

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 2016 年半年度报告摘要

2016 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：2016 年 8 月 29 日

§ 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 2016 年 8 月 25 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 2016 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	前海开源一带一路混合	
基金主代码	001209	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 4 月 29 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	518,801,815.00 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	前海开源一带一路混合 A	前海开源一带一路混合 C
下属分级基金的交易代码:	001209	002080
报告期末下属分级基金的份额总额	518,798,821.50 份	2,993.50 份

2.2 基金产品说明

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。
投资策略	<p>本基金的投资策略主要有以下五方面内容：</p> <p>1、大类资产配置</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>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。</p> <p>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额度，构建投资组合，其后根据资产额度的变化，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。</p> <p>(1) 选股策略</p>

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。

	<p>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。</p> <p>4、权证投资策略</p> <p>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。</p> <p>5、股指期货投资策略</p> <p>本基金以套期保值为目的，参与股指期货交易。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
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，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。

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
	联系电话	0755-88601888
	电子邮箱	qhky@qhkyfund.com
客户服务电话	4001666998	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

基金级别	前海开源一带一路混合 A	前海开源一带一路混合 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	23,719,683.32	3,165,617.17
本期利润	51,415,353.14	-3,093,119.89
加权平均基金份额本期利润	0.0758	-0.0059
本期基金份额净值增长率	8.87%	13.39%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)	
期末可供分配基金份额利润	-0.0043	0.0867
期末基金资产净值	541,066,206.53	3,398.40
期末基金份额净值	1.043	1.135

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

前海开源一带一路混合 A

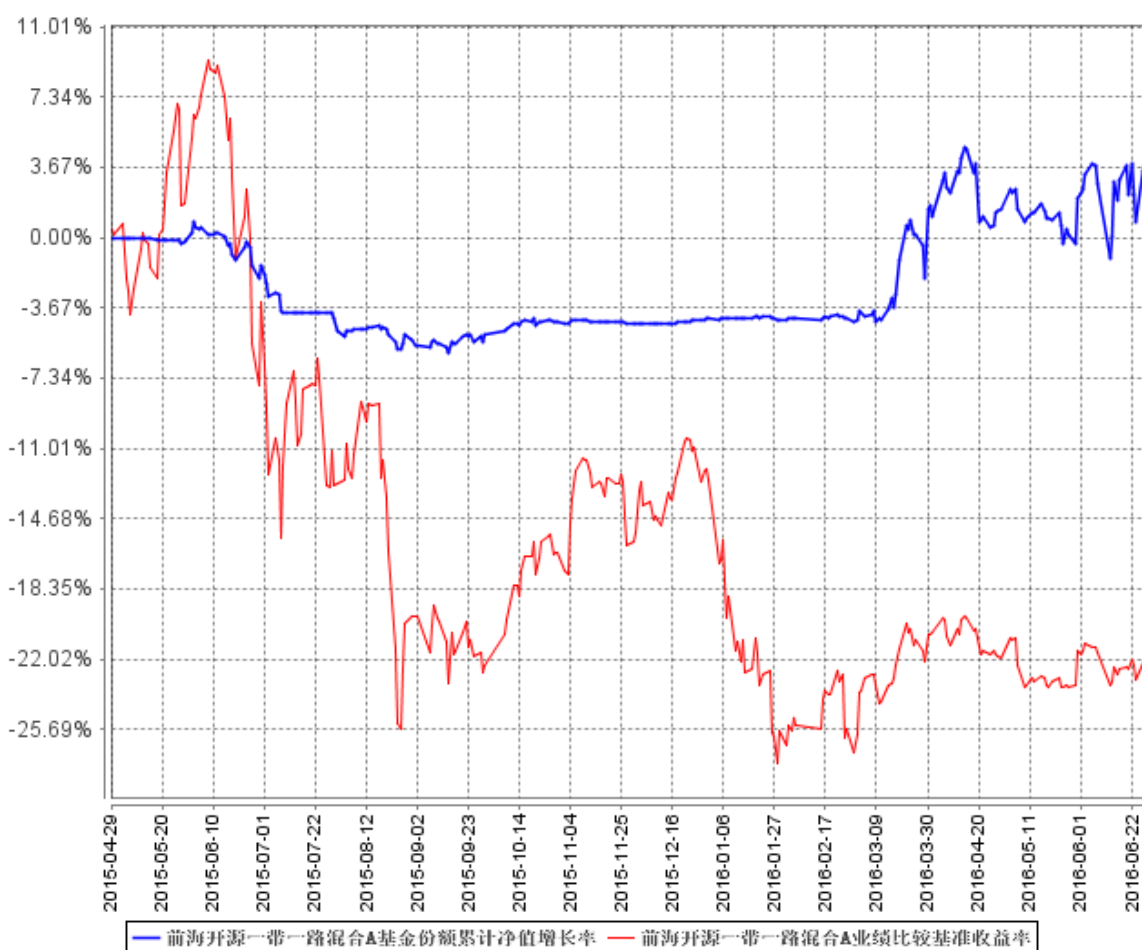
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.15%	1.54%	-0.11%	0.69%	2.26%	0.85%
过去三个月	2.56%	1.11%	-1.23%	0.71%	3.79%	0.40%
过去六个月	8.87%	0.92%	-10.27%	1.29%	19.14%	-0.37%
过去一年	5.89%	0.66%	-18.94%	1.61%	24.83%	-0.95%
自基金合同生效起至今	4.30%	0.62%	-21.65%	1.68%	25.95%	-1.06%

