

前海开源沪深 300 指数型证券投资基金 2016 年半年度报告

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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行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。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
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.....	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告	33
7.1 期末基金资产组合情况.....	33
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	33
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.....	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	57
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.....	57
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	57
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.....	57
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.....	57
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	58
7.12 投资组合报告附注.....	58

§8 基金份额持有人信息	59
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	59
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	59
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.....	59
§9 开放式基金份额变动	60
§10 重大事件揭示	60
10.1 基金份额持有人大会决议.....	60
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.....	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	60
10.4 基金投资策略的改变.....	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	60
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.....	60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	61
10.8 其他重大事件.....	62
§11 影响投资者决策的其他重要信息	64
§12 备查文件目录	64
12.1 备查文件目录.....	64
12.2 存放地点.....	65
12.3 查阅方式.....	65

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	前海开源沪深 300 指数型证券投资基金
基金简称	前海开源沪深 300 指数
基金主代码	000656
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 6 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	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	46,635,785.32 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪沪深 300 指数，在严格控制基金的日均跟踪偏离度和年跟踪误差的前提下，力争获取与标的指数相似的投资收益。
投资策略	<p>本基金采用完全复制标的指数的方法，进行被动式指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合复制标的指数，并根据标的指数变动而进行相应调整。本基金在严格控制基金日均跟踪偏离度和年跟踪误差的前提下，力争获取与标的指数相似的投资收益。由于标的指数编制方法调整、成份股及其权重变化的原因，或因基金的申购和赎回等其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。</p> <p>1、大类资产配置：本基金管理人主要按照沪深 300 指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的 90%，投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的 85%；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% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。</p> <p>2、股票投资策略：（1）股票投资组合构建：本基金采用完全复制标的指数的方法，按照标的指数成份股组成及其权重构建股票投资组合。若出现特殊情况，本基金将采用替代性的方法构建组合，以减少跟踪误差。</p> <p>（2）股票投资组合的调整：本基金股票投资组合根据沪深 300 指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，</p>

	<p>还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况等，对其进行适时调整。在正常市场情况下，力争控制本基金的份额净值与业绩比较基准的收益率日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免误差进一步扩大。</p> <p>3、债券投资策略：本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，降低跟踪误差，主要采取组合久期配置策略，同时辅之以收益率曲线策略、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：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；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：本基金以套期保值为目的，参与股指期货交易。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，以达到降低投资组合的整体风险的目的。基金管理人将建立股指期货投资决策部门或小组，经董事会批准后执行。若相关法律法规发生变化时，基金管理人从其最新规定。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。
风险收益特征	本基金属于采用指数化操作的股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金，为证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	傅成斌	林葛
	联系电话	0755-88601888	010-66060069
	电子邮箱	qhky@qhkyfund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4001666998	95599
传真		0755-83181169	010-68121816
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)	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		深圳市福田区深南大道 7006 号万科富春东方大厦 2206	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		518040	100031

法定代表人	王兆华	周慕冰
-------	-----	-----

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	前海开源基金管理有限公司	深圳市福田区深南大道 7006 号万科富春东方大厦 2206

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	6,736,700.20
本期利润	6,881,662.54
加权平均基金份额本期利润	0.0277
本期加权平均净值利润率	2.58%
本期基金份额净值增长率	-5.68%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	1,357,364.35
期末可供分配基金份额利润	0.0291
期末基金资产净值	47,993,149.67
期末基金份额净值	1.029
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	29.78%

注：① 上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

② 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

③ 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润期末余额和未分配利润中已实现部分期末余额的孰低数。表中的“期末”均指报告期最后一个自然日，无论该日是否为开放日或交易所

