前海开源大安全核心精选灵活配置混合型证券投资基金

2015 第二季度 报告

2015年6月30日

基金管理人:前海开源基金管理有限公司

基金托管人:中国建设银行股份有限公司

报告送出日期:2015年7月20日

§1 重要提示

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年7月17日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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	前海开源大安全混合
场内简称	-
交易代码	000969
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年2月6日
报告期末基金份额总额	808,688,954.38份
投资目标	本基金主要通过精选投资与大安全主题相关的优质证券,在合理控制风险并保持基金资产良好流动性的前提下,力争实现基金资产的长期稳定增值。 大安全即国家安全,是国家的基本利益,是一个国家处于没有危险的客观状态。中国共产党中央国家安全委员会于2013年11月12日正式成立,将国家安全提升至前所未有的高度。在国家安全的大背景下,国家必将加大对相关领域的投资和政策支持,这些领域主要包括:国防军工、信息安全、能源安全、生态安全、食品安全、国民安全、经济安全和其他一些涉及国家安全的领域。
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。 2、股票投资策略 本基金将精选有良好增值潜力的、与大安全主题相关的上市公司股票构建股票投资组合。大安全主题的股票投资策略将从定性和定量两方面入手,定性方面主要考察上市公司所属行业发展前景、行业地位、竞争优势、管理团队、创新能力等多种因素;定量方面考量公司估值、资产质量及财务状况,比较分析各优质上市公司的估值、成长及财务指标,优先选择具有相对比较优势的公司作为最终股票投资对象。 3、债券投资策略 在债券投资策略方面,本基金将以大安全主题相关债券为主线,在综合研究的基础上实施积极主动的组合管理,采用宏观环境分析和微观市场定价分析两个方面进行债券资产的投资。在宏观环境分析方面,结合对宏观经济、市场利率、债券供求等因素的综合分析,根据交易所市场与银行间市场类属资产的风险收益特征,定期对投资组合类属资产进行优化配置和调整,确定不同类属资产的最优权重。 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、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。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×70%+中证全债指数收益率×30%。
风险收益特征	本基金为混合型基金,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。
基金管理人	前海开源基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年4月1日 - 2015年6月30日)
1.本期已实现收益	598,535,282.54
2.本期利润	426,897,133.29
3.加权平均基金份额本期利润	0.3447
4.期末基金资产净值	1,145,105,172.04
5.期末基金份额净值	1.416

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	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
过去三个月	23.67%	3.17%	8.37%	1.83%	15.30%	1.34%

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

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

注:①本基金的基金合同于2015年2月6日生效,截至2015年6月30日止,本基金成立未满1年。

②本基金的建仓期为6个月,截至2015年6月30日,本基金建仓期尚未结束。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
薛小波	执行投资总监	2015年2月6日	-	9年	本基金合同生效起至披露截止日不满一年;薛小波先生,33岁,清华大学工程力学学士、流体力学硕士。2006年7月至2014年4月任中信证券机械行业和军工行业首席分析师,高级副总裁。现任前海开源基金管理有限公司执行投资总监。

注:①对基金的首任基金经理,其"任职日期"为基金合同生效日,"离任日期"为根据公司决定确定的解聘日期,对此后的非首任基金经理,"任职日期"和"离任日期"分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《前海开源大安全核心精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》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 公平交易专项说明

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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内,我们采用动态灵活的投资策略,考虑到国家安全涉及的各领域中长期发展前景看好,但每个领域的驱动力和估值影响因素会有所不同,因此我们自上而下选领域,自下而上选公司,同时结合估值水平精选投资标的进行配置,取得了较好的投资业绩。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额单位净值为1.416元,报告期内单位净值增长率为23.67%,同期业绩比较基准收益率为8.37%。?

