前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金

2017 半年度 报告摘要

2017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:国信证券股份有限公司
送出日期:2017年8月28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。

基金托管人国信证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年8月18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2017年01月01日起至06月30日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	前海开源健康分级		
场内简称	健康分级		
基金主代码	164401		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015年4月16日		
基金管理人	前海开源基金管理有限公司		
基金托管人	国信证券股份有限公司		
报告期末基金份额总额	514,288,963.23份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2015年5月8日		
下属分级基金的基金简称	前海开源健康分级	前海开源健康A	前海开源健康B
下属分级基金场内简称:	健康分级	健康A	健康B
下属分级基金的交易代码	164401	150219	150220
报告期末下属分级基金份额总额	28,622,983.23份	242,832,990.00份	242,832,990.00份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金紧密跟踪标的指数——中证健康产业指数，通过严谨数量化管理和投资纪律约束，力争保持基金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【0.35%】，年跟踪误差不超过【4%】。		
投资策略	本基金采用动态复制标的指数的投资方法，参照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整，以复制和跟踪标的指数。本基金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。 当预期成份股发生调整或成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或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管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。 本基金力争前海开源中证健康份额净值增长率与同期业绩比较基准的增长率之间的日均跟踪偏离度不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。 1、资产配置策略 为实现跟踪标的指数的投资目标，本基金将以不低于非现金基金资产的90%的比例投资于标的指数成份股及其备选成份股，并保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。 2、股票投资策略 （1）股票投资组合的构建 本基金在建仓期内，将参照标的指数各成份股的基准权重对其逐步买入，在力求跟踪误差最小化的前提下，本基金可采取适当方法，以降低买入成本。当遇到成份股停牌、流动性不足等其他市场因素而无法依指数权重购买某成份股及预期标的指数的成份股即将调整或其他影响指数复制的因素时，本基金可以根据市场情况，结合研究分析，对基金财产进行适当调整，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。 （2）股票投资组合的调整 本基金所构建的股票投资组合将根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、新股增发因素等变化，对其进行适时调整，以保证前海开源中证健康份额净值增长率与标的指数收益率间的高度正相关和跟踪误差最小化。基金管理人将对成份股的流动性进行分析，如发现流动性欠佳的个股将可能采用合理方法寻求替代。由于受到各项持股比例限制，基金可能不能按照成份股权重持有成份股，基金将会采用合理方法寻求替代。 1）定期调整 根据标的指数的调整规则和备选股票的预期，对股票投资组合及时进行调整。 2）不定期调整 根据指数编制规则，当标的指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重新调整时，本基金将根据各成份股的权重变化进行相应调整； 根据本基金的申购和赎回情况，对股票投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数； 根据法律、法规规定，成份股在标的指数中的权重因其它特殊原因发生相应变化的，本基金可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。 3、债券投资策略 本基金可以根据流动性管理需要，选取到期日在一年以内的政府债券进行配置。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。		
业绩比较基准	中证健康产业指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%		
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数基金，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。 从本基金所分拆的两类基金份额来看，前海开源中证健康A份额为稳健收益类份额；前海开源中证健康B份额为积极收益类份额。		
下属分级基金的风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数基金，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。	前海开源中证健康A份额为稳健收益类份额。	前海开源中证健康B份额为积极收益类份额。

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	国信证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	傅成斌	孙常新
	联系电话	0755-88601888	0755-22940701
	电子邮箱	qhky@qhkyfund.com	03356@guosen.com.cn
客户服务电话		4001666998	95536
传真		0755-83181169	0755-22940165

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（2017年1月1日 - 2017年6月30日）
本期已实现收益	7,929,593.05
本期利润	-7,726,727.00
加权平均基金份额本期利润	-0.0121
本期基金份额净值增长率	0.30%
3.1.2 期末数据和指标	**报告期末（2017年6月30日）**
期末可供分配基金份额利润	0.0502
期末基金资产净值	513,791,771.31
期末基金份额净值	0.999

