（上接B62版）

客服电话:4001-099-918,(021)32109999,(029)68918888
网址:www.cfsc.com.cn
54 中山证券有限责任公司
注册地址:深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼7层、8层
办公地址:深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼7层、8层
法定代表人:黄扬录
联系人:刘军
电话:(0755)82943755
传真:(0755)82960582
客服电话:4001-022-011
公司网址:www.zszq.com
55 国金证券股份有限公司
注册地址:四川省成都市东城根上街95号
办公地址:四川省成都市东城根上街95号
法定代表人:冉云
联系人:刘婧漪
电话:028-86690057
传真:028-86690126
客服电话:400-660-0109
网址:www.gjzq.com.cn
56 华宝证券有限责任公司
地址:上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心57层
法定代表人:陈林
联系人:刘阳川
电话:(021)68778790
传真:(021)68777992
客服电话:4008-209-898
网址:www.cnhbstock.com
57 爱建证券有限责任公司
地址:上海市浦东新区世纪大道1600号陆家嘴商务广场32楼
法定代表人:钱华
联系人:士薇
电话:(021)32229888
传真:(021)68728703
客服电话:4001-962-502
网址:www.ajzq.com
58 华融证券股份有限公司
地址:北京市西城区金融大街8号
办公地址:北京市朝阳区朝阳门北大街18号中国人保寿险大厦12层
法定代表人:祝献忠
联系人:李慧灵
联系电话:(010)85556100
传真:(010)85556153
客服电话:400-898-9999
网址:www.hrsec.com.cn
59 大通证券股份有限公司
注册地址:大连市沙河口区会展路129号大连国际金融中心A座大连期货大厦38、39层
办公地址:大连市沙河口区会展路129号大连国际金融中心A座大连期货大厦38、39层
法定代表人:李红光
联系人:谢立军
电话:0411-39991807
传真:0411-82826601
客服电话:4008-169-169
网址:www.daton.com.cn
60 开源证券股份有限公司
注册地址:西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层
办公地址:西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层
法定代表人:李刚
联系人:付琦
电话:(029)81887087
客服电话:400-860-8866
网址:www.kysec.cn
（二）登记机构
名称:前海开源基金管理有限公司
注册地址: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）
办公地址:深圳市福田区深南大道7006号万科富春东方大厦22楼
法定代表人:王兆华
联系人:任福利
电话:（0755）83180910
传真:（0755）83181121
（三）律师事务所和经办律师
名称:广东信达律师事务所
注册地址:深圳市福田区益田路6001号太平金融大厦12楼
负责人:麻云燕
经办律师:杨扬、胡云云
电话:（0755）88265288
传真:（0755）88265537
（四）会计师事务所和经办注册会计师
名称:瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）
注册地址:北京市海淀区西四环中路16号院2号楼4层
办公地址:北京市东城区永定门西滨河路8号院7号楼中海地产广场西塔5-11层
法定代表人:杨剑涛
联系人:胡立新
经办会计师:洪祖柏、胡立新
电话:（010）88095588
传真:（010）88091199

四、基金名称

前海开源一带一路主题精选灵活配置混合型证券投资基金

五、基金的类型

混合型

六、基金的运作方式

开放式

七、基金的投资

（一）投资目标

本基金力图把握“一带一路”战略带来的投资机会，通过主题精选和个股精选，分享“丝绸之路”经济带和“海上丝绸之路”建设所带来的长期投资价值。在严格控制投资风险的前提下，力争获取超越业绩比较基准的稳健收益。

（二）投资范围

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法上市的股票（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（包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、可转换债券等）、资产支持证券、权证、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例范围为0-95%；投资于一路主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的80%；持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的3%；本基金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，应当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。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金参与股指期货交易，应符合法律法规规定和基金合同约定的投资限制并遵守相关期货交易所的业务规则。

（三）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。

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、证券市场发展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

本基金采取自上而下的宏观分析和自下而上精选个股的投资策略，在遵循本基金资产配置比例限制前提下，确定基金在各类资产具体投资比例。

根据国家“一带一路”的相关规划和布局，自上而下重点投资基建、交运、贸易、旅游、文化和金融等相关板块，自下而上精选受益于“一带一路”主题的优质公司，构建核心股票池；再通过本基金已有的个股筛选打分体系，根据模拟组合的资产规模，构建投资组合，其后根据资产规模的变化，投资组合个股数量也会相应进行调整，以期追求超额收益，分享“一带一路”的建设带来的投资价值。