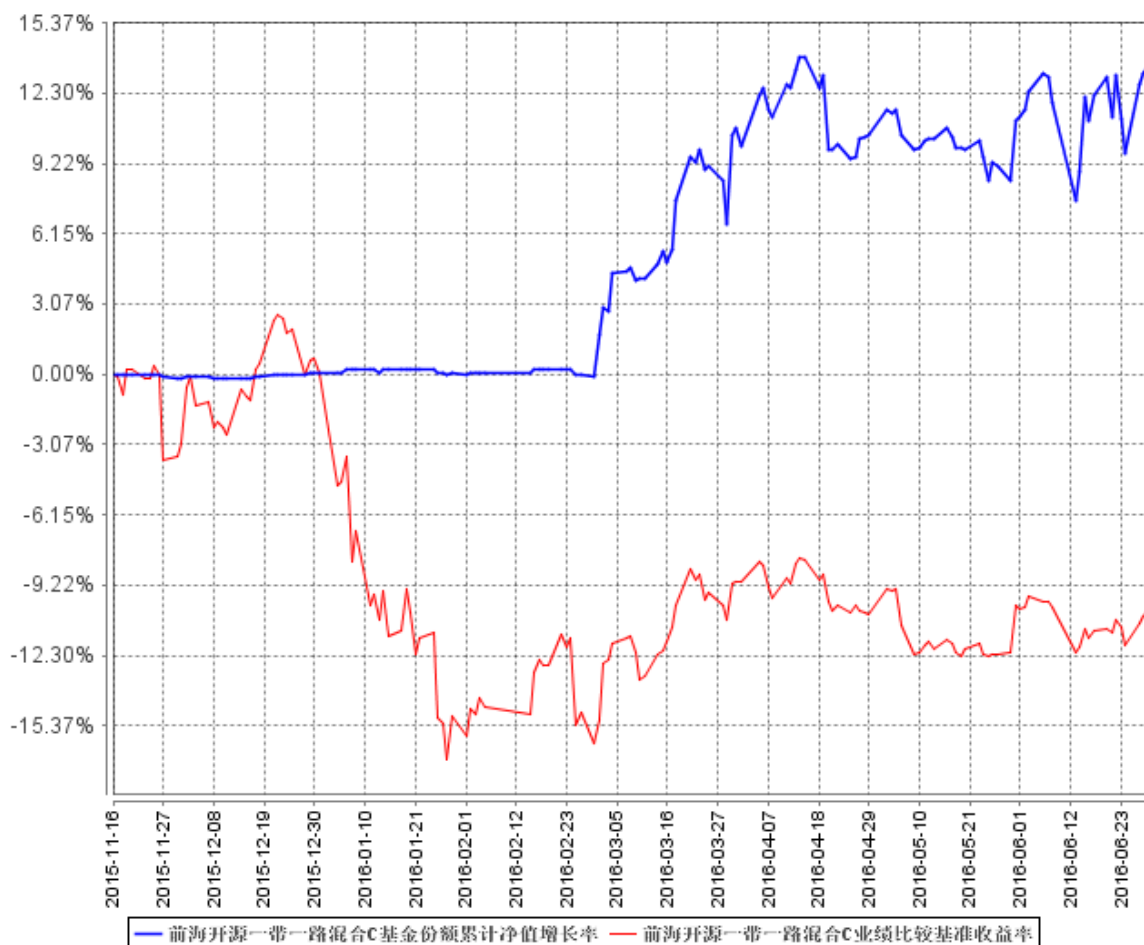
前海开源一带一路混合 C

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	2.16%	1.56%	-0.11%	0.69%	2.27%	0.87%
过去三个月	2.44%	1.13%	-1.23%	0.71%	3.67%	0.42%
过去六个月	13.39%	0.96%	-10.27%	1.29%	23.66%	-0.33%
自基金合同生效起至今	13.50%	0.84%	-10.23%	1.26%	23.73%	-0.42%

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%。

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 2016 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 32 只开放式基金，资产管理规模超过 309 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		
薛小波	本基金的基金经理、公司执行投资总监	2015 年 4 月 29 日	-	9 年	薛小波先生，清华大学工程力学学士、流体力学硕士。2006 年 7 月至 2014 年 4 月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。
徐立平	本基金的基金经理、公司执行投资总监	2015 年 5 月 22 日	-	14 年	徐立平先生，清华大学工商管理硕士。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。

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合规守信情况的说明

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、《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》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

