

# 前海开源沪深 300 指数型证券投资基金

## 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:中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业银行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	前海开源沪深300指数型证券投资基金
基金简称	前海开源沪深300指数
基金主代码	000656
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年06月17日
基金管理人	前海开源基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	37,414,642.92份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用指数化投资策略,紧密跟踪沪深300指数,在严格控制基金的日均跟踪偏离度和年跟踪误差的前提下,力争获取与标的指数相似的投资收益。
投资策略	<p>本基金采用完全复制标的指数的方法,进行被动式指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合复制标的指数,并根据标的指数变动而进行相应调整。本基金在严格控制基金日均跟踪偏离度和年跟踪误差的前提下,力争获取与标的指数相似的投资收益。由于标的指数编制方法调整、成份股及其权重变化的原因,或因基金的申购和赎回等其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以对投资组合进行适当变通和调整,力求降低跟踪误差。</p> <p>1、大类资产配置:本基金管理人主要按照沪深300指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合,并根据指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的90%,投资于沪深300指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的85%;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</p>

	<p>不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。</p> <p>2、股票投资策略：（1）股票投资组合构建：本基金采用完全复制标的指数的方法，按照标的指数成份股组成及其权重构建股票投资组合。若出现特殊情况，本基金将采用替代性的方法构建组合，以减少跟踪误差。（2）股票投资组合的调整：本基金股票投资组合根据沪深300指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况等，对其进行适时调整。在正常市场情况下，力争控制本基金的份额净值与业绩比较基准的收益率日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%。如超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免误差进一步扩大。</p> <p>3、债券投资策略：本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，降低跟踪误差，主要采取组合久期配置策略，同时辅之以收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略等积极投资策略构建债券投资组合。</p> <p>4、权证投资策略：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；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：本基金以套期保值为目的，参与股指期货交易。运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，以达到降低投资组合的整体风险的目的。基金管理人将建立股指期货投资决策部门或小组，经董事会批准后执行。若相关法律法规发生变化时，基金管理人从其最新规定。</p>
业绩比较基准	$\text{沪深300指数收益率} \times 95\% + \text{银行活期存款利率(税后)} \times 5\%$
风险收益特征	<p>本基金属于采用指数化操作的股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金。</p>

## 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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	傅成斌
	联系电话	0755-88601888
	电子邮箱	qhky@qhkyfund.com
客户服务电话	4001666998	95599
传真	0755-83181169	010-68121816

## 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）
本期已实现收益	3,774,857.92
本期利润	6,051,997.57
加权平均基金份额本期利润	0.2065
本期基金份额净值增长率	31.95%
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	0.3011
期末基金资产净值	48,678,968.02
期末基金份额净值	1.301

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	5.77%	1.07%	5.13%	1.10%	0.64%	-0.03%
过去三个月	-0.15%	1.43%	-1.11%	1.45%	0.96%	-0.02%
过去六个月	31.95%	1.48%	25.65%	1.47%	6.30%	0.01%
过去一年	19.03%	1.40%	8.66%	1.45%	10.37%	-0.05%
过去三年	26.43%	1.00%	20.45%	1.05%	5.98%	-0.05%
自基金合同生效起至今	64.09%	1.46%	72.82%	1.49%	-8.73%	-0.03%

注：本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

#### 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

前海开源沪深300指数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		
付海 宁	本基金的基金经理、公司 投资副总监	2017- 02-14	-	9 年	付海宁先生，硕士研究生。 2009年至2010年担任摩根 士丹利商业分析师，2010 年-2012年担任美银美林 量化风险分析师，2013年 至2015年担任美国标准普 尔资管助理、投资经理，2 015年11月加盟前海开源 基金管理有限公司，现任 公司投资副总监。

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

根据基金合同规定,追踪沪深300指数,力争为投资人提供投资沪深300指数的工具。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末前海开源沪深300指数基金份额净值为1.301元,本报告期内,基金份额净值增长率为31.95%,同期业绩比较基准收益率为25.65%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从OECD经济领先指标来看,中国企稳回升,美国与欧洲延续下滑。美国5月 Markit PMI,4月ISM PMI均大幅下滑,预示工业产出将出现明显下滑。一季度中国名义GDP继续回落,名义GDP较去年四季度回落1.4%。在固定资产投资方面,房地产和基建托底经济,而制造业受贸易战影响加速回落。房贷利率对地产销量压制作用减弱,信贷刺激放缓后地产投资增速将有所回落。社会消费品零售的实际增速仍处于历史趋势线下方,总体来讲经济核心驱动力不强,但是财政政策表现了相对积极的一面,财政支出增速从2018年四季度以来快速回升,实际公共财政赤字高于较去年和历史平均水平。股票市场由于基本面和政策两方面的对冲,出现趋势性行情的可能性不大,建议中性配置并寻求结构性行情。

