前海开源睿远稳健增利混合型证券投资基金

2015 半年度报告摘要

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:广发证券股份有限公司
送出日期:2015年8月25日

§1 重要提示

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。

基金托管人广发证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年8月24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2015年1月14日(基金合同生效日)起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	前海开源睿远稳健增利混合	
基金主代码	000932	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年1月14日	
基金管理人	前海开源基金管理有限公司	
基金托管人	广发证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	3,028,967,067.06份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	前海开源睿远稳健增利混合A	前海开源睿远稳健增利混合C
下属分级基金的交易代码:	000932	000933
报告期末下属分级基金的份额总额	12,413,683.95份	3,016,553,383.11份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点投资于债券和现金类资产，力争在严格控制风险和保持基金资产流动性的前提下，实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金的投资策略主要有以下六方面内容： 1、大类资产配置 在大类资产配置中，本基金将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，制定本基金在债券、股票、现金等大类资产之间的配置比例。 2、债券投资策略 在债券投资策略方面，本基金将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。 3、股票投资策略 本基金精选有良好增值潜力的股票构建股票投资组合。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。 4、可转债策略 基于行业分析、企业基本面分析和可转换债券估值模型分析，并结合市场环境情况等，本基金在一、二级市场投资可转换债券，以达到在严格控制风险的基础上，实现基金资产稳健增值的目的。可转债的策略具体包括：1)个券选择策略，2)转换策略，3)条款博弈策略，4)套利策略。 5、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。 6、股指期货投资策略 本基金以套期保值为目的，参与股指期货交易。 本基金参与股指期货投资时机和数量的决策建立在对证券市场总体行情的判断和组合风险收益分析的基础上。基金管理人将根据宏观经济因素、政策及法规因素和资本市场因素，结合定性和定量方法，确定投资时机。基金管理人将结合股票投资的总体规模，以及中国证监会的相关限制和要求，确定参与股指期货交易的投资比例。 若相关法律法规发生变化时，基金管理人期货投资管理从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。
业绩比较基准	中证全债指数收益率×85%+沪深300指数收益率×15%。
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市场基金、债券型基金，低于股票型基金。

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	广发证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	傅成斌	王玮
	联系电话	0755-88601888	020-87555888-6052
	电子邮箱	qhky@qhkyfund.com	wwei@gf.com.cn
客户服务电话		4001666998	95575
传真		0755-83181169	020-87555129

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、基金托管人的办公地址

§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

基金级别	前海开源睿远稳健增利混合A	前海开源睿远稳健增利混合C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2015年1月14日-2015年6月30日)	报告期(2015年1月14日-2015年6月30日)
本期已实现收益	2,938,707.10	25,714,714.83
本期利润	2,815,176.38	26,950,415.22
加权平均基金份额本期利润	0.0963	0.0311
本期基金份额净值增长率	9.50%	8.60%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)	
期末可供分配基金份额利润	0.0949	0.0859
期末基金资产净值	13,591,583.50	3,275,558,368.33
期末基金份额净值	1.095	1.086

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与未分配利润中已实现部分的孰低数。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。

④ 本基金合同于2015年1月14日生效，截止2015年6月30日，本基金成立未满1年。

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

前海开源睿远稳健增利混合A

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	0.46%	0.08%	-0.66%	0.52%	1.12%	-0.44%
过去三个月	5.49%	0.63%	3.68%	0.40%	1.81%	0.23%
自基金合同生效起至今	9.50%	0.59%	6.53%	0.36%	2.97%	0.23%

前海开源睿远稳健增利混合C

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	0.28%	0.07%	-0.66%	0.52%	0.94%	-0.45%
过去三个月	4.93%	0.62%	3.68%	0.40%	1.25%	0.22%
自基金合同生效起至今	8.60%	0.59%	6.53%	0.36%	2.07%	0.23%

