

前海开源沪深 300 指数型证券投资基金 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：中国农业银行股份有限公司

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
期末按公允价值报告期末按行业分类的股票投资组合值占基金资产净值比例大小排序的所有
权益投资明细
报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合
报告期末积极投资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
期末指数投资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
积极投资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
期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明
期末积极投资前五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。

基金托管人中国农业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

前海开源沪深 300 指数型证券投资基金

基金简称

前海开源沪深 300 指数

场内简称

基金主代码

000656

基金运作方式

契约型开放式

基金合同生效日

2014-06-17

基金管理人

前海开源基金管理有限公司

基金托管人

中国农业银行股份有限公司

报告期末基金份额总额

8,224,975.20

基金合同存续期

不定期

基金产品说明

投资目标

本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪沪深 300 指数，在严格控制基金的日均跟踪偏离度和年跟踪误差的前提下，力争获取与标的指数相似的投资收益。

投资策略

本基金采用完全复制标的指数的方法，进行被动式指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合复制标的指数，并根据标的指数变动而进行相应调整。本基金在严格控制基金日均跟踪偏离度和年跟踪误差的前提下，力争获取与标的指数相似的投资收益。由于标的指数编制方法调整、成份股及其权重变化的原因，或因基金的申购和赎回等其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。

1、大类资产配置：本基金管理人主要按照沪深 300 指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合,并根据指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的 90%，投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现

金基金资产的 85%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。

2、股票投资策略：（1）股票投资组合构建：本基金采用完全复制标的指数的方法，按照标的指数成份股组成及其权重构建股票投资组合。若出现特殊情况，本基金将采用替代性的方法构建组合，以减少跟踪误差。（2）股票投资组合的调整：本基金股票投资组合根据沪深 300 指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况等，对其进行适时调整。在正常市场情况下，力争控制本基金的份额净值与业绩比较基准的收益率日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免误差进一步扩大。

3、债券投资策略：本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，降低跟踪误差，主要采取组合久期配置策略，同时辅之以收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略等积极投资策略构建债券投资组合。

4、权证投资策略：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；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。运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，以达到降低投资组合的整体风险的目的。基金管理人将建立股指期货投资决策部门或小组，经董事会批准后执行。若相关法律法规发生变化时，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×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

风险收益特征

本基金属于采用指数化操作的股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金。

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

中国农业银行股份有限公司

信息披露负责人

姓名

傅成斌

林葛

联系电话

0755-88601888

010-66060069

电子邮箱

qhky@qhkyfund.com

tgxxpl@abchina.com

客户服务电话

4001666998

95599

传真

0755-83181169

010-68121816

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）

北京市东城区建国门内大街 69 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

北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9

邮政编码

518040

100031

法定代表人

王兆华

周慕冰

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

2,806,446.18

本期利润

1,476,351.56

加权平均基金份额本期利润

0.0381

本期加权平均净值利润率

3.43 %

本期基金份额净值增长率

6.57 %

报告期末

报告期末(2017-06-30)

期末可供分配利润

1,243,627.34

期末可供分配基金份额利润

0.1512

期末基金资产净值

9,468,602.54

期末基金份额净值

1.151

报告期末

报告期末(2017-06-30)

基金份额累计净值增长率

45.17 %

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

4.45 %

0.58 %

4.73 %

0.64 %

-0.28 %

-0.06 %

过去三个月

2.77 %

0.59 %

5.79 %

0.59 %

-3.02 %

0.00 %

过去六个月

6.57 %
0.54 %
10.23 %
0.54 %
-3.66 %
0.00 %
过去一年
11.86 %
0.63 %
15.44 %
0.63 %
-3.58 %
0.00 %
过去三年
45.02 %
1.65 %
65.95 %
1.66 %
-20.93 %
-0.01 %

自基金合同生效起至今

45.17 %
1.64 %
65.62 %
1.65 %
-20.45 %
-0.01 %

注：注：本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×95% + 银行活期存款利率（税后）×5%。

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

付海宁

本基金的基金经理、公司投资副总监

2017-02-14

-

7 年

付海宁先生，硕士研究生。2009 年至 2010 年担任摩根士丹利商业分析师，2010 年-2012 年担任美银美林量化风险分析师，2013 年至 2015 年担任美国标准普尔资管助理、投资经理，2015 年 11 月加盟前海开源基金管理有限公司，现任公司投资副总监。

王霞

本基金的基金经理、公司执行投资总监

2014-06-17

-

13 年

王霞女士，北京交通大学管理学硕士，中国注册会计师(CPA)。历任南方基金管理有限公司商业、贸易、旅游行业研究员、房地产行业首席研究员。现任前海开源基金管理有限公司执行投资总监。

苏天杉

本基金的基金经理、公司执行投资总监

2016-04-21

2017-06-13

5 年

苏天杉先生，美国罗彻斯特大学商学院 MBA、对外经济贸易大学管理学硕士、美国注册金融分析师（CFA）。2011 年加入美国领航基金（Vanguard Group）费城总部，任投资管理部投资分析师。曾任英特尔（Intel）全球新兴市场情报分析经理，高级分析师。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

报告期内，本基金紧密跟踪指数，降低跟踪误差。

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6.57%，同期业绩比较基准收益率为10.23%。

管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年货币政策以收紧为基调，政府调控手段加强，证券市场维持震荡格局，结构性趋势不大，相比之下沪深300等大盘股票走势会比较稳定。

