

前海开源一带一路主题精选灵活配置混合型证券投资基金

招募说明书（更新）摘要

基金管理人：前海开源基金管理有限公司

基金托管人：中国银河证券股份有限公司

截止日：2017年10月29日

重要提示

本基金经2015年3月25日中国证券监督管理委员会下发的证监许可[2015]426号文注册募集，基金合同已于2015年4月29日正式生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资人在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括但不限于：市场风险、信用风险、管理风险、流动性风险、操作和技术风险、合规性风险、股指期货投资风险、本基金特有的风险、其他风险及本法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险等。

基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金表现的保证。基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金管理人提醒投资人基金投资的买者自负原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行承担。投资有风险，投资人在投资本基金前应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。

本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为2017年10月29日，有关财务数据和净值表现截止日2017年9月30日（未经审计）。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

- 1、名称：前海开源基金管理有限公司
- 2、住所：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）
- 3、成立日期：2013年1月23日
- 4、法定代表人：王兆华
- 5、批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可[2012]1751号
- 6、组织形式：有限责任公司
- 7、办公地址：深圳市福田区深南大道7006号万科富春东方大厦22楼

8、电话：0755-88601888 传真：0755-83181169

9、联系人：傅成斌

10、注册资本：人民币 2 亿元

11、存续期限：持续经营

12、股权结构：开源证券股份有限公司出资 1/4，北京市中盛金期投资管理有限公司出资 1/4，北京长和世纪资产管理有限公司出资 1/4，深圳市和合投信资产管理合伙企业（有限合伙）出资 1/4。

（二）主要人员情况

1、基金管理人董事会成员

王兆华先生，董事长，本科学历，国籍：中国。历任中国人民银行西安市分行职员，中国工商银行西安市开发区支行副行长、分行信贷处处长，华夏证券西安营业部总经理、华夏证券济南管理总部党委书记兼总经理、华夏证券总裁助理兼重庆分公司党委书记、总经理，华夏证券总裁助理，开源证券董事长、总经理，现任开源证券董事、前海开源基金管理有限公司董事长。

龚方雄先生，荣誉董事长，宾夕法尼亚大学沃顿学院金融经济学博士。国籍：中国香港。曾任纽约联储储备银行经济学家，美国银行首席策略师、全球货币及利率市场策略部联席主管，摩根大通中国区研究部主管、首席市场策略师、首席大中华区经济学家、中国综合公司（企业）投融资主席。2009年9月起担任摩根大通亚太区董事总经理、中国投资银行主席。现任前海开源基金管理有限公司荣誉董事长。

王宏远先生，联席董事长，西安交通大学经济学硕士，美国哥伦比亚大学公共管理硕士，国籍：中国。曾任深圳特区证券有限公司行业研究员，南方基金管理有限公司投资总监、副总经理，中信证券股份有限公司首席投资官、自营负责人，现任前海开源基金管理有限公司联席董事长。

朱永强先生，执行董事长，硕士研究生，国籍：中国。历任华泰证券股份有限公司电脑工程部总经理、技术总监，网上交易部总经理；北京世纪飞虎信息技术有限公司副总裁；华泰联合证券有限责任公司总裁助理、副总裁；中信证券股份有限公司经纪业务发展管理委员会董事总经理；中国银河证券股份有限公司经纪业务线业务总监，兼任经纪管理总部总经理，现任前海开源基金管理有限公司执行董事长。

蔡颖女士，董事、公司总经理，硕士研究生，国籍：中国。历任南方证券广州分公司营业部电脑部主管、经纪业务部主管、电子商务部副经理，南方基金管理有限公司广州代表处首席代表、南方区域总部高级经理，鹏华基金管理有限公司华南营销中心（广州）副总经理、广州分公司总经理，现任前海开源基金管理有限公司董事、公司总经理，前海开源资产管理有限公司董事长。

周芊先生，董事，北京大学 DBA，国籍：中国。曾任中信证券股份有限公司董事总经理、中信证券产品委员会委员、中信金石不动产基金管理有限公司经理，信保股权投资基金董事、全国工商联商业地产专家委员会委员、中房协养老地产专委会副主任委员。现任北京中联国新基金管理有限公司董事长，前海开源基金管理有限公司董事。

范镛先生，董事，本科学历，国籍：中国。曾任职中国建设银行武汉分行、华安保险北京分公司、交通银行天津分行、北京长和世纪资产管理有限公司投资总监。

向松祚先生，独立董事，教授，高级经济师，国籍：中国。著名经济学家、国际金融战略专家，中国人民大学博士，美国哥伦比亚大学国际关系学院国际事务硕士，英国剑桥大学经济系和嘉丁管理学院访问学者。现任中国人民大学财政金融学院教授、国际货币研究所理事兼副所长、美国约翰霍普金斯大学应用经济研究所高级顾问、国际货币金融机构官方论坛（OMFIF）顾问委员会副主席、世界经济论坛

（WorldEconomicForum）国际货币体系改革分论坛咨询顾问，曾任中国农业银行首席经济学家。

申嫦娥女士，独立董事，博士，教授，博士生导师，中国注册会计师（非执业会员），国家税务总局特邀监察员（2003-2010），国籍：中国。历任西安交通大学助教、讲师、副教授，北京师范大学副教授、教授。

MrShujieYao（姚树洁先生），独立董事，教授，国籍：英国。英国诺丁汉大学当代中国学院院长、教授，西安交通大学特聘讲座教授、重庆大学、华南师范大学、华南农业大学、华中农业大学、渭南师范学院等大学特聘教授、海南大学经济管理学院荣誉院长；英国皇家经济学会会员、英国中国经济协会会员、

美国比较经济学协会会员、美国经济协会会员；全英专业团体联合会副主席；《经济研究》、《西安交通大学学报社科版》、《当代中国》（英文）等科学杂志的编委。曾任华南热带农业大学助理教授，英国牛津大学研究员，英国朴茨茅斯大学教授、主任，英国伦敦米德尔塞克斯大学教授、系主任。

周新生先生，独立董事，管理学博士学位，经济学教授。国籍：中国。历任陕西财经学院助教、讲师、副教授、教授、工业经济系副主任、研究生部主任、MBA 中心主任、院长助理；曾任陕西省审计厅副厅长、任长安银行监事长；2007 年 7 月至今任民建陕西省委员会副主委。曾任第十二届全国政协委员，中国工业经济学会副会长，中共陕西省委政策研究室特聘研究员。

2、基金管理人监事会成员

骆新都女士，监事会主席，经济学硕士，经济师，国籍：中国。曾任民政部外事处处长、南方证券有限公司副总裁、南方基金管理有限公司董事长、监事会主席。现任前海开源基金管理有限公司监事会主席。