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。

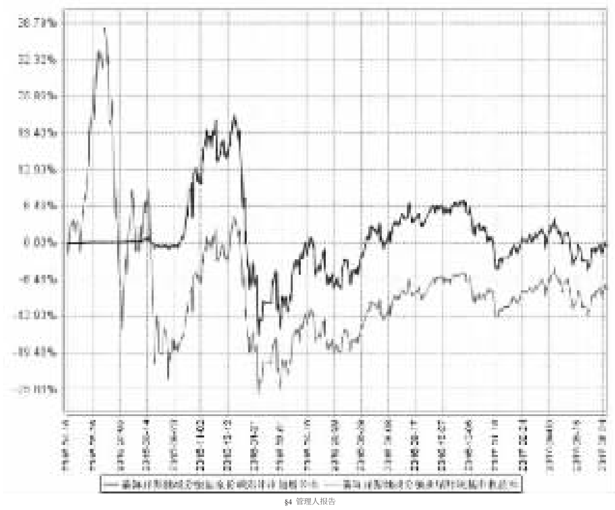
3.2 基金净值表现

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
过去三个月	0.10%	0.88%	1.17%	0.89%	-1.07%	-0.01%
过去六个月	0.30%	0.78%	1.96%	0.78%	-1.66%	0.00%
过去一年	5.22%	0.80%	8.30%	0.80%	-3.08%	0.00%
自基金合同生效起至今	5.11%	1.32%	-7.66%	2.02%	12.77%	-0.70%

注:本基金的业绩比较基准为:中证健康产业指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率(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



§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，在深圳设立华南营销中心；直销中心覆盖珠三角、长三角和京津冀环渤海经济区，为公司的快速发展奠定了组织和区域基础。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58只开放式基金，资产管理规模超过620亿元。

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		
孙亚超	本基金的基金经理、公司执行投资总监	2015年4月16日	2017年5月31日	8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，前海开源基金管理有限公司执行投资总监。
聂守华	本基金的基金经理、公司投资副总监	2017年2月14日	-	7年	聂守华先生，博士研究生。2013年11月至2015年9月任法国巴黎银行（纽约）新兴市场部固定收益交易员，负责墨西哥利率和外汇衍生品的投资和做市业务；2010年6月至2013年11月任职法国巴黎银行（纽约）固定收益部金融分析师，负责外汇和利率衍生品定价和风控模型的开发和应用。2015年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、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

本报告期内，在无大额申购或赎回等特殊情况时，基本保持了基金合同所允许的90%到95%的仓位，对基准指数进行了有效的动态跟踪。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内，基金份额净值增长率为0.30%，同期业绩比较基准收益率为1.96%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2017年下半年宏观经济，2017年上半年金融环境和货币政策边际收紧以及房地产调控作用将会逐步显现，经济具有一定的下行压力，呈现前高后低的走势。在金融去杠杆取得一定成效的环境下，货币政策进一步收紧的必要性和概率均有所降低，从而对证券市场带来一定的支撑。就大健康指数涉及的板块来看，医疗保健、食品健康和环境保护在全社会老龄化、消费观念升级和注重绿色发展的大趋势下持续具有中长期的配置价值。

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。估值委员会由执行董事长、督察长、基金事务部、研究部、投资部、监察稽核部、金融工程部、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

据本基金基金合同的约定，在存续期内，本基金(包括前海开源中证健康分级份额、前海开源中证健康A份额、前海开源中证健康B份额)不进行收益分配。

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

托管人声明，在本报告期间，本基金托管人——国信证券股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、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，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

基金管理人本半年度报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告等内容真实、准确和完整，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:前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金

报告截止日：2017年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
资 产：		
银行存款	17,250,599.60	74,576,151.44
结算备付金	213,800.97	5,338.92
存出保证金	905,630.83	397,130.95
交易性金融资产	494,090,549.36	1,012,201,815.51
其中:股票投资	484,167,549.36	1,012,201,815.51
基金投资	-	-
债券投资	9,923,000.00	-
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	-	-
应收证券清算款	7,415,102.34	-
应收利息	47,750.35	37,128.66
应收股利	-	-
应收申购款	45,713.11	1,315.59
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	519,969,146.56	1,087,218,881.07
负债和所有者权益	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016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	-	-
应付赎回款	5,084,231.96	2,095,595.85
应付管理人报酬	436,640.26	997,386.04
应付托管费	87,328.07	199,477.21
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	206,723.35	636,652.72
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	362,451.61	532,851.59
负债合计	6,177,375.25	4,461,963.41
所有者权益：		
实收基金	487,985,928.30	1,031,043,487.46
未分配利润	25,805,843.01	51,713,430.20
所有者权益合计	513,791,771.31	1,082,756,917.66
负债和所有者权益总计	519,969,146.56	1,087,218,881.07

