
前海开源沪深 300 指数型证券投资基金

2019 年半年度报告

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。

本报告期自2019年01月01日起至2019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	7
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	13
§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	15
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股票投资明细	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	56
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	57
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	57
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	57
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	57
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	57
7.12 投资组合报告附注	58
§8 基金份额持有人信息	59
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	59

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	59
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.....	59
§9 开放式基金份额变动.....	59
§10 重大事件揭示.....	60
10.1 基金份额持有人大会决议.....	60
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.....	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	60
10.4 基金投资策略的改变.....	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	60
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.....	60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	60
10.8 其他重大事件.....	62
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	65
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.....	65
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	66
§12 备查文件目录.....	66
12.1 备查文件目录.....	66
12.2 存放地点.....	66
12.3 查阅方式.....	66

§ 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	<p>沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。</p>
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
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）	北京市东城区建国门内大街69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	北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码	518040	100031
法定代表人	王兆华	周慕冰

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
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（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
本期加权平均净值利润率	16.78%
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）
期末可供分配利润	11,264,325.10
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
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2019年06月30日）
基金份额累计净值增长率	64.09%

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，2015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，未发现有关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	附注号	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	6.4.7.1	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	6.4.7.2	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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	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	6.4.7.6	-	-
资产总计		49,078,291.94	13,712,079.84
负债和所有者权益	附注号	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	6.4.7.3	-	-
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	6.4.7.7	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	6.4.7.8	155,548.34	190,528.84
负债合计		399,323.92	406,082.49
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	37,414,642.92	13,496,433.96
未分配利润	6.4.7.10	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	附注号	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	6.4.7.11	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	6.4.7.12	3,599,941.85	1,247,990.11
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	-	327.83
资产支持证券投资	6.4.7.14.	-	-
收益	5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	444,001.55	88,967.88
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	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“-”	6.4.7.19	150,427.61	110,666.04

号填列)			
减：二、费用		440,440.46	309,089.58
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	112,798.76	61,189.59
2. 托管费	6.4.10.2.2	20,146.12	9,178.40
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	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	6.4.7.21	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)	-	-	-

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

何隽

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 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 2019年06月30日
活期存款	1,202,033.92
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	1,202,033.92

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末2019年06月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	44,276,310.55	45,394,390.74	1,118,080.19
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	2,143,250.61	2,140,283.40
	银行间市场	-	-
	合计	2,143,250.61	2,140,283.40
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	46,419,561.16	47,534,674.14	1,115,112.98

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年06月30日
应收活期存款利息	234.98
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	18.81

应收债券利息	53,797.32
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	18.27
合计	54,069.38

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 2019年06月30日
交易所市场应付交易费用	29,829.30
银行间市场应付交易费用	-
合计	29,829.30

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	671.95
预提费用	114,876.39
其他应付	40,000.00
合计	155,548.34

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2019年01月01日至2019年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	13,496,433.96	13,496,433.96
本期申购	110,575,816.60	110,575,816.60
本期赎回（以“-”号填列）	-86,657,607.64	-86,657,607.64
本期末	37,414,642.92	37,414,642.92

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	24,850,878.42	-25,041,315.03	-190,436.61
本期利润	3,774,857.92	2,277,139.65	6,051,997.57
本期基金份额交易产生的变动数	46,647,855.72	-41,245,091.58	5,402,764.14
其中：基金申购款	210,825,283.50	-192,145,033.70	18,680,249.80
基金赎回款	-164,177,427.78	150,899,942.12	-13,277,485.66
本期已分配利润	-	-	-
本期末	75,273,592.06	-64,009,266.96	11,264,325.10

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2019年01月01日至2019年06月30日
活期存款利息收入	9,786.95
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	1,157.62
其他	1,016.58
合计	11,961.15

注：“其他”为申购款利息收入及结算保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019年01月01日至2019年06月30日
卖出股票成交总额	68,556,042.50
减：卖出股票成本总额	64,956,100.65
买卖股票差价收入	3,599,941.85