美联储 6 月份加息预期落空，受美国经济复苏低于预期影响，自去年 12 月份首次加息之后第二次加息时间点一再推迟，新兴市场迎来了难得的反弹窗口期。从历史经验看，美元指数在首次加息后走弱有利于风险资产价格的修复，以原油为代表的大宗商品价格仍在反弹通道，而 6 月底的黑天鹅事件英国脱欧刺激了黄金等避险资产价格创出了阶段性新高。

上半年国内宏观经济基本平稳运行，预计上半年 GDP 增速仍将维持在 6.7% 左右，PMI 有所回落但仍在扩张区间，CPI 指数前高后低，显示季节性因素消除之后重新回到低位；受大宗商品价格反弹，PPI 指数继续回升，CPI 和 PPI 裂口进一步收窄。

从分项数据看，固定资产投资增速进一步回落，主要受制造业去产能影响，固定资产投资增速继续下滑；地产销售数据在经历上半年的高速增长之后开始高位回落，预计对下半年地产开发投资预计会形成负面影响；二季度“稳增长”主要靠财政政策发力，仅基建投资维持在 20% 左右的增速。社会消费品零售总额继续平稳增长，进出口仍处于双双负增长的“衰退性繁荣”之中。

继 1 月份 2.51 万亿天量新增贷款之后，受制于美联储加息和一季度 CPI 上行压力，二季度货币政策整体稳健，M2 同比增速在 12% 左右，显示货币政策继 2015 年下半年的适度宽松之后开始转向稳健。从当前时点看，美联储加息一再推迟，英国脱欧之后降息预期开始上升，同时国内 CPI 开始高位回落，这为下半年的货币政策留下了宽松的余地。

A 股市场在经历一季度的大幅下行后开始低位调整，结构性机会开始显现，食品饮料、家电等稳定增长的蓝筹股表现亮眼，而受益于“调结构、去产能”的有色金属、煤炭等周期性行业亦有不错的表现，成长股方面新能源汽车、OLED、锂电池等主题超额收益相对突出。

本基金在一季度维持了较低的仓位，较好地规避了市场下行的风险，在二季度初提高了股票

的配置头寸，持仓主要集中在食品饮料、家电、银行等稳定增长的行业，同时对于国企改革预期较为明确的军工股、估值较低的成长股亦加大了配置比例。

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 8.87%，同期业绩比较基准增长率为-10.27%；C 类基金份额净值增长率为 13.39%，同期业绩比较基准增长率为-10.27%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

美联储加息时点一再推迟，显示美国国内经济复苏不达预期，加息次数也由年初预期的四次下降到两次，英国脱欧公投后为维持国内宏观经济的稳定，降息预期开始上升，日本则继续实施量化宽松，预计下半年外围流动性整体对中国等新兴经济体的影响偏正面。