注:报告截止日2017年6 月30 日，前海开源健康分级基金份额净值0.999元，前海开源健康A基金份额净值1.030元，前海开源健康B基金份额净值0.968元；基金份额总额514,288,963.23份，其中，前海开源健康分级基金份额28,622,983.23份，前海开源健康A基金份额242,832,990.00份，前海开源健康B基金份额242,832,990.00份。

6.2 利润表

会计主体:前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金

本报告期:2017年1月1日至2017年6月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
一、收入	-2,264,094.01	-121,244,022.70
1.利息收入	402,016.35	1,157,366.30
其中:存款利息收入	347,183.30	1,157,366.30
债券利息收入	54,833.05	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以"-"填列）	12,275,196.08	9,339,553.83
其中:股票投资收益	9,737,624.89	-1,479,198.66
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-8,273.00	-
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	2,545,844.19	10,818,752.49
3.公允价值变动收益（损失以"-"号填列）	-15,656,320.05	-131,978,482.60
4.汇兑收益（损失以"-"号填列）	-	-
5.其他收入（损失以"-"号填列）	715,013.61	237,539.77
减:二、费用	5,462,632.99	10,978,267.35
1.管理人报酬	3,174,538.68	7,805,576.59
2.托管费	634,907.84	1,561,115.34
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	1,369,672.79	1,199,725.22
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	283,513.68	411,850.20
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）	-7,726,727.00	-132,222,290.05
减:所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以"-"号填列）	-7,726,727.00	-132,222,290.05

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金

本报告期:2017年1月1日至2017年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017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）	1,031,043,487.46	51,713,430.20	1,082,756,917.66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-7,726,727.00	-7,726,727.00
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）	-543,057,559.16	-18,180,860.19	-561,238,419.35
其中:1.基金申购款	10,983,460.38	645,503.16	11,628,963.54
2.基金赎回款	-554,041,019.54	-18,826,363.35	-572,867,382.89
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）	487,985,928.30	25,805,843.01	513,791,771.31
项目	上年度可比期间 2016年1月1日至2016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）	1,086,555,816.24	205,931,152.62	1,292,486,968.86
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-132,222,290.05	-132,222,290.05
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）	727,777,299.71	-71,344,572.49	656,432,727.22
其中:1.基金申购款	914,627,989.43	-67,509,651.56	847,118,337.87
2.基金赎回款	-186,850,689.72	-3,834,920.93	-190,685,610.65
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）	1,814,333,115.95	2,364,290.08	1,816,697,406.03

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　　何璁　　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

前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金(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【2015】139号文《关于准予前海开源中证健康产业指数分级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》、《前海开源中证健康产业指数分级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3月30日至2015年4月10日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集351,034,309.00元，经瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)瑞华验字[2015]02030029号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金基金合同》于2015年4月16日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为351,085,447.02份基金份额，其中认购资金利息折合51,138.02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，本基金托管人为国信证券股份有限公司。

根据《前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金基金合同》并报中国证监会备案，本基金的基金份额包括前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金之基础份额(以下简称"前海开源健康分级份额")、前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金之A份额(以下简称"前海开源健康A份额")、前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金之B份额(以下简称"前海开源健康B份额")。前海开源健康分级份额为可以申购、赎回但不能上市交易的基金份额，前海开源健康A份额与前海开源健康B份额为可以上市交易但不能申购、赎回的基金份额。前海开源健康A份额与前海开源健康B份额的配比始终保持1:1的比率不变。本基金基金合同生效后，前海开源健康分级份额与前海开源健康A份额、前海开源健康B份额之间可以按约定的规则进行场内份额配对转换。

