前海开源沪港深农业主题精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

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：中国银河证券股份有限公司
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。

基金托管人中国银河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	前海开源沪港深农业混合（LOF）
场内简称	农业精选
基金主代码	164403
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年7月20日
基金管理人	前海开源基金管理有限公司
基金托管人	中国银河证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	41,785,735.73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	2016年8月15日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过精选投资于农业主题相关证券，在合理控制风险并保持基金资产良好流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金的投资策略主要有以下五方面内容： 1、大类资产配置 在大类资产配置中，本基金综合运用定性和定量的分析手段，在对宏观经济因素进行充分研究的基础上，判断宏观经济周期所处阶段。本基金将依据经济周期理论，结合对证券市场的系统性风险以及未来一段时期内各大类资产风险和预期收益率的评估，制定本基金在股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例。 2、股票投资策略 本基金采取自上而下宏观分析和自下而上精选个股相结合的投资策略，在遵循本基金资产配置比例限制的前提下，确定各类资产的投资比例。 本基金将精选具有巨大增长潜力、与农业主题相关的上市公司股票构建股票投资组合，投资于农业主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的80%。本基金所指的农业主题包括种植业、畜禽养殖、林业、渔业、农产品加工等农业基础领域，亦包括为农业提供服务支持的相关上下游行业，包括但不限于化肥、农药、动物保健、饲料、农业互联网化、农业机械化等有相关细分子行业。 3、债券投资策略 本基金主要基于流动性管理需求投资于债券。本基金将结合宏观经济变化趋势、货币政策及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，运用久期调整、凸度挖掘、信用分析、波动性交易、回购套利等策略，权衡到期收益率与市场流动性，精选个券并构建和调整债券组合，在追求债券资产投资收益的同时兼顾流动性和安全性。 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、中小企业私募债券投资策略 本基金对中小企业私募债的投资综合考虑安全性、收益性和流动性等方面特征进行全方位的研究和比较，对个券发行主体的性质、行业、经营情况，以及债券的增信措施等进行全面分析，选择具有优势的品种进行投资，并通过久期控制和调整、适度分散投资来管理组合的风险。 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。
业绩比较基准	中证大农业指数收益率×60%+恒生指数收益率×10%+中证全债指数收益率×30%
风险收益特征	本基金为混合型基金，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。本基金如果投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。

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	中国银河证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	傅成斌	孟波
	联系电话	0755－88601888	010－83574679
	电子邮箱	qhky@qhkyfund.com	yhzq_tgzz@chinastock.com.cn
客户服务电话		4001666998	95551；400－888－8888
传真		0755－83181169	010－66568532

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	-262,671.70
本期利润	-345,918.23
加权平均基金份额本期利润	-0.0017
本期基金份额净值增长率	2.96%
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	-0.0395
期末基金资产净值	39,256,363.09
期末基金份额净值	0.939

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。

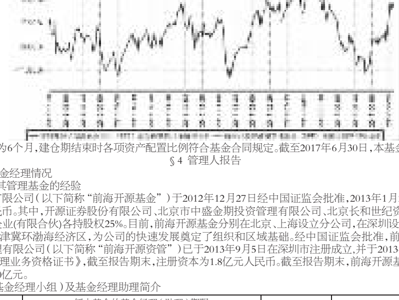
3.2 基金净值表现

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	0.97%	0.80%	-3.36%	0.58%	4.33%	0.22%
过去六个月	2.96%	0.75%	-1.53%	0.48%	4.49%	0.27%
自基金合同生效起至今	1.51%	0.78%	-0.21%	0.52%	1.72%	0.26%

注：自2017年3月8日起，本基金的业绩比较基准由原来的"沪深300 指数收益率×70%＋中证全债指数收益率×30%"，变更为"中证大农业指数收益率×60%+恒生指数收益率×10%+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



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规定。截至2017年6月30日，本基金建仓期结束未满1年。