6.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期内无基金投资收益。

6.4.7.14 债券投资收益**6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成**

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内无债券买卖差价收入。

6.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

6.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券申购差价收入。

6.4.7.14.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.15 贵金属投资收益**6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无贵金属买卖差价收入。

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
	2019年01月01日至2019年06月30日
股票投资产生的股利收益	444,001.55
基金投资产生的股利收益	-
合计	444,001.55

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2019年01月01日至2019年06月30日
1. 交易性金融资产	2,277,139.65
——股票投资	2,280,106.86
——债券投资	-2,967.21
——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	2,277,139.65

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日
基金赎回费收入	61,751.51
转换费收入	88,676.10
合计	150,427.61

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日
交易所市场交易费用	203,288.68
银行间市场交易费用	-
合计	203,288.68

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日
审计费用	14,876.39
信息披露费	-
汇划手续费	1,330.51
指数使用费	80,000.00
律师费	8,000.00
合计	104,206.90

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，本基金无需要说明的重大或有事项。

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。

6.4.10 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内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内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内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内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 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。

6.4.10.2.2 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。

6.4.10.2.3 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内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	本期	上年度可比期间

称	2019年01月01日至2019年06月30日		2018年01月01日至2018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
中国农业 银行股份 有限公司	1,202,033.92	9,786.95	464,053.37	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。

6.4.10.6 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内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内无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况—非货币市场基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2019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

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	-

6.4.12.3 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。

6.4.12.3.2 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。

6.4.13 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 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	2,140,283.40	-
合计	2,140,283.40	-

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

本基金本报告期末未持有长期信用评级的债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有长期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末未持有长期信用评级的同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限的投资品种比例等。本基金所持大部分证券在证券交易所或银行间同业市场交易，除在“期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制的情况外，其余均能及时变现。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注6.4.12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2019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	1,202,033.92	-	-	-	1,202,033.92
结算备付金	46,653.38	-	-	-	46,653.38
存出保证金	45,221.01	-	-	-	45,221.01
交易性金融资	2,140,283.40	-	-	45,394,390.74	47,534,674.14

产					
应收利息	-	-	-	54,069.38	54,069.38
应收申购款	748.80	-	-	194,891.31	195,640.11
资产总计	3,434,940.51	-	-	45,643,351.43	49,078,291.94
负债					
应付证券清算款	-	-	-	2,848.85	2,848.85
应付赎回款	-	-	-	187,749.76	187,749.76
应付管理人报酬	-	-	-	19,456.40	19,456.40
应付托管费	-	-	-	3,891.27	3,891.27
应付交易费用	-	-	-	29,829.30	29,829.30
其他负债	-	-	-	155,548.34	155,548.34
负债总计	-	-	-	399,323.92	399,323.92
利率敏感度缺口	3,434,940.51	-	-	45,244,027.51	48,678,968.02
上年度末2018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	982,082.77	-	-	-	982,082.77
结算备付金	311,431.93	-	-	-	311,431.93
存出保证金	21,989.73	-	-	-	21,989.73
交易性	-	-	-	12,367,425.71	12,367,425.71

金融资产					
应收利息	-	-	-	330.36	330.36
应收申购款	-	-	-	28,819.34	28,819.34
资产总计	1,315,504.43	-	-	12,396,575.41	13,712,079.84
负债					
应付赎回款	-	-	-	149,272.05	149,272.05
应付管理人报酬	-	-	-	11,265.92	11,265.92
应付托管费	-	-	-	1,689.88	1,689.88
应付交易费用	-	-	-	53,325.80	53,325.80
其他负债	-	-	-	190,528.84	190,528.84
负债总计	-	-	-	406,082.49	406,082.49
利率敏感度缺口	1,315,504.43	-	-	11,990,492.92	13,305,997.35

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合同约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 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
	基准点利率增加0.25%	-932.07	-
	基准点利率减少0.25%	932.90	-

