

前海开源工业革命 4.0 灵活配置混合型证券投资基金

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:中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
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	12
§6 半年度财务会计报告(未经审计)	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	16
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	43
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	43
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	43
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	43
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	44
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	44
7.12 投资组合报告附注	44
§8 基金份额持有人信息	45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	45

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	45
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.....	45
§9 开放式基金份额变动.....	46
§10 重大事件揭示.....	46
10.1 基金份额持有人大会决议.....	46
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.....	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	46
10.4 基金投资策略的改变.....	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	46
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.....	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	47
10.8 其他重大事件.....	50
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	56
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.....	56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	56
§12 备查文件目录.....	56
12.1 备查文件目录.....	56
12.2 存放地点.....	56
12.3 查阅方式.....	56

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	前海开源工业革命4.0灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	前海开源工业革命4.0混合
基金主代码	001103
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年03月27日
基金管理人	前海开源基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	483,042,850.03份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	<p>本基金主要通过精选投资于与工业革命4.0相关的优质证券，在合理控制风险并保持基金资产良好流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。</p> <p>工业革命4.0，即以智能制造为主导的第四次工业革命，旨在通过移动互联网、云计算、物联网、大数据等新一代信息技术在制造业的集成应用，将制造业推向智能化。工业革命4.0将带来制造业技术、产品、工艺、服务的全方位创新，不断催生和孕育出新技术、新业态和新模式。</p>
投资策略	<p>1、大类资产配置</p> <p>在大类资产配置中，本基金综合运用定性和定量的分析手段，在对宏观经济因素进行充分研究的基础上，判断宏观经济周期所处阶段。本基金将依据经济周期理论，结合对证券市场的系统性风险以及未来一段时期内各大类资产风险和预期收益率的评估，制定本基金在股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金所称的工业革命4.0主题相关股票是指上市公司中属于计算机、通信、电子、机械设备、家用</p>

	<p>电器、汽车和轻工制造行业的股票。本基金采用申银万国行业分类标准。</p> <p>本基金将精选有良好增值潜力的、与工业革命4.0主题相关的上市公司股票构建股票投资组合。工业革命4.0主题相关股票投资策略将从定性和定量两方面入手,定性方面主要考察上市公司所属行业发展前景、行业地位、竞争优势、管理团队、创新能力等多种因素;定量方面考量公司估值、资产质量及财务状况,比较分析各优质上市公司的估值、成长及财务指标,优先选择具有相对比较优势的公司作为最终股票投资对象。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>在债券投资策略方面,本基金将以工业革命4.0主题相关债券为主线,在综合研究的基础上实施积极主动的组合管理,采用宏观环境分析和微观市场定价分析两个方面进行债券资产的投资。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。</p> <p>4、权证投资策略</p> <p>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。</p> <p>5、股指期货投资策略</p> <p>本基金以套期保值为目的,参与股指期货交易。</p>
业绩比较基准	沪深300指数收益率×70%+中证全债指数收益率×30%。
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金,低于股票型基金。

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	中国建设银行股份有限公司	
信息披露负责人	姓名	傅成斌	田青
	联系电话	0755-88601888	010-67595096
	电子邮箱	qhky@qhkyfund.com	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话	4001666998	010-67595096	
传真	0755-83181169	010-66275853	
注册地址	深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）	北京市西城区金融大街25号	
办公地址	深圳市福田区深南大道7006号万科富春东方大厦2206	北京市西城区金融大街25号	
邮政编码	518040	100033	
法定代表人	王兆华	田国立	

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）
---------------	-------------------------------

本期已实现收益	23,634,960.10
本期利润	-12,251,201.49
加权平均基金份额本期利润	-0.0246
本期加权平均净值利润率	-1.96%
本期基金份额净值增长率	-2.04%
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	78,091,137.30
期末可供分配基金份额利润	0.1617
期末基金资产净值	561,133,987.33
期末基金份额净值	1.162
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	23.23%

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。

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

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	-0.94%	0.34%	-5.20%	0.90%	4.26%	-0.56%
过去三个月	-3.73%	0.38%	-6.39%	0.79%	2.66%	-0.41%
过去六个月	-2.04%	0.49%	-7.88%	0.81%	5.84%	-0.32%
过去一年	13.06%	0.90%	-1.55%	0.66%	14.61%	0.24%
过去三年	22.50%	1.11%	-11.17%	1.04%	33.67%	0.07%
自基金合同	23.23%	1.08%	-2.15%	1.12%	25.38%	-0.04%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

