



**前海开源大海洋战略经济灵活配置  
混合型证券投资基金  
招募说明书（更新）摘要  
（2015 年第 2 号）**

基金管理人：前海开源基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

截止日：2015 年 7 月 31 日

## 重要提示

本基金经 2014 年 6 月 4 日中国证券监督管理委员会下发的证监许可[2014]559 号文注册募集，基金合同已于 2014 年 7 月 31 日正式生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资人在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括但不限于：市场风险、信用风险、管理风险、流动性风险、操作和技术风险、合规性风险、本基金特有的风险及其他风险等。

基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金表现的保证。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行承担。投资有风险，投资人在投资本基金前应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。

本招募说明书所载内容截止日为 2015 年 7 月 31 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2015 年 6 月 30 日（未经审计）。

本基金托管人中国建设银行股份有限公司已于 2015 年 8 月 24 日复核了本次更新的招募说明书。

## 一、基金管理人

### （一）基金管理人概况

- 1、名称：前海开源基金管理有限公司
- 2、住所：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）
- 3、成立日期：2013年1月23日
- 4、法定代表人：王兆华
- 5、批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可[2012]1751号
- 6、组织形式：有限责任公司
- 7、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
- 8、电话：0755-88601888 传真：0755-83181169
- 9、联系人：曾季平
- 10、注册资本：人民币2亿元
- 11、存续期限：持续经营
- 12、股权结构：开源证券股份有限公司出资1/4，北京市中盛金期投资管理有限公司出资1/4，北京长和世纪资产管理有限公司出资1/4，深圳市和合投信资产管理合伙企业（有限合伙）出资1/4。

### （二）主要人员情况

#### 1、基金管理人董事会成员

王兆华先生，董事长，本科学历，国籍：中国。历任中国人民银行西安市分行职员，中国工商银行西安市开发区支行副行长、分行信贷处处长，华夏证券西安营业部总经理、华夏证券济南管理总部党委书记兼总经理、华夏证券总裁助理兼重庆分公司党委书记、总经理，华夏证券总裁助理，开源证券董事长兼总经理，现任开源证券总经理、前海开源基金管理有限公司董事长。

王宏远先生，联席董事长，西安交通大学硕士，美国哥伦比亚大学公共管理硕士，国籍：中国。曾任深圳特区证券有限公司行业研究员，南方基金管理有限公司投资总监、副总经理，中信证券股份有限公司首席投资官、自营负责人，现任前海开源基金管理有限公司联席董事长。

蔡颖女士，董事、公司总经理，硕士研究生，国籍：中国。历任南方证券广州分公司营业部电脑部主管、经纪业务部主管、电子商务部副经理，南方基金管理有限公司广州代表处首席代表、南方区域总部高级经理，鹏华基金管理有限公司华南营销中心（广州）副总经理、广州分公司总经理，现任前海开源基金管理有限公司董事会董事、公司总经理、投资决策委员会荣誉主席、风险控制委员会荣誉主席，前海开源资产管理（深圳）有限公司董事长。

孔大路先生，董事，国籍：中国。曾任职华夏银行，中国民生银行总行国际部、信贷部、公司业务部副处长、处长、总经理助理，交通银行天津分行行长助理、副行长等，现任北京市中盛金期投资管理有限公司副董事长。

刘新华先生，董事，高级经济师，博士后，国籍：中国。历任广东证券研究中心负责人、泰阳证券研究中心负责人、广东省广业资产经营公司规划部副部长、华夏基金管理有限公司机构产品部副总监（主持工作）、广东金海资产管理有限公司总经理。

范镭先生，董事，本科学历，国籍：中国。曾任职中国建设银行武汉分行、华安保险北京分公司、交通银行天津分行、北京长和世纪资产管理有限公司投资总监。

向松祚先生，独立董事，教授，高级经济师，国籍：中国。著名经济学家、国际金融战略专家，中国人民大学博士，美国哥伦比亚大学国际关系学院国际事务硕士，英国剑桥大学经济系和嘉丁管理学院访问学者。现任中国农业银行首席经济学家、中国人民大学财政金融学院教授、国际货币研究所理事兼副所长、美国约翰霍普金斯大学应用经济研究所高级顾问、国际货币基金机构官方论坛（OMFIF）顾问委员会副主席、世界经济论坛（World Economic Forum）国际货币体系改革分论坛咨询顾问。

申嫦娥女士，独立董事，博士，教授，博士生导师，中国注册会计师（非执业会员），国家税务总局特邀监察员（2003-2010），国籍：中国。历任西安交通大学助教、讲师、副教授，北京师范大学副教授、教授。

姚树洁先生，独立董事，教授，国籍：英国。英国诺丁汉大学当代中国学院院长、教授，西安交通大学特聘讲座教授、重庆大学、华南师范大学、华南农业大学、华中农业大学、渭南师范学院等大学特聘教授、海南大学经济管理学院荣誉院长；英国皇家经济学会会员、英国中国经济协会会员、美国比较经济学协会会员、美国经济协会会员；全英专业团体联合会副主席；《经济研究》、《西安交通大学学报社科版》、《当代中国》（英文）等科学杂志的编委。曾任华南热带农业大学助理教授，英国牛津大学研究员，英国朴茨茅斯大学教授、主任，英国伦敦米德尔塞克斯大学教授、系主任。

