

---

# 前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金

## 2018 年半年度报告

2018 年 06 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:上海银行股份有限公司

送出日期:2018 年 08 月 27 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。

基金托管人上海银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年8月20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2018年01月01日起至2018年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	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	11
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	14
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	14
§6 半年度财务会计报告(未经审计)	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	18
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
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	47
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	47
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	47
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	47
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.12 投资组合报告附注	48
§8 基金份额持有人信息	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	49

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	49
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情况.....	50
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	50
§9 开放式基金份额变动.....	51
§10 重大事件揭示.....	51
10.1 基金份额持有人大会决议.....	51
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.....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	51
10.4 基金投资策略的改变.....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	52
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.....	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	52
10.8 其他重大事件.....	53
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	58
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.....	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	59
§12 备查文件目录.....	59
12.1 备查文件目录.....	59
12.2 存放地点.....	59
12.3 查阅方式.....	59

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金	
基金简称	前海开源事件驱动混合	
基金主代码	000423	
基金运作方式	契约型发起式开放式	
基金合同生效日	2013年12月19日	
基金管理人	前海开源基金管理有限公司	
基金托管人	上海银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	162,678,205.01份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	前海开源事件驱动混合A	前海开源事件驱动混合C
下属分级基金的交易代码	000423	001865
报告期末下属分级基金的份额总额	24,583,255.58份	138,094,949.43份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	<p>本基金基于对宏观经济、资本市场的深入分析和理解，在积极把握市场发展趋势和市场参与者行为逻辑的基础上，精选具有估值优势和成长潜力的公司进行投资，力争获取超越业绩比较基准的收益，追求基金资产的长期稳定增值。</p>
投资策略	<p>本基金的投资策略包括五个方面：（1）大类资产配置：本基金依据经济周期理论，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：本基金在积极把握宏观经济变迁、证券市场变化以及证券市场参与各方行为逻辑的基础上，将影响行业和公司投资价值的事件性因素作为投资的主线，以事件驱动为核心的投资策略；（3）债券投资策略：通过深入分</p>

	析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势以及不同类属固定收益类投资品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，以目标久期管理和品种选择策略为主，以收益率利差策略、债券置换策略为辅，构造能获得稳定收益的固定收益类投资品种组合；（4）权证投资策略：本基金将权证的作为提高基金投资组合收益的辅助手段。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。
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。

### 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	上海银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	傅成斌
	联系电话	0755-88601888
	电子邮箱	qhky@qhkyfund.com
客户服务电话	4001666998	95594
传真	0755-83181169	021-68476936
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）	中国（上海）自由贸易试验区银城中路168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	中国（上海）自由贸易试验区银城中路168号42楼
邮政编码	518040	200120
法定代表人	王兆华	金煜

## 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、基金托管人处

## 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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年01月01日-2018年06月30日)	
	前海开源事件驱动混合A	前海开源事件驱动混合C
本期已实现收益	-665,698.13	-1,538,698.17
本期利润	-6,225,969.07	-28,605,431.69
加权平均基金份额本期利润	-0.1444	-0.1883
本期加权平均净值利润率	-10.20%	-14.77%
本期基金份额净值增长率	-10.20%	-10.24%

3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年06月30日)	
期末可供分配利润	7,020,913.35	24,026,834.95
期末可供分配基金份额利润	0.2856	0.1740
期末基金资产净值	31,604,168.93	162,121,784.38
期末基金份额净值	1.286	1.174
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	28.60%	17.40%

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 本基金自2015年10月26日起，增加C类基金份额并设置对应基金代码。

## 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

前海开源事件驱动混合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	-3.53%	1.31%	-5.20%	0.90%	1.67%	0.41%
过去三个月	-2.50%	1.30%	-6.39%	0.79%	3.89%	0.51%
过去六个月	-10.20%	1.40%	-7.88%	0.81%	-2.32%	0.59%
过去一年	3.71%	1.24%	-1.55%	0.66%	5.26%	0.58%



过去三年	20.86%	1.03%	-11.17%	1.04%	32.03%	-0.01%
自基金合同生效起至今	28.60%	1.02%	47.42%	1.08%	-18.82%	-0.06%

