

前海开源沪港深裕鑫灵活配置混合型证券投资基金 2017 年半年度报

告

2017-06-30

基金管理人：前海开源基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：2017-08-28

[目录全部展开](#) [目录全部收拢](#)

重要提示

基金简介

基金基本情况

基金产品说明

基金管理人和基金托管人

信息披露方式

其他相关资料

主要财务指标和基金净值表现

主要会计数据和财务指标

基金净值表现

基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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

管理人报告

基金管理人及基金经理情况

基金管理人及其管理基金的经验

基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

公平交易制度的执行情况

异常交易行为的专项说明

管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内基金的业绩表现

管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

托管人报告

报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

托管人对半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

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

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

信用风险
按短期信用评级列示的债券投资
按长期信用评级列示的债券投资
流动性风险
金融资产和金融负债的到期期限分析
市场风险
利率风险
利率风险敞口
利率风险的敏感性分析
外汇风险
外汇风险敞口
外汇风险的敏感性分析
其他价格风险
其他价格风险敞口
其他价格风险的敏感性分析
采用风险价值法管理风险
有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项
投资组合报告
期末基金资产组合情况
报告期末按行业分类的股票投资组合
报告期末按行业分类的股票投资组合
报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细
期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细
报告期内股票投资组合的重大变动
累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细
累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细
买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额
期末按债券品种分类的债券投资组合
期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细
期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细
报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细
报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金投资股指期货的投资政策
报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
本期国债期货投资政策
报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本期国债期货投资评价
投资组合报告附注
本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚情况的说明
基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明
期末其他各项资产构成

期末持有的处于转股期的可转换债券明细
期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
投资组合报告附注的其他文字描述部分
基金份额持有人信息
期末基金份额持有人户数及持有人结构
期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况
期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况
发起式基金发起资金持有份额情况
开放式基金份额变动
重大事件揭示
基金份额持有人大会决议
基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动
涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼
基金投资策略的改变
为基金进行审计的会计师事务所情况
管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况
基金租用证券公司交易单元的有关情况
基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况
其他重大事件
重大事件揭示
基金份额持有人大会决议
基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动
涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼
基金投资策略的改变
为基金进行审计的会计师事务所情况
管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况
基金租用证券公司交易单元的有关情况
基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况
其他重大事件
影响投资者决策的其他重要信息
报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况
影响投资者决策的其他重要信息
备查文件目录
备查文件目录
存放地点
查阅方式

重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证

复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 3 月 23 日（基金合同生效日）起至 06 月 30 日止。

基金基本情况

项目

数值

基金名称

前海开源沪港深裕鑫灵活配置混合型证券投资基金

基金简称

前海开源沪港深裕鑫

场内简称

基金主代码

004316

基金运作方式

契约型开放式

基金合同生效日

2017-03-23

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

177,377,667.24

基金合同存续期

不定期

下属 2 级基金的基金简称

前海开源沪港深裕鑫 A

前海开源沪港深裕鑫 C

下属 2 级基金的场内简称

下属 2 级基金的交易代码

004316

004317

报告期末下属 2 级基金的份额总额

74,724,906.40

102,652,760.84

基金产品说明

投资目标

本基金通过股票与债券等资产的合理配置，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

本基金的投资策略包括六个方面：

（1）大类资产配置：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。

（2）股票投资策略：本基金股票投资包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）和港股通标的股票。本基金股票投资策略主要包括股票投资策略和港股通标的股票投资策略。

（3）债券投资策略：本基金将结合对宏观经济、市场利率、债券供求等因素的综合分析，根据交易所市场与银行间市场类属资产的风险收益特征，定期对投资组合类属资产进行优化配置和调整，确定不同类属资产的最优权重。同时结合经济趋势、货币政策及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，重点选择那些流动性较好、风险水平合理、到期收益率与信用质量相对较高的债券品种。具体投资策略有收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略等积极投资策略。