## 2、基金管理人监事会成员

孔令国先生，监事会主席，工商管理硕士，国籍：中国。曾任中信证券股份有限公司交易与衍生品部研究员、投资经理助理、前海开源基金管理有限公司专户投资部投资经理，现任前海开源基金管理有限公司专户投资部副总监。

李东骞先生，监事，美国注册金融分析师（CFA），工学硕士、工商管理硕士，国籍：中国。历任美国前沿（FORE）基金管理有限公司高级经理，中信证券股份有限公司交易与衍生产品业务部副总裁、投资经理助理，现任前海开源基金管理有限公司董事总经理、联席投资总监、前海开源可转债债券型发起式证券投资基金基金经理、前海开源中证军工指数型证券投资基金基金经理。

任福利先生，监事，大学本科学历，国籍：中国。曾任职中国建设银行辽宁省分行、泰

达宏利基金管理有限公司基金运营部、方正富邦基金管理有限公司基金运营部，现任前海开源基金管理有限公司基金事务部总监。

张学玲女士，监事，会计师，国籍：中国。历任武汉大学财务部副部长。

刘纯斌先生，监事，经济学硕士，中国注册会计师、经济师、律师，国籍：中国。历任交通银行深圳分行大信大厦支行行长，深圳市明星康桥投资发展有限公司董事长兼总经理，中诚国际（香港）有限公司副总裁，广东省龙门茶排铅锌矿有限公司财务总监，深圳中金投资管理有限公司财务总监。

### 3、高级管理人员情况

王兆华先生，董事长，本科学历，国籍：中国。历任中国人民银行西安市分行职员，中国工商银行西安市开发区支行副行长、分行信贷处处长，华夏证券西安营业部总经理、华夏证券济南管理总部党委书记兼总经理、华夏证券总裁助理兼重庆分公司党委书记、总经理，华夏证券总裁助理，开源证券董事长兼总经理，现任开源证券总经理、前海开源基金管理有限公司董事长。

蔡颖女士，公司总经理，硕士研究生，国籍：中国。历任南方证券广州分公司营业部电脑部主管、经纪业务部主管、电子商务部副经理，南方基金管理有限公司广州代表处首席代表、南方区域总部高级经理，鹏华基金管理有限公司华南营销中心（广州）副总经理、广州分公司总经理，现任前海开源基金管理有限公司董事会董事、公司总经理、投资决策委员会荣誉主席、风险控制委员会荣誉主席，前海开源资产管理（深圳）有限公司董事长。

李志祥先生，首席运营官，本科学历，经济师，国籍：中国。历任湖北省黄冈市体改委副科长，深圳市农产品股份有限公司秘书科科长，大鹏证券有限责任公司业务秘书，南方基金管理有限公司高级经理，前海开源基金管理有限公司督察长。现任前海开源基金管理有限公司首席运营官、董事会秘书、前海开源资产管理（深圳）有限公司董事。

傅成斌先生，督察长，硕士研究生，国籍：中国。历任中国建设银行深圳分行科技部软件开发工程师，南方基金管理有限公司信息技术部总监助理、监察稽核部副总监、执行总监。现任前海开源基金管理有限公司督察长、风险控制委员会主席。

### 4、本基金基金经理

丁骏先生，经济学博士，国籍：中国。历任中国建设银行浙江省分行国际业务部本外币交易员、经济师，国泰君安证券股份有限公司企业融资部业务经理、高级经理，长盛基金管理有限公司行业研究员、机构理财部组合经理助理，基金同盛、长盛同智基金经理。现任前海开源基金管理有限公司董事总经理、联席投资总监、前海开源大海洋战略经济灵活配置混合型证券投资基金基金经理、前海开源新经济灵活配置混合型证券投资基金基金经理。丁骏先生具备基金从业资格。

### 5、投资决策委员会成员情况

蔡颖女士，公司总经理，硕士研究生，国籍：中国。历任南方证券广州分公司营业部电

脑部主管、经纪业务部主管、电子商务部副经理，南方基金管理有限公司广州代表处首席代表、南方区域总部高级经理，鹏华基金管理有限公司华南营销中心（广州）副总经理、广州分公司总经理，现任前海开源基金管理有限公司董事会董事、公司总经理、投资决策委员会荣誉主席、风险控制委员会荣誉主席，前海开源资产管理（深圳）有限公司董事长。

王厚琼先生，工程学士，国籍：中国。历任南方证券武汉分公司证券部副经理，南方证券有限公司资产管理部副处长，南方基金管理有限公司交易管理部主管、交易管理部总监助理兼中央交易室主管、交易管理部副总监兼中央交易室主管。现任前海开源基金管理有限公司董事总经理、投资决策委员会主席。

赵雪芹女士，经济学博士研究生，国籍：中国。历任山东财经大学讲师、海通证券股份有限公司首席分析师、中信证券股份有限公司首席分析师。现任前海开源基金管理有限公司董事总经理、联席投资总监。