在前海开源健康A份额、前海开源健康分级份额存续期内的每个会计年度(除基金合同生效日所在会计年度外)第一个工作日，本基金将进行基金的定期份额折算。除定期份额折算外，本基金还将在前海开源健康分级份额的基金份额净值达到1.500元时或前海开源健康B份额的基金份额参考净值跌至0.250元时进行不定期份额折算。基金份额折算后基金份额净值相应调整。

经深圳证券交易所(以下简称"深交所")深证上[2015]第179号文审核同意，本基金前海开源健康A份额126,701,967.00份基金份额和前海开源健康B份额126,701,967.00份基金份额于2015年5月8日在深交所挂牌交易。对于托管在场内的前海开源健康分级份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其分拆为前海开源健康A份额和前海开源健康B份额即可上市流通；对于托管在场外的前海开源健康分级份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其跨系统转托管至深交所场内后分拆为前海开源健康A份额和前海开源健康B份额即可上市流通。

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》、《前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

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、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

本基金本报告期末发生会计政策变更。

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[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[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补充政策的通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下:

(1) 于2016年5月1日前，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。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。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，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(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2015年9月8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，股息红利所得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。

(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 2017年6月30日
活期存款	17,250,599.60
定期存款	-
其中:存款期限1-3个月	-
其他存款	-
合计:	17,250,599.60

6.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目		本期末 2017年6月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		467,245,299.36	484,167,549.36	16,922,250.00
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	9,921,000.00	9,923,000.00	2,000.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	9,921,000.00	9,923,000.00	2,000.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		477,166,299.36	494,090,549.36	16,924,250.00

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 2017年6月30日
应收活期存款利息	7,217.81
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	86.58
应收债券利息	40,079.12
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	366.84
合计	47,750.35

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 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	206,723.35
银行间市场应付交易费用	-
合计	206,723.35

6.4.7.8 其他负债

单位:人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	19,137.93
预提费用	303,313.68
指数使用费	40,000.00
合计	362,451.61

6.4.7.9 实收基金

金额单位:人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,055,081,860.91	1,031,043,487.46
本期申购	1,576.08	1,539.78
本期赎回（以"-"号填列）	-126,750.00	-123,830.51
2017年1月3日 基金拆分/份额折算前	1,054,956,686.99	1,030,921,196.73
基金拆分/份额折算变动份额	31,550,577.00	-
本期申购	11,572,267.17	10,981,920.60
本期赎回（以"-"号填列）	-583,790,567.93	-553,917,189.03
本期末	514,288,963.23	487,985,928.30

注:①根据本基金的基金合同、招募说明书及深圳证券交易所和中国证券登记结算有限公司的规定，本基金以2017年1月3日为份额折算基准日，对前海开源健康分级的场外份额、场内份额以及前海开源健康A份额实施定期份额折算。

②本期申购含转换转入份(金)额，本期赎回含转出份(金)额。

③根据《基金合同》规定，投资者可申购、赎回前海开源健康分级基础份额，前海开源健康A份额和前海开源健康B份额只可在深圳证券交易所上市交易，故本表不再单独披露前海开源健康A和前海开源健康B份额的情况。

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	171,264,424.65	-119,550,994.45	51,713,430.20
本期利润	7,929,593.05	-15,656,320.05	-7,726,727.00
本期基金份额交易产生的变动数	-94,177,254.55	75,996,394.36	-18,180,860.19
其中:基金申购款	1,929,397.38	-1,283,894.22	645,503.16
基金赎回款	-96,106,651.93	77,280,288.58	-18,826,363.35
本期已分配利润	-	-	-
本期末	85,016,763.15	-59,210,920.14	25,805,843.01

6.4.7.11 存款利息收入

单位:人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	337,002.85
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	3,050.18
其他	7,130.27
合计	347,183.30

注:"其他"为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 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	680,974,665.77
减:卖出股票成本总额	671,237,040.88
买卖股票差价收入	9,737,624.89

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 2017年1月1日至2017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	-8,273.00
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	-8,273.00