注:本基金的业绩比较基准为:中证全债指数收益率×85%+沪深300指数收益率×15%。

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

注:①本基金的基金合同于2015年1月14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，注册资本为1.5亿元人民币，近期经股东会通过，注册资本增至2亿元，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，在深圳设立华南营销中心；直销中心也覆盖珠三角、长三角和京津冀环渤海经济区，为公司的快速发展奠定了的组织和区域基础。经中国证监会批准，前海开源基金控股子公司——前海开源资产管理(深圳)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》，前海开源资管于2014年7月16日完成增资扩股的工商变更事宜，新的股权结构为：前海开源基金出资2400万，占比60%，恒大地产集团有限公司出资1600万，占比40%。

截至报告期末，前海开源基金旗下管理21只开放式基金，资产管理规模超过450亿元。

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		
刘静	联席投资总监	2015年1月14日	-	14年	本基金合同生效起至披露截止日不满一年；刘静女士，经济学硕士。历任长盛基金管理有限公司债券高级交易员、基金经理助理、长盛货币市场基金基金经理、长盛全债指数增强型债券投资基金基金经理、长盛积极配置债券投资基金基金经理，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。

①对基金的首任基金经理，其"任职日期"为基金合同生效日，"离职日期"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》、《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、《前海开源睿远稳健增利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 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

一季度，基本面有所走弱，GDP和工业增加值增速均创下09年二季度以来的新低；物价数据低于13年和14年同期水平，通缩压力不减；货币政策方面，央行先后进行了降准和降息操作，并且三次下调逆回购利率，以应对经济基本面走弱。二季度，从高频数据上看，基本面弱势不改，尽管地产销售持续改善，但从地产销售领先地产投资半年来看，经济至少要3季度末才可能企稳。CPI继续低位运行，通胀压力不大。货币政策方面，央行先后进行了降准和降息操作，并在月末重启逆回购，以应对经济基本面走弱和季末因素导致的资金面的波动。

纯债方面，1-2月，由于基本面较弱，资金面较为宽松，且货币政策宽松预期较强，收益曲线平坦化下行。3月，尽管央行连续三次下调逆回购利率，但受地方政府债务置换导致供需关系恶化，地产销售好转及稳增长政策频出导致经济企稳预期加强，以及股市吸虹效应的影响，收益率陡峭化上行，10年一度达到4.3%的高位。二季度，在降准降息等利好因素的作用下，资金利率降至10年以来的低位，债券市场收益率整体下行，短端债券和中高等级信用债收益率下行幅度较大，而中长期利率债则受地方债供给放量和经济企稳预期的影响收益率下行受到制约。整体来看，期限利差大幅拉大，信用利差大幅收窄。

权益方面，1月份受政策放松不及预期，以及两融业务监管等因素的影响，大盘有所调整，转债亦跟随正股回调。2、3月份，在全面降准降息、逆回购利率多次下调等多重利好的带动下，股市走强，中小盘表现好于大盘；转债跟随正股回暖，但由于估值压缩，转债表现不及正股。4月份在地产新政、公开市场利率连续下调、存款准备金率大幅下调等利好因素的影响下，增量资金加速入市，股市继续走强；5月份尽管央行进行了年内第二次降息，但市场在累计了较大涨幅后对利空因素较为敏感，股市上涨的同时波动加大。6月前两周股市延续了之前的上涨趋势，但之后在场外配资清理的影响下出现了快速的下跌，并在市场大跌后出现流动性危机。转债在股市上涨时跟随正股上涨，在股市大跌时转债因面临正股下跌和估值下降的双重压力跌幅一度超过正股，但之后因有债底保护表现出一定的抗跌性。

新股方面，一季度受益于中签率较高打新收益可观。二季度，之前较高的打新收益吸引了大量资金，导致中签率大幅下降，但在次新股强势上涨的带动下新股一字板个数增加，较高的涨幅在一定程度上抵消了中签率下降带来的不利影响。再加上5月后新股发行提速，新股申购仍能获得较高的收益，4月份、5月份和6月份第一批新股的平均年化收益率均超过10%，新股在类固收品种中性价比仍高。

