

前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型
证券投资基金
2017 年半年度报告

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：前海开源基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	8
2.4 信息披露方式.....	9
2.5 其他相关资料.....	9
§3 主要财务指标和基金净值表现	10
3.1 主要会计数据和财务指标.....	10
3.2 基金净值表现.....	11
3.3 其他指标.....	13
§4 管理人报告	14
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	14
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	15
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	16
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	16
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	17
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	17
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	18
6.1 资产负债表.....	18
6.2 利润表.....	19

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	21
6.4 报表附注.....	22
§7 投资组合报告.....	51
7.1 期末基金资产组合情况.....	51
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	51
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	52
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	71
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	73
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	74
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	74
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	74
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	74
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	75
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	75
7.12 投资组合报告附注.....	75
§8 基金份额持有人信息.....	77
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	77
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	78
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	78
§9 开放式基金份额变动.....	79
§10 重大事件揭示.....	80
10.1 基金份额持有人大会决议.....	80
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	80
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	80
10.4 基金投资策略的改变.....	80
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	80
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	80
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	81
10.8 其他重大事件.....	82
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	89

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	89
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	90
§12 备查文件目录.....	91
12.1 备查文件目录.....	91
12.2 存放地点.....	91
12.3 查阅方式.....	91

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	前海开源沪港深核心资源混合	
基金主代码	003304	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 10 月 17 日	
基金管理人	前海开源基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	572,082,326.64 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	前海开源沪港深核心资源混合 A	前海开源沪港深核心资源混合 C
下属分级基金的交易代码:	003304	003305
报告期末下属分级基金的份额总额	491,386,639.44 份	80,695,687.20 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过精选投资于核心资源主题相关证券，在合理控制风险并保持基金资产良好流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>本基金的投资策略主要有以下六方面内容：</p> <p>1、大类资产配置</p> <p>在大类资产配置中，本基金综合运用定性和定量的分析手段，在对宏观经济因素进行充分研究的基础上，判断宏观经济周期所处阶段。本基金将依据经济周期理论，结合对证券市场的系统性风险以及未来一段时期内各大类资产风险和预期收益率的评估，制定本基金在股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例。</p>

本基金通过对股票等权益类、债券等固定收益类和现金资产分布的实时监控，根据经济运行周期变动、市场利率变化、市场估值、证券市场变化等因素以及基金的风险评估进行灵活调整。在各类资产中，根据其参与市场基本要素的变动，调整各类资产在基金投资组合中的比例。

2、股票投资策略

（1）核心资源主题相关股票的界定

本基金所称“核心资源”是指能够被企业占有和利用，为企业创造经济价值，进而给企业带来核心竞争力的稀缺资源以及生产或经营条件。以核心资源为主题，本基金将重点配置拥有上述核心资源开发、经营或使用权的上市公司发行的股票。

本基金将在拥有上述核心资源的上市公司中，重点关注具有良好发展潜力的核心资源及拥有该资源开发经营权的上市公司。

（2）核心资源主题相关股票的投资策略

本基金将精选有良好增值潜力的、与核心资源主题相关的上市公司股票构建股票投资组合。

（3）港股通标的股票投资策略

本基金可通过沪港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，不使用合格境内机构投资者(QDII)境外投资额度进行境外投资。本基金将遵循核心资源主题相关股票的投资策略，优先将基本面健康、业绩向上弹性较大、具有估值优势的港股纳入本基金的股票投资组合。

3、债券投资策略

在债券投资策略方面，本基金将以核心资源主题相关债券为主线，在综合研究的基础上实施积极主动的组合管理，采用宏观环境分析和微观市场定价分析两个方面进行债券资产的投资。

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，发现市场对股票权证的非理性定价；利用权证衍生工具的特性，通过权证与证券的组合投资，来达到改善组合风险收益特征的目的。

5、资产支持证券投资策略

	<p>本基金通过对资产支持证券发行条款的分析、违约概率和提前偿付比率的预估，借用必要的数量模型来谋求对资产支持证券的合理定价，在严格控制风险、充分考虑风险补偿收益和市场流动性的条件下，谨慎选择风险调整后收益较高的品种进行投资。</p> <p>本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。</p> <p>6、股指期货投资策略</p> <p>本基金以套期保值为目的，参与股指期货交易。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×70%+中证全债指数收益率×30%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金，低于股票型基金。本基金如果投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		前海开源基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	傅成斌	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	上海市浦东新区银城中路 188

	7006 号万科富春东方大厦 2206	号
邮政编码	518040	200120
法定代表人	王兆华	牛锡明

2.4 信息披露方式

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

2.5 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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	前海开源沪港深核心资源混合 A	前海开源沪港深核心资源混合 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日)	报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	9,135,280.22	818,460.19
本期利润	14,211,540.79	657,778.15
加权平均基金份额本期利润	0.0313	0.0141
本期加权平均净值利润率	3.08%	1.38%
本期基金份额净值增长率	3.51%	3.41%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)	
期末可供分配利润	10,993,835.46	1,751,926.27
期末可供分配基金份额利润	0.0224	0.0217
期末基金资产净值	506,429,944.74	83,112,182.40
期末基金份额净值	1.031	1.030
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	3.10%	3.00%

注：① 上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

② 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

③ 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润期末余额和未分配利润中已实现部分期末余额的孰低数。表中的“期末”均指报告期最后一个自然日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

④ 本基金的基金合同于 2016 年 10 月 17 日生效，截至 2017 年 6 月 30 日，本基金成立未满 1 年。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

前海开源沪港深核心资源混合 A

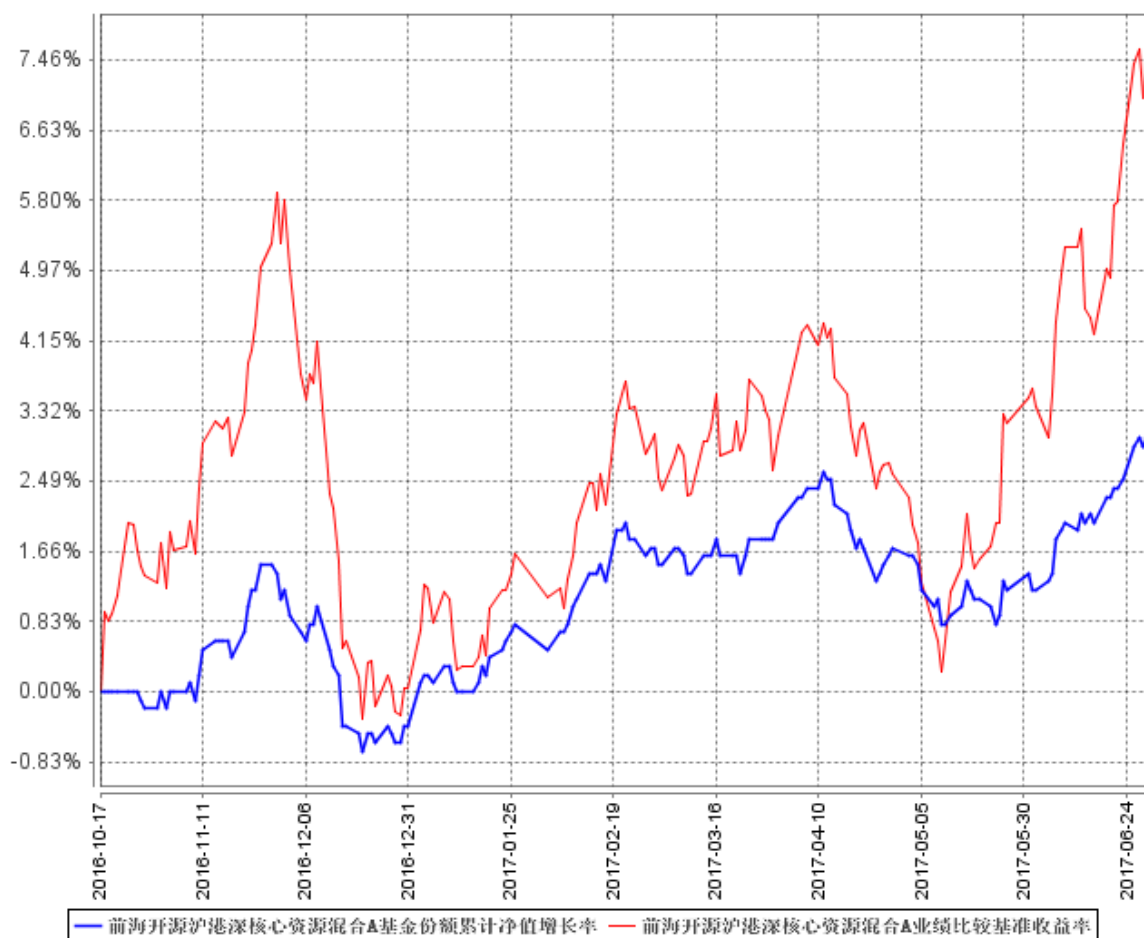
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.68%	0.15%	3.84%	0.47%	-2.16%	-0.32%
过去三个月	1.08%	0.17%	4.30%	0.44%	-3.22%	-0.27%
过去六个月	3.51%	0.17%	7.41%	0.40%	-3.90%	-0.23%
自基金合同生效起至今	3.10%	0.17%	7.45%	0.44%	-4.35%	-0.27%