侯燕琳女士，工程硕士、管理学硕士，国籍：中国。历任泰信基金管理有限公司研究部高级研究员、基金经理助理、基金经理；益民基金管理有限公司投资总监、基金经理。现任前海开源基金管理有限公司董事总经理、联席投资总监。

刘静女士，经济学硕士，国籍：中国。历任长盛基金管理有限公司债券高级交易员、基金经理助理、长盛货币市场基金基金经理、长盛全债指数增强型债券投资基金基金经理、长盛积极配置债券投资基金基金经理，现任前海开源基金管理有限公司董事总经理、联席投资总监、前海开源睿远稳健增利混合型证券投资基金基金经理。

丁骏先生，经济学博士，国籍：中国。历任中国建设银行浙江省分行国际业务部本外币交易员、经济师，国泰君安证券股份有限公司企业融资部业务经理、高级经理，长盛基金管理有限公司行业研究员、机构理财部组合经理助理，基金同盛、长盛同智基金经理。现任前海开源基金管理有限公司董事总经理、联席投资总监、前海开源大海洋战略经济灵活配置混合型证券投资基金基金经理、前海开源新经济灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

罗大林先生，工商管理硕士，国籍：中国。历任长盛基金管理有限公司行业研究员、基金经理助理、专户部投资经理，中信证券股份有限公司自营部高级投资经理。现任前海开源基金管理有限公司董事总经理。

付柏瑞先生，硕士，国籍：中国。历任华宝兴业基金管理有限公司分析师；农银汇理基金管理有限公司行业研究员、基金经理助理、基金经理。2009年4月至2014年4月担任农银汇理基金管理公司农银平衡双利基金经理。现任前海开源基金管理有限公司董事总经理、联席投资总监。

李东骞先生，美国注册金融分析师（CFA），工学硕士、工商管理硕士，国籍：中国。历任美国前沿（FORE）基金管理有限公司高级经理，中信证券股份有限公司交易与衍生产品业务部副总裁、投资经理助理，现任前海开源基金管理有限公司董事总经理、联席投资总监、前海开源可转债债券型发起式证券投资基金基金经理、前海开源中证军工指数型证券投资基金



基金经理。

曲扬先生，博士研究生，国籍：中国。历任南方基金管理有限公司研究员、基金经理助理、南方全球精选基金经理，2009年11月至2013年1月担任南方基金香港子公司投资经理助理、投资经理。现任前海开源基金管理有限公司执行投资总监、前海开源优势蓝筹股票型证券投资基金基金经理、前海开源国家比较优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

徐立平先生，工商管理硕士，国籍：中国。历任泰信基金管理有限公司行业研究员，中邮创业基金管理有限公司研究员、基金经理助理。现任前海开源基金管理有限公司执行投资总监、前海开源中国成长灵活配置混合型证券投资基金基金经理、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经理。

薛小波先生，流体力学硕士，国籍：中国。历任中信证券机械行业和军工行业首席分析师、高级副总裁。现任前海开源基金管理有限公司执行投资总监、前海开源中证军工指数型证券投资基金基金经理、前海开源大安全核心精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、前海开源高端装备制造灵活配置混合型证券投资基金基金经理、前海开源工业革命4.0灵活配置混合型证券投资基金基金经理、前海开源中航军工指数分级证券投资基金基金经理、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经理。

邱杰先生，经济学硕士，国籍：中国。历任南方基金管理有限公司研究部行业研究员、中小盘股票研究员、制造业组组长；建信基金管理有限公司研究员。现任前海开源基金管理有限公司执行投资总监、研究负责人、前海开源股息率100强等权重股票型证券投资基金基金经理、前海开源再融资主题精选股票型证券投资基金基金经理、前海开源清洁能源主题精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

王霞女士，会计学硕士，注册会计师，国籍：中国。历任南方基金管理有限公司商业、贸易、旅游行业研究员、房地产行业首席研究员。现任前海开源基金管理有限公司执行投资总监、前海开源沪深300指数型证券投资基金基金经理、前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理。

孙亚超先生，数学科博士后，国籍：中国。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。现任前海开源基金管理有限公司执行投资总监、产品二部负责人；前海开源中证大农业指数增强型证券投资基金基金经理、前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金基金经理、前海开源中证大农业指数分级证券投资基金基金经理。

谢屹先生，金融与经济数学、工程物理学硕士，国籍：德国。历任汇丰银行（德国）股票研究所及投资银行部分析师、高级分析师、副总裁。现任前海开源基金管理有限公司执行投资总监、前海开源金银珠宝主题精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

陈晓晨女士，工商管理硕士，国籍：中国。历任工银瑞信基金管理有限公司交易员、中信证券股份有限公司交易与衍生品部交易员、投资经理助理、前海开源基金管理有限公司交

易部总监，现任前海开源基金管理有限公司投资副总监、前海开源沪深 300 指数型证券投资基金基金经理。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