（4）权证投资策略：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：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。

（6）股指期货投资策略：本基金参与股指期货投资时机和数量的决策建立在对证券市场总体行情的判断和组合风险收益分析的基础上。基金管理人将结合股票投资的总体规模，以及中国证监会的相关限定和要求，确定参与股指期货交易的投资比例。

业绩比较基准

沪深 300 指数收益率×50%+恒生指数收益率×20%+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。本基金若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等特别风险。

下属分级基金的风险收益特征

基金管理人和基金托管人

项目

基金管理人

基金托管人

名称

前海开源基金管理有限公司

交通银行股份有限公司

信息披露负责人

姓名

傅成斌

陆志俊

联系电话

0755-88601888

95559

电子邮箱

qhky@qhkyfund.com

luzj@bankcomm.com

客户服务电话

4001666998

95559

传真

0755-83181169

021-62701216

注册地址

深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址

深圳市福田区深南大道 7006 号万科富春东方大厦 2206

上海市浦东新区银城中路 188 号

邮政编码

518040

200120

法定代表人

王兆华

牛锡明

信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称

上海证券报

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(2017-03-23 至 2017-06-30)

前海开源沪港深裕鑫

前海开源沪港深裕鑫 A

前海开源沪港深裕鑫 C

本期已实现收益

494,450.62

795,523.04
本期利润
587,533.26
919,728.40
加权平均基金份额本期利润
0.0073
0.0073
本期加权平均净值利润率
-%
0.73 %
0.73 %
本期基金份额净值增长率
-%
0.74 %
0.75 %
报告期末
报告期末(2017-06-30)
前海开源沪港深裕鑫
前海开源沪港深裕鑫 A
前海开源沪港深裕鑫 C
期末可供分配利润
462,597.41
645,719.88
期末可供分配基金份额利润
0.0062
0.0063
期末基金资产净值
75,279,622.89
103,425,049.79
期末基金份额净值
1.0074
1.0075
报告期末
报告期末(2017-06-30)
前海开源沪港深裕鑫
前海开源沪港深裕鑫 A
前海开源沪港深裕鑫 C
基金份额累计净值增长率
-%
0.74 %
0.75 %

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。

④ 本基金的基金合同于 2017 年 3 月 23 日生效,截止 2017 年 6 月 30 日,本基金成立未
满 1 年。

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 A

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

0.34 %

0.02 %

2.63 %

0.41 %

-2.29 %

-0.39 %

过去三个月

0.71 %

0.01 %

3.99 %

0.40 %

-3.28 %

-0.39 %

自基金合同生效起至今

0.74 %

0.01 %

3.80 %

0.39 %

-3.06 %

-0.38 %

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 C

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

0.31 %

0.02 %

2.63 %

0.41 %

-2.32 %

-0.39 %

过去三个月

0.72 %

0.01 %

3.99 %

0.40 %

-3.27 %

-0.39 %

自基金合同生效起至今

0.75 %

0.01 %

3.80 %

0.39 %

-3.05 %

-0.38 %

注：注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×50%+恒生指数收益率×20%+中证全债指数收益率×30%。

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

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 C

注：注：①本基金的基金合同于 2017 年 3 月 23 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，截至 2017 年 6 月 30 日，本基金建仓期尚未结束。

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

王霞

本基金的基金经理、公司执行投资总监

2017-03-23

-

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。

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，鉴于国内金融监管加强导致市场风险偏好快速下降，A 股公司企业盈利增速在一季度阶段性冲高回落，美国进入加息周期后 6 月份再次加息使得国内货币政策边际放松的可能性降低，A 股市场先抑后扬，但总体仍处于下跌的态势。本基金的投资策略突出稳健，目前仍以固定收益类配置为主。

报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内，A类基金份额净值增长率为0.74%，同期业绩比较基准收益率为3.80%；C类基金份额净值增长率为0.75%，同期业绩比较基准收益率为3.80%。