李匆先生，联席监事会主席，上海交通大学工商管理博士，美国哥伦比亚大学公共管理硕士，中国注册会计师，国籍：中国香港。曾任职华银国际信托投资公司上海证券营业部、华安基金管理有限公司基金经理、香港亨茂投资集团基金经理、韩国未来资产环球投资(香港)有限公司高级基金经理、中国股票投资部主管、公司首席投资官兼亚太区投资部主管、公司投资委员会主席。现任香港泽源资本创始人、投资总监及前海开源基金管理有限公司联席监事会主席。

孔令国先生，监事，美国密苏里大学圣路易斯分校 MBA，国籍：中国。曾任职深圳市公安局罗湖分局、中信证券股份有限公司研究部、前海开源基金管理有限公司专户投资部，现任江苏联发股份有限公司董事及前海开源基金管理有限公司监事。

任福利先生，监事，大学本科学历，国籍：中国。曾任职中国建设银行辽宁省分行、泰达宏利基金管理有限公司基金运营部、方正富邦基金管理有限公司基金运营部，现任前海开源基金管理有限公司基金事务部总监。

刘彤女士，监事，硕士研究生，国籍：中国。曾任职汉唐证券有限责任公司人力资源经理、海王生物股份有限公司人事行政经理、顺丰速运集团员工关系总监、英大证券有限责任公司人力资源部主管及银泰证券有限责任公司人力运营总监、总裁助理，现任前海开源基金管理有限公司人力资源部执行总监。

3、高级管理人员情况

王兆华先生，董事长，本科学历，国籍：中国。历任中国人民银行西安市分行职员，中国工商银行西安市开发区支行副行长、分行信贷处处长，华夏证券西安营业部总经理、华夏证券济南管理总部党委书记兼总经理、华夏证券总裁助理兼重庆分公司党委书记、总经理，华夏证券总裁助理，开源证券董事长、总经理，现任开源证券董事、前海开源基金管理有限公司董事长。

蔡颖女士，董事、公司总经理，硕士研究生，国籍：中国。历任南方证券广州分公司营业部电脑部主管、经纪业务部主管、电子商务部副经理，南方基金管理有限公司广州代表处首席代表、南方区域总部高级经理，鹏华基金管理有限公司华南营销中心（广州）副总经理、广州分公司总经理，现任前海开源基金管理有限公司董事、公司总经理，前海开源资产管理有限公司董事长。

傅成斌先生，督察长，硕士研究生，国籍：中国。历任中国建设银行深圳分行科技部软件开发工程师，南方基金管理有限公司信息技术部总监助理、监察稽核部副总监、执行总监。现任前海开源基金管理有限公司督察长、前海开源资产管理有限公司董事。

4、本基金基金经理

薛小波先生，流体力学硕士，国籍：中国。历任中信证券机械行业和军工行业首席分析师、高级副总裁。现任前海开源基金管理有限公司执行投资总监、前海开源中证军工指数型证券投资基金基金经理、前海开源大安全核心精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、前海开源高端装备制造灵活配置混合型证券投资基金基金经理、前海开源工业革命 4.0 灵活配置混合型证券投资基金基金经理、前海开源中航军工指数分级证券投资基金基金经理、前海开源一带一路主题精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、前海开源润和 6 个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理。薛小波先生具备基金从业资格。

徐立平先生，工商管理硕士，国籍：中国。历任泰信基金管理有限公司行业研究员，中邮创业基金管理有

限公司研究员、基金经理助理。现任前海开源基金管理有限公司执行投资总监、前海开源中国成长灵活配置混合型证券投资基金基金经理、前海开源一带一路主题精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、前海开源沪港深新硬件主题灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。徐立平先生具备基金从业资格。

5、投资决策委员会成员情况

投资决策委员会主席王厚琼，联席投资总监兼研究部行政负责人赵雪芹，联席投资总监侯燕琳、刘静、丁骏、曲扬、邱杰、史程，首席经济学家杨德龙，执行投资总监徐立平、薛小波、王霞、谢屹。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基金托管人情况

名称：中国银河证券股份有限公司（以下简称银河证券）

注册地址：中国北京西城区金融大街 35 号 2-6 层

法定代表人：陈共炎

成立日期：2007 年 1 月 26 日

批准设立机关和批准设立文号：证监会、证监机构字[2007]25 号

注册资本：101.37 亿元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：证监许可【2014】629 号

联系人：李蔚

联系电话：95551

中国银河证券股份有限公司是中国证券行业领先的综合性金融服务提供商，提供经纪、销售和交易、投资银行等综合证券服务。2007 年 1 月 26 日，公司经中国证监会批准，由中国银河金融控股有限责任公司作为主发起人，联合 4 家国内机构投资者共同发起正式成立。中央汇金投资有限责任公司为公司实际控制人。公司本部设在北京，注册资本为人民币 101.37 亿元。公司于 2013 年 5 月 22 日在香港联合交易所上市，控股股东为中国银河金融控股有限责任公司。

（二）主要人员情况

银河证券托管部管理团队具有十年以上银行、公募基金、证券清算等金融从业经验，骨干员工从公司原有运营部门抽调，可为客户提供更多安全高效的资金保管、产品核算及产品估值等服务。

（三）基金托管业务经营情况

银河证券托管部于 2014 年 1 月正式成立，在获得证券监管部门批准获得托管资格后已可为各类公开募集资金设立的证券投资基金提供托管服务。托管部拥有独立的安全监控设施，稳定、高效的托管业务系统，完善的业务管理制度，同时秉承公司忠诚、包容、创新、卓越的企业精神，为基金份额持有人利益履行基金托管职责。

（四）基金托管人的内部控制制度

1、内部控制目标

银河证券作为基金托管人：

（1）托管业务的经营运作遵守国家有关法律法规和行业监管规则，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念。

（2）建立科学合理、控制严密、运行高效的内部控制体系，保持托管业务内部控制制度健全、执行有效。

（3）防范和化解经营风险，提高经营管理效益，使托管业务稳健运行和受托资产安全完整，实现托管业务的持续、稳定、健康发展。

（4）不断改进和完善内控机制、体制和各项业务制度、流程，提高业务运作效率和效果。

2、内部控制组织结构

公司针对资产托管业务建立科学合理、控制严密、运行高效的内部控制体系，保持资产托管业务的内部控

制制度健全、执行有效。

公司审计部、风险管理部、法律合规部将根据法律法规和公司相关制度，定期或不定期对开展该业务的相关部门进行稽核检查，评估风险控制措施的有效性，对发现的问题，要求相关部门及时整改，并对整改情况进行监督。