操作上，基金总体较好地把握了大类资产的轮动。纯债方面，1、2月份进行了较大幅度的加仓，将仓位维持在较高水平，较好的获得了收益曲线快速下行带来的资本利得收益。3月债券市场调整时进行了一定的减仓。二季度，本基金前期持有的中高等级信用债获取了较好的收益。权益方面，1、2月份因市场波动较大本基金在股票和转债上的仓位不高，3月份市场回暖后进行了较大幅度的加仓，6月份市场大跌前进行了一定程度的减仓，并在市场大跌后择机减仓。权益部分为组合带来了较大的正贡献。新股方面，本基金在对新股基本面和市场节奏进行充分研究的基础上一定程度参与了新股申购，获取了较为稳定的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金A类份额净值增长率为9.5%，同期业绩比较基准收益率为6.53%。C类份额净值增长率为8.6%，同期业绩比较基准收益率为6.53%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

二季度经济和金融数据有所企稳。GDP与一季度持平，第三产业贡献较大。但第三产业对GDP的贡献中有相当一部分来自于金融业，这与二季度股市大涨有关，而经历了6月下旬以来的暴跌后，股市对金融业增加值的贡献将难以持续。尽管信贷数据超预期，但表外融资走弱，信贷的增长可能是由于表外转表内所致，如果将表外融资、企业债券融资等看作企业中长期贷款的补充来看，企业融资需求仍较弱。因此，经济企稳是否具有可持续性仍有待观察。由于上半年货币金融数据整体较弱，下半年CPI有望继续低位运行，通胀压力不大。在经济企稳的可持续性尚不确定，货币政策仍将以宽松为主。

展望未来，纯债方面，由于经济企稳的可持续性尚不确定，货币政策仍将以宽松为主，债市整体风险不大。对于利率债，经济企稳预期和地方债供给仍是其绕不开的压力，预计利率债收益率将以震荡为主，难有趋势性机会。对于信用债，IPO暂停将释放万亿的打新资金，而这些资金因风险偏好较低或大概率流入中短久期债券的可能性较大。我们认为宜将久期控制在3年以内，选择中高评级个券进行配置。

权益方面，在经历了去杠杆引发的大跌后，监管层出重拳救市使得流动性危机没有进一步蔓延，市场有所企稳。我们认为市场调整已告一段落，未来将有宽幅震荡，个股间的分化将加大。转债二级市场亦将以震荡为主，一级市场则因稀缺性有较为确定的机会。

基于以上考虑，未来本基金将本着以获取稳健收益为主的原则根据市场的情况进行大类资产灵活配置，纯债以中短久期信用债为主，以获取较为稳定的票息，以及增量资金入市带来的资本利得。权益主要根据市场变化情况进行波段操作，力争为基金持有人获取较好的超额收益。

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。估值委员会由总经理、督察长、基金事务部、研究部、投资部、监察稽核部、交易部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央国债登记结算有限责任公司、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或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§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

