前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金

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:上海银行股份有限公司
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。

基金托管人上海银行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1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	前海开源事件驱动混合
基金主代码	000423
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年12月19日
基金管理人	前海开源基金管理有限公司
基金托管人	上海银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	6,625,495,724.13份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金基于对宏观经济、资本市场的深入分析和理解,在积极把握市场发展趋势和市场参与者行为逻辑的基础上,精选具有估值优势和成长潜力的公司进行投资,力争获取超越业绩比较基准的收益,追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金的投资策略包括五个方面:(1)大类资产配置:本基金依据经济周期理论,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:本基金在积极把握宏观经济变迁、证券市场变化以及证券市场参与各方行为逻辑的基础上,将影响行业和公司投资价值的事件性因素作为投资的主线,以事件驱动为核心的投资策略;(3)债券投资策略:通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势以及不同类属固定收益类投资品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素,以目标久期管理和品种选择策略为主,以收益率利差策略、债券置换策略为辅,构造能获取稳定收益的固定收益类投资品种组合;(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x70%+中证全债指数收益率x30%。
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。

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	上海银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	傅成斌	叶忆红
	联系电话	0755-88601888	021-68475888
	电子邮箱	qhky@qhkyfund.com	yeyh@bankofshanghai.com
客户服务电话		4001666998	95594
传真		0755-83181169	021-68476936

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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2015年1月1日 - 2015年6月30日)
本期已实现收益	102,775,725.44
本期利润	158,880,526.03
加权平均基金份额本期利润	0.0625
本期基金份额净值增长率	4.62%
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	0.0638
期末基金资产净值	7,048,274,554.98
期末基金份额净值	1.064

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的期末余额的孰低数。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。

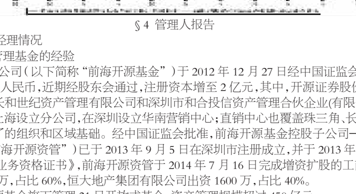
3.2 基金净值表现

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	0.95%	0.06%	-5.01%	2.45%	5.96%	-2.39%
过去三个月	3.10%	0.07%	8.37%	1.83%	-5.27%	-1.76%
过去六个月	4.62%	1.05%	19.83%	1.58%	-15.21%	-0.53%
过去一年	9.69%	1.09%	71.68%	1.29%	-61.99%	-0.20%
自基金合同生效起至今	6.40%	0.99%	65.96%	1.13%	-59.56%	-0.14%

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



§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		
王霞	执行投资总监	2014年12月25日	-	11年	王霞女士,北京交通大学经济学硕士,中国注册会计师(CPA)。历任南方基金管理有限公司商业、贸易、旅游行业研究员、房地产行业首席研究员。现任前海开源基金管理有限公司执行投资总监。
唐文杰	联席投资总监	2013年12月19日	2015年1月15日	10年	唐文杰先生,39岁,对外经济贸易大学经济学学士,英国雷丁大学理学硕士。曾任职长盛基金、博时基金研究员、行业投资经理,鹏华基金基金经理和建信信托投资总监。

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、《前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式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

2015年6月下旬大盘出现较大幅度的回调,由于本基金在报告期内采取了较为谨慎的操作,总体基金净值的波动较小,基金净值稳步提升。全年看,我们维持在一季报中的展望,预计未来指数在一定区间内震荡的可能性较大。为提高该基金2015年全年的绝对收益,我们将及时把握相关事件驱动的机会,力争逐步提高该基金的业绩。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末,本基金份额净值为1.064元。本报告期基金份额净值增长率为4.62%,同期业绩比较基准收益率为19.83%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

报告期内,股市先是经历了持续大涨,主板与创业板共同繁荣;6月下旬开始股市转而出现了持续的系统性下跌的局面。我们认为在实体经济全面复苏、通胀抬头、货币政策转为紧缩前,预计本轮牛市大的趋势仍没有结束,但市场持续的快速上涨最终仍是需要实际盈利增长作支撑的,而在企业盈利增长未出现改善或者改善的进度低于预期时,市场阶段性的潜在风险可能要大于继续上涨的收益。