（五）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

银河证券托管部制定投资监督标准与监督流程，依据法律法规的规定、基金合同和托管协议的约定，在授权范围内独立履行对托管资产投资运作的监督职责。

投资监督可以为事中监督和事后监督，主要包括：**1、对托管资产的投资范围、投资比例、投资限制进行监督；2、对托管资产的核算估值是否符合相关法律法规和规范性文件、基金合同和托管协议的约定进行监督；3、对托管资产的资金运用、计提和支付各类费用等情况进行监督；4、对托管资产是否存在透支行为、应收款项是否及时足额到账进行监督；5、对托管资产的收益分配是否符合法律法规和托管协议的约定进行监督；6、其他法律法规、基金合同和托管协议约定的监督事项。**

公司在对托管资产的投资运作监督过程中，发现违反法律、行政法规和其他相关规定，或者违反基金合同和托管协议约定的事项，应当履行通知管理人、报告监管部门等程序，并持续跟进管理人的后续处理，督促管理人依法履行信息披露义务。

三、相关服务机构

（一）基金份额销售机构

1、直销机构

（1）前海开源基金管理有限公司直销柜台

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）

办公地址：深圳市福田区深南大道7006号万科富春东方大厦10层

法定代表人：王兆华

联系人：胥阿南

电话：（0755）83181190

传真：（0755）83180622

（2）前海开源基金管理有限公司电子直销交易

客服电话：4001-666-998

网址：www.qhkyfund.com

微信公众号：qhkyfund

2、代销机构：

代码 代销机构 销售机构信息

1 一路财富（北京）信息科技有限公司 一路财富（北京）信息科技有限公司

注册地址：北京市西城区车公庄大街9号五栋大楼C座702室

法定代表人：吴雪秀

客服电话：400-001-1566

网址：www.yilucaifu.com

2 光大证券股份有限公司 光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路1508号

法定代表人：薛峰

客服电话：95525

网址：www.ebscn.com

3 南京苏宁基金销售有限公司 南京苏宁基金销售有限公司

办公地址：江苏省南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

法定代表人：刘汉青

客服电话：95177

网址：www.snjjin.com

4 西南证券股份有限公司 西南证券股份有限公司

注册地址：重庆市江北区桥北苑 8 号

法定代表人：吴坚

客服电话：95355、4008096096

网址：<http://www.swsc.com.cn>

5 深圳众禄金融控股股份有限公司 深圳众禄金融控股股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

法定代表人：薛峰

客服电话：4006-788-887

网址：www.zlfund.cn，www.jjmmw.com

6 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 幢 202 室

法定代表人：陈柏青

客服电话：4000-766-123

网址：www.fund123.cn

7 和讯信息科技有限公司 和讯信息科技有限公司

注册地址：北京朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人：王莉

客服电话：4009-200-022

网址：www.hexun.com

8 中信建投证券股份有限公司 中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

法定代表人：王常青

客服电话：4008-888-108

网址：www.csc108.com

9 申万宏源证券有限公司 申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人：李梅

客服电话：95523，4008-895-523

网址：www.swhysc.com

10 东兴证券股份有限公司 东兴证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12、15 层

法定代表人：魏庆华

客服电话：4008-888-993

网址：www.dxzq.net

11 厦门市鑫鼎盛控股有限公司 厦门市鑫鼎盛控股有限公司

注册地址：福建省厦门市思明区鹭江道 2 号厦门第一广场西座 1501-1504 室

法定代表人：陈洪生

客服电话：400-918-0808

网址：www.xds.com.cn

12 深圳富济财富管理有限公司 深圳富济财富管理有限公司

注册地址：深圳市南山区粤海街道科苑南路高新南七道惠恒集团二期 418 室

法定代表人：刘鹏宇

客服电话：0755-83999913

网址：www.jinqianwo.cn

13 中经北证（北京）资产管理有限公司 中经北证（北京）资产管理有限公司

注册地址：北京市西城区车公庄大街 4 号 5 号楼 1 层

法定代表人：徐福星

客服电话：400-600-0030

网址：www.bzfunds.com

14 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

法定代表人：汪静波

客服电话：400-821-5399

网址：www.noah-fund.com

15 中国邮政储蓄银行股份有限公司 中国邮政储蓄银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区宣武门西大街 131 号

法定代表人：李国华

客服电话：95580

网址：www.psbc.com

16 国泰君安证券股份有限公司 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

法定代表人：杨德红

客服电话：95521

网址：www.gtja.com

17 北京广源达信基金销售有限公司 北京广源达信基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座六层 605 室

法定代表人：齐剑辉

客服电话：400-623-6060

网址：网站：www.niuniufund.com

18 天风证券股份有限公司 天风证券股份有限公司

注册地址：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦 4 楼

法定代表人：余磊

客服电话：400-800-5000

网址：www.tfzq.com

19 北京肯特瑞财富投资管理有限公司 北京肯特瑞财富投资管理有限公司

注册地址：北京市海淀区海淀东三街 2 号 4 层 401-15

法定代表人：陈超

客服电话：95118（个人业务）、400-088-8816（企业业务）

网址：<http://fund.jd.com/>

20 深圳腾元基金销售有限公司 深圳腾元基金销售有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 2028 号卓越世纪中心 1 号楼 1806-1808 单元

法定代表人：曾革

客服电话：400-990-8600

网址: www.tenyuanfund.com

21 北京钱景基金销售有限公司 北京钱景基金销售有限公司

注册地址: 北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012

法定代表人: 赵荣春

客服电话: 400-893-6885

网址: www.qianjing.com

22 中民财富管理(上海)有限公司 中民财富管理(上海)有限公司

注册地址: 上海市黄浦区中山南路 100 号 07 层

法定代表人: 弭洪军

联系人: 黄鹏

传真: 021-63353736

客服电话: 400-876-5716

网址: www.cmiwm.com

23 国海证券股份有限公司 国海证券股份有限公司

注册地址: 广西壮族自治区桂林市辅星路 13 号

法定代表人: 何春梅

客服电话: 95563

网址: www.ghzq.com.cn

24 华宝证券有限责任公司 华宝证券有限责任公司

注册地址: 上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 57 层

法定代表人: 陈林

客服电话: 4008-209-898

网址: www.cnhbstock.com

25 华龙证券股份有限公司 华龙证券股份有限公司

注册地址: 兰州市城关区东岗西路 638 号财富大厦

法定代表人: 李晓安

客服电话: 400-689-8888

网址: www.hlzq.com

26 北京电盈基金销售有限公司 北京电盈基金销售有限公司

注册地址: 北京市朝阳区呼家楼(京广中心)1号楼36层3603室

法定代表人: 程刚

客服电话: 400-100-3391

网址: www.dianyingfund.com

27 平安证券股份有限公司 平安证券股份有限公司

注册地址: 深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

法定代表人: 谢永林

客服电话: 95511-8

网址: <http://stock.pingan.com>

28 北京格上富信投资顾问有限公司 北京格上富信投资顾问有限公司

注册地址: 北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 710 内 09 室

法定代表人: 李悦章

客服电话: 400-066-8586

网址: www.igesafe.com

29 北京虹点基金销售有限公司 北京虹点基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区西大望路 1 号 1 号楼 16 层 1603