## 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的情形。

本基金2019年1月18日至2019年4月17日连续58个工作日、2019年4月29日至2019年6月28日连续41个工作日基金资产净值低于五千万元。

### § 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人-前海开源基金管理有限公司 2019年1月1日至2019年6月30日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，前海开源基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

#### 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

本托管人认为，前海开源基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

### § 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：前海开源沪深300指数型证券投资基金

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
<b>资 产：</b>		
银行存款	1,202,033.92	982,082.77
结算备付金	46,653.38	311,431.93
存出保证金	45,221.01	21,989.73
交易性金融资产	47,534,674.14	12,367,425.71
其中：股票投资	45,394,390.74	12,367,425.71
基金投资	-	-
债券投资	2,140,283.40	-
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	-	-
应收利息	54,069.38	330.36
应收股利	-	-
应收申购款	195,640.11	28,819.34
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	49,078,291.94	13,712,079.84
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2019年06月30日</b>	<b>上年度末 2018年12月31日</b>
<b>负 债：</b>		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-

衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	2,848.85	-
应付赎回款	187,749.76	149,272.05
应付管理人报酬	19,456.40	11,265.92
应付托管费	3,891.27	1,689.88
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	29,829.30	53,325.80
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	155,548.34	190,528.84
负债合计	399,323.92	406,082.49
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	37,414,642.92	13,496,433.96
未分配利润	11,264,325.10	-190,436.61
所有者权益合计	48,678,968.02	13,305,997.35
负债和所有者权益总计	49,078,291.94	13,712,079.84

注：报告截止日2019年6月30日，前海开源沪深300基金份额净值1.301元，基金份额总额37,414,642.92份。

## 6.2 利润表

会计主体：前海开源沪深300指数型证券投资基金

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	6,492,438.03	-200,294.92
1. 利息收入	20,927.37	10,897.02

其中：存款利息收入	11,961.15	10,074.66
债券利息收入	8,966.22	0.13
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	822.23
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	4,043,943.40	1,337,285.82
其中：股票投资收益	3,599,941.85	1,247,990.11
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	327.83
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	444,001.55	88,967.88
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	2,277,139.65	-1,659,143.80
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	150,427.61	110,666.04
<b>减：二、费用</b>	440,440.46	309,089.58
1. 管理人报酬	112,798.76	61,189.59
2. 托管费	20,146.12	9,178.40
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	203,288.68	108,381.21
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	104,206.90	130,340.38
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	6,051,997.57	-509,384.50
减：所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	6,051,997.57	-509,384.50

### 6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：前海开源沪深300指数型证券投资基金

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)	13,496,433.96	-190,436.61	13,305,997.35
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	6,051,997.57	6,051,997.57
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)	23,918,208.96	5,402,764.14	29,320,973.10
其中：1. 基金申购款	110,575,816.60	18,680,249.80	129,256,066.40
2. 基金赎回款	-86,657,607.64	-13,277,485.66	-99,935,093.30
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)	37,414,642.92	11,264,325.10	48,678,968.02
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)	7,821,041.97	1,863,565.45	9,684,607.42
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-509,384.50	-509,384.50
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)	1,060,251.87	-523,999.61	536,252.26
其中：1. 基金申购款	72,380,835.82	16,833,640.59	89,214,476.41
2. 基金赎回款	-71,320,583.95	-17,357,640.20	-88,678,224.15
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)	8,881,293.84	830,181.34	9,711,475.18

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

前海开源沪深300指数型证券投资基金（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【2014】494号文《关于核准前海开源沪深300指数型证券投资基金募集的批复》，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》、《前海开源沪深300指数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2014年6月3日至2014年6月13日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集234,687,022.67元，经瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）瑞华验字[2014]02030017号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《前海开源沪深300指数型证券投资基金基金合同》于2014年6月17日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为234,720,620.35份基金份额，其中认

购资金利息折合 33,597.68 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农业银行股份有限公司。

#### 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》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
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人
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**

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股票交易。

**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内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内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**

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交易，无佣金产生。

## 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201 9年06月30日	上年度可比期间 2018年01月01日至201 8年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	112,798.76	61,189.59
其中：支付销售机构的客户维护费	29,125.87	2,390.45

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

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首日起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。