从近期公布的经济数据来看,前5个月财政收入累计同比仅增长5%,表明国内经济依旧疲弱。5月份CPI同比增速从4月份的1.5%回落至1.2%,低于市场预期的1.3%;5月份PPI同比增速持平于4月份的-4.6%,仍低于市场预期的-4.5%,表明通缩压力仍然较大,预计未来加权平均贷款利率仍有进一步下降的需求。

作为早周期的房地产行业,经过黄金十年的快速发展,在降低首付、放宽二套房认定标准等各项利好政策的推动下,主要城市的销售已经呈现复苏的态势,但增长较为缓慢。值得一提的是,这次房地产行业的复苏与2009年不同,地产的销售好转却难以传导到开发商买地、房地产投资上,前5个月土地出让金收入同比大幅下滑40.1%,因为开发商有庞大的库存需要消化,去库存的压力仍然很大。

创业板和中小板作为中国经济创新与转型的主要力量,估值已经进入了市梦率的时代,其中多数企业能否成为与之高估值相匹配的真正的优秀的公司仍是需要时间和理性去检验的,潜在风险确实很大。即使创业板有可能继续创新高,但主板的绩优蓝筹无疑风险相对较低。

从行业和主题来看,我们继续看好有较高估值安全边际的大金融行业。国家战略性重点发展的领域,如:军工、中国制造2025、环保、新能源等。国企改革这个主题目前看仍是值得重点配置方向之一。此外,受益于货币政策宽松、行业基本面处于复苏阶段的地产等周期性行业也具有中短期配置价值。

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,出现了连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形;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。

本基金为发起式基金,截止2015年6月30日,本基金成立未满三年。《公开募集证券投资基金运作管理办法》关于基金份额持有人数量及基金资产净值的限制性条款暂不适用于本基金。

§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,本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、《前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》和《前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议》的有关约定,诚实、尽责地履行了基金托管人义务,不存在损害本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

本报告期,本托管人根据国家有关法律法规、基金合同、托管协议的规定,对本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

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,认为复核内容真实、准确、完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§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:前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金

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	上年度末 2014年12月31日
资 产:			
银行存款		32,956,693.88	10,753,670.54
结算备付金		26,936,824.61	165,375.17
存出保证金		208,534.55	249,482.32
交易性金融资产		463,047,568.89	18,417,450.64
其中:股票投资		108,273,390.89	18,417,450.64
基金投资		-	-
债券投资		354,774,178.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		4,360,000,000.00	-
应收证券清算款		2,158,958,326.53	-
应收利息		11,485,765.88	2,006.80
应收股利		-	-
应收申购款		10,058.02	5,796.98
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		7,053,603,772.36	29,593,782.45
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	6,447,499.64
应付赎回款		113,979.20	470,912.18
应付管理人报酬		4,778,566.97	25,028.83
应付托管费		265,475.92	5,214.32
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		71,976.55	97,531.98
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		99,218.74	250,093.47
负债合计		5,329,217.38	7,296,280.42
所有者权益:			
实收基金		6,625,495,724.13	21,921,410.71
未分配利润		422,778,830.85	376,091.32
所有者权益合计		7,048,274,554.98	22,297,502.03
负债和所有者权益总计		7,053,603,772.36	29,593,782.45

注:报告截止日2015年6月30日,基金份额净值1.064元,基金份额总额6,625,495,724.13份。

6.2 利润表

会计主体:前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期:2015年1月1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1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
一、收入		172,640,649.54	4,318,232.42
1.利息收入		17,844,742.87	515,885.20
其中:存款利息收入		3,702,211.14	170,948.66
债券利息收入		2,992,371.53	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		11,150,160.20	344,936.54
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		98,222,668.98	3,448,367.55
其中:股票投资收益		98,026,253.98	3,276,224.38
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		196,415.00	172,143.17
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		56,104,800.59	20,297.52
4. 汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		468,437.10	333,682.15
减:二、费用		13,760,123.51	1,786,393.02
1.管理人报酬		12,139,767.13	439,595.84
2.托管费		1,086,251.19	91,582.48
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		534,067.98	1,078,874.71
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用		37.21	176,339.99
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		158,880,526.03	2,531,839.40
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		158,880,526.03	2,531,839.40