## 前海开源事件驱动混合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	-3.61%	1.32%	-5.20%	0.90%	1.59%	0.42%
过去三个月	-2.57%	1.31%	-6.39%	0.79%	3.82%	0.52%
过去六个月	-10.24%	1.40%	-7.88%	0.81%	-2.36%	0.59%
过去一年	3.71%	1.24%	-1.55%	0.66%	5.26%	0.58%
自基金合同生效起至今	17.40%	1.09%	1.71%	0.80%	15.69%	0.29%

注：①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%。

②本基金自 2015 年 10 月 26 日起，增加 C 类基金份额并设置对应基金代码。

### 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

前海开源事件驱动混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2013年12月19日-2018年06月30日)



前海开源事件驱动混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2015年10月27日-2018年06月30日)



注：本基金自 2015 年 10 月 26 日起，增加 C 类基金份额并设置对应基金代码；前海开源事件驱动混合 C 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起始日为 2015 年 10 月 26 日。

### 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。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73只开放式基金，资产管理规模超过441.89亿元。

#### 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		
王霞	本基金的 基金经 理、公司 执行投资 总监	2014-12- 25	-	14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：①对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”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遵规守信情况的说明

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

报告期内国内经济增长总体保持较平稳态势，但股票市场震荡加剧，尤其是第二季度上证指数不断创近一年来的新低，市场情绪低迷。反应出在国内金融去杠杆的背景下，叠加中美贸易战的影响，市场对未来国内经济增长可持续性及其下行压力的担忧。

由于报告期内市场风格、行业轮动较快，本基金的行业配置基本保持稳定，继续持有大炼化、煤炭、银行板块，但在第二季度逐步兑现了白酒行业的收益，战略性布局了地产股。未来仍需根据经济增长预期及行业政策的变化对所持行业进行调整。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末前海开源事件驱动混合A基金份额净值为1.286元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-10.20%，同期业绩比较基准收益率为-7.88%；截至报告期末前海开源事件驱动混合C基金份额净值为1.174元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-10.24%，同期业绩比较基准收益率为-7.88%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从目前国家对房地产行业调控的决心来看，在今年二次降准后，对房地产行业的调控政策继续收紧，预计下半年房地产市场将出现较明显降温，加上金融去杠杆不断深入

及贸易战的影响，预计下半年国内经济下行压力有所增大。在应对措施方面，预计国家将推进减税等财政政策以缓解经济增速回落的风险。

受此影响，预计下半年股票市场将可能继续承压，但从中长期看，未来市场的潜在机会可能大于风险。一是目前整体市场的估值水平处于历史低位，二是金融去杠杆的推进反而有利于金融市场未来可持续的、健康的发展。鉴于此，我们预计下半年自下而上选股可能更为重要，代表未来发展方向的科技类优质成长股将可能取得超越市场的表现。此外，过去两年连续大幅跑输大盘的地产股，在下半年行业不断降温的过程中，预计行业调控可能有边际改善的可能，行业龙头公司具有一定的中期配置价值。

#### 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、基金核算部、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，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、《前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》和《前海

开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议》的有关约定，诚实、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

## 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，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。报告期内，本基金未实施利润分配。

## 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

本托管人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，认为复核内容真实、准确、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：前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2018年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	20,637,680.24	85,147,904.38
结算备付金		322,667.43	1,204,524.65
存出保证金		411,399.68	448,288.55
交易性金融资产	6.4.7.2	173,216,289.31	137,305,924.98
其中：股票投资		173,216,289.31	137,305,924.98
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-

买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	4,489.84	17,758.33
应收股利		-	-
应收申购款		44,885.03	6,163,289.94
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		194,637,411.53	230,287,690.83
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018年06月30日</b>	<b>上年度末 2017年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
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		-	-
应付证券清算款		-	4,403,642.59
应付赎回款		140,880.84	373,515.92
应付管理人报酬		150,826.76	148,917.40
应付托管费		8,379.31	8,273.18
应付销售服务费		13,950.19	10,627.03
应付交易费用	6.4.7.7	173,687.17	451,477.98
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	423,733.95	500,123.01
负债合计		911,458.22	5,896,577.11
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	162,678,205.01	166,845,947.22
未分配利润	6.4.7.1 0	31,047,748.30	57,545,166.50