管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

一季度国内经济复苏势头良好，大宗商品价格反弹，PMI指标大幅回升。二季度初，国内金融监管的加强导致市场风险偏好快速下降，叠加美国再次加息的预期，市场出现较为恐慌的下跌。为了防止恐慌情绪的过度释放，6月份央行的公开市场操作使得市场对中期末流动性的担忧趋于缓解。市场情绪又开始回升，大多数前期杀跌的周期股因基本面超预期增长而又出现强劲反弹。整个半年来看，A股市场总体呈现震荡略向上的走势。我们预计下半年市场可能继续延续震荡向上的趋势。

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或者基金资产净值低于五千万元的情形。

报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，交通银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

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。

托管人对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。

资产负债表

会计主体：前海开源沪港深裕鑫灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017-06-30

单位：人民币元

资产

本期末

2017-06-30

资产：

银行存款

680,709.65

结算备付金

1,353,274.52

存出保证金

2,022.23

交易性金融资产

168,479,083.00

其中：股票投资

-

基金投资

-

债券投资

168,479,083.00

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

9,500,000.00

应收证券清算款

501,936.99

应收利息

2,003,942.84

应收股利

-

应收申购款

7,940.45

递延所得税资产

-

其他资产

-

资产总计

182,528,909.68

负债和所有者权益

本期末

2017-06-30

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

2,500,000.00

应付证券清算款

-

应付赎回款

1,000,759.05

应付管理人报酬

229,322.44

应付托管费

38,220.42

应付销售服务费

8,914.01

应付交易费用

1,075.00

应交税费

-

应付利息

763.01

应付利润

-

递延所得税负债

-

其他负债

45,183.07

负债合计

3,824,237.00

所有者权益：

-

实收基金

177,377,667.24

未分配利润

1,327,005.44

所有者权益合计

178,704,672.68

负债和所有者权益总计

182,528,909.68

注：注：①报告截止日 2017 年 6 月 30 日，前海开源沪港深裕鑫 A 基金份额净值 1.0074 元，基金份额总额 74,724,906.40 份；前海开源沪港深裕鑫 C 基金份额净值 1.0075 元，基金份额总额 102,652,760.84 份。

②本基金合同于 2017 年 3 月 23 日生效，无上年度末可比数据。

利润表

会计主体：前海开源沪港深裕鑫灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017-03-23 至 2017-06-30

单位：人民币元

项目

本期

2017-03-23 至 2017-06-30

一、收入

2,602,475.81

1.利息收入

2,200,973.57

其中：存款利息收入

840,196.51

 债券利息收入

814,596.52

 资产支持证券利息收入

-

 买入返售金融资产收入

546,180.54

 其他利息收入

-

2.投资收益（损失以“-”填列）

-685.40

其中：股票投资收益

-

 基金投资收益

-

 债券投资收益

-685.40

 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

-

3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）

217,288.00

4.汇兑收益（损失以“-”号填列）

-
5.其他收入（损失以“-”号填列）
184,899.64
减：二、费用
1,095,214.15
1. 管理人报酬
840,286.27
2. 托管费
140,047.72
3. 销售服务费
34,220.46
4. 交易费用
1,112.91
5. 利息支出
35,132.79
其中：卖出回购金融资产支出
35,132.79
6. 其他费用
44,414.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）
1,507,261.66
减：所得税费用
-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）
1,507,261.66

注：注：本基金的基金合同于 2017 年 3 月 23 日生效，无上年度可比期间数据。

所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：前海开源沪港深裕鑫灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017-03-23 至 2017-06-30