§4 管理人报告

4.1 基金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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
柯海东	本基金的基金经理、公司投资副总监	2016年7月20日	-	6年	柯海东先生，中山大学管理学硕士。历任中国中投证券研究总部食品饮料行业分析师，国泰君安证券研究所食品饮料行业分析师。现任前海开源基金管理有限公司投资副总监。
孙亚超	本基金的基金经理、公司执行投资总监	2015年6月4日	2017年5月31日	8年	孙亚超先生，数学博士后。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。

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

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《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

2017年上半年，农业主题表现不佳，跑输了沪深300指数，如农林牧渔（申万）指数下跌14.9%，中证大农业指数下跌8.3%。我们通过灵活地自下而上选股及仓位调整，基金取得了正收益，总体而言跑赢了农业主要指数，也战胜了业绩基准。

我们认为上半年农业主题表现不佳的主要原因有三点：一是猪周期见顶回落后，在二季度下行的速度超出预期，如5月份猪价的下行幅度超出了产业界及资本市场的预期，且本轮周期将以上市公司扩产能为主，因此有可能周期比以往的时间要更长。二是原油价格表现较弱，显著低于市场在年初的预期，造成市场通胀预期亦较弱，压制了农业板块的估值。三是金融监管加强，市场风险偏好显著下降，以中小市值公司为主的农业板块估值受到了较大的负面影响。

在此情况下，我们积极把握结构性的机会，如养殖后周期的饲料、疫苗等细分子行业龙头，处于新产品周期的种业龙头，以及增持了部分正处于景气上行周期的白酒龙头公司，较好地应对了市场的变化。

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2.96%，同期业绩比较基准收益率为-1.53%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2017年下半年，我们认为国内宏观经济仍保持较强的韧性，不会对证券市场带来负面压力；金融监管强化对流动性的最大冲击已经过去，其影响正边际减弱；十九大可能提振改革预期，从而提升风险偏好。总体而言，我们对市场仍保持较为乐观的态度，结构性的投资机会仍存，我们将继续积极寻找受益于行业景气向上，或者集中度提升，及估值相对合理的股票。

对于农业行业，我们认为行业整体景气度依然一般，行业整体的趋势性机会仍需等待，我们将把更多精力聚焦在自下而上寻找细分的景气度向上的子行业或者龙头公司上。

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

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，中国银河证券股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《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，本托管人按照《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人依法复核前海开源基金管理有限公司编制和披露的前海开源沪港深农业主题精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2017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，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：前海开源沪港深农业主题精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

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	2,493,097.40	6,554,769.40
结算备付金	353,169.41	301,096.65
存出保证金	148,927.40	180,945.45
交易性金融资产	36,519,720.97	119,707,652.83
其中：股票投资	36,519,720.97	119,707,652.83
基金投资	-	-
债券投资	-	-
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	517,844.66	369,789.54
应收利息	5,187.68	1,751.70
应收股利	95,991.11	12,320.00
应收申购款	1,597.62	25,828.30
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	40,135,536.25	127,154,153.87
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	-	563,093.93
应付赎回款	285,363.33	11,898.53
应付管理人报酬	151,281.78	161,086.90
应付托管费	25,213.64	26,847.82
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	213,272.61	160,688.80
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	204,041.80	100,051.16
负债合计	879,173.16	1,023,667.14
所有者权益：		
实收基金	40,906,356.58	135,467,472.12
未分配利润	-1,649,993.49	-9,336,985.39
所有者权益合计	39,256,363.09	126,130,486.73
负债和所有者权益总计	40,135,536.25	127,154,153.87

