

# 前海开源沪港深农业主题精选灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)招募说明书(更新)摘要

基金管理人：前海开源基金管理有限公司

基金托管人：中国银河证券股份有限公司

截止日：2017年1月20日

## 重要提示

前海开源沪港深农业主题精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）由前海开源中证大农业指数分级证券投资基金转型而来。自2016年6月8日至2016年7月6日，前海开源中证大农业指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，会议审议通过了《关于前海开源中证大农业指数分级证券投资基金转型相关事项的议案》，同意前海开源中证大农业指数分级证券投资基金转型为前海开源沪港深农业主题精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF），其基金类别、基金费率、投资目标、投资范围和投资策略等相关事宜均发生变更；基于该等变更，基金合同亦进行相应修改。上述基金转型事项已于2016年7月8日经持有人大会表决通过生效，自2016年7月20日起，《前海开源沪港深农业主题精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》生效，《前海开源中证大农业指数分级证券投资基金基金合同》同日失效。

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

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资人在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括但不限于：市场风险、信用风险、管理风险、流动性风险、操作和技术风险、合规性风险、股指期货投资风险、本基金特有的风险及其他风险等。本基金为混合型基金，属于中高风险收益的投资品种，其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基

金，低于股票型基金。本基金若投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。

本基金可投资中小企业私募债券，当基金所投资的中小企业私募债券之债务人出现违约，或在交易过程中发生交收违约，或由于中小企业私募债券信用质量降低导致价格下降等，可能造成基金财产损失。此外，受市场规模及交易活跃程度的影响，中小企业私募债券可能无法在同一价格水平上进行较大数量的买入或卖出，存在一定的流动性风险，从而对基金收益造成影响。

基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金表现的保证。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行承担。投资有风险，投资人在投资本基金前应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。

本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为2017年1月20日，有关财务数据和净值表现截止日2016年12月31日（未经审计）。

## 一、基金管理人

### （一）基金管理人概况

- 1、名称：前海开源基金管理有限公司
- 2、住所：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）
- 3、设立日期：2013年1月23日
- 4、法定代表人：王兆华
- 5、批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可〔2012〕1751号
- 6、组织形式：有限责任公司
- 7、办公地址：深圳市福田区深南大道7006号万科富春东方大厦22楼
- 8、电话：0755-88601888 传真：0755-83181169
- 9、联系人：吕文敏
- 10、注册资本：人民币2.0亿元

11、存续期限：持续经营

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

## (二) 主要人员情况

### 1、基金管理人董事会成员

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

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

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

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

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

公司董事长。

Mr Yan Charles Wang（王岩先生），董事，学士学位，国籍：加拿大。从1993年起，曾任职加拿大美林证券，美国 Clemente Capital 董事、大中国区主管，美国纽约州立养老金另类投资部主管，美国磐石基金大中国区主管、董事总经理，美国橡树资本中国区主管、董事总经理，长安街资本合伙人，现任美国米尔斯坦中国总裁。曾是美国机构有限投资者协会（ILPA）创始会员，中国风险协会（CVCA）顾问。现任前海开源基金管理有限公司董事。

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

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

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

Mr Shujie Yao（姚树洁先生），独立董事，教授，国籍：英国。英国诺丁汉大学当代中国学院院长、教授，西安交通大学特聘讲座教授、重庆大学、华南师范大学、华南农业大学、华中农业大学、渭南师范学院等大学特聘教授、海南大学经济管理学院荣誉院长；英国皇家经济学会会员、英国中国经济协会会员、美国比较经济学协会会员、美国经济协会会员；全英专业团体联合会副主席；《经济研究》、《西安交通大学学报社科版》、《当代中国》（英文）等科学杂志的编委。曾任华南热带农业大学助理教授，英国牛津大学研究员，英国朴茨茅斯大学教授、主任，英国伦敦米德尔塞克斯大学教授、系主任。

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

## 2、基金管理人监事会成员

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

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

张学玲女士，监事，会计师，国籍：中国。历任武汉大学财务部副部长。

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

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

## 3、高级管理人员情况

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

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

李志祥先生，首席运营官，本科学历，经济师，国籍：中国。历任湖北省黄冈市体改委副科长，深圳市农产品股份有限公司秘书科科长，大鹏证券有限责任公司业务秘书，南方基金管理有限公司高级经理，前海开源基金管理有限公司督

察长、董事会秘书。现任前海开源基金管理有限公司首席运营官、前海开源资产管理有限公司董事。

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

#### 4、本基金基金经理

孙亚超先生，数学科博士后，国籍：中国。历任爱建证券研究所创新发展部经理、高级研究员；光大证券理财产品部量化产品系列负责人；齐鲁证券机构部创新业务研究总监。现任前海开源基金管理有限公司执行投资总监；前海开源中证大农业指数增强型证券投资基金基金经理、前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金基金经理、前海开源沪港深农业主题精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金经理。孙亚超先生具备基金从业资格。

柯海东先生，中山大学财务学硕士，华中科技大学工学学士，武汉大学管理学双学士，6年证券从业经历。历任中国中投证券研究总部食品饮料行业分析师，国泰君安证券研究所食品饮料行业分析师。现任前海开源基金管理有限公司投资副总监、前海开源中证军工指数型证券投资基金基金经理、前海开源沪港深农业主题精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金经理。柯海东先生具备基金从业资格。