（1）选股策略

本基金采用自上而下与自下而上相结合的选股策略，通过对“一带一路”主题所涉及的基建、交运、贸易、旅游等领域的上市公司进行甄选，精选其中的优质上市公司股票作为投资对象。

（2）个股选择方法

随着“一带一路”战略的推进，中国的相关企业将迎来新的发展机遇，本基金重点挖掘“一带一路”主题相关的优质上市公司股票作为投资标的，力求实现基金资产的长期、持续、稳定增值。具体为以下几个方面：

1）“一带一路”股票池

本基金通过对宏观经济、“一带一路”战略、企业成长能力、估值水平的综合研究分析和判断，以股票的基本面研究为基础，结合市场热点，核心构建“一带一路”核心股票池。

2）“一带一路”股票精选方法

对于进入“一带一路”股票池的股票，本基金管理人将采取自下而上的方法，运用本基金综合评价模型和打分体系，从定性与定量两个角度进行打分，最终筛选出具有较强竞争力的优质上市公司股票，进行估值水平的评估。

A、定性分析

本基金综合评价模型定性分析部分，主要从公司核心竞争力、主营业务成长性、经营管理能力、商业模式、主题相关性等几方面对备选股票进行定性分析。本基金管理人将根据外部报告以及研究员实地调研结果，对备选上市公司的各项指标进行综合判断，并以此作为本基金综合评价模型定性分析的分析结果。

B、定量分析

本基金将定量因素主要归结为收益能力、运营能力、偿债能力和市场地位几大类指标。在此基础上，根据市场关注度与认可度对各指标赋予不同权重进行打分判断。

本基金管理人将上市公司综合评价模型定性分析与定量分析综合评估，根据综合评估打分情况，选取综合评估靠前的上市公司股票进入投资组合。

3）股票组合的构建与定期调整

本基金管理人将以“一带一路”主题涉及的基建、交运、贸易、旅游和文化等领域为主要投资方向，以本基金综合评价模型的评价结果为基础，同时参考如下因素进行股票组合的构建：

A、个股持仓量的政策限制

本基金管理人将根据相关的法律、法规和基金合同等法律文件进行投资，杜绝违法、违规的现象。

B、分散投资和风险控制

本基金管理人参考数量化风险分析结果，确认主动性风险的来源，并将风险分解到各个层面，如资产类别、行业及股票，减少风险集中度，并不断地进行收益—风险最优化测试。

本基金管理人根据市场与上市公司基本面的变化等情况适时调整股票投资组合。

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。在宏观环境分析方面，结合对宏观经济、市场利率、债券供求等因素的综合分析，根据交易所市场与银行间市场类属资产的风险收益特征，定期对投资组合类属资产进行优化配置和调整，确定不同类属资产的最优权重。

在微观市场定价分析方面，本基金以中长期利率趋势分析为基础，结合经济趋势、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，重点选择那些流动性较好、风险水平合理、到期收益率与信用质量相对较高的债券品种。具体投资策略有收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略等积极投资策略构建债券投资组合。

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、股指期货投资策略

本基金以套期保值为目的，参与股指期货交易。

本基金参与股指期货投资时机和数量的决策建立在对证券市场总体行情的判断和组合风险收益分析的基础上。基金管理人将根据宏观经济因素、政策及法规因素和资本市场因素，结合定性和定量方法，确定投资时机。基金管理人将结合股票投资的总体规模，以及中国证监会的相关限定和要求，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。

（四）投资决策依据及程序

1、决策依据

以《基金法》、基金合同、公司章程等有关法律法规为决策依据，并以维护基金份额持有人利益作为最高准则。

2、决策程序

（1）投资决策委员会制定整体投资战略。

（2）研究部根据自身以及其他研究机构的研究成果，构建股票备选库、精选库，对拟投资对象进行持续跟踪调研，并提供个股、债券决策支持。

（3）基金经理根据投资决策委员会的投资战略，设计和调整投资组合。设计和调整投资组合需要考虑的基本因素包括：每日基金申购和赎回净现金流量；基金合同的投资限制和比例限制；研究员的投资建议；基金经理的独立判断；绩效与风险评估小组的建议等。