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从宏观经济面看,中国经济通过经济转型升级,正在从过去的高速增长走向中高速增长,转型过程中经济难免会有波动,但最终会走向更高质量更可持续发展的新常态。从资金面上看,一方面预计央行可能还会降准和降息,保持较为宽松的流动性,一方面预计资金从房地产、传统产业和信托等固定收益配置转向股市还将继续,再考虑到随着资本市场的开放,外资对中国股市的配置将大幅提高,可以预计未来还有大量资金将继续流入国内股市。结合宏观经济面和资金面,我们判断随着市场系统性风险的释放,未来市场将震荡向上。中国共产党中央国家安全委员会于2013年11月12日正式成立,将国家安全提升至前所未有的高度。在国家安全的大背景下,国家必将加大对相关领域的投资和政策支持,超越整体经济增速发展,具备高成长和高确定性。未来我们将继续保持稳健灵活的投资策略,围绕国家安全主题的投资范畴,精选个股,力争给投资者带来更好的回报。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§5 投资组合报告

5.1 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	1,064,830,395.65	83.84
	其中:股票	1,064,830,395.65	83.84
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	169,384,840.56	13.34
7	其他资产	35,924,834.62	2.83
8	合计	1,270,140,070.83	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	1,653.10	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	979,576,501.89	85.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	41,202,000.00	3.60
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	5,690,986.80	0.50
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	38,355,061.33	3.35
J	金融业	-	-
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	-	-
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	4,192.53	0.00
S	综合	-	-
	合计	1,064,830,395.65	92.99

5.3 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	601877	正泰电器	4,354,858	136,829,638.36	11.95
2	002008	大族激光	3,600,000	103,392,000.00	9.03
3	002450	康得新	3,100,000	94,860,000.00	8.28
4	002367	康力电梯	4,500,000	94,050,000.00	8.21
5	600038	中直股份	1,500,000	92,925,000.00	8.11
6	600703	三安光电	2,900,000	90,770,000.00	7.93
7	002013	中航机电	2,500,000	69,625,000.00	6.08
8	600885	宏发股份	1,500,000	47,010,000.00	4.11
9	002236	大华股份	1,400,000	44,688,000.00	3.90
10	000063	中兴通讯	1,849,887	44,045,809.47	3.85

5.4 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。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 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。

5.7 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。

5.8 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。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,041,029.14
2	应收证券清算款	32,879,873.58
3	应收股利	-
4	应收利息	20,018.09
5	应收申购款	1,983,913.81
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	35,924,834.62

5.11.4 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处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	601877	正泰电器	136,829,638.36	11.95	重大资产重组
2	002367	康力电梯	94,050,000.00	8.21	重大事项

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	2,470,233,595.07
报告期期间基金总申购份额	782,184,859.02
减:报告期期间基金总赎回份额	2,443,729,499.71
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	808,688,954.38

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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

1.本报告期内,经中国证券监督管理委员会(证监许可[2015]755号文)批准,基金管理人注册资本由人民币1.5亿元(RMB150,000,000.00元)增加至人民币2亿元(RMB200,000,000.00元)。新增注册资本5000万元人民币全部由深圳市和合投信资产管理合伙企业(有限合伙)出资。

2.本报告期内,基金管理人注册地址由"深圳市南山区粤兴二道6号武汉大学深圳产学研大楼B815房(入驻:深圳市前海商务秘书有限公司)"变更为"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)"。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