#### 5、投资决策委员会成员情况

投资决策委员会主席王厚琼，联席投资总监兼研究部行政负责人赵雪芹，联席投资总监侯燕琳、刘静、丁骏，执行投资总监曲扬、徐立平、薛小波、邱杰、王霞、孙亚超、谢屹。

#### 6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

### （一）基金托管人情况

名称：中国银河证券股份有限公司（以下简称“银河证券”）

注册地址：中国北京西城区金融大街35号2-6层

法定代表人：陈共炎

成立日期：2007年1月26日

批准设立机关和批准设立文号：证监会、证监机构字[2007]25号

注册资本：953725.8757 万元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：证监许可【2014】629号

联系人：李蔚

联系电话：95551

中国银河证券股份有限公司是中国证券行业领先的综合性金融服务提供商，提供经纪、销售和交易、投资银行等综合证券服务。2007年1月26日，公司经中国证监会批准，由中国银河金融控股有限责任公司作为主发起人，联合4家国内机构投资者共同发起正式成立。中央汇金投资有限责任公司为公司实际控制人。公司本部设在北京，注册资本为人民币953725.8757万元。公司于2013年5月22日在香港联合交易所上市，控股股东为中国银河金融控股有限责任公司。

## （二）主要人员情况

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

## （三）基金托管业务经营情况

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

## （四）基金托管人的内部控制制度

### 1、内部控制目标

银河证券作为基金托管人：

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

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

（3）防范和化解经营风险，提高经营管理效益，使托管业务稳健运行和受

托资产安全完整，实现托管业务的持续、稳定、健康发展。

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

## 2、内部控制组织结构

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

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

## (五) 基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

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

投资监督可以为事中监督和事后监督，主要包括：（一）对托管资产的投资范围、投资比例、投资限制进行监督；（二）对托管资产的核算估值是否符合相关法律法规和规范性文件、基金合同和托管协议的约定进行监督；（三）对托管资产的资金运用、计提和支付各类费用等情况进行监督；（四）对托管资产是否存在透支行为、应收款项是否及时足额到账进行监督；（五）对托管资产的收益分配是否符合法律法规和托管协议的约定进行监督；（六）其他法律法规、基金合同和托管协议约定的监督事项。

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

## 三、相关服务机构

### (一) 基金份额销售机构

#### 1、场外销售机构

##### (1) 直销机构

##### 1) 前海开源基金管理有限公司

办公地址：深圳市福田区深南大道 7006 号万科富春东方大厦 10 层

联系人：吕文敏

电话：（0755）83181190

传真：（0755）83180622

2) 前海开源基金管理有限公司电子直销交易

客服电话：4001-666-998

网址：www.qhkyfund.com

微信公众号：qhkyfund

## （2）代销机构

代码 代销机构 销售机构信息

1 交通银行股份有限公司 交通银行股份有限公司住所：上海市浦东新区银城中路 188 号办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号法定代表人：牛锡明联系人：张宏革客服电话：95559 网址：www.bankcomm.com

2 中国邮政储蓄银行股份有限公司 中国邮政储蓄银行股份有限公司注册地址：北京市西城区宣武门西大街 131 号办公地址：北京市西城区金融大街 3 号法定代表人：李国华客服电话：95580 网址：www.psbc.com

3 华夏银行股份有限公司 华夏银行股份有限公司地址：北京市东城区建国门内大街 22 号法定代表人：吴建电话：010-85238441 传真：010-85238680 客服电话：95577 网址：www.hxb.com.cn/home/cn

4 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#办公地址：北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 16 层法定代表人：杨懿联系人：张燕电话：010-58325388-1588 传真：010-58325300 客服电话：400-166-1188 网址：<http://8.jrj.com.cn/>

5 和讯信息科技有限公司 和讯信息科技有限公司地址：北京朝外大街 22 号泛利大厦 10 层法定代表人：王莉联系人：于杨电话：(021)20835779 客服电话：4009-200-022 网址：www.hexun.com

6 厦门市鑫鼎盛控股有限公司 厦门市鑫鼎盛控股有限公司注册地址：福建省厦门市思明区鹭江道 2 号厦门第一广场西座 1501-1504 室办公地址：厦门市思明区鹭江道 2 号第一广场 1501-1504 法定代表人：陈洪生联系人：梁云波电话：0592-3122757 传真：0592-3122701 客服电话：400-918-0808 网址：[www.xds.com.cn](http://www.xds.com.cn)

7 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司 诺亚正行（上海）基金销售投

资顾问有限公司注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室办公地址：  
上海市杨浦区昆明路 508 号北美广场 B 座 12F 法定代表人：汪静波联系人：徐诚  
电话：(021)38509639 传真：(021)38509777 客服电话：400-821-5399 网址：  
www.noah-fund.com

8 深圳众禄金融控股股份有限公司 深圳众禄金融控股股份有限公司地址：深圳  
市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼法定代表人：薛峰联系人：童彩平电话：  
(0755)33227950 客服电话：4006-788-887 网址：www.zlfund.cn，  
www.jjmmw.com

9 上海天天基金销售有限公司 上海天天基金销售有限公司地址：上海市徐汇区  
宛平南路 88 号金座（北楼）25 层法定代表人：其实客服电话：4001-818-188 网  
址：www.1234567.com.cn

10 上海好买基金销售有限公司 上海好买基金销售有限公司地址：上海市虹口区  
欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号法定代表人：杨文斌客服电话：400-700-9665 网  
址：www.ehowbuy.com

11 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司注册地址：  
浙江省杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 幢 202 室法定代表人：陈柏青  
联系人：徐舫绯电话：(021)60897840 传真：(0571)26697013 客服电话：4000-  
766-123 网址：www.fund123.cn

12 上海长量基金销售投资顾问有限公司 上海长量基金销售投资顾问有限公司地  
址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层法定代表人：张跃伟电  
话：(021)20691832 传真：(021)20691861 客服电话：400-820-2899 网址：  
www.erichfund.com