（4）投资决策委员会对基金经理提交的方案进行论证分析，并形成决策纪要。

（5）根据决策纪要，基金经理小组构造具体的投资组合及操作方案，交由交易部执行。

（6）交易部按有关交易规则执行，并将有关信息反馈基金经理。

（7）基金绩效评估岗及风险管理岗定期进行基金绩效评估，并向投资决策委员会提交综合评估意见和改进方案。

（8）风险控制委员会对识别、防范、控制基金运作各个环节的风险全面负责，尤其重点关注基金投资组合的风险状况；基金绩效评估岗及风险管理岗重点控制基金投资组合的市场风险和流动性风险。

（五）业绩比较基准

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%。

业绩比较基准选择理由：

沪深300指数是由中证指数公司编制发布、表征A股市场走势的权威指数。该指数是由上海和深圳证券市场中选取300只A股作为样本编制而成的成份股指数，其样本覆盖了沪深市场六成左右的市值，具有良好的市场代表性。本基金选择该指数来衡量股票投资部分的绩效。

中证全债指数是中证指数公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数。该指数的样本由银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券组成，中证指数公司每日计算并发布中证全债的收盘指数及相应的债券属性指标。该指数的一个重要特点在于对异常价格和无价情况下使用了模型价，能更为真实地反映债券的实际价值和收益率特征。本基金选择该指数来衡量债券投资部分的绩效。

根据本基金的投资范围和投资比例约束，设定本基金的基准为沪深300指数收益率×70%+中证全债指数收益率×30%，该基准能客观衡量本基金的投资绩效。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时，本基金管理人协商基金托管人后可以在报中国证监会备案以后变更业绩比较基准并及时公告，但不需要召集基金份额持有人大会。

（六）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。

（七）投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金股票投资占基金资产的比例为0-95%；投资于一带一路主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的80%；

（2）本基金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，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；

（3）本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的10%；

（4）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%；

（5）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%；

（6）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的10%；

（7）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%；

（8）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的10%；

（9）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%；

（10）本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；

（11）本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%；

（12）本基金应投资于信用级别评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；

（13）基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

（14）本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%；债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；

（15）本基金持有一家公司发行的流通受限证券，其市值不得超过基金资产净值的3%；本基金持有的所有流通受限证券，其市值不得超过基金资产净值的15%；经基金管理人和基金托管人协商，可对以上比例进行调整；

（16）本基金投资单只中期票据的额度不得超过其发行总额度的10%，并且不得超过基金净值的10%；

（17）本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货约价值不得超过基金资产净值的10%；

（18）本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的95%；其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

（19）本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；本基金管理人应当按照中国金融期货交易所要求的内容、格式与时限向交易所报告所交易和持有的卖出期货合约情况、交易目的及对应的证券资产情况等；

（20）本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

（21）本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%；

（22）本基金总资产不得超过基金净资产的百分之一百四十；

（23）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

基金管理人运用基金财产投资证券衍生品种的，应当根据风险管理的原则，并制定严格的授权管理制度和投资决策流程。基金管理人运用基金财产投资证券衍生品种的具体比例，应当符合中国证监会的有关规定。

本基金在开始进行股指期货投资之前，应与基金托管人就股指期货划款指令、清算、估值、交割等事宜另行具体协商。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

（1）承销证券；

（2）违反规定向他人贷款或者提供担保；

（3）从事承担无限责任的投资；

（4）买卖其他基金份额，但是国务院证券监督管理机构另有规定的除外；

（5）向其基金管理人、基金托管人出资；

（6）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

（7）法律、行政法规和国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

（八）基金管理人代表基金行使股东权利及债权人权利的处理原则及方法

1、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；

2、有利于基金资产的安全与增值；

3、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益；

4、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利，保护基金份额持有人的利益。

（九）基金的融资融券

本基金可以根据有关法律法规和政策的规定进行融资、融券。

（十）基金的投资组合报告

基金管理人的董事会及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责任。

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2015年11月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本投资组合报告所载数据截至2015年9月30日（未经审计）。