(1)中国证券监督管理委员会批准前海开源大安全核心精选灵活配置混合型证券投资基金设立的文件

(2)《前海开源大安全核心精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

(3)《前海开源大安全核心精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

(4)基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

(5)前海开源大安全核心精选灵活配置混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

9.3 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

2015年7月20日

前海开源大海洋战略经济灵活配置混合型证券投资基金

2015 第二季度 报告

2015年6月30日

基金管理人:前海开源基金管理有限公司

基金托管人:中国建设银行股份有限公司

报告送出日期:2015年7月20日

§1 重要提示

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年7月17日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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	前海开源大海洋混合
场内简称	-
交易代码	000690
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年7月31日
报告期末基金份额总额	258,088,623.10份
投资目标	本基金主要通过精选投资与大海洋战略经济相关的优质证券,在合理控制风险并保持基金资产良好流动性的前提下,力争实现基金资产的长期稳定增值。 大海洋战略是一个囊括了海洋经济发展、海洋科技进步、海洋环境保护、海上安全保障、国家安全以及海洋相关服务业发展的总体方略。大海洋战略经济是指在大海洋战略方针政策指导下的相关产业和经济领域,包括国防军工、海洋装备制造、信息安全、海洋运输、海洋油气、海洋生物医药、海水淡化综合利用、海洋新能源开发利用以及旅游等经济领域。
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。 2、股票投资策略 本基金将精选有良好增值潜力的、与大海洋战略经济主题相关的上市公司股票构建股票投资组合。大海洋战略经济股票投资策略将从定性和定量两方面入手,定性方面主要考察上市公司所属行业发展前景、行业地位、竞争优势、管理团队、创新能力等多种因素;定量方面考量公司估值、资产质量及财务状况,比较分析各优质上市公司的估值、成长及财务指标,优先选择具有相对比较优势的公司作为最终股票投资对象。 3、债券投资策略 在债券投资策略方面,本基金将以大海洋战略经济相关债券为主线,在综合研究的基础上实施积极主动的组合管理,采用宏观环境分析和微观市场定价分析两个方面进行债券资产的投资。在宏观环境分析方面,结合对宏观经济、市场利率、债券供求等因素的综合分析,根据交易所市场与银行间市场类属资产的风险收益特征,定期对投资组合类属资产进行优化配置和调整,确定不同类属资产的最优权重。 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、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。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×70%+中证全债指数收益率×30%。
风险收益特征	本基金为混合型基金,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。
基金管理人	前海开源基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年4月1日 - 2015年6月30日)
1.本期已实现收益	122,492,947.62
2.本期利润	102,511,302.22
3.加权平均基金份额本期利润	0.2944
4.期末基金资产净值	438,576,717.55
5.期末基金份额净值	1.699

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。

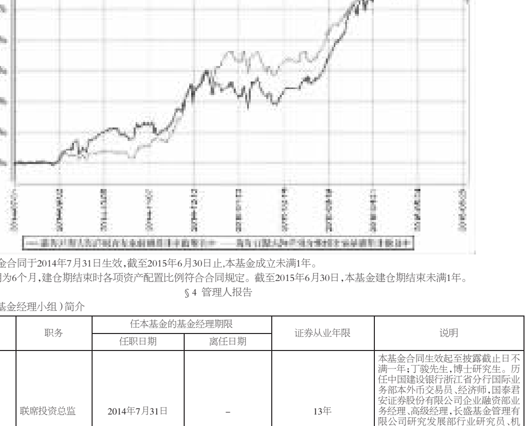
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	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
过去三个月	17.74%	2.40%	8.37%	1.83%	9.37%	0.57%

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

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



注:①本基金的基金合同于2014年7月31日生效,截至2015年6月30日止,本基金成立未满1年。

②本基金的建仓期为6个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。截至2015年6月30日,本基金建仓期结束未满1年。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
丁骏	联席投资总监	2014年7月31日	-	13年	本基金合同生效起至披露截止日不满一年;丁骏先生,博士研究生。历任中国建设银行浙江省分行国际业务部本外币交易员、经济师,国泰君安证券股份有限公司企业融资部业务经理、高级经理,长盛基金管理有限公司研究发展部行业研究员、机构理财部组合经理助理、基金同盛、长盛同智基金经理。现任前海开源基金管理有限公司董事总经理、联席投资总监。

注:①对基金的首任基金经理,其"任职日期"为基金合同生效日,"离任日期"为根据公司决定确定的解聘日期,对此后的非首任基金经理,"任职日期"和"离任日期"分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《前海开源大海洋战略经济灵活配置混合型证券投资基金基金合同》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 公平交易专项说明

