前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金

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:交通银行股份有限公司
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。

基金托管人交通银行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	前海开源沪港深核心资源混合	
基金主代码	003304	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年10月17日	
基金管理人	前海开源基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	572,082,326.64份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	前海开源沪港深核心资源混合A	前海开源沪港深核心资源混合C
下属分级基金的交易代码:	003304	003305
报告期末下属分级基金的份额总额	491,386,639.44份	80,695,687.20份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过精选投资于核心资源主题相关证券,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六方面内容: 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。 本基金通过对股票等权益类、债券等固定收益类和现金资产分布的实时监控,根据经济运行周期变动、市场利率变化、市场估值、证券市场变化等因素以及基金的风险评估进行灵活调整。在各类资产中,根据其参与市场基本要素的变动,调整各类资产在基金投资组合中的比例。 2、股票投资策略 (1)核心资源主题相关股票的界定 本基金所称"核心资源"是指能够被企业占有和利用,为企业创造经济价值,进而给企业带来核心竞争力的稀缺资源以及生产或经营条件。以核心资源为主题,本基金将重点配置拥有上述核心资源开发、经营或使用权的上市公司发行的股票。 本基金将在拥有上述核心资源的上市公司中,重点关注具有良好发展潜力的核心资源及拥有该资源开发经营权的上市公司。 (2)核心资源主题相关股票的投资策略 本基金将精选有良好增值潜力的、与核心资源主题相关的上市公司股票构建股票投资组合。 (3)港股通标的股票投资策略 本基金可通过沪港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场,不使用合格境内机构投资者(QDII)境外投资额度进行境外投资。本基金将遵循核心资源主题相关股票的投资策略,优先将基本面健康、业绩向上弹性较大、具有估值优势的港股纳入本基金的股票投资组合。 3、债券投资策略 在债券投资策略方面,本基金将以核心资源主题相关债券为主线,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。 4、权证投资策略 在权证投资方面,本基金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、资产支持证券投资策略 本基金通过对资产支持证券发行条款的分析、违约概率和提前偿付比率的预估,借用必要的数量模型来谋求对资产支持证券的合理定价,在严格控制风险、充分考虑风险补偿收益和市场流动性的条件下,谨慎选择风险调整后收益较高的品种进行投资。 本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资,以降低流动性风险。 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	沪深300指数收益率×70%+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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	傅成斌	陆志俊
	联系电话	0755-88601888	95559
	电子邮箱	qhky@qhkyfund.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		4001666998	95559
传真		0755-83181169	021-62701216

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	前海开源沪港深核心资源混合A	前海开源沪港深核心资源混合C
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)	报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	9,135,280.22	818,460.19
本期利润	14,211,540.79	657,778.15
加权平均基金份额本期利润	0.0313	0.0141
本期基金份额净值增长率	3.51%	3.41%
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	0.0224	0.0217
期末基金资产净值	506,429,944.74	83,112,182.40
期末基金份额净值	1.031	1.030

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。

④ 本基金的基金合同于2016年10月17日生效,截至2017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

前海开源沪港深核心资源混合A

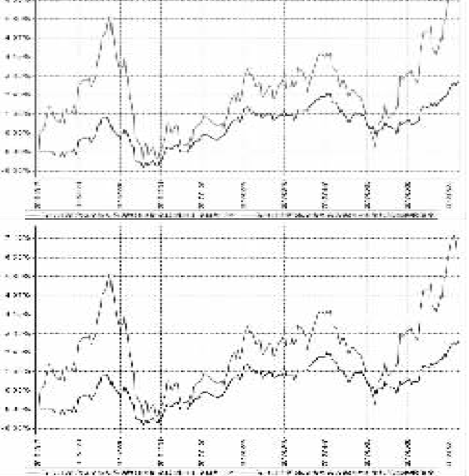
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.68%	0.15%	3.84%	0.47%	-2.16%	-0.32%
过去三个月	1.08%	0.17%	4.30%	0.44%	-3.22%	-0.27%
过去六个月	3.51%	0.17%	7.41%	0.40%	-3.90%	-0.23%
自基金合同生效起至今	3.10%	0.17%	7.45%	0.44%	-4.35%	-0.27%