本报告期内，本基金托管人在对前海开源睿远稳健增利混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，前海开源睿远稳健增利混合型证券投资基金的管理人——前海开源基金管理有限公司在前海开源睿远稳健增利混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本报告期内，前海开源睿远稳健增利混合型证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对前海开源基金管理有限公司编制和披露的前海开源睿远稳健增利混合型证券投资基金2015年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§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:前海开源睿远稳健增利混合型证券投资基金
报告截止日:2015年6月30日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2015年6月30日
资产:		
银行存款	6.4.7.1	1,071,922,518.57
结算备付金		12,503,986.73
存出保证金		322,494.13
交易性金融资产	6.4.7.2	133,310,608.69
其中:股票投资		22,511,968.49
基金投资		-
债券投资		110,798,640.20
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	700,000,000.00
应收证券清算款		1,409,363,385.21
应收利息	6.4.7.5	633,997.61
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		3,328,056,990.94
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年6月30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		-
应付赎回款		34,015,990.04
应付管理人报酬		2,727,826.15
应付托管费		454,637.70
应付销售服务费		1,356,407.70
应付交易费用	6.4.7.7	182,110.57
应交税费		1,158.00
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	168,908.95
负债合计		38,907,039.11
所有者权益:		
实收基金	6.4.7.9	3,028,967,067.06
未分配利润	6.4.7.10	260,182,884.77
所有者权益合计		3,289,149,951.83
负债和所有者权益总计		3,328,056,990.94

注:①报告截止日2015年6月30日，前海开源睿远稳健增利混合A基金份额净值1.095元，基金份额总额12,413,683.95份，前海开源睿远稳健增利混合C基金份额净值1.086元，基金份额总额3,016,553,383.11份。

②本基金的基金合同于2015年1月14日生效，无上年度末可比数据。

6.2 利润表

会计主体:前海开源睿远稳健增利混合型证券投资基金
本报告期:2015年1月14日至2015年6月30日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2015年1月14日至2015年6月30日
一、收入		39,408,580.17
1.利息收入		5,020,913.91
其中:存款利息收入	6.4.7.11	1,582,464.19
债券利息收入		987,188.21
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		2,451,261.51
其他利息收入		-
2.投资收益(损失以"-"填列)		33,103,458.36
其中:股票投资收益	6.4.7.12	30,644,792.27
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	2,242,869.19
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	215,796.90
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	6.4.7.17	1,112,169.67
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	6.4.7.18	172,038.23
减:二、费用		9,642,988.57
1.管理人报酬	6.4.9.2.1	5,293,969.51
2.托管费	6.4.9.2.2	882,328.31
3.销售服务费	6.4.9.2.3	2,563,889.54
4.交易费用	6.4.7.19	732,148.27
5.利息支出		2,747.18
其中:卖出回购金融资产支出		2,747.18
6.其他费用	6.4.7.20	167,905.76
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		29,765,591.60
减:所得税费用		-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		29,765,591.60

注:本基金的基金合同于2015年1月14日生效，实际报告期间为2015年1月14日(基金合同生效日)到2015年6月30日，无上年度可比期间数据。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:前海开源睿远稳健增利混合型证券投资基金
本报告期:2015年1月14日至2015年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月14日至2015年6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)	303,948,857.19	-	303,948,857.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	29,765,591.60	29,765,591.60
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)	2,725,018,209.87	230,417,293.17	2,955,435,503.04
其中:1.基金申购款	3,022,659,138.96	243,328,065.10	3,265,987,204.06
2.基金赎回款	-297,640,929.09	-12,910,771.93	-310,551,701.02
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)	3,028,967,067.06	260,182,884.77	3,289,149,951.83

注:本基金的基金合同于2015年1月14日生效，实际报告期间为2015年1月14日(基金合同生效日)到2015年6月30日，无上年度可比期间数据。

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 李志祥 任福利
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

前海开源睿远稳健增利混合型证券投资基金(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】1268号文《关于准予前海开源睿远稳健增利混合型证券投资基金注册的批复》，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》、《前海开源睿远稳健增利混合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2015年1月5日至2015年1月12日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集303,866,359.21元，经瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)瑞华验字[2015]第02030002号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《前海开源睿远稳健增利混合型证券投资基金基金合同》于2015年1月14日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为303,948,857.19份基金份额，其中认购资金利息折合82,497.98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，本基金托管人为广发证券股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《前海开源睿远稳健增利混合型证券投资基金基金合同》等有关规定，本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、次级债券、短期融资券、地方政府债、债券回购等)、银行存款、货币市场工具、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。基金的投资组合比例为股票、权证、股指期货等权益类资产占基金资产的0-30%；债券、现金等其他金融工具占基金资产的比例不低于70%，其中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现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的5%；权证投资占基金资产净值的0-3%。股指期货的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部2006年2月颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第3号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金的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2015年6月30日的财务状况以及2015年1月14日(基金合同生效日)至2015年6月30日的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间系自2015年1月14日(基金合同生效日)起至2015年6月30日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