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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年上半年,A股市场经历了较大幅度的快速上涨,在投资者获得较高回报的同时,市场也孕育了较大的投资风险。基于这样的判断,本基金在二季度逐步减持了投资组合中高估值的中小盘股票,适时兑现投资收益。在有所准备的情况下,6月15日后市场开始调整,本基金投资组合表现出较好的抵御风险能力。但是市场的调整幅度、力度和速度超出本基金的判断,市场随即进入快速杀跌阶段。市场中跌停股票众多甚至出现了部分流动性风险。在这个过程中,本基金组合中的前期强势股票出现了大幅度的补跌,基金净值也出现了较大的回撤。对此我们深表歉意。

3季度,本基金将继续秉承稳健的投资策略。具体来看,在宏观经济逐步触底复苏预期下,本基金将配置景气度提高、基本面扎实的优质蓝筹股;同时,在中小盘股票价格大幅回落后,我们也将择机选择其中成长性较好的优质个股进行投资。最后,我们也还要强调,我们坚定看好海洋经济这一战略产业,短期的市场波动不影响中长期趋势,看好的是中长期的趋势性机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金份额净值增长率为17.74%,同期业绩比较基准收益率为8.37%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从中长期来看,宏观经济将随着改革与转型的逐步深入,在以"互联网+"和"工业4.0"为代表的新发展模式推动下,获得高质量的持续增长动力。从短期来看,最新披露的核心经济指标表明经济开始企稳,预期货币政策将维持当前水平,但进一步宽松可能性降低,下一步将以疏通政策传导渠道来为财政政策推动稳增长护航。

市场方面,尽管二季度末市场回调力度较大,但驱动本轮市场上扬的动力依然存在且将长期发生作用。第一,央行分两批合计2万亿的地方债务置换措施有利于夯实经济发展基础,将在中长期内对市场产生积极影响;第二,"亚投行"、"一带一路"、和"中国制造2025"等国家层面长远发展战略得到稳步推进,上市公司将在这些战略中获得中长期的发展空间;第三,新一届政府改革力度强于预期,长期看经济结构将得以优化,企业增长潜力也将得以释放;我们仍看好股市未来3-5年的长期前景。但从短期来看,前期场外配资的杠杆交易是报告期末市场反转下行的重要诱发因素,随着后续相关监管措施的逐步完善,杠杆推动型牛市或将难以重现;另一方面,尽管经济出现企稳信号,但在转型与结构调整还远没有完成的情况下,经济出现强劲反弹的可能性不高,上市公司股价缺乏经济基本面支撑;综上,从资金面和基本面上看,短期内市场难以获得上行的动力。因此,短期内我们将以谨慎为主,根据市场变化进行波段操作。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§5 投资组合报告

5.1 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	406,618,758.41	72.23
	其中:股票	406,618,758.41	72.23
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	155,541,948.34	27.63
7	其他资产	784,790.30	0.14
8	合计	562,945,497.05	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	12,869,534.08	2.93
B	采矿业	16,247,863.64	3.70
C	制造业	250,737,418.27	57.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,706,000.00	3.13
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	12,387,500.00	2.82
G	交通运输、仓储和邮政业	15,660,336.00	3.57
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,111,500.00	2.31
J	金融业	30,865,976.30	7.04
K	房地产业	24,776,624.67	5.65
L	租赁和商务服务业	6,951,356.10	1.58
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	12,304,649.35	2.81
S	综合	-	-
	合计	406,618,758.41	92.71

5.3 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	000768	中航飞机	712,521	31,051,665.18	7.08
2	000880	潍柴重机	784,000	16,895,200.00	3.85
3	600056	中国医药	651,500	15,857,510.00	3.62
4	600487	亨通光电	405,600	14,926,080.00	3.40
5	600302	标准股份	1,148,821	14,038,592.62	3.20
6	600521	华海药业	448,300	14,009,375.00	3.19
7	600675	中华企业	1,208,875	13,672,376.25	3.12
8	000930	中粮生化	693,400	13,070,590.00	2.98
9	600048	保利地产	972,351	11,104,248.42	2.53
10	600643	爱建股份	657,280	10,996,294.40	2.51