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，从2017年5月19日至2017年6月30日连续29个工作日基金资产净值低于五千万元。

报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—前海开源基金管理有限公司2017年1月1日至2017年6月30日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，前海开源基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，前海开源基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

资产负债表

会计主体：前海开源沪深 300 指数型证券投资基金

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

701,477.94

4,205,696.99

结算备付金

-

-

存出保证金

11,451.77

4,015.51

交易性金融资产

8,977,074.07

46,708,457.34

其中：股票投资

8,977,074.07

46,708,457.34

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
105,270.61
-
应收利息
138.95
695.13
应收股利
-
-
应收申购款
3,444.44
43,574.39
递延所得税资产
-
-
其他资产
-
-
资产总计
9,798,857.78
50,962,439.36
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

152,297.27

6,386.84

应付管理人报酬

7,821.02

44,057.54

应付托管费

1,173.15

6,608.63

应付销售服务费

-

-

应付交易费用

29,042.46

5,279.94

应交税费

-

-

应付利息

-

-

应付利润

-

-

递延所得税负债

-

-

其他负债

139,921.34

190,024.05

负债合计

330,255.24

252,357.00

所有者权益：

-

-

实收基金

8,224,975.20
46,938,152.91
未分配利润
1,243,627.34
3,771,929.45
所有者权益合计
9,468,602.54
50,710,082.36
负债和所有者权益总计
9,798,857.78
50,962,439.36

注：注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.151 元，基金份额总额 8,224,975.20 份。

利润表

会计主体：前海开源沪深 300 指数型证券投资基金

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

1,926,047.23

8,836,195.60

1.利息收入

14,602.95

1,220,853.01

其中：存款利息收入

14,582.29

1,220,852.26

 债券利息收入

20.66

0.75

 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）

3,210,006.95
-702,846.07
其中：股票投资收益
3,073,593.33
-1,092,361.93
 基金投资收益
-
-
 债券投资收益
878.34
60.45
 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
135,535.28
389,455.41
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）
-1,330,094.62
144,962.34
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）
-
-
5.其他收入（损失以“-”号填列）
31,531.95
8,173,226.32
减：二、费用
449,695.67
1,954,533.06
1. 管理人报酬
214,252.03
1,365,170.56
2. 托管费
32,137.81
204,775.58
3. 销售服务费
-
-

4. 交易费用

73,180.45

253,759.26

5. 利息支出

-

-

其中：卖出回购金融资产支出

-

-

6. 其他费用

130,125.38

130,827.66

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）

1,476,351.56

6,881,662.54

减：所得税费用

-

-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）

1,476,351.56

6,881,662.54

所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：前海开源沪深 300 指数型证券投资基金

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）

46,635,785.32

1,357,364.35

47,993,149.67

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）

-

1,476,351.56

1,476,351.56

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）

-38,713,177.71

-4,004,653.67

-42,717,831.38

其中：1.基金申购款

3,933,565.73

456,985.82

4,390,551.55

2.基金赎回款

-42,646,743.44

-4,461,639.49

-47,108,382.93

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）

8,224,975.20

1,243,627.34

9,468,602.54

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）

3,461,960.99

1,302,462.44

4,764,423.43

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）

-

6,881,662.54

6,881,662.54

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）

43,173,824.33

1,684,066,688.75

1,727,240,513.08

其中：1.基金申购款

6,854,059,729.75

1,411,776,504.22

8,265,836,233.97

2.基金赎回款

-6,810,885,905.42

272,290,184.53

-6,538,595,720.89

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）

-

-1,690,893,449.38

-1,690,893,449.38

五、期末所有者权益（基金净值）

46,635,785.32

1,357,364.35

47,993,149.67

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

前海开源沪深 300 指数型证券投资基金（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】494 号文《关于准予前海开源沪深 300 指数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》、《前海开源沪深 300 指数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 6 月 3 日至 2014 年 6 月 13 日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 234,687,022.67 元，经瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）瑞华验字[2014]第 02030017 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《前海开源沪深 300 指数型证券投资基金基金合同》于 2014 年 6 月 17 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 234,720,620.35 份基金份额，其中认购资金利息折合 33,597.68 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农业银行股份有限公司。

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》、《前海开源沪深 300 指数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[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]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》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