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

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

前海开源工业革命4.0灵活配置混合型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



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		
邱杰	本基金的 基金经 理、公司 董事总经 理、投资 部联席行 政负责人	2018-05- 07	-	10年	邱杰先生，经济学硕士。历任南方基金管理有限公司研究部行业研究员、中小盘股票研究员、制造业组组长；建信基金管理有限公司研究员。现任前海开源基金管理有限公司董事总经理、投资部联席行政负责人。
薛小波	本基金的 基金经 理、公司 执行投资 总监	2015-03- 27	2018-05- 07	11年	薛小波先生，清华大学工程力学学士、流体力学硕士。2006年7月至2014年4月任中信证券机械行业和军工行业首席分析师、高级副总裁。曾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

上半年国内经济下行压力开始显现，消费、投资及净出口均表现趋弱；CPI保持低位，PPI高位徘徊；“去杠杆”政策持续推进，融资环境显著收紧，信用风险事件时有发生。受金融“去杠杆”及中美关系的影响，上半年A股市场出现下跌，其中沪深300指数下跌12.9%，创业板指数下跌8.3%。

本基金权益仓位有所降低，并主要持有成长性和估值匹配、业绩增长确定性高的个股，上半年净值略有下跌。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末前海开源工业革命4.0混合基金份额净值为1.162元，本报告期内，基金份额净值增长率为-2.04%，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

我们认为“去杠杆”对于防范化解金融风险、提高经济增长质量意义重大，预计“去杠杆”政策仍将坚定推进，这可能会对短期经济增长和市场流动性造成一定冲击；同时国际环境的不确定性可能长期存在，对我国出口和国际经济技术合作的影响仍将持续，达到新的均衡状态还需要时间。

我们将从具备长期增长潜力的行业中精选拥有核心竞争力、估值与成长相匹配的优质个股，以上市公司的长期业绩成长来对抗市场短期波动的影响，争取为投资者创造可持续的稳健的投资回报。

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

本基金本报告期内实施利润分配一次，2018年6月28日前海开源工业革命4.0混合基金每10份基金份额分配0.7元，分配利润33,580,820.87元。

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，中国建设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。

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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，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，本基金实施利润分配的金额为33,580,820.87元。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 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：前海开源工业革命4.0灵活配置混合型证券投资基金

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
资产：			
银行存款	6.4.7.1	31,754,793.13	319,090,509.88
结算备付金		5,084,727.58	743,382.43
存出保证金		235,924.55	323,483.47
交易性金融资产	6.4.7.2	303,332,037.52	161,973,129.51
其中：股票投资		88,886,812.42	161,973,129.51
基金投资		-	-
债券投资		214,445,225.10	-
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	220,000,000.00	-
应收证券清算款		823,445.33	137,732,995.60
应收利息	6.4.7.5	1,174,272.28	23,103.53
应收股利		-	-
应收申购款		482,746.49	72,101.05
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		562,887,946.88	619,958,705.47
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日

负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		209,347.12	998,937.64
应付管理人报酬		736,279.34	786,516.94
应付托管费		122,713.19	131,086.17
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	241,971.61	881,906.11
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	443,648.29	520,440.52
负债合计		1,753,959.55	3,318,887.38
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	483,042,850.03	490,344,342.67
未分配利润	6.4.7.1 0	78,091,137.30	126,295,475.42
所有者权益合计		561,133,987.33	616,639,818.09
负债和所有者权益总计		562,887,946.88	619,958,705.47

注：报告截止日2018年6月30日，前海开源工业革命4.0基金份额净值1.162元，基金份额总额483,042,850.03份。

6.2 利润表

会计主体：前海开源工业革命4.0灵活配置混合型证券投资基金

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	本期2018年01月01	上年度可比期间
-----	----	--------------	---------