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 2019年06月30日		上年度末 2018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	45,394,390.74	93.25	12,367,425.71	92.95
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	45,394,390.74	93.25	12,367,425.71	92.95

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 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
	权益性投资的市场价格上升5%	2,447,313.61	652,098.48
权益性投资的市场价格下降5%	-2,447,313.61	-652,098.48	

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	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、软件和信息技术服务业	1,634,972.55	3.36
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	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
11	601328	交通银行	100,535	615,274.20	1.26
12	600016	民生银行	90,535	574,897.25	1.18
13	600000	浦发银行	42,950	501,656.00	1.03
14	000002	万科A	17,700	492,237.00	1.01
15	300498	温氏股份	13,500	484,110.00	0.99
16	601398	工商银行	78,945	464,986.05	0.96
17	601668	中国建筑	76,846	441,864.50	0.91
18	600900	长江电力	24,091	431,228.90	0.89
19	000001	平安银行	31,239	430,473.42	0.88
20	601601	中国太保	11,473	418,879.23	0.86
21	600837	海通证券	29,365	416,689.35	0.86
22	002415	海康威视	13,528	373,102.24	0.77
23	600048	保利地产	26,035	332,206.60	0.68

24	600104	上汽集团	12,760	325,380.00	0.67
25	601169	北京银行	54,154	320,050.14	0.66
26	601888	中国国旅	3,460	306,729.00	0.63
27	603288	海天味业	2,900	304,500.00	0.63
28	601211	国泰君安	16,424	301,380.40	0.62
29	600585	海螺水泥	7,246	300,709.00	0.62
30	601688	华泰证券	13,357	298,128.24	0.61
31	000725	京东方 A	86,503	297,570.32	0.61
32	600009	上海机场	3,479	291,470.62	0.60
33	601988	中国银行	77,191	288,694.34	0.59
34	601766	中国中车	35,607	288,060.63	0.59
35	000063	中兴通讯	8,701	283,043.53	0.58
36	600031	三一重工	21,325	278,931.00	0.57
37	600028	中国石化	48,932	267,658.04	0.55
38	002304	洋河股份	2,200	267,432.00	0.55
39	300059	东方财富	19,550	264,902.50	0.54
40	601088	中国神华	12,051	245,599.38	0.50
41	600309	万华化学	5,673	242,747.67	0.50
42	601229	上海银行	20,000	237,000.00	0.49
43	600690	海尔智家	13,457	232,671.53	0.48
44	002142	宁波银行	9,453	229,140.72	0.47
45	601818	光大银行	58,090	221,322.90	0.45
46	002475	立讯精密	8,901	220,655.79	0.45
47	600340	华夏幸福	6,579	214,278.03	0.44
48	000338	潍柴动力	17,304	212,666.16	0.44
49	600019	宝钢股份	32,675	212,387.50	0.44
50	601012	隆基股份	9,150	211,456.50	0.43
51	000568	泸州老窖	2,605	210,562.15	0.43
52	600050	中国联通	33,854	208,540.64	0.43
53	601857	中国石油	29,733	204,563.04	0.42
54	002027	分众传媒	37,340	197,528.60	0.41