13 浙江同花顺基金销售有限公司 浙江同花顺基金销售有限公司注册地址：浙江  
省杭州市文二西路元茂大厦 903 室办公地址：浙江省杭州市翠柏路 7 号杭州电子  
商务产业园 2 号楼 2 楼法定代表人：凌顺平联系人：吴强电话：  
(0571)88911818 传真：(0571)88910240 客服电话：4008-773-772 网址：  
www.5ifund.com

14 北京展恒基金销售股份有限公司 北京展恒基金销售股份有限公司注册地址：  
北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号办公地址：北京市朝阳区安苑路 15-1 号邮电  
新闻大厦 2 层法定代表人：闫振杰联系人：马林电话：010-59601366-7024 传真：  
010-62020355 客服电话：400-818-8000 网址：www.myfund.com

15 上海利得基金销售有限公司 上海利得基金销售有限公司注册地址：上海市宝  
山区蕴川路 5475 号 1033 室办公地址：上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼

12 楼法定代表人：李兴春联系人：徐鹏电话：86-021-50583533 传真：86-021-50583633 客服电话：400-921-7755 网址：[www.leadbank.com.cn](http://www.leadbank.com.cn)

16 宜信普泽投资顾问（北京）有限公司 宜信普泽投资顾问（北京）有限公司注册地址：北京市朝阳区建国路 88 号楼 soho 现代城 C 座 18 层 1809 法人代表：沈伟桦客服热线：400-609-9200 网站：[www.yixinfund.com](http://www.yixinfund.com)

17 众升财富（北京）基金销售有限公司 众升财富（北京）基金销售有限公司注册地址：北京市朝阳区望京东园四区 13 号楼 A 座 9 层 908 室办公地址：北京市朝阳区望京浦项中心 A 座 9 层 04-08 法定代表人：李招娣联系人：李艳电话：010-59497361 传真：010-64788016 客服电话：400-059-8888 网址：[www.zscffund.com](http://www.zscffund.com)

18 北京增财基金销售有限公司 北京增财基金销售有限公司注册地址：北京市西城区南礼士路 66 号 1 号楼 12 层 1208 号办公地址：北京市西城区南礼士路 66 号 1 号楼 12 层 1208 号法定代表人：罗细安联系人：李皓电话：010-67000988 传真：010-67000988-6000 客服电话：400-001-8811 网址：[www.zcvc.com.cn](http://www.zcvc.com.cn)

19 北京恒天明泽基金销售有限公司 北京恒天明泽基金销售有限公司注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室办公地址：北京市朝阳区东三环中路 20 号乐成中心 A 座 23 层法定代表人：梁越联系人：马鹏程电话：010-57756084 传真：010-57756199 客服电话：4008-980-618 网址：[www.chtfund.com](http://www.chtfund.com)

20 北京汇成基金销售有限公司 北京汇成基金销售有限公司注册地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108 室办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108 室法定代表人：王伟刚联系人：丁向坤电话：18001102931 传真：010-62680827 客服电话：400-619-9059 网址：[www.fundzone.cn](http://www.fundzone.cn)

21 一路财富（北京）信息科技有限公司 一路财富（北京）信息科技有限公司注册地址：北京市西城区车公庄大街 9 号五栋大楼 C 座 702 室办公地址：北京市西城区阜成门外大街 2 号万通新世界广场 A 座 2208 法定代表人：吴雪秀联系人：段京璐电话：010-88312877 传真：010-88312099 客服电话：400-001-1566 网址：[www.yilucaifu.com](http://www.yilucaifu.com)

22 北京钱景财富投资管理有限公司 北京钱景财富投资管理有限公司注册地址：北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012 办公地址：北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012 法定代表人：赵荣春联系人：高静电话：010-59158282 传真：010-57569671 客服电话：400-893-6885 网址：[www.qianjing.com](http://www.qianjing.com)

23 北京新浪仓石基金销售有限公司 北京新浪仓石基金销售有限公司注册地址：

北京市海淀区北四环西路 58 号理想国际大厦 906 办公地址：北京市海淀区北四环西路 58 号理想国际大厦 906 法定代表人：张琪联系人：付文红电话：010-62676405 客服电话：010-62675369 网址：www.xincai.com

24 上海联泰资产管理有限公司 上海联泰资产管理有限公司注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室办公地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 号楼 3 层联系人：陈东电话：021-52822063 传真：021-52975270 客服电话：4000-466-788 网址：www.66zichan.com

25 上海汇付金融服务有限公司 上海汇付金融服务有限公司办公地址：上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼法定代表人：张晶电话：021-33323999-8318 客服电话：400-820-2819 网址：www.chinapnr.com

26 北京乐融多源投资咨询有限公司 北京乐融多源投资咨询有限公司注册地址：北京市朝阳区西大望路 1 号 1 号楼 16 层 1603 办公地址：北京市朝阳区西大望路 1 号 1 号楼 16 层 1603 法定代表人：董浩联系人：付瑞华电话：010-56580666 客服电话：400-068-1176 网址：www.jimufund.com

27 深圳富济财富管理有限公司 深圳富济财富管理有限公司注册地址：深圳市南山区粤海街道科苑南路高新南七道惠恒集团二期 418 室办公地址：深圳市南山区高新南七道 12 号惠恒集团二期 418 室法定代表人：齐小贺联系人：马力佳电话：0755-83999907-815 传真：0755-83999926 客服电话：0755-83999913 网址：www.jinqianwo.cn