5.4 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。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 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。

5.7 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。

5.8 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。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	601,876.18
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	16,599.01
5	应收申购款	166,315.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	784,790.30

5.11.4 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处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600643	爱建股份	10,996,294.40	2.51	重大事项

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	422,267,134.54
报告期期间基金总申购份额	73,046,056.39
减:报告期期间基金总赎回份额	237,224,567.83
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	258,088,623.10

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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

1.本报告期内,经中国证券监督管理委员会(证监许可[2015]755号文)批准,基金管理人注册资本由人民币1.5亿元(RMB150,000,000.00元)增加至人民币2亿元(RMB200,000,000.00元)。新增注册资本5000万元人民币全部由深圳市和合投信资产管理合伙企业(有限合伙)出资。

2.本报告期内,基金管理人注册地址由"深圳市南山区粤兴二道6号武汉大学深圳产学研大楼B815房(入驻:深圳市前海商务秘书有限公司)"变更为"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)"。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

(1)中国证券监督管理委员会批准前海开源大海洋战略经济灵活配置混合型证券投资基金设立的文件

(2)《前海开源大海洋战略经济灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

(3)《前海开源大海洋战略经济灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

(4)基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

(5)前海开源大海洋战略经济灵活配置混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

9.3 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

2015年7月20日

前海开源中证大农业指数增强型证券投资基金

2015 第二季度 报告

2015年6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:北京银行股份有限公司

报告送出日期:2015年7月20日

§1 重要提示

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。

基金托管人北京银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年7月17日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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	前海开源中证大农业指数增强
场内简称	-
交易代码	001027
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年2月13日
报告期末基金份额总额	308,063,952.39份
投资目标	本基金为股票指数增强型基金,即通过指数复制的方法拟合、跟踪中证大农业指数,并在严格控制跟踪偏离度和跟踪误差的前提下进行相对增强的组合管理。力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%,年跟踪误差不超过7.75%。
投资策略	1、资产配置策略 本基金的大类资产由股票资产和非股票资产构成。其中股票资产中绝大部分股票组合为全复制中证大农业的成份股及其备选成份股组合,非股票组合绝大部分由现金以及到期日在一年以内的政府债券组成,主要用于支付赎回款,支付交易费用、管理费和托管费等。 本基金为增强型指数基金,股票资产占基金资产的比例范围为90%-95%,其中投资于中证大农业指数成份股和备选成份股的资产占非现金基金资产的比例不低于80%。在基金运作过程中,为尽量减少跟踪误差,基金管理人将在法律法规和基金合同规定的范围内,根据对申购、赎回、转换等业务和相关费用提留的预判,尽可能降低现金组合所占比重,防止因现金比例增加而导致跟踪误差的加大。 2、股票投资策略 本基金采用指数复制结合相对增强的投资策略,即通过全样本复制的方式拟合、跟踪中证大农业指数,并在严格控制跟踪偏离度和跟踪误差的前提下进行相对增强的投资管理。以有效降低基金运作成本并提高本基金的投资收益率。 (1)指数复制策略 本基金将采用全样本复制的方式,即按照标的指数的成份股及其权重构建跟踪组合以拟合标的指数的业绩表现,具体包括:跟踪组合的构建和日常管理中的调整。 1)跟踪组合的构建 基金管理人将根据中证指数有限公司提供的成份股和备选成份股及权重数据进行相应的买入或卖出操作,使跟踪组合的构成与标的指数基本一致。