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期:2015年1月1日 至 2015年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1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)	21,921,410.71	376,091.32	22,297,502.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	158,880,526.03	158,880,526.03
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)	6,603,574,313.42	263,522,213.50	6,867,096,526.92
其中:1.基金申购款	6,722,984,223.77	266,280,859.00	6,989,265,082.77
2.基金赎回款	-119,409,910.35	-2,758,645.50	-122,168,555.85
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)	6,625,495,724.13	422,778,830.85	7,048,274,554.98
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014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)	128,523,462.75	81,196.24	128,604,658.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	2,531,839.40	2,531,839.40
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)	-78,928,175.19	-4,119,290.96	-83,047,466.15
其中:1.基金申购款	5,661,956.99	13,314.33	5,675,271.32
2.基金赎回款	-84,590,132.18	-4,132,605.29	-88,722,737.47
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)	49,595,287.56	-1,506,255.32	48,089,032.24

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

前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金(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【2013】1399号文《关于核准前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金募集的批复》核准,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》、《前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式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2013年11月15日至2013年12月16日,首次设立募集不包括认购资金利息共募集128,484,379.36元,经瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)瑞华验字[2013]第332A0009号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》于2013年12月19日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为128,523,462.75份基金份额,其中认购资金利息折合39,083.39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,本基金托管人为上海银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式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(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、中期票据、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。基金的投资组合比例为:本基金将基金资产的0%-95%投资于股票,将不低于5%的基金资产投资于债券等固定收益类品种,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,本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。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。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%。

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颁布的《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1日至2015年6月30日的经营成果和净值变动情况。

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

除6.4.5.2所述会计估计变更外,本基金本报告期所采用的会计政策、其他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

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 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内,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。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
前海开源基金管理有限公司("前海开源基金公司")	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
上海银行股份有限公司("上海银行")	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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.8.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.8.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行交易,无佣金产生。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	12,139,767.13	439,595.84
其中:支付销售机构的客户维护费	43,955.09	2,617.00

注:本基金的管理费按前一日资产净值的0.90%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.90%÷ 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3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《前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同(2015年4月修订)》及《前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议(2015年4月修订)》约定,自2015年4月1日起,本基金的管理费率由1.20%/年调整为0.90%/年。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,086,251.19	91,582.48

注:本基金的托管费按前一日资产净值的0.05%年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.05%÷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3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。

根据《前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同(2015年4月修订)》及《前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议(2015年4月修订)》约定,自2015年4月1日起,本基金的托管费率由0.25%/年调整为0.05%/年。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内与关联方无银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
基金合同生效日(2013年12月19日)持有的基金份额	10,001,250.00	10,001,250.00
期初持有的基金份额	10,001,250.00	10,001,250.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	10,001,250.00	10,001,250.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.15%	20.17%

注:基金管理人运用固有资金投资本基金相关费率按照基金合同及招募说明书规定执行。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
上海银行股份有限公司	32,956,693.88	3,403,207.27	42,763,659.81	163,114.33

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

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间内无其他关联交易事项。

6.4.9 期末(2015年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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	-
603838	四通股份	2015年6月23日	2015年7月1日	新股流通受限	7.73	7.73	18,119	140,059.87	140,059.87	-
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	-

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000630	铜陵有色	2015年3月9日	重大事项	10.31	-	-	615,200	4,283,440.00	6,342,712.00	-
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	-

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末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。

6.4.9.3.2 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。

6.4.10 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101,050,179.20元,属于第二层次的余额为361,997,389.69元,无属于第三层次的余额;于2014年12月31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18,417,450.64元,属于第二层次的余额为0.00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(2014年12月31日:同)。

(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	108,273,390.89	1.54
	其中:股票	108,273,390.89	1.54
2	固定收益投资	354,774,178.00	5.03
	其中:债券	354,774,178.00	5.03
	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	4,360,000,000.00	61.81
	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	59,893,518.49	0.85
7	其他各项资产	2,170,662,684.98	30.77
8	合计	7,053,603,772.36	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	-	-
B	采矿业	3,117,059.25	0.04
C	制造业	19,440,797.05	0.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	66,586,944.80	0.94
E	建筑业	517,786.92	0.01
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	225,347.22	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,234,260.04	0.02
J	金融业	3,324,900.00	0.05
K	房地产业	12,327,800.00	0.17
L	租赁和商务服务业	674,883.93	0.01
M	科学研究和技术服务业	823,611.68	0.01
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	108,273,390.89	1.54