所有者权益合计		193,725,953.31	224,391,113.72
负债和所有者权益总计		194,637,411.53	230,287,690.83

注：报告截止日2018年6月30日，前海开源事件驱动混合A基金份额净值1.286元，基金份额总额24,583,255.58份；前海开源事件驱动混合C基金份额净值1.174元，基金份额总额138,094,949.43份。

## 6.2 利润表

会计主体：前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2018年01月01日至2018年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2018年01月01日至2018年06月30日	上年度可比期间2017年01月01日至2017年06月30日
一、收入		-32,549,714.30	28,554,661.64
1. 利息收入		156,750.19	173,746.78
其中：存款利息收入	6.4.7.1 1	156,750.19	161,445.21
债券利息收入		-	12,301.57
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-336,017.27	17,791,440.60
其中：股票投资收益	6.4.7.1 2	-2,412,354.85	16,859,190.21
基金投资收益	6.4.7.1 3	-	-
债券投资收益	6.4.7.1 4	-	-8,021.40
资产支持证券投资收	6.4.7.1	-	-



益	4.5		
贵金属投资收益	6.4.7.1 5	-	-
衍生工具收益	6.4.7.1 6	-	-
股利收益	6.4.7.1 7	2,076,337.58	940,271.79
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.1 8	-32,627,004.46	10,517,714.56
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.1 9	256,557.24	71,759.70
<b>减：二、费用</b>		2,281,686.46	2,325,859.16
1. 管理人报酬	6.4.10. 2.1	1,140,459.22	798,418.88
2. 托管费	6.4.10. 2.2	63,358.92	44,356.59
3. 销售服务费	6.4.10. 2.3	96,177.84	59,199.90
4. 交易费用	6.4.7.2 0	796,594.84	1,239,139.76
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.2 1	185,095.64	184,744.03
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		-34,831,400.76	26,228,802.48
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		-34,831,400.76	26,228,802.48

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2018年01月01日至2018年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2018年01月01日至2018年06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)	166,845,947.22	57,545,166.50	224,391,113.72
二、本期经营活动产生 的基金净值变动 数(本期利润)	-	-34,831,400.76	-34,831,400.76
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)	-4,167,742.21	8,333,982.56	4,166,240.35
其中：1. 基金申购款	112,616,770.48	44,867,682.58	157,484,453.06
2. 基金赎回 款	-116,784,512.69	-36,533,700.02	-153,318,212.71
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)	162,678,205.01	31,047,748.30	193,725,953.31
项 目	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06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)	215,151,985.48	-1,290,742.03	213,861,243.45
二、本期经营活动产生 的基金净值变动	-	26,228,802.48	26,228,802.48

数(本期利润)			
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)	-66,998,153.55	-299,237.74	-67,297,391.29
其中:1.基金申购款	107,405,198.58	11,634,778.63	119,039,977.21
2.基金赎回款	-174,403,352.13	-11,934,016.37	-186,337,368.50
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)	148,153,831.93	24,638,822.71	172,792,654.64

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

傅智

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

前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金(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【2013】1399号文《关于核准前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金募集的批复》核准,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》、《前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式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2013年11月15日至2013年12月16日,首次设立募集不包括认购资金利息共募集128,484,379.36元,经瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)瑞华验字[2013]第332A0009号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》于2013年12月19日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为128,523,462.75份基金份额,其中认购资金利息

折合39,083.39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，本基金托管人为上海银行股份有限公司。

#### 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》、《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 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的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 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[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、[2012]85号《关于实施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[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有

关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例》、《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉的决定》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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，股票的股息、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。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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金分别按实际缴纳的增值税额的7%、3%、2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

## 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 2018年06月30日
活期存款	20,637,680.24
定期存款	-
其中：存款期限1个月以内	-

存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
合计	20,637,680.24

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末2018年06月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	193,340,577.92	173,216,289.31	-20,124,288.61
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	193,340,577.92	173,216,289.31	-20,124,288.61