前海开源沪港深核心资源混合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	1.68%	0.14%	3.84%	0.47%	-2.16%	-0.33%
过去三个月	1.08%	0.17%	4.30%	0.44%	-3.22%	-0.27%
过去六个月	3.41%	0.17%	7.41%	0.40%	-4.00%	-0.23%
自基金合同生效起至今	3.00%	0.17%	7.45%	0.44%	-4.45%	-0.27%

注:本基金业绩比较基准为: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



注:①本基金的基金合同于2016年10月17日生效,截至2017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,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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吴国清	本基金的基金经理	2016年10月17日	-	9年	吴国清先生,清华大学博士研究生。历任南方基金管理有限公司研究员、基金经理助理、投资经理。2015年8月加入前海开源基金管理有限公司。

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

上半年A股市场走出了近似正弦波的走势,年初开始我们主要以持有大盘价值股为主。4月底由于金融监管密集,市场出现大幅回调,我们基于对后续市场走势的乐观判断,在5月初对持仓组合进行了一定调整,将前期主要集中于大盘股的持仓调整为大盘股和中小盘股比例相对均衡的结构。基于历史经验,市场在明显的上升趋势阶段,中小盘股一般更具弹性。从5月下旬市场触底反弹以来,沪深300代表的大盘股和中证500代表的中小盘股表现基本相当。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内,A类基金份额净值增长率为3.51%, 同期业绩比较基准收益率为7.41%;C类基金份额净值增长率为3.41%,同期业绩比较基准收益率为7.41%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为下半年股市震荡走高概率较大,经济基本面全球各大经济体复苏明显,出现黑天鹅事件概率很低。政策层面在十九大召开前,不会有激进的利空政策出台。情绪方面稳步上涨的态势产生赚钱效应后,股市对资金的吸引力将强化。目前股市虽有一定反弹,但估值与历史高点相比仍显著处于底部区域。

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,交通银行股份有限公司(以下称"本托管人")在前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金(以下称"本基金")的托管过程中,严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,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,本托管人根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据真实、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:前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金

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	71,175,838.05	40,868,924.78
结算备付金	1,113,817.40	3,459,207.63
存出保证金	57,981.95	27,610.82
交易性金融资产	564,970,098.28	241,609,727.00
其中:股票投资	141,444,923.05	90,747,623.43
基金投资	-	-
债券投资	319,116,791.10	96,206,299.20
资产支持证券投资	104,408,384.13	54,655,804.37
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	46,000,509.00
应收证券清算款	217,463.89	-
应收利息	7,476,295.97	2,190,729.62
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	645,011,495.54	334,156,708.85
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	54,700,000.00	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	1,987.61
应付管理人报酬	282,727.22	413,558.36
应付托管费	47,121.24	68,926.42
应付销售服务费	5,905.07	13.00
应付交易费用	229,826.66	80,636.04
应交税费	-	-
应付利息	15,227.31	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	188,560.90	55,000.00
负债合计	55,469,368.40	620,121.43
所有者权益:		
实收基金	572,082,326.64	334,857,276.13
未分配利润	17,459,800.50	-1,320,688.71
所有者权益合计	589,542,127.14	333,536,587.42
负债和所有者权益总计	645,011,495.54	334,156,708.85

注:报告截止日2017年6月30日,前海开源沪港深核心资源混合A基金份额净值1.031元,基金份额总额491,386,639.44份,前海开源沪港深核心资源混合C基金份额净值1.030元,基金份额总额80,695,687.20份。

6.2 利润表

会计主体:前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金

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
一、收入	18,074,487.13
1.利息收入	9,097,899.18
其中:存款利息收入	1,081,358.46
债券利息收入	5,968,722.34
资产支持证券利息收入	1,436,414.09
买入返售金融资产收入	611,404.29
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	3,761,159.62
其中:股票投资收益	2,702,376.76
基金投资收益	-
债券投资收益	44,917.17
资产支持证券投资收益	41,843.52
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	972,022.17
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	4,915,578.53
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	299,849.80
减:二、费用	3,205,168.19
1.管理人报酬	1,651,548.35
2.托管费	275,258.08
3.销售服务费	22,804.99
4.交易费用	473,936.99
5.利息支出	572,071.72
其中:卖出回购金融资产支出	572,071.72
6.其他费用	209,548.06
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	14,869,318.94
减:所得税费用	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	14,869,318.94