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	601985	中国核电	5,094,640	66,586,944.80	0.94
2	000006	深振业A	540,000	7,327,800.00	0.10
3	000630	铜陵有色	615,200	6,342,712.00	0.09
4	600376	首开股份	200,000	3,858,000.00	0.05
5	600038	中直股份	40,000	2,478,000.00	0.04
6	601628	中国人寿	70,000	2,192,400.00	0.03
7	603116	红蜻蜓	65,334	1,831,965.36	0.03
8	000768	中航飞机	40,000	1,743,200.00	0.02
9	603979	金诚信	66,063	1,635,059.25	0.02
10	600547	山东黄金	60,000	1,482,000.00	0.02

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	601985	中国核电	24,201,815.60	108.54
2	600958	东方证券	21,978,418.04	98.57
3	600376	首开股份	10,114,233.57	45.36
4	600547	山东黄金	10,059,017.00	45.11
5	601628	中国人寿	9,566,045.59	42.90
6	600048	保利地产	7,953,534.21	35.67
7	601318	中国平安	6,152,189.00	27.59
8	000776	广发证券	5,945,476.61	26.66
9	600837	海通证券	4,864,452.00	21.82
10	002081	金螳螂	4,863,439.24	21.81
11	000630	铜陵有色	4,283,440.00	19.21
12	600010	包钢股份	4,245,130.00	19.04
13	000831	五矿稀土	4,225,443.00	18.95
14	000024	招商地产	3,814,880.30	17.11
15	000768	中航飞机	3,720,569.00	16.69
16	600016	民生银行	3,670,994.00	16.46
17	601633	长城汽车	3,639,985.00	16.32
18	000651	格力电器	3,639,869.00	16.32
19	601166	兴业银行	3,639,371.23	16.32
20	601992	金隅股份	3,639,230.00	16.32
21	600959	江苏有线	3,628,431.51	16.27
22	600038	中直股份	3,473,205.00	15.58
23	000006	深振业A	3,435,334.88	15.41
24	600340	华夏幸福	1,379,392.00	6.19
25	300463	迈克生物	1,359,163.56	6.10
26	603116	红蜻蜓	1,156,411.80	5.19
27	603979	金诚信	1,135,622.97	5.09
28	000069	华侨城A	1,093,805.60	4.91
29	000002	万科A	936,300.00	4.20
30	600690	青岛海尔	865,080.00	3.88
31	000625	长安汽车	841,983.82	3.78
32	603589	口子窖	722,688.00	3.24
33	002756	永兴特钢	720,311.42	3.23
34	300485	赛升药业	668,127.12	3.00
35	603355	莱克电气	611,781.12	2.74
36	603599	广信股份	540,039.42	2.42
37	002776	柏堡龙	472,693.84	2.12
38	601988	中国银行	465,000.00	2.09