	号	日至2018年06月30 日	2017年01月01日至201 7年06月30日
一、收入		-5,763,681.03	98,899,661.55
1. 利息收入		3,240,381.51	309,415.69
其中：存款利息收入	6.4.7.1 1	1,261,131.24	309,415.69
债券利息收入		789,909.93	-
资产支持证券利息收 入		-	-
买入返售金融资产收 入		1,189,340.34	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填 列）		26,550,872.08	1,946,523.13
其中：股票投资收益	6.4.7.1 2	25,920,955.21	-2,880,716.05
基金投资收益	6.4.7.1 3	-	-
债券投资收益	6.4.7.1 4	-	-
资产支持证券投资收 益	6.4.7.1 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	629,916.87	4,827,239.18
3. 公允价值变动收益（损失以 “-”号填列）	6.4.7.1 8	-35,886,161.59	96,458,402.42
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	331,226.97	185,320.31
减：二、费用		6,487,520.46	9,624,723.68
1. 管理人报酬	6.4.10. 2.1	4,658,232.75	6,503,369.88
2. 托管费	6.4.10. 2.2	776,372.13	1,083,895.03
3. 销售服务费	6.4.10. 2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.2 0	872,718.85	1,855,549.92
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	180,196.73	181,908.85
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-12,251,201.49	89,274,937.87
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-12,251,201.49	89,274,937.87

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：前海开源工业革命4.0灵活配置混合型证券投资基金

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）	490,344,342.67	126,295,475.42	616,639,818.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动	-	-12,251,201.49	-12,251,201.49

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)	-7,301,492.64	-2,372,315.76	-9,673,808.40
其中:1.基金申购款	171,388,070.97	43,377,469.29	214,765,540.26
2.基金赎回款	-178,689,563.61	-45,749,785.05	-224,439,348.66
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)	-	-33,580,820.87	-33,580,820.87
五、期末所有者权益(基金净值)	483,042,850.03	78,091,137.30	561,133,987.33
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)	980,956,585.98	-10,438,137.62	970,518,448.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	89,274,937.87	89,274,937.87
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)	-241,214,088.69	-12,091,829.79	-253,305,918.48
其中:1.基金申购款	58,082,812.04	600,051.38	58,682,863.42
2.基金赎回款	-299,296,900.73	-12,691,881.17	-311,988,781.90
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)	739,742,497.29	66,744,970.46	806,487,467.75

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

前海开源工业革命4.0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【2015】290号文《关于准予前海开源工业革命4.0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》、《前海开源工业革命4.0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2015年3月9日至2015年3月25日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集4,616,953,545.83元，经瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）瑞华验字[2015]02030020号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《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合同》于2015年3月27日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为4,618,104,097.78份基金份额，其中认购资金利息折合1,150,551.95份基金份额。本基金的基金管理人为前海开源基金管理有限公司，本基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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行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	31,754,793.13
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	31,754,793.13

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	91,374,473.87	88,886,812.42	-2,487,661.45
贵金属投资-金	-	-	-

交易所黄金合约				
债券	交易所市场	15,892,797.60	15,850,225.10	-42,572.50
	银行间市场	198,664,500.00	198,595,000.00	-69,500.00
	合计	214,557,297.60	214,445,225.10	-112,072.50
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		305,931,771.47	303,332,037.52	-2,599,733.95

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

单位：人民币元

项目	本期末2018年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
交易所市场	220,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	220,000,000.00	-

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	9,236.12
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	2,059.29
应收债券利息	1,123,985.65
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	38,895.64
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	95.58
合计	1,174,272.28

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	241,971.61
银行间市场应付交易费用	-
合计	241,971.61

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	87.39
预提费用	443,560.90
合计	443,648.29

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2018年01月01日至2018年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	490,344,342.67	490,344,342.67
本期申购	171,388,070.97	171,388,070.97
本期赎回（以“-”号填列）	-178,689,563.61	-178,689,563.61
本期末	483,042,850.03	483,042,850.03

注：申购含红利再投、转换入份（金）额；赎回含转换出份（金）额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	166,021,248.76	-39,725,773.34	126,295,475.42
本期利润	23,634,960.10	-35,886,161.59	-12,251,201.49
本期基金份额交易产生的变动数	-3,002,125.96	629,810.20	-2,372,315.76
其中：基金申购款	64,268,733.01	-20,891,263.72	43,377,469.29
基金赎回款	-67,270,858.97	21,521,073.92	-45,749,785.05
本期已分配利润	-33,580,820.87	-	-33,580,820.87
本期末	153,073,262.03	-74,982,124.73	78,091,137.30

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	1,242,662.38
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	10,032.85
其他	8,436.01

合计	1,261,131.24
----	--------------

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	350,302,828.00
减：卖出股票成本总额	324,381,872.79
买卖股票差价收入	25,920,955.21