单位：人民币元

项目

本期

2017-03-23 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）

237,133,619.16

-

237,133,619.16

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）

-

1,507,261.66

1,507,261.66

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）

-59,755,951.92

-180,256.22

-59,936,208.14

其中：1.基金申购款

10,398,548.92

20,323.31

10,418,872.23

2.基金赎回款

-70,154,500.84

-200,579.53

-70,355,080.37

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）

177,377,667.24

1,327,005.44

178,704,672.68

注：注：本基金的基金合同于 2017 年 3 月 23 日生效，无上年度可比期间数据。

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

前海开源沪港深裕鑫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】1856号文《关于准予前海开源沪港深裕鑫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》、《前海开源沪港深裕鑫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 2017 年 2 月 16 日至 2017 年 3 月 17 日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 237,046,601.36 元，经瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）瑞华验字[2017]01300010 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《前海开源沪港深裕鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 3 月 23 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 237,133,619.16 份基金份额，其中认购资金利息折合 87,017.80 份基金份额。本基金的基金管理人为前海开源基金管理有限公司，本基金托管人为交通银行股份有限公司。

会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金

金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《前海开源沪港深裕鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

重要会计政策和会计估计

-

会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系自 2017 年 3 月 23 日（基金合同生效日）起至 2017 年 6 月 30 日止。

记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。本基金目前以交易目的持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。

终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

- (1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。
- (2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。
- (3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

费用的确认和计量

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

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

基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 本基金两类基金份额在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38 号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2)对于在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21 号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

差错更正的说明

本基金本报告期未发生会计差错更正。

税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》，财政部、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。