注:本基金的基金合同于2016年10月17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:前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金

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)	334,857,276.13	-1,320,688.71	333,536,587.42
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	14,869,318.94	14,869,318.94
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)	237,225,050.51	3,911,170.27	241,136,220.78
其中:1.基金申购款	336,432,288.43	5,478,868.80	341,911,157.23
2.基金赎回款	-99,207,237.92	-1,567,698.53	-100,774,936.45
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)	572,082,326.64	17,459,800.50	589,542,127.14

注:本基金的基金合同于2016年10月17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

前海开源沪港深核心资源灵活配置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【2016】965号文《关于准予前海开源沪港深核心资源灵活配置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》、《前海开源沪港深核心资源灵活配置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2016年9月6日至2016年10月13日,首次设立募集不包括认购资金利息共募集260,252,626.81元,经瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)瑞华验字[2016]02230150号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2016年10月17日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为260,287,793.58份基金份额,其中认购资金利息折合35,166.77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,本基金托管人为交通银行股份有限公司。

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》、《前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型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 重要会计政策和会计估计

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补充政策的通知》,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。对基金通过港股通投资香港联交所上市H股取得的股息红利,H股公司按照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	1,175,838.05
定期存款	70,000,000.00
其中:存款期限1-3个月	20,000,000.00
存款期限3个月以上	50,000,000.00
其他存款	-
合计:	71,175,838.05

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		136,988,618.02	141,444,923.05	4,456,305.03
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	191,134,216.74	189,223,791.10	-1,910,425.64
	银行间市场	129,504,006.15	129,893,000.00	388,993.85
	合计	320,638,222.89	319,116,791.10	-1,521,431.79
资产支持证券		104,408,384.13	104,408,384.13	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		562,035,225.04	564,970,098.28	2,934,873.24

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	476.19
应收定期存款利息	409,139.13
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	451.08
应收债券利息	5,432,649.35
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	1,633,580.22
合计	7,476,295.97

注:"其他"为应收结算保证金利息和应收资产支持证券利息。

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	228,539.36
银行间市场应付交易费用	1,287.30
合计	229,826.66

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	-
预提费用	188,560.90
合计	188,560.90

6.4.7.9 实收基金

金额单位:人民币元

前海开源沪港深核心资源混合A

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	334,707,195.07	334,707,195.07
本期申购	215,751,232.14	215,751,232.14
本期赎回(以"-"号填列)	-59,071,787.77	-59,071,787.77
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	491,386,639.44	491,386,639.44

前海开源沪港深核心资源混合C

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	150,081.06	150,081.06
本期申购	120,681,056.29	120,681,056.29
本期赎回(以"-"号填列)	-40,135,450.15	-40,135,450.15
- 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	80,695,687.20	80,695,687.20

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

前海开源沪港深核心资源混合A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	737,892.01	-2,058,006.27	-1,320,114.26
本期利润	9,135,280.22	5,076,260.57	14,211,540.79
本期基金份额交易产生的变动数	1,120,663.23	1,031,215.54	2,151,878.77
其中:基金申购款	1,615,480.47	1,422,198.87	3,037,679.34
基金赎回款	-494,817.24	-390,983.33	-885,800.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,993,835.46	4,049,469.84	15,043,305.30

前海开源沪港深核心资源混合C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	349.10	-923.55	-574.45
本期利润	818,460.19	-160,682.04	657,778.15
本期基金份额交易产生的变动数	933,116.98	826,174.52	1,759,291.50
其中:基金申购款	1,641,155.55	800,033.91	2,441,189.46
基金赎回款	-708,038.57	26,140.61	-681,897.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,751,926.27	664,568.93	2,416,495.20

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	55,944.68
定期存款利息收入	1,002,144.68
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	9,770.54
其他	13,498.56
合计	1,081,358.46

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	165,286,582.89
减:卖出股票成本总额	162,584,206.13
买卖股票差价收入	2,702,376.76

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	44,917.17
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	44,917.17

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	69,032,785.76
减:卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	67,658,153.54
减:应收利息总额	1,329,715.05
买卖债券差价收入	44,917.17