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。

根据《关于调整前海开源沪深300指数型证券投资基金管理费率 and 托管费率并修改基金合同等事项的公告》约定，自2019年3月15日起，本基金的管理费率由1.00%/年调整为0.50%/年。

### 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	20,146.12	9,178.40

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

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首日起5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

根据《关于调整前海开源沪深300指数型证券投资基金管理费率 and 托管费率并修改基金合同等事项的公告》约定，自2019年3月15日起，本基金的托管费率由0.15%/年调整为0.10%/年。

#### 6.4.8.2.3 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。

#### 6.4.8.3 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内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

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0 6月30日	
	期末余额	当期利息收 入	期末余额	当期利息收 入
中国农业银行股份有限公司	1,202,033. 92	9,786.95	464,053.3 7	9,569.58

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行股份有限公司保管，按适用利率或约定利率计息。

#### 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内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内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

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。

##### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600485	*ST信威	2016-12-26	重大资产重组	6.28	2019-07-12	13.86	7,295	120,270.46	45,812.60	-

##### 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	45,394,390.74	92.49
	其中：股票	45,394,390.74	92.49
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,140,283.40	4.36
	其中：债券	2,140,283.40	4.36
	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	1,248,687.30	2.54
8	其他各项资产	294,930.50	0.60
9	合计	49,078,291.94	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（指数投资）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	658,128.40	1.35
B	采矿业	1,464,566.24	3.01
C	制造业	18,033,592.75	37.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,030,580.94	2.12
E	建筑业	1,376,312.72	2.83
F	批发和零售业	619,404.23	1.27
G	交通运输、仓储和邮政业	1,377,671.09	2.83
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术	1,634,972.55	3.36

	术服务业		
J	金融业	15,343,630.83	31.52
K	房地产业	1,979,836.43	4.07
L	租赁和商务服务业	625,239.36	1.28
M	科学研究和技术服务业	34,672.00	0.07
N	水利、环境和公共设施管理业	53,906.80	0.11
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	226,718.53	0.47
R	文化、体育和娱乐业	210,711.00	0.43
S	综合	-	-
	合计	44,669,943.87	91.76

### 7.2.2 报告期末（积极投资）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	80,111.52	0.16
C	制造业	206,898.00	0.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,827.00	0.07
E	建筑业	24,896.00	0.05
F	批发和零售业	72,816.32	0.15
G	交通运输、仓储和邮政业	70,512.09	0.14
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	95,035.68	0.20
J	金融业	112,002.80	0.23

K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	30,347.46	0.06
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	724,446.87	1.49

### 7.2.3 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股票投资明细

#### 7.3.1 期末指数投资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	601318	中国平安	39,269	3,479,626.09	7.15
2	600519	贵州茅台	1,865	1,835,160.00	3.77
3	600036	招商银行	37,403	1,345,759.94	2.76
4	601166	兴业银行	53,097	971,144.13	1.99
5	000651	格力电器	17,600	968,000.00	1.99
6	000333	美的集团	16,902	876,537.72	1.80
7	000858	五粮液	7,101	837,562.95	1.72
8	600276	恒瑞医药	11,290	745,140.00	1.53
9	600887	伊利股份	22,126	739,229.66	1.52
10	600030	中信证券	28,763	684,847.03	1.41

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。

### 7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600739	辽宁成大	5,008	72,816.32	0.15
2	002797	第一创业	9,620	60,990.80	0.13
3	000839	中信国安	12,952	52,067.04	0.11
4	600549	厦门钨业	3,620	51,802.20	0.11
5	600909	华安证券	7,800	51,012.00	0.10

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	601318	中国平安	5,178,006.53	38.91
2	600519	贵州茅台	3,684,822.00	27.69
3	600036	招商银行	3,431,388.00	25.79
4	601166	兴业银行	2,761,294.00	20.75
5	000333	美的集团	2,414,994.00	18.15
6	601328	交通银行	2,409,747.00	18.11
7	000651	格力电器	2,222,400.28	16.70
8	600030	中信证券	2,200,566.00	16.54
9	600016	民生银行	2,160,466.00	16.24
10	000858	五粮液	1,495,098.00	11.24
11	600276	恒瑞医药	1,318,657.00	9.91