### （一）基金托管人情况

#### 1、基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司（简称：中国建设银行）

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：王洪章

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人：田青

联系电话：(010)6759 5096

中国建设银行成立于 1954 年 10 月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。中国建设银行于 2005 年 10 月在香港联合交易所挂牌上市（股票代码 939），于 2007 年 9 月在上海证券交易所挂牌上市（股票代码 601939）。于 2014 年末，中国建设银行市值约为 2,079 亿美元，居全球上市银行第四位。

于 2014 年末，本集团资产总额 167,441.30 亿元，较上年增长 8.99%；客户贷款和垫款总额 94,745.23 亿元，增长 10.30%；客户存款总额 128,986.75 亿元，增长 5.53%。营业收入 5,704.70 亿元，较上年增长 12.16%；其中，利息净收入增长 12.28%，净利息收益率（NIM）2.80%；手续费及佣金净收入占营业收入比重为 19.02%；成本收入比为 28.85%。利润总额 2,990.86 亿元，较上年增长 6.89%；净利润 2,282.47 亿元，增长 6.10%。资本充足率 14.87%，不良贷款率 1.19%，拨备覆盖率 222.33%。

客户基础进一步夯实，全年公司机构有效客户和单位人民币结算账户分别新增 11 万户和 68 万户，个人有效客户新增 1,188 万户。网点“三综合”覆盖面进一步扩大，综合性网点达到 1.37 万个，综合柜员占比达到 80%，综合营销团队 1.75 万个，网点功能逐步向客户营销平台、体验平台和产品展示平台转变。深化网点柜面业务前后台分离，全行超过 1.45 万个营业网点 30 类柜面实时性业务产品实现总行集中处理，处理效率提高 60%。总分行之



间、总分行与子公司之间、境内外以及各分行之间的业务联动和交叉营销取得重要进展，集团综合性、多功能优势逐步显现。

债务融资工具累计承销 3,989.83 亿元，承销额连续四年同业排名第一。以“养颐”为主品牌的养老金融产品体系进一步丰富，养老金受托资产规模、账户管理规模分别新增 188.32 亿元和 62.34 万户。投资托管业务规模增幅 38.06%，新增证券投资基金托管只数和首发份额市场领先。跨境人民币客户数突破 1 万个、结算量达 1.46 万亿元。信用卡累计发卡量 6,593 万张，消费交易额 16,580.81 亿元，多项核心指标同业第一。私人银行业务持续推进，客户数量增长 14.18%，金融资产增长 18.21%。

2014年，本集团各方面良好表现，得到市场与业界广泛认可，先后荣获国内外知名机构授予的100余项重要奖项。在英国《银行家》杂志2014年“世界银行1000强排名”中，以一级资本总额位列全球第2；在英国《金融时报》全球500强排名第29位，新兴市场500强排名第3位；在美国《福布斯》杂志2014年全球上市公司2000强排名中位列第2；在美国《财富》杂志世界500强排名第38位。此外，本集团还荣获国内外重要媒体评出的诸多重要奖项，覆盖公司治理、社会责任、风险管理、公司信贷、零售业务、投资托管、债券承销、信用卡、住房金融和信息科技等多个领域。

中国建设银行总行设投资托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII 托管处、养老金托管处、清算处、核算处、监督稽核处等 9 个职能处室，在上海设有投资托管服务上海备份中心，共有员工 220 余人。自 2007 年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

## 2、主要人员情况

赵观甫，投资托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行郑州市分行、总行信贷部、总行信贷二部、行长办公室工作，并在中国建设银行河北省分行营业部、总行个人银行业务部、总行审计部担任领导职务，长期从事信贷业务、个人银行业务和内部审计等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部，长期从事大客户的客户管理及服务工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行总行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室，长期从事零售业务和个人存款业务管理工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张力铮，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行建筑经济部、信贷二部、信贷部、信贷管理部、信贷经营部、公司业务部，并在总行集团客户部和中国建设银行北京市分行担任领导职务，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业

务管理经验。

黄秀莲，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

### 3、基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2015 年 6 月末，中国建设银行已托管 514 只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行自 2009 年至今连续五年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”。

## （二）基金托管人的内部控制制度

### 1、内部控制目标

作为基金托管人，中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

### 2、内部控制组织结构

中国建设银行设有风险与内控管理委员会，负责全行风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。投资托管业务部专门设置了监督稽核处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，具有独立行使监督稽核工作职权和能力。

### 3、内部控制制度及措施

投资托管业务部具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理严格实行复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

## （三）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

### 1、监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的“托管业务综合系统——基金监督子系统”，严格按照现行法律法规以及基金合同

规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督，并定期编写基金投资运作监督报告，报送中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

## 2、监督流程

（1）每工作日按时通过基金监督子系统，对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控，发现投资比例超标等异常情况，向基金管理人发出书面通知，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，并及时报告中国证监会。

（2）收到基金管理人的划款指令后，对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。

（3）根据基金投资运作监督情况，定期编写基金投资运作监督报告，对各基金投资运作的合法合规性、投资独立性和风格显著性等方面进行评价，报送中国证监会。

（4）通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求基金管理人进行解释或举证，并及时报告中国证监会。