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	629,916.87
基金投资产生的股利收益	-
合计	629,916.87

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	-35,886,161.59
——股票投资	-35,774,089.09
——债券投资	-112,072.50
——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	-35,886,161.59

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	327,808.89
转换费收入	3,418.08
合计	331,226.97

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	872,718.85
银行间市场交易费用	-
合计	872,718.85

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	6,275.83

账户维护费	360.00
合计	180,196.73

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
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	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	4,658,232.75	6,503,369.88
其中：支付销售机构的客户维护费	2,989,888.97	3,351,587.95

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

基金管理费每日计提，按月支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，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	上年度可比期间 2017年01月01日至2017
----	------------------------	-----------------------------

	年06月30日	年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	776, 372. 13	1, 083, 895. 03

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

基金托管费每日计提，按月支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

本报告期内及上年度可比期间内关联方未从本基金获得销售服务费。

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

本报告期内及上年度可比期间内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	31, 754, 793. 13	1, 242, 662. 38	85, 301, 129. 15	300, 734. 74

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设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

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
1	2018-06-28	2018-06-28	0.700	30,203,653.49	3,377,167.38	33,580,820.87	-
合计			0.700	30,203,653.49	3,377,167.38	33,580,820.87	-

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**

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。

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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	198,596,000.10	-
合计	198,596,000.10	-

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

6.4.13.2.2 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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	-	-
未评级	15,849,225.00	-
合计	15,849,225.00	-

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

6.4.13.2.5 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股票不超过该上市公司可流通股股票的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股票，不得超过该上市公司可流通股股票的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	31,754,793.13	-	-	-	31,754,793.13
结算备	5,084,727.58	-	-	-	5,084,727.58

付金					
存出保证金	235,924.55	-	-	-	235,924.55
交易性金融资产	214,445,225.10	-	-	88,886,812.42	303,332,037.52
买入返售金融资产	220,000,000.00	-	-	-	220,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	823,445.33	823,445.33
应收利息	-	-	-	1,174,272.28	1,174,272.28
应收申购款	-	-	-	482,746.49	482,746.49
资产总计	471,520,670.36	-	-	91,367,276.52	562,887,946.88
负债					
应付赎回款	-	-	-	209,347.12	209,347.12
应付管理人报酬	-	-	-	736,279.34	736,279.34
应付托管费	-	-	-	122,713.19	122,713.19
应付交易费用	-	-	-	241,971.61	241,971.61
其他负债	-	-	-	443,648.29	443,648.29
负债总计	-	-	-	1,753,959.55	1,753,959.55
利率敏感度缺口	471,520,670.36	-	-	89,613,316.97	561,133,987.33
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	319,090,509.88	-	-	-	319,090,509.88
结算备付金	743,382.43	-	-	-	743,382.43
存出保证金	323,483.47	-	-	-	323,483.47
交易性金融资产	-	-	-	161,973,129.51	161,973,129.51
应收证券清算款	-	-	-	137,732,995.60	137,732,995.60
应收利息	-	-	-	23,103.53	23,103.53
应收申购款	-	-	-	72,101.05	72,101.05
资产总计	320,157,375.78	-	-	299,801,329.69	619,958,705.47
负债					
应付赎回款	-	-	-	998,937.64	998,937.64
应付管理人报酬	-	-	-	786,516.94	786,516.94
应付托管费	-	-	-	131,086.17	131,086.17
应付交易费用	-	-	-	881,906.11	881,906.11
其他负债	-	-	-	520,440.52	520,440.52
负债总计	-	-	-	3,318,887.38	3,318,887.38
利率敏感度缺口	320,157,375.78	-	-	296,482,442.31	616,639,818.09

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日期或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位:人民币元)	
		本期末 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
	基准点利率增加0.25%	-82,995.67	-
	基准点利率减少0.25%	83,088.08	-

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	88,886,812.42	15.84	161,973,129.51	26.27

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	88,886,812.42	15.84	161,973,129.51	26.27

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%	5,029,595.50	11,863,296.63
权益性投资的市场价格下降5%	-5,029,595.50	-11,863,296.63	