#### 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 2018年06月30日
应收活期存款利息	4,192.48
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	130.68
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	166.68
合计	4,489.84

注：“其他”为应收结算保证金利息。

#### 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 2018年06月30日
交易所市场应付交易费用	173,687.17
银行间市场应付交易费用	-
合计	173,687.17

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年06月30日
应付券商交易单元保证金	-

应付赎回费	173.05
预提费用	423,560.90
合计	423,733.95

#### 6.4.7.9 实收基金

##### 6.4.7.9.1 前海开源事件驱动混合A

金额单位：人民币元

项目 (前海开源事件驱动混合A)	本期2018年01月01日至2018年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	49,172,456.27	49,172,456.27
本期申购	23,617,957.99	23,617,957.99
本期赎回(以“-”号填列)	-48,207,158.68	-48,207,158.68
本期末	24,583,255.58	24,583,255.58

##### 6.4.7.9.2 前海开源事件驱动混合C

金额单位：人民币元

项目 (前海开源事件驱动混合C)	本期2018年01月01日至2018年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	117,673,490.95	117,673,490.95
本期申购	88,998,812.49	88,998,812.49
本期赎回(以“-”号填列)	-68,577,354.01	-68,577,354.01
本期末	138,094,949.43	138,094,949.43

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

##### 6.4.7.10.1 前海开源事件驱动混合A

单位：人民币元

项目 (前海开源事件驱动混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计



上年度末	17,155,391.67	4,097,665.05	21,253,056.72
本期利润	-665,698.13	-5,560,270.94	-6,225,969.07
本期基金份额交易产生的变动数	-7,938,839.31	-67,334.99	-8,006,174.30
其中：基金申购款	8,194,528.26	3,275,641.21	11,470,169.47
基金赎回款	-16,133,367.57	-3,342,976.20	-19,476,343.77
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,550,854.23	-1,529,940.88	7,020,913.35

## 6.4.7.10.2 前海开源事件驱动混合C

单位：人民币元

项目 (前海开源事件驱动混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	25,885,323.11	10,406,786.67	36,292,109.78
本期利润	-1,538,698.17	-27,066,733.52	-28,605,431.69
本期基金份额交易产生的变动数	5,825,183.44	10,514,973.42	16,340,156.86
其中：基金申购款	19,173,066.32	14,224,446.79	33,397,513.11
基金赎回款	-13,347,882.88	-3,709,473.37	-17,057,356.25
本期已分配利润	-	-	-
本期末	30,171,808.38	-6,144,973.43	24,026,834.95

## 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2018年01月01日至2018年06月30日
活期存款利息收入	142,836.62
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	5,840.60
其他	8,072.97
合计	156,750.19

注：“其他”为申购款利息收入和结算保证金利息收入。

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2018年01月01日至2018年06月30日
卖出股票成交总额	280,284,503.78
减：卖出股票成本总额	282,696,858.63
买卖股票差价收入	-2,412,354.85

#### 6.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期内无基金投资收益。

#### 6.4.7.14 债券投资收益

##### 6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期内无债券投资收益。

##### 6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内无债券买卖差价收入。

##### 6.4.7.14.3 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。

##### 6.4.7.14.4 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。

##### 6.4.7.14.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.15 贵金属投资收益

##### 6.4.7.15.1 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。

##### 6.4.7.15.2 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。

#### 6.4.7.15.3 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。

#### 6.4.7.15.4 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。

#### 6.4.7.16 衍生工具收益

##### 6.4.7.16.1 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。

##### 6.4.7.16.2 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。

#### 6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日
股票投资产生的股利收益	2,076,337.58
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,076,337.58

#### 6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年01月01日至2018年06月30日
1. 交易性金融资产	-32,627,004.46
——股票投资	-32,627,004.46
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-

——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-32,627,004.46

## 6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2018年01月01日至2018年06月30日
基金赎回费收入	243,963.58
转换费收入	12,593.66
合计	256,557.24

## 6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2018年01月01日至2018年06月30日
交易所市场交易费用	796,594.84
银行间市场交易费用	-
合计	796,594.84