的交易日。

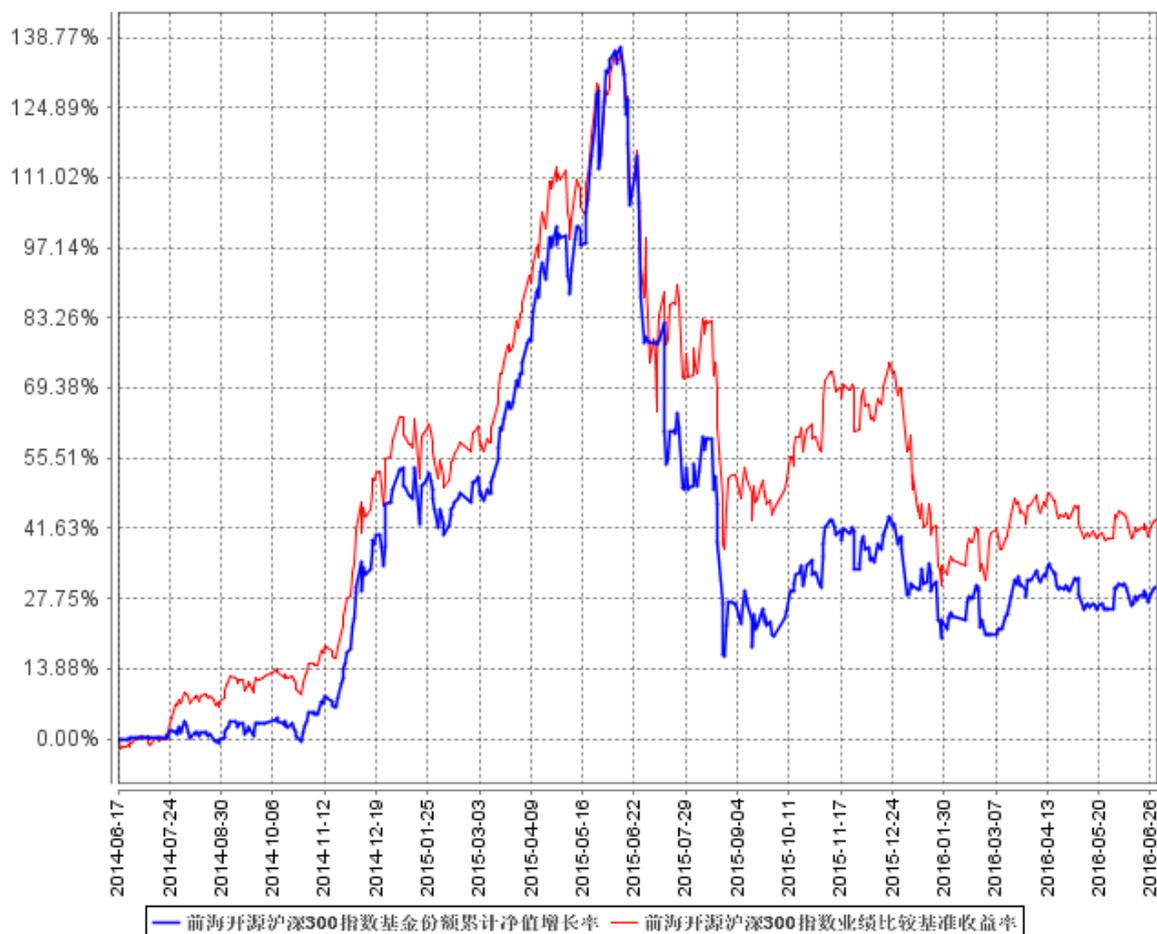
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-0.19%	0.92%	-0.46%	0.93%	0.27%	-0.01%
过去三个月	-1.25%	0.97%	-1.88%	0.96%	0.63%	0.01%
过去六个月	-5.68%	1.53%	-14.66%	1.75%	8.98%	-0.22%
过去一年	-27.66%	2.11%	-28.01%	2.19%	0.35%	-0.08%
自基金合同生效起至今	29.78%	1.95%	43.47%	1.97%	-13.69%	-0.02%