28 上海陆金所资产管理有限公司 上海陆金所资产管理有限公司注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼法定代表人：鲍东华联系人：宁博宇电话：021-20665952 传真：021-22066653 客服电话：4008219031 网址：www.lufunds.com

29 大泰金石基金销售有限公司 大泰金石基金销售有限公司注册地址：南京市建邺区江东中路 359 号国睿大厦一号楼 B 区 4 楼 A506 室办公地址：上海市长宁区虹桥路 1386 号文广大厦 15 楼法定代表人：袁顾明联系人：何庭宇电话：13917225742 传真：021-22268089 客服电话：400-928-2266 公司网址：www.dtfunds.com

30 珠海盈米财富管理有限公司 珠海盈米财富管理有限公司注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491 办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼法定代表人：肖雯 联系人：吴煜浩电话：020-89629021 传真：020-89629011 客服电话：020-89629066 网址：www.yingmi.cn

31 奕丰金融服务（深圳）有限公司 奕丰金融服务（深圳）有限公司注册地址：

深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入住深圳市前海商务秘书有限公司）办公地址：深圳市南山区海德三路海岸大厦东座1115室，1116室及1307室 邮编 518054 法定代表人：TAN YIK KUAN 联系人：叶健 办公电话：0755 8946 0500 传真号码：0755 2167 4453 客服电话：400-684-0500 网址：

[www.ifastps.com.cn](http://www.ifastps.com.cn)

32 北京肯特瑞财富投资管理有限公司 北京肯特瑞财富投资管理有限公司注册地址：北京市海淀区海淀东三街2号4层401-15 法定代表人：陈超 联系人：江卉 客服电话：95118（个人业务）、400-088-8816（企业业务） 网址：

<http://fund.jd.com/>

33 北京蛋卷基金销售有限公司 北京蛋卷基金销售有限公司住所：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507 法定代表人：钟斐斐 联系人：吴季林 电话：010-61840688 传真：010-61840699 客服电话：400-0618-518 网址：

[danjuanapp.com](http://danjuanapp.com)

34 中信期货有限公司 中信期货有限公司地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层 法定代表人：张磊 联系人：韩钰 电话：010-60833754 客服电话：400-990-8826 网址：[www.citicsf.com](http://www.citicsf.com)

35 国泰君安证券股份有限公司 国泰君安证券股份有限公司注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路618号 办公地址：上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼 法定代表人：杨德红 联系人：朱雅崑 电话：

(021)38676767 客服电话：95521 网址：[www.gtja.com](http://www.gtja.com)

36 中信建投证券股份有限公司 中信建投证券股份有限公司注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼 办公地址：北京市朝内大街188号 法定代表人：王常青 联系人：张颢 电话：(010)85156398 传真：(010)65182261 客服电话：4008-888-108 网址：[www.csc108.com](http://www.csc108.com)

37 中信证券股份有限公司 中信证券股份有限公司注册地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座 办公地址：北京朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦 法定代表人：王东明 联系人：顾凌 电话：(010)60838696 客服电话：95548 网址：[www.cs.ecitic.com](http://www.cs.ecitic.com)

38 中国银河证券股份有限公司 中国银河证券股份有限公司地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座 法定代表人：陈共炎 联系人：邓颜 电话：(010)66568292 传真：(010)66568990 客服电话：4008-888-888 网址：

[www.chinastock.com.cn](http://www.chinastock.com.cn)

39 海通证券股份有限公司 海通证券股份有限公司注册地址：上海市广东路

689 号办公地址：上海市广东路 689 号法定代表人：王开国联系人：李笑鸣电话：  
(021)23219000 客服电话：95553 网址：www.htsec.com

40 申万宏源证券有限公司 申万宏源证券有限公司注册地址：上海市徐汇区长乐路  
989 号 45 层办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层法定代表人：李梅联  
系人：曹晔电话：(021) 33389888 传真：(021) 33388224 电话委托：  
(021)962505 客服电话：95523，4008-895-523 网址：www.swhysc.com

41 安信证券股份有限公司 安信证券股份有限公司注册地址：深圳市福田区金田  
路 4018 号安联大厦 35 楼、28 层 A02 单元办公地址：深圳市福田区金田路  
4018 号安联大厦 35 楼、28 层 A02 单元法定代表人：牛冠兴电话：  
(0755)82555551 客服电话：4008-001-001 网址：www.essence.com.cn

42 渤海证券股份有限公司 渤海证券股份有限公司注册地址：天津市经济技术开  
发区第二大街 42 号写字楼 101 室办公地址：天津市南开区宾水西道 8 号法定代  
表人：王春峰联系人：蔡霆电话：022-28451991 传真：022-28451958 客服电话：  
400-651-5988 网址：www.ewww.com.cn

43 华泰证券股份有限公司 华泰证券股份有限公司注册地址：南京市江东中路  
228 号办公地址：南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场法定代表人：周易  
联系人：庞晓芸电话：0755-82492193 传真：0755-82492962 客服电话：95597 网  
址：www.htsc.com.cn

44 山西证券股份有限公司 山西证券股份有限公司地址：山西省太原市府西街  
69 号山西国际贸易中心东塔楼法定代表人：侯巍客服电话：400-666-1618、  
95573 网址：www.i618.com.cn

45 中信证券（山东）有限责任公司 中信证券（山东）有限责任公司注册地址：  
青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001 办公地址：青岛市市南区东海西路 28 号  
龙翔广场东座 5 层法定代表人：杨宝林联系人：吴忠超电话：(0532)85022326 客  
服电话：95548 网址：www.zxwt.com.cn