701,477.94

-

定期存款

-

-

其中：存款期限 1-3 个月

-

-

其他存款

-

-

合计

701,477.94

4,205,696.99

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

8,001,841.06

8,977,074.07

975,233.01

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

8,001,841.06

8,977,074.07

975,233.01

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

134.27

-

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

-

-

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

4.68

-

合计

138.95

695.13

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

29,042.46

-

银行间市场应付交易费用

-

-

合计

29,042.46

5,279.94

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

330.96

-

预提费用

99,590.38

-

指数使用费

40,000.00

-

合计

139,921.34

190,024.05

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

46,938,152.91

46,938,152.91

本期申购

3,933,565.73

3,933,565.73

本期赎回（以“-”号填列）

-42,646,743.44

-42,646,743.44

本期末

8,224,975.20

8,224,975.20

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

68,329,417.84

-64,557,488.39

3,771,929.45

本期利润

2,806,446.18

-1,330,094.62

1,476,351.56

本期基金份额交易产生的变动数

-57,307,008.08

53,302,354.41

-4,004,653.67

其中：基金申购款

5,888,631.08

-5,431,645.26

456,985.82

基金赎回款

-63,195,639.16
58,733,999.67
-4,461,639.49
本期已分配利润
-
-
-

本期末
13,828,855.94
-12,585,228.60

1,243,627.34
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
14,512.58

-
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
42.74

-
其他
26.97

-
合计
14,582.29

1,220,852.26

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

40,120,601.31

-

减：卖出股票成本总额

37,047,007.98

-

买卖股票差价收入

3,073,593.33

-

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

878.34

-

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

878.34

60.45

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

62,899.00

-

减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额

62,000.00

-

减：应收利息总额

20.66

-

买卖债券差价收入

878.34

-

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

135,535.28

-

基金投资产生的股利收益

-

-

合计

135,535.28

389,455.41

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

-1,330,094.62

-

——股票投资

-1,330,094.62

-

——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
-1,330,094.62

144,962.34

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

30,821.45

-

基金转换费收入

710.50

-

合计

31,531.95

8,173,226.32

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

73,180.45

-

银行间市场交易费用

-

-

合计

73,180.45

253,759.26

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

24,795.19

-

汇划费

235.00

-

指数使用费

80,000.00

-

其他

300.00

-

合计

130,125.38

130,827.66

注：注：“其他”为账户维护费、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

中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）

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、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

214,252.03

1,365,170.56

其中：支付销售机构的客户维护费

1,149.27

21,363.18

注：注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.00%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$

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

32,137.81

204,775.58

注：注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$

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、公休假等，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（2014-06-17）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

中国农业银行股份有限公司

701,477.94

14,512.58

4,818,237.87

939,581.94

注：注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业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

600050

中国联通

2017-04-05

重大事项

6.85

-

-

45,054

195,012.56

308,619.90

-

300104

乐视网

2017-04-17

重大资产重组

30.68

-

-

5,300

262,601.13

162,604.00

-

000100

TCL 集团

2017-04-21

重大资产重组

3.43

2017-07-26

3.47

38,498

139,649.10
132,048.14
-
600100
同方股份
2017-04-21
重大资产重组
14.12
-
-
9,070
120,751.06
128,068.40
-
601919
中远海控
2017-05-17
重大资产重组
5.35
2017-07-26
5.89
19,738
117,818.34
105,598.30
-
002252
上海莱士
2017-04-21
重大事项
20.24
-
-
5,180
108,621.67
104,843.20
-
000503
海虹控股
2017-05-11
重大资产重组
24.93
-
-
3,804

120,441.17

94,833.72

-

600485

信威集团

2016-12-26

重大资产重组

14.59

-

-

6,281

120,270.46

91,639.79

-

002426

胜利精密

2017-01-16

重大事项

8.06

-

-

8,800

73,292.00

70,928.00

-

002129

中环股份

2016-04-25

重大事项

8.27

-

-

7,944

67,089.34

65,696.88

-

600666

奥瑞德

2017-04-28

重大资产重组

17.40

-

-

3,749

73,690.80
65,232.60
-
002049
紫光国芯
2017-02-20
重大资产重组
31.57
2017-07-17
27.74
1,800
58,796.00
56,826.00
-
601872
招商轮船
2017-05-02
重大事项
5.16
-
-
10,934
57,055.79
56,419.44
-
601989
中国重工
2017-05-31
重大资产重组
6.46
-
-
6,893
45,450.14
44,528.78
-
601608
中信重工
2017-04-19
重大事项
5.54
2017-07-26
5.26
6,700

35,833.90

37,118.00

-

601088

中国神华

2017-06-05

重大事项

22.29

-

-

1,551

22,008.63

34,571.79

-

600795

国电电力

2017-06-05

重大资产重组

3.60

-

-

8,827

26,767.25

31,777.20

-

601727

上海电气

2017-06-23

重大资产重组

7.57

2017-07-03

7.54

2,473

20,973.65

18,720.61

-

600959

江苏有线

2017-06-19

重大资产重组

10.57

-

-

1,202

13,214.22

12,705.14

-

000061

农产品

2017-06-28

重大资产重组

9.06

-

-

607

7,608.67

5,499.42

-

300085

银之杰

2017-06-30

非公开发行股票

18.50

2017-07-07

18.88

200

5,929.73

3,700.00

-

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。

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

701,477.94
-
701,477.94
存出保证金
11,451.77
-
11,451.77
交易性金融资产
-
8,977,074.07
8,977,074.07
应收证券清算款
-
105,270.61
105,270.61
应收利息
-
138.95
138.95
应收申购款
298.21
3,146.23
3,444.44
资产总计
713,227.92
9,085,629.86
9,798,857.78
负债
应付赎回款
-
152,297.27
152,297.27
应付管理人报酬
-
7,821.02
7,821.02
应付托管费
-
1,173.15
1,173.15
应付交易费用
-
29,042.46
29,042.46

其他负债
-
139,921.34
139,921.34
负债总计
-
330,255.24
330,255.24
利率敏感度缺口
713,227.92
8,755,374.62
9,468,602.54
上年度末
2016-12-31
1 年以内
不计息
合计
资产
银行存款
4,205,696.99
-
4,205,696.99
存出保证金
4,015.51
-
4,015.51
交易性金融资产
-
46,708,457.34
46,708,457.34
应收利息
-
695.13
695.13
应收申购款
198.81
43,375.58
43,574.39
其他资产
-
-
-
资产总计
4,209,911.31