基金目前以交易目的持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认:(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在"损益平准金"科目中核算，并于期末全额转入"未分配利润/(累计亏损)"。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。资产支持证券投资在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率与合同利率差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率与合同利率差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配最多为6次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的30%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

(4) 本基金两类基金份额在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分:(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下:

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2)对于在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

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

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息，自2015年3月27日起，本基金采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。于2015年3月27日，相关调整对前一估值日基金资产净值的影响不超过0.50%。

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[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下:

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(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，股权的股息、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。自2013年1月1日起，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，暂减按25%计入应纳税所得额。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。

(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。

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 2015年6月30日
活期存款	1,071,922,518.57
定期存款	-
其中:存款期限1-3个月	-
其他存款	-
合计:	1,071,922,518.57

6.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目		本期末 2015年6月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		21,858,667.12	22,511,968.49	653,301.37
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	11,255,471.90	11,718,640.20	463,168.30
	银行间市场	99,084,300.00	99,080,000.00	-4,300.00
	合计	110,339,771.90	110,798,640.20	458,868.30
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		132,198,439.02	133,310,608.69	1,112,169.67

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

单位:人民币元

项目	本期末 2015年6月30日	
	账面余额	其中:买断式逆回购
交易所市场	700,000,000.00	-
合计	700,000,000.00	-

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 2015年6月30日
应收活期存款利息	168,101.74
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	5,064.12
应收债券利息	258,553.63
应收买入返售证券利息	202,147.44
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	130.68
合计	633,997.61

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 2015年6月30日
交易所市场应付交易费用	181,710.57
银行间市场应付交易费用	400.00
合计	182,110.57

6.4.7.8 其他负债

单位:人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,863.19
预提费用	167,045.76
合计	168,908.95

6.4.7.9 实收基金

金额单位:人民币元

前海开源睿远稳健增利混合A

项目	本期 2015年1月14日(基金合同生效日)至2015年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	44,214,320.96	44,214,320.96
本期申购	7,807,579.19	7,807,579.19
本期赎回(以"-"号填列)	-39,608,216.20	-39,608,216.20
jiJinChaiFHFEZSQRQA基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以"-"号填列)	-	-
本期末	12,413,683.95	12,413,683.95

前海开源睿远稳健增利混合C

项目	本期 2015年1月14日(基金合同生效日)至2015年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	259,734,536.23	259,734,536.23
本期申购	3,014,851,559.77	3,014,851,559.77
本期赎回(以"-"号填列)	-258,032,712.89	-258,032,712.89
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以"-"号填列)	-	-
本期末	3,016,553,383.11	3,016,553,383.11

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

前海开源睿远稳健增利混合A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	2,938,707.10	-123,530.72	2,815,176.38
本期基金份额交易产生的变动数	-1,540,786.59	-96,490.24	-1,637,276.83
其中:基金申购款	563,092.07	-29,712.74	533,379.33
基金赎回款	-2,103,878.66	-66,777.50	-2,170,656.16
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,397,920.51	-220,020.96	1,177,899.55

前海开源睿远稳健增利混合C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	25,714,714.83	1,235,700.39	26,950,415.22
本期基金份额交易产生的变动数	286,385,087.87	-54,330,517.87	232,054,570.00
其中:基金申购款	295,371,896.23	-52,577,210.46	242,794,685.77
基金赎回款	-8,986,808.36	-1,753,307.41	-10,740,115.77
本期已分配利润	-	-	-
本期末	312,099,802.70	-53,094,817.48	259,004,985.22