注：本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×95% + 银行活期存款利率（税后）×5%。

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



§ 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		
王霞	本基金的基金经理、公司执行投资总监	2014 年 6 月 17 日	-	12 年	王霞女士，北京交通大学管理学硕士，中国注册会计师(CPA)。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。
苏天杉	本基金的基金经理、公司执行投资总监	2016 年 4 月 21 日	-	4 年	苏天杉先生，美国罗彻斯特大学商学院 MBA、对外经济贸易大学管理学硕士、美国注册金融分析师(CFA)。2011 年加入美国领航基金(Vanguard Group) 费城总部，任投资管

					理部投资分析师。曾任英特尔 (Intel) 全球新兴市场情报分析经理, 高级分析师。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、《前海开源沪深 300 指数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

报告期内, 本基金紧密跟踪指数, 降低跟踪误差。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内, 基金份额净值增长率为-5.68%, 同期业绩比较基准收益率为-14.66%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

报告期内，国内宏观经济回升的态势在第一季度有所回暖后，受国内整体流动性状况、政策支持力度较一季度略收紧和放缓的影响，经济复苏态势继续疲弱。4 月份工业企业利润增速、食品、房价涨幅均开始放缓；5 月份地产销售量同比增速也开始放缓。6 月 24 日英国意外脱欧给全球经济带来不确定性，欧盟经济增长面临下行风险将可能导致中国出口再度下滑，这些都将在一定程度上加大国内经济复苏的压力。

国内证券市场在经历了 1 月份的惨烈下跌后呈现了区间震荡的走势，外汇市场及国际地缘政治的波动及复杂性凸显了黄金股的战略性配置价值。受益于国家供给侧改革的稀有金属如稀土等取得了较好收益；具有稳定增长预期的白酒、家电行业表现也较为突出。

为应对脱欧的负面冲击及全球经济的衰退，我们预计未来全球包括中国在内的主要国家将采取较为宽松货币政策的概率增加，这将对大宗商品、股市等风险资产形成一定利好。券商行业经历上半年业绩的大幅下滑后，6 月份开始业绩环比改善较明显；地缘政治的冲击及受益国企改革推进的预期，我们预计军工行业将最为受益；此外，上半年明显跑输大盘的地产股，逐步具备标配价值，我们预计地产行业下半年将进入阶段的调整期，受益于整体流动性依然保持较为宽松，明年地产行业的销售增长依然可期。

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

本基金本报告期内实施利润分配一次，每 10 份基金份额分配 2.50 元，共分配利润 1,690,893,449.38 元。

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的情形。

本基金本报告期内，从 2016 年 1 月 14 日至 2016 年 2 月 29 日，连续 28 个工作日基金净值低于五千万元；从 2016 年 3 月 11 日至 2016 年 5 月 24 日，连续 51 个工作日基金净值低于五千万元；从 2016 年 5 月 27 日至 2016 年 6 月 30 日，连续 23 个工作日基金净值低于五千万元。

§ 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—前海开源基金管理有限公司 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，前海开源基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本基金本报告期内实施利润分配一次，每 10 份基金份额分配 2.50 元，共分配利润 1,690,893,449.38 元。

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

本托管人认为，前海开源基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§ 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：前海开源沪深 300 指数型证券投资基金
报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	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	6.4.7.1	4,818,237.87	562,682.21
结算备付金		-	-
存出保证金		54,543.46	30,699.93
交易性金融资产	6.4.7.2	45,518,222.19	4,348,139.50
其中：股票投资		45,518,222.19	4,348,139.50
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		917,860.24	19,221.06
应收利息	6.4.7.5	880.26	129.05
应收股利		-	-
应收申购款		6,082.02	19,276.86
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		51,315,826.04	4,980,148.61
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		2,870,428.89	1,610.14
应付赎回款		218,782.95	18,666.37
应付管理人报酬		39,157.17	4,012.37
应付托管费		5,873.57	601.87
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	47,883.23	764.08
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	140,550.56	190,070.35
负债合计		3,322,676.37	215,725.18
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	46,635,785.32	3,461,960.99