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	88,886,812.42	15.79

	其中：股票	88,886,812.42	15.79
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	214,445,225.10	38.10
	其中：债券	214,445,225.10	38.10
	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	220,000,000.00	39.08
	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	36,839,520.71	6.54
8	其他各项资产	2,716,388.65	0.48
9	合计	562,887,946.88	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	-	-
C	制造业	67,937,512.42	12.11
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	5,326,800.00	0.95
G	交通运输、仓储和邮政业	3,713,500.00	0.66
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	11,909,000.00	2.12
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	88,886,812.42	15.84

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	603008	喜临门	831,966	16,456,287.48	2.93
2	000921	海信科龙	1,071,400	11,099,704.00	1.98
3	002327	富安娜	750,000	8,130,000.00	1.45
4	603839	安正时尚	349,920	6,337,051.20	1.13
5	002179	中航光电	161,227	6,287,853.00	1.12
6	601155	新城控股	200,000	6,194,000.00	1.10
7	002025	航天电器	247,953	5,727,714.30	1.02
8	001979	招商蛇口	300,000	5,715,000.00	1.02
9	002035	华帝股份	220,000	5,374,600.00	0.96
10	000963	华东医药	110,400	5,326,800.00	0.95
11	002007	华兰生物	137,640	4,426,502.40	0.79
12	002120	韵达股份	70,000	3,713,500.00	0.66
13	002614	奥佳华	143,900	2,977,291.00	0.53
14	300750	宁德时代	10,261	738,381.56	0.13

15	300136	信维通信	8,400	258,132.00	0.05
16	300747	锐科激光	1,543	123,995.48	0.02

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	603008	喜临门	18,701,266.80	3.03
2	002690	美亚光电	13,407,499.97	2.17
3	600498	烽火通信	13,285,942.00	2.15
4	600201	生物股份	13,086,867.61	2.12
5	002202	金风科技	12,958,416.93	2.10
6	600482	中国动力	12,717,527.54	2.06
7	000921	海信科龙	12,245,446.02	1.99
8	002236	大华股份	9,910,335.00	1.61
9	300182	捷成股份	9,397,619.00	1.52
10	601933	永辉超市	9,381,378.72	1.52
11	002327	富安娜	8,879,922.80	1.44
12	002179	中航光电	7,948,925.66	1.29
13	002572	索菲亚	7,057,463.00	1.14
14	001979	招商蛇口	6,859,631.81	1.11
15	603839	安正时尚	6,740,225.40	1.09
16	600060	XD海信电	6,660,372.66	1.08
17	002383	合众思壮	6,548,688.00	1.06
18	000333	美的集团	6,515,770.91	1.06
19	300271	华宇软件	6,484,402.00	1.05
20	600196	复星医药	6,302,926.00	1.02

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	600703	三安光电	23,745,752.01	3.85
2	002236	大华股份	22,818,433.24	3.70
3	000725	京东方 A	21,362,573.24	3.46
4	002008	大族激光	20,892,887.10	3.39
5	601012	隆基股份	20,673,125.00	3.35
6	002690	美亚光电	14,367,012.59	2.33
7	300166	东方国信	14,170,211.00	2.30
8	600498	烽火通信	14,058,445.00	2.28
9	300271	华宇软件	13,078,675.77	2.12
10	002202	金风科技	12,613,250.86	2.05
11	600482	中国动力	12,320,842.23	2.00
12	600522	中天科技	12,320,662.14	2.00
13	600201	生物股份	11,991,840.86	1.94
14	600183	生益科技	10,349,710.00	1.68
15	002179	中航光电	10,319,581.40	1.67
16	601933	永辉超市	9,764,605.00	1.58
17	300182	捷成股份	8,332,032.00	1.35
18	300628	亿联网络	7,149,560.60	1.16
19	002572	索菲亚	7,129,219.00	1.16
20	600196	复星医药	7,058,278.00	1.14

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	287,069,644.79
卖出股票收入（成交）总额	350,302,828.00

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	198,596,000.10	35.39
2	央行票据	-	-
3	金融债券	15,849,225.00	2.82
	其中：政策性金融债	15,849,225.00	2.82
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	-	-
9	其他	-	-
10	合计	214,445,225.10	38.22

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	189921	18贴现国债21	1,500,000	148,950,000.00	26.54
2	189923	18贴现国债23	500,000	49,645,000.00	8.85
3	018002	国开1302	156,150	15,849,225.00	2.82
4	019571	17国债17	10	1,000.10	-

注：本基金本报告期末仅持有以上债券。

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	235,924.55
2	应收证券清算款	823,445.33
3	应收股利	-