## 三、相关服务机构

### （一）基金份额销售机构

#### 1、直销机构

（1）前海开源基金管理有限公司直销柜台

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：曾季平

电话：（0755）83181190

传真：（0755）83180622

（2）前海开源基金管理有限公司网上交易

客户服务电话：4001-666-998

网址：www.qhkyfund.com

#### 2、代销机构：

序号	代销机构名称	代销机构信息
----	--------	--------

1	中国建设银行股份有限公司	注册地址：北京市西城区金融大街 25 号 办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼 法定代表人：王洪章 电话：(010)66275654 传真：(010)66275654 联系人：张静 客服电话：95533 网址：www.ccb.com
2	中国农业银行股份有限公司	注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号 办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 法定代表人：刘士余 联系人：牛峰 电话：(010)85108223 传真：(010)85109219 客服电话：95599 网址：www.abchina.com
3	中国工商银行股份有限公司	注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号 办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号 法定代表人：姜建清 联系人：杨菲 传真：(010)66107910 客服电话：95588 网址：www.icbc.com.cn
4	交通银行股份有限公司	办公地址：上海市银城中路 188 号 法定代表人：牛锡明 联系人：曹榕 联系电话：(021)58781234 客服电话：95559 网址：www.bankcomm.com
5	北京银行股份有限公司	注册地址：北京市西城区金融大街甲 17 号首层 法定代表人：闫冰竹 联系人：王曦 联系电话：(010) 66223584 客服电话：95526 网址：www.bankofbeijing.com.cn
6	深圳市新兰德证券投资咨询有限公司	注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006# 办公地址：北京市西城区金融大街 35 号 国际企业大厦 C 座 9 层 邮政编码：518028 法定代表人：杨懿 联系人：张燕 电话：010-58325388-1588 传真：010-58325300 客服电话：400-116-1188 网址：http://8.jrj.com.cn/
7	和讯信息科技有限公司	地址：北京朝外大街 22 号泛利大厦 10 层 法定代表人：王莉 联系人：于杨 电话：(021)20835779 客服电话：4009-200-022 网址：www.hexun.com

8	诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司	注册地址：上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室 办公地址：上海市杨浦区昆明路508号北美广场B座12F 法定代表人：汪静波 联系人：徐诚 电话：(021)38509639 传真：(021)38509777 客服电话：400-821-5399 网址：www.noah-fund.com
9	深圳众禄基金销售有限公司	地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼 法定代表人：薛峰 联系人：童彩平 电话：(0755)33227950 客服电话：4006-788-887 网址：www.zlfund.cn, www.jjmmw.com
10	上海天天基金销售有限公司	地址：上海市徐汇区龙田路195号3C座7楼 法定代表人：其实 客服电话：4001-818-188 网址：www.1234567.com.cn
11	上海好买基金销售有限公司	地址：上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号 法定代表人：杨文斌 客服电话：400-700-9665 网址：www.ehowbuy.com
12	杭州数米基金销售有限公司	地址：浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼 法定代表人：陈柏青 联系人：徐映绯 电话：(021)60897840 传真：(0571)26697013 客服电话：4000-766-123 网址：www.fund123.cn
13	上海长量基金销售投资顾问有限公司	地址：上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层 法定代表人：张跃伟 电话：(021)20691832 传真：(021)20691861 客服电话：400-820-2899 网址：www.erichfund.com
14	浙江同花顺基金销售有限公司	注册地址：浙江省杭州市文二西路元茂大厦903室 办公地址：浙江省杭州市翠柏路7号杭州电子商务产业园2号楼2楼 法定代表人：凌顺平 联系人：吴强 电话：(0571)88911818 传真：(0571)88910240 客服电话：4008-773-772 网址：www.5ifund.com
15	北京展恒基金销售有限公司	注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街6号 办公地址：北京市朝阳区华严北里2号民建大厦6层 法定代表人：闫振杰 联系人：王琳 电话：010-62020088 传真：010-62020355 客服电话：400-888-6661 网址：www.myfund.com



16	中期资产管理有限公司	地址：北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢11层1103号 法定代表人：朱剑林 客服电话：(010)65807609 网址：www.cifcofund.com
17	万银财富（北京）基金销售有限公司	注册地址：北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼3201内3201单元 办公地址：北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼3201内3201单元 法定代表人：王斐 电话：(010)59393923 传真：(010)59393074 客服电话：4008-080-069 网址：www.wy-fund.com
18	北京增财基金销售有限公司	注册地址：北京市西城区南礼士路66号1号楼12层1208号 办公地址：北京市西城区南礼士路66号1号楼12层1208号 法定代表人：罗细安 联系人：李皓 电话：010-67000988 传真：010-67000988-6000 客服电话：400-001-8811 网址：www.zcvc.com.cn
19	北京恒天明泽基金销售有限公司	注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室 办公地址：北京市朝阳区东三环中路20号乐成中心A座23层 法定代表人：梁越 联系人：马鹏程 电话：010-57756084 传真：010-57756199 客服电话：4008-980-618 网址：www.chtfund.com
20	深圳前海汇联基金销售有限公司	地址：深圳福田区金田路2028号皇岗商务中心4楼 法定代表人：丁海 联系人：张誉腾 电话：(0755)32938888-6200 客服电话：(0755)36907366 网址：www.flyingfund.com.cn
21	一路财富（北京）信息科技有限公司	注册地址：北京市西城区车公庄大街9号五栋大楼C座702室 办公地址：北京市西城区阜成门外大街2号万通新世界广场A座2208 法定代表人：吴雪秀 联系人：段京璐 电话：010-88312877 传真：010-88312099 客服电话：400-001-1566 网址：www.yilucaifu.com