55	600919	江苏银行	25,300	183,678.00	0.38
56	601939	建设银行	24,632	183,262.08	0.38
57	001979	招商蛇口	8,701	181,850.90	0.37
58	601989	中国重工	32,493	180,661.08	0.37
59	002230	科大讯飞	5,432	180,559.68	0.37
60	601009	南京银行	21,654	178,862.04	0.37
61	600999	招商证券	10,459	178,744.31	0.37
62	601390	中国中铁	27,390	178,582.80	0.37
63	601006	大秦铁路	21,844	176,717.96	0.36
64	601628	中国人寿	6,149	174,139.68	0.36
65	002714	牧原股份	2,960	174,018.40	0.36
66	600015	华夏银行	22,511	173,334.70	0.36
67	002594	比亚迪	3,333	169,049.76	0.35
68	601186	中国铁建	16,942	168,572.90	0.35
69	601899	紫金矿业	44,461	167,617.97	0.34
70	000538	云南白药	2,000	166,840.00	0.34
71	601336	新华保险	3,027	166,575.81	0.34
72	000166	申万宏源	32,913	164,894.13	0.34
73	600570	恒生电子	2,361	160,902.15	0.33
74	002024	苏宁易购	13,601	156,139.48	0.32
75	000776	广发证券	10,804	148,446.96	0.30
76	600352	浙江龙盛	9,369	147,749.13	0.30
77	601669	中国电建	27,847	147,310.63	0.30
78	601933	永辉超市	14,038	143,327.98	0.29
79	300015	爱尔眼科	4,549	140,882.53	0.29
80	600958	东方证券	13,099	139,897.32	0.29
81	601225	陕西煤业	14,690	135,735.60	0.28
82	000661	长春高新	400	135,200.00	0.28
83	000876	新希望	7,700	133,749.00	0.27
84	000100	TCL 集团	39,598	131,861.34	0.27
85	601155	新城控股	3,200	127,392.00	0.26

86	600436	片仔癀	1,100	126,720.00	0.26
87	002202	金风科技	10,080	125,294.40	0.26
88	600406	国电南瑞	6,716	125,186.24	0.26
89	300142	沃森生物	4,400	124,784.00	0.26
90	600741	华域汽车	5,724	123,638.40	0.25
91	600588	用友网络	4,553	122,384.64	0.25
92	002736	国信证券	9,003	118,479.48	0.24
93	600660	福耀玻璃	5,164	117,377.72	0.24
94	601377	兴业证券	17,185	115,826.90	0.24
95	600547	山东黄金	2,784	114,617.28	0.24
96	600010	包钢股份	66,704	112,729.76	0.23
97	000157	中联重科	18,702	112,399.02	0.23
98	000783	长江证券	14,107	110,175.67	0.23
99	002008	大族激光	3,200	110,016.00	0.23
100	600795	国电电力	43,227	109,796.58	0.23
101	601901	方正证券	15,163	107,808.93	0.22
102	600705	中航资本	19,598	106,221.16	0.22
103	601111	中国国航	10,956	104,848.92	0.22
104	000069	华侨城 A	14,901	103,561.95	0.21
105	600111	北方稀土	8,011	102,861.24	0.21
106	603993	洛阳钼业	25,901	102,567.96	0.21
107	600011	华能国际	16,200	100,926.00	0.21
108	600703	三安光电	8,945	100,899.60	0.21
109	601108	财通证券	9,100	99,918.00	0.21
110	600089	特变电工	13,673	99,129.25	0.20
111	600383	金地集团	8,257	98,506.01	0.20
112	600886	国投电力	12,556	97,560.12	0.20
113	601800	中国交建	8,584	97,170.88	0.20
114	600029	南方航空	12,572	97,055.84	0.20
115	600438	通威股份	6,900	97,014.00	0.20
116	002236	大华股份	6,600	95,832.00	0.20