46,752,528.05
50,962,439.36
负债
应付赎回款
-
6,386.84
6,386.84
应付管理人报酬
-
44,057.54
44,057.54
应付托管费
-
6,608.63
6,608.63
应付交易费用
-
5,279.94
5,279.94
其他负债
-
190,024.05
190,024.05
负债总计
-
252,357.00
252,357.00
利率敏感度缺口
4,209,911.31
46,500,171.05
50,710,082.36

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

8,977,074.07

94.81

46,708,457.34

92.11

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

8,977,074.07

94.81

46,708,457.34

92.11

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%

453,149.20

2,321,483.88

权益性投资的市场价格下降 5%

-453,149.20

-2,321,483.88

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 7,345,094.76 元，第二层次的余额为 1,631,979.31 元，属于第三层次的余额为 0.00 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 45,461,444.04 元，属于第二层次的余额为 1,247,013.30 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 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

8,977,074.07

91.61

其中：股票

8,977,074.07

91.61

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

701,477.94

7.16

7

其他各项资产

120,305.77

1.23

8

合计

9,798,857.78

100.00

报告期末按行业分类的股票投资组合

报告期末指数投资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

19,492.96

0.21

B

采矿业

260,193.92

2.75

C

制造业

3,224,564.15

34.06

D

电力、热力、燃气及水生产和供应业

221,639.11

2.34

E

建筑业

356,380.30

3.76

F

批发和零售业

164,646.16

1.74

G

交通运输、仓储和邮政业

364,310.58

3.85

H

住宿和餐饮业

-

-

I

信息传输、软件和信息技术服务业

918,796.11

9.70

J

金融业

2,536,452.78

26.79

K

房地产业

269,396.74

2.85

L

租赁和商务服务业

64,623.55

0.68

M

科学研究和技术服务业

-

-

N

水利、环境和公共设施管理业

65,540.42

0.69

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

87,584.77

0.93

S

综合

23,395.21

0.25

合计

8,577,016.76

90.58

报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

代码

行业类别

公允价值（元）

占基金资产净值比例（%）

A

农、林、牧、渔业

-

-

B

采矿业

-

-

C

制造业

247,165.50

2.61

D

电力、热力、燃气及水生产和供应业

6,063.73

0.06

E

建筑业

-

-

F

批发和零售业

17,422.72

0.18

G

交通运输、仓储和邮政业

5,221.92

0.06

H

住宿和餐饮业

5,420.00

0.06

I

信息传输、软件和信息技术服务业

26,325.14

0.28

J

金融业	6,548.00	0.07
K		
房地产业	-	-
L		
租赁和商务服务业	13,303.78	0.14
M		
科学研究和技术服务业	-	-
N		
水利、环境和公共设施管理业	51,671.84	0.55
O		
居民服务、修理和其他服务业	-	-
P		
教育	-	-
Q		
卫生和社会工作	11,327.62	0.12
R		
文化、体育和娱乐业	5,533.92	0.06
S		
综合	4,053.14	0.04
合计	400,057.31	4.23
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

期末指数投资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

601318

中国平安
7,768
385,370.48
4.07
2
600050
中国联通
45,054
308,619.90
3.26
3
600519
贵州茅台
465
219,410.25
2.32
4
600036
招商银行
7,603
181,787.73
1.92
5
300104
乐视网
5,300
162,604.00
1.72
6
601166
兴业银行
9,597
161,805.42
1.71
7
600016
民生银行
18,246
149,982.12
1.58
8
000651
格力电器
3,300

135,861.00

1.43

9

601328

交通银行

21,835

134,503.60

1.42

10

000333

美的集团

3,102

133,510.08

1.41

11

000100

TCL 集团

38,498

132,048.14

1.39

12

600100

同方股份

9,070

128,068.40

1.35

13

601668

中国建筑

11,290

109,287.20

1.15

14

600000

浦发银行

8,450

106,892.50

1.13

15

601919

中远海控

19,738

105,598.30

1.12

16
002252
上海莱士
5,180
104,843.20
1.11
17
600030
中信证券
5,763
98,086.26
1.04
18
600887
伊利股份
4,526
97,716.34
1.03
19
600837
海通证券
6,424
95,396.40
1.01
20
000503
海虹控股
3,804
94,833.72
1.00
21
600485
信威集团
6,281
91,639.79
0.97
22
601398
工商银行
17,245
90,536.25
0.96
23
601169

北京银行
9,295
85,235.15
0.90
24
600104
上汽集团
2,660
82,593.00
0.87
25
600900
长江电力
5,191
79,837.58
0.84
26
601766
中国中车
7,707
77,994.84
0.82
27
000858
五 粮 液
1,401
77,979.66
0.82
28
000725
京东方 A
18,303
76,140.48
0.80
29
601601
中国太保
2,173
73,599.51
0.78
30
002426
胜利精密
8,800