46 东兴证券股份有限公司 东兴证券股份有限公司地址：北京市西城区金融大街  
5 号新盛大厦 B 座 12、15 层法定代表人：魏庆华联系人：汤漫川电话：  
(010)66555316 客服电话：4008-888-993 网址：www.dxzq.net

47 信达证券股份有限公司 信达证券股份有限公司地址：北京市西城区闹市口大  
街 9 号院 1 号楼法定代表人：张志刚联系人：唐静电话：(010)63080985 客服电  
话：95321 网址：www.cindasc.com

48 长城证券股份有限公司 长城证券股份有限公司注册地址：深圳市福田区深南  
大道 6008 号特区报业大厦 16、17 层办公地址：深圳市福田区深南大道 6008 号

特区报业大厦 14、16、17 层法定代表人：黄耀华联系人：胡永君电话：0755-83516289 传真：0755-83515567 客服电话：400-666-6888 网址：www.cgws.com

49 光大证券股份有限公司 光大证券股份有限公司地址：上海市静安区新闻路 1508 号法定代表人：薛峰联系人：刘晨电话：(021)22169081 传真：

(021)22169134 客服电话：95525 网址：www.ebscn.com

50 广州证券股份有限公司 广州证券股份有限公司注册地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层办公地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层法定代表人：邱三发联系人：梁微电话：

(020)88836999 客服电话：95396 网址：www.gzs.com.cn

51 大同证券有限责任公司 大同证券有限责任公司注册地址：大同市城区迎宾街 15 号桐城中央 21 层办公地址：山西省太原市长治路 111 号山西世贸中心 A 座 12、13 层法定代表人：董祥联系人：薛津电话：(0351)4130322 客服电话：

4007-121-212 网址：www.dtsbc.com.cn

52 平安证券股份有限公司 平安证券股份有限公司注册地址：深圳市福田区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层办公地址：深圳市福田区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层法定代表人：谢永林联系人：周一涵电话：021-38637436 传真：

021-33830395 客服电话：95511-8 网址：http://stock.pingan.com

53 华安证券股份有限公司 华安证券股份有限公司注册地址：合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号办公地址：合肥市蜀山区南二环路 959 号财智中心华安证券 B1 座 0327 室法定代表人：李工联系人：甘霖电话：(0551)65161821 传真：

(0551)65161672 客服电话：95318, 4008-096-518 网址：www.hazq.com

54 国海证券股份有限公司 国海证券股份有限公司注册地址：广西壮族自治区桂林市辅星路 13 号办公地址：广西壮族自治区南宁市滨湖路 46 号国海大厦法定代表人：何春梅电话：(0755)82047857 传真：(0755)82835785 客服电话：95563 电

话委托：95563 网址：www.ghzq.com.cn

55 东莞证券股份有限公司 东莞证券股份有限公司地址：广东省东莞市莞城区可园南路一号金源中心法定代表人：张运勇客服电话：(0769)961130 网址：

www.dgzq.com.cn

56 申万宏源西部证券有限公司 申万宏源西部证券有限公司注册地址：新疆乌鲁木齐高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室法

定代表人：许建平联系人：唐岚电话：(010)88085258 传真：(010)88085195 客服电话：400-800-0562 网址：www.hysec.com

57 中泰证券股份有限公司 中泰证券股份有限公司地址：山东省济南市经七路  
86 号法定代表人：李玮联系人：吴阳电话：(0531)68889155 客服电话：95538 网  
址：www.zts.com.cn

58 华龙证券股份有限公司 华龙证券股份有限公司注册地址：兰州市城关区东岗  
西路 638 号财富大厦办公地址：兰州市城关区东岗西路 638 号财富大厦法定代表  
人：李晓安联系人：邓鹏怡电话：0931-4890208 传真：0931-4890628 客服电话：  
400-689-8888 网址：www.hlzq.com

59 中国国际金融股份有限公司 中国国际金融股份有限公司地址：北京市建国门  
外大街 1 号国贸大厦 2 座 27、28 层法定代表人：丁学东联系人：秦朗电话：  
(010)85679888-6035 传真：(010)85679535 客服电话：400-910-1166 网址：  
www.cicc.com.cn

60 华鑫证券有限责任公司 华鑫证券有限责任公司注册地址：深圳市福田区金田  
路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01 (b) 单元办公地址：上海市徐汇区宛平南路  
8 号法定代表人：俞洋联系人：杨丽娟电话：(021)54967202 客服电话：4001-  
099-918, (021)32109999, (029)68918888 网址：www.cfsc.com.cn

61 中山证券有限责任公司 中山证券有限责任公司注册地址：深圳市南山区科技  
中一路西华强高新大厦 7 层、8 层办公地址：深圳市南山区科技中一路西华  
强高新大厦 7 层、8 层法定代表人：黄扬录联系人：刘军电话：  
(0755)82943755 传真：(0755)82960582 客服电话：4001-022-011 网址：  
www.zszq.com

62 联讯证券股份有限公司 联讯证券股份有限公司 注册地址：广东省惠州市惠  
城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼办公地址：广东省惠州市惠城  
区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼法定代表人：徐刚联系人：彭莲  
电话：0752-2119700 客服电话：95564 网址：www.lxsec.com

63 国金证券股份有限公司 国金证券股份有限公司注册地址：四川省成都市东城  
根上街 95 号办公地址：四川省成都市东城根上街 95 号法定代表人：冉云联系人：  
刘婧漪、贾鹏电话：028-86690057、028-86690058 传真：028-86690126 客服电  
话：95310 网址：www.gjzq.com.cn

