

前海开源沪深 300 指数型证券投资基金

2015 第二季度 报告 2015年6月30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 本报告期自 2015 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。 178 80% 3.以对基金的自让基金空埋,其 仁明日期 "为基金合同主效日","路社日期"为根据公司决定倾定的解码日期,对此首任基金空原。任职日期 "用"展任日期"分别根据公司决定顺定的报日期期解码日期。证券处域上、设备格管型办法的相关规定。 证券处域的含义遵从行业协会《证券业处业人员货格管理办法》的相关规定。 管理从对战市的水基金应于建筑等的设施的信息,并是成立。 报告期外,本基金管理人严格遵守、(中华人民共和国间信券投资基金法)及其各项实施细则、(南海开源沪深 300 指数报告期外,本基金管理人严格遵守、(中严格应制 接收 306 条件 306 次年 306 《哈伊八人还在44.20年以 韩荣文景行为协夺顺识明 北京市场中的大学师说明 北京市场中域之界。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 较少的单位交易被没有超过被压券当日成交旅的多场价情况。 留EX.下口-3。 中国证券监督管理委員会批准前海开源沪深 300 指数型证券投资基金设 ((前海开源沪深 300 指数型证券投资基金基金台司) ((前海开源沪深 300 指数型证券投资基金指节协议) 基金管理人业券资格时件、富祉规则公司章程 前海开潮沪深 300 指数型证券投资基金往前定报刊上各项公告的原稿

27.24% 15368

前海开源股息率 100 强等权重股票型证券投资基金

2015 第二季度 报告 整的可能。我们认为未来一段时间市场将迎来个极行情的分化,有确定性安全边际的价值股将受到市场青睐。以高股息代表的虚聚股损地优良、估值底、分红高、且很多公司股价的处于长期底部。在语论改革优化激励机制、利率下降带动国产重新企理。每分金融充、重型估值格局的大导管下,我们指信本来。2年仍全有经好的表现。46 报告期内基金特有人发或基金货产净值预管设罚。本基金本按告期内,未出现是逐步一个工作日建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 基金托管人:中国农业银行股份有限报告送出日期:2015年7月20日 第1 重要提示 基金管理人的董事会及董事保证本报告所载資料不存在虚假記载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确 宗整性亲祖小別及在带责任。 基金任语人中国及企能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 股资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假试载,误守性陈述或者重大遗漏。 基金管理人所谓以诚实信用,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。 基金的过在业场并不代表其未来表现。投资有风险。投资者在旧址按设朱真加定种侧域床基金的招募说明书。 本报告中财务资料未经审计。 本报告期自 2015 年 4 月 1 日紀至 6 月 30 日止。 3.1 主要财务指标 单位:人民币: 38,19% 4.31 公平交易制度的执行情况。 本报告期,本基金管理人帮扶行(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多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。 4.32 异常交易行动的专项的进制。 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液止券当日成交量的 5%的情况。 4.4 报告期内基金的投资额路和运营分别, 4.1 报告期内基金的投资额路和运作分析。 2015年2季度市场逐渐的起加剧。各主要指数在创出新高后均出现大幅调整。从结构来看,前期领涨的创业板调整幅度 较大,成长银的跌幅远大于大盘监海银。虽然很多创业板公司符合中国经济转型和创新的方向,但在经历过去一段时间的快 速上张之后。坐处司股价已经被支了外规则和加州。公司联、未来可能仍然存在调整空间。 9.1 备企文件目录 (1)中国证券監督管理委员会批准前海开源股息率 100 强等权重股票型证券投资基金设立的文件 (2) (前海开源股息率 100 强等权重投票型证券投资基金基金合同) (3) (前海开源股息率 100 强等权重投票型证券投资基金注管协议) (4)基金管理人业务资格批件、富业企额和公司章程 (5)前海升源股息率 100 强等权重投票型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿 9.2 存於地息, 表于对市场存在局部泡沫的认识,本基金在2季度保持了较低的仓位运作、较好的规避了大盘调整的风险:同时本基金 认股息率为主要选股指标,集中投资于高分红、高股息率的大盘蓝筹,没有受到创业板剧烈波动的影响,较好的控制了 验得以股息率为主要企能指称。某中投资于高分红、高级息率的大富监等。及有交到则业数周宏级观的影响。较好的控制了价值的波对加固缩超度。 在未来的基金运作,我们仍将坚持以定量分析为主、辅以定性分析的方法,在高股息率个股中进行适当精选。在为投资者创造做支和腹避风险之间做好平衡,使得基金净值整体表现稳健。 4.2 报告期内基金的业绩表现 截至报告期末、本基金产品的单位净值为 1.261.报告期内单位净值增长率为 8.89%。同期业绩比较基准收益率为 9.98%。 4.5 宫理人对宏观经济、证券市场及行业走势的荷要展望 法金管理人、基金托管人处 3 查阅方式 9.3 宣风刀式 (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)