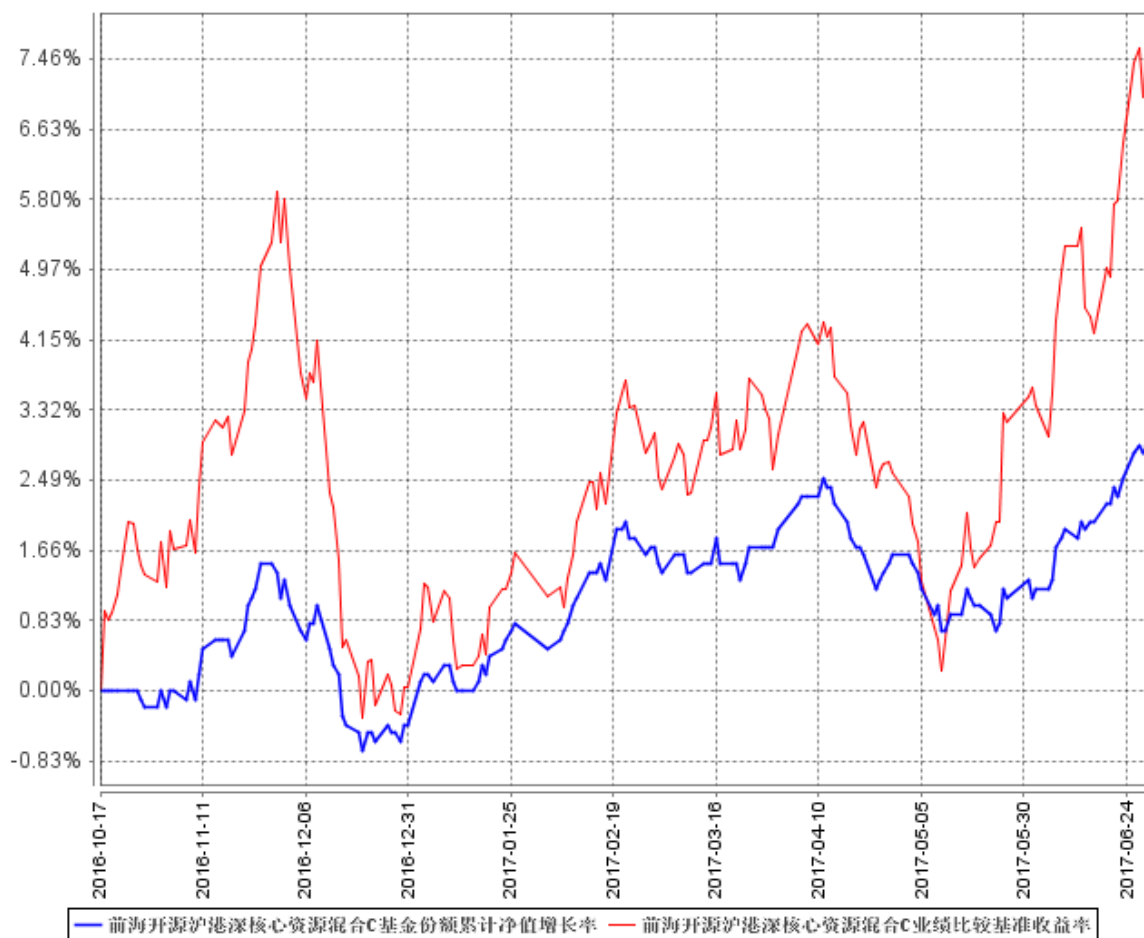
前海开源沪港深核心资源混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.68%	0.14%	3.84%	0.47%	-2.16%	-0.33%
过去三个月	1.08%	0.17%	4.30%	0.44%	-3.22%	-0.27%
过去六个月	3.41%	0.17%	7.41%	0.40%	-4.00%	-0.23%
自基金合同生效起至今	3.00%	0.17%	7.45%	0.44%	-4.45%	-0.27%

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

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





注：①本基金的基金合同于2016年10月17日生效，截至2017年6月30日止，本基金成立未满1年。

②本基金的建仓期为6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同规定。截至2017年6月30日，本基金建仓期结束未满1年。

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

前海开源基金管理有限公司（以下简称“前海开源基金”）于 2012 年 12 月 27 日经中国证监会批准，2013 年 1 月 23 日注册成立，截至报告期末，注册资本为 2 亿元人民币。其中，开源证券股份有限公司、北京市中盛金期投资管理有限公司、北京长和世纪资产管理有限公司和深圳市和合投信资产管理合伙企业(有限合伙)各持股权 25%。目前，前海开源基金分别在北京、上海设立分公司，在深圳设立华南营销中心；直销中心覆盖珠三角、长三角和京津冀环渤海经济区，为公司的快速发展奠定了组织和区域基础。经中国证监会批准，前海开源基金全资控股子公司——前海开源资产管理有限公司（以下简称“前海开源资管”）已于 2013 年 9 月 5 日在深圳市注册成立，并于 2013 年 9 月 18 日取得中国证监会核发的《特定客户资产管理业务资格证书》，截至报告期末，注册资本为 1.8 亿元人民币。截至报告期末，前海开源基金旗下管理 58 只开放式基金，资产管理规模超过 620 亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吴国清	本基金的基金经理	2016 年 10 月 17 日	-	9 年	吴国清先生，清华大学博士研究生。历任南方基金管理有限公司研究员、基金经理助理、投资经理。2015 年 8 月加入前海开源基金管理有限公司。

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

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量没有超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年 A 股市场走出了近似正弦波的走势，年初开始我们主要以持有大盘价值股为主。4 月底由于金融监管密集，市场出现大幅回调，我们基于对后续市场走势的乐观判断，在 5 月初对持仓组合进行了一定调整，将前期主要集中于大盘股的持仓调整为大盘股和中小盘股比例相对均衡的结构。基于历史经验，市场在明显的上升趋势阶段，中小盘股一般更具弹性。从 5 月下旬市场触底反弹以来，沪深 300 代表的大盘股和中证 500 代表的中小盘股表现基本相当。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内，A 类基金份额净值增长率为 3.51%，同期业绩比较基准收益率为 7.41%；

C 类基金份额净值增长率为 3.41%，同期业绩比较基准收益率为 7.41%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为下半年股市震荡走高概率较大，经济基本面全球各大经济体复苏明显，出现黑天鹅事件概率很低。政策层面在十九大召开前，不会有激进的利空政策出台。情绪方面稳步上涨的态势产生赚钱效应后，股市对资金的吸引力将强化。目前股市虽有一定反弹，但估值与历史高点相比仍显著处于底部区域。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

本基金本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内，未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，交通银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内，本基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	71,175,838.05	40,868,924.78
结算备付金		1,113,817.40	3,459,207.63
存出保证金		57,981.95	27,610.82
交易性金融资产	6.4.7.2	564,970,098.28	241,609,727.00
其中：股票投资		141,444,923.05	90,747,623.43
基金投资		-	-
债券投资		319,116,791.10	96,206,299.20
资产支持证券投资		104,408,384.13	54,655,804.37
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	46,000,509.00
应收证券清算款		217,463.89	-
应收利息	6.4.7.5	7,476,295.97	2,190,729.62
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		645,011,495.54	334,156,708.85
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日

负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		54,700,000.00	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	1,987.61
应付管理人报酬		282,727.22	413,558.36
应付托管费		47,121.24	68,926.42
应付销售服务费		5,905.07	13.00
应付交易费用	6.4.7.7	229,826.66	80,636.04
应交税费		-	-
应付利息		15,227.31	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	188,560.90	55,000.00
负债合计		55,469,368.40	620,121.43
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	572,082,326.64	334,857,276.13
未分配利润	6.4.7.10	17,459,800.50	-1,320,688.71
所有者权益合计		589,542,127.14	333,536,587.42
负债和所有者权益总计		645,011,495.54	334,156,708.85

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，前海开源沪港深核心资源混合 A 基金份额净值 1.031 元，基金份额总额 491,386,639.44 份，前海开源沪港深核心资源混合 C 基金份额净值 1.030 元，基金份额总额 80,695,687.20 份。

6.2 利润表

会计主体：前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		18,074,487.13
1.利息收入		9,097,899.18
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,081,358.46
债券利息收入		5,968,722.34
资产支持证券利息收入		1,436,414.09
买入返售金融资产收入		611,404.29
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		3,761,159.62
其中：股票投资收益	6.4.7.12	2,702,376.76
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	44,917.17
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	41,843.52
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	972,022.17
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	4,915,578.53
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	299,849.80
减：二、费用		3,205,168.19
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,651,548.35
2. 托管费	6.4.10.2.2	275,258.08
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	22,804.99

4. 交易费用	6.4.7.19	473,936.99
5. 利息支出		572,071.72
其中：卖出回购金融资产支出		572,071.72
6. 其他费用	6.4.7.20	209,548.06
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		14,869,318.94
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		14,869,318.94

注：本基金的基金合同于 2016 年 10 月 17 日生效，无上年度可比期间数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	334,857,276.13	-1,320,688.71	333,536,587.42
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	14,869,318.94	14,869,318.94
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）	237,225,050.51	3,911,170.27	241,136,220.78

其中：1.基金申购款	336,432,288.43	5,478,868.80	341,911,157.23
2.基金赎回款	-99,207,237.92	-1,567,698.53	-100,774,936.45
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）	572,082,326.64	17,459,800.50	589,542,127.14