法定代表人：董浩

客服电话：400-068-1176

网址：www.jimufund.com

30 深圳前海凯恩斯基金销售有限公司 深圳前海凯恩斯基金销售有限公司

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

法定代表人：高锋

客服电话：4008-048-688

网址：www.keynesasset.com

31 泰诚财富基金销售（大连）有限公司 泰诚财富基金销售（大连）有限公司

注册地址：辽宁省大连市沙河口区星海中心 3 号

法定代表人：林卓

客服电话：400-6411-999

网址：www.taichengcaifu.com

32 深圳市华融金融服务有限公司 深圳市华融金融服务有限公司

注册地址：深圳市福田区滨河路 5022 号联合广场 A 座裙楼 A302

法定代表人：喻天柱

客服电话：400-600-0583

网址：www.hrjijin.com

33 北京增财基金销售有限公司 北京增财基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区南礼士路 66 号 1 号楼 12 层 1208 号

法定代表人：罗细安

客服电话：400-001-8811

网址：www.zcvc.com.cn

34 申万宏源西部证券有限公司 申万宏源西部证券有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室

法定代表人：许建平

客服电话：400-800-0562

网址：www.hysec.com

35 武汉市伯嘉基金销售有限公司 武汉市伯嘉基金销售有限公司

注册地址：湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际 SOHO 城（一期）第 7 栋 23 层 1 号、4 号

法定代表人：陶捷

客服电话：027-87006003

网址：www.buyfunds.cn

36 华泰证券股份有限公司 华泰证券股份有限公司

注册地址：南京市江东中路 228 号

法定代表人：周易

客服电话：95597

网址：www.htsc.com.cn

37 万联证券股份有限公司 万联证券股份有限公司

注册地址：广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 座 18、19 楼

法定代表人：张建军

客服电话：4008-888-133

网址：www.wlzq.com.cn

- 38 深圳市锦安基金销售有限公司 深圳市锦安基金销售有限公司
注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路鲤鱼门街1号前海深港合作区管理局综合办公楼A栋201室
法定代表人：李学东
客服电话：400-071-9888
网址：www.ananji.cn
- 39 海通证券股份有限公司 海通证券股份有限公司
注册地址：上海市广东路689号
法定代表人：王开国
客服电话：95553
网址：www.htsec.com
- 40 国金证券股份有限公司 国金证券股份有限公司
注册地址：四川省成都市东城根上街95号
法定代表人：冉云
客服电话：95310
网址：www.gjzq.com.cn
- 41 奕丰金融服务（深圳）有限公司 奕丰金融服务（深圳）有限公司
注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入住深圳市前海商务秘书有限公司）
法定代表人：TANYIKKUAN
客服电话：400-684-0500
网址：www.ifastps.com.cn
- 42 中国国际金融股份有限公司 中国国际金融股份有限公司
注册地址：北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27、28层
法定代表人：丁学东
客服电话：400-910-1166
网址：www.cicc.com.cn
- 43 中期资产管理有限公司 中期资产管理有限公司
注册地址：北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢11层1103号
法定代表人：朱剑林
客服电话：(010)65807609
网址：www.cifcofund.com
- 44 深圳前海京西票号基金销售有限公司 深圳前海京西票号基金销售有限公司
注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室
法定代表人：吴永宏
客服电话：400-800-8668
网址：www.ph6.com
- 45 中信证券（山东）有限责任公司 中信证券（山东）有限责任公司
注册地址：青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001
法定代表人：杨宝林
客服电话：95548
网址：www.zxwt.com.cn
- 46 上海联泰资产管理有限公司 上海联泰资产管理有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路277号3层310室
法定代表人：燕斌
客服电话：4000-466-788

网址: www.66zichan.com

47 开源证券股份有限公司 开源证券股份有限公司

注册地址: 西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层

法定代表人: 李刚

客服电话: 400-860-8866

网址: www.kysec.cn

48 华鑫证券有限责任公司 华鑫证券有限责任公司

注册地址: 深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01 (b) 单元

法定代表人: 俞洋

客服电话: 4001-099-918, (021)32109999, (029)68918888

网址: www.cfsc.com.cn

49 华融证券股份有限公司 华融证券股份有限公司

注册地址: 北京市西城区金融大街 8 号

法定代表人: 祝献忠

客服电话: 400-898-9999

网址: www.hrsec.com.cn

50 北京展恒基金销售股份有限公司 北京展恒基金销售股份有限公司

注册地址: 北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号

法定代表人: 闫振杰

客服电话: 400-818-8000

网址: www.myfund.com

51 凤凰金信(银川)投资管理有限公司 凤凰金信(银川)投资管理有限公司

注册地址: 北京市朝阳区紫月路 18 号院朝来高科技产业园 18 号楼

法定代表人: 程刚

客服电话: 4008105919

网址: www.fengfd.com

52 扬州国信嘉利投资理财有限公司 扬州国信嘉利投资理财有限公司

注册地址: 广陵产业园创业路 7 号

法定代表人: 王浩

客服电话: 4000216088

53 上海挖财金融信息服务有限公司 上海挖财金融信息服务有限公司

注册地址: 上海浦东新区杨高南路 799 号陆家嘴世纪金融广场 3 号楼 5 楼

法定代表人: 胡燕亮

客服电话: 021-50810673

网址: www.wacaijijin.com

54 天津万家财富资产管理有限公司 天津万家财富资产管理有限公司

注册地址: 北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 A 座五层

客服电话: 010-59013825

网址: www.wanjiawealth.com

55 北京恒天明泽基金销售有限公司 北京恒天明泽基金销售有限公司

注册地址: 北京市经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室

法定代表人: 梁越

客服电话: 4008-980-618

网址: www.chtfund.com

56 北京植信基金销售有限公司 北京植信基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区四惠盛世龙源 10 号

法定代表人：于龙

网址：www.zhixin-inv.com

57 中泰证券股份有限公司 中泰证券股份有限公司

注册地址：山东省济南市经七路 86 号

法定代表人：李玮

客服电话：95538

网址：www.zts.com.cn

58 安信证券股份有限公司 安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 楼、28 层 A02 单元