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	600958	东方证券	47,891,443.73	214.78
2	600959	江苏有线	38,517,535.50	172.74
3	600547	山东黄金	10,577,320.79	47.44
4	600376	首开股份	8,221,708.05	36.87
5	601318	中国平安	7,344,802.64	32.94
6	601628	中国人寿	6,987,672.06	31.34
7	000776	广发证券	6,920,712.71	31.04
8	600048	保利地产	6,757,027.20	30.30
9	002081	金螳螂	5,458,042.87	24.48
10	600010	包钢股份	5,442,317.00	24.41
11	300424	航新科技	5,370,008.94	24.08
12	000024	招商地产	5,226,330.29	23.44
13	600837	海通证券	4,656,098.00	20.88
14	000768	中航飞机	4,492,219.64	20.15
15	300463	迈克生物	4,415,849.00	19.80
16	600016	民生银行	4,232,050.00	18.98
17	601166	兴业银行	4,131,230.69	18.53
18	000831	五矿稀土	3,972,747.22	17.82
19	000651	格力电器	3,778,629.00	16.95
20	601633	长城汽车	3,581,676.52	16.06
21	300458	全志科技	3,292,896.60	14.77
22	002756	永兴特钢	3,226,482.57	14.47
23	601992	金隅股份	3,101,810.00	13.91
24	603355	莱克电气	2,760,705.36	12.38
25	300449	汉邦高科	2,556,157.80	11.46
26	603885	吉祥航空	2,551,243.23	11.44
27	603599	广信股份	2,280,445.90	10.23
28	300438	鹏辉能源	2,061,792.00	9.25
29	600038	中直股份	1,929,937.00	8.66
30	002747	埃斯顿	1,675,075.90	7.51
31	600739	辽宁成大	1,578,266.00	7.08
32	300450	先导股份	1,534,509.00	6.88
33	601989	中国重工	1,507,680.00	6.76
34	300456	耐威科技	1,478,656.00	6.63
35	000623	吉林敖东	1,391,022.02	6.24
36	002757	南兴装备	1,363,382.00	6.11
37	300465	高伟达	1,254,400.00	5.63
38	603901	永创智能	1,229,936.60	5.52
39	300451	创业软件	1,224,792.54	5.49
40	600340	华夏幸福	1,223,243.08	5.49
41	600118	中国卫星	1,186,853.00	5.32
42	600585	海螺水泥	1,052,682.00	4.72
43	603108	润达医疗	1,009,980.00	4.53
44	000069	华侨城A	962,240.00	4.32
45	603023	威帝股份	882,283.32	3.96
46	600690	青岛海尔	868,500.00	3.90
47	000625	长安汽车	853,020.00	3.83
48	000002	万科A	852,474.95	3.82
49	603026	石大胜华	729,212.00	3.27
50	603598	引力传媒	673,679.00	3.02
51	000423	东阿阿胶	468,059.00	2.10
52	000538	云南白药	450,942.00	2.02
53	300461	田中精机	448,478.60	2.01
54	600348	阳泉煤业	446,500.00	2.00

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	174,320,980.30
卖出股票收入(成交)总额	239,436,633.32

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	353,931,380.00	5.02
	其中:政策性金融债	353,931,380.00	5.02
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	842,798.00	0.01
8	其他	-	-
9	合计	354,774,178.00	5.03

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	018001	国开1301	3,454,000	353,931,380.00	5.02
2	110031	航信转债	5,800	842,798.00	0.01

注:本基金本报告期末仅持有上述债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金以套期保值为目的,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。

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

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货。

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

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货。

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	208,534.55
2	应收证券清算款	2,158,958,326.53
3	应收股利	-
4	应收利息	11,485,765.88
5	应收申购款	10,058.02
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,170,662,684.98

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	000630	铜陵有色	6,342,712.00	0.09	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

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
215	30,816,259.18	6,620,984,908.25	99.93%	4,510,815.88	0.07%

8.3 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	27,664.20	0.00%

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

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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

8.5 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	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	10,001,250.00	0.15	10,001,250.00	0.15	三年
基金管理人高级管理人员	1,000.00	0.00	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	26,664.20	0.00	-	-	-
合计	10,028,914.20	0.15	10,001,250.00	0.15	三年

注:①上述份额总数为扣除认购费用并包含利息结转份额后的总份额数。

②本基金发起式资金提供方仅为基金管理人,基金管理人高级管理人员、基金经理、其他从业人员持有的基金份额不属于发起份额。

§9 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2013年12月19日)基金份额总额	128,523,462.75
本报告期期初基金份额总额	21,921,410.71
本报告期基金总申购份额	6,722,984,223.77
减:本报告期基金总赎回份额	119,409,910.35
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
本报告期期末基金份额总额	6,625,495,724.13

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

报告期内无基金份额持有人大会决议。

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、基金托管人的专门基金托管部无重大人事变动。

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

本基金在本报告期内,基于对市场的判断,在二季度采取了趋向稳健的投资策略。

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	
银河证券	2	359,301,919.37	100.00%	255,247.20	100.00%	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-

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
银河证券	355,034,716.70	100.00%	29,948,100,000.00	100.00%	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-

§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)"。

3.本报告期内,根据2015年3月30日在中国证监会指定媒介和管理人官方网站发布的《关于降低前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金管理费和托管费的公告》,自2015年4月1日起,本基金的管理费率调整为0.9%/年,托管费率调整为0.05%/年。同时,对《前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》及《前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议》做了相应修改,详见2015年3月30日在中国证监会指定媒介和管理人官方网站发布的相关公告。

前海开源基金管理有限公司

2015年8月25日