注：本基金的基金合同于 2016 年 10 月 17 日生效，无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

 蔡颖 何璁 任福利
 基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期未发生会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》，财政部、国家税务总局、证监会财税[2014]81 号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、

财税[2016]127 号《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2015 年 9 月 8 日起，对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

(5) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基金通过港股通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2017 年 6 月 30 日
活期存款	1,175,838.05
定期存款	70,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	20,000,000.00
存款期限 3 个月以上	50,000,000.00
其他存款	-
合计：	71,175,838.05

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	136,988,618.02	141,444,923.05	4,456,305.03	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	191,134,216.74	189,223,791.10	-1,910,425.64
	银行间市场	129,504,006.15	129,893,000.00	388,993.85
	合计	320,638,222.89	319,116,791.10	-1,521,431.79
资产支持证券	104,408,384.13	104,408,384.13	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	562,035,225.04	564,970,098.28	2,934,873.24	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应收活期存款利息	476.19
应收定期存款利息	409,139.13
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	451.08
应收债券利息	5,432,649.35
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	1,633,580.22
合计	7,476,295.97

注：“其他”为应收结算保证金利息和应收资产支持证券利息。

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	228,539.36
银行间市场应付交易费用	1,287.30

合计	229,826.66
----	------------

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	188,560.90
合计	188,560.90

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

前海开源沪港深核心资源混合 A		
项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	334,707,195.07	334,707,195.07
本期申购	215,751,232.14	215,751,232.14
本期赎回(以“-”号填列)	-59,071,787.77	-59,071,787.77
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	491,386,639.44	491,386,639.44

金额单位：人民币元

前海开源沪港深核心资源混合 C

项目	本期	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	150,081.06	150,081.06
本期申购	120,681,056.29	120,681,056.29
本期赎回(以“-”号填列)	-40,135,450.15	-40,135,450.15
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	80,695,687.20	80,695,687.20

注：申购含红利再投、转换入份（金）额；赎回含转换出份（金）额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

前海开源沪港深核心资源混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	737,892.01	-2,058,006.27	-1,320,114.26
本期利润	9,135,280.22	5,076,260.57	14,211,540.79
本期基金份额交易产生的变动数	1,120,663.23	1,031,215.54	2,151,878.77
其中：基金申购款	1,615,480.47	1,422,198.87	3,037,679.34
基金赎回款	-494,817.24	-390,983.33	-885,800.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,993,835.46	4,049,469.84	15,043,305.30

单位：人民币元

前海开源沪港深核心资源混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	349.10	-923.55	-574.45

本期利润	818,460.19	-160,682.04	657,778.15
本期基金份额交易产生的变动数	933,116.98	826,174.52	1,759,291.50
其中：基金申购款	1,641,155.55	800,033.91	2,441,189.46
基金赎回款	-708,038.57	26,140.61	-681,897.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,751,926.27	664,568.93	2,416,495.20

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	55,944.68
定期存款利息收入	1,002,144.68
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	9,770.54
其他	13,498.56
合计	1,081,358.46

注：“其他”为申购款利息收入及结算保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	165,286,582.89
减：卖出股票成本总额	162,584,206.13
买卖股票差价收入	2,702,376.76

6.4.7.13 债券投资收益**6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	44,917.17
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	44,917.17

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	69,032,785.76
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	67,658,153.54
减：应收利息总额	1,329,715.05
买卖债券差价收入	44,917.17

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	21,024,577.71
减：卖出资产支持证券成本总额	20,745,968.49
减：应收利息总额	236,765.70
资产支持证券投资收益	41,843.52

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属赎回差价收入。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属申购差价收入。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无其他衍生工具投资收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	972,022.17
基金投资产生的股利收益	-

合计	972,022.17
----	------------

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
1. 交易性金融资产	4,915,578.53
——股票投资	5,045,449.94
——债券投资	-129,871.41
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	4,915,578.53

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	299,830.42
基金转换费收入	19.38
合计	299,849.80

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	471,424.49
银行间市场交易费用	2,512.50
合计	473,936.99

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	148,765.71
律师费	15,000.00
汇划费	8,587.16
债券托管账户维护费	12,400.00
合计	209,548.06

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

6.4.8.2 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。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
-------	---------

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

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行交易，无佣金产生。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30
----	------------------------	--------------------------------

	月 30 日	日
当期发生的基金应支付的管理费	1,651,548.35	-
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：本基金的管理费按前一日资产净值的 0.60% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

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前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

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

本基金于 2017 年 1 月 19 日发布《前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，自 2017 年 1 月 19 日起，本基金的管理费年费率由 1.50% 调整为 0.60%。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	275,258.08

注：本基金的托管费按前一日资产净值的 0.10% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托

管费划款指令,基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

本基金于 2017 年 1 月 19 日发布《前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》,自 2017 年 1 月 19 日起,本基金的托管费年费率由 0.25%调整为 0.10%。

6.4.10.2.3 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 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	前海开源沪港深核心资源混合 A	前海开源沪港深核心资源混合 C	合计
前海开源基金管理有限公司	0.00	22,761.53	22,761.53
合计	0.00	22,761.53	22,761.53

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

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

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内与关联方无银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期	
	2017年1月1日至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	1,175,838.05	55,944.68

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。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2017年6月30日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券	证券	成功	可流	流通受	认购	期末估	数量	期末	期末估值	备注

代码	名称	认购日	通日	限类型	价格	值单价	(单位:股)	成本总额	总额	
603933	睿能科技	2017年6月28日	2017年7月6日	新股流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-
603305	旭升股份	2017年6月30日	2017年7月10日	新股流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
300670	大烨智能	2017年6月26日	2017年7月3日	新股流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
300672	国科微	2017年6月30日	2017年7月12日	新股流通受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-
603331	百达精工	2017年6月27日	2017年7月5日	新股流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
300671	富满电子	2017年6月27日	2017年7月5日	新股流通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
603617	君禾股份	2017年6月23日	2017年7月3日	新股流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌	期末估值单	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
------	------	------	----	-------	------	--------	-------	--------	--------	----

			原	价						
			因							
601088	中国 神华	2017 年6 月5 日	重 大 事 项	22.29	-	-	22,300	443,755.00	497,067.00	-
002399	海普 瑞	2017 年4 月28 日	重 大 事 项	20.23	-	-	23,800	479,855.03	481,474.00	-
600289	亿阳 信通	2017 年5 月10 日	重 大 事 项	10.94	2017 年8 月18 日	12.03	31,500	366,886.00	344,610.00	-
600795	国电 电力	2017 年6 月5 日	重 大 资 产 重 组	3.60	-	-	87,500	297,589.33	315,000.00	-
601608	中信 重工	2017 年4 月19 日	重 大 事 项	5.54	2017 年7 月26 日	5.26	55,500	310,519.01	307,470.00	-
000061	农 产 品	2017 年6 月28 日	重 大 资 产 出	9.06	-	-	22,200	196,553.33	201,132.00	-

			售							
600468	百利电气	2017年5月16日	重大资产重组	6.50	-	-	28,950	233,553.55	188,175.00	-
300201	海伦哲	2017年2月6日	重大资产重组	8.69	-	-	21,100	172,576.38	183,359.00	-
002013	中航机电	2017年5月12日	重大事项	10.24	2017年8月2日	11.36	15,750	185,640.00	161,280.00	-
002128	露天煤业	2017年3月17日	重大资产重组	8.70	2017年8月14日	9.57	17,700	162,324.05	153,990.00	-
601989	中国重工	2017年5月31日	重大资产重组	6.46	-	-	23,700	151,882.87	153,102.00	-

002252	上海莱士	2017年4月21日	重大事项	20.24	-	-	7,400	160,179.04	149,776.00	-
300085	银之杰	2017年6月30日	非公开发行股票	18.50	2017年7月7日	18.88	7,800	139,144.00	144,300.00	-
002426	胜利精密	2017年1月16日	重大事项	8.06	-	-	15,600	150,148.61	125,736.00	-
002505	大康农业	2017年3月13日	重大资产重组	3.01	-	-	35,300	125,136.52	106,253.00	-
600959	江苏有线	2017年6月19日	重大资产重组	10.57	-	-	7,500	79,252.30	79,275.00	-
000301	东方市场	2017年3	重大	5.05	-	-	12,700	65,941.08	64,135.00	-

		月 13 日	资 产 重 组							
000099	中信 海直	2017 年 5 月 4 日	重 大 资 产 重 组	11.26	-	-	5,600	65,128.00	63,056.00	-
300267	尔康 制药	2017 年 5 月 10 日	重 大 事 项	11.46	-	-	3,500	48,182.56	40,110.00	-
600609	金杯 汽车	2017 年 3 月 20 日	重 大 资 产 重 组	8.08	-	-	4,900	37,338.00	39,592.00	-
601919	中远 海控	2017 年 5 月 17 日	重 大 资 产 重 组	5.35	2017 年 7 月 26 日	5.89	5,800	30,444.00	31,030.00	-
601872	招商 轮船	2017 年 5 月 2	重 大 事 项	5.16	-	-	5,300	28,188.30	27,348.00	-

		日	项							
600460	士兰 微	2017 年 5 月 12 日	重 大 资 产 重 组	6.07	2017 年 8 月 15 日	6.68	3,600	22,607.00	21,852.00	-
002358	森源 电气	2017 年 5 月 12 日	重 大 资 产 重 组	17.02	2017 年 7 月 12 日	16.68	800	13,889.00	13,616.00	-