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

单位:人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	21,024,577.71
减:卖出资产支持证券成本总额	20,745,968.49
减:应收利息总额	236,765.70
资产支持证券投资收益	41,843.52

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	972,022.17
基金投资产生的股利收益	-
合计	972,022.17

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	4,915,578.53
——股票投资	5,045,449.94
——债券投资	-129,871.41
——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	4,915,578.53

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	299,830.42
基金转换费收入	19.38
合计	299,849.80

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	471,424.49
银行间市场交易费用	2,512.50
合计	473,936.99

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
律师费	15,000.00
汇划费	8,587.16
债券托管账户维护费	12,400.00
合计	209,548.06

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、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司("交通银行")	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

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

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	1,651,548.35	-
其中:支付销售机构的客户维护费	-	-

注:本基金的管理费按前一日资产净值的0.60%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.60%÷ 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。

本基金于2017年1月19日发布《前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》,自2017年1月19日起,本基金的管理费年费率由1.50%调整为0.60%。

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	275,258.08	-

注:本基金的托管费按前一日资产净值的0.10%年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.10 %÷ 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。

本基金于2017年1月19日发布《前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》,自2017年1月19日起,本基金的托管费年费率由0.25%调整为0.10%。

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 2017年1月1日至2017年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	前海开源沪港深核心资源混合A	前海开源沪港深核心资源混合C	合计
前海开源基金管理有限公司	0.00	22,761.53	22,761.53
合计	0.00	22,761.53	22,761.53
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	前海开源沪港深核心资源混合A	前海开源沪港深核心资源混合C	合计

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0.10%。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类基金资产净值的0.10%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.10% ÷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,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销售服务费划款指令,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。销售服务费由登记机构代收并按照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
交通银行股份有限公司	1,175,838.05	55,944.68	-	-

注:本基金的银行存款由基金托管人交通银行股份有限公司保管,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
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	-
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	-
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	-
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	-
603617	君禾股份	2017年6月23日	2017年7月3日	新股流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-

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
601088	中国神华	2017年6月5日	重大事项	22.29	-	-	22,300	443,755.00	497,067.00	-
002399	海普瑞	2017年4月28日	重大事项	20.23	-	-	23,800	479,855.03	481,474.00	-
600289	亿阳信通	2017年5月10日	重大事项	10.94	2017年8月18日	12.03	31,500	366,886.00	344,610.00	-
600795	国电电力	2017年6月5日	重大资产重组	3.60	-	-	87,500	297,589.33	315,000.00	-
601608	中信重工	2017年4月19日	重大事项	5.54	2017年7月26日	5.26	55,500	310,519.01	307,470.00	-
000061	农产品	2017年6月28日	重大资产出售	9.06	-	-	22,200	196,553.33	201,132.00	-
600468	百利电气	2017年5月16日	重大资产重组	6.50	-	-	28,950	233,553.55	188,175.00	-
300201	海伦哲	2017年2月6日	重大资产重组	8.69	-	-	21,100	172,576.38	183,359.00	-
002013	中航机电	2017年5月12日	重大事项	10.24	2017年8月2日	11.36	15,750	185,640.00	161,280.00	-
002128	露天煤业	2017年3月17日	重大资产重组	8.70	2017年8月14日	9.57	17,700	162,324.05	153,990.00	-
601989	中国重工	2017年5月31日	重大资产重组	6.46	-	-	23,700	151,882.87	153,102.00	-
002252	上海莱士	2017年4月21日	重大事项	20.24	-	-	7,400	160,179.04	149,776.00	-
300085	银之杰	2017年6月30日	非公开发行股票	18.50	2017年7月7日	18.88	7,800	139,144.00	144,300.00	-
002426	胜利精密	2017年1月16日	重大事项	8.06	-	-	15,600	150,148.61	125,736.00	-
002505	大康农业	2017年3月13日	重大资产重组	3.01	-	-	35,300	125,136.52	106,253.00	-
600959	江苏有线	2017年6月19日	重大资产重组	10.57	-	-	7,500	79,252.30	79,275.00	-
000301	东方市场	2017年3月13日	重大资产重组	5.05	-	-	12,700	65,941.08	64,135.00	-
000099	中信海直	2017年5月4日	重大资产重组	11.26	-	-	5,600	65,128.00	63,056.00	-
300267	尔康制药	2017年5月10日	重大事项	11.46	-	-	3,500	48,182.56	40,110.00	-
600609	金杯汽车	2017年3月20日	重大资产重组	8.08	-	-	4,900	37,338.00	39,592.00	-
601919	中远海控	2017年5月17日	重大资产重组	5.35	2017年7月26日	5.89	5,800	30,444.00	31,030.00	-
601872	招商轮船	2017年5月2日	重大事项	5.16	-	-	5,300	28,188.30	27,348.00	-
600460	士兰微	2017年5月12日	重大资产重组	6.07	2017年8月15日	6.68	3,600	22,607.00	21,852.00	-
002358	森源电气	2017年5月12日	重大资产重组	17.02	2017年7月12日	16.68	800	13,889.00	13,616.00	-