4	应收利息	1,174,272.28
5	应收申购款	482,746.49
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,716,388.65

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

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
8,252	58,536.46	131,360,587.5 5	27.19%	351,682,262.4 8	72.81%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	0.00%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
----	-------------------

本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2015年03月27日)基金份额总额	4,618,104,097.78
本报告期期初基金份额总额	490,344,342.67
本报告期基金总申购份额	171,388,070.97
减：本报告期基金总赎回份额	178,689,563.61
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	483,042,850.03

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	
山西证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	235,276,355.90	36.93%	172,056.12	36.93%	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-

恒泰 证券	2	-	-	-	-	-
方正 证券	2	-	-	-	-	-
申万 宏源 西部	2	-	-	-	-	-
西藏 东方 财富 证券	2	-	-	-	-	-
大同 证券	2	-	-	-	-	-
中泰 证券	2	-	-	-	-	-
华鑫 证券	2	-	-	-	-	-
东北 证券	2	-	-	-	-	-
中信 证券	2	-	-	-	-	-
新时 代证 券	2	395,845,207.62	62.14%	289,482.53	62.14%	-
广发 证券	2	-	-	-	-	-
国信 证券	2	-	-	-	-	-
平安 证券	2	-	-	-	-	-
中信 建投	2	5,934,144.00	0.93%	4,339.72	0.93%	-
西南	2	-	-	-	-	-

证券						
----	--	--	--	--	--	--

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
山西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-	-	-
红塔证券	15,892,797.60	100.00%	1,237,500,000.00	53.01%	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-	-	-

国金证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏 源西部	-	-	-	-	-	-	-	-
西藏东 方财富 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
大同证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
华鑫证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
新时代 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建 投	-	-	1,096,900,000.00	46.99%	-	-	-	-
西南证 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	2018-01-03

	股票估值方法的提示性公告	方网站	
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	2018-01-09
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	2018-01-16
5	前海开源工业革命4.0灵活配置混合型证券投资基金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
6	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
7	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
8	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
9	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
10	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
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	2018-02-07
12	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	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

	与其费率优惠活动的公告		
13	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
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	2018-02-08
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	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
16	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
17	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
18	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
19	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合同（2018年3月修订）	基金管理人的官方网站	2018-03-24
20	前海开源工业革命4.0灵活配置混合型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
21	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站	2018-03-28
22	前海开源工业革命4.0灵活配置混合型证券投资基金20	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官	2018-03-29

	17年年度报告摘要	方网站	
23	前海开源工业革命4.0灵活配置混合型证券投资基金2017年年度报告	基金管理人的官方网站	2018-03-29
24	前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加恒宇天泽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	2018-03-30
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	2018-03-30
26	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告	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
27	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站	2018-04-09
28	前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加基煜基金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	2018-04-11
29	前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加联储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	2018-04-12
30	前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加盈信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	2018-04-13
31	前海开源基金管理有限公司	中国证券报、上海证券报、	2018-04-19

	关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告	证券时报、基金管理人的官方网站	
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	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站	2018-04-20
34	前海开源工业革命4.0灵活配置混合型证券投资基金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
35	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站	2018-05-08
36	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
37	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
38	前海开源工业革命4.0灵活配置混合型证券投资基金变更基金经理的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站	2018-05-09
39	前海开源工业革命4.0灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2018年第1号）	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站	2018-05-10
40	前海开源工业革命4.0灵活	基金管理人的官方网站	2018-05-10

	配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2018年第1号）		
41	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
42	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
43	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
44	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	2018-06-09
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	2018-06-12
46	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
47	关于前海开源工业革命4.0灵活配置混合型证券投资基金限制大额申购、定期定额投资及转换转入业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站	2018-06-26
48	前海开源工业革命4.0灵活配置混合型证券投资基金第一次收益分配公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站	2018-06-26
49	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	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

	和转换业务并参与其费率优惠活动的公告		
--	--------------------	--	--

§ 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
无。

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工业革命4.0灵活配置混合型证券投资基金设立的文件

(2) 《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合同》

(3) 《前海开源工业革命4.0灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

(4) 《前海开源工业革命4.0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) 前海开源工业革命4.0灵活配置混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

12.3 查阅方式

(1) 投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件

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

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

前海开源基金管理有限公司

二〇一八年八月二十七日