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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

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

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以监察及风险控制委员会、督察长、风险控制委员会、监察稽核部、金融工程部和相关业务部门构成的多层级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立监察及风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；本基金的基金管理人设立督察长制度，积极对公司各项制度、业务的合法合规性及内部控制制度的执行情况进行监察、稽核，定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况；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。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款由基金托管人保管，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级，通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，且通过分散化投资以分散信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
A-1	30,024,000.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	70,216,000.00	9,940,000.00
合计	100,240,000.00	9,940,000.00

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

6.4.13.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
AAA	0.00	853,699.20
AAA 以下	160,727,000.00	69,467,000.00
未评级	58,149,791.10	15,945,600.00
合计	218,876,791.10	86,266,299.20

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

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大部分证券在证券交易所或银行间同业市场交易，除在“期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制的情况外，其余均能及时变现。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	71,175,838.05	-	-	-	71,175,838.05
结算备付金	1,113,817.40	-	-	-	1,113,817.40
存出保证金	57,981.95	-	-	-	57,981.95
交易性金融资产	258,107,434.12	165,417,741.11	-	141,444,923.05	564,970,098.28
应收证券清算款	-	-	-	217,463.89	217,463.89
应收利息	-	-	-	7,476,295.97	7,476,295.97
资产总计	330,455,071.52	165,417,741.11	-	149,138,682.91	645,011,495.54
负债					
卖出回购金融资产款	54,700,000.00	-	-	-	54,700,000.00
应付管理人报酬	-	-	-	282,727.22	282,727.22
应付托管费	-	-	-	47,121.24	47,121.24
应付销售服务费	-	-	-	5,905.07	5,905.07

应付交易费用	-	-	-	229,826.66	229,826.66
应付利息	-	-	-	15,227.31	15,227.31
其他负债	-	-	-	188,560.90	188,560.90
负债总计	54,700,000.00	-	-	769,368.40	55,469,368.40
利率敏感度缺口	275,755,071.52	165,417,741.11	-	-148,369,314.51	589,542,127.14
上年度末 2016 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以 上	不计息	合计
资产					
银行存款	40,868,924.78	-	-	-	40,868,924.78
结算备付金	3,459,207.63	-	-	-	3,459,207.63
存出保证金	27,610.82	-	-	-	27,610.82
交易性金融资产	25,885,600.00	70,320,699.20	-	-145,403,427.80	241,609,727.00
买入返售金融资产	46,000,509.00	-	-	-	46,000,509.00
应收利息	-	-	-	2,190,729.62	2,190,729.62
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	116,241,852.23	70,320,699.20	-	-147,594,157.42	334,156,708.85
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,987.61	1,987.61
应付管理人报酬	-	-	-	413,558.36	413,558.36
应付托管费	-	-	-	68,926.42	68,926.42
应付销售服务费	-	-	-	13.00	13.00
应付交易费用	-	-	-	80,636.04	80,636.04
其他负债	-	-	-	55,000.00	55,000.00
负债总计	-	-	-	620,121.43	620,121.43
利率敏感度缺口	116,241,852.23	70,320,699.20	-	-146,974,035.99	333,536,587.42

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变
----	--------------------

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2017年6月30日）	上年度末（2016年12月31日）
	基准点利率增加 0.25%	-740,494.57	-298,889.64
	基准点利率减少 0.25%	745,831.62	300,713.13

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变化而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日		上年度末 2016年12月31日	
	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	141,444,923.05	23.99	90,747,623.43	27.21
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	141,444,923.05	23.99	90,747,623.43	27.21

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	若其他市场变量保持不变，对市场价格敏感的权益性投资的市场价格上升或下降 5%		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2017年6月 30日）	上年度末（2016年12月 31日）
	权益性投资的市场价格上升 5%	7,915,344.29	4,248,901.00
权益性投资的市场价格下降 5%	-7,915,344.29	-4,248,901.00	

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 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 137,470,551.41 元，属于第二层次的余额为 427,499,546.87 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 88,258,541.21 元，属于第二层次的余额为 153,351,185.79 元，属于第三层次的余额为 0.00 元。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2016 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	141,444,923.05	21.93
	其中：股票	141,444,923.05	21.93
2	固定收益投资	423,525,175.23	65.66
	其中：债券	319,116,791.10	49.47
	资产支持证券	104,408,384.13	16.19
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	72,289,655.45	11.21
7	其他各项资产	7,751,741.81	1.20
8	合计	645,011,495.54	100.00

注：本基金本报告期末未通过港股通机制投资港股。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	958,209.00	0.16
B	采矿业	9,250,149.00	1.57
C	制造业	63,887,662.38	10.84

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,791,816.00	0.64
E	建筑业	4,828,337.22	0.82
F	批发和零售业	5,075,244.90	0.86
G	交通运输、仓储和邮政业	3,995,078.20	0.68
H	住宿和餐饮业	94,850.00	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,303,962.09	1.07
J	金融业	29,738,074.26	5.04
K	房地产业	6,495,665.00	1.10
L	租赁和商务服务业	2,321,355.00	0.39
M	科学研究和技术服务业	148,680.00	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	1,810,868.00	0.31
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	355,712.00	0.06
R	文化、体育和娱乐业	1,484,006.00	0.25
S	综合	905,254.00	0.15
	合计	141,444,923.05	23.99

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未通过港股通机制投资港股。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000001	平安银行	245,300	2,303,367.00	0.39

2	002142	宁波银行	107,000	2,065,100.00	0.35
3	601288	农业银行	467,700	1,646,304.00	0.28
4	600036	招商银行	58,600	1,401,126.00	0.24
5	601939	建设银行	216,700	1,332,705.00	0.23
6	600028	中国石化	220,400	1,306,972.00	0.22
7	601166	兴业银行	72,800	1,227,408.00	0.21
8	600015	华夏银行	129,088	1,190,191.36	0.20
9	600000	浦发银行	93,470	1,182,395.50	0.20
10	601857	中国石油	151,900	1,168,111.00	0.20
11	601988	中国银行	315,600	1,167,720.00	0.20
12	601398	工商银行	220,900	1,159,725.00	0.20
13	601009	南京银行	102,100	1,144,541.00	0.19
14	601318	中国平安	23,000	1,141,030.00	0.19
15	601818	光大银行	280,700	1,136,835.00	0.19
16	600016	民生银行	136,800	1,124,496.00	0.19
17	600688	上海石化	164,700	1,088,667.00	0.18
18	601998	中信银行	172,000	1,081,880.00	0.18
19	600583	海油工程	169,400	1,057,056.00	0.18
20	000778	新兴铸管	153,300	1,027,110.00	0.17
21	600256	广汇能源	247,700	1,025,478.00	0.17
22	000876	新希望	121,400	997,908.00	0.17
23	000858	五粮液	17,300	962,918.00	0.16
24	002568	百润股份	57,400	953,988.00	0.16
25	601601	中国太保	28,000	948,360.00	0.16
26	601336	新华保险	16,031	823,993.40	0.14
27	000983	西山煤电	93,700	821,749.00	0.14
28	000895	双汇发展	33,800	802,750.00	0.14
29	000415	渤海金控	118,400	796,832.00	0.14

30	000027	深圳能源	117,800	792,794.00	0.13
31	002081	金螳螂	71,900	789,462.00	0.13
32	601628	中国人寿	29,000	782,420.00	0.13
33	000157	中联重科	171,900	771,831.00	0.13
34	600019	宝钢股份	109,300	733,403.00	0.12
35	000069	华侨城 A	72,200	726,332.00	0.12
36	002304	洋河股份	8,200	711,842.00	0.12
37	002310	东方园林	41,100	687,192.00	0.12
38	600221	海航控股	205,300	661,066.00	0.11
39	000402	金融街	55,900	655,148.00	0.11
40	002236	大华股份	28,700	654,647.00	0.11
41	000651	格力电器	15,800	650,486.00	0.11
42	000338	潍柴动力	48,300	637,560.00	0.11
43	000333	美的集团	14,100	606,864.00	0.10
44	002456	欧菲光	33,250	604,152.50	0.10
45	000725	京东方 A	144,300	600,288.00	0.10
46	000671	阳光城	102,800	598,296.00	0.10
47	000413	东旭光电	50,900	571,098.00	0.10
48	600022	山东钢铁	276,510	569,610.60	0.10
49	002241	歌尔股份	29,500	568,760.00	0.10
50	002008	大族激光	16,400	568,096.00	0.10
51	000568	泸州老窖	11,200	566,496.00	0.10
52	600177	雅戈尔	54,600	552,552.00	0.09
53	002475	立讯精密	18,800	549,712.00	0.09
54	000776	广发证券	31,700	546,825.00	0.09
55	000063	中兴通讯	22,600	536,524.00	0.09
56	000630	铜陵有色	186,900	530,796.00	0.09
57	000002	万科 A	21,100	526,867.00	0.09