\$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 完整性承担小别及准带责任。 本报告中财务贷料木没甲口。 本报告期自 2015 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

场内简称	-
交易代码	000536
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 3 月 25 日
报告期末基金份额总额	15,278,055.83 😚
投资目标	本基金主要利用可转像品种兼具债券和股票的特性,在合理控制风险、保持适当流动性的基础上,力争取得超越基金业绩比较基准的收益。
投資策略	本基金的投資廠等。提有以下三分面內容。 1. 资产配置商品。在大步型产配用,本基金综合进用定性和定量的分析于段。在 安分的文章是完全进行重要的基础。其相它观念的周围的长途经和来来发展起步,本基 全新物理之间,有一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个
业绩比较基准	中证可转换债券指数收益率×70%+中证综合债指数收益率×20%+沪深 300 指数收益率×10%。
风险收益特征	本基金为债券型基金,其预期的风险和收益离于货币市场基金,低于混合型基金、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	中国农业银行股份有限公司
3.1 主要财务指标	§ 3 主要财务指标和基金净值表现 单位:人民币
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	1,866,761.3
2.本期利润	-1,792,288.5
3.加权平均基金份额本期利润	-0.109
4.期末基金资产净值	20,937,564.6
5.期末基金份額净值	1.37

阶段 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 20.00% 11,775 71.64% 02.501 36.92%

前海开源可转债债券型发起式证券投资基金

前海开源基金管理有限公司 2015年7月20日

2015	第		季	度	报	쑏
------	---	--	---	---	---	---

2015年6月30日

注: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基金合同约定。截至2015年6月30日,本基金建仓期结束未满1年。 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

後歐百年八、孫延旦日八公 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)投资者可在营业时间免费查阅,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 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

ま))投资者可访问本基金管理人公司网站,网址:www.qhkyfund.com

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

职务

姓名

记出说了"一定程度的更深深间,相对」个基金教习的观读,F然现在中的观画也追放一定的影响。 4.42 报告制内基金的业绩表现 截至报告期末,本基金产品的单位净值为 1.37,报告期内单位净值增长率为 -8.97%,同期业绩比较基准收益率为 -6.