注：报告截止日2017年6月30日，基金份额净值0.939元，基金份额总额41,785,735.73份。

6.2 利润表

会计主体：前海开源沪港深农业主题精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

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
一、收入	2,300,782.88
1.利息收入	96,158.85
其中：存款利息收入	84,538.85
债券利息收入	-
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	11,620.00
其他利息收入	-
2.投资收益（损失以"-"填列）	2,104,309.62
其中：股票投资收益	1,056,057.46
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	1,048,252.16
3.公允价值变动收益（损失以"-"号填列）	-83,246.53
4.汇兑收益（损失以"-"号填列）	-
5.其他收入（损失以"-"号填列）	183,560.94
减：二、费用	2,646,701.11
1． 管理人报酬	1,407,707.31
2． 托管费	234,617.84
3． 销售服务费	-
4． 交易费用	801,062.28
5． 利息支出	-
其中：卖出回购金融资产支出	-
6． 其他费用	203,313.68
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）	-345,918.23
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以"-"号填列）	-345,918.23

注：本基金的基金合同于2016年7月20日生效，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：前海开源沪港深农业主题精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

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）	135,467,472.12	-9,336,985.39	126,130,486.73
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-345,918.23	-345,918.23
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）	-94,561,115.54	8,032,910.13	-86,528,205.41
其中：1.基金申购款	111,712,498.67	-7,409,306.69	104,303,191.98
2.基金赎回款	-206,273,614.21	15,442,216.82	-190,831,397.39
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）	40,906,356.58	-1,649,993.49	39,256,363.09

注：本基金的基金合同于2016年7月20日生效，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　　　　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

前海开源沪港深农业主题精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）(简称"本基金")由前海开源中证大农业指数分级证券投资基金(以下简称"前海开源大农业指数分级")转型而成。前海开源大农业指数分级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]669号《关于准予前海开源中证大农业指数分级证券投资基金注册的批复》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》和《前海开源中证大农业指数分级证券投资基金基金合同》负责公开募集。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5月21日至2015年5月29日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币406,513,861.86元，经瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)瑞华验字[2015]0220016号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《前海开源中证大农业指数分级证券投资基金基金合同》于2015年6月4日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为406,557,096.53份基金份额，其中认购资金利息折合43,234.67份基金份额。基金管理人为前海开源基金管理有限公司，基金托管人为中国银河证券股份有限公司。前海开源大农业指数分级经中国证监会证监许可 [2016]1142号文《关于准予前海开源中证大农业指数分级证券投资基金变更注册的批复》核准，本基金变更注册为前海开源沪港深农业主题精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）。

前海开源中证大农业指数分级证券投资基金基金份额持有人大会于2016年6月8日至2016年7月6日以通讯方式召开，表决通过《关于前海开源中证大农业指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》，同意前海开源中证大农业指数分级证券投资基金转型为前海开源沪港深农业主题精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF），其基金类别、投资目标、投资范围和投资策略等相关事宜均发生变更，基金合同亦相应修改。

持有人大会决议生效日为2016年7月8日，本基金正式实施转型日为2016年7月20日(基金合同生效日)。自基金转型实施之日起，《前海开源中证大农业指数分级证券投资基金基金合同》失效且《前海开源沪港深农业主题精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）》同时生效。

前海开源沪港深农业主题精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）为契约型开放式，存续期限不定。前海开源沪港深农业主题精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）的基金管理人为前海开源基金管理有限公司，基金托管人为中国银河证券股份有限公司。《前海开源沪港深农业主题精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》、《前海开源沪港深农业主题精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）招募说明书》等文件已按规定报送中国证监会备案。

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》、《前海开源沪港深农业主题精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）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 重要会计政策和会计估计

本基金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。

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

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政策的补充通知》、财政部、国家税务总局、证监会财税[2014]81号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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》、财税[2016]127号《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》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)对基金通过沪港通投资香港联交所上市股票取得的转让差价所得，自2014年11月17日起至2017年11月16日止，暂免征收个人所得税。对基金通过深港通投资香港联交所上市股票取得的转让差价所得，自2016年12月5日起至2019年12月4日止，暂免征收个人所得税。对基金通过沪港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应当按照20%的税率代扣个人所得税。对基金通过沪港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(5)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。基金通过港股通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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	2,493,097.40
定期存款	-
其中：存款期限1-3个月	-
其他存款	-
合计：	2,493,097.40