短期国内宏观经济基本企稳、通胀下行，我们预计三季度仍是 A 股反弹的甜蜜窗口期，但中长期经济结构调整和经济下行的压力仍在。下半年 CPI 有可能出现季节性的反弹，因此我们倾向于认为货币政策有宽松的余地但空间不大，全年仍将维持积极的财政政策，货币政策由去年的适度宽松转向稳健。

在此逻辑判断的基础上，我们认为 A 股下半年仍将是结构性行情，我们将以低估值的蓝筹白马股为底仓，重点投资国防军工、高铁、北斗和核电等具有国家比较优势的高端装备制造业；同时，对代表未来产业方向的新能源、新材料等估值合理的成长股亦将保持相应的头寸。本基金将继续保持相对灵活的仓位，力争为投资者带来更好的回报。

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。估值委员会由总经理、督察长、基金事务部、研究部、投资部、监察稽核部、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方面进行了监督，未发现基金管理人有关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一带一路主题精选灵活配置混合型证券投资基金 2016 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：前海开源一带一路主题精选灵活配置混合型证券投资基金
报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	30,445,126.95	323,375,432.21

结算备付金	3,192,176.00	362,093.42
存出保证金	771,464.95	591,604.55
交易性金融资产	512,893,849.72	31,966,882.63
其中：股票投资	512,893,849.72	31,966,882.63
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	-	1,569,800,000.00
应收证券清算款	2,746,792.39	934,342,721.26
应收利息	8,119.68	444,840.23
应收股利	-	-
应收申购款	45,894.63	939.45
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	550,103,424.32	2,860,884,513.75
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2016年6月30日	2015年12月31日
负 债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	7,074,715.77	2,985,543.02
应付管理人报酬	679,908.29	3,667,597.51
应付托管费	113,318.05	611,266.27
应付销售服务费	0.30	161,233.08
应付交易费用	868,772.20	192,120.74
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	297,104.78	121,192.67
负债合计	9,033,819.39	7,738,953.29
所有者权益：		
实收基金	518,801,815.00	2,892,240,872.06
未分配利润	22,267,789.93	-39,095,311.60
所有者权益合计	541,069,604.93	2,853,145,560.46
负债和所有者权益总计	550,103,424.32	2,860,884,513.75

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，前海开源一带一路混合 A 基金份额净值 1.043 元，基金份额总额 518,798,821.50 份，前海开源一带一路混合 C 基金份额净值 1.135 元，基金份额总额 3,398.40 份。

6.2 利润表

会计主体：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

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 4 月 29 日(基金合同生效日) 至 2015 年 6 月 30 日
一、收入	61,911,641.25	-19,338,666.11
1.利息收入	5,730,341.66	2,904,619.71
其中：存款利息收入	2,818,767.94	1,786,338.34
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	2,911,573.72	1,118,281.37
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	34,145,590.60	847,237.13
其中：股票投资收益	31,926,860.00	783,055.13
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	2,218,730.60	64,182.00
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	21,436,932.76	-23,090,522.95
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	598,776.23	-
减：二、费用	13,589,408.00	5,006,147.54
1. 管理人报酬	9,315,304.09	4,105,230.24
2. 托管费	1,552,550.71	684,205.06
3. 销售服务费	283,749.18	-
4. 交易费用	2,213,736.84	172,952.49
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	224,067.18	43,759.75
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	48,322,233.25	-24,344,813.65
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	48,322,233.25	-24,344,813.65

注：本基金的基金合同于 2015 年 4 月 29 日生效，上年度可比期间为 2015 年 4 月 29 日（基金合同生效日）到 2015 年 6 月 30 日。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：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

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	2,892,240,872.06	-39,095,311.60	2,853,145,560.46
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	-	48,322,233.25	48,322,233.25
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)	-2,373,439,057.06	13,040,868.28	-2,360,398,188.78
其中：1.基金申购款	29,090,819.94	551,594.39	29,642,414.33
2.基金赎回款	-2,402,529,877.00	12,489,273.89	-2,390,040,603.11
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)	518,801,815.00	22,267,789.93	541,069,604.93
项目	上年度可比期间 2015 年 4 月 29 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	1,613,952,378.29	-	1,613,952,378.29
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	-	-24,344,813.65	-24,344,813.65
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)	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-