法定代表人：牛冠兴

客服电话：4008-001-001

网址：www.essence.com.cn

59 中信期货有限公司 中信期货有限公司

注册地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层

法定代表人：张磊

客服电话：400-990-8826

网址：www.citicsf.com

60 大同证券有限责任公司 大同证券有限责任公司

注册地址：大同市城区迎宾街 15 号桐城中央 21 层

法定代表人：董祥

客服电话：4007-121-212

网址：www.dtsbc.com.cn

61 爱建证券有限责任公司 爱建证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 1600 号陆家嘴商务广场 32 楼

法定代表人：钱华

客服电话：4001-962-502

网址：www.ajzq.com

62 长城证券股份有限公司 长城证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16、17 层

法定代表人：黄耀华

客服电话：400-666-6888

网址：www.cgws.com

63 济安财富（北京）资本管理有限公司 济安财富（北京）资本管理有限公司

注册地址：北京市朝阳区东三环中路 7 号北京财富中心 A 座 46 层

法定代表人：杨健

客服电话：400-673-7010

网址：www.jianfortune.com

64 宜信普泽投资顾问（北京）有限公司 宜信普泽投资顾问（北京）有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国路 88 号楼 soho 现代城 C 座 18 层 1809

法定代表人：沈伟桦

客服电话：400-609-9200

网址：www.yixinfund.com

- 65 长江证券股份有限公司 长江证券股份有限公司
注册地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦
法定代表人：杨泽柱
客服电话：95579
网址：www.95579.com
- 66 中国银河证券股份有限公司 中国银河证券股份有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座
法定代表人：陈共炎
客服电话：4008-888-888
网址：www.chinastock.com.cn
- 67 北京蛋卷基金销售有限公司 北京蛋卷基金销售有限公司
注册地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507
法定代表人：钟斐斐
客服电话：400-0618-518
网址：danjuanapp.com
- 68 上海万得投资顾问有限公司 上海万得投资顾问有限公司
注册地址：上海市浦东新区福山路 33 号 8 楼
法定代表人：王廷富
客服电话：400-821-0203
网址：www.520fund.com.cn
- 69 广州证券股份有限公司 广州证券股份有限公司
注册地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层
法定代表人：邱三发
客服电话：95396
网址：www.gzs.com.cn
- 70 上海陆金所资产管理有限公司 上海陆金所资产管理有限公司
注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元
法定代表人：鲍东华
客服电话：4008219031
网址：www.lufunds.com
- 71 浙江同花顺基金销售有限公司 浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址：浙江省杭州市文二西路元茂大厦 903 室
法定代表人：凌顺平
客服电话：4008-773-772
网址：www.5ifund.com
- 72 众升财富（北京）基金销售有限公司 众升财富（北京）基金销售有限公司
注册地址：北京市朝阳区望京东园四区 13 号楼 A 座 9 层 908 室
法定代表人：李招弟
客服电话：400-059-8888
网址：www.zscffund.com
- 73 北京创金启富投资管理有限公司 北京创金启富投资管理有限公司
注册地址：北京市西城区民丰胡同 31 号 5 号楼 215A
法定代表人：梁蓉
客服电话：400-6262-818

网址: www.5irich.com

74 交通银行股份有限公司 交通银行股份有限公司

注册地址: 上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人: 牛锡明

客服电话: 95559

网址: www.bankcomm.com

75 深圳市金斧子基金销售有限公司 深圳市金斧子基金销售有限公司

注册地址: 深圳市南山区粤海街道科苑路 16 号东方科技大厦 18 楼

法定代表人: 赖任军

客服电话: 400-9500-888

网址: www.jfzinv.com

76 山西证券股份有限公司 山西证券股份有限公司

注册地址: 山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人: 侯巍

客服电话: 400-666-1618、95573

网址: www.i618.com.cn

77 乾道金融信息服务(北京)有限公司 乾道金融信息服务(北京)有限公司

注册地址: 北京市西城区德胜门外大街合生财富广场 1302 室

法定代表人: 王兴吉

客服电话: 400-088-8080

网址: www.qiandaojr.com

78 上海天天基金销售有限公司 上海天天基金销售有限公司

注册地址: 上海市徐汇区宛平南路 88 号东方财富大厦

法定代表人: 其实

客服电话: 4001-818-188

网址: www.1234567.com.cn

79 中国工商银行股份有限公司 中国工商银行股份有限公司

注册地址: 北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人: 易会满

客服电话: 95588

网址: www.icbc.com.cn

80 喜鹊财富基金销售有限公司 喜鹊财富基金销售有限公司

注册地址: 西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦 1513 室

法定代表人: 陈皓

客服电话: 0891-6177483

网址: www.xiquefund.com

81 中信证券股份有限公司 中信证券股份有限公司

注册地址: 广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座

法定代表人: 王东明

客服电话: 95548

网址: www.cs.ecitic.com

82 招商银行股份有限公司 招商银行股份有限公司

注册地址: 深圳市福田区深南大道 7088 号

法定代表人: 李建红

客服电话：95555

网址：www.cmbchina.com

83 北京晟视天下投资管理有限公司 北京晟视天下投资管理有限公司

注册地址：北京市怀柔区九渡河镇黄坎村 735 号 03 室

法定代表人：蒋煜

客服电话：400-818-8866

网址：www.shengshiview.com

84 渤海证券股份有限公司 渤海证券股份有限公司

注册地址：天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

法定代表人：王春峰

客服电话：400-651-5988

网址：www.ewww.com.cn

85 北京新浪仓石基金销售有限公司 北京新浪仓石基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区北四环西路 58 号理想国际大厦 906