58	600048	保利地产	51,500	513,455.00	0.09
59	000625	长安汽车	35,500	511,910.00	0.09
60	000039	中集集团	28,300	510,249.00	0.09
61	600887	伊利股份	23,100	498,729.00	0.08
62	601088	中国神华	22,300	497,067.00	0.08
63	002024	苏宁云商	44,000	495,000.00	0.08
64	600315	上海家化	15,000	486,750.00	0.08
65	002399	海普瑞	23,800	481,474.00	0.08
66	001979	招商蛇口	22,200	474,192.00	0.08
67	600176	中国巨石	42,880	470,822.40	0.08
68	002085	万丰奥威	24,140	469,523.00	0.08
69	000623	吉林敖东	20,020	458,257.80	0.08
70	002594	比亚迪	9,000	449,550.00	0.08
71	000686	东北证券	44,500	447,225.00	0.08
72	002736	国信证券	33,700	446,525.00	0.08
73	601168	西部矿业	57,700	443,713.00	0.08
74	002001	新和成	22,400	434,784.00	0.07
75	600519	贵州茅台	900	424,665.00	0.07
76	600219	南山铝业	124,300	421,377.00	0.07
77	002466	天齐锂业	7,600	413,060.00	0.07
78	000800	一汽轿车	40,400	410,868.00	0.07
79	002673	西部证券	28,800	409,536.00	0.07
80	002179	中航光电	13,050	407,029.50	0.07
81	000559	万向钱潮	38,100	404,622.00	0.07
82	000060	中金岭南	36,000	403,200.00	0.07
83	600436	片仔癀	6,600	402,864.00	0.07
84	002074	国轩高科	12,700	400,685.00	0.07
85	002202	金风科技	25,800	399,126.00	0.07

86	000049	德赛电池	7,700	398,937.00	0.07
87	002183	怡亚通	46,200	398,706.00	0.07
88	300199	翰宇药业	25,900	397,306.00	0.07
89	300115	长盈精密	13,600	396,848.00	0.07
90	600664	哈药股份	68,200	396,242.00	0.07
91	000712	锦龙股份	23,800	389,606.00	0.07
92	600585	海螺水泥	17,100	388,683.00	0.07
93	000423	东阿阿胶	5,400	388,206.00	0.07
94	000540	中天城投	55,400	385,030.00	0.07
95	000538	云南白药	4,100	384,785.00	0.07
96	300026	红日药业	81,600	384,336.00	0.07
97	002146	荣盛发展	38,900	383,943.00	0.07
98	002424	贵州百灵	20,300	382,858.00	0.06
99	000826	启迪桑德	10,900	382,808.00	0.06
100	000738	中航动控	19,500	381,615.00	0.06
101	000009	中国宝安	46,900	379,421.00	0.06
102	600161	天坛生物	9,620	373,352.20	0.06
103	600993	马应龙	17,100	372,438.00	0.06
104	000050	深天马 A	18,100	372,317.00	0.06
105	600170	上海建工	96,271	367,755.22	0.06
106	000612	焦作万方	44,900	361,445.00	0.06
107	002007	华兰生物	9,900	361,350.00	0.06
108	000718	苏宁环球	61,400	359,804.00	0.06
109	000728	国元证券	29,250	357,435.00	0.06
110	600395	盘江股份	48,600	356,238.00	0.06
111	000761	本钢板材	67,700	354,071.00	0.06
112	300147	香雪制药	34,400	353,288.00	0.06
113	300039	上海凯宝	48,550	352,958.50	0.06

114	300166	东方国信	26,239	352,389.77	0.06
115	002465	海格通信	32,800	352,272.00	0.06
116	002407	多氟多	15,900	349,641.00	0.06
117	600188	兖州煤业	28,500	348,840.00	0.06
118	601699	潞安环能	44,500	347,990.00	0.06
119	600289	亿阳信通	31,500	344,610.00	0.06
120	600487	亨通光电	11,900	333,795.00	0.06
121	600971	恒源煤电	41,000	333,330.00	0.06
122	600699	均胜电子	10,300	330,527.00	0.06
123	000792	盐湖股份	31,500	329,175.00	0.06
124	002340	格林美	54,340	328,757.00	0.06
125	300146	汤臣倍健	23,900	328,386.00	0.06
126	000555	神州信息	19,600	327,320.00	0.06
127	002405	四维图新	16,500	326,040.00	0.06
128	603589	口子窖	8,400	325,836.00	0.06
129	000970	中科三环	22,000	325,160.00	0.06
130	600366	宁波韵升	18,400	324,576.00	0.06
131	600690	青岛海尔	21,500	323,575.00	0.05
132	002415	海康威视	10,000	323,000.00	0.05
133	600809	山西汾酒	9,300	322,617.00	0.05
134	000078	海王生物	53,300	321,399.00	0.05
135	000581	威孚高科	12,400	321,160.00	0.05
136	300122	智飞生物	16,800	321,048.00	0.05
137	600594	益佰制药	20,800	317,408.00	0.05
138	000627	天茂集团	39,200	316,736.00	0.05
139	600795	国电电力	87,500	315,000.00	0.05
140	002396	星网锐捷	16,200	313,470.00	0.05
141	000825	太钢不锈	71,600	311,460.00	0.05

142	601668	中国建筑	32,100	310,728.00	0.05
143	002131	利欧股份	93,800	308,602.00	0.05
144	002588	史丹利	40,100	308,369.00	0.05
145	601186	中国铁建	25,600	307,968.00	0.05
146	002508	老板电器	7,080	307,838.40	0.05
147	601608	中信重工	55,500	307,470.00	0.05
148	000709	河钢股份	73,300	307,127.00	0.05
149	002217	合力泰	31,000	306,280.00	0.05
150	002670	华声股份	19,200	305,280.00	0.05
151	002230	科大讯飞	7,600	303,240.00	0.05
152	600060	海信电器	19,900	301,883.00	0.05
153	601390	中国中铁	34,800	301,716.00	0.05
154	600820	隧道股份	29,800	300,980.00	0.05
155	300032	金龙机电	21,400	298,530.00	0.05
156	000963	华东医药	6,000	298,200.00	0.05
157	601618	中国中冶	59,000	295,590.00	0.05
158	000066	长城电脑	32,800	295,528.00	0.05
159	300257	开山股份	13,800	290,904.00	0.05
160	000425	徐工机械	77,100	289,125.00	0.05
161	600068	葛洲坝	25,700	288,868.00	0.05
162	002491	通鼎互联	21,400	287,616.00	0.05
163	000839	中信国安	28,400	283,716.00	0.05
164	300287	飞利信	30,900	283,662.00	0.05
165	300124	汇川技术	11,100	283,494.00	0.05
166	600030	中信证券	16,600	282,532.00	0.05
167	000596	古井贡酒	5,500	280,225.00	0.05
168	600839	四川长虹	77,000	278,740.00	0.05
169	600098	广州发展	35,000	276,850.00	0.05

170	601669	中国电建	34,800	275,616.00	0.05
171	300055	万邦达	14,800	272,320.00	0.05
171	601016	节能风电	74,000	272,320.00	0.05
172	001696	宗申动力	35,900	271,763.00	0.05
173	300253	卫宁健康	34,770	271,553.70	0.05
174	300024	机器人	13,900	271,050.00	0.05
175	002572	索菲亚	6,600	270,600.00	0.05
176	600157	永泰能源	75,600	269,892.00	0.05
177	600059	古越龙山	28,900	267,325.00	0.05
178	601800	中国交建	16,600	263,774.00	0.04
179	600536	中国软件	13,600	260,576.00	0.04
180	300015	爱尔眼科	11,100	258,186.00	0.04
181	600499	科达洁能	32,200	255,668.00	0.04
182	000528	柳工	29,400	254,016.00	0.04
183	002311	海大集团	13,848	253,002.96	0.04
184	300182	捷成股份	26,300	251,428.00	0.04
185	000777	中核科技	12,500	249,500.00	0.04
186	002690	美亚光电	13,000	249,340.00	0.04
187	002065	东华软件	11,400	248,406.00	0.04
188	300002	神州泰岳	29,700	247,698.00	0.04
189	600741	华域汽车	10,200	247,248.00	0.04
190	600416	湘电股份	18,000	246,600.00	0.04
191	600056	中国医药	9,500	246,525.00	0.04
192	300070	碧水源	13,200	246,180.00	0.04
193	600770	综艺股份	32,600	244,500.00	0.04
194	600017	日照港	54,300	244,350.00	0.04
195	002672	东江环保	14,300	241,527.00	0.04
196	600053	九鼎投资	6,900	241,224.00	0.04

197	600874	创业环保	12,200	238,754.00	0.04
198	002153	石基信息	10,500	238,665.00	0.04
199	600023	浙能电力	43,400	236,964.00	0.04
200	600010	包钢股份	107,800	236,082.00	0.04
201	002242	九阳股份	12,000	236,040.00	0.04
202	000690	宝新能源	39,400	235,612.00	0.04
203	300266	兴源环境	7,600	233,472.00	0.04
204	600765	中航重机	16,900	232,882.00	0.04
205	000977	浪潮信息	13,400	232,088.00	0.04
206	300017	网宿科技	19,100	230,537.00	0.04
207	002460	赣锋锂业	4,900	226,625.00	0.04
208	600720	祁连山	28,900	226,287.00	0.04
209	600811	东方集团	34,700	226,244.00	0.04
210	002450	康得新	10,000	225,200.00	0.04
211	600881	亚泰集团	44,000	223,520.00	0.04
212	000547	航天发展	21,300	222,585.00	0.04
213	002573	清新环境	11,800	222,076.00	0.04
214	000960	锡业股份	16,300	221,843.00	0.04
215	600537	亿晶光电	44,500	221,610.00	0.04
216	600894	广日股份	18,700	221,408.00	0.04
217	002714	牧原股份	8,000	217,760.00	0.04
218	002727	一心堂	11,800	217,120.00	0.04
219	300001	特锐德	12,900	216,204.00	0.04
220	601611	中国核建	18,000	215,460.00	0.04
221	601006	大秦铁路	25,400	213,106.00	0.04
222	600418	江淮汽车	19,900	209,945.00	0.04
223	002589	瑞康医药	13,570	208,978.00	0.04
224	000750	国海证券	37,800	207,900.00	0.04