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 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	17,268,564.12
减:卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	16,964,573.00
减:应收利息总额	312,264.12
买卖债券差价收入	-8,273.00

6.4.7.13.3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。

6.4.7.13.4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。

6.4.7.13.5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。

6.4.7.14.2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买卖贵金属差价收入。

6.4.7.14.3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。

6.4.7.14.4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。

6.4.7.15 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 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,545,844.19
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,545,844.19

6.4.7.17公允价值变动收益

单位:人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
1.交易性金融资产	-15,656,320.05
——股票投资	-15,658,320.05
——债券投资	2,000.00
——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	-15,656,320.05

6.4.7.18 其他收入

单位:人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	715,013.61
合计	715,013.61

6.4.7.19 交易费用

单位:人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	1,369,672.79
银行间市场交易费用	-
合计	1,369,672.79

6.4.7.20 其他费用

单位:人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	148,765.71
基金上市费	29,752.78
汇划费	200.00
指数使用费	80,000.00
合计	283,513.68

6.4.8 关联方关系

7.4.8.1 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。

6.4.8.2 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"）	基金管理人、基金销售机构
国信证券股份有限公司（"国信证券"）	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
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。

6.4.9 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 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国信证券股份有限公司	-	-	821,650,704.27	71.19%

注:本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.9.1.2 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。

6.4.9.1.3 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。

6.4.9.1.4 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。

6.4.9.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017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
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016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
国信证券股份有限公司	600,875.22	71.19%	15,240.28	5.90%

注:本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行交易，无佣金产生。

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 2017年1月1日至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,174,538.68	7,805,576.59
其中:支付销售机构的客户维护费	2,995.72	30,102.39

注:本基金的管理费按前一日资产净值的1.0%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×1.0%÷ 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 2017年1月1日至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	634,907.84	1,561,115.34

注:本基金的托管费按前一日资产净值的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取。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

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。

6.4.9.3 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。

6.4.9.4 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。

6.4.9.4.2 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。

6.4.9.5 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 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016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
国信证券股份有限公司	17,250,599.60	337,002.85	134,363,969.07	1,103,219.77

注:本基金的银行存款由基金托管人国信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。

6.4.9.7 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。

6.4.10 期末(2017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
603933	睿能科技	2017年6月28日	2017年7月6日	新股流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-
603305	旭升股份	2017年6月30日	2017年7月10日	新股流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
300672	国科微	2017年6月30日	2017年7月12日	新股流通受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-
603331	百达精工	2017年6月27日	2017年7月5日	新股流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-

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
002399	海普瑞	2017年4月28日	重大事项	20.23	-	-	294,336	5,232,543.40	5,954,417.28	-
002252	上海莱士	2017年4月21日	重大事项	20.24	-	-	251,653	5,404,785.15	5,093,456.72	-
002447	壹桥海参	2017年5月2日	重大资产重组	9.00	-	-	556,299	4,032,698.78	5,006,691.00	-
002505	大康农业	2017年3月13日	重大事项	3.01	-	-	1,562,366	4,923,185.57	4,702,721.66	-
300267	尔康制药	2017年5月10日	重大事项	11.46	-	-	368,640	5,272,879.86	4,224,614.40	-

注:本基金本报告期末持有的暂时停牌等流通受限股票的复牌情况，统计截止日期为2017年8月18日。

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2017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2017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2017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469,055,844.91元，属于第二层次的余额为25,034,704.45元，属于第三层次的余额为0.00元。于2016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1,004,358,035.63元，属于第二层次的余额为7,843,779.88元，属于第三层次的余额为0.00元。

(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。

(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2017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(2016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	484,167,549.36	93.11
	其中:股票	484,167,549.36	93.11
2	固定收益投资	9,923,000.00	1.91
	其中:债券	9,923,000.00	1.91
	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	17,464,400.57	3.36
7	其他各项资产	8,414,196.63	1.62
8	合计	519,969,146.56	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	66,672,365.61	12.98
B	采矿业	-	-
C	制造业	279,129,662.22	54.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	27,899,611.05	5.43
E	建筑业	31,957,503.04	6.22
F	批发和零售业	24,900,171.10	4.85
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	33,257,583.17	6.47
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	10,118,818.10	1.97
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	473,935,714.29	92.24