法定代表人：张琪

客服电话：010-62675369

网址：www.xincai.com

86 上海好买基金销售有限公司 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

办公地址：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

法定代表人：杨文斌

客服电话：400-700-9665

网址：www.ehowbuy.com

87 东莞证券股份有限公司 东莞证券股份有限公司

注册地址：广东省东莞市莞城区可园南路一号金源中心

法定代表人：张运勇

客服电话：(0769) 961130

网址：www.dgzq.com.cn

88 上海汇付金融服务有限公司 上海汇付金融服务有限公司

注册地址：办公上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

法定代表人：张晶

客服电话：400-820-2819

网址：www.chinapnr.com

89 大泰金石基金销售有限公司 大泰金石基金销售有限公司

注册地址：南京市建邺区江东中路 359 号国睿大厦一号楼 B 区 4 楼 A506 室

法定代表人：袁顾明

客服电话：400-928-2266

网址：www.dtfunds.com

90 中山证券有限责任公司 中山证券有限责任公司

注册地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼 7 层、8 层

法定代表人：黄扬录

客服电话：95329

网址：www.zszq.com

91 大通证券股份有限公司 大通证券股份有限公司

注册地址：大连市沙河口区会展路 129 号大连国际金融中心 A 座大连期货大厦 38、39 层

法定代表人：李红光

客服电话：4008-169-169

网址：www.daton.com.cn

92 英大证券有限责任公司 英大证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层

法定代表人：吴骏

客服电话：400-018-8688

网址：www.ydsc.com.cn

93 北京微动利投资管理有限公司 北京微动利投资管理有限公司

注册地址：北京市石景山区古城西路 113 号景山财富中心 341

法定代表人：梁洪军

客服电话：4008-196-665

网址：www.buyforyou.com.cn

94 珠海盈米财富管理有限公司 珠海盈米财富管理有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

法定代表人：肖雯

客服电话：020-89629066

网址：www.yingmi.cn

95 上海利得基金销售有限公司 上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

法定代表人：李兴春

客服电话：400-921-7755

网址：www.leadbank.com.cn

96 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#

法定代表人：杨懿

客服电话：400-166-1188

网址：<http://8.jrj.com.cn/>

97 华安证券股份有限公司 华安证券股份有限公司

注册地址：合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

法定代表人：李工

客服电话：95318

网址：www.hazq.com

98 信达证券股份有限公司 信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：张志刚

客服电话：95321

网址：www.cindasc.com

99 上海长量基金销售投资顾问有限公司 上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市浦东新区东方路 1267 号 11 层

法定代表人：张跃伟

客服电话：400-820-2899

网址：www.erichfund.com

100 中衍期货有限公司 中衍期货有限公司

注册地址：北京市朝阳区东四环中路 82 号金长安大厦 B 座 7 层

法定代表人：马宏波

客服电话：4006881117

网址：www.cdfco.com.cn

101 北京汇成基金销售有限公司 北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108 室

法定代表人：王伟刚

客服电话：400-619-9059

网址：www.hcjijin.com

102 和讯证券股份有限公司 和讯证券股份有限公司

注册地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼

法定代表人：徐刚

客服电话：95564

网址：www.lxsec.com

（二）登记机构

名称：前海开源基金管理有限公司

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）

办公地址：深圳市福田区深南大道 7006 号万科富春东方大厦 22 楼

法定代表人：王兆华

联系人：任福利

电话：（0755）83180910

传真：（0755）83181121

（三）律师事务所和经办律师

名称：广东信达律师事务所

注册地址：深圳市福田区益田路 6001 号太平金融大厦 12 楼

负责人：麻云燕

经办律师：杨扬、胡云云

电话：（0755）88265288

传真：（0755）88265537

（四）会计师事务所和经办注册会计师

名称：瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：北京市海淀区西四环中路 16 号院 2 号楼 4 层

办公地址：北京市东城区永定门西滨河路 8 号院 7 号楼中海地产广场西塔 5-11 层

法定代表人：杨剑涛

联系人：郭红霞

经办会计师：张富根、郭红霞

电话：（010）88095588

传真：（010）88091199

四、基金名称

前海开源一带一路主题精选灵活配置混合型证券投资基金

五、基金的类型

混合型

六、基金的运作方式

开放式

七、基金的投资

（一）投资目标

本基金力图把握一带一路战略带来的投资机会，通过主题精选和个股精选，分享丝绸之路经济带和海上丝绸之路建设所带来的长期投资价值。在严格控制投资风险的前提下，力争获取超越业绩比较基准的稳健收益。

（二）投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、可转换债券等）、资产支持证券、权证、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例范围为 0-95%；投资于一带一路主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的 80%；持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金参与股指期货交易，应符合法律法规规定和基金合同约定的投资限制并遵守相关期货交易所的业务规则。

（三）投资策略

本基金的投资策略主要有以下五方面内容：

1、大类资产配置

在大类资产配置中，本基金综合运用定性和定量的分析手段，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。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

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

根据国家一带一路的相关规划和布局，自上而下重点投资基建、交运、贸易、旅游、文化和金融等相关板块，自下而上精选受益于一带一路主题的优质公司，构建核心股票池；再通过本基金已有的个股筛选打分体系，根据模拟组合的资产额度，构建投资组合，其后根据资产额度的变化，投资组合个股数量也会相应进行调整，以期追求超额收益，分享一带一路的建设带来的投资价值。

（1）选股策略

本基金采用自上而下与自下而上相结合的选股策略，通过对一带一路主题所涉及的基建、交运、贸易、旅

游等领域的上市公司进行甄选，精选其中的优质上市公司股票作为投资对象。

（2）个股选择方法

随着一带一路战略的推进，中国的相关企业将迎来新的发展机遇，本基金重点挖掘一带一路主题相关的优质上市公司股票作为投资标的，力求实现基金资产的长期、持续、稳定增值。具体为以下几个方面：

1) 一带一路股票池

本基金通过对宏观经济、一带一路战略、企业成长能力、估值水平的综合研究分析和判断，以股票的基本面研究为基础、结合市场热点，核心构建一带一路核心股票池。

2) 一带一路股票精选方法

对于进入一带一路股票池的股票，本基金管理人将采取自下而上的方法，运用本基金综合评价模型和打分体系，从定性与定量两个角度进行打分，最终筛选出具有较强竞争力的优质上市公司股票，进行估值水平的评估。

A、定性分析

本基金综合评价模型定性分析部分，主要从公司核心竞争力、主营业务成长性、经营管理能力、商业模式、主题相关性等几方面对备选股票进行定性分析。本基金管理人将根据外部报告以及研究员实地调研结果，对备选上市公司的各项指标进行综合判断，并以此作为本基金综合评价模型定性分析的分析结果。

B、定量分析

本基金将定量因素主要归结为收益能力、运营能力、偿债能力和市场地位几大类指标。在此基础上，根据市场关注度与认可度对各指标赋予不同权重进行打分判断。

本基金管理人将上市公司综合评价模型定性分析与定量分析综合评估，根据综合评估打分情况，选取综合评估靠前的上市公司股票进入投资组合。

3) 股票组合的构建与定期调整

本基金管理人将以一带一路主题涉及的基建、交运、贸易、旅游和文化等领域为主要投资方向，以本基金综合评价模型的评价结果为基础，同时参考如下因素进行股票组合的构建：

A、个股持仓量的政策限制

本基金管理人将根据相关的法律、法规和基金合同等法律文件进行投资，杜绝违法、违规的现象。

B、分散投资和风险控制

本基金管理人参考数量化风险分析结果，确认主动性风险的来源，并将风险分解到各个层面，如资产类别、行业及股票，减少风险集中度，并不断地进行收益—风险最优化测试。

本基金管理人根据市场与上市公司基本面的变化等情况适时调整股票投资组合。

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。在宏观环境分析方面，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。