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

活期存款

680,709.65

定期存款

-

其中：存款期限1-3个月

-

其他存款

-

合计

680,709.65

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

-

-

-

贵金属投资-金交所黄金合约

-

-

-

债券

交易所市场

12,403,795.00

12,364,083.00

-39,712.00

银行间市场

155,858,000.00

156,115,000.00

257,000.00

合计

168,261,795.00

168,479,083.00

217,288.00

资产支持证券

-

-

-

基金

-

-

-

其他

-

-

-

合计

168,261,795.00

168,479,083.00

217,288.00

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

-

-

-

-

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

买入返售证券

9,500,000.00

-

合计

9,500,000.00

-

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

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

应收活期存款利息

131.64

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

548.10

应收债券利息

1,985,284.27

应收买入返售证券利息

17,978.02

应收申购款利息

-

应收黄金合约拆借孳息

-

其他

0.81

合计

2,003,942.84

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

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

交易所市场应付交易费用

-

银行间市场应付交易费用

1,075.00

合计

1,075.00

其他负债

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

应付券商交易单元保证金

-

应付赎回费

1,169.07

预提费用

44,014.00

合计

45,183.07

实收基金

单位：人民币元

项目

本期

2017-03-23 至 2017-06-30

前海开源沪港深裕鑫 A

前海开源沪港深裕鑫 C

基金份额（份）

账面金额

基金份额（份）

账面金额

基金合同生效日

83,522,583.11

83,522,583.11

153,611,036.05

153,611,036.05

本期申购

1,904,258.41

1,904,258.41

8,494,290.51

8,494,290.51

本期赎回（以“-”号填列）

-10,701,935.12

-10,701,935.12

-59,452,565.72

-59,452,565.72

本期末

74,724,906.40

74,724,906.40

102,652,760.84

102,652,760.84

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

前海开源沪港深裕鑫 A

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

基金合同生效日

-

-

-

本期利润

494,450.62

93,082.64

587,533.26

本期基金份额交易产生的变动数

-31,853.21

-963.56

-32,816.77

其中：基金申购款

3,376.84

-11.75

3,365.09

基金赎回款

-35,230.05

-951.81

-36,181.86

本期已分配利润

-

-

-

本期末

462,597.41

92,119.08

554,716.49

前海开源沪港深裕鑫 C

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

基金合同生效日

-

-

-

本期利润

795,523.04

124,205.36

919,728.40

本期基金份额交易产生的变动数

-149,803.16

2,363.71

-147,439.45

其中：基金申购款

17,660.29

-702.07

16,958.22

基金赎回款

-167,463.45

3,065.78

-164,397.67

本期已分配利润

-

-

-

本期末

645,719.88

126,569.07

772,288.95

存款利息收入

单位：人民币元

项目

本期

2017-03-23 至 2017-06-30

活期存款利息收入

47,289.25

定期存款利息收入

788,166.67

其他存款利息收入

-

结算备付金利息收入

4,734.74

其他

5.85

合计

840,196.51

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

2017-03-23 至 2017-06-30

卖出股票成交总额

-

减：卖出股票成本总额

-

买卖股票差价收入

-

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

2017-03-23 至 2017-06-30

债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入

-685.40

债券投资收益——赎回差价收入

-

债券投资收益——申购差价收入

-

合计

-685.40

债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目

本期

2017-03-23 至 2017-06-30

卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额

12,765,363.11

减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额

12,566,705.00

减：应收利息总额

199,343.51

买卖债券差价收入

-685.40

债券投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目

本期

2017-03-23 至 2017-06-30

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

2017-03-23 至 2017-06-30

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

2017-03-23 至 2017-06-30

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

2017-03-23 至 2017-06-30

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

2017-03-23 至 2017-06-30

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
2017-03-23 至 2017-06-30
股票投资产生的股利收益
-
基金投资产生的股利收益
-
合计

公允价值变动收益
单位：人民币元

项目
本期
2017-03-23 至 2017-06-30

1.交易性金融资产
217,288.00
——股票投资
-
——债券投资
217,288.00
——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

217,288.00
其他收入
单位：人民币元

项目
本期
2017-03-23 至 2017-06-30

基金赎回费收入
184,899.64
合计

184,899.64

交易费用

单位：人民币元

项目

本期

2017-03-23 至 2017-06-30

交易所市场交易费用

37.91

银行间市场交易费用

1,075.00

合计

1,112.91

其他费用

单位：人民币元

项目

本期

2017-03-23 至 2017-06-30

审计费用

17,606.00

信息披露费

26,408.00

其他

400.00

合计

44,414.00

注：注：“其他”为证券账户开户费。

或有事项、资产负债表日后事项的说明

或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无资产负债表日后事项。

关联方关系

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

-

本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称

与本基金的关系

前海开源基金管理有限公司（“前海开源基金”）

基金管理人、注册登记机构、基金销售机构

交通银行股份有限公司（“交通银行”）

基金托管人

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

2017-03-23(基金合同生效日)至 2017-06-30

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

2017-03-23(基金合同生效日)至 2017-06-30

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

2017-03-23 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

注：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。

关联方报酬

基金管理费

单位：人民币元

项目

本期

2017-03-23 至 2017-06-30

当期发生的基金应支付的管理费

840,286.27

其中：支付销售机构的客户维护费

0.56

注：注：本基金的管理费按前一日资产净值的 1.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 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。