12	600887	伊利股份	1,254,144.00	9.43
13	600837	海通证券	1,154,586.00	8.68
14	600000	浦发银行	1,049,886.00	7.89
15	601668	中国建筑	998,970.00	7.51
16	601398	工商银行	995,417.00	7.48
17	000002	万 科 A	953,002.00	7.16
18	002714	牧原股份	943,897.00	7.09
19	002415	海康威视	801,171.00	6.02
20	601169	北京银行	781,902.00	5.88
21	000725	京东方 A	757,247.00	5.69
22	600900	长江电力	744,669.00	5.60
23	600104	上汽集团	739,263.16	5.56
24	601766	中国中车	721,377.00	5.42
25	601601	中国太保	712,167.00	5.35
26	601211	国泰君安	680,754.00	5.12
27	000001	平安银行	674,424.00	5.07
28	300498	温氏股份	634,755.00	4.77
29	601688	华泰证券	619,251.00	4.65
30	601988	中国银行	605,787.00	4.55
31	600048	保利地产	585,349.00	4.40
32	000063	中兴通讯	559,860.00	4.21
33	600028	中国石化	552,756.00	4.15
34	600309	万华化学	520,281.00	3.91
35	601818	光大银行	504,105.00	3.79
36	601888	中国国旅	492,952.00	3.70
37	600019	宝钢股份	470,973.00	3.54
38	000876	新 希 望	467,941.00	3.52
39	601390	中国中铁	456,781.00	3.43
40	600518	ST康美	452,529.00	3.40
41	600050	中国联通	451,936.00	3.40
42	600547	山东黄金	451,152.40	3.39

43	002304	洋河股份	433,239.00	3.26
44	600585	海螺水泥	418,176.00	3.14
45	300059	东方财富	408,492.00	3.07
46	601857	中国石油	408,238.00	3.07
47	601186	中国铁建	403,085.00	3.03
48	600015	华夏银行	399,202.00	3.00
49	601006	大秦铁路	397,506.00	2.99
50	601088	中国神华	387,812.00	2.91
51	002008	大族激光	381,251.00	2.87
52	600690	海尔智家	374,811.00	2.82
53	000776	广发证券	370,503.00	2.78
54	601989	中国重工	368,692.00	2.77
55	001979	招商蛇口	358,030.00	2.69
56	600009	上海机场	348,003.00	2.62
57	000538	云南白药	345,167.00	2.59
58	601939	建设银行	343,421.00	2.58
59	600999	招商证券	342,704.00	2.58
60	601628	中国人寿	342,597.00	2.57
61	600031	三一重工	342,051.00	2.57
62	600958	东方证券	340,788.00	2.56
63	601555	东吴证券	338,648.00	2.55
64	002230	科大讯飞	321,238.00	2.41
65	601899	紫金矿业	319,805.00	2.40
66	600703	三安光电	317,082.00	2.38
67	002142	宁波银行	310,157.70	2.33
68	601009	南京银行	309,191.00	2.32
69	600340	华夏幸福	308,642.00	2.32
70	002024	苏宁易购	306,750.00	2.31
71	601336	新华保险	302,379.00	2.27
72	000166	申万宏源	292,282.00	2.20
73	000338	潍柴动力	283,351.00	2.13

74	601669	中国电建	279,458.00	2.10
75	601229	上海银行	276,215.00	2.08
76	002475	立讯精密	274,590.00	2.06
77	600795	国电电力	273,351.00	2.05
78	002027	分众传媒	272,347.00	2.05
79	000568	泸州老窖	271,202.00	2.04
80	601377	兴业证券	266,953.00	2.01
81	002594	比亚迪	266,653.00	2.00

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	601318	中国平安	3,249,276.00	24.42
2	600519	贵州茅台	2,792,744.00	20.99
3	600036	招商银行	2,642,530.00	19.86
4	601166	兴业银行	2,180,751.00	16.39
5	601328	交通银行	2,053,709.00	15.43
6	000333	美的集团	1,992,330.00	14.97
7	600016	民生银行	1,923,458.00	14.46
8	600030	中信证券	1,840,789.00	13.83
9	000651	格力电器	1,756,617.00	13.20
10	000858	五粮液	1,220,807.00	9.17
11	600837	海通证券	1,030,044.74	7.74
12	002714	牧原股份	933,677.00	7.02
13	600887	伊利股份	834,781.00	6.27
14	600276	恒瑞医药	829,355.84	6.23
15	600000	浦发银行	764,037.00	5.74
16	601668	中国建筑	744,695.00	5.60