7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	采掘业	-	-
C	制造业	10,231,835.07	1.99
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	10,231,835.07	1.99

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

7.3.1 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

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	002695	煌上煌	309,900	6,619,464.00	1.29
2	300355	蒙草生态	539,520	5,794,444.80	1.13
3	300003	乐普医疗	242,030	5,351,283.30	1.04
4	002515	金字火腿	562,804	5,335,381.92	1.04
5	002299	圣农发展	358,250	5,327,177.50	1.04
6	002234	民和股份	424,673	5,282,932.12	1.03
7	002294	信立泰	148,018	5,278,321.88	1.03
8	002458	益生股份	254,400	5,253,360.00	1.02
9	600887	伊利股份	242,896	5,244,124.64	1.02
10	002044	美年健康	307,300	5,224,100.00	1.02

7.3.2 积极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

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	002399	海普瑞	294,336	5,954,417.28	1.16
2	300267	尔康制药	368,640	4,224,614.40	0.82
3	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.00
4	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
5	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.00

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	002695	煌上煌	7,069,936.00	0.65
2	002458	益生股份	6,103,130.00	0.56
3	002746	仙坛股份	5,515,476.00	0.51
4	000820	金城股份	5,291,546.00	0.49
5	600056	中国医药	5,282,129.92	0.49
6	002044	美年健康	5,254,938.96	0.49
7	600664	哈药股份	5,156,332.00	0.48
8	600566	济川药业	5,132,670.00	0.47
9	300355	蒙草生态	5,113,237.00	0.47
10	603556	海兴电力	4,918,057.00	0.45
11	603858	步长制药	4,910,770.00	0.45
12	300495	美尚生态	4,885,047.96	0.45
13	300558	贝达药业	4,865,045.04	0.45
14	000639	西王食品	4,843,069.09	0.45
15	603658	安图生物	4,834,060.17	0.45
16	300529	健帆生物	4,753,756.30	0.44
17	002411	必康股份	4,248,414.00	0.39
18	300498	温氏股份	3,874,085.00	0.36
19	600226	瀚叶股份	3,181,178.00	0.29
20	000538	云南白药	3,113,276.80	0.29

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	000538	云南白药	19,935,817.10	1.84
2	600874	创业环保	14,258,394.30	1.32
3	002086	东方海洋	11,811,112.84	1.09
4	600252	中恒集团	10,522,182.43	0.97
5	300263	隆华节能	10,316,218.02	0.95
6	300156	神雾环保	10,279,611.95	0.95
7	300498	温氏股份	10,113,052.41	0.93
8	000035	中国天楹	10,036,809.48	0.93
9	600008	首创股份	9,830,131.39	0.91
10	600572	康恩贝	9,747,953.24	0.90
11	002770	科迪乳业	9,659,042.90	0.89
12	002437	誉衡药业	9,550,308.84	0.88
13	600251	冠农股份	9,549,576.05	0.88
14	601368	绿城水务	9,507,635.06	0.88
15	300199	翰宇药业	9,439,748.29	0.87
16	603567	珍宝岛	9,283,841.46	0.86
17	600196	复星医药	9,242,502.29	0.85
18	002030	达安基因	9,010,576.00	0.83
19	002310	东方园林	8,970,613.57	0.83
20	002573	清新环境	8,876,871.39	0.82

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	158,861,094.78
卖出股票收入（成交）总额	680,974,665.77

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	9,923,000.00	1.93
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
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	9,923,000.00	1.93

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	020178	17贴债22	100,000	9,923,000.00	1.93

注:本基金本报告期末仅持有以上债券。

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

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。

7.11.2

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	905,630.83
2	应收证券清算款	7,415,102.34
3	应收股利	-
4	应收利息	47,750.35
5	应收申购款	45,713.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,414,196.63