## 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2018年01月01日至2018年06月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	148,765.71
汇划手续费	2,534.74
账户维护费	9,000.00

合计	185,095.64
----	------------

#### 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
上海银行股份有限公司（“上海银行”）	基金托管人、基金代销机构
开源证券股份有限公司（“开源证券”）	基金管理人股东、基金代销机构
北京市中盛金期投资管理有限公司	基金管理人股东
北京长和世纪资产管理有限公司	基金管理人股东
深圳市和合投信资产管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
前海开源资产管理有限公司	基金管理人的子公司

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

### 6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行债券交易。

### 6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易，无佣金产生。

## 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 2018年01月01日至201 8年06月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至201 7年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,140,459.22	798,418.88
其中：支付销售机构的客户维护费	26,691.21	13,969.19

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.90%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.90\% \div \text{当年天数}$$

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3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。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018 年06月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017 年06月30日

当期发生的基金应支付的托管费	63,358.92	44,356.59
----------------	-----------	-----------

注：本基金的托管费按前一日资产净值的0.05%年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

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3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。

#### 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 2018年01月01日至2018年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	前海开源事件驱动混合A	前海开源事件驱动混合C	合计
前海开源基金管理有限公司	-	86,614.07	86,614.07
合计	-	86,614.07	86,614.07
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	前海开源事件驱动混合A	前海开源事件驱动混合C	合计
前海开源基金管理有限公司	-	56,687.92	56,687.92
合计	-	56,687.92	56,687.92

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。

本基金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。

销售服务费的计算方法如下：

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

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，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。

#### 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

本基金本报告期内及上年度可比期间与关联方无银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 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

前海开源事件驱动混合A

份额单位：份

项目	本期 2018年01月01日至2018年06 月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06 月30日
基金合同生效日（2013年12月19日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	10,001,250.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	10,001,250.00
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

前海开源事件驱动混合C

份额单位：份



项目	本期		上年度可比期间	
	2018年01月01日至2018年06月30日		2017年01月01日至2017年06月30日	
基金合同生效日（2013年12月19日）持有的基金份额	-	-	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-	-	-

注：基金管理人运用固有资金投资本基金相关费率按照基金合同及招募说明书规定执行。

#### 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		上年度可比期间	
	2018年01月01日至2018年06月30日		2017年01月01日至2017年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
上海银行股份有限公司	20,637,680.24	142,836.62	8,052,939.48	150,172.16

注：本基金的银行存款由基金托管人上海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

本基金本报告期内及上年度可比期间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

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况—非货币市场基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2018年06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
603693	江苏新能	2018-06-25	2018-07-03	-	9.00	9.00	5,384	48,456.00	48,456.00	-
603706	环宇申购	2018-06-29	-	-	13.09	13.09	1,765	23,103.85	23,103.85	-
603105	芯能申购	2018-06-29	-	-	4.83	4.83	3,410	16,470.30	16,470.30	-

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 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2018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2018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。

##### 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**

本基金本报告期末未持有短期信用评级的债券。

#### **6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末未持有短期信用评级的资产支持证券。

#### **6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末未持有短期信用评级的同业存单。

#### **6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期末未持有长期信用评级的债券。

#### **6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末未持有长期信用评级的资产支持证券。

#### **6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末未持有长期信用评级的同业存单。

### **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。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自2017年10月1日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不超过该上市公司可流通股票的15%；本基金与由本基金的基金管理人管理的其他全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制），同时，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注7.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### 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2018年06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	20,637,680.24	-	-	-	20,637,680.24
结算备付金	322,667.43	-	-	-	322,667.43
存出保证金	411,399.68	-	-	-	411,399.68
交易性金融资产	-	-	-	173,216,289.31	173,216,289.31
应收利息	-	-	-	4,489.84	4,489.84
应收申购款	-	-	-	44,885.03	44,885.03
资产总计	21,371,747.35	-	-	173,265,664.18	194,637,411.53
负债					
应付赎回款	-	-	-	140,880.84	140,880.84