17	601398	工商银行	713,829.00	5.36
18	000002	万科 A	678,604.00	5.10
19	000725	京东方 A	631,846.00	4.75
20	601169	北京银行	596,237.00	4.48
21	600104	上汽集团	531,610.00	4.00
22	601766	中国中车	523,841.00	3.94
23	601601	中国太保	505,451.00	3.80
24	000876	新希望	503,943.00	3.79
25	601211	国泰君安	500,010.00	3.76
26	600900	长江电力	498,759.00	3.75
27	600518	ST康美	471,874.50	3.55
28	002415	海康威视	471,652.00	3.54
29	601688	华泰证券	462,694.00	3.48
30	000063	中兴通讯	438,054.97	3.29
31	600547	山东黄金	431,447.00	3.24
32	601988	中国银行	421,372.00	3.17
33	000001	平安银行	407,797.00	3.06
34	601818	光大银行	354,335.00	2.66
35	600050	中国联通	350,650.00	2.64
36	601390	中国中铁	349,947.00	2.63
37	600048	保利地产	348,961.00	2.62
38	600028	中国石化	347,583.00	2.61
39	600309	万华化学	343,329.00	2.58
40	600019	宝钢股份	311,594.00	2.34
41	601888	中国国旅	308,160.00	2.32
42	002008	大族激光	306,113.00	2.30
43	600015	华夏银行	304,036.00	2.28
44	601006	大秦铁路	290,908.00	2.19
45	601186	中国铁建	289,505.00	2.18
46	601989	中国重工	288,351.00	2.17
47	000776	广发证券	282,357.00	2.12

48	002304	洋河股份	281,410.00	2.11
49	600958	东方证券	279,113.00	2.10
50	601628	中国人寿	278,973.00	2.10
51	601555	东吴证券	270,130.00	2.03

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	95,702,958.82
卖出股票收入（成交）总额	68,556,042.50

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,140,283.40	4.40
	其中：政策性金融债	2,140,283.40	4.40
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	2,140,283.40	4.40

#### 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	108603	国开1804	21,390	2,140,283.4 0	4.40

注：本基金本报告期末仅持有上述债券。

#### 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 报告期末，本基金投资的前十名证券除“招商银行（证券代码600036）”外其他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。

本基金投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

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	45,221.01
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	54,069.38
5	应收申购款	195,640.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	294,930.50

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

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五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
4,249	8,805.52	0.00	0.00%	37,414,642.92	100.00%

## 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	1,581,656.66	4.23%

## 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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	>100
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(2014年06月17日)基金份额总额	234,720,620.35
本报告期期初基金份额总额	13,496,433.96
本报告期基金总申购份额	110,575,816.60
减：本报告期基金总赎回份额	86,657,607.64
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	37,414,642.92

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；

2019年1月，中国农业银行总行决定免去史静欣托管业务部副总裁职务；2019年4月，中国农业银行总行决定免去马曙光托管业务部总裁职务。

## 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的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
银河证券	1	11,924,384.34	7.26%	8,720.41	7.26%	-
中信建投	1	110,872,402.60	67.50%	81,080.87	67.50%	-
东吴证券	1	1,094,456.00	0.67%	800.37	0.67%	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-

西藏东方财富证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	3	40,354,327.50	24.57%	29,512.10	24.57%	-

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	2, 14 3, 25 0. 61	100. 00%	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20190111 - 20190117	-	34, 65 5, 56 1. 17	34, 65 5, 56 1. 17	-	0. 00%
	2	20190221 - 20190303	-	34, 65 5, 56 1. 17	34, 65 5, 56 1. 17	-	0. 00%
	3	20190111 - 20190117	-	25, 86 6, 26 3. 60	25, 86 6, 26 3. 60	-	0. 00%

#### 产品特有风险

##### 1. 巨额赎回风险

(1) 本基金单一投资者所持有的基金份额占比较大, 单一投资者的巨额赎回, 可能导致基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要, 对本基金的投资运作及净值表现产生较大影响。

响；

(2) 单一投资者大额赎回时容易造成本基金发生巨额赎回。在发生巨额赎回情形时，在符合基金合同约定情况下，如基金管理人认为有必要，可延期办理本基金的赎回申请，投资者可能面临赎回申请被延期办理的风险；如果连续2个开放日以上（含）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；

#### 2. 转换运作方式或终止基金合同的风险

单一投资者巨额赎回后，若本基金连续60个工作日基金份额持有人低于200人或基金资产净值低于5000万情形的，基金管理人应当向中国证监会提出解决方案，或按基金合同约定，转换运作方式或终止基金合同，其他投资者可能面临基金转换运作方式或终止基金合同的风险；

#### 3. 流动性风险

单一投资者巨额赎回可能导致本基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；

4. 巨额赎回可能导致基金资产规模过小，导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

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