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

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.1期末积极投资前五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	002399	海普瑞	5,954,417.28	1.16	重大事项
2	300267	尔康制药	4,224,614.40	0.82	重大事项
3	603933	睿能科技	17,311.40	0.00	新股锁定
4	603305	旭升股份	15,212.26	0.00	新股锁定
5	300672	国科微	10,659.36	0.00	新股锁定

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	占总份额比例
前海开源健康分级	2,262	12,653.84	12,616,271.00	44.08%	16,006,712.23	55.92%
前海开源健康A	140	1,734,521.36	237,831,498.00	97.94%	5,001,492.00	2.06%
前海开源健康B	5,653	42,956.48	34,014,496.00	14.01%	208,818,494.00	85.99%
合计	8,055	63,847.17	284,462,265.00	55.31%	229,826,698.23	44.69%

注:① 分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数(即期末基金份额总额)。

② 户均持有的基金份额合计=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

8.2 期末上市基金前十名持有人

健康A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	新华人寿保险股份有限公司	149,912,050.00	61.73%
2	中意人寿保险有限公司-分红-团体年金	41,138,200.00	16.94%
3	中国银河证券股份有限公司	22,673,050.00	9.34%
4	中意人寿保险有限公司	13,981,975.00	5.76%
5	中国太平洋人寿保险股份有限公司-分红-个人分红	3,539,037.00	1.46%
6	中国太保集团股份有限公司-本级-集团自有资金-012G-ZY001	2,000,000.00	0.82%
7	光大期货有限公司-光大期货道冲水滴1号资产管理计划	1,809,000.00	0.74%
8	福建道冲投资管理有限公司-道冲补天1号私募基金	1,286,999.00	0.53%
9	肖瑛	1,236,919.00	0.51%
10	北京快快网络技术有限公司	1,167,300.00	0.48%

健康B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	福建道冲投资管理有限公司-道冲补天1号私募基金	13,461,128.00	5.54%
2	福建道冲投资管理有限公司	7,918,149.00	3.26%
3	李亨蓥	7,006,839.00	2.89%
4	赵升旺	6,800,000.00	2.80%
5	上海道策信息技术有限公司	6,498,882.00	2.68%
6	黎焕金	4,494,400.00	1.85%
7	宋宝林	4,035,300.00	1.66%
8	尹春锦	3,684,609.00	1.52%
9	中意人寿保险有限公司-分红-团体年金	3,027,900.00	1.25%
10	吴克亮	3,000,000.00	1.24%

注:以上信息中，持有人名称及持有份额由中国证券登记结算有限责任公司提供。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	前海开源健康分级	100.00	0.00%
	前海开源健康A	-	-
	前海开源健康B	-	-
	合计	100.00	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

本报告期末本基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人、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	前海开源健康分级	前海开源健康A	前海开源健康B
基金合同生效日（2015年4月16日）基金份额总额	351,085,447.02	-	-
本报告期期初基金份额总额	449,584,680.91	302,748,590.00	302,748,590.00
本报告期基金总申购份额	11,573,843.25	-	-
减:本报告期基金总赎回份额	583,917,317.93	-	-
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	151,381,777.00	-59,915,600.00	-59,915,600.00
本报告期期末基金份额总额	28,622,983.23	242,832,990.00	242,832,990.00

注:拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额及定期、不定期折算调整的份额。

§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；

本报告期内，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），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	
中投证券	2	575,294,270.73	68.51%	420,712.79	68.51%	-
东方财富	2	264,488,686.43	31.49%	193,420.62	31.49%	-
国信证券	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
中投证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	43,848,694.98	100.00%	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-

§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	20170124-20170630	155,918,650.00	-	6,006,600.00	149,912,050.00	30.02%
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

1. 巨额赎回风险

（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；

（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；

2. 转换运作方式或终止基金合同的风险

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；

3.流动性风险

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；

4.巨额赎回可能导致基金资产规模过小，导致部分投资策略无法顺利实施，无法实现基金合同约定的投资目标及投资策略。

11.2影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，根据基金合同约定，基金管理人以2017年1月3日为基金份额折算基准日对本基金办理定期份额折算业务，投资者敬请查阅基金管理人刊登在中国证监会指定媒介发布的相关公告。

前海开源基金管理有限公司

2017年8月28日