117	600271	航天信息	4,138	95,380.90	0.20
118	601985	中国核电	17,050	94,798.00	0.19
119	601600	中国铝业	23,980	94,001.60	0.19
120	600196	复星医药	3,697	93,534.10	0.19
121	002422	科伦药业	3,100	92,163.00	0.19
122	600606	绿地控股	13,346	91,153.18	0.19
123	002007	华兰生物	2,974	90,677.26	0.19
124	002001	新和成	4,700	90,663.00	0.19
125	300003	乐普医疗	3,900	89,778.00	0.18
126	000895	双汇发展	3,606	89,753.34	0.18
127	601555	东吴证券	8,743	89,615.75	0.18
128	600115	东方航空	14,250	89,347.50	0.18
129	603019	中科曙光	2,500	87,750.00	0.18
130	002311	海大集团	2,800	86,520.00	0.18
131	600109	国金证券	8,854	86,060.88	0.18
132	002044	美年健康	6,900	85,836.00	0.18
133	600221	海航控股	42,146	85,556.38	0.18
134	600061	国投资本	6,053	84,802.53	0.17
135	300124	汇川技术	3,701	84,789.91	0.17
136	600522	中天科技	9,100	83,447.00	0.17
137	600332	白云山	2,025	82,964.25	0.17
138	000963	华东医药	3,180	82,552.80	0.17
139	000413	东旭光电	16,002	82,250.28	0.17
140	002410	广联达	2,500	82,225.00	0.17
141	600487	亨通光电	4,900	82,124.00	0.17
142	600177	雅戈尔	12,868	81,711.80	0.17
143	601788	光大证券	7,140	81,538.80	0.17
144	000768	中航飞机	5,100	80,325.00	0.17
145	600018	上港集团	11,739	80,059.98	0.16
146	600637	东方明珠	7,552	79,598.08	0.16
147	601618	中国中冶	26,126	79,423.04	0.16

148	600100	同方股份	8,670	78,463.50	0.16
149	300122	智飞生物	1,800	77,580.00	0.16
150	601607	上海医药	4,229	76,756.35	0.16
151	600893	航发动力	3,349	76,055.79	0.16
152	300408	三环集团	3,900	75,855.00	0.16
153	000425	徐工机械	16,996	75,802.16	0.16
154	300017	网宿科技	7,029	75,772.62	0.16
155	002271	东方雨虹	3,300	74,778.00	0.15
156	002352	顺丰控股	2,200	74,712.00	0.15
157	601877	正泰电器	3,200	73,888.00	0.15
158	600176	中国巨石	7,700	73,381.00	0.15
159	600498	烽火通信	2,600	72,436.00	0.15
160	600516	方大炭素	5,811	71,417.19	0.15
161	300136	信维通信	2,900	70,905.00	0.15
162	601919	中远海控	14,038	70,470.76	0.14
163	600867	通化东宝	4,504	69,361.60	0.14
164	601727	上海电气	12,873	69,256.74	0.14
165	600004	白云机场	3,800	69,160.00	0.14
166	300033	同花顺	700	68,852.00	0.14
167	002460	赣锋锂业	2,900	67,947.00	0.14
168	000423	东阿阿胶	1,700	67,694.00	0.14
169	000728	国元证券	7,359	67,482.03	0.14
170	601998	中信银行	11,274	67,305.78	0.14
171	600489	中金黄金	6,500	66,755.00	0.14
172	600023	浙能电力	14,907	65,888.94	0.14
173	002673	西部证券	6,504	65,560.32	0.13
174	002466	天齐锂业	2,560	64,716.80	0.13
175	601018	宁波港	14,467	63,510.13	0.13
176	600066	宇通客车	4,870	63,407.40	0.13
177	600926	杭州银行	7,600	63,308.00	0.13
178	002241	歌尔股份	7,110	63,207.90	0.13