2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,613,952,378.29	-24,344,813.65	1,589,607,564.64

注：本基金的基金合同于 2015 年 4 月 29 日生效，上年度可比期间为 2015 年 4 月 29 日（基金合同生效日）到 2015 年 6 月 30 日。

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：

<u>蔡颖</u>	<u>李志祥</u>	<u>任福利</u>
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

前海开源一带一路主题精选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【2015】426 号文《关于准予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》及其他法律法规公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次募集期间为 2015 年 4 月 14 日至 2015 年 4 月 27 日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 1,613,336,326.04 元，经瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）瑞华验字[2015]02030037 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《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》于 2015 年 4 月 29 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,613,952,378.29 份基金份额，其中认购资金利息折合 616,052.25 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，本基金托管人为中国银河证券股份有限公司。

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》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

本基金的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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期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[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]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》及其他相关财税法规和实务操作, 主要税项列示如下:

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前, 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围, 不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起, 金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税, 对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入, 包括买卖股票、债券的差价收入, 股权的股息、红利收入, 债券的利息收入及其他收入, 暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入, 应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2015 年 9 月 8 日起, 对基金从上市公司取得的股息红利所得, 持股期限在 1

个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,股息红利所得暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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（“前海开源基金公司”）	基金管理人、注册登记机构、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”）	基金管理人的股东、基金代销机构

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年4月29日(基金合同生效日)至 2015年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
中国银河证券股份有限 公司	1,184,519,684.16	64.42%	203,687,300.53	100.00%

6.4.8.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年4月29日(基金合同生效日)至 2015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	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	5,400,000,000.00	100.00%	1,075,200,000.00	100.00%

6.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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
中国银河证券股份 有限公司	866,238.14	64.42%	390,314.00	44.93%
关联方名称	上年度可比期间 2015年4月29日(基金合同生效日)至2015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	144,698.82	100.00%	144,698.82	100.00%

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6 月30日	上年度可比期间 2015年4月29日(基金合同生效日) 至2015年6月30日
当期发生的基金应支付 的管理费	9,315,304.09	4,105,230.24
其中：支付销售机构的客 户维护费	1,220,449.47	167,403.20

注：本基金的管理费按前一日资产净值的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。

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。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 4 月 29 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,552,550.71	684,205.06

注：本基金的托管费按前一日资产净值的 0.25% 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。

6.4.8.2.3 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		
	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		
	前海开源一带一路混合 A	前海开源一带一路混合 C	合计
前海开源基金管理有限公司	-	283,744.01	283,744.01
合计	-	283,744.01	283,744.01

注：①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 0.1%。

本基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.1% 年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

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，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性划出，由注册登记机构代收，注册登记机构收到后按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。”

②本基金自 2015 年 11 月 16 日起，增加 C 类基金份额并设置对应基金代码，因此本基金上年度可比期间不计提销售服务费。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内与关联方无银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况**6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本报告期内及上年度可比期间内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.8.4.2 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。

6.4.8.5 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 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年4月29日(基金合同生效日)至 2015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
中国银河证券股份有限公司	30,445,126.95	2,740,928.93	1,430,944,543.81	1,778,890.22

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。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间内无其他关联交易事项。

6.4.9 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券**6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金本报告期末无因认购新发或增发而持有流通受限证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末2016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。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 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。

§ 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	512,893,849.72	93.24
	其中：股票	512,893,849.72	93.24
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	33,637,302.95	6.11
7	其他各项资产	3,572,271.65	0.65
8	合计	550,103,424.32	100.00

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（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	25,621,521.44	4.74
B	采矿业	15,156,722.00	2.80
C	制造业	361,101,736.48	66.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务	71,266,485.20	13.17

	业		
J	金融业	26,004,198.00	4.81
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	13,743,186.60	2.54
S	综合	-	-
	合计	512,893,849.72	94.79

7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未通过沪港通机制投资港股。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	002508	老板电器	818,550	30,098,083.50	5.56
2	300059	东方财富	1,322,249	29,353,927.80	5.43
3	000858	五粮液	855,281	27,822,290.93	5.14
4	600519	贵州茅台	93,024	27,155,566.08	5.02
5	002179	中航光电	603,200	26,130,624.00	4.83
6	002234	民和股份	871,184	25,621,521.44	4.74
7	300017	网宿科技	347,577	23,357,174.40	4.32
8	002311	海大集团	1,361,929	21,477,620.33	3.97
9	600071	凤凰光学	723,800	21,475,146.00	3.97
10	600343	航天动力	818,450	19,462,741.00	3.60

