
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

2019 年半年度报告摘要

2019 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:中国银河证券股份有限公司

送出日期:2019 年 08 月 24 日

§ 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。

基金托管人中国银河证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告期自 2019 年 01 月 01 日起至 2019 年 06 月 30 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

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	
基金简称	前海开源一带一路混合	
基金主代码	001209	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年04月29日	
基金管理人	前海开源基金管理有限公司	
基金托管人	中国银河证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	238,622,162.20份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	前海开源一带一路混合A	前海开源一带一路混合C
下属分级基金的交易代码	001209	002080
报告期末下属分级基金的份额总额	227,925,803.45份	10,696,358.75份

2.2 基金产品说明

投资目标	<p>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。</p>
投资策略	<p>本基金的投资策略主要有以下五方面内容：</p> <p>1、大类资产配置</p> <p>在大类资产配置中，本基金综合运用定性和定量的分析手段，在对宏观经济因素进行充分研究的基础上，判断宏观经济周期所处阶段。本基金将依据经济周期理论，结合对证券市场的系统性风险以及未来一段时期内各大类资产风险和预期收益率的评估，制定本基金在股票、债券、现金等大类资产之间的配置比</p>

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。

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。
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	中国银河证券股份有限公司
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	95551; 400-888-8888
传真	0755-83181169	010-66568532

2.4 信息披露方式

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

§ 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(2019年01月01日-2019年06月30日)	
	前海开源一带一路混合 A	前海开源一带一路混合 C
本期已实现收益	13,476,403.06	31,477.40
本期利润	23,928,097.83	-382,310.88
加权平均基金份额本期利润	0.1033	-0.0481
本期基金份额净值增长率	14.59%	14.60%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年06月30日)	
期末可供分配基金份额利润	-0.1980	-0.1179
期末基金资产净值	184,365,546.06	9,490,231.64
期末基金份额净值	0.809	0.887

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

前海开源一带一路混合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	6.59%	1.22%	3.95%	0.81%	2.64%	0.41%
过去三 个月	-7.33%	1.64%	-0.50%	1.06%	-6.83%	0.58%
过去六 个月	14.59%	1.61%	19.36%	1.08%	-4.77%	0.53%
过去一	0.50%	1.32%	8.87%	1.07%	-8.37%	0.25%

年						
过去三年	-22.44%	1.08%	19.30%	0.78%	-41.74%	0.30%
自基金合同生效起至今	-19.10%	0.98%	-6.53%	1.11%	-12.57%	-0.13%

前海开源一带一路混合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	6.48%	1.23%	3.95%	0.81%	2.53%	0.42%
过去三个月	-7.31%	1.64%	-0.50%	1.06%	-6.81%	0.58%
过去六个月	14.60%	1.61%	19.36%	1.08%	-4.76%	0.53%
过去一年	0.34%	1.33%	8.87%	1.07%	-8.53%	0.26%
过去三年	-21.85%	1.09%	19.30%	0.78%	-41.15%	0.31%
自基金合同生效起至今	-11.30%	1.05%	7.45%	0.88%	-18.75%	0.17%

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%。

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

前海开源一带一路混合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



前海开源一带一路混合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



注：本基金自 2015 年 11 月 16 日起，增加 C 类基金份额并设置对应基金代码。

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83只开放式基金，资产管理规模超过626.78亿元。

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		
苏天杉	本基金的基金经理、公司执行投资总监	2018-02-09	-	7年	苏天杉先生，美国罗彻斯特大学商学院MBA、对外经济贸易大学管理学硕士、美国注册金融分析师（CFA）。2011年加入美国领航基金（Vanguard Group）费城总部，任投资管理部投资分析师。曾任英特尔（Intel）全球新兴市场情报分析经理，高级分析师。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合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、本基金《基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

基金在2019上半年以稳健为目标，坚持价值投资。国际贸易形势的恶化对整体市场都产生了负面影响，特定行业和公司尤甚。本基金继续投资于有竞争力的行业和公司，坚持在公司层面精选个股，选取在国内外市场有竞争力的标的。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末前海开源一带一路混合A基金份额净值为0.809元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为14.59%，同期业绩比较基准收益率为19.36%；截至报告期末前海