22	泰诚财富基金销售（大连）有限公司	地址：辽宁省大连市沙河口区星海中路3号 法定代表人：林卓 联系人：李春光 电话：18640999991 传真：0411-84396536 客服电话：400-6411-999 网址：www.taichengcaifu.com
23	上海汇付金融服务有限公司	办公地址：上海市中山南路100号金外滩国际广场19楼 法定代表人：张晶 电话：021-33323999-8318 客服电话：400-820-2819 网址：www.ttyfund.com
24	中国国际期货有限公司	注册地址：北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢1层、2层、9层、11层、12层 办公地址：北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢1层、2层、9层、11层、12层 法定代表人：王兵 联系电话：(010)59539999 传真：(010)59539806 客服电话：95162 网址：www.cifco.net
25	国泰君安证券股份有限公司	地址：上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼 法定代表人：万建华 联系人：芮敏祺 电话：(021)38676666 传真：(021)38670666 客服电话：95521 网址：www.gtja.com
26	中信建投证券股份有限公司	注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼 办公地址：北京市朝内大街188号 法定代表人：王常青 联系人：张颢 电话：(010)85156398 传真：(010)65182261 客服电话：4008-888-108 网址：www.csc108.com
27	国信证券股份有限公司	注册地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16-26层 法定代表人：何如 联系人：周杨 电话：(0755)82130833 传真：(0755)82133952 客服电话：95536 网址：www.guosen.com.cn
28	中信证券股份有限公司	注册地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座 办公地址：北京朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦 法定代表人：王东明 联系人：顾凌 联系电话：(010)60838696 客服电话：95548 网址：www.cs.ecitic.com

29	中国银河证券股份有限公司	地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座 法定代表人：陈有安 联系人：宋明 联系电话：(010)66568450 传真：(010)66568990 客服电话：4008-888-888 网址：www.chinastock.com.cn
30	海通证券股份有限公司	注册地址：上海市广东路 689 号 办公地址：上海市广东路 689 号 法定代表人：王开国 联系人：李笑鸣 联系电话：(021)23219000 客服电话：95553 网址：www.htsec.com
31	申万宏源证券有限公司	注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层 办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层 法定代表人：李梅 联系人：曹晔 电话：(021) 33389888 传真：(021) 33388224 电话委托：(021)962505 客服电话：95523，4008-895-523 网址：www.swhysc.com
32	安信证券股份有限公司	注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 楼、28 层 A02 单元 办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 楼、28 层 A02 单元 法定代表人：牛冠兴 联系电话：(0755)82555551 客服电话：4008-001-001 网址：www.essence.com.cn
33	中信证券（浙江）有限责任公司	注册地址：浙江省杭州市解放东路 29 号迪凯银座 22、23 层 办公地址：浙江省杭州市解放东路 29 号迪凯银座 22、23 层 法定代表人：沈强 联系人：李珊 电话：(0571)85776114 客服电话：95548 网址：www.bigsun.com.cn
34	万联证券有限责任公司	地址：广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 座 18、19 楼 法定代表人：张建军 客服电话：4008-888-133 网址：www.wlzq.com.cn
35	国元证券股份有限公司	地址：安徽合肥寿春路 179 号 法定代表人：蔡咏 联系人：李蔡 电话：(0551)68167423 传真：(0551)68167421 客服电话：95578 网址：www.gyzq.com.cn

36	山西证券股份有限公司	地址：山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼 法定代表人：侯巍 客服电话：400-666-1618、95573 网址：www.i618.com.cn
37	中信证券（山东）有限责任公司	注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001 办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层 法定代表人：杨宝林 联系人：吴忠超 电话：(0532)85022326 客服电话：95548 网址：www.zxwt.com.cn
38	东兴证券股份有限公司	地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12、15 层 法定代表人：魏庆华 联系人：汤漫川 电话：(010)66555316 客服电话：4008-888-993 网址：www.dxzq.net
39	信达证券股份有限公司	地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼 法定代表人：张志刚 联系人：唐静 电话：(010)63080985 客服电话：4008-008-899 网址：www.cindasc.com
40	光大证券股份有限公司	地址：上海市静安区新闻路 1508 号 法定代表人：薛峰 联系人：刘晨 电话：(021)22169081 客服电话：95525 传真：(021)22169134 网址：www.ebscn.com
41	大同证券有限责任公司	注册地址：大同市城区迎宾街 15 号桐城中央 21 层 办公地址：山西省太原市长治路 111 号山西世贸中心 A 座 12、13 层 法定代表人：董祥 联系人：薛津 联系电话：(0351) 4130322 客服电话：4007-121-212 网址：www.dtsbc.com.cn
42	华安证券股份有限公司	注册地址：合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号 办公地址：合肥市蜀山区南二环路 959 号财智中心华安证券 B1 座 0327 室（230081） 法定代表人：李工 联系人：甘霖 电话：(0551)65161821 传真：(0551)65161672 客服电话：4008-096-518 公司网址：www.hazq.com