64 华宝证券有限责任公司 华宝证券有限责任公司地址：上海市浦东新区世纪大  
道 100 号上海环球金融中心 57 层法定代表人：陈林联系人：刘闻川电话：  
(021)68778790 传真：(021)68777992 客服电话：4008-209-898 网址：  
www.cnhbstock.com

65 爱建证券有限责任公司 爱建证券有限责任公司地址：上海市浦东新区世纪大

道 1600 号陆家嘴商务广场 32 楼法定代表人：钱华联系人：王薇电话：  
(021)32229888 传真：(021)68728703 客服电话：4001-962-502 网址：

www.ajzq.com

66 英大证券有限责任公司 英大证券有限责任公司注册地址：深圳市福田区深南  
中路华能大厦三十、三十一层办公地址：深圳市福田区深南中路华能大厦三十、  
三十一层法定代表人：吴骏联系人：吴尔晖电话：0755-83007159 传真：0755-  
83007034 客服电话：400-018-8688 网址：www.ydsc.com.cn

67 华融证券股份有限公司 华融证券股份有限公司地址：北京市西城区金融大街  
8 号办公地址：北京市朝阳区朝阳门北大街 18 号中国人保寿险大厦 12 层法定代  
表人：祝献忠联系人：李慧灵联系电话：(010)85556100 传真：  
(010)85556153 客服电话：400-898-9999 网址：www.hrsec.com.cn

68 天风证券股份有限公司 天风证券股份有限公司注册地址：湖北省武汉市东湖  
新技术开发区关东园路 2 号高科大厦 4 楼办公地址：湖北省武汉市武昌区中南路  
99 号保利广场 A 座 37 楼法定代表人：余磊联系人：杨晨电话：027-87610052 传  
真：027-87618863 客服电话：400-800-5000 网址：www.tfzq.com

69 大通证券股份有限公司 大通证券股份有限公司注册地址：大连市沙河口区会  
展路 129 号大连国际金融中心 A 座大连期货大厦 38、39 层办公地址：大连市沙  
河口区会展路 129 号大连国际金融中心 A 座大连期货大厦 38、39 层法定代表人：  
李红光联系人：谢立军电话：0411-39991807 传真：0411-82826601 客服电话：  
4008-169-169 网址：www.daton.com.cn

70 长江证券股份有限公司 长江证券股份有限公司注册地址：武汉市新华路特  
8 号长江证券大厦办公地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦法定代表人：杨  
泽柱联系人：奚博宇电话：027-65799999 传真：027-85481900 客服电话：  
95579 网址：www.95579.com

## 2、场内发售机构

本基金的场内发售机构为具有基金销售业务资格、经深圳证券交易所和中国  
证券登记结算有限责任公司认可的深圳证券交易所会员单位（具体名单可在深圳  
证券交易所网站查询）。

### （二）基金登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街 17 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：周明

联系电话：010-59378835

传真：010-59378839

联系人：朱立元

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

注册地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：俞卫锋

经办律师：黎明、陆奇

联系人：陆奇

电话：021-31358666

传真：021-31358600

（四）审计基金资产的会计师事务所

名称：瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市海淀区西四环中路 16 号院 2 号楼 4 层

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

法定代表人：杨剑涛

联系人：郭红霞

经办会计师：张富根、郭红霞

电话：010-88095588

传真：010-88091199

四、基金名称

前海开源沪港深农业主题精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

五、基金的类型

混合型

六、基金的运作

开放式

## 七、基金的投资

### （一）投资目标

本基金主要通过精选投资于农业主题相关证券，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。

### （二）投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、沪港股票市场交易互联互通机制试点允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券、可交换债券、中小企业私募债券及其他中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

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

基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例为0-95%（其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的0-95%，投资于港股通标的股票的比例占基金资产的0-95%），投资于农业主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的80%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

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

### （三）投资策略

本基金的投资策略主要有以下五方面内容：

#### 1、大类资产配置

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

本基金通过对股票等权益类、债券等固定收益类和现金资产分布的实时监控，根据经济运行周期变动、市场利率变化、市场估值、证券市场变化等因素以及基金的风险评估进行灵活调整。在各类资产中，根据其参与市场基本要素的变动，调整各类资产在基金投资组合中的比例。

## 2、股票投资策略

本基金采取自上而下宏观分析和自下而上精选个股相结合的投资策略，在遵循本基金资产配置比例限制的前提下，确定各类资产的投资比例。

本基金将精选具有巨大增长潜力、与农业主题相关的上市公司股票构建股票投资组合，投资于农业主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的 80%。本基金所指的农业主题包括种植业、畜禽养殖、林业、渔业、农产品加工等农业基础领域，亦包括为农业提供服务支持的相关上下游行业，包括但不限于化肥、农药、动物保健、饲料、农业互联网化、农业机械化等等相关细分子行业。基于前述概念的界定，本基金投资的股票主要包括：

### （1）基础农业生产商

基础的农业板块是指种植业、畜禽养殖、林业、渔业、农产品加工等等细分子行业，本基金将仔细甄别各细分子行业所处的景气周期，精选景气周期向上的子行业，及具有规模化竞争优势的企业作为重要投资方向。

### （2）农业相关上下游产业链

农业相关上下游产业链包括但不限于化肥、农药、动物保健、饲料、农业互联网化、农业机械化等等细分子行业，这些相关子行业对基础农业的发展具有重要的支持作用。本基金将从政策导向、技术领先、商业模式优选等多个维度对农业相关上下游产业链进行筛选，精选子行业及投资标的。