在微观市场定价分析方面，本基金以中长期利率趋势分析为基础，结合经济趋势、货币政策及不同债券品种的收益率水平、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构建债券投资组合。

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、股指期货投资策略

本基金以套期保值为目的，参与股指期货交易。

本基金参与股指期货投资时机和数量的决策建立在对证券市场总体行情的判断和组合风险收益分析的基础上。基金管理人将根据宏观经济因素、政策及法规因素和资本市场因素，结合定性和定量方法，确定投资时机。基金管理人将结合股票投资的总体规模，以及中国证监会的相关限定和要求，确定参与股指期货交易的投资比例。

基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

基金管理人在进行股指期货投资前将建立股指期货投资决策部门或小组，负责股指期货的投资管理的相关事项，同时针对股指期货投资管理制定投资决策流程和风险控制等制度，并经基金管理人董事会批准后执行。

若相关法律法规发生变化时，基金管理人期货投资管理从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。

（四）投资决策依据及程序

1、决策依据

以《基金法》、基金合同、公司章程等有关法律法规为决策依据，并以维护基金份额持有人利益作为最高准则。

2、决策程序

（1）投资决策委员会制定整体投资战略。

（2）研究部根据自身以及其他研究机构的研究成果，构建股票备选库、精选库，对拟投资对象进行持续跟踪调研，并提供个股、债券决策支持。

（3）基金经理根据投资决策委员会的投资战略，设计和调整投资组合。设计和调整投资组合需要考虑的基本因素包括：每日基金申购和赎回净现金流量；基金合同的投资限制和比例限制；研究员的投资建议；基金经理的独立判断；绩效与风险评估小组的建议等。

（4）投资决策委员会对基金经理提交的方案进行论证分析，并形成决策纪要。

（5）根据决策纪要，基金经理小组构造具体的投资组合及操作方案，交由交易部执行。

（6）交易部按有关交易规则执行，并将有关信息反馈基金经理。

（7）基金绩效评估岗及风险管理岗定期进行基金绩效评估，并向投资决策委员会提交综合评估意见和改进方案。

（8）风险控制委员会对识别、防范、控制基金运作各个环节的风险全面负责，尤其重点关注基金投资组合的风险状况；基金绩效评估岗及风险管理岗重点控制基金投资组合的市场风险和流动性风险。

（五）业绩比较基准

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

业绩比较基准选择理由：

沪深 300 指数是由中证指数公司编制发布、表征 A 股市场走势的权威指数。该指数是由上海和深圳证券交易所市场中选取 300 只 A 股作为样本编制而成的成份股指数。其样本覆盖了沪深市场六成左右的市值，具有良好的市场代表性。本基金选择该指数来衡量股票投资部分的绩效。

中证全债指数是中证指数公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数。该指数的样本由银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券组成，中证指数公司每日计算并发布中证全债的收盘指数及相应的债券属性指标。该指数的一个重要特点在于对异常价格和无价情况下使用了模型价，能更为真实地反映债券的实际价值和收益率特征。本基金选择该指数来衡量债券投资部分的绩效。

根据本基金的投资范围和投资比例约束，设定本基金的基准为沪深 300 指数收益率 70%+中证全债指数收益率 30%，该基准能客观衡量本基金的投资绩效。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上

出现更加适合于本基金的业绩基准的指数时，本基金管理人协商基金托管人后可以在报中国证监会备案以后变更业绩比较基准并及时公告，但不需要召集基金份额持有人大会。

（六）风险收益特征

本基金为混合型基金，属于中高风险收益的投资品种，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。

（七）投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

- （1）本基金股票投资占基金资产的比例为 0-95%；投资于一带一路主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的 80%；
- （2）本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券；
- （3）本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；
- （4）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；
- （5）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；
- （6）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；
- （7）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；
- （8）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；
- （9）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；
- （10）本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；
- （11）本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；
- （12）本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；
- （13）基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；
- （14）本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；
- （15）本基金持有一家公司发行的流通受限证券，其市值不得超过基金资产净值的 3%；本基金持有的所有流通受限证券，其市值不得超过基金资产净值的 15%；经基金管理人和基金托管人协商，可对以上比例进行调整；
- （16）本基金投资单只中期票据的额度不得超过其发行总额度的 10%，并且不得超过基金净值的 10%；
- （17）本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值不得超过基金资产净值的 10%；
- （18）本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；
- （19）本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；本基金管理人应当按照中国金融期货交易所要求的内容、格式与时限向交易所报告所交易和持有的卖出期货合约情况、交易目的及对应的证券资产情况等；
- （20）本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；
- （21）本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；
- （22）本基金总资产不得超过基金净资产的百分之一百四十；

(23) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

基金管理人运用基金财产投资证券衍生品品种的，应当根据风险管理的原则，并制定严格的授权管理制度和投资决策流程。基金管理人运用基金财产投资证券衍生品品种的具体比例，应当符合中国证监会的有关规定。

本基金在开始进行股指期货投资之前，应与基金托管人就股指期货划款指令、清算、估值、交割等事宜另行具体协商。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是国务院证券监督管理机构另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (7) 法律、行政法规和国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

(八) 基金管理人代表基金行使股东权利及债权人权利的处理原则及方法

- 1、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；
- 2、有利于基金资产的安全与增值；
- 3、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益；
- 4、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利，保护基金份额持有人的利益。

(九) 基金的融资融券

本基金可以根据有关法律法规和政策的规定进行融资、融券。

(十) 基金的投资组合报告

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人根据基金合同规定复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本投资组合报告所载数据截至 2017 年 9 月 30 日（未经审计）。

1. 报告期末基金资产组合情况

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1	权益投资	168,824,995.03	58.66
	其中：股票	168,824,995.03	58.66
2	基金投资	--	
3	固定收益投资	--	
	其中：债券	--	
	资产支持证券	--	
4	贵金属投资	--	
5	金融衍生品投资	--	
6	买入返售金融资产	--	
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	--	
7	银行存款和结算备付金合计	110,150,419.84	38.27
8	其他资产	8,840,822.63	3.07
9	合计	287,816,237.50	100.00

2.报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	23,080,571.94	8.18
C	制造业	111,385,541.45	39.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	--	
E	建筑业	60,260.96	0.02
F	批发和零售业	3,860,064.00	1.37
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	27,330,143.68	9.69
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	3,108,413.00	1.10
S	综合	--	
	合计	168,824,995.03	59.84