开源一带一路混合C基金份额净值为0.887元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为14.60%，同期业绩比较基准收益率为19.36%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

预计国际贸易形势在短期内很难好转，这对于全球经济尤其是我国经济的增长是一个不可控因素。国际政治预计仍将是市场的重要决定因素。美联储预计会转向宽松，国内政策预计会对特定领域进行宽松。因此，下半年的股票市场预计仍将维持波动的行情。

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。估值委员会由督察长、基金核算部、监察稽核部、金融工程部、交易部、投资研究部门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债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供固定收益品种的估值数据。

本基金本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银河证券股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人按照《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，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。

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

本托管人依法复核前海开源基金管理有限公司编制和披露的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2019年半年度报告中财务指标、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，以上内容真实、准确和完整。

§ 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：前海开源一带一路主题精选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2019年06月30日

单位：人民币元

资产	本期末 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
资产：		
银行存款	17,030,506.00	19,661,062.91
结算备付金	115,836.84	600,088.99
存出保证金	192,463.68	177,593.65
交易性金融资产	177,543,108.02	150,886,804.67
其中：股票投资	177,543,108.02	150,886,804.67
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	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	3,427,418.53

应收利息	3,548.42	3,989.78
应收股利	-	-
应收申购款	29,071.47	16,907.30
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	194,914,534.43	174,773,865.83
负债和所有者权益	本期末 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	5,539,532.63
应付赎回款	215,920.15	49,352.78
应付管理人报酬	230,618.52	221,556.23
应付托管费	38,436.42	36,926.05
应付销售服务费	804.64	259.09
应付交易费用	229,233.98	226,912.60
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	343,743.02	510,003.02
负债合计	1,058,756.73	6,584,542.40
所有者权益:		
实收基金	238,622,162.20	237,950,504.27
未分配利润	-44,766,384.50	-69,761,180.84
所有者权益合计	193,855,777.70	168,189,323.43
负债和所有者权益总计	194,914,534.43	174,773,865.83

注：报告截止日2019年6月30日，前海开源一带一路混合基金份额总额238,622,162.20份。其中，前海开源一带一路混合A类基金份额净值0.809元，基金份额总额为227,925,803.45份；前海开源一带一路混合C类基金份额净值0.887元，基金份额总额为10,696,358.75份。

6.2 利润表

会计主体：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

本报告期：2019年01月01日至2019年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期2019年01月01日 至2019年06月30日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日
一、收入	26,307,056.43	-10,668,331.37
1. 利息收入	66,162.96	458,370.37
其中：存款利息收入	66,162.96	276,753.88
债券利息收入	-	66,673.97
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	114,942.52
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	16,089,277.88	-21,085,671.10
其中：股票投资收益	14,363,282.73	-21,670,584.92
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	1,725,995.15	584,913.82
3. 公允价值变动收益（损失以	10,037,906.49	9,867,703.07

“-”号填列)		
4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列)	-	-
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	113,709.10	91,266.29
减: 二、费用	2,761,269.48	2,900,753.30
1. 管理人报酬	1,424,023.33	1,603,983.74
2. 托管费	237,337.20	267,330.66
3. 销售服务费	3,442.29	2,537.40
4. 交易费用	1,000,843.06	853,340.60
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	95,623.60	173,560.90
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	23,545,786.95	-13,569,084.67
减: 所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	23,545,786.95	-13,569,084.67

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 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

本报告期: 2019年01月01日至2019年06月30日

单位: 人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019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)	237,950,504.27	-69,761,180.84	168,189,323.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	23,545,786.95	23,545,786.95
三、本期基金份额交易产生的	671,657.93	1,449,009.39	2,120,667.32