农业主题的范畴会随着中国经济结构调整优化的进程不断变化，基金管理人将持续跟踪相关行业最新发展变化，发现不断涌现的投资机会，对该范畴进行动态调整。

## 3、债券投资策略

本基金主要基于流动性管理需求投资于债券。本基金将结合宏观经济变化趋势、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，运用久

期调整、凸度挖掘、信用分析、波动性交易、回购套利等策略，权衡到期收益率与市场流动性，精选个券并构建和调整债券组合，在追求债券资产投资收益的同时兼顾流动性和安全性。

#### 4、权证投资策略

本基金将权证的投资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、中小企业私募债券投资策略

本基金对中小企业私募债的投资综合考虑安全性、收益性和流动性等方面特征进行全方位的研究和比较，对个券发行主体的性质、行业、经营情况、以及债券的增信措施等进行全面分析，选择具有优势的品种进行投资，并通过久期控制和调整、适度分散投资来管理组合的风险。

#### 6、股指期货投资策略

本基金以套期保值为目的，参与股指期货交易。

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

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

### （四）投资限制

#### 1、投资组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

(1) 本基金股票投资占基金资产的比例为 0-95%（其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的 0-95%，投资于港股通标的股票的比例占基金资产的 0-95%），投资于农业主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的 80%；

(2) 本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券；

(3) 本基金持有一家公司发行的证券（同一家公司在境内和香港同时上市的 A+H 股合计计算），其市值不超过基金资产净值的 10%；

(4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；

(5) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

(6) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

(7) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；

(8) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

(9) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

(10) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

(11) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

(12) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

(13) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(14) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

(15) 本基金投资流通受限证券，基金管理人应事先根据中国证监会相关规定，与基金托管人在本基金托管协议中明确基金投资流通受限证券的比例，根据比例进行投资。基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险；

(16) 本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过基金资产净值的 10%；

(17) 本基金投资单只中期票据的额度不得超过其发行总额度的 10%，并且不得超过基金资产净值的 10%；

(18) 本基金参与股指期货交易后，依据下列标准建构组合：

1) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值不得超过基金资产净值的 10%；

2) 本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

3) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；

4) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

5) 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；

(19) 本基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

(20) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

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

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

因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

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

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准，但须提前公告，不需要经基金份额持有人大会审议。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；

- (5) 向基金管理人、基金托管人出资；
- (6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

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

如法律、行政法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定，本基金可不受上述规定的限制，或以变更后的规定为准，但须提前公告，不需要经基金份额持有人大会审议。

#### （五）业绩比较基准

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%。

业绩比较基准选择理由：

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

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

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

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩

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

#### （六）风险收益特征

本基金为混合型基金，属于中高风险收益的投资品种，其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金，低于股票型基金。本基金如果投资港股通标的的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。

#### （七）基金的投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏、并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人根据基金合同规定复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至 2016 年 12 月 31 日（未经审计）。

##### 1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	119,707,652.83	94.14
	其中：股票	119,707,652.83	94.14
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	6,855,866.05	5.39
8	其他资产	590,639.09	0.46
9	合计	127,154,157.97	100.00

注：权益投资中通过沪港通交易机制投资的港股公允价值为 19,045,915.87 元，占资产净值比例 15.10%。

##### 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	24,143,710.94	19.14
B	采矿业	1,271,350.00	1.01
C	制造业	60,941,616.83	48.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	8,185,792.23	6.49
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	1,249,517.20	0.99
J	金融业	65,376.00	0.05
K	房地产业	2,158,780.00	1.71
L	租赁和商务服务业	2,645,593.76	2.10
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	100,661,736.96	79.81

2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
原材料	2,802,589.28	2.22
工业	2,161,136.16	1.71
日常消费品	8,968,455.66	7.11
金融	3,359,779.56	2.66
公用事业	1,753,955.21	1.39
合计	19,045,915.87	15.10

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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

(%)

1	000998	隆平高科	289,898	6,212,514.14	4.93
2	000902	新洋丰	370,000	4,166,200.00	3.30
3	000895	双汇发展	199,000	4,165,070.00	3.30
4	600201	生物股份	130,000	4,106,700.00	3.26
5	600737	中粮屯河	325,000	4,049,500.00	3.21
6	000568	泸州老窖	118,000	3,894,000.00	3.09
7	300498	温氏股份	110,000	3,874,200.00	3.07
8	002311	海大集团	230,000	3,461,500.00	2.74
9	1117	现代牧业	1,991,000	3,401,651.57	2.70
10	1432	中国圣牧	1,718,000	3,304,051.59	2.62

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

1) 本基金本报告期末未持有股指期货。(2) 本基金本报告期末未进行股指期货投资。

10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

#### 10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

#### 10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

#### 11、投资组合报告附注

11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

11.2 基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

#### 11.3 其他资产构成

序号 名称 金额（元）

1	存出保证金	180,945.45
2	应收证券清算款	369,793.64
3	应收股利	12,320.00
4	应收利息	1,751.70
5	应收申购款	25,828.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	590,639.09

#### 11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

#### 11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未持有流通受限的股票。

#### 11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## 八、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表

现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

前海开源中证大农业指数分级证券投资基金（转型前）

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

2015.06.04 -2015.12.31 5.60% 0.59% -24.97% 3.03% 30.57% -2.44%

2016.01.01-2016.07.19 -10.76% 2.24% -14.91% 2.01% 4.15% 0.23%

2015.06.04-2016.07.19 -5.76% 1.61% -36.15% 2.58% 30.39% -0.97%

注：（1）本基金转型日期为2016年7月20日，该日起原前海开源中证大农业指数分级证券投资基金正式变更为前海开源沪港深农业主题精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）。

（2）前海开源中证大农业指数分级证券投资基金的业绩比较基准为：中证大农业指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%。