43	国海证券股份有限公司	注册地址：广西壮族自治区桂林市辅星路 13 号 办公地址：广西壮族自治区南宁市滨湖路 46 号国海大厦 法定代表人：何春梅 电话：(0755)82047857 传真：(0755)82835785 客服电话：95563 电话委托：95563 网址：www.ghzq.com.cn
44	东莞证券股份有限公司	地址：广东省东莞市莞城区可园南路一号金源中心 法定代表人：张运勇 客服电话：(0769) 961130 网址：www.dgzq.com.cn
45	申万宏源西部证券有限公司	注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室 办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室 法定代表人：许建平 电话：(010)88085858 传真：(010)88085195 联系人：李巍 客服电话：400-800-0562 网址：www.hysec.com
46	齐鲁证券有限公司	地址：山东省济南市经七路 86 号 法定代表人：李玮 联系人：吴阳 电话：(0531)68889155 客服电话：95538 网址：www.qlzq.com.cn
47	中国国际金融股份有限公司	地址：北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27、28 层 法定代表人：丁学东 客服电话：400-910-1166 网址：www.cicc.com.cn
48	华鑫证券有限责任公司	地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01（b）单元 法定代表人：俞洋 联系人：陈敏 电话：(021)64316642 客服电话：(021)32109999，(029)68918888，4001-099-918 网址：www.cfsc.com.cn
49	中国中投证券有限责任公司	地址：深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 04、18 层至 21 层 法定代表人：龙增来 联系人：刘毅 联系电话：(0755)82023442 客服电话：95532，4006-008-008 网址：www.china-invs.cn



50	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大厦 7 层、8 层 办公地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新大厦 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
51	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：刘闻川 电话：(021)68778790 传真：(021)68777992 客服电话：4008-209-898 公司网址：www.cnhbstock.com
52	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：戴莉丽 电话：(021)32229888 传真：(021)62878783 客服电话：4001-962-502 网址：www.ajzq.com
53	华融证券股份有限公司	地址：北京市西城区金融大街 8 号 A 座 3 层 法定代表人：祝献忠 联系人：黄恒 联系电话：(010)58568235 传真：(010)58568062 客服电话：400-898-9999 网址：www.hrsec.com.cn
54	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
55	上海联泰资产管理有限公司	注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室 办公地址：上海市长宁区金钟路 658 弄 2 号楼 B 座 6 楼 联系人：汤蕾 电话：021-51507071 传真：021-62990063 客服电话：4000-466-788 网址：www.91fund.com.cn

56	中信期货有限公司	地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层 法定代表人：张磊 联系人：洪诚 电话：0755-23953913 客服电话：400-990-8826 网址：www.citicsf.com
57	长城证券股份有限公司	注册地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦16、17层 办公地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层 法定代表人：黄耀华 联系人：刘阳 电话：0755-83516289 传真：0755-83515567 客服电话：400-666-6888 网址：www.cgws.com
58	北京钱景财富投资管理有限公司	注册地址：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012 办公地址：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012 法定代表人：赵荣春 联系人：高静 电话：010-59158282 传真：010-57569671 客服电话：400-893-6885 网址：www.qianjing.com

## （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、卢华羽

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

前海开源大海洋战略经济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

本基金主要通过精选投资与大海洋战略经济相关的优质证券，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。

大海洋战略是一个囊括了海洋经济发展、海洋科技进步、海洋环境保护、海上安全保障、国家安全以及海洋相关服务业发展的总体方略。大海洋战略经济是指在大海洋战略方针政策指导下的相关产业和经济领域，包括国防军工、海洋装备制造、信息安全、海洋运输、海洋油气、海洋生物医药、海水淡化综合利用、海洋新能源开发利用以及旅游等经济领域。

### （二）投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、权证、股指期货以及经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:本基金股票投资占基金资产的比例范围为0-95%,投资于大海洋战略经济主题相关证券不低于非现金基金资产的80%。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**

本基金将精选有良好增值潜力的、与大海洋战略经济主题相关的上市公司股票构建股票投资组合。大海洋战略经济股票投资策略将从定性和定量两方面入手,定性方面主要考察上市公司所属行业发展前景、行业地位、竞争优势、管理团队、创新能力等多种因素;定量方面考量公司估值、资产质量及财务状况,比较分析各优质上市公司的估值、成长及财务指标,优先选择具有相对比较优势的公司作为最终股票投资对象。

#### **3、债券投资策略**

在债券投资策略方面,本基金将以大海洋战略经济相关债券为主线,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。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

本基金将权证的投资作为提高基金投资组合收益的辅助手段。根据权证对应公司基本面研究成果确定权证的合理估值，发现市场对股票权证的非理性定价；利用权证衍生工具的特性，通过权证与证券的组合投资，来达到改善组合风险收益特征的目的。

