报、基金管理人的官方网站

2017-04-25

20

前海开源基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告
证券日报、基金管理人的官方网站

2017-05-09

21

前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加扬州国信嘉利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
证券日报、基金管理人的官方网站

2017-05-11

22

前海开源基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告
证券日报、基金管理人的官方网站

2017-05-11

23

前海开源中国成长灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2017 年第 1 号）

证券日报、基金管理人的官方网站

2017-05-12

24

前海开源中国成长灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2017 年第 1 号）
基金管理人的官方网站

2017-05-12

25

前海开源基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告
证券日报、基金管理人的官方网站

2017-05-12

26

前海开源基金管理有限公司关于展恒基金费率调整的公告
证券日报、基金管理人的官方网站

2017-05-15

27

前海开源基金管理有限公司关于锦安基金费率调整的公告

证券日报、基金管理人的官方网站

2017-05-15

28

前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金在伯嘉基金开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告

证券日报、基金管理人的官方网站

2017-05-18

29

前海开源基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告

证券日报、基金管理人的官方网站

2017-05-24

30

前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中衍期货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

证券日报、基金管理人的官方网站

2017-05-25

31

前海开源基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告

证券日报、基金管理人的官方网站

2017-06-02

32

前海开源基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告

证券日报、基金管理人的官方网站

2017-06-13

33

前海开源基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告

证券日报、基金管理人的官方网站

2017-06-20

34

前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加济安财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

证券日报、基金管理人的官方网站

2017-06-27

35

前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金在华泰证券开通转换业务的公告

证券日报、基金管理人的官方网站

2017-06-29

36

前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加挖财基金为代销机构及开通定投业务并参与其费率优惠活动的公告

证券日报、基金管理人的官方网站

2017-06-29

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

20170601-20170607

0.00

11,207,602.34

11,207,602.34

0.00

0.000000 %

个人

-

-

-

-

-

-

-

产品特有风险

1. 巨额赎回风险

(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；

(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；

2. 转换运作方式或终止基金合同的风险

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；

3. 流动性风险

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；

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。

影响投资者决策的其他重要信息

无。

备查文件目录

(1) 中国证券监督管理委员会批准前海开源中国成长灵活配置混合型证券投资基金设立的文件

(2) 《前海开源中国成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

(3) 《前海开源中国成长灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

(4) 《前海开源中国成长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) 前海开源中国成长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

存放地点

基金管理人、基金托管人处

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