225	000008	神州高铁	28,200	205,296.00	0.03
226	600259	广晟有色	5,200	203,008.00	0.03
227	000166	申万宏源	36,100	202,160.00	0.03
228	600104	上汽集团	6,500	201,825.00	0.03
229	000061	农产品	22,200	201,132.00	0.03
230	600682	南京新百	5,400	199,260.00	0.03
231	600312	平高电气	14,500	199,230.00	0.03
232	600166	福田汽车	69,600	197,664.00	0.03
233	600029	南方航空	22,700	197,490.00	0.03
234	000768	中航飞机	10,700	197,308.00	0.03
235	601788	光大证券	13,100	195,583.00	0.03
236	600383	金地集团	17,000	194,990.00	0.03
237	601901	方正证券	19,600	194,628.00	0.03
238	600376	首开股份	17,000	194,480.00	0.03
239	600291	西水股份	8,800	193,600.00	0.03
240	000401	冀东水泥	12,500	192,375.00	0.03
241	600031	三一重工	23,600	191,868.00	0.03
242	600066	宇通客车	8,700	191,139.00	0.03
243	002174	游族网络	6,000	190,560.00	0.03
244	000783	长江证券	20,100	190,347.00	0.03
245	600717	天津港	15,200	189,848.00	0.03
246	002739	万达院线	3,700	188,589.00	0.03
247	600468	百利电气	28,950	188,175.00	0.03
248	601688	华泰证券	10,500	187,950.00	0.03
249	600660	福耀玻璃	7,200	187,488.00	0.03
250	600280	中央商场	23,500	186,355.00	0.03
251	002470	金正大	24,600	185,238.00	0.03
252	601607	上海医药	6,400	184,832.00	0.03

253	600816	安信信托	13,600	184,824.00	0.03
254	600837	海通证券	12,400	184,140.00	0.03
255	600886	国投电力	23,300	184,070.00	0.03
256	000988	华工科技	12,600	183,834.00	0.03
257	601633	长城汽车	13,800	183,402.00	0.03
258	300201	海伦哲	21,100	183,359.00	0.03
259	600089	特变电工	17,691	182,748.03	0.03
260	600999	招商证券	10,600	182,532.00	0.03
261	600517	置信电气	23,900	180,923.00	0.03
262	600362	江西铜业	10,700	180,402.00	0.03
263	600633	浙数文化	9,300	179,676.00	0.03
264	601111	中国国航	18,400	179,400.00	0.03
265	600628	新世界	15,500	179,025.00	0.03
266	002029	七匹狼	18,600	178,002.00	0.03
267	300072	三聚环保	4,800	177,840.00	0.03
268	000917	电广传媒	15,700	177,410.00	0.03
269	600755	厦门国贸	19,400	176,928.00	0.03
270	600674	川投能源	17,900	175,778.00	0.03
271	002292	奥飞娱乐	10,400	175,760.00	0.03
272	600158	中体产业	10,200	174,420.00	0.03
273	600409	三友化工	17,300	174,211.00	0.03
274	002345	潮宏基	16,000	173,920.00	0.03
275	601155	新城控股	9,300	172,422.00	0.03
276	600900	长江电力	11,200	172,256.00	0.03
277	600115	东方航空	25,200	171,360.00	0.03
278	601333	广深铁路	37,900	171,308.00	0.03
279	600606	绿地控股	21,600	168,912.00	0.03
280	600018	上港集团	26,500	168,010.00	0.03

281	600009	上海机场	4,500	167,895.00	0.03
282	601000	唐山港	32,000	167,040.00	0.03
283	600651	飞乐音响	19,500	165,165.00	0.03
284	601021	春秋航空	4,900	164,787.00	0.03
285	002152	广电运通	19,800	164,538.00	0.03
286	002271	东方雨虹	4,400	163,240.00	0.03
287	600835	上海机电	7,700	162,778.00	0.03
288	601600	中国铝业	36,000	162,720.00	0.03
289	601211	国泰君安	7,900	162,029.00	0.03
290	600153	建发股份	12,500	161,625.00	0.03
291	600208	新湖中宝	35,900	161,550.00	0.03
292	002013	中航机电	15,750	161,280.00	0.03
292	601866	中远海发	44,800	161,280.00	0.03
293	600648	外高桥	8,700	161,124.00	0.03
294	603993	洛阳钼业	31,800	160,908.00	0.03
295	601555	东吴证券	14,300	160,589.00	0.03
296	600739	辽宁成大	8,900	160,467.00	0.03
297	601018	宁波港	28,400	160,460.00	0.03
298	000400	许继电气	8,900	159,844.00	0.03
299	600875	东方电气	16,500	158,070.00	0.03
300	601766	中国中车	15,600	157,872.00	0.03
301	600582	天地科技	34,300	157,437.00	0.03
302	600498	烽火通信	6,179	156,637.65	0.03
303	600109	国金证券	13,200	154,704.00	0.03
304	601877	正泰电器	7,700	154,693.00	0.03
305	002128	露天煤业	17,700	153,990.00	0.03
306	600663	陆家嘴	6,500	153,660.00	0.03
307	600895	张江高科	9,100	153,608.00	0.03

308	002500	山西证券	16,000	153,280.00	0.03
309	600563	法拉电子	3,100	153,171.00	0.03
310	600862	中航高科	15,800	153,102.00	0.03
310	601989	中国重工	23,700	153,102.00	0.03
311	600825	新华传媒	21,500	152,435.00	0.03
312	300144	宋城演艺	7,300	152,351.00	0.03
313	603555	贵人鸟	6,800	152,048.00	0.03
314	600058	五矿发展	12,200	151,402.00	0.03
315	600340	华夏幸福	4,500	151,110.00	0.03
316	600038	中直股份	3,300	151,041.00	0.03
317	600332	白云山	5,200	151,008.00	0.03
318	603885	吉祥航空	9,940	150,889.20	0.03
319	600085	同仁堂	4,300	150,328.00	0.03
320	600528	中铁工业	10,500	150,045.00	0.03
321	600518	康美药业	6,900	150,006.00	0.03
322	002252	上海莱士	7,400	149,776.00	0.03
323	601099	太平洋	37,100	149,142.00	0.03
324	600880	博瑞传播	22,800	148,884.00	0.03
325	600297	广汇汽车	19,760	148,792.80	0.03
326	603698	航天工程	5,900	148,680.00	0.03
327	601198	东兴证券	8,600	148,264.00	0.03
328	600183	生益科技	12,000	148,080.00	0.03
329	601958	金钼股份	20,600	147,702.00	0.03
330	600705	中航资本	26,000	146,900.00	0.02
331	601985	中国核电	18,800	146,828.00	0.02
332	600482	中国动力	5,800	146,682.00	0.02
333	600150	中国船舶	6,400	146,368.00	0.02
334	600196	复星医药	4,700	145,653.00	0.02

335	600649	城投控股	13,800	145,038.00	0.02
336	300085	银之杰	7,800	144,300.00	0.02
337	600831	广电网络	14,500	144,275.00	0.02
338	000598	兴蓉环境	25,600	143,872.00	0.02
339	600316	洪都航空	8,900	143,023.00	0.02
340	000703	恒逸石化	10,000	142,400.00	0.02
341	002223	鱼跃医疗	6,000	142,080.00	0.02
342	600021	上海电力	11,700	141,453.00	0.02
343	600704	物产中大	19,350	141,061.50	0.02
344	600867	通化东宝	7,680	140,083.20	0.02
345	600549	厦门钨业	6,500	139,685.00	0.02
346	600685	中船防务	5,100	139,638.00	0.02
347	600276	恒瑞医药	2,760	139,628.40	0.02
348	600958	东方证券	10,000	139,100.00	0.02
349	000998	隆平高科	6,300	138,726.00	0.02
350	603766	隆鑫通用	19,000	138,320.00	0.02
351	600270	外运发展	7,300	138,189.00	0.02
352	600026	中远海能	20,800	137,904.00	0.02
353	300133	华策影视	12,300	137,760.00	0.02
354	600435	北方导航	9,600	137,376.00	0.02
355	600111	北方稀土	12,100	137,093.00	0.02
356	600184	光电股份	7,300	136,948.00	0.02
357	002123	荣信股份	12,300	136,653.00	0.02
358	000572	海马汽车	26,300	135,971.00	0.02
359	002498	汉缆股份	37,000	135,420.00	0.02
360	000636	风华高科	15,800	134,458.00	0.02
361	600309	万华化学	4,680	134,035.20	0.02
362	600008	首创股份	20,300	133,574.00	0.02