由于跟踪组合构建与标的指数组合构建存在差异,若出现较为特殊的情况(例如成份股或备选成份股流动性不足等),本基金将采用替代性的方法构建组合,使得跟踪组合尽可能近似于全复制组合,以减少对标的指数的跟踪误差。 2)跟踪组合的调整 本基金为开放式基金,由于基金开放日基金的申购、赎回、转换业务、标的指数成份股及备选成份股定期或不定期的调整、成份股权重调整、成份股投资受限等因素的影响,使得跟踪组合需要适时进行个股或权重的调整。 (2)股票增强策略 本基金在控制跟踪偏离度和跟踪误差的基础上,辅以有限度的增强操作,以求获取超越标的指数的收益率表现。 1)基于成份股基本面分析的增强 鉴于中国股票市场的非完全有效性和指数编制本身的局限性及时效性,本基金将通过对标的指数成份股及其备选成份股的基本面分析,剔除或低配部分标的指数成份股,以达到增强组合收益的效果。 2)基于非成份股投资机会的增强 本基金将基于基金管理人对证券市场个股深入研究的基础上,精选出具有综合性比较优势的个股,在基金投资比例允许的范围内适度参与非标的指数成份股投资。 3、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。 4、债券投资策略 本基金将以降低基金的跟踪误差为目的,在控制流动性风险的基础上,构建债券投资组合。本基金债券投资组合将采用自上而下的投资策略,根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来利率变化,并利用债券定价技术,进行个券选择。基金管理人将优先选择信用等级较高、剩余期限较短、流动性较好的政府债券进行投资,合理分配基金资产在债券上的配置比例。 5、现金头寸管理 由于法律法规限制和开放式基金正常运作的需要,在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,基金保留的现金以及到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。其主要用途包括:支付潜在赎回金额、计提管理费和托管费等各类费用的需求、支付交易费用等行为。为有效控制现金留存的影响,基金管理人将采用积极的现金头寸管理手段。 6、跟踪误差控制与管理 本基金对标的指数的跟踪目标是:力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%,年跟踪误差不超过7.75%。每日对基金组合与业绩比较基准的收益率偏离度进行跟踪,每月末、季度末定期分析基金跟踪误差变化情况及其原因,并根据跟踪误差的来源和其可控制性,有针对性的进行管理和控制。 7、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。 基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征,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,如大额申购赎回等;利用金融衍生品的杠杆作用,以达到降低投资组合的整体风险的目的。 基金管理人在进行股指期货投资前将建立股指期货投资决策部门或小组,负责股指期货的投资管理的相关事项,同时针对股指期货投资管理制定投资决策流程和风险控制等制度,并经基金管理人董事会批准后执行。 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。
业绩比较基准	中证大农业指数收益率×95%+商业银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金属于股票指数增强型基金,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,为证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。
基金管理人	前海开源基金管理有限公司
基金托管人	北京银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年4月1日 - 2015年6月30日)
1.本期已实现收益	90,084.89
2.本期利润	-80,452.25
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0002
4.期末基金资产净值	307,947,100.88
5.期末基金份额净值	1.000

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	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
过去三个月	-0.10%	0.04%	14.26%	2.83%	-14.36%	-2.79%

注:本基金的业绩比较基准为:中证大农业指数收益率×95%+商业银行活期存款利率(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

注:①本基金的基金合同于2015年2月13日生效,截至2015年6月30日止,本基金成立未满1年。

②本基金的建仓期为6个月,截至2015年6月30日,本基金建仓期尚未结束。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
孙亚超	执行投资总监	2015年2月13日	-	7年	本基金合同生效起至披露截止日不满一年;孙亚超先生,数学科博士后。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、产品开发二部负责人。

注:①对基金的首任基金经理,其"任职日期"为基金合同生效日,"离任日期"为根据公司决定确定的解聘日期,对此后的非首任基金经理,"任职日期"和"离任日期"分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《前海开源中证大农业指数增强型证券投资基金基金合同》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 公平交易专项说明

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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年2季度市场基本延续了1季度的上行趋势,各主要指数均出现明显上涨。不过,随着市场重心的加速上移,宽幅震荡态势亦尤为明显;特别是6月中下旬以来,在各种因素的共同作用下,市场出现了大幅单边下挫,创业板、中小板跌幅领先。