未分配利润	6.4.7.10	1,357,364.35	1,302,462.44
所有者权益合计		47,993,149.67	4,764,423.43
负债和所有者权益总计		51,315,826.04	4,980,148.61

注：报告截止日 2016 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.029 元，基金份额总额 46,635,785.32 份。

6.2 利润表

会计主体：前海开源沪深 300 指数型证券投资基金

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	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		8,836,195.60	10,163,784.08
1.利息收入		1,220,853.01	9,932.77
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,220,852.26	9,932.77
债券利息收入		0.75	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-702,846.07	17,572,414.74
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-1,092,361.93	17,527,794.33
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	60.45	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	389,455.41	44,620.41
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	144,962.34	-7,561,073.19
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	8,173,226.32	142,509.76
减：二、费用		1,954,533.06	507,726.21
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,365,170.56	128,450.08
2. 托管费	6.4.10.2.2	204,775.58	19,267.52
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	253,759.26	189,804.32
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	130,827.66	170,204.29
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		6,881,662.54	9,656,057.87

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		6,881,662.54	9,656,057.87

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：前海开源沪深 300 指数型证券投资基金

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）	3,461,960.99	1,302,462.44	4,764,423.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,881,662.54	6,881,662.54
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）	43,173,824.33	1,684,066,688.75	1,727,240,513.08
其中：1.基金申购款	6,854,059,729.75	1,411,776,504.22	8,265,836,233.97
2.基金赎回款	-6,810,885,905.42	272,290,184.53	-6,538,595,720.89
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）	-	-1,690,893,449.38	-1,690,893,449.38
五、期末所有者权益（基金净值）	46,635,785.32	1,357,364.35	47,993,149.67
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 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）	26,422,222.95	13,067,875.36	39,490,098.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	9,656,057.87	9,656,057.87
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）	5,156,300.77	2,356,854.54	7,513,155.31

其中：1.基金申购款	72,630,525.90	48,942,872.26	121,573,398.16
2.基金赎回款	-67,474,225.13	-46,586,017.72	-114,060,242.85
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)	31,578,523.72	25,080,787.77	56,659,311.49

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

前海开源沪深 300 指数型证券投资基金（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【2014】494 号文《关于准予前海开源沪深 300 指数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》、《前海开源沪深 300 指数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 2014 年 6 月 3 日至 2014 年 6 月 13 日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 234,687,022.67 元，经瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）瑞华验字[2014]第 02030017 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《前海开源沪深 300 指数型证券投资基金基金合同》于 2014 年 6 月 17 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 234,720,620.35 份基金份额，其中认购资金利息折合 33,597.68 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农业银行股份有限公司。

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》、《前海开源沪深 300 指数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 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[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 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 2016 年 6 月 30 日
活期存款	4,818,237.87
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	4,818,237.87

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	45,358,786.10	45,518,222.19	159,436.09
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	45,358,786.10	45,518,222.19	159,436.09

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 2016 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	858.12
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	22.14
合计	880.26

注：“其他”为应收结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	47,883.23
银行间市场应付交易费用	-
合计	47,883.23

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	824.52
预提费用	99,726.04
指数使用费	40,000.00
合计	140,550.56

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,461,960.99	3,461,960.99
本期申购	6,854,059,729.75	6,854,059,729.75
本期赎回(以“-”号填列)	-6,810,885,905.42	-6,810,885,905.42
- 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	46,635,785.32	46,635,785.32

注：申购含红利再投、转换入份（金）额；赎回含转换出份（金）额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,779,853.98	-4,477,391.54	1,302,462.44
本期利润	6,736,700.20	144,962.34	6,881,662.54
本期基金份额交易产生的变动数	1,746,002,375.74	-61,935,686.99	1,684,066,688.75
其中：基金申购款	11,580,042,663.80	-10,168,266,159.58	1,411,776,504.22
基金赎回款	-9,834,040,288.06	10,106,330,472.59	272,290,184.53
本期已分配利润	-1,690,893,449.38	-	-1,690,893,449.38
本期末	67,625,480.54	-66,268,116.19	1,357,364.35