70,928.00

0.75

31

601211

国泰君安

3,324

68,175.24

0.72

32

600276

恒瑞医药

1,320

66,778.80

0.71

33

002415

海康威视

2,028

65,504.40

0.69

34

601988

中国银行

16,991

62,866.70

0.66

35

000001

平安银行

6,439

60,462.21

0.64

36

002049

紫光国芯

1,800

56,826.00

0.60

37

601872

招商轮船

10,934

56,419.44

0.60

38
300168
万达信息
3,800
55,290.00
0.58
39
600048
保利地产
5,235
52,192.95
0.55
40
601390
中国中铁
5,990
51,933.30
0.55
41
600028
中国石化
8,632
51,187.76
0.54
42
600518
康美药业
2,350
51,089.00
0.54
43
601818
光大银行
12,390
50,179.50
0.53
44
600019
宝钢股份
6,675
44,789.25
0.47
45
601989

中国重工
6,893
44,528.78
0.47
46
600015
华夏银行
4,811
44,357.42
0.47
47
601688
华泰证券
2,457
43,980.30
0.46
48
002304
洋河股份
500
43,405.00
0.46
49
601186
中国铁建
3,542
42,610.26
0.45
50
002450
康得新
1,890
42,562.80
0.45
51
601006
大秦铁路
4,844
40,641.16
0.43
52
000776
广发证券
2,204

38,019.00
0.40
53
000063
中兴通讯
1,601
38,007.74
0.40
54
000538
云南白药
400
37,540.00
0.40
55
601608
中信重工
6,700
37,118.00
0.39
56
601628
中国人寿
1,349
36,396.02
0.38
57
001979
招商蛇口
1,701
36,333.36
0.38
58
600585
海螺水泥
1,546
35,140.58
0.37
59
601088
中国神华
1,551
34,571.79
0.37

60
600690
青岛海尔
2,257
33,967.85
0.36
61
600958
东方证券
2,399
33,370.09
0.35
62
601336
新华保险
627
32,227.80
0.34
63
601939
建设银行
5,232
32,176.80
0.34
64
600795
国电电力
8,827
31,777.20
0.34
65
002024
苏宁云商
2,801
31,511.25
0.33
66
601009
南京银行
2,753
30,861.13
0.33
67
000568

泸州老窖
605
30,600.90
0.32
68
600703
三安光电
1,545
30,436.50
0.32
69
600999
招商证券
1,759
30,289.98
0.32
70
601857
中国石油
3,933
30,244.77
0.32
71
601899
紫金矿业
8,661
29,707.23
0.31
72
601901
方正证券
2,963
29,422.59
0.31
73
600009
上海机场
779
29,064.49
0.31
74
002142
宁波银行
1,502

28,988.60
0.31
75
000423
东阿阿胶
400
28,756.00
0.30
76
601985
中国核电
3,650
28,506.50
0.30
77
601669
中国电建
3,547
28,092.24
0.30
78
600309
万华化学
973
27,866.72
0.29
79
600660
福耀玻璃
1,064
27,706.56
0.29
80
002241
歌尔股份
1,410
27,184.80
0.29
81
002466
天齐锂业
500
27,175.00
0.29

82
601607
上海医药
929
26,829.52
0.28
83
601377
兴业证券
3,585
26,636.55
0.28
84
300070
碧水源
1,420
26,483.00
0.28
85
000166
申万宏源
4,713
26,392.80
0.28
86
002230
科大讯飞
655
26,134.50
0.28
87
300072
三聚环保
700
25,935.00
0.27
88
600089
特变电工
2,473
25,546.09
0.27
89
002456

欧菲光
1,400
25,438.00
0.27
90
002736
国信证券
1,903
25,214.75
0.27
91
600886
国投电力
3,156
24,932.40
0.26
92
600196
复星医药
797
24,699.03
0.26
93
002008
大族激光
700
24,248.00
0.26
94
600066
宇通客车
1,070
23,507.90
0.25
95
600029
南方航空
2,672
23,246.40
0.25
96
600010
包钢股份
10,604

23,222.76
0.25
97
000069
华侨城 A
2,301
23,148.06
0.24
98
601788
光大证券
1,540
22,992.20
0.24
99
600068
葛洲坝
2,043
22,963.32
0.24
100
601888
中国国旅
760
22,906.40
0.24
101
600637
东方明珠
1,055
22,861.85
0.24
102
002236
大华股份
1,000
22,810.00
0.24
103
600340
华夏幸福
679
22,800.82
0.24

104
000783
长江证券
2,407
22,794.29
0.24
105
300059
东方财富
1,877
22,561.54
0.24
106
000338
潍柴动力
1,702
22,466.40
0.24
107
600741
华域汽车
924
22,397.76
0.24
108
600535
天士力
534
22,182.36
0.23
109
601600
中国铝业
4,880
22,057.60
0.23
110
000625
长安汽车
1,503
21,673.26
0.23
111
002594

比亚迪
433
21,628.35
0.23
112
601099
太平洋
5,356
21,531.12
0.23
113
600406
国电南瑞
1,216
21,462.40
0.23
114
600705
中航资本
3,798
21,458.70
0.23
115
601618
中国中冶
4,226
21,172.26
0.22
116
601933
永辉超市
2,938
20,801.04
0.22
117
600031
三一重工
2,525
20,528.25
0.22
118
000839
中信国安
2,052