1. 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	95,530,308.93	8.36
	其中:股票	95,530,308.93	8.36
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	380,000,000.00	33.26
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	79,586,479.61	6.96
8	其他资产	587,549,005.83	51.42
9	合计	1,142,665,794.37	100.00

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

3.	代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
	A	农、林、牧、渔业	-	-
	B	采矿业	-	-
	C	制造业	71,577,049.88	6.29
	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	23,953,259.05	2.10
	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	95,530,308.93	8.39

3. 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601933	永辉超市	2,359,927	23,953,259.05	2.10
2	603288	海天味业	700,292	21,968,160.04	1.93
3	000768	中航飞机	622,054	13,952,671.22	1.23
4	002415	海康威视	401,959	13,095,824.22	1.15
5	000570	苏常柴A	700,019	6,615,179.55	0.58
6	002013	中航机电	342,996	6,602,673.00	0.58
7	600521	华海药业	271,000	5,989,100.00	0.53
8	600699	均胜电子	139,400	3,349,782.00	0.29
9	600893	中航动力	47	1,920.42	0.00
10	000738	中航动控	77	1,739.43	0.00

4. 报告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。

5. 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

6. 报告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. 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。

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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

9.1 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。

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

10.2 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。

10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

11. 投资组合报告附注

11.1 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。

11.2 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。

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	626,314.53
2	应收证券清算款	586,644,132.33
3	应收股利	-
4	应收利息	218,243.59
5	应收申购款	60,315.38
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	587,549,005.83

11.4 报告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。

11.5 报告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的情况。

11.6 投资组合报告附注的其他说明

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

八、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、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，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

前海开源一带一路主题精选灵活配置混合型证券投资基金

阶段	净值增长率①	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
2015.4.29-2015.9.30	-5.10%	0.28%	-22.31%	2.22%	17.21%	-1.94%

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%。

九、基金的费用与税收

（一）基金费用的种类

1、基金管理人的管理费；

2、基金托管人的托管费；

3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；

4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；

5、基金份额持有人大会费用；

6、基金的证券、期货交易费用；

7、基金的银行汇划费用；

8、证券、期货账户开户费用、银行账户维护费用；

9、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×1.50%÷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

基金管理费每日计提，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，按照指定的账户路径进行资金支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

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

H＝E×0.25%÷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

基金托管费每日计提，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，按照指定的账户路径进行资金支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类中第3－9项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、《基金合同》生效前的相关费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（四）基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。降低基金管理费率、基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照有关规定于新的费率实施日前在指定媒介和基金管理人网站上刊登公告。

（五）基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十、其他应披露事项

（一）本基金管理人的董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在子公司前海开源资产管理（深圳）有限公司（以下简称“前海开源资管公司”）兼职及领薪情况如下：

本基金管理人总经理、董事蔡颖女士兼任前海开源资管公司董事长、法定代表人；

本基金管理人首席运营官、董事会秘书李志祥先生兼任前海开源资管公司董事；

本基金管理人滕大江先生兼任前海开源资管公司监事；

本基金管理人联席投资总监付柏瑞先生兼任前海开源资管公司联席总经理；

本基金管理人专户投资部员工袁自勇、张卫华、陈新、李勇、黄锦良兼任前海开源资管公司投资经理。

上述人员均不在前海开源资管公司领薪。

本基金管理人除上述人员以外未有其他董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在前海开源资管公司兼任职务的情况。