前海开源沪港深农业主题精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（转型后）

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

2016.07.20 -2016.12.31 -1.41% 0.83% 1.34% 0.55% -2.75% 0.28%

注：（1）本基金转型日期为2016年7月20日，该日起原前海开源中证大农业指数分级证券投资基金正式变更为前海开源沪港深农业主题精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）。

（2）前海开源沪港深农业主题精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×70%+中证全债指数收益率×30%。

## 九、基金的费用与税收

### （一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券、期货交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、账户开户费用、账户维护费用；

9、基金的上市费和年费；

10、因投资相关规定范围内的香港联合交易所上市的股票而产生的各项合理费用；

11、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

## （二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

### 2、基金托管人的托管费

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

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述“（一）基金费用的种类”中第 3—11 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

## （三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；

- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

#### （四）费用调整

基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率等相关费率。基金管理人必须依照有关规定于新的费率实施日前在指定媒介刊登公告。

#### （五）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

### 十、其他应披露事项

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

本公司总经理、董事蔡颖女士兼任前海开源资管公司董事长；

本公司首席运营官李志祥先生兼任前海开源资管公司董事；

本公司汤力女士兼任前海开源资管公司监事；

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

（二）2016年7月20日至2017年1月20日披露的公告：

2017-01-20 前海开源沪港深农业主题精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

2016年第4季度报告

2017-01-03 前海开源基金管理有限公司旗下基金2016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

2016-12-28 前海开源基金管理有限公司关于调整旗下部分基金通过蛋卷基金定投申购起点金额的公告

2016-12-28 前海开源基金管理有限公司关于泰诚财富费率调整的公告

2016-12-28 前海开源基金管理有限公司关于北京微动利费率调整的公告

2016-12-23 前海开源沪港深农业主题精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）  
圣诞节假期暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告

2016-12-22 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

2016-12-16 前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加新浪仓石为代销机构并开通定投业务的公告

2016-12-15 前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加宜信普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

2016-12-13 前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加汇成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

2016-12-02 前海开源基金管理有限公司关于调整旗下开放式基金申购金额下限的公告

2016-12-01 前海开源基金管理有限公司关于旗下基金继续参与交通银行费率优惠活动的公告

2016-12-01 前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金在肯特瑞财富开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告

2016-11-24 前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加肯特瑞财富为代销机构并开通定投和转换业务的公告

2016-11-11 前海开源基金管理有限公司关于广源达信费率调整的公告

2016-11-11 前海开源基金管理有限公司关于新浪仓石费率调整的公告

2016-11-07 前海开源基金管理有限公司关于钱景财富费率调整的公告

2016-11-07 前海开源基金管理有限公司关于华融金融费率调整的公告

2016-10-26 前海开源沪港深农业主题精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）  
（前海开源中证大农业指数分级证券投资基金转型而来）2016年第3季度报告

2016-10-22 关于前海开源沪港深农业主题精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）于香港交易所休市日暂停申购、赎回、定投、转换等业务的公告

2016-09-27 前海开源沪港深农业主题精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）  
2016年国庆节、重阳节假期暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告

2016-09-20 前海开源基金管理有限公司关于旗下基金参与交通银行费率优惠活动的公告

2016-09-20 前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加奕丰金融为代销机

构并开通定投和转换业务的公告

2016-09-12 前海开源沪港深农业主题精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

中秋节假期暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告

2016-08-29 前海开源中证大农业指数分级证券投资基金 2016 年半年度报告摘要

2016-08-29 前海开源中证大农业指数分级证券投资基金 2016 年半年度报告

2016-08-24 前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加蛋卷基金为代销机构及  
开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告

2016-08-15 前海开源沪港深农业主题精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

上市交易提示性公告

2016-08-10 前海开源沪港深农业主题精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

上市交易公告书

2016-08-03 关于前海开源沪港深农业主题精选灵活配置混合型证券投资基金

（LOF）于香港交易所休市日暂停申购、赎回、定投、转换等业务的公告

2016-07-27 前海开源基金管理有限公司关于诺亚正行费率调整的公告

2016-07-27 前海开源基金管理有限公司关于华安证券费率调整的公告

2016-07-22 前海开源沪港深农业主题精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

增聘基金经理的公告

2016-07-21 关于前海开源中证大农业指数分级证券投资基金基金份额转换结果的  
公告

## 十一、备查文件

### （一）备查文件名录

- 1、中国证监会准予变更注册的文件
- 2、《前海开源沪港深农业主题精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》
- 3、《前海开源沪港深农业主题精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）登记结算服务协议》
- 4、《前海开源沪港深农业主题精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）托管协议》
- 5、法律意见书

- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照

(二) 备查文件的存放地点和投资人查阅方式

1、存放地点

《基金合同》、《托管协议》存放在基金管理人和基金托管人处；其余备查文件存放在基金管理人处。

2、查阅方式

投资人可在营业时间免费到存放地点查阅，也可按工本费购买复印件。

十二、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对本基金的原招募说明书进行了更新，主要更新的内容如下：

- 1、对“基金管理人”相关信息进行了更新。
- 2、对“基金托管人”相关信息进行了更新。
- 3、对“相关服务机构”相关信息进行了更新。
- 4、对“基金份额的申购与赎回”相关信息进行了更新。
- 5、在“基金的投资”部分，增加了“基金的投资组合报告”、“基金的业绩”相关信息。
- 6、在“其他应披露事项”部分相关信息进行了更新，披露了期间涉及本基金的公告。
- 7、对部分表述进行了更新。

前海开源基金管理有限公司

二〇一七年三月四日