6.4.7.11 存款利息收入

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月14日至2015年6月30日
活期存款利息收入	1,385,413.25
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	22,621.65
其他	174,429.29
合计	1,582,464.19

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

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月14日至2015年6月30日
卖出股票成交总额	251,173,287.85
减:卖出股票成本总额	220,528,495.58
买卖股票差价收入	30,644,792.27

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月14日(基金合同生效日)至2015年6月30日
债券投资收益——买卖债券(、债转股及债券到期兑付)差价收入	2,242,869.19
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	2,242,869.19

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月14日(基金合同生效日)至2015年6月30日
卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交总额	289,649,371.54
减:卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	283,383,714.57
减:应收利息总额	4,022,787.78
买卖债券差价收入	2,242,869.19

6.4.7.13.5 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。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 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 衍生工具收益

6.4.7.15.1 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。

6.4.7.15.2 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。

6.4.7.16 股利收益

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月14日至2015年6月30日
股票投资产生的股利收益	215,796.90
基金投资产生的股利收益	-
合计	215,796.90

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位:人民币元

项目名称	本期 2015年1月14日至2015年6月30日
1.交易性金融资产	1,112,169.67
——股票投资	653,301.37
——债券投资	458,868.30
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	1,112,169.67

6.4.7.18 其他收入

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月14日至2015年6月30日
基金赎回费收入	147,497.46
基金转换费收入	24,540.77
合计	172,038.23

6.4.7.19 交易费用

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月14日至2015年6月30日
交易所市场交易费用	731,748.27
银行间市场交易费用	400.00
合计	732,148.27

6.4.7.20 其他费用

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月14日至2015年6月30日
审计费用	23,864.40
信息披露费	143,181.36
其他	860.00
合计	167,905.76

注:"其他"为证券账户开户费、账户维护费。

6.4.8 关联方关系

6.4.8.1 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

本报告期内，经公司2014年第二次股东会审议通过，并经中国证券监督管理委员会(证监许可[2015]755号文)批准，本公司注册资本由人民币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。本次增加注册资本后，公司新的股权结构为:开源证券股份有限公司出资5000万元，占比25%；北京市中盛金期投资管理有限公司出资5000万元，占比25%；北京长和世纪资产管理有限公司出资5000万元，占比25%；深圳市和合投信资产管理合伙企业(有限合伙)出资5000万元，占比25%。本次增加注册资本的工商变更登记手续已在深圳市市场监督管理局办理完毕。

6.4.8.2 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("前海开源基金公司")	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
广发证券股份有限公司("广发证券")	基金托管人、基金代销机构
开源证券股份有限公司("开源证券")	基金管理人的股东、基金代销机构

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.9.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月14日(基金合同生效日)至2015年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券股份有限公司	468,437,306.35	100.00%

6.4.9.1.2 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月14日(基金合同生效日)至2015年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
广发证券股份有限公司	552,760,965.58	100.00%

6.4.9.1.3 债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月14日(基金合同生效日)至2015年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
广发证券股份有限公司	5,877,300,000.00	100.00%

6.4.9.1.4 权证交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.9.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月14日(基金合同生效日)至2015年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券股份有限公司	426,465.99	100.00%	181,710.57	100.00%

6.4.9.2 关联方报酬

6.4.9.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月14日(基金合同生效日)至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,293,969.51
其中:支付销售机构的客户维护费	339,054.29

注:本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.2%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×1.2%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

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

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。

6.4.9.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月14日(基金合同生效日)至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	882,328.31

注:本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.2%年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.2%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费 E为前一日的基金资产净值

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

6.4.9.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2015年1月14日(基金合同生效日)至2015年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	前海开源睿远稳健增利混合A	前海开源睿远稳健增利混合C	合计
前海开源基金管理有限公司	-	2,160,958.69	2,160,958.69
广发证券股份有限公司	-	393,768.60	393,768.60
合计	-	2,554,727.29	2,554,727.29