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		34,882,600.96	36,519,720.97	1,637,120.01
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		34,882,600.96	36,519,720.97	1,637,120.01

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	3,951.44
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	1,150.89
应收债券利息	-
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	85.35
合计	5,187.68

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	213,272.61
银行间市场应付交易费用	-
合计	213,272.61

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	728.12
预提费用	203,313.68
合计	204,041.80

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	138,309,620.96	135,467,472.12
本期申购	114,044,493.78	111,712,498.67
本期赎回(以"-"号填列)	-210,568,379.01	-206,273,614.21
－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	41,785,735.73	40,906,356.58

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-5,800,929.52	-3,536,055.87	-9,336,985.39
本期利润	-262,671.70	-83,246.53	-345,918.23
本期基金份额交易产生的变动数	5,817,177.75	2,215,732.38	8,032,910.13
其中：基金申购款	-4,621,489.55	-2,787,817.14	-7,409,306.69
基金赎回款	10,438,667.30	5,003,549.52	15,442,216.82
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-246,423.47	-1,403,570.02	-1,649,993.49

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	70,872.93
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	8,634.85
其他	5,031.07
合计	84,538.85

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 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	292,715,870.73
减：卖出股票成本总额	291,659,813.27
买卖股票差价收入	1,056,057.46

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

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.13.2债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内无债券买卖差价收入。

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贵金属买卖差价收入。

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	1,048,252.16
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,048,252.16

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	-83,246.53
——股票投资	-83,246.53
——债券投资	-
——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	-83,246.53

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	183,517.54
基金转换费收入	43.40
合计	183,560.94

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	801,062.28
银行间市场交易费用	-
合计	801,062.28

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
合计	203,313.68

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
中国银河证券股份有限公司（"银河证券"）	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 成交金额	占当期股票成交总额的比例	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
中国银河证券股份有限公司	498,614,869.58	100.00%	-	-

6.4.9.1.2 债券交易

本基金本报告期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

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 回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	上年度可比期间 2016年1月1日至2016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
中国银河证券股份有限公司	87,000,000.00	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 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
中国银河证券股份有限公司	371,622.95	100.00%	213,272.61	100.00%

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

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	1,407,707.31	-
其中：支付销售机构的客户维护费	2,103.51	-

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×年管理费率÷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	234,617.84	-

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×年托管费率÷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

本报告期内无关联方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 期末余额	当期利息收入	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
中国银河证券股份有限公司	2,493,097.40	70,872.93	-	-

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银河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（ 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
002859	洁美科技	2017年3月24日	2018年3月26日	新股流通受限	29.82	73.00	6,666	198,780.12	486,618.00	-
002860	星帅尔	2017年3月31日	2018年4月2日	新股流通受限	19.81	48.90	7,980	158,083.80	390,222.00	-
002879	长缆科技	2017年6月5日	2017年7月7日	新股流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017年6月15日	2017年7月21日	新股流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
300670	大烨智能	2017年6月26日	2017年7月3日	新股流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
300671	富满电子	2017年6月27日	2017年7月5日	新股流通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-

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
300087	荃银高科	2017年5月12日	重大资产重组	14.14	2017年8月10日	9.80	240,000	3,374,884.82	3,393,600.00	-
600057	象屿股份	2017年6月27日	重大事项	10.17	2017年7月4日	10.17	95,000	1,108,246.52	966,150.00	-

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32,096,521.02元，属于第二层次的余额为4,423,199.95元，属于第三层次的余额为0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119,465,829.12 元，属于第二层次的余额为241,823.71元，属于第三层次的余额为0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	36,519,720.97	90.99
	其中：股票	36,519,720.97	90.99
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	2,846,266.81	7.09
7	其他各项资产	769,548.47	1.92
8	合计	40,135,536.25	100.00