应付管理人报酬	-	-	-	150,826.76	150,826.76
应付托管费	-	-	-	8,379.31	8,379.31
应付销售服务费	-	-	-	13,950.19	13,950.19
应付交易费用	-	-	-	173,687.17	173,687.17
其他负债	-	-	-	423,733.95	423,733.95
负债总计	-	-	-	911,458.22	911,458.22
利率敏感度缺口	21,371,747.35	-	-	172,354,205.96	193,725,953.31
上年度末2017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	85,147,904.38	-	-	-	85,147,904.38
结算备付金	1,204,524.65	-	-	-	1,204,524.65
存出保证金	448,288.55	-	-	-	448,288.55
交易性金融资产	-	-	-	137,305,924.98	137,305,924.98
应收利息	-	-	-	17,758.33	17,758.33
应收申购款	-	-	-	6,163,289.94	6,163,289.94
资产总计	86,800,717.58	-	-	143,486,973.25	230,287,690.83
负债					
应付证	-	-	-	4,403,642.59	4,403,642.59

券清算款					
应付赎回款	-	-	-	373,515.92	373,515.92
应付管理人报酬	-	-	-	148,917.40	148,917.40
应付托管费	-	-	-	8,273.18	8,273.18
应付销售服务费	-	-	-	10,627.03	10,627.03
应付交易费用	-	-	-	451,477.98	451,477.98
其他负债	-	-	-	500,123.01	500,123.01
负债总计	-	-	-	5,896,577.11	5,896,577.11
利率敏感度缺口	86,800,717.58	-	-	137,590,396.14	224,391,113.72

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

截至2018年6月30日，本基金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。

#### 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 2018年06月30日		上年度末 2017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	173,216,289.31	89.41	137,305,924.98	61.19
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	173,216,289.31	89.41	137,305,924.98	61.19

#### 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 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日

	权益性投资的市场价格 上升5%	11,876,578.12	8,139,441.79
	权益性投资的市场价格 下降5%	-11,876,578.12	-8,139,441.79

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项  
无。

## § 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	173,216,289.31	88.99
	其中：股票	173,216,289.31	88.99
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	20,960,347.67	10.77
8	其他各项资产	460,774.55	0.24
9	合计	194,637,411.53	100.00

### 7.2 报告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

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	58,247,011.42	30.07
C	制造业	61,193,475.08	31.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	71,559.85	0.04
E	建筑业	1,659,410.11	0.86
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	29,802,767.71	15.38
K	房地产业	22,160,839.00	11.44
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	81,226.14	0.04
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	173,216,289.31	89.41

### 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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601233	桐昆股份	990,761	17,060,904.42	8.81
2	600188	兖州煤业	1,300,606	16,959,902.2	8.75

				4	
3	002493	荣盛石化	1,564,050	16,140,996.00	8.33
4	601088	中国神华	720,522	14,367,208.68	7.42
5	601699	潞安环能	1,472,175	13,632,340.50	7.04
6	600348	XD阳泉煤	1,858,400	13,287,560.00	6.86
7	000703	恒逸石化	773,080	11,503,430.40	5.94
8	600346	恒力股份	740,100	10,849,866.00	5.60
9	600048	保利地产	484,500	5,910,900.00	3.05
10	601398	工商银行	1,051,300	5,592,916.00	2.89
11	001979	招商蛇口	274,300	5,225,415.00	2.70
12	601939	建设银行	776,710	5,087,450.50	2.63
13	002142	宁波银行	310,389	5,056,236.81	2.61
14	601318	中国平安	67,080	3,929,546.40	2.03
15	601288	农业银行	1,115,500	3,837,320.00	1.98
16	600019	宝钢股份	484,900	3,777,371.00	1.95
17	002146	荣盛发展	419,500	3,662,235.00	1.89
18	600383	金地集团	358,900	3,657,191.00	1.89
19	601601	中国太保	114,600	3,650,010.00	1.88
20	600606	绿地控股	429,200	2,806,968.00	1.45
21	600036	招商银行	100,200	2,649,288.00	1.37
22	603799	华友钴业	18,400	1,793,448.00	0.93
23	000961	中南建设	262,981	1,659,410.11	0.86
24	601155	新城控股	29,000	898,130.00	0.46
25	601330	绿色动力	4,971	81,226.14	0.04
26	603650	彤程新材	2,376	50,988.96	0.03