179	600068	葛洲坝	10,143	63,190.89	0.13
180	002179	中航光电	1,880	62,904.80	0.13
181	300144	宋城演艺	2,700	62,478.00	0.13
182	600809	山西汾酒	900	62,145.00	0.13
183	300024	机器人	4,021	61,239.83	0.13
184	600170	上海建工	16,283	61,224.08	0.13
185	601997	贵阳银行	7,060	61,069.00	0.13
186	002081	金螳螂	5,900	60,829.00	0.12
187	601198	东兴证券	5,092	60,492.96	0.12
188	600362	江西铜业	3,840	60,441.60	0.12
189	002146	荣盛发展	6,400	60,096.00	0.12
190	600398	海澜之家	6,600	59,862.00	0.12
191	000961	中南建设	6,900	59,754.00	0.12
192	600219	南山铝业	26,200	59,212.00	0.12
193	600085	同仁堂	2,029	58,841.00	0.12
194	601881	中国银河	4,800	58,800.00	0.12
195	601838	成都银行	6,600	58,278.00	0.12
196	600674	川投能源	6,506	57,903.40	0.12
197	002602	世纪华通	5,300	57,876.00	0.12
198	000703	恒逸石化	4,200	57,372.00	0.12
199	000630	铜陵有色	23,024	56,639.04	0.12
200	601021	春秋航空	1,250	56,250.00	0.12
201	000786	北新建材	3,100	56,203.00	0.12
202	600535	天士力	3,388	56,071.40	0.12
203	002739	万达电影	3,000	55,320.00	0.11
204	002456	欧菲光	7,000	54,880.00	0.11
205	603156	养元饮品	1,480	54,878.40	0.11
206	600482	中国动力	2,300	54,326.00	0.11
207	002493	荣盛石化	4,500	54,270.00	0.11
208	002050	三花智控	5,130	54,121.50	0.11
209	300070	碧水源	6,920	53,906.80	0.11

210	600297	广汇汽车	11,960	53,341.60	0.11
211	000629	攀钢钒钛	15,700	53,223.00	0.11
212	601138	工业富联	4,400	53,020.00	0.11
213	603986	兆易创新	600	52,020.00	0.11
214	603799	华友钴业	2,430	51,783.30	0.11
215	002555	三七互娱	3,800	51,490.00	0.11
216	600369	西南证券	10,317	50,965.98	0.10
217	300296	利亚德	6,500	50,895.00	0.10
218	600663	陆家嘴	3,200	49,600.00	0.10
219	600208	新湖中宝	15,728	49,385.92	0.10
220	002624	完美世界	1,900	49,039.00	0.10
221	600118	中国卫星	2,154	48,572.70	0.10
222	002065	东华软件	6,900	48,231.00	0.10
223	000596	古井贡酒	400	47,404.00	0.10
224	000625	长安汽车	7,103	47,092.89	0.10
225	600153	建发股份	5,236	46,495.68	0.10
226	600760	中航沈飞	1,600	46,448.00	0.10
227	000656	金科股份	7,700	46,431.00	0.10
228	000709	河钢股份	15,503	46,353.97	0.10
229	601992	金隅集团	12,300	46,248.00	0.10
230	600038	中直股份	1,125	46,147.50	0.09
231	002508	老板电器	1,700	46,138.00	0.09
232	000627	天茂集团	7,100	46,079.00	0.09
233	600346	恒力石化	3,780	45,964.80	0.09
234	600027	华电国际	12,100	45,617.00	0.09
235	601878	浙商证券	4,900	45,570.00	0.09
236	002032	苏泊尔	600	45,498.00	0.09
237	600583	海油工程	8,038	45,012.80	0.09
238	002153	石基信息	1,200	43,428.00	0.09
239	601117	中国化学	7,200	43,344.00	0.09
240	603833	欧派家居	400	43,048.00	0.09

241	600977	中国电影	2,700	42,282.00	0.09
242	002558	巨人网络	2,300	41,791.00	0.09
243	603160	汇顶科技	300	41,640.00	0.09
244	600688	上海石化	8,066	41,620.56	0.09
245	603858	步长制药	1,600	41,232.00	0.08
246	600415	小商品城	9,898	40,779.76	0.08
247	601216	君正集团	12,345	40,615.05	0.08
248	600816	安信信托	7,944	40,117.20	0.08
249	601066	中信建投	1,900	40,052.00	0.08
250	000671	阳光城	6,000	38,880.00	0.08
251	002252	上海莱士	5,480	38,086.00	0.08
252	002010	传化智联	4,800	36,144.00	0.07
253	600566	济川药业	1,200	36,132.00	0.07
254	601238	广汽集团	3,300	36,069.00	0.07
255	601319	中国人保	3,800	36,062.00	0.07
256	002294	信立泰	1,600	35,808.00	0.07
257	600188	兖州煤业	3,291	35,773.17	0.07
258	601633	长城汽车	4,302	35,577.54	0.07
259	600704	物产中大	6,427	34,834.34	0.07
260	300072	三聚环保	4,390	34,812.70	0.07
261	002310	东方园林	5,800	34,800.00	0.07
262	603259	药明康德	400	34,672.00	0.07
263	000402	金融街	4,401	34,503.84	0.07
264	002601	龙鳞佰利	2,300	34,109.00	0.07
265	000898	鞍钢股份	8,840	33,503.60	0.07
266	002120	韵达股份	1,050	32,361.00	0.07
267	601898	中煤能源	6,700	32,160.00	0.07
268	601360	三六零	1,500	32,070.00	0.07
269	002773	康弘药业	920	30,286.40	0.06
270	000938	紫光股份	1,076	29,321.00	0.06
271	600372	中航电子	1,965	29,160.60	0.06