363	600618	氯碱化工	12,500	133,500.00	0.02
364	002261	拓维信息	11,400	133,494.00	0.02
365	600790	轻纺城	19,600	133,476.00	0.02
366	600489	中金黄金	13,300	133,399.00	0.02
367	600827	百联股份	8,200	133,250.00	0.02
368	600535	天士力	3,200	132,928.00	0.02
369	600872	中炬高新	7,200	131,760.00	0.02
370	600187	国中水务	25,900	130,795.00	0.02
371	300058	蓝色光标	16,700	130,594.00	0.02
372	601933	永辉超市	18,400	130,272.00	0.02
373	600879	航天电子	14,800	130,092.00	0.02
374	600252	中恒集团	32,200	130,088.00	0.02
375	300113	顺网科技	4,800	129,120.00	0.02
376	600061	国投安信	8,300	129,065.00	0.02
377	600597	光明乳业	10,100	128,775.00	0.02
378	002221	东华能源	11,800	128,738.00	0.02
379	600873	梅花生物	22,700	128,709.00	0.02
380	002064	华峰氨纶	26,700	128,694.00	0.02
381	002078	太阳纸业	17,500	128,625.00	0.02
382	600893	航发动力	4,700	128,310.00	0.02
383	600783	鲁信创投	7,500	127,725.00	0.02
384	300273	和佳股份	10,500	127,680.00	0.02
385	300251	光线传媒	15,500	126,945.00	0.02
386	002392	北京利尔	21,300	126,309.00	0.02
387	002426	胜利精密	15,600	125,736.00	0.02
388	300027	华谊兄弟	15,500	125,395.00	0.02
389	000488	晨鸣纸业	9,700	125,130.00	0.02
390	600826	兰生股份	6,900	124,890.00	0.02

391	600352	浙江龙盛	13,100	124,843.00	0.02
392	601899	紫金矿业	35,900	123,137.00	0.02
393	600804	鹏博士	6,900	122,475.00	0.02
394	000786	北新建材	7,700	121,968.00	0.02
395	600195	中牧股份	6,200	120,218.00	0.02
396	600587	新华医疗	6,700	119,126.00	0.02
397	600251	冠农股份	14,800	117,956.00	0.02
398	603005	晶方科技	4,200	117,558.00	0.02
399	600584	长电科技	7,300	117,165.00	0.02
400	601718	际华集团	13,100	115,149.00	0.02
401	600687	刚泰控股	8,900	114,632.00	0.02
402	000501	鄂武商 A	6,110	112,790.60	0.02
403	000973	佛塑科技	14,600	112,712.00	0.02
404	600108	亚盛集团	26,100	112,491.00	0.02
405	000829	天音控股	10,400	112,320.00	0.02
406	601169	北京银行	12,000	110,040.00	0.02
407	600171	上海贝岭	10,800	109,836.00	0.02
408	601216	君正集团	22,400	109,536.00	0.02
409	600415	小商品城	15,100	109,324.00	0.02
410	600797	浙大网新	8,800	109,032.00	0.02
411	002344	海宁皮城	13,100	108,992.00	0.02
412	000541	佛山照明	11,900	108,409.00	0.02
413	002385	大北农	17,100	107,559.00	0.02
414	600871	石化油服	32,100	107,214.00	0.02
415	603866	桃李面包	3,000	106,740.00	0.02
416	600751	天海投资	18,700	106,403.00	0.02
417	002505	大康农业	35,300	106,253.00	0.02
418	601118	海南橡胶	18,600	105,648.00	0.02

419	600122	宏图高科	9,500	105,450.00	0.02
420	002416	爱施德	9,700	104,663.00	0.02
421	601888	中国国旅	3,400	102,476.00	0.02
422	000930	中粮生化	9,400	101,332.00	0.02
422	600848	上海临港	4,700	101,332.00	0.02
423	600271	航天信息	4,900	101,136.00	0.02
424	002701	奥瑞金	15,700	100,323.00	0.02
425	002269	美邦服饰	26,800	99,964.00	0.02
426	600639	浦东金桥	5,500	99,660.00	0.02
427	600787	中储股份	12,500	98,875.00	0.02
428	000592	平潭发展	17,900	98,808.00	0.02
428	600433	冠豪高新	17,900	98,808.00	0.02
429	600570	恒生电子	2,100	98,028.00	0.02
430	300244	迪安诊断	3,100	97,526.00	0.02
431	000089	深圳机场	10,400	97,240.00	0.02
432	600586	金晶科技	19,800	96,822.00	0.02
433	600754	锦江股份	3,500	94,850.00	0.02
434	002155	湖南黄金	9,900	94,743.00	0.02
435	600138	中青旅	4,400	92,664.00	0.02
436	000156	华数传媒	6,200	92,442.00	0.02
437	002176	江特电机	10,600	92,432.00	0.02
438	600373	中文传媒	3,900	91,689.00	0.02
439	600588	用友网络	5,300	90,736.00	0.02
440	600637	东方明珠	4,100	88,847.00	0.02
441	600037	歌华有线	6,100	88,816.00	0.02
442	600718	东软集团	5,700	88,635.00	0.02
443	000158	常山股份	5,600	88,480.00	0.02
444	002477	雏鹰农牧	19,900	88,157.00	0.01

445	601928	凤凰传媒	9,000	87,840.00	0.01
446	600064	南京高科	5,800	87,580.00	0.01
447	600759	洲际油气	14,400	87,264.00	0.01
448	600580	卧龙电气	12,700	86,614.00	0.01
449	600640	号百控股	5,100	86,190.00	0.01
450	002249	大洋电机	12,800	84,224.00	0.01
451	002707	众信旅游	6,400	84,032.00	0.01
452	000012	南玻A	9,000	83,970.00	0.01
453	603000	人民网	6,100	80,337.00	0.01
454	600737	中粮糖业	8,500	80,240.00	0.01
455	002663	普邦园林	14,600	79,278.00	0.01
456	600959	江苏有线	7,500	79,275.00	0.01
457	002342	巨力索具	7,800	78,546.00	0.01
458	600118	中国卫星	2,800	77,952.00	0.01
459	600335	国机汽车	6,500	77,740.00	0.01
460	000062	深圳华强	2,900	76,937.00	0.01
461	601233	桐昆股份	5,500	76,230.00	0.01
462	002431	棕榈股份	6,500	71,630.00	0.01
463	600125	铁龙物流	7,800	69,888.00	0.01
464	600635	大众公用	12,400	67,580.00	0.01
465	603528	多伦科技	4,500	64,665.00	0.01
466	000301	东方市场	12,700	64,135.00	0.01
467	002041	登海种业	4,800	63,600.00	0.01
468	600446	金证股份	3,600	63,288.00	0.01
469	600917	重庆燃气	6,700	63,181.00	0.01
470	000099	中信海直	5,600	63,056.00	0.01
471	000762	西藏矿业	4,400	62,348.00	0.01
472	002191	劲嘉股份	6,400	59,904.00	0.01

473	600611	大众交通	10,300	56,856.00	0.01
474	601258	庞大集团	19,600	54,880.00	0.01
475	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.01
476	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.01
477	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.01
478	300267	尔康制药	3,500	40,110.00	0.01
479	600609	金杯汽车	4,900	39,592.00	0.01
480	603042	华脉科技	1,232	35,013.44	0.01
481	600220	江苏阳光	9,500	32,585.00	0.01
482	002262	恩华药业	2,100	31,773.00	0.01
483	601919	中远海控	5,800	31,030.00	0.01
484	300472	新元科技	1,100	30,030.00	0.01
485	601872	招商轮船	5,300	27,348.00	0.00
486	002299	圣农发展	1,800	26,766.00	0.00
487	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.00
488	000938	紫光股份	400	24,448.00	0.00
489	600460	士兰微	3,600	21,852.00	0.00
490	603679	华体科技	809	21,438.50	0.00
491	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.00
492	600703	三安光电	1,000	19,700.00	0.00
493	002280	联络互动	1,800	19,584.00	0.00
494	002195	二三四五	2,600	18,590.00	0.00
495	000004	国农科技	700	17,955.00	0.00
496	002002	鸿达兴业	2,238	17,523.54	0.00
497	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.00
498	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
499	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.00
500	300059	东方财富	1,200	14,424.00	0.00

501	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.00
502	002358	森源电气	800	13,616.00	0.00
503	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.00
504	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
505	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
506	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00
507	600967	内蒙一机	100	1,363.00	0.00
508	300202	聚龙股份	9	148.68	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002142	宁波银行	5,956,181.05	1.79
2	000001	平安银行	5,862,735.00	1.76
3	002568	百润股份	1,483,844.00	0.44
4	601939	建设银行	1,447,456.69	0.43
5	601398	工商银行	1,327,004.00	0.40
6	600016	民生银行	1,299,106.00	0.39
7	601818	光大银行	1,288,538.00	0.39
8	600028	中国石化	1,284,502.00	0.39
9	601857	中国石油	1,161,439.00	0.35
10	000778	新兴铸管	1,144,922.00	0.34
11	601998	中信银行	1,134,102.00	0.34
12	600000	浦发银行	1,091,054.00	0.33
13	601009	南京银行	1,084,218.00	0.33
14	000876	新希望	1,046,401.00	0.31

15	600256	广汇能源	1,046,231.00	0.31
16	000761	本钢板材	1,036,984.00	0.31
17	600583	海油工程	1,033,843.80	0.31
18	000776	广发证券	1,030,719.00	0.31
19	600688	上海石化	1,019,660.00	0.31
20	000552	靖远煤电	980,018.93	0.29