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137,470,551.41元,属于第二层次的余额为 427,499,546.87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88,258,541.21元, 属于第二层次的余额为153,351,185.79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	141,444,923.05	21.93
	其中:股票	141,444,923.05	21.93
2	固定收益投资	423,525,175.23	65.66
	其中:债券	319,116,791.10	49.47
	资产支持证券	104,408,384.13	16.19
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	72,289,655.45	11.21
7	其他各项资产	7,751,741.81	1.20
8	合计	645,011,495.54	100.00

注:本基金本报告期末未通过港股通机制投资港股。

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	958,209.00	0.16
B	采矿业	9,250,149.00	1.57
C	制造业	63,887,662.38	10.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,791,816.00	0.64
E	建筑业	4,828,337.22	0.82
F	批发和零售业	5,075,244.90	0.86
G	交通运输、仓储和邮政业	3,995,078.20	0.68
H	住宿和餐饮业	94,850.00	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,303,962.09	1.07
J	金融业	29,738,074.26	5.04
K	房地产业	6,495,665.00	1.10
L	租赁和商务服务业	2,321,355.00	0.39
M	科学研究和技术服务业	148,680.00	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	1,810,868.00	0.31
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	355,712.00	0.06
R	文化、体育和娱乐业	1,484,006.00	0.25
S	综合	905,254.00	0.15
	合计	141,444,923.05	23.99

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未通过港股通机制投资港股。

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	000001	平安银行	245,300	2,303,367.00	0.39
2	002142	宁波银行	107,000	2,065,100.00	0.35
3	601288	农业银行	467,700	1,646,304.00	0.28
4	600036	招商银行	58,600	1,401,126.00	0.24
5	601939	建设银行	216,700	1,332,705.00	0.23
6	600028	中国石化	220,400	1,306,972.00	0.22
7	601166	兴业银行	72,800	1,227,408.00	0.21
8	600015	华夏银行	129,088	1,190,191.36	0.20
9	600000	浦发银行	93,470	1,182,395.50	0.20
10	601857	中国石油	151,900	1,168,111.00	0.20

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	002142	宁波银行	5,956,181.05	1.79
2	000001	平安银行	5,862,735.00	1.76
3	002568	百润股份	1,483,844.00	0.44
4	601939	建设银行	1,447,456.69	0.43
5	601398	工商银行	1,327,004.00	0.40
6	600016	民生银行	1,299,106.00	0.39
7	601818	光大银行	1,288,538.00	0.39
8	600028	中国石化	1,284,502.00	0.39
9	601857	中国石油	1,161,439.00	0.35
10	000778	新兴铸管	1,144,922.00	0.34
11	601998	中信银行	1,134,102.00	0.34
12	600000	浦发银行	1,091,054.00	0.33
13	601009	南京银行	1,084,218.00	0.33
14	000876	新希望	1,046,401.00	0.31
15	600256	广汇能源	1,046,231.00	0.31
16	000761	本钢板材	1,036,984.00	0.31
17	600583	海油工程	1,033,843.80	0.31
18	000776	广发证券	1,030,719.00	0.31
19	600688	上海石化	1,019,660.00	0.31
20	000552	靖远煤电	980,018.93	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	002142	宁波银行	12,581,788.39	3.77
2	000001	平安银行	11,248,751.00	3.37
3	600036	招商银行	3,310,040.90	0.99
4	601318	中国平安	3,245,959.00	0.97
5	601628	中国人寿	3,244,394.42	0.97
6	601288	农业银行	3,160,703.00	0.95
7	601988	中国银行	3,107,232.00	0.93
8	600015	华夏银行	2,974,128.00	0.89
9	601336	新华保险	2,970,262.00	0.89
10	601166	兴业银行	2,728,631.00	0.82
11	601601	中国太保	2,399,566.00	0.72
12	000776	广发证券	1,613,396.00	0.48
13	002302	西部建设	1,588,220.00	0.48
14	000783	长江证券	1,430,312.00	0.43
15	002500	山西证券	1,143,808.00	0.34
16	000166	申万宏源	1,083,531.00	0.32
17	601901	方正证券	981,495.00	0.29
18	000552	靖远煤电	931,021.00	0.28
19	600823	世茂股份	910,265.00	0.27
20	000539	粤电力A	886,521.00	0.27