#### 5、股指期货投资策略

本基金以套期保值为目的，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，交由集中交易室执行。

(6) 集中交易室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交易所中选取 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范围为 0-95%，投资于大海洋战略经济主题相关证券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) 本基金持有一家上市公司的股票，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上市公司发行的证券，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) 本基金投资流通受限证券，基金管理人应事先根据中国证监会相关规定，与基金托管人在本基金托管协议中明确基金投资流通受限证券的比例，根据比例进行投资。基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险；

(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合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）比例为 0-95%；

（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）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。

本基金在进行股指期货投资之前，应与基金托管人就股指期货清算、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。

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。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，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

## 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年8月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现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6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	406,618,758.41	72.23
	其中：股票	406,618,758.41	72.23
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	155,541,948.34	27.63
7	其他资产	784,790.30	0.14
8	合计	562,945,497.05	100.00

#### 2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	12,869,534.08	2.93
B	采矿业	16,247,863.64	3.70

C	制造业	250,737,418.27	57.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,706,000.00	3.13
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	12,387,500.00	2.82
G	交通运输、仓储和邮政业	15,660,336.00	3.57
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,111,500.00	2.31
J	金融业	30,865,976.30	7.04
K	房地产业	24,776,624.67	5.65
L	租赁和商务服务业	6,951,356.10	1.58
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	12,304,649.35	2.81
S	综合	-	-
	合计	406,618,758.41	92.71

### 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	000768	中航飞机	712,521	31,051,665.18	7.08
2	000880	潍柴重机	784,000	16,895,200.00	3.85
3	600056	中国医药	651,500	15,857,510.00	3.62
4	600487	亨通光电	405,600	14,926,080.00	3.40
5	600302	标准股份	1,148,821	14,038,592.62	3.20
6	600521	华海药业	448,300	14,009,375.00	3.19
7	600675	中华企业	1,208,875	13,672,376.25	3.12
8	000930	中粮生化	693,400	13,070,590.00	2.98
9	600048	保利地产	972,351	11,104,248.42	2.53
10	600643	爱建股份	657,280	10,996,294.40	2.51

### 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

本基金本报告期末投资股指期货。

#### 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

本基金本报告期末投资国债期货。

##### 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

本基金本报告期末投资国债期货。

#### 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	601,876.18
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	16,599.01
5	应收申购款	166,315.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	784,790.30



#### 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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600643	爱建股份	10,996,294.40	2.51	重大事项

#### 11.6 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。

## 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。

#### 前海开源大海洋战略经济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
2014.7.31-2014.12.31	25.30%	1.25%	35.34%	0.98%	-10.04%	0.27%
2015.1.1-2015.6.30	35.59%	1.96%	19.83%	1.58%	15.76%	0.38%
2014.7.31-2015.6.30	69.90%	1.66%	62.17%	1.34%	7.73%	0.32%

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、基金的证券交易费用；

- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、证券账户开户费用、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：

$$H=E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

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。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。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：

$$H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。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

- 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体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项纳税主体，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龚自勇、张卫华、陈新、李隽、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1月31日至2015年7月31日披露的公告：

时间	公告
2015-07-20	前海开源大海洋战略经济灵活配置混合型证券投资基金 2015 年第 2 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兰德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
2015-06-26	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金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并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
2015-06-02	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金参与中国农业银行申购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

2015-05-06	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加诺亚正行为代销机构并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
2015-04-23	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金参加众禄基金费率优惠活动的公告
2015-04-22	前海开源大海洋战略经济灵活配置混合型证券投资基金 2015 年第 1 季度报告
2015-04-18	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加展恒基金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
2015-04-04	前海开源基金管理有限公司关于转换业务实行申购补差费率在直销机构新增支付渠道优惠的公告
2015-03-30	前海开源基金管理有限公司关于旗下证券投资基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告
2015-03-30	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金继续参与中国工商银行申购费率优惠活动的公告
2015-03-27	前海开源大海洋战略经济灵活配置混合型证券投资基金 2014 年年度报告摘要
2015-03-27	前海开源大海洋战略经济灵活配置混合型证券投资基金 2014 年年度报告
2015-03-25	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金在申万宏源证券、申万宏源西部证券开通定投业务并参与其费率优惠活动的公告
2015-03-16	前海开源大海洋战略经济灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2015 年第 1 号）
2015-02-16	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金在东莞证券、国海证券开通基金转换业务的公告
2015-02-10	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金参与中国国际金融申购费率优惠活动的公告

## 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大海洋战略经济灵活配置混合型证券投资基金募集的文件

2、《前海开源大海洋战略经济灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

3、《前海开源大海洋战略经济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，对本基金的原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、对“基金托管人”相关信息进行了更新。
- 3、在“相关服务机构”部分，对代销机构名单进行了更新。
- 4、在“基金份额的申购与赎回”部分，对投资人通过基金管理人网上交易系统申购本基金的申购费率进行了更新。
- 5、在“基金的投资”部分，更新了“（十）基金的投资组合报告”、“（十一）基金的业绩”相关信息。
- 6、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1月31日至2015年7月31日期间涉及本基金的公告。
- 7、对部分表述进行了更新。

前海开源基金管理有限公司

二〇一五年九月十二日