注：权益投资中通过港股通交易机制投资的港股公允价值为9,548,236.14 元，占资产净值比例24.32%。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1报告期末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	5,643,615.00	14.38
B	采矿业	-	-
C	制造业	17,575,460.21	44.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,453,920.00	3.70
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	7,639.62	0.02
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,324,700.00	3.37
L	租赁和商务服务业	966,150.00	2.46
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	26,971,484.83	68.71

7.2.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
能源	912,045.05	2.32
工业	503,046.43	1.28
非日常生活消费品	1,044,034.85	2.66
日常消费品	873,301.10	2.22
医疗保健	2,717,283.94	6.92
金融	1,207,389.55	3.08
信息技术	702,737.47	1.79
公用事业	1,588,397.75	4.05
合计	9,548,236.14	24.32

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

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	300087	荃银高科	240,000	3,393,600.00	8.64
2	000998	隆平高科	102,000	2,246,040.00	5.72
3	0874	白云山	104,000	1,936,155.94	4.93
4	000568	泸州老窖	38,200	1,932,156.00	4.92
5	0371	北控水务集团	302,000	1,588,397.75	4.05
6	600197	伊力特	80,000	1,562,400.00	3.98
7	002568	百润股份	89,567	1,488,603.54	3.79
8	600201	生物股份	41,100	1,461,927.00	3.72
9	000639	西王食品	68,000	1,345,720.00	3.43
10	600104	上汽集团	43,000	1,335,150.00	3.40

注：所用证券代码使用当地市场代码。

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	002568	百润股份	21,446,250.99	17.00
2	000639	西王食品	10,421,782.00	8.26
3	00874	白云山	9,712,988.09	7.70
4	600201	生物股份	9,512,146.00	7.54
5	00371	北控水务集团	5,967,683.85	4.73
6	000860	顺鑫农业	5,736,705.00	4.55
7	00606	中国粮油控股	5,651,353.31	4.48
8	601288	农业银行	5,594,000.00	4.44
9	600197	伊力特	5,566,109.00	4.41
10	600598	北大荒	5,511,660.92	4.37
11	000998	隆平高科	4,900,342.55	3.89
12	600104	上汽集团	4,822,685.42	3.82
13	000157	中联重科	4,646,343.67	3.68
14	000568	泸州老窖	4,436,907.00	3.52
15	03323	中国建材	4,430,570.80	3.51
16	002458	益生股份	4,114,034.20	3.26
17	00753	中国国航	3,961,726.15	3.14
18	603833	欧派家居	3,551,189.80	2.82
19	00570	中国中药	3,412,410.62	2.71
20	603609	禾丰牧业	3,405,576.00	2.70
21	00322	康师傅控股	3,248,758.50	2.58
22	000505	*ST 珠江	3,214,153.92	2.55
23	600057	象屿股份	2,970,263.37	2.35
24	00506	中国食品	2,967,222.44	2.35
25	600198	大唐电信	2,921,324.77	2.32
26	300197	铁汉生态	2,872,911.38	2.28
27	01458	周黑鸭	2,760,898.86	2.19
28	600502	安徽水利	2,745,864.88	2.18
29	01288	农业银行	2,741,801.38	2.17