（二）2015年4月29日至2015年10月29日披露的公告：

时间	公告
2015-10-24	前海开源一带一路主题精选灵活配置混合型证券投资基金2015年第3季度报告
2015-10-23	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加中国邮政储蓄银行为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告
2015-10-20	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加积木盒子为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告
2015-10-20	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加北京微动利为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告
2015-10-16	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加大通证券为代销机构并开通转换业务的公告
2015-10-16	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加中经北证为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告
2015-10-16	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加国金证券为代销机构并开通转换业务的公告
2015-10-15	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加盈米财富为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告
2015-09-29	前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金在爱建证券开通转换业务的公告
2015-09-25	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加融金所资管为代销机构并参与其费率优惠活动的公告
2015-09-23	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加新浪仓石为代销机构并参与其费率优惠活动的公告
2015-09-14	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金参与华宝证券费率优惠活动的公告
2015-09-09	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加富济财富为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告
2015-09-09	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加锦安基金为代销机构并参与其费率优惠活动的公告
2015-09-07	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加渤海证券为代销机构并开通转换业务的公告
2015-08-31	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金参加公祿金融费率优惠活动的公告
2015-08-25	前海开源一带一路主题精选灵活配置混合型证券投资基金2015年半年度报告摘要
2015-08-25	前海开源一带一路主题精选灵活配置混合型证券投资基金2015年半年度报告
2015-08-18	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金参与中金公司费率优惠活动的公告
2015-08-13	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金参与泰诚财富费率优惠活动的公告
2015-08-07	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金参加天天基金费率优惠活动的公告
2015-08-07	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金参加数米基金费率优惠活动的公告
2015-08-06	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加钱银财富为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告
2015-08-03	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加长城证券为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告
2015-07-20	前海开源一带一路主题精选灵活配置混合型证券投资基金2015年第3季度报告
2015-07-20	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金在安信证券开通转换业务的公告
2015-07-20	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加恒天明泽为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告
2015-07-14	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加新三板为代销机构并参与其费率优惠活动的公告
2015-07-03	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加中期资产为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告
2015-07-01	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金2015年半年度最后一个交易日基金资产净值、基金份额净值及基金份额累计净值公告
2015-06-30	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金参与交通银行申购费率优惠活动的公告
2015-06-29	前海开源一带一路主题精选灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定投业务的公告
2015-06-29	关于前海开源一带一路主题精选灵活配置混合型证券投资基金参与部分代销机构费率优惠活动的公告
2015-06-26	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加泰诚财富为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告
2015-06-24	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加汇付金融为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告
2015-06-12	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加增财基为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告
2015-06-12	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加中信期货为代销机构及开通定投和转换业务的公告
2015-06-12	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加联泰资产为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告
2015-06-10	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金参与中信建投费率优惠活动的公告
2015-06-10	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加一路财富为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告
2015-05-27	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金参与诺亚正行费率优惠活动的公告
2015-05-23	前海开源基金管理有限公司关于前海开源一带一路主题精选灵活配置混合型证券投资基金增聘基金经理公告
2015-05-19	前海开源基金管理有限公司关于增加华宝证券为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告
2015-05-06	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金参与诺亚正行为代销机构及开通定投业务的公告
2015-05-06	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金参与开源证券费率优惠活动的公告
2015-04-30	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金参与天天基金费率优惠活动的公告
2015-04-30	前海开源一带一路主题精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同生效公告

十一、备查文件

（一）备查文件包括：

1、中国证监会准予注册前海开源一带一路主题精选灵活配置混合型证券投资基金募集的文件

2、《前海开源一带一路主题精选灵活配置混合型证券投资基金募集合同》

3、《前海开源一带一路主题精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

4、法律意见书

5、基金管理人业务资格批件、营业执照

6、基金托管人业务资格批件、营业执照

（二）备查文件的存放地点和投资人查阅方式：

1、存放地点：《基金合同》、《托管协议》存放在基金管理人和基金托管人处；其余备查文件存放在基金管理人处。

2、查阅方式：投资人可在营业时间免费到存放地点查阅，也可按工本费购买复印件。

十二、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《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》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对本基金的招募说明书进行了更新，主要更新的内容如下：

1、对“基金管理人”相关信息进行了更新，包括股权结构、董监高人员信息等。

2、在“相关服务机构”部分，对代销机构名单进行了更新。

3、对“基金的募集”相关信息进行了更新。

4、对“基金合同的生效”相关信息进行了更新。

5、对“基金份额申购与赎回”相关信息进行了更新，包括基金申购费率、开放、定投、转换等。

6、在“基金的投资”部分，增加了“（十）基金的投资组合报告”、“（十一）基金的业绩”相关信息。

7、在“其他应披露事项”部分，披露了本基金管理人董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在子公司前海开源资产管理（深圳）有限公司兼职及领薪情况；披露了2015年4月29日至2015年10月29日期间涉及本