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。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002142	宁波银行	12,581,788.39	3.77
2	000001	平安银行	11,248,751.00	3.37
3	600036	招商银行	3,310,040.90	0.99
4	601318	中国平安	3,245,959.00	0.97
5	601628	中国人寿	3,244,394.42	0.97
6	601288	农业银行	3,160,703.00	0.95
7	601988	中国银行	3,107,232.00	0.93
8	600015	华夏银行	2,974,128.00	0.89
9	601336	新华保险	2,970,262.00	0.89
10	601166	兴业银行	2,728,631.00	0.82
11	601601	中国太保	2,399,566.00	0.72
12	000776	广发证券	1,613,396.00	0.48
13	002302	西部建设	1,588,220.00	0.48
14	000783	长江证券	1,430,312.00	0.43
15	002500	山西证券	1,143,808.00	0.34

16	000166	申万宏源	1,083,531.00	0.32
17	601901	方正证券	981,495.00	0.29
18	000552	靖远煤电	931,021.00	0.28
19	600823	世茂股份	910,265.00	0.27
20	000539	粤电力A	886,521.00	0.27

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。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	208,236,055.81
卖出股票收入（成交）总额	165,286,582.89

注：买入股票成本、卖出股票收入均按照买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	28,496,791.10	4.83
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	160,727,000.00	27.26
5	企业短期融资券	100,240,000.00	17.00
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	29,653,000.00	5.03
9	其他	-	-
10	合计	319,116,791.10	54.13

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	112257	15 荣盛 02	412,960	41,296,000.00	7.00
2	112381	16 华联债	400,000	40,268,000.00	6.83
3	136350	16 海怡 02	400,000	39,728,000.00	6.74
4	011697009	16 阳煤 SCP010	200,000	20,068,000.00	3.40
5	011761021	17 海药 SCP001	200,000	20,064,000.00	3.40

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	142430	君创 A2	300,000	30,000,000.00	5.09
2	116323	万科 1A1	250,000	24,999,842.47	4.24
3	142154	国药 1 优 1	200,000	19,902,293.15	3.38
4	116418	万科 3A1	150,000	14,881,112.88	2.52
5	142382	花呗 12A1	100,000	9,934,394.52	1.69
6	131814	聚信贰 A2	100,000	4,690,741.11	0.80

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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

7.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
----	----	----

1	存出保证金	57,981.95
2	应收证券清算款	217,463.89
3	应收股利	-
4	应收利息	7,476,295.97
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,751,741.81

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持有人 户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比 例	持有份额	占总份 额比例
前 海 开 源 沪 港 深 核 心 资 源 混 合 A	25	19,655,465.58	490,819,089.11	99.88%	567,550.33	0.12%
前 海 开 源 沪 港 深 核 心 资 源 混 合 C	218	370,163.70	80,655,171.45	99.95%	40,515.75	0.05%
合计	243	2,354,248.26	571,474,260.56	99.89%	608,066.08	0.11%

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

② 户均持有的基金份额合计=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	前海开源沪港深核心资源混合 A	9.80	0.00%
	前海开源沪港深核心资源混合 C	1,199.51	0.00%
	合计	1,209.31	0.00%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

本报告期末基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部负责人、本基金基金经理未持有本开放式基金份额。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	前海开源沪港深 核心资源混合 A	前海开源沪港深 核心资源混合 C
基金合同生效日（2016 年 10 月 17 日）基金 份额总额	260,124,485.86	163,307.72
本报告期期初基金份额总额	334,707,195.07	150,081.06
本报告期基金总申购份额	215,751,232.14	120,681,056.29
减：本报告期基金总赎回份额	59,071,787.77	40,135,450.15
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-” 填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	491,386,639.44	80,695,687.20

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金管理人于 2016 年 12 月 14 日至 2017 年 1 月 16 日以通讯方式组织召开了本基金的基金份额持有人大会，会议表决通过了《关于调整前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金管理费率、托管费率和赎回费率有关事项的议案》，本基金管理人根据该议案对本基金的基金合同与托管协议进行了修改，并自 2017 年 1 月 19 日起，将本基金的管理费年费率调整为 0.60%，托管费年费率调整为 0.10%，并调整了 A 类基金份额的赎回费率。投资人敬请查阅基金管理人刊登在中国证监会指定媒介上的有关公告。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动；

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票 成交总额的比 例	佣金	占当期佣金 总量的比例	
中信证券	4	235,400,418.57	63.46%	172,149.37	63.46%	-
光大证券	2	135,569,573.41	36.54%	99,142.00	36.54%	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-

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

A：选择标准

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

B：选择流程

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

- 1、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座；
- 2、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实，投资建议是否准确；
- 3、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信证券	197,718,102.22	97.10%	724,500,000.00	69.40%	-	-
光大证券	5,903,878.04	2.90%	319,438,000.00	30.60%	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	前海开源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	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站	2017 年 1 月 3 日
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	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站	2017 年 1 月 17 日
3	前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金基金合同（2017 年 1 月修订）	基金管理人的官方网站	2017 年 1 月 19 日
4	前海开源沪港深核心资源灵	基金管理人的官方	2017 年 1 月 19 日

	活配置混合型证券投资基金 托管协议（2017 年 1 月修订）	网站	
5	前海开源沪港深核心资源灵 活配置混合型证券投资基金 基金份额持有人大会表决结 果暨决议生效的公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、基 金管理人的官方网 站	2017 年 1 月 19 日
6	前海开源沪港深核心资源灵 活配置混合型证券投资基金 2016 年第 4 季度报告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、基 金管理人的官方网 站	2017 年 1 月 20 日
7	前海开源沪港深核心资源灵 活配置混合型证券投资基金 主要投资市场节假日暂停申 购、赎回、转换及定期定额投 资业务的公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、基 金管理人的官方网 站	2017 年 1 月 23 日
8	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	中国证券报、上海证 券报、证券时报、基 金管理人的官方网 站	2017 年 2 月 23 日
9	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	中国证券报、上海证 券报、证券时报、基 金管理人的官方网 站	2017 年 2 月 24 日
10	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	中国证券报、上海证 券报、证券时报、基 金管理人的官方网 站	2017 年 3 月 23 日
11	前海开源沪港深核心资源灵 活配置混合型证券投资基金	中国证券报、上海证 券报、证券时报、基	2017 年 3 月 28 日

	主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	基金管理人的官方网站	
12	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	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站	2017 年 3 月 29 日
13	前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金 2016 年年度报告摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站	2017 年 3 月 30 日
14	前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金 2016 年年度报告	基金管理人的官方网站	2017 年 3 月 30 日
15	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	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站	2017 年 4 月 11 日
16	前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站	2017 年 4 月 12 日
17	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	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站	2017 年 4 月 17 日

	惠活动的公告		
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	中国证券报、上海证 券报、证券时报、基 金管理人的官方网 站	2017 年 4 月 19 日
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	中国证券报、上海证 券报、证券时报、基 金管理人的官方网 站	2017 年 4 月 20 日
20	前海开源沪港深核心资源灵 活配置混合型证券投资基金 2017 年第 1 季度报告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、基 金管理人的官方网 站	2017 年 4 月 21 日
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	中国证券报、上海证 券报、证券时报、基 金管理人的官方网 站	2017 年 4 月 25 日
22	前海开源沪港深核心资源灵 活配置混合型证券投资基金 主要投资市场节假日暂停申 购、赎回、转换及定期定额投 资业务的公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、基 金管理人的官方网 站	2017 年 5 月 2 日
23	前海开源基金管理有限公司 关于旗下部分基金增加蚂蚁 基金为代销机构及开通定投 和转换业务并参与其费率优 惠活动的公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、基 金管理人的官方网 站	2017 年 5 月 4 日
24	关于前海开源基金管理有限 公司旗下沪港深基金在直销	中国证券报、上海证 券报、证券时报、基	2017 年 5 月 8 日

	柜台及电子直销交易系统调整转换业务金额限制的公告	基金管理人的官方网站	
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	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站	2017年5月9日
26	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	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站	2017年5月11日
27	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	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站	2017年5月11日
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	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站	2017年5月12日
29	前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站	2017年5月23日
30	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	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站	2017年5月24日
31	前海开源基金管理有限公司	中国证券报、上海证	2017年5月25日

	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	券报、证券时报、基金管理人的官方网站	
32	前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金招募说明书(更新)摘要(2017年第1号)	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站	2017年5月31日
33	前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金招募说明书(更新)(2017年第1号)	基金管理人的官方网站	2017年5月31日
34	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	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站	2017年6月2日
35	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	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站	2017年6月13日
36	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	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站	2017年6月20日
37	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	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站	2017年6月27日

38	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	中国证券报、上海证 券报、证券时报、基 金管理人的官方网 站	2017 年 6 月 29 日
----	---	---	-----------------

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170101-20170630	324,033,100	77,525,024.53	59,000,000.00	342,558,124.53	59.88%
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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

(1) 中国证券监督管理委员会批准前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金设立的文件

(2) 《前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

(3) 《前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

(4) 《前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》

(5) 基金管理人业务资格批件和营业执照

(6) 前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

12.3 查阅方式

(1) 投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件

(2) 投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人前海开源基金管理有限公司，客户服务电话：4001-666-998（免长途话费）

(3) 投资者可访问本基金管理人公司网站，网址：www.qhkyfund.com

前海开源基金管理有限公司

2017年8月28日