基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	40,192,002.91	-4,161,915.31	36,030,087.60
2. 基金赎回款	-39,520,344.98	5,610,924.70	-33,909,420.28
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)	238,622,162.20	-44,766,384.50	193,855,777.70
项 目	上年度可比期间 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)	276,805,138.26	-39,542,133.24	237,263,005.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-13,569,084.67	-13,569,084.67
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)	-29,168,181.42	5,295,587.77	-23,872,593.65
其中：1. 基金申购款	25,759,865.13	-3,298,722.91	22,461,142.22
2. 基金赎回款	-54,928,046.55	8,594,310.68	-46,333,735.87
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)	247,636,956.84	-47,815,630.14	199,821,326.70

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

何隼

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

前海开源一带一路主题精选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】426号文《关于准予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》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4月14日至2015年4月27日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集1,613,336,326.04元，经瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）瑞华验字[2015]02030037号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《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》于2015年4月29日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为1,613,952,378.29份基金份额，其中认购资金利息折合616,052.25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银河证券股份有限公司。

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》及其他中国证监会、中国证券投资基金业协会发布的有关规定和指引编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

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[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]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]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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》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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(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。

基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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
中国银河证券股份有限公司（“银河证券”）	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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年01月01日 至2019年06月30 日		上年度可比期间 2018年01月01日 至2018年06月30 日	
	成交 金额	占当期 股票成 交总额 的比例	成交 金额	占当期 股票成 交总额 的比例
中国银河证券股份有限公司（“银河证券”）	758,282,251.66	100.00%	1,925,276.00	0.33%

6.4.8.1.2 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。

6.4.8.1.3 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。

6.4.8.1.4 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。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年01月01日至2019年06月30日			
	当期 佣金	占当期 佣金总 量的比 例	期末应 付佣金 余额	占期末应 付佣金总 额的比例
中国银河证券股份有限公司（“银河证券”）	554,532.39	100.00%	229,233.98	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日			

	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中国银河证券股份有限公司（“银河证券”）	1,407.92	0.33%	1,407.92	0.90%

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,424,023.33	1,603,983.74
其中：支付销售机构的客户维护费	1,093,916.79	677,096.63

注：①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。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	237,337.20	267,330.66

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。

6.4.8.2.3 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 2019年01月01日至2019年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	前海开源一带一路混合A	前海开源一带一路混合C	合计
前海开源基金管理有限公司	0.00	26.29	26.29
开源证券股份有限公司	0.00	0.85	0.85
合计	0.00	27.14	27.14
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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		
	前海开源一带一路混合A	前海开源一带一路混合C	合计
前海开源基金管理有限公司	0.00	4.86	4.86
合计	0.00	4.86	4.86

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0.1%。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：

$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$

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。

6.4.8.3 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。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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。

6.4.8.4.2 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。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

无。

6.4.8.6 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。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

6.4.8.7.1 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。

6.4.9 期末(2019年06月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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
601236	红塔证券	2019-06-26	2019-07-05	新股流通受限	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-
3007	中信	2019	2019	新股	14.8	14.8	1,556	23,128	23,128	-

88	出版	-06- 27	-07- 05	流通 受限	5	5		06.6 0	06.6 0	
----	----	------------	------------	----------	---	---	--	-----------	-----------	--

6.4.9.2 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。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2019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。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2019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。

6.4.10 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	177,543,108.02	91.09
	其中：股票	177,543,108.02	91.09
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	17,146,342.84	8.80
8	其他各项资产	225,083.57	0.12
9	合计	194,914,534.43	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

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	8,062,332.83	4.16
C	制造业	102,020,581.90	52.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,761,440.00	4.00
E	建筑业	13,874,649.69	7.16
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	2,882,032.00	1.49
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,404,754.26	6.91
J	金融业	13,423,564.94	6.92
K	房地产业	9,233,520.00	4.76
L	租赁和商务服务业	5,649,841.80	2.91
M	科学研究和技术服务业	1,207,284.00	0.62
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	23,106.60	0.01
S	综合	-	-
	合计	177,543,108.02	91.59