本基金为指数增强型基金,属于指数拟合与增强策略相结合的半主动半被动型产品;考虑到产品合同中约定投资于标的指数即中证大农业指数成分股的资产占非现金资产的比重不低于80%,其类型更偏向于指数型基金。此外,就新一期成分股的构成来看,标的指数50只成分股中含中小板、创业板个股31只,权重占比超过60%;因此在操作策略上更多参照了公司投决会的建议,遵循谨慎理念。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2015年6月30日,本基金份额单位净值1.000元,累计单位净值1.000元。本报告期份额净值增长率-0.10%,同期业绩比较基准增长率14.26%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

随着国内经济改革的深入,发展模式渐入新常态;即由原来的高增长模式向中等增长模式转变。为应对这一复杂的经济环境,并考虑到通胀率低位徘徊的现实情况;我们认为,适度宽松的货币政策与财政政策有望持续一段时间,证券市场的投资吸引力亦不会在短期内结束。

农业主题近年来一直是中央1号文的重点,今年尤为不同;更加之畜禽养殖周期的回升、改革与转型的推进、互联网+等成长概念的渗入,我们坚定看好农业产业价值的重估机会,及中长期投资价值的良好的态势。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§5 投资组合报告

5.1 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	5,193,469.80	1.67
	其中:股票	5,193,469.80	1.67
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	305,809,814.56	98.29
7	其他资产	142,270.30	0.05
8	合计	311,145,554.66	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

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	891,918.00	0.29
B	采矿业	-	-
C	制造业	3,901,473.80	1.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	104,805.00	0.03
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	96,640.00	0.03
L	租赁和商务服务业	151,773.00	0.05
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	5,146,609.80	1.67

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

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	采掘业	-	-
C	制造业	46,860.00	0.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	-	-
J	金融业	-	-
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	-	-
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	46,860.00	0.02

5.3 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

5.3.1 报告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

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	600201	金宇集团	5,600	398,272.00	0.13
2	002385	大北农	21,600	292,032.00	0.09
3	000525	红 太 阳	12,600	281,862.00	0.09
4	600486	扬农化工	7,800	280,644.00	0.09
5	000876	新 希 望	13,500	262,035.00	0.09
6	600873	梅花生物	21,900	228,636.00	0.07
7	000998	隆平高科	8,300	224,930.00	0.07
8	002018	华信国际	5,000	220,400.00	0.07
9	600073	上海梅林	14,400	186,336.00	0.06
10	000592	平潭发展	6,100	181,536.00	0.06

5.3.2 报告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

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	600389	江山股份	1,500	46,860.00	0.02

注:本基金本报告期末仅持有以上积极投资股票。

5.4 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。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 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。

5.7 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。

5.8 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。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金目前尚未有投资股指期货行为。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金目前尚未有投资国债期货行为。

5.10.2 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。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金目前尚未有投资国债期货行为。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,427.90
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	44,475.70
5	应收申购款	96,366.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	142,270.30

5.11.4 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处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002018	华信国际	220,400.00	0.07	资产重组
2	000592	平潭发展	181,536.00	0.06	重大事项

5.11.5.2 报告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的情况。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	565,118,121.52
报告期期间基金总申购份额	114,416,116.04
减:报告期期间基金总赎回份额	371,470,285.17
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	308,063,952.39

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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

1.本报告期内,经中国证券监督管理委员会(证监许可[2015]755号文)批准,基金管理人注册资本由人民币1.5亿元(RMB150,000,000.00元)增加至人民币2亿元(RMB200,000,000.00元)。新增注册资本5000万元人民币全部由深圳市和合投信资产管理合伙企业(有限合伙)出资。

2.本报告期内,基金管理人注册地址由"深圳市南山区粤兴二道6号武汉大学深圳产学研大楼B815房(入驻:深圳市前海商务秘书有限公司)"变更为"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)"。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

(1)中国证券监督管理委员会批准前海开源中证大农业指数增强型证券投资基金设立的文件

(2)《前海开源中证大农业指数增强型证券投资基金基金合同》

(3)《前海开源中证大农业指数增强型证券投资基金托管协议》

(4)基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

(5)前海开源中证大农业指数增强型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

9.3 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

2015年7月20日