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。

3.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号 股票代码 股票名称 数量(股) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1	601989	中国重工	4,336,525	28,924,621.75	10.25
---	--------	------	-----------	---------------	-------

2	600702	沱牌舍得	443,603	17,340,441.27	6.15
3	601069	西部黄金	626,621	13,065,047.85	4.63
4	000887	中鼎股份	566,600	11,813,610.00	4.19
5	300115	长盈精密	334,700	11,570,579.00	4.10
6	300327	中颖电子	299,489	10,242,523.80	3.63
7	300059	东方财富	712,400	9,852,492.00	3.49
8	600038	中直股份	204,476	8,937,645.96	3.17
9	002439	启明星辰	327,356	7,247,661.84	2.57
10	300502	新易盛	180,800	6,181,552.00	2.19

4.报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.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。

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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9.报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

9.1 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。

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

10.报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

10.2 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。

10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

11.投资组合报告附注

11.1 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。

11.2 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。

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	376,361.15
2	应收证券清算款	8,313,298.56
3	应收股利	-
4	应收利息	24,509.64
5	应收申购款	126,653.28
6	其他应收款	-

- 7 待摊费用 -
- 8 其他 -
- 9 合计 8,840,822.63

11.4 报告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。

11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分公允价值(元)	占基金净值比例(%)	流通受限情况说明
1	601989	中国重工	28,924,621.75	10.25	重大资产重组

11.6 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。

八、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、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，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

前海开源一带一路混合 A

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	—	—
2015.4.29-2015.12.31	-4.20%	0.23%	-12.68%	1.92%	8.48%	-1.69%
2016.1.1-2016.12.31	5.01%	0.78%	-7.02%	0.98%	12.03%	-0.20%
2017.1.1-2017.9.30	-5.86%	0.78%	11.07%	0.40%	-16.93%	0.38%
2015.4.29-2017.9.30	-5.30%	0.67%	-9.82%	1.21%	4.52%	-0.54%

前海开源一带一路混合 C

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	—	—
2015.11.16-2015.12.31	0.10%	0.05%	0.04%	1.13%	0.06%	-1.08%
2016.1.1-2016.12.31	9.59%	0.80%	-7.02%	0.98%	16.61%	-0.18%
2017.1.1-2017.9.30	-5.29%	0.79%	11.07%	0.40%	-16.36%	0.39%
2015.11.16-2017.9.30	3.90%	0.77%	3.33%	0.82%	0.57%	-0.05%

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

九、基金的费用与税收

(一) 基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、从 C 类基金份额的基金财产中计提的销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券、期货交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、证券、期货账户开户费用、银行账户维护费用；
- 10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，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、按照指定的账户路径进行资金支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，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、按照指定的账户路径进行资金支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

3、从 C 类基金份额的基金财产中计提的销售服务费

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 0.1%。

本基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.1%年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.1\% \times \text{当年天数}$$

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，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性划出，由注册登记机构代收，注册登记机构收到后按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。

上述（一）基金费用的种类中第 4—10 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（四）基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率和销售服务费率等相关费率。降低基金管理费率、基金托管费率和销售服务费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照有关规定于新的费率实施日前在指定媒介和基金管理人网站上刊登公告。

（五）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十、其他应披露事项

（一）前海开源基金管理有限公司（以下简称本公司）的从业人员在前海开源资产管理有限公司（以下简称前海开源资管公司或子公司）兼任董事、监事及领薪情况如下：

本公司总经理、董事蔡颖女士兼任前海开源资管公司董事长；

本公司督察长傅成斌先生兼任前海开源资管公司董事；

本公司汤力女士兼任前海开源资管公司监事；

上述人员均不在前海开源资管公司领薪。本公司除上述人员以外未有从业人员在前海开源资管公司兼任职务的情况。

(二) 2017年4月29日至2017年10月29日披露的公告：

2017-10-26 前海开源一带一路主题精选灵活配置混合型证券投资基金 2017年第3季度报告

2017-10-25 前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加苏宁基金为代销机构及开通转换业务并参与其费率优惠活动的公告

2017-09-29 前海开源基金管理有限公司关于调整旗下部分基金通过中泰证券定投申购起点金额的公告

2017-09-20 前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加喜鹊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

2017-09-19 前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加植信基金为代销机构并参与其费率优惠活动的公告

2017-08-31 前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加万家财富为代销机构及开通转换业务并参与其费率优惠活动的公告

2017-08-28 前海开源一带一路主题精选灵活配置混合型证券投资基金 2017年半年度报告摘要

2017-08-28 前海开源一带一路主题精选灵活配置混合型证券投资基金 2017年半年度报告

2017-08-07 前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中民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

2017-07-28 前海开源基金管理有限公司关于华泰证券费率调整的公告

2017-07-25 前海开源基金管理有限公司关于中泰证券费率调整的公告

2017-07-21 前海开源一带一路主题精选灵活配置混合型证券投资基金 2017年第2季度报告

2017-07-06 前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加凤凰金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

2017-07-03 前海开源基金管理有限公司旗下基金 2017年半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

2017-07-01 前海开源基金管理有限公司关于旗下基金继续参与交通银行费率优惠活动的公告

2017-06-29 前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金在华泰证券开通转换业务的公告

2017-06-29 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

2017-06-27 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

2017-06-12 前海开源一带一路主题精选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)

2017-05-25 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

2017-05-18 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

2017-05-15 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

2017-05-15 前海开源基金管理有限公司关于锦安基金费率调整的公告

2017-05-11 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

十一、备查文件

（一）备查文件包括：

- 1、中国证监会准予注册前海开源一带一路主题精选灵活配置混合型证券投资基金募集的文件
- 2、《前海开源一带一路主题精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《前海开源一带一路主题精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 4、法律意见书
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照

（二）备查文件的存放地点和投资人查阅方式：

- 1、存放地点：《基金合同》、《托管协议》存放在基金管理人和基金托管人处；其余备查文件存放在基金管理人处。
- 2、查阅方式：投资人可在营业时间免费到存放地点查阅，也可按工本费购买复印件。

十二、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《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》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对本基金的原招募说明书进行了更新，主要更新的内容如下：

- 1、对基金管理人部分，对人员信息进行了更新。
- 2、对基金托管人相关信息进行了更新。
- 3、对相关服务机构相关信息进行了更新。
- 4、对基金份额的申购与赎回相关信息进行了更新。
- 5、在基金的投资部分，更新了（十）基金的投资组合报告、（十一）基金的业绩相关信息。
- 6、在其他应披露事项部分相关信息进行了更新，披露了期间涉及本基金的公告。
- 7、对部分表述进行了更新。

前海开源基金管理有限公司

二〇一七年十二月十二日