20,499.48

0.22

119

300124

汇川技术

801

20,457.54

0.22

120

002739

万达院线

400

20,388.00

0.22

121

000768

中航飞机

1,100

20,284.00

0.21

122

600383

金地集团

1,757

20,152.79

0.21

123

000963

华东医药

400

19,880.00

0.21

124

600111

北方稀土

1,711

19,385.63

0.20

125

000895

双汇发展

806

19,142.50

0.20

126
002475
立讯精密
652
19,064.48
0.20
127
601800
中国交建
1,184
18,813.76
0.20
128
601727
上海电气
2,473
18,720.61
0.20
129
600023
浙能电力
3,407
18,602.22
0.20
130
002202
金风科技
1,201
18,579.47
0.20
131
002673
西部证券
1,304
18,542.88
0.20
132
601555
东吴证券
1,643
18,450.89
0.19
133
600109

国金证券

1,554

18,212.88

0.19

134

600739

辽宁成大

1,008

18,174.24

0.19

135

000623

吉林敖东

780

17,854.20

0.19

136

600893

航发动力

649

17,717.70

0.19

137

002007

华兰生物

483

17,629.50

0.19

138

601018

宁波港

3,067

17,328.55

0.18

139

600271

航天信息

838

17,296.32

0.18

140

600177

雅戈尔

1,677

16,971.24
0.18
141
600547
山东黄金
584
16,895.12
0.18
142
600352
浙江龙盛
1,769
16,858.57
0.18
143
600674
川投能源
1,706
16,752.92
0.18
144
600221
海航控股
5,146
16,570.12
0.18
145
000793
华闻传媒
1,617
16,364.04
0.17
146
600570
恒生电子
347
16,197.96
0.17
147
600804
鹏博士
907
16,099.25
0.17

148
600018
上港集团
2,539
16,097.26
0.17
149
300024
机器人
821
16,009.50
0.17
150
600153
建发股份
1,236
15,981.48
0.17
151
600415
小商品城
2,198
15,913.52
0.17
152
000826
启迪桑德
453
15,909.36
0.17
153
000413
东旭光电
1,402
15,730.44
0.17
154
600816
安信信托
1,153
15,669.27
0.17
155
000728

国元证券
1,259
15,384.98
0.16
156
601198
东兴证券
892
15,378.08
0.16
157
600115
东方航空
2,250
15,300.00
0.16
158
002065
东华软件
700
15,253.00
0.16
159
601111
中国国航
1,556
15,171.00
0.16
160
600820
隧道股份
1,499
15,139.90
0.16
161
002310
东方园林
900
15,048.00
0.16
162
600085
同仁堂
429

14,997.84
0.16
163
601998
中信银行
2,374
14,932.46
0.16
164
000157
中联重科
3,302
14,825.98
0.16
165
000709
河钢股份
3,503
14,677.57
0.16
166
000540
中天城投
2,100
14,595.00
0.15
167
600606
绿地控股
1,846
14,435.72
0.15
168
603993
洛阳钼业
2,801
14,173.06
0.15
169
600157
永泰能源
3,964
14,151.48
0.15

170
002465
海格通信
1,309
14,058.66
0.15
171
600489
中金黄金
1,400
14,042.00
0.15
172
300315
掌趣科技
1,701
13,880.16
0.15
173
600663
陆家嘴
585
13,829.40
0.15
174
000630
铜陵有色
4,824
13,700.16
0.14
175
300017
网宿科技
1,129
13,627.03
0.14
176
600008
首创股份
2,023
13,311.34
0.14
177
600061

国投安信

853

13,264.15

0.14

178

002081

金螳螂

1,200

13,176.00

0.14

179

600208

新湖中宝

2,928

13,176.00

0.14

180

000876

新希望

1,600

13,152.00

0.14

181

000009

中国宝安

1,617

13,081.53

0.14

182

601155

新城控股

700

12,978.00

0.14

183

600718

东软集团

822

12,782.10

0.13

184

600959

江苏有线

1,202

12,705.14
0.13
185
600118
中国卫星
454
12,639.36
0.13
186
600150
中国船舶
552
12,624.24
0.13
187
002074
国轩高科
400
12,620.00
0.13
188
600297
广汇汽车
1,660
12,499.80
0.13
189
300033
同花顺
200
12,442.00
0.13
190
600332
白云山
425
12,342.00
0.13
191
000060
中金岭南
1,100
12,320.00
0.13

192
000938
紫光股份
200
12,224.00
0.13
193
600170
上海建工
3,183
12,159.06
0.13
194
000750
国海证券
2,202
12,111.00
0.13
195
601633
长城汽车
902
11,987.58
0.13
196
600369
西南证券
2,117
11,876.37
0.13
197
601333
广深铁路
2,583
11,675.16
0.12
198
600688
上海石化
1,766
11,673.26
0.12
199
000425

徐工机械
3,096
11,610.00
0.12
200
600583
海油工程
1,838
11,469.12
0.12
201
000686
东北证券
1,087
10,924.35
0.12
202
600362
江西铜业
640
10,790.40
0.11
203
000559
万向钱潮
1,001
10,630.62
0.11
204
000402
金融街
901
10,559.72
0.11
205
000983
西山煤电
1,200
10,524.00
0.11
206
300027
华谊兄弟
1,295