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于前海开源基金管理有限公司网站（www.qhkyfund.com）上的半年度报告正文。

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	000768	中航飞机	38,306,939.76	1.34
2	600685	中船防务	32,716,843.86	1.15
3	300059	东方财富	31,388,187.04	1.10
4	002234	民和股份	31,307,812.50	1.10
5	601933	永辉超市	30,318,319.10	1.06
6	002508	老板电器	30,295,554.06	1.06
7	603288	海天味业	29,998,049.58	1.05
8	600547	山东黄金	29,846,340.32	1.05
9	000418	小天鹅A	29,128,779.97	1.02
10	000858	五粮液	28,532,469.27	1.00
11	600519	贵州茅台	28,530,917.12	1.00
12	002179	中航光电	25,790,619.18	0.90
13	600482	中国动力	25,605,216.46	0.90
14	002268	卫士通	24,656,981.90	0.86
15	300017	网宿科技	23,761,024.00	0.83
16	002311	海大集团	23,145,413.20	0.81
17	002590	万安科技	22,679,036.56	0.79
18	601336	新华保险	22,513,668.62	0.79
19	600765	中航重机	20,517,935.88	0.72
20	601069	西部黄金	20,093,129.32	0.70

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	000768	中航飞机	45,251,331.02	1.59
2	600547	山东黄金	35,045,777.51	1.23
3	600482	中国动力	34,051,473.19	1.19
4	601933	永辉超市	32,750,252.70	1.15
5	603288	海天味业	32,578,393.42	1.14
6	600685	中船防务	32,303,653.79	1.13
7	002268	卫士通	27,743,054.51	0.97
8	601336	新华保险	22,611,408.36	0.79

9	600765	中航重机	20,439,543.54	0.72
10	601069	西部黄金	19,368,628.17	0.68
11	000418	小天鹅 A	19,077,116.75	0.67
12	002701	奥瑞金	18,731,719.78	0.66
13	600028	中国石化	18,549,047.00	0.65
14	601668	中国建筑	17,968,652.00	0.63
15	300271	华宇软件	17,878,576.94	0.63
16	601766	中国中车	17,777,643.00	0.62
17	300166	东方国信	17,522,448.86	0.61
18	002466	天齐锂业	17,158,359.88	0.60
19	600855	航天长峰	17,090,206.49	0.60
20	601801	皖新传媒	16,520,805.35	0.58

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	1,133,481,013.64
卖出股票收入（成交）总额	705,917,839.31

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

本基金本报告期内未投资国债期货。

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	771,464.95
2	应收证券清算款	2,746,792.39
3	应收股利	-
4	应收利息	8,119.68
5	应收申购款	45,894.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,572,271.65

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 一 带 一 路 混 合 A	11,669	44,459.58	23,245,256.56	4.48%	495,553,564.94	95.52%
前 海 开 源 一 带 一 路 混 合 C	3	997.83	-	0.00%	2,993.50	100.00%
合计	11,672	44,448.41	23,245,256.56	4.48%	495,556,558.44	95.52%

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

② 户均持有的基金份额合计=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金份额。

8.3 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、基金投资和研发部负责人、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	前海开源一带一 路混合 A	前海开源一带一 路混合 C
基金合同生效日（2015 年 4 月 29 日）基金份 额总额	1,613,952,378.29	-
本报告期期初基金份额总额	992,243,873.56	1,899,996,998.50
本报告期基金总申购份额	29,013,030.69	77,789.25
减：本报告期基金总赎回份额	502,458,082.75	1,900,071,794.25
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-” 填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	518,798,821.50	2,993.50

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

本报告期内投资策略未改变。

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	
银河证券	2	1,184,519,684.16	64.42%	866,238.14	64.42%	-
方正证券	2	654,258,155.43	35.58%	478,458.20	35.58%	-

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
银河证券	-	-	5,400,000,000.00	100.00%	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-

前海开源基金管理有限公司
2016年8月29日