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
	活期存款利息收入
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,144.17
其他	280,126.15
合计	1,220,852.26

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 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	83,045,244.92
减：卖出股票成本总额	84,137,606.85
买卖股票差价收入	-1,092,361.93

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 2016年1月1日至2016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	60.45
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	60.45

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 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,061.20
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,000.00
减：应收利息总额	0.75
买卖债券差价收入	60.45

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益**6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 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
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	389,455.41
基金投资产生的股利收益	-
合计	389,455.41

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	144,962.34
——股票投资	144,962.34
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	144,962.34

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	8,171,856.57
基金转换费收入	1,369.75
合计	8,173,226.32

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	253,759.26
银行间市场交易费用	-
合计	253,759.26

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
审计费用	24,863.02
信息披露费	24,863.02
其他	300.00
汇划费	801.62
指数使用费	80,000.00
合计	130,827.66

注：“其他”为账户维护费、审计询证费。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易，无佣金产生。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

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 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,365,170.56	128,450.08
其中：支付销售机构的客户维护费	21,363.18	26,591.46

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.00% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

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首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

本基金管理人按照与基金代销机构签订的基金销售协议约定，依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，客

户维护费从基金管理费中列支。

6.4.10.2.2 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 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	204,775.58	19,267.52

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.3 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与关联方无银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		2015 年 1 月 1 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
中国农业银行股份有限公司	4,818,237.87	939,581.94	507,566.85	8,034.47

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行股份有限公司保管，按适用利率或约定利率计息。

6.4.10.6 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未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 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无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

金额单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日		每 10 份 基金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2016 年 3 月 7 日	-	2016 年 3 月 7 日	2.5000	1,689,698,358.92	1,195,090.46	1,690,893,449.38	
合计	-	-		2.5000	1,689,698,358.92	1,195,090.46	1,690,893,449.38	

6.4.12 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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。

6.4.12.2 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
600019	宝钢 股份	2016 年 6 月 27 日	重大 资产 重组	4.90	-	-	29,400	161,754.22	144,060.00	-
002465	海格 通信	2016 年 6 月 13 日	重大 事项	12.92	-	-	10,108	122,087.89	130,595.36	-
600649	城投 控股	2016 年 6 月 20 日	重大 资产 重组	14.36	-	-	8,906	130,276.53	127,890.16	-
000728	国元 证券	2016 年 6 月 8 日	重大 事项	16.72	2016 年 7 月 8 日	17.37	7,306	126,111.15	122,156.32	-
000651	格力 电器	2016 年 2 月 22	重大 事项	22.07	-	-	3,600	72,129.20	79,452.00	-

		日								
000002	万科 A	2015 年 12 月 18 日	重大 资产 重组	18.20	2016 年 7 月 4 日	21.99	4,300	57,708.83	78,260.00	-
600005	武钢 股份	2016 年 6 月 27 日	重大 资产 重组	2.76	-	-	23,900	76,778.94	65,964.00	-
002129	中环 股份	2016 年 4 月 25 日	重大 事项	8.29	-	-	7,944	67,089.34	65,855.76	-
000629	*ST 钒 钛	2016 年 5 月 26 日	重大 资产 重组	2.39	-	-	25,400	82,302.54	60,706.00	-
002065	东华 软件	2015 年 12 月 22 日	重大 事项	25.10	2016 年 7 月 4 日	22.59	400	11,697.85	10,040.00	-
000415	渤海 金控	2016 年 2 月 1 日	重大 资产 重组	6.82	2016 年 8 月 11 日	7.50	1,400	11,223.00	9,548.00	-

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 2016 年 8 月 25 日。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 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。