10,476.55
0.11
207
300144
宋城演艺
500
10,435.00
0.11
208
600588
用友网络
609
10,426.08
0.11
209
600895
张江高科
611
10,313.68
0.11
210
600038
中直股份
225
10,298.25
0.11
211
600373
中文传媒
438
10,297.38
0.11
212
600649
城投控股
970
10,194.70
0.11
213
000917
电广传媒
900
10,170.00
0.11

214
600498
烽火通信
400
10,140.00
0.11
215
600256
广汇能源
2,401
9,940.14
0.10
216
600060
海信电器
652
9,890.84
0.10
217
002146
荣盛发展
1,000
9,870.00
0.10
218
002385
大北农
1,552
9,762.08
0.10
219
600704
物产中大
1,327
9,673.83
0.10
220
002174
游族网络
300
9,528.00
0.10
221
601216

君正集团

1,945

9,511.05

0.10

222

600074

保千里

742

9,505.02

0.10

223

002183

怡亚通

1,101

9,501.63

0.10

224

000792

盐湖股份

906

9,467.70

0.10

225

000415

渤海金控

1,400

9,422.00

0.10

226

600827

百联股份

572

9,295.00

0.10

227

601718

际华集团

1,051

9,238.29

0.10

228

601225

陕西煤业

1,290

9,120.30
0.10
229
002470
金正大
1,208
9,096.24
0.10
230
600376
首开股份
791
9,049.04
0.10
231
600685
中船防务
324
8,871.12
0.09
232
601866
中远海发
2,442
8,791.20
0.09
233
002500
山西证券
907
8,689.06
0.09
234
000977
浪潮信息
500
8,660.00
0.09
235
601021
春秋航空
250
8,407.50
0.09

236
002714
牧原股份
300
8,166.00
0.09
237
000627
天茂集团
1,000
8,080.00
0.09
238
002195
二三四五
1,130
8,079.50
0.09
239
600037
歌华有线
552
8,037.12
0.08
240
601877
正泰电器
400
8,036.00
0.08
241
600021
上海电力
655
7,918.95
0.08
242
000738
中航动控
400
7,828.00
0.08
243
600482

中国动力
300
7,587.00
0.08
244
002424
贵州百灵
400
7,544.00
0.08
245
002152
广电运通
900
7,479.00
0.08
246
000156
华数传媒
500
7,455.00
0.08
247
600737
中粮糖业
779
7,353.76
0.08
248
000671
阳光城
1,200
6,984.00
0.07
249
002027
分众传媒
500
6,880.00
0.07
250
002153
石基信息
300

6,819.00
0.07
251
600446
金证股份
386
6,785.88
0.07
252
002292
奥飞娱乐
400
6,760.00
0.07
253
600549
厦门钨业
300
6,447.00
0.07
254
600372
中航电子
365
6,340.05
0.07
255
300133
华策影视
560
6,272.00
0.07
256
002131
利欧股份
1,850
6,086.50
0.06
257
601611
中国核建
500
5,985.00
0.06

258
002299
圣农发展
400
5,948.00
0.06
259
300251
光线传媒
720
5,896.80
0.06
260
601118
海南橡胶
947
5,378.96
0.06
261
600871
石化油服
1,606
5,364.04
0.06
262
000718
苏宁环球
900
5,274.00
0.06
263
601958
金铂股份
731
5,241.27
0.06
264
000008
神州高铁
700
5,096.00
0.05
265
000555

神州信息

300

5,010.00

0.05

266

601127

小康股份

200

3,990.00

0.04

267

600188

兖州煤业

291

3,561.84

0.04

268

002797

第一创业

320

2,947.20

0.03

期末积极投资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

002129

中环股份

7,944

65,696.88

0.69

2

600666

奥瑞德

3,749

65,232.60

0.69

3

601200

上海环境
1,936
51,671.84
0.55
4
600867
通化东宝
970
17,692.80
0.19
5
002085
万丰奥威
840
16,338.00
0.17
6
300015
爱尔眼科
487
11,327.62
0.12
7
601258
庞大集团
4,000
11,200.00
0.12
8
000039
中集集团
600
10,818.00
0.11
9
000778
新兴铸管
1,602
10,733.40
0.11
10
600839
四川长虹
2,833

10,255.46

0.11

11

300002

神州泰岳

1,101

9,182.34

0.10

12

600873

梅花生物

1,600

9,072.00

0.10

13

600252

中恒集团

2,171

8,770.84

0.09

14

600875

东方电气

915

8,765.70

0.09

15

300146

汤臣倍健

600

8,244.00

0.09

16

300058

蓝色光标

998

7,804.36

0.08

17

300182

捷成股份

800

7,648.00

0.08

18
000712
锦龙股份
400
6,548.00
0.07
19
600648
外高桥
336
6,222.72
0.07
20
000800
一汽轿车
606
6,163.02
0.07
21
000027
深圳能源
901
6,063.73
0.06
22
600582
天地科技
1,320
6,058.80
0.06
23
603000
人民网
440
5,794.80
0.06
24
601928
凤凰传媒
567
5,533.92
0.06
25
000061