注：①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。

②所用证券代码使用当地市场代码。

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	002568	百润股份	16,996,379.38	13.48
2	600201	生物股份	12,901,203.51	10.23
3	000639	西王食品	9,721,012.10	7.71
4	000568	泸州老窖	9,526,939.25	7.55
5	000998	隆平高科	8,963,342.81	7.11
6	03323	中国建材	7,743,207.86	6.14
7	00606	中国粮油控股	7,667,098.53	6.08
8	00874	白云山	7,449,510.91	5.91
9	00371	北控水务集团	6,560,584.07	5.20
10	601288	农业银行	5,682,859.00	4.51
11	300197	铁汉生态	5,636,124.58	4.47
12	000860	顺鑫农业	5,216,505.88	4.14
13	300498	温氏股份	4,905,109.27	3.89
14	000157	中联重科	4,887,846.00	3.88
15	000858	五 粮 液	4,733,981.00	3.75
16	600737	中粮糖业	4,643,527.00	3.68
17	600598	北大荒	4,640,337.00	3.68
18	000895	双汇发展	4,635,433.00	3.68
19	002311	海大集团	4,596,562.00	3.64
20	603609	禾丰牧业	4,536,860.81	3.60
21	600197	伊力特	4,249,572.08	3.37
22	300138	晨光生物	4,142,988.83	3.28
23	01288	农业银行	4,114,225.42	3.26
24	600104	上汽集团	4,080,650.60	3.24
25	600057	象屿股份	4,029,955.00	3.20
26	01618	中国中冶	3,984,115.58	3.16
27	600068	葛洲坝	3,941,451.00	3.12
28	00753	中国国航	3,821,209.04	3.03
29	002458	益生股份	3,721,249.00	2.95
30	000930	中粮生化	3,709,808.00	2.94
31	000505	*ST 珠江	3,688,159.10	2.92
32	002041	登海种业	3,664,241.55	2.91
33	01117	现代牧业	3,601,372.43	2.86
34	600108	亚盛集团	3,577,079.00	2.84
35	000915	山大华特	3,518,489.00	2.79
36	002456	欧菲光	3,500,663.22	2.78
37	000902	新洋丰	3,483,107.00	2.76
38	00322	康师傅控股	3,473,138.46	2.75
39	600502	安徽水利	3,435,802.08	2.72
40	002588	史丹利	3,393,617.00	2.69
41	300106	西部牧业	3,226,821.00	2.56
42	600873	梅花生物	3,088,098.10	2.45
43	01432	中国圣牧	2,855,518.22	2.26
44	600963	岳阳林纸	2,848,297.00	2.26
45	603833	欧派家居	2,840,332.21	2.25
46	600500	中化国际	2,837,280.06	2.25
47	02689	玖龙纸业	2,833,077.43	2.25
48	00700	腾讯控股	2,706,095.81	2.15
49	00506	中国食品	2,678,913.62	2.12
50	600298	安琪酵母	2,542,679.00	2.02
51	600195	中牧股份	2,537,584.00	2.01
52	00570	中国中药	2,529,285.63	2.01

注：①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。

②所用证券代码使用当地市场代码。

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	208,555,127.94
卖出股票收入（成交）总额	292,715,870.73

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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。

7.12.2

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	148,927.40
2	应收证券清算款	517,844.66
3	应收股利	95,991.11
4	应收利息	5,187.68
5	应收申购款	1,597.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	769,548.47

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

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	300087	荃银高科	3,393,600.00	8.64	重大资产重组

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 持有份额	占总份额比例	个人投资者 持有份额	占总份额比例
1,016	41,127.69	21,469,466.53	51.38%	20,316,269.20	48.62%

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	28,918.56	0.0700%

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

基金合同生效日（ 2016年7月20日 ）基金份额总额	142,966,943.05
本报告期期初基金份额总额	138,309,620.96
本报告期基金总申购份额	114,044,493.78
减：本报告期基金总赎回份额	210,568,379.01
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	41,785,735.73

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

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），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 成交金额	占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金 佣金	占当期佣金总量的比例	备注
银河证券	2	498,614,869.58	100.00%	371,622.95	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 成交金额	占当期债券成交总额的比例	债券回购交易 成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	权证交易 成交金额	占当期权证成交总额的比例
银河证券	-	-	87,000,000.00	100.00%	-	-

§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

无。

11.2影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，自2017年3月8日起，本基金的业绩比较基准由原来的"沪深300指数收益率×70%＋中证全债指数收益率×30%"变更为"中证大农业指数收益率×60%+恒生指数收益率×10%+中证全债指数收益率×30%"，并修改了本基金的基金合同和托管协议。投资者敬请查阅基金管理人在中国证监会指定媒介发布的有关公告。

前海开源基金管理有限公司

2017年8月28日