基金托管费

单位：人民币元

项目

本期

2017-03-23 至 2017-06-30

当期发生的基金应支付的托管费

140,047.72

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

2017-03-23 至 2017-06-30

当期发生的基金应支付的销售服务费

前海开源沪港深裕鑫 A

前海开源沪港深裕鑫 C

合计

开源证券

-

14,967.43

14,967.43

前海开源基金管理有限公司

-

1,271.63

1,271.63

合计

-

16,239.06

16,239.06

注：注：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。

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

2017-03-23 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

注：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。

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

2017-03-23 至 2017-06-30

份额级别

前海开源沪港深裕鑫 A

前海开源沪港深裕鑫 C

基金合同生效日（2017-03-23）持有的基金份额

-

-

期初持有的基金份额

-

-

期间申购/买入总份额

-

-

期间因拆分增加的份额

-

-

减：期间赎回/卖出总份额

-

-

期末持有的基金份额

-

-

期末持有的基金份额占基金总份额比例

-%

-%

注：本报告期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

关联方名称

前海开源沪港深裕鑫 A

本期末

2017-06-30

持有的基金份额

持有的基金份额占基金总份额的比例

关联方名称

前海开源沪港深裕鑫 C

本期末

2017-06-30

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

2017-03-23 至 2017-06-30

期末余额

当期利息收入

交通银行股份有限公司

680,709.65

47,289.25

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

利率计息。

本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

本期

2017-03-23 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

注：本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销证券。

其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

利润分配情况

利润分配情况——非货币市场基金前海开源沪港深裕鑫 A

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

利润分配情况——非货币市场基金前海开源沪港深裕鑫 C

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

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

注：本基金本报告期末未持有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

-

金额单位：人民币元

债券代码

债券名称

回购到期日

期末估值单价

数量（张）

期末估值总额

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

交易所市场债券正回购

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

金融工具风险及管理

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

风险管理政策和组织架构

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

信用风险

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

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

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

按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级

本期末

2017-06-30

A-1

-

A-1 以下

-

未评级

-

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

AAA

0.00

AAA 以下

0.00

未评级

168,479,083.00

合计

168,479,083.00

注：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。

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。

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

-

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

680,709.65

-

680,709.65

结算备付金

1,353,274.52

-

1,353,274.52

存出保证金

2,022.23

-

2,022.23

交易性金融资产

168,479,083.00

-

168,479,083.00

买入返售金融资产
9,500,000.00
-
9,500,000.00
应收证券清算款
-
501,936.99
501,936.99
应收利息
-
2,003,942.84
2,003,942.84
应收申购款
-
7,940.45
7,940.45
资产总计
180,015,089.40
2,513,820.28
182,528,909.68
负债
卖出回购金融资产款
2,500,000.00
-
2,500,000.00
应付赎回款
-
1,000,759.05
1,000,759.05
应付管理人报酬
-
229,322.44
229,322.44
应付托管费
-
38,220.42
38,220.42
应付销售服务费
-
8,914.01
8,914.01
应付交易费用
-
1,075.00

1,075.00
 应付利息
 -
 763.01
 763.01
 其他负债
 -
 45,183.07
 45,183.07
 负债总计
 2,500,000.00
 1,324,237.00
 3,824,237.00
 利率敏感度缺口
 177,515,089.40
 1,189,583.28
 178,704,672.68

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

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

-

-

-

-

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

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

公允价值

占基金资产净值比例（%）

交易性金融资产—股票投资

-

-

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

-

-

其他价格风险的敏感性分析

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

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

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 0.00 元，属于第二层次的余额为 168,479,083.00 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。

(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

-

-

其中：股票

-

-

2

固定收益投资

168,479,083.00

92.30

其中：债券

168,479,083.00

92.30

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

9,500,000.00

5.20

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

2,033,984.17

1.11

7

其他各项资产

2,515,842.51

1.38

8

合计

182,528,909.68

100.00

注：注：本基金本报告期末未通过港股通机制投资港股。

报告期末按行业分类的股票投资组合

报告期末按行业分类的股票投资组合

代码

行业类别

公允价值（元）

占基金资产净值比例（%）

A

农、林、牧、渔业

-

-

B

采矿业

-

-

C

制造业

-

-

D

电力、热力、燃气及水生产和供应业

-

-

E

建筑业

-

-

F

批发和零售业

-

-

G

交通运输、仓储和邮政业

-

-

H

住宿和餐饮业

-

-

I

信息传输、软件和信息技术服务业

-

-

J

金融业

-

-

K

房地产业

-

-

L

租赁和商务服务业

-

-

M

科学研究和技术服务业

-

-

N

水利、环境和公共设施管理业

-

-

O

居民服务、修理和其他服务业

-

-

P

教育

-

-

Q

卫生和社会工作

-

-

R

文化、体育和娱乐业

-

-

S

综合

-

-

合计

-

-

注：本基金本报告期末未持有境内投资的股票。
报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
行业类别