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前十名股票投资明细

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	600276	恒瑞医药	145,360	9,593,760.00	4.95
2	000043	中航善达	779,200	9,233,520.00	4.76
3	600585	海螺水泥	209,800	8,706,700.00	4.49
4	600030	中信证券	350,600	8,347,786.00	4.31
5	300450	先导智能	235,525	7,913,640.00	4.08
6	600900	长江电力	433,600	7,761,440.00	4.00
7	000338	潍柴动力	602,600	7,405,954.00	3.82
8	603444	吉比特	34,300	7,201,628.00	3.71
9	601088	中国神华	344,176	7,014,306.88	3.62
10	000858	五粮液	54,000	6,369,300.00	3.29

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 www.qhkyfund.com 网站的半年度报告正文。

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	600536	中国软件	14,536,917.25	8.64
2	002174	游族网络	14,100,883.00	8.38
3	600131	岷江水电	10,755,045.00	6.39
4	600036	招商银行	10,622,415.00	6.32
5	002157	正邦科技	10,216,614.36	6.07
6	002640	跨境通	9,972,849.00	5.93

7	000063	中兴通讯	8,737,513.00	5.20
8	000043	中航善达	8,673,458.00	5.16
9	600703	三安光电	8,635,580.00	5.13
10	600030	中信证券	8,496,086.00	5.05
11	300750	宁德时代	8,368,746.24	4.98
12	002439	启明星辰	8,334,169.61	4.96
13	601162	天风证券	8,235,496.00	4.90
14	000338	潍柴动力	8,227,654.81	4.89
15	300340	科恒股份	8,210,779.00	4.88
16	600660	福耀玻璃	8,127,884.17	4.83
17	300571	平治信息	8,119,554.50	4.83
18	300498	温氏股份	8,103,854.40	4.82
19	600585	海螺水泥	8,091,253.00	4.81
20	300059	东方财富	8,079,619.00	4.80
21	002701	奥瑞金	7,863,683.00	4.68
22	600900	长江电力	7,670,114.23	4.56
23	603444	吉比特	7,493,895.00	4.46
24	300747	锐科激光	7,188,217.70	4.27
25	300136	信维通信	7,115,017.16	4.23
26	601088	中国神华	7,051,806.09	4.19
27	300450	先导智能	6,409,761.00	3.81
28	002371	北方华创	6,340,237.50	3.77
29	000625	长安汽车	6,260,637.00	3.72
30	300284	苏交科	6,218,403.00	3.70
31	002475	立讯精密	6,202,921.64	3.69
32	002920	德赛西威	6,172,193.00	3.67
33	300438	鹏辉能源	6,147,216.00	3.65
34	000858	五粮液	5,936,111.00	3.53
35	000651	格力电器	5,545,713.12	3.30
36	000538	云南白药	5,412,781.88	3.22
37	601318	中国平安	4,922,060.00	2.93

38	300308	中际旭创	4,351,110.00	2.59
39	300033	同花顺	4,275,982.00	2.54
40	000671	阳光城	4,260,346.00	2.53
41	603019	中科曙光	4,244,247.20	2.52
42	000333	美的集团	4,091,136.00	2.43
43	000887	中鼎股份	4,087,865.00	2.43
44	601888	中国国旅	4,058,513.95	2.41
45	600570	恒生电子	4,055,751.00	2.41
46	600276	恒瑞医药	3,947,654.68	2.35
47	600809	山西汾酒	3,839,225.94	2.28
48	600104	上汽集团	3,740,546.73	2.22
49	600028	中国石化	3,434,858.00	2.04

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	600536	中国软件	16,717,837.31	9.94
2	000063	中兴通讯	15,395,728.37	9.15
3	002174	游族网络	14,375,005.56	8.55
4	600036	招商银行	12,581,434.74	7.48
5	002157	正邦科技	11,397,030.86	6.78
6	600131	岷江水电	10,892,691.44	6.48
7	002640	跨境通	10,499,598.06	6.24
8	600030	中信证券	10,312,419.00	6.13
9	300308	中际旭创	8,913,409.76	5.30
10	300340	科恒股份	8,711,366.62	5.18
11	300284	苏交科	8,452,791.00	5.03
12	300498	温氏股份	8,149,994.51	4.85