272	300413	芒果超媒	700	28,735.00	0.06
273	601228	广州港	6,800	28,424.00	0.06
274	002411	延安必康	1,600	27,840.00	0.06
275	002468	申通快递	1,100	27,434.00	0.06
276	000415	渤海租赁	6,900	27,048.00	0.06
277	600025	华能水电	6,600	26,862.00	0.06
278	002938	鹏鼎控股	900	26,424.00	0.05
279	600998	九州通	2,100	25,956.00	0.05
280	600339	中油工程	6,000	25,320.00	0.05
281	300251	光线传媒	3,220	21,896.00	0.04
282	601808	中海油服	2,200	21,186.00	0.04
283	300433	蓝思科技	3,000	20,910.00	0.04
284	002939	长城证券	1,200	20,028.00	0.04
285	601162	天风证券	1,800	19,512.00	0.04
286	000408	藏格控股	2,300	19,021.00	0.04
287	600390	五矿资本	2,000	18,860.00	0.04
288	002945	华林证券	1,000	18,500.00	0.04
289	000553	安道麦A	1,600	17,152.00	0.04
290	601828	美凯龙	1,400	17,010.00	0.03
291	600233	圆通速递	1,300	16,029.00	0.03
292	002925	盈趣科技	400	15,604.00	0.03
293	002625	光启技术	1,600	14,864.00	0.03
294	601212	白银有色	3,300	14,487.00	0.03
295	601298	青岛港	1,700	14,263.00	0.03
296	603260	合盛硅业	300	14,118.00	0.03
297	601577	长沙银行	1,400	13,356.00	0.03
298	600733	北汽蓝谷	1,500	12,390.00	0.03
299	600299	安迪苏	1,000	10,370.00	0.02

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	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
6	601333	广深铁路	15,383	49,687.09	0.10
7	002572	索菲亚	2,600	48,256.00	0.10
8	600485	*ST信威	7,295	45,812.60	0.09
9	600157	永泰能源	26,764	44,963.52	0.09
10	000503	国新健康	2,504	42,968.64	0.09
11	002085	万丰奥威	5,240	38,147.20	0.08
12	000983	西山煤电	5,800	35,148.00	0.07
13	601991	大唐发电	10,300	31,827.00	0.07
14	000826	启迪环境	2,574	30,347.46	0.06
15	601611	中国核建	3,200	24,896.00	0.05
16	000959	首钢股份	6,500	22,880.00	0.05
17	001965	招商公路	2,500	20,825.00	0.04

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	2,140,283.40	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 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	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	

	数量		的比例		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	2,143,250.61	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	-	-	-	-	-	-	-	-

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2018年12月31日基金资产净值、基金份额净值及基金份额累计净值公告	基金管理人的官方网站	2019-01-02