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	208,236,055.81
卖出股票收入(成交)总额	165,286,582.89

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	28,496,791.10	4.83
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	160,727,000.00	27.26
5	企业短期融资券	100,240,000.00	17.00
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	29,653,000.00	5.03
9	其他	-	-
10	合计	319,116,791.10	54.13

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	112257	15荣盛02	412,960	41,296,000.00	7.00
2	112381	16华联债	400,000	40,268,000.00	6.83
3	136350	16海怡02	400,000	39,728,000.00	6.74
4	011697009	16阳煤SCP010	200,000	20,068,000.00	3.40
5	011761021	17海药SCP001	200,000	20,064,000.00	3.40

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

金额单位:人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	142430	君创A2	300,000	30,000,000.00	5.09
2	116323	万科1A1	250,000	24,999,842.47	4.24
3	142154	国药1优1	200,000	19,902,293.15	3.38
4	116418	万科3A1	150,000	14,881,112.88	2.52
5	142382	花呗12A1	100,000	9,934,394.52	1.69
6	131814	聚信贰A2	100,000	4,690,741.11	0.80

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	57,981.95
2	应收证券清算款	217,463.89
3	应收股利	-
4	应收利息	7,476,295.97
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,751,741.81

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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
前海开源沪港深核心资源混合A	25	19,655,465.58	490,819,089.11	99.88%	567,550.33	0.12%
前海开源沪港深核心资源混合C	218	370,163.70	80,655,171.45	99.95%	40,515.75	0.05%
合计	243	2,354,248.26	571,474,260.56	99.89%	608,066.08	0.11%

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。

8.3 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	前海开源沪港深核心资源混合A	9.80	0.00%
	前海开源沪港深核心资源混合C	1,199.51	0.00%
	合计	1,209.31	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	前海开源沪港深核心资源混合A	前海开源沪港深核心资源混合C
基金合同生效日(2016年10月17日)基金份额总额	260,124,485.86	163,307.72
本报告期期初基金份额总额	334,707,195.07	150,081.06
本报告期基金总申购份额	215,751,232.14	120,681,056.29
减:本报告期基金总赎回份额	59,071,787.77	40,135,450.15
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	491,386,639.44	80,695,687.20

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

本基金管理人于2016年12月14日至2017年1月16日以通讯方式组织召开了本基金的基金份额持有人大会,会议表决通过了《关于调整前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金管理费率、托管费率和赎回费率有关事项的议案》,本基金管理人根据该议案对本基金的基金合同与托管协议进行了修改,并自2017年1月19日起,将本基金的管理费年费率调整为0.60%,托管费年费率调整为0.10%,并调整了A类基金份额的赎回费率,投资人敬请查阅基金管理人刊登在中国证监会指定媒介上的有关公告。

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		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	
中信证券	4	235,400,418.57	63.46%	172,149.37	63.46%	-
光大证券	2	135,569,573.41	36.54%	99,142.00	36.54%	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-

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
中信证券	197,718,102.22	97.10%	724,500,000.00	69.40%	-	-
光大证券	5,903,878.04	2.90%	319,438,000.00	30.60%	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-

§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	20170101-20170630	324,033,100.00	77,525,024.53	59,000,000.00	342,558,124.53	59.88%
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;如果连续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,导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

前海开源基金管理有限公司
2017年8月28日