农产品

607

5,499.42

0.06

26

600754

锦江股份

200

5,420.00

0.06

27

603885

吉祥航空

344

5,221.92

0.06

28

600783

鲁信创投

238

4,053.14

0.04

29

300085

银之杰

200

3,700.00

0.04

30

002568

百润股份

200

3,324.00

0.04

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

600016

民生银行
106,656.00
0.21
2
600019
宝钢股份
96,148.36
0.19
3
600837
海通证券
56,865.00
0.11
4
000002
万 科 A
49,384.00
0.10
5
601200
上海环境
39,374.88
0.08
6
600030
中信证券
34,926.00
0.07
7
600000
浦发银行
31,467.00
0.06
8
601668
中国建筑
28,349.00
0.06
9
601169
北京银行
24,882.00
0.05
10

601166
兴业银行
22,954.00
0.05
11
600104
上汽集团
21,798.00
0.04
12
601601
中国太保
16,720.00
0.03
13
002673
西部证券
13,046.13
0.03
14
600873
梅花生物
9,120.00
0.02
15
601328
交通银行
8,610.00
0.02
16
601398
工商银行
6,682.00
0.01
17
600549
厦门钨业
6,585.00
0.01
18
000718
苏宁环球
5,283.00
0.01

19

601988

中国银行

4,784.00

0.01

20

600028

中国石化

4,165.00

0.01

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

601318

中国平安

2,010,309.00

3.96

2

600036

招商银行

958,516.00

1.89

3

601166

兴业银行

955,718.00

1.88

4

600519

贵州茅台

911,490.00

1.80

5

600016

民生银行

909,127.00

1.79

6
601328
交通银行
723,229.00
1.43
7
000002
万科A
719,526.35
1.42
8
000333
美的集团
709,348.00
1.40
9
000651
格力电器
699,838.00
1.38
10
601668
中国建筑
624,005.00
1.23
11
600000
浦发银行
607,287.00
1.20
12
600030
中信证券
580,696.00
1.15
13
600837
海通证券
568,882.00
1.12
14
600887
伊利股份
499,835.00

0.99
15
601169
北京银行
482,381.00
0.95
16
601398
工商银行
481,791.00
0.95
17
600104
上汽集团
435,359.00
0.86
18
000725
京东方 A
430,510.00
0.85
19
600900
长江电力
421,528.29
0.83
20
601601
中国太保
410,434.00
0.81

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

645,719.33

卖出股票收入（成交）总额

40,120,601.31

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

11,451.77

2

应收证券清算款

105,270.61

3

应收股利

-

4

应收利息

138.95

5

应收申购款

3,444.44

6

其他应收款

-

7

待摊费用

-

8

其他

-

9

合计

120,305.77

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。

期末指数投资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

600050

中国联通

308,619.90

3.26

重大事项

2

300104

乐视网

162,604.00

1.72

重大资产重组

期末积极投资前五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

002129

中环股份

65,696.88

0.69

重大事项

2

600666

奥瑞德

65,232.60

0.69

重大资产重组

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

928

8,863.12

900.79

0.01 %

8,224,074.41

99.99 %

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

1,394,834.13

16.96 %

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、基金投资和部门负责人持有本开放式基金

>100

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（2014-06-17）的基金份额总额

234,720,620.35

本报告期期初基金份额总额

46,938,152.91

本报告期期间基金总申购份额

3,933,565.73

减：本报告期期间基金总赎回份额

42,646,743.44

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

8,224,975.20

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

本基金本报告期投资策略未改变。

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

中泰证券

2

40,144,220.28

99.17 %

-

-%

62,899.00

100.00 %

-

-%

-

-%

29,358.08

99.17 %

-

东兴证券

2

335,225.79

0.83 %

-

-%

-

-%

-

-%

-

-%

245.16

0.83 %

-

银河证券

1

-

-%

-

-%

-

-%

-

-%

-

-%

-

-%

-

中金公司

2

-

-%

-

-%

-

-%

-

-%

-

-%

-

-%

-

中信建投

1

-

-%

-

-%

-

-%

-

-%

-

-%

-

-%

-

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。 -

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

前海开源沪深 300 指数型证券投资基金 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

前海开源沪深 300 指数型证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2016 年第 2 号）

证券日报、基金管理人的官方网站

2017-01-26

5

前海开源沪深 300 指数型证券投资基金招募说明书（更新）（2016 年第 2 号）

基金管理人的官方网站

2017-01-26

6

前海开源沪深 300 指数型证券投资基金增聘基金经理的公告

证券日报、基金管理人的官方网站

2017-02-22

7

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

8

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

9

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

10

前海开源沪深 300 指数型证券投资基金 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

11

前海开源沪深 300 指数型证券投资基金 2016 年年度报告
基金管理人的官方网站

2017-03-30

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

前海开源沪深 300 指数型证券投资基金 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

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

2017-05-09

20

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

21

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

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

2017-05-12

23

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

24

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

25

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

26

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

27

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

28

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

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

2017-06-13

30

前海开源沪深 300 指数型证券投资基金变更基金经理的公告
证券日报、基金管理人的官方网站

2017-06-15

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

2017-06-20

32

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

33

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

34

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

20170101-20170523

13,269,194.31

0.00

13,269,194.31

0.00

0.000000 %

2

20170101-20170523

9,636,269.43

0.00

9,636,269.43

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沪深 300 指数型证券投资基金设立的文件
- (2) 《前海开源沪深 300 指数型证券投资基金基金合同》
- (3) 《前海开源沪深 300 指数型证券投资基金托管协议》
- (4) 《前海开源沪深 300 指数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) 前海开源沪深 300 指数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