27	603693	江苏新能	5,384	48,456.00	0.03
28	603706	东方环宇	1,765	23,103.85	0.01
29	603105	芯能科技	3,410	16,470.30	0.01

## 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	600348	阳泉煤业	25,768,409.00	11.48
2	601088	中国神华	21,962,582.32	9.79
3	601233	桐昆股份	21,820,354.14	9.72
4	601939	建设银行	18,769,302.15	8.36
5	601699	潞安环能	17,749,663.00	7.91
6	600188	兖州煤业	14,696,551.29	6.55
7	600346	恒力股份	14,148,109.00	6.31
8	600019	宝钢股份	13,277,911.20	5.92
9	000703	恒逸石化	12,683,778.00	5.65
10	601601	中国太保	12,405,218.20	5.53
11	001979	招商蛇口	10,562,790.97	4.71
12	600036	招商银行	10,403,610.00	4.64
13	601288	农业银行	10,372,847.00	4.62
14	601818	光大银行	10,054,029.00	4.48
15	002493	荣盛石化	9,411,138.00	4.19
16	600029	南方航空	9,232,907.60	4.11
17	002304	洋河股份	8,630,589.00	3.85
18	601398	XD工商银	6,793,458.00	3.03
19	601328	交通银行	6,697,977.00	2.98
20	000983	西山煤电	6,663,403.00	2.97
21	601666	平煤股份	6,663,142.00	2.97
22	600507	方大特钢	6,580,141.00	2.93

23	600048	保利地产	6,541,090.00	2.92
24	601111	中国国航	6,364,768.00	2.84
25	002142	宁波银行	6,140,832.66	2.74
26	601001	大同煤业	5,572,871.00	2.48

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	002304	洋河股份	15,745,909.88	7.02
2	000858	五粮液	14,842,897.00	6.61
3	600519	贵州茅台	14,824,129.60	6.61
4	600702	舍得酒业	14,647,637.98	6.53
5	600779	水井坊	13,858,600.80	6.18
6	600809	山西汾酒	13,747,747.00	6.13
7	000568	泸州老窖	13,287,527.90	5.92
8	600348	阳泉煤业	13,187,529.00	5.88
9	601939	建设银行	12,073,082.00	5.38
10	600036	招商银行	11,584,483.00	5.16
11	601318	中国平安	11,298,208.00	5.04
12	601818	光大银行	8,830,890.00	3.94
13	600029	南方航空	8,100,729.44	3.61
14	601601	中国太保	8,014,179.00	3.57
15	601398	XD工商银	7,644,888.00	3.41
16	600019	宝钢股份	7,149,546.65	3.19
17	601328	交通银行	6,218,355.00	2.77
18	601666	平煤股份	6,072,032.00	2.71
19	600507	方大特钢	5,933,346.00	2.64
20	000983	西山煤电	5,735,690.00	2.56

21	601288	农业银行	5,512,660.00	2.46
22	601088	中国神华	5,443,213.60	2.43
23	601111	中国国航	5,274,676.00	2.35
24	601001	大同煤业	5,098,032.00	2.27

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	351,234,227.42
卖出股票收入（成交）总额	280,284,503.78

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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 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	411,399.68
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,489.84
5	应收申购款	44,885.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	460,774.55

### 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 事件 驱动 混合A	3,274	7,508.63	10,613,155.64	43.17%	13,970,099.94	56.83%
前海 开源 事件 驱动 混合C	1,126	122,642.05	133,985,731.76	97.02%	4,109,217.67	2.98%
合计	4,400	36,972.32	144,598,887.40	88.89%	18,079,317.61	11.11%

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	占基金总份额比
----	------	--------	---------

		(份)	例
基金管理人所有从业人员持有本基金	前海开源事件驱动混合A	177,771.08	0.7231%
	前海开源事件驱动混合C	-	-
	合计	177,771.08	0.1093%

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金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）。