每于台里开州 承天八尺的。1980年5月,1980年5月,1980年5月,1980年5日, 1980年5日, 1

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			-			_	
0	居民服务、修理和其他		_			-		
p	9½ třr		_			_		
Q	卫生和社会工作						-	
R	文化,体育和娱乐业					-	_	
S	综合					-	_	
-		合计			2,867,770.	00	13.70	
53 ‡	号告期末按公允价	值占基金资产净值比	:例大/	排序的前十名附				
序号	股票代码	股票名称	20 10 0 1	数量(投)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	
1	002241	歌尔声学				718.000.00	3.43	
2	600837	海通证券		.,		654,000.00	3.12	
3	000651	格力电器	1	9,500		607,050.00	2.90	
4	600060	海信电器	+	24,000		590,160.00	2.82	
5	000800	一汽轿车	+	12,000		298,560.00	1.43	
	本基金本报告期末 设告期末按债券品		le					
序号		资券品种		公允价值	直(元)		占基金资产净值比例(%)	
1	国家债券				-		-	
2	央行票据			-			-	
3	金融债券			-			_	
	其中:政策性金融债			-			_	
4	企业债券			4,454,963.70			21.28	
5	企业短期融资券			-			-	
6	中期票据				-		_	
7	可转债				12,916,713.20		61.69	
8	其他			-			-	
9	合计				17,371,676.90		82.97	
5.5 🛉	设告期末按公允价	值占基金资产净值比	(例大/	排序的前五名的	贵券投资明细			
序号	债券代码	债券名称		数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	
1	113008	电气转债		41,150	7,	449,796.00	35.58	
2	132001	14宝钢 EB		24,090	4,	454,963.70	21.28	
3	113501	洛钼转债		26,610	3,	710,498.40	17.72	
4	113007	吉视转债		7,500		929,175.00		
5	128009	128009 歌尔转债 5,210			827,243.80			
本基 5.7 才 5.8 才 本基 5.9 才 5.9.1 本基 5.9.2 本基	金本报告期末未持 侵告期末按公允价 金本报告期末未持 侵告期末按公允价 金本报告期末未持 侵告期末而基金投 本期国债期货投 金本报告期内未找	值占基金资产净值比有贵金属。 值占基金资产净值比有贵金。 作权证。 资的国债期货交易情 致策 资国债期货。 设资的国债期货持仓 资的国债期货持仓	(例大小 (例大小 (祝说明	排序的前五名数	音金属投资明细	97200		

4.5 管理人对宏观经济、证券中场及了业定势时间要限望 我国正处于经济转型期、经济增长正在由最增重区间中等增速区间过渡。政府在加快改革释放经济活力的同时、通过 货币政策、财政政策对经济"托底",经济硬着陆风险基本消失。目前通胀压力较低,政策宽松仍会延续,下半年经济增长有 可能逐步危险。 经过近期的下跌,股票市场风险已经得到相当大程度的释放,同时偏暖的政策环境也在一定程度上封杀了股市继续,剔

5.10.1 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

序号	名称 金額(元)							
1	存出保证金		28,87					
2	应收证券清算款							
3	应收股利							
4	应收利息			28				
5	应收申购款				92			
6	其他应收款							
7	待摊费用							
8	其他							
9	合计		150,0					
5.10.4	报告期末持有的处于转股期	期的可转换债券						
序号	债券代码	债券名	称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)			
1	113501	洛钼转	债	3,710,498.40				
2	113007	吉视转	债	929,175.00				
3	128009	歌尔转	债	827,243.80				

报告期期初管理人持有的本基金包	分額				9,999,525.00	
报告期期间买人/申购总份额			0.0			
报告期期间卖出/赎回总份额					0.00	
报告期期末管理人持有的本基金位	分額				9,999,525.00	
报告期期末持有的本基金份额占法	E金总份额比例(%)		65.45			
7.2 基金管理人运用固存 本报告期内基金管理人	未运用固有资金申			青况		
项目	持有份额总数	持有份額占基金总份	发起份额总数	发起份额占基金总份额	发起份额承诺持有期限	

本报告期内基金管理人					
	§ 8 报告	前末发起式基金发	起资金持有份额	青况	
项目	持有份額总数	持有份額占基金总份 額比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额 比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	9,999,525.00	65.45	9,999,525.00	65.45	三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	9,999,525.00	65.45	9,999,525.00	65.45	三年
注:①上述份额总数为扣					
②本基金发起式资金提	共方仅为基金管理	!人,基金管理人高级	及管理人员、基金组	亞里、基金管理人股系	京、其他从业人员持有

的基金份额不属了完起份额。

1.本报告期内,各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,基金管理人注册他址由"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(人驻:深圳市前海南条秘书南限公司)"变更为"深圳市前海深港合作区前湾"路 1号 A 栋 201 室(人驻深圳市前海商券秘书有限公司)"。

10.1 各套文件目录

10.1 备查文件目录 (1)中国证券监督管理委员会批准前海开源可转债债券型发起式证券投资基金设立的文件 (2)(前海开源可转债债券型发起式证券投资基金基金台同) (3)(前海开源可转债债券型发起式证券投资基金托管协议) (4)基金管理人业务资格批件、营业共原和公司章程 (5)前海开源可转债债券型发起式证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿 10.2 存放地点

(3)投资者可访问本基金管理人公司网站,网址:www.qhkyfund.com