13	002439	启明星辰	7,611,621.00	4.53
14	601162	天风证券	7,514,127.02	4.47
15	300571	平治信息	7,492,766.00	4.45
16	300059	东方财富	7,386,919.00	4.39
17	600703	三安光电	7,221,953.00	4.29
18	300628	亿联网络	6,807,798.70	4.05
19	300136	信维通信	6,335,755.97	3.77
20	300438	鹏辉能源	6,244,306.94	3.71
21	600498	烽火通信	6,211,979.00	3.69
22	300747	锐科激光	5,692,333.40	3.38
23	002475	立讯精密	5,462,599.20	3.25
24	002371	北方华创	5,388,590.50	3.20
25	601788	光大证券	5,366,758.18	3.19
26	600999	招商证券	5,216,138.88	3.10
27	600487	亨通光电	4,828,533.20	2.87
28	600760	中航沈飞	4,758,814.00	2.83
29	601800	中国交建	4,476,941.00	2.66
30	600038	中直股份	4,373,076.00	2.60
31	000625	长安汽车	4,357,825.00	2.59
32	002415	海康威视	4,348,195.00	2.59
33	600585	海螺水泥	4,328,920.00	2.57
34	300496	中科创达	4,257,702.00	2.53
35	300450	先导智能	4,061,918.00	2.42
36	601668	中国建筑	3,958,326.00	2.35
37	000539	粤电力A	3,910,485.15	2.33
38	601998	中信银行	3,833,734.23	2.28
39	600967	内蒙一机	3,797,024.32	2.26
40	000671	阳光城	3,741,703.00	2.22
41	300033	同花顺	3,739,487.53	2.22
42	603444	吉比特	3,709,030.51	2.21
43	000887	中鼎股份	3,564,331.00	2.12

44	002465	海格通信	3,563,638.32	2.12
----	--------	------	--------------	------

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	381,223,803.51
卖出股票收入（成交）总额	378,968,689.38

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。

7.8 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	192,463.68
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,548.42
5	应收申购款	29,071.47
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	225,083.57

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 一带 一路 混合A	8,929	25,526.46	1,735,596.25	0.76%	226,190,207.20	99.24%
前海 开源 一带 一路 混合C	2,209	4,842.17	0.00	0.00%	10,696,358.75	100.00%
合计	11,138	21,424.15	1,735,596.25	0.73%	236,886,565.95	99.27%

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

②户均持有的基金份额合计=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比 例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	前海开源一带一 路混合A	0.00	0.00%
	前海开源一带一 路混合C	0.00	0.00%
	合计	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	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	前海开源一带一路 混合A	0
	前海开源一带一路 混合C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基 金	前海开源一带一路 混合A	0
	前海开源一带一路 混合C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	前海开源一带一路混合 A	前海开源一带一路混合 C
基金合同生效日(2015年04月29 日)基金份额总额	1,613,952,378.29	-
本报告期期初基金份额总额	234,089,865.83	3,860,638.44
本报告期基金总申购份额	21,879,535.54	18,312,467.37

减：本报告期基金总赎回份额	28,043,597.92	11,476,747.06
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	227,925,803.45	10,696,358.75

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

本基金本报告期内未改聘会计师事务所。

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	佣金	占当期佣金总量的比	

			的比例		例	
银河证券	2	758,282,251.66	100.00%	554,532.39	100.00%	-
方正证券	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
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-

本基金本报告期内租用证券公司交易单元未进行其他证券投资。

§ 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

2019年4月14日，由中国证券报社主办的第十六届中国基金业金牛奖评选结果公布，前海开源基金管理有限公司荣获“金牛基金管理公司”，公司旗下前海开源工业革命4.0灵活配置混合型证券投资基金(基金代码：001103)荣获“三年期开放式混合型持续优胜金牛基金”。

前海开源基金管理有限公司
二〇一九年八月二十四日