### 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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	前海开源事件驱动混合A	0~10
	前海开源事件驱动混合C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	前海开源事件驱动混合A	10~50
	前海开源事件驱动混合C	0
	合计	10~50

### 8.4 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	1,000.00	0.00%	-	-	-
基金经理等人员	162,882.65	0.10%	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-

其他	13,888.43	0.01%	-	-	-
合计	177,771.08	0.11%	-	-	-

注：①上述份额总数为扣除认购费用并包含利息结转份额后的总份额数。

②本基金发起式资金提供方仅为基金管理人，基金管理人高级管理人员、基金经理、其他从业人员持有的基金份额不属于发起份额。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	前海开源事件驱动混合 A	前海开源事件驱动混合 C
基金合同生效日(2013年12月19日)基金份额总额	128,523,462.75	-
本报告期期初基金份额总额	49,172,456.27	117,673,490.95
本报告期基金总申购份额	23,617,957.99	88,998,812.49
减：本报告期基金总赎回份额	48,207,158.68	68,577,354.01
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	24,583,255.58	138,094,949.43

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

本基金报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 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

本报告期内本基金投资策略未改变。

## 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	
广发证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	2	317,061,574.71	50.36%	231,866.37	50.36%	-
银河证券	2	312,579,395.42	49.64%	228,589.90	49.64%	-
东方证券	2	-	-	-	-	-

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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-

### 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2017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	2018-01-02
2	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金参与中国农业银行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	2018-01-03
3	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	2018-01-03

4	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	2018-01-09
5	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	2018-01-16
6	前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金 2017 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	2018-01-18
7	前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加有鱼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	2018-01-22
8	前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书（更新）（2017 年第 2 号）	基金管理人的官方网站	2018-02-01
9	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	2018-02-01
10	前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2017 年第 2 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	2018-02-01
11	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	2018-02-02
12	前海开源基金管理有限公司关于中投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	2018-02-06
13	前海开源基金管理有限公司关于恒天明泽费率调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站	2018-02-06

	告	方网站	
14	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站	2018-02-07
15	前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金在利得基金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	2018-02-07
16	前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金在小牛投资咨询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	2018-02-07
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	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站	2018-02-08
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	2018-02-12
19	前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加懒猫金融为代销机构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	2018-03-09
20	前海开源基金管理有限公司关于中信建投费率调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站	2018-03-15
21	关于前海开源基金管理有限公司旗下基金根据流动性风险管理规定修改基金合同的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站	2018-03-24
22	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站	2018-03-24
23	前海开源事件驱动灵活配置	基金管理人的官方网站	2018-03-24

	混合型发起式证券投资基金基金合同（2018年3月修订）		
24	前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议（2018年3月修订）	基金管理人的官方网站	2018-03-24
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	2018-03-28
26	前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金2017年年度报告	基金管理人的官方网站	2018-03-29
27	前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金2017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	2018-03-29
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	2018-03-30
29	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	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站	2018-03-30
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	2018-04-04
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	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站	2018-04-09
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	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站	2018-04-19
33	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站	2018-04-19
34	前海开源基金管理有限公司	中国证券报、上海证券报、	2018-04-20



	关于旗下部分基金增加华西证券为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人的官方网站	
35	前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金 2018 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	2018-04-23
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	2018-05-08
37	前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加坤元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	2018-05-08
38	前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加和耕传承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	2018-05-08
39	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	2018-05-12
40	前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加招商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	2018-05-21
41	前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金在新兰德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	2018-05-31
42	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官	2018-06-09

	股票估值方法的提示性公告	方网站	
43	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	2018-06-12
44	前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加富国大通为代销机构并开通转换业务和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	2018-06-14
45	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	2018-06-20
46	前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加民商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	2018-06-27
47	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	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站	2018-06-29

## § 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	20180508 - 20180510	0.00	35,561,166.43	17,780,583.00	17,780,583.43	10.93%
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事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金设立的文件

(2) 《前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》

(3) 《前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议》

(4) 《前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式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) 前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式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](http://www.qhkyfund.com)

前海开源基金管理有限公司

二〇一八年八月二十七日