注:本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.6%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务。销售服务费按前一日C类基金份额净值的0.6%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.6%÷当年天数

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金资产中划出，由注册登记机构代收，注册登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内与关联方无银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.9.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.9.4.2 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

本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.9.5 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 2015年1月14日(基金合同生效日)至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
广发证券股份有限公司	1,071,922,518.57	1,582,464.19

注:本基金的银行存款由基金托管人广发证券股份有限公司保管，按适用利率或约定利率计息。

6.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.9.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

6.4.10 期末(2015年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.10.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

6.4.10.1.1 受限证券类别:股票

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300487	蓝晓科技	2015年6月24日	2015年7月2日	新股流通受限	14.83	14.83	10,700	158,681.00	158,681.00	-
300488	恒锋工具	2015年6月25日	2015年7月1日	新股流通受限	20.11	20.11	6,734	135,420.74	135,420.74	-
300489	中飞股份	2015年6月24日	2015年7月1日	新股流通受限	17.56	17.56	7,319	128,521.64	128,521.64	-
300480	光力科技	2015年6月25日	2015年7月2日	新股流通受限	7.28	7.28	7,263	52,874.64	52,874.64	-

6.4.10.2 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
300467	迅游科技	2015年6月25日	重大事项	297.30	2015年7月2日	267.57	3,726	125,752.50	1,107,739.80	-

6.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.10.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2015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。

6.4.10.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2015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。

6.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a)金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于2015年6月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为22,383,443.87元，属于第二层次的余额为110,927,164.82元，无属于第三层次的余额。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，本基金于2015年3月27日起改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值，并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2015年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§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	22,511,968.49	0.68
	其中:股票	22,511,968.49	0.68
2	固定收益投资	110,798,640.20	3.33
	其中:债券	110,798,640.20	3.33
	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	700,000,000.00	21.03
	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	1,084,426,505.30	32.58
7	其他各项资产	1,410,319,876.95	42.38
8	合计	3,328,056,990.94	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	2,547,775.00	0.08
B	采矿业	-	-
C	制造业	9,577,190.22	0.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	517,786.92	0.02
F	批发和零售业	5,546,904.27	0.17
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,536,620.68	0.05
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,785,691.40	0.08
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	22,511,968.49	0.68

7.3 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

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	占基金资产净值比例(%)
1	300005	探路者	222,401	6,093,787.40	0.19
2	600280	中央商场	399,921	5,546,904.27	0.17
3	002447	壹桥海参	203,822	2,547,775.00	0.08
4	600138	中青旅	100,000	2,112,000.00	0.06
5	300485	赛升药业	17,372	1,164,097.72	0.04
6	300467	迅游科技	3,726	1,107,739.80	0.03
7	002775	文科园林	19,306	517,786.92	0.02
8	300479	神思电子	9,600	434,688.00	0.01
9	002773	康弘药业	17,338	411,430.74	0.01
10	002768	国恩股份	14,405	362,429.80	0.01

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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600739	辽宁成大	22,959,372.24	0.70
2	002447	壹桥海参	18,906,023.60	0.57
3	600185	格力地产	16,151,731.90	0.49
4	002580	圣阳股份	15,375,050.47	0.47
5	600280	中央商场	13,902,942.28	0.42
6	300005	探路者	8,953,536.10	0.27
7	002391	长青股份	7,957,098.00	0.24
8	002505	大康牧业	7,745,210.20	0.24
9	002194	武汉凡谷	6,609,567.86	0.20
10	601318	中国平安	6,120,200.00	0.19
11	601166	兴业银行	6,104,282.03	0.19
12	601988	中国银行	6,053,168.54	0.18
13	600048	保利地产	6,039,799.00	0.18
14	600594	益佰制药	5,878,205.00	0.18
15	601398	工商银行	5,116,206.08	0.16
16	600138	中青旅	4,861,789.00	0.15
17	002228	合兴包装	4,613,038.00	0.14
18	002604	龙力生物	4,507,646.00	0.14
19	002024	苏宁云商	4,388,000.00	0.13
20	002236	大华股份	4,161,975.00	0.13