公允价值（人民币）

占基金资产净值比例（%）

A 基础材料

-

-

B 消费者非必需品

-

-

C 消费者常用品

-

-

D 能源

-

-

E 金融

-

-

F 医疗保健

-

-

G 工业

-

-

H 信息技术

-

-

I 电信服务

-

-

J 公用事业

-

-

注：本基金本报告期末未通过港股通机制投资港股。

期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号

股票代码

股票名称

数量（股）

公允价值（元）

占基金资产净值比例（%）

注：本基金本报告期末未持有股票。

报告期内股票投资组合的重大变动

累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号

股票代码

股票名称

本期累计买入金额

占期末基金资产净值比例（%）

注：本基金本报告期内未买入股票。

累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号

股票代码

股票名称

本期累计卖出金额

占期末基金资产净值比例（%）

注：本基金本报告期内未卖出股票。

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

-

卖出股票收入（成交）总额

-

注：本基金本报告期内未投资股票。

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

12,364,083.00

6.92

2

央行票据

-

-

3

金融债券

-

-

其中：政策性金融债

-

-

4

企业债券

-

-

5

企业短期融资券

-

-

6

中期票据

-

-

7

可转债（可交换债）

-

-

8

同业存单

156,115,000.00

87.36

9

其他

-

-

10

合计

168,479,083.00

94.28

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

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（元）

占基金资产净值比例（%）

1

111717112

17 光大银行 CD112

300,000

29,667,000.00

16.60

2

111798278

17 广州农村商业银行 CD099

300,000

29,325,000.00

16.41

3

111609337

16 浦发 CD337

300,000

29,070,000.00

16.27

4

111790881

17 徽商银行 CD024

300,000

28,719,000.00

16.07

5

111710258

17 兴业银行 CD258

200,000

19,776,000.00

11.07

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

2,022.23

2

应收证券清算款

501,936.99

3

应收股利

-

4

应收利息

2,003,942.84

5

应收申购款

7,940.45

6

其他应收款

-

7

待摊费用

-

8

其他

-

9

合计

2,515,842.51

期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有可转换债券。

期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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

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

前海开源沪港深裕鑫 A

1,400

53,374.93

0.00

0.00 %

74,724,906.40

100.00 %

前海开源沪港深裕鑫 C

1,734

59,199.98

46,908.31

0.05 %

102,605,852.53

99.95 %

合计

3,134

56,597.85

46,908.31

0.03 %

177,330,758.93

99.97 %

注：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。

期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

份额单位：份

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
前海开源沪港深裕鑫 A

9.90

0.0000 %

前海开源沪港深裕鑫 C

9.90

0.0000 %

合计

19.80

0.0000 %

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

份额级别

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

前海开源沪港深裕鑫 A

-

前海开源沪港深裕鑫 C

-

合计

-

本基金基金经理持有本开放式基金

前海开源沪港深裕鑫 A

-

前海开源沪港深裕鑫 C

-

合计

-

注：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。

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	
前海开源沪港深裕鑫	
前海开源沪港深裕鑫 A	
前海开源沪港深裕鑫 C	
基金合同生效日（2017-03-23）的基金份额总额	
-	
83,522,583.11	
153,611,036.05	
本报告期期初基金份额总额	
-	
-	

-
本报告期期间基金总申购份额

-
1,904,258.41
8,494,290.51

减：本报告期期间基金总赎回份额

-
10,701,935.12
59,452,565.72

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

177,377,667.24
74,724,906.40
102,652,760.84

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

-
-%
-
-%
-
-%
-
-%
-
-%
-
-%
-

注：注：(1)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。

(2)本基金本报告期租用证券公司交易单元未进行股票投资，无佣金产生。 -

其他重大事件

序号

公告事项

法定披露方式

法定披露日期

1

前海开源沪港深裕鑫灵活配置混合型证券投资基金招募说明书
上海证券报、基金管理人的官方网站

2017-02-13

2

前海开源沪港深裕鑫灵活配置混合型证券投资基金托管协议
基金管理人的官方网站

2017-02-13

3

前海开源沪港深裕鑫灵活配置混合型证券投资基金基金份额发售公告
上海证券报、基金管理人的官方网站

2017-02-13

4

前海开源沪港深裕鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同内容摘要
上海证券报、基金管理人的官方网站