	(一)		
2	前海开源基金管理有限公司关于增加第一创业证券为旗下部分基金的销售机构并参与其费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人的官方网站	2019-01-08
3	关于调整前海开源旗下部分证券投资基金通过东海证券办理定投业务起点金额的公告	证券日报、基金管理人的官方网站	2019-01-21
4	前海开源沪深300指数型证券投资基金2018年第4季度报告	证券日报、基金管理人的官方网站	2019-01-22
5	前海开源沪深300指数型证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2018年第2号）	证券日报、基金管理人的官方网站	2019-01-30
6	前海开源沪深300指数型证券投资基金招募说明书（更新）（2018年第2号）	基金管理人的官方网站	2019-01-30
7	前海开源基金管理有限公司关于暂停大泰金石基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	证券日报、基金管理人的官方网站	2019-01-31
8	前海开源基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加申万宏源证券、申万宏源西部证券申购及定投费率优惠的公告	证券日报、基金管理人的官方网站	2019-02-19
9	前海开源基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加平安证券认购、申购及定投费率优惠的公告	证券日报、基金管理人的官方网站	2019-03-04
10	前海开源沪深300指数型证券投资基金基金合同（2019年3月修订）	基金管理人的官方网站	2019-03-14

11	前海开源沪深300指数型证券投资基金托管协议（2019年3月修订）	基金管理人的官方网站	2019-03-14
12	关于调整前海开源沪深300指数型证券投资基金管理费率及托管费率并修改基金合同等事项的公告	证券日报、基金管理人的官方网站	2019-03-14
13	前海开源基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加国泰君安认购、申购及定投费率优惠的公告	证券日报、基金管理人的官方网站	2019-03-15
14	前海开源基金管理有限公司关于增加信诚基金为旗下部分基金的销售机构并参与其费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人的官方网站	2019-03-15
15	前海开源沪深300指数型证券投资基金2018年年度报告摘要	证券日报、基金管理人的官方网站	2019-03-27
16	前海开源基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加凤凰金信转换业务申购补差费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人的官方网站	2019-03-27
17	前海开源沪深300指数型证券投资基金2018年年度报告	基金管理人的官方网站	2019-03-27
18	前海开源基金管理有限公司关于开源宝赎回转认/申购基金业务在电子直销平台实施费率优惠的公告	证券日报、基金管理人的官方网站	2019-03-29
19	前海开源基金管理有限公司关于增加玄元保险为旗下部分基金的销售机构并参与其费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人的官方网站	2019-04-03
20	前海开源沪深300指数型证	证券日报、基金管理人的官	2019-04-19

	券投资基金2019年第1季度报告	方网站	
21	关于调整前海开源旗下部分证券投资基金通过恒宇天泽办理定投业务起点金额的公告	证券日报、基金管理人的官方网站	2019-04-25
22	前海开源基金管理有限公司关于增加华福证券为旗下部分基金的销售机构并参与其费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人的官方网站	2019-05-17
23	前海开源基金管理有限公司关于增加中证金牛为旗下部分基金的代销机构并参加其费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人的官方网站	2019-06-03
24	前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资于科创板股票的公告	证券日报、基金管理人的官方网站	2019-06-21
25	前海开源基金管理有限公司关于增加新华信通为旗下部分基金的销售机构并参与其费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人的官方网站	2019-06-24

§ 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	0.00	34,655,561.17	34,655,561.17	0.00	0.00%
	2	20190221 - 20190303	0.00	34,655,561.17	34,655,561.17	0.00	0.00%

	3	20190111 - 201901 17	0.00	25,866,263.60	25,866,263.60	0.00	0.00%
产品特有风险							
<p>1. 巨额赎回风险</p> <p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>2. 转换运作方式或终止基金合同的风险</p> <p>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；</p> <p>3. 流动性风险</p> <p>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；</p> <p>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。</p>							

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”。

§ 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沪深300指数型证券投资基金设立的文件
- (2) 《前海开源沪深300指数型证券投资基金基金合同》
- (3) 《前海开源沪深300指数型证券投资基金托管协议》
- (4) 《前海开源沪深300指数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) 前海开源沪深300指数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

二〇一九年八月二十四日