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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600739	辽宁成大	25,759,690.62	0.78
2	002447	壹桥海参	21,546,493.00	0.66
3	002580	圣阳股份	21,404,958.20	0.65
4	600185	格力地产	16,655,011.15	0.51
5	600280	中央商场	10,691,583.89	0.33
6	002391	长青股份	7,851,207.26	0.24
7	002194	武汉凡谷	7,311,815.44	0.22
8	600594	益佰制药	7,083,900.00	0.22
9	601166	兴业银行	6,317,500.00	0.19
10	002505	大康牧业	6,001,405.00	0.18
11	601988	中国银行	5,644,468.54	0.17
12	600048	保利地产	5,434,944.62	0.17
13	601318	中国平安	5,382,300.00	0.16
14	002604	龙力生物	5,047,850.00	0.15
15	601398	工商银行	4,751,588.48	0.14
16	002228	合兴包装	4,643,776.00	0.14
17	002024	苏宁云商	4,564,259.00	0.14
18	002236	大华股份	4,239,000.00	0.13
19	002521	齐峰新材	4,136,400.00	0.13
20	000768	中航飞机	4,051,011.00	0.12

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	242,387,162.70
卖出股票收入(成交)总额	251,173,287.85

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	99,080,000.00	3.01
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	10,263,927.00	0.31
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	1,454,713.20	0.04
8	其他	-	-
9	合计	110,798,640.20	3.37

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	159905	15贴现国债05	1,000,000	99,080,000.00	3.01
2	122354	15康美债	100,000	10,171,000.00	0.31
3	110031	航信转债	5,800	842,798.00	0.03
4	113008	电气转债	3,380	611,915.20	0.02
5	122645	12苏园建	1,000	82,690.00	0.00

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

本基金本报告期内未投资股指期货。

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

本基金本报告期内未投资国债期货。

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

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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。

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	322,494.13
2	应收证券清算款	1,409,363,385.21
3	应收股利	-
4	应收利息	633,997.61
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,410,319,876.95

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处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300467	迅游科技	1,107,739.80	0.03	重大事项

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

份额级别	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
前海开源睿远稳健增利混合A	259	47,929.28	1,269,357.70	10.23%	11,144,326.25	89.77%
前海开源睿远稳健增利混合C	732	4,120,974.57	2,980,272,903.18	98.80%	36,280,479.93	1.20%
合计	991	3,056,475.35	2,981,542,260.88	98.43%	47,424,806.18	1.57%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本报告期末基金管理人的从业人员未持有本开放式基金份额。

8.4 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的情况

本报告期末基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部负责人、本基金基金经理未持有本开放式基金份额。

§9 开放式基金份额变动

单位:份

项目	前海开源睿远稳健增利混合A	前海开源睿远稳健增利混合C
基金合同生效日(2015年1月14日)基金份额总额	44,214,320.96	259,734,536.23
本报告期期初基金份额总额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	7,807,579.19	3,014,851,559.77
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	39,608,216.20	258,032,712.89
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
本报告期期末基金份额总额	12,413,683.95	3,016,553,383.11

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

项目

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

本报告期内本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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

本基金本报告期内投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金提供审计服务的会计师事务所为瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)，本报告期内未发生变更。

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	
广发证券股份有限公司	2	468,437,306.35	100.00%	426,465.99	100.00%	-

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	
	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
广发证券股份有限公司	552,760,965.58	100.00%	5,877,300,000.00	100.00%	-	-

§11 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)"。

前海开源基金管理有限公司
2015年8月25日