2017-02-13

5

前海开源沪港深裕鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同
基金管理人的官方网站

2017-02-13

6

关于前海开源沪港深裕鑫灵活配置混合型证券投资基金增加部分代销机构的公告
上海证券报、基金管理人的官方网站

2017-02-20

7

关于前海开源沪港深裕鑫灵活配置混合型证券投资基金增加部分代销机构的公告
上海证券报、基金管理人的官方网站

2017-02-22

8

关于前海开源沪港深裕鑫灵活配置混合型证券投资基金增加开源证券为代销机构的公告
上海证券报、基金管理人的官方网站

2017-02-24

9

前海开源沪港深裕鑫灵活配置混合型证券投资基金提前结束募集的公告
上海证券报、基金管理人的官方网站

2017-03-18

10

前海开源沪港深裕鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同生效公告
上海证券报、基金管理人的官方网站

2017-03-24

11

前海开源沪港深裕鑫灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定投业务的公告
上海证券报、基金管理人的官方网站

上海证券报、基金管理人的官方网站

2017-04-05

12

关于前海开源沪港深裕鑫灵活配置混合型证券投资基金参与部分代销机构费率优惠活动的公告
上海证券报、基金管理人的官方网站

上海证券报、基金管理人的官方网站

2017-04-06

13

前海开源沪港深裕鑫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
上海证券报、基金管理人的官方网站
2017-04-12

14

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
上海证券报、基金管理人的官方网站
2017-04-17

15

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
上海证券报、基金管理人的官方网站
2017-04-19

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
上海证券报、基金管理人的官方网站
2017-04-20

17

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
上海证券报、基金管理人的官方网站
2017-04-25

18

前海开源沪港深裕鑫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
上海证券报、基金管理人的官方网站
2017-05-02

19

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
上海证券报、基金管理人的官方网站
2017-05-04

20

关于前海开源基金管理有限公司旗下沪港深基金在直销柜台及电子直销交易系统调整转换业务金额限制的公告
上海证券报、基金管理人的官方网站
2017-05-08

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
上海证券报、基金管理人的官方网站
2017-05-09

22

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
上海证券报、基金管理人的官方网站
2017-05-11

23

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
上海证券报、基金管理人的官方网站

2017-05-11

24

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
上海证券报、基金管理人的官方网站

2017-05-12

25

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

2017-05-15

26

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
上海证券报、基金管理人的官方网站

2017-05-18

27

前海开源沪港深裕鑫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
上海证券报、基金管理人的官方网站

2017-05-23

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
上海证券报、基金管理人的官方网站

2017-05-24

29

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
上海证券报、基金管理人的官方网站

2017-05-25

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
上海证券报、基金管理人的官方网站

2017-06-02

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
上海证券报、基金管理人的官方网站

2017-06-13

32

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

2017-06-20

33

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

上海证券报、基金管理人的官方网站

2017-06-27

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

上海证券报、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

-

-

-

-

-

-

-

个人

-

-

-

-

-

-

-

产品特有风险

-

注：无。

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港深裕鑫灵活配置混合型证券投资基金设立的文件

- (2) 《前海开源沪港深裕鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- (3) 《前海开源沪港深裕鑫灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- (4) 《前海开源沪港深裕鑫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) 前海开源沪港深裕鑫灵活配置混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

存放地点

基金管理人、基金托管人处

查阅方式

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