6.4.12.3.2 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以监察及风险控制委员会、督察长、风险控制委员会、监察稽核部、金融工程部和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立监察及风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部、金融工程部负责，

协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款由基金托管人保管，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；本基金未进行银行间同业市场交易。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级，通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，且通过分散化投资以分散信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末未持有短期信用评级的债券。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末未持有长期信用评级的债券。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购

赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券均在证券交易所上市，金融资产均能以合理价格适时变现。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	4,818,237.87	-	-	-	4,818,237.87
存出保证金	54,543.46	-	-	-	54,543.46
交易性金融资产	-	-	-	45,518,222.19	45,518,222.19
应收证券清算款	-	-	-	917,860.24	917,860.24
应收利息	-	-	-	880.26	880.26
应收申购款	-	-	-	6,082.02	6,082.02
资产总计	4,872,781.33	-	-	46,443,044.71	51,315,826.04
负债					

应付证券清算款	-	-	-	2,870,428.89	2,870,428.89
应付赎回款	-	-	-	218,782.95	218,782.95
应付管理人报酬	-	-	-	39,157.17	39,157.17
应付托管费	-	-	-	5,873.57	5,873.57
应付交易费用	-	-	-	47,883.23	47,883.23
其他负债	-	-	-	140,550.56	140,550.56
负债总计	-	-	-	3,322,676.37	3,322,676.37
利率敏感度缺口	4,872,781.33	-	-	-43,120,368.34	47,993,149.67
上年度末 2015 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	562,682.21	-	-	-	562,682.21
存出保证金	30,699.93	-	-	-	30,699.93
交易性金融资产	-	-	-	4,348,139.50	4,348,139.50
应收证券清算款	-	-	-	19,221.06	19,221.06
应收利息	-	-	-	129.05	129.05
应收申购款	-	-	-	19,276.86	19,276.86
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	593,382.14	-	-	4,386,766.47	4,980,148.61
负债					
应付证券清算款	-	-	-	1,610.14	1,610.14
应付赎回款	-	-	-	18,666.37	18,666.37
应付管理人报酬	-	-	-	4,012.37	4,012.37
应付托管费	-	-	-	601.87	601.87
应付交易费用	-	-	-	764.08	764.08
其他负债	-	-	-	190,070.35	190,070.35
负债总计	-	-	-	215,725.18	215,725.18
利率敏感度缺口	593,382.14	-	-	-4,171,041.29	4,764,423.43

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日期或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

截至 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2015 年 12 月 31 日：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2015 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变化而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以

外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金的投资组合中，本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的 90%，投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的 85%；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% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	45,518,222.19	94.84	4,348,139.50	91.26
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	45,518,222.19	94.84	4,348,139.50	91.26

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016 年 6 月	上年度末（2015 年 12 月

		30 日)	31 日)
	业绩比较基准增加 5%	1,952,564.11	213,751.42
	业绩比较基准减少 5%	-1,952,564.11	-213,751.42

6.4.14 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 2016 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 44,623,694.59 元，第二层次的余额为 894,527.60 元，无属于第三层次的余额；于 2015 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 4,072,505.82 元，属于第二层次的余额为 275,633.68 元，无属于第三层次的余额。

(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 2016 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（2015 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	45,518,222.19	88.70
	其中：股票	45,518,222.19	88.70
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	4,818,237.87	9.39
7	其他各项资产	979,365.98	1.91
8	合计	51,315,826.04	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资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	37,234.99	0.08
B	采矿业	1,667,308.78	3.47
C	制造业	14,673,434.90	30.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,890,307.93	3.94
E	建筑业	1,574,277.79	3.28
F	批发和零售业	997,887.66	2.08
G	交通运输、仓储和邮政业	1,457,570.61	3.04
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,897,753.78	6.04
J	金融业	16,507,491.32	34.40
K	房地产业	1,694,104.45	3.53

L	租赁和商务服务业	515,951.75	1.08
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	333,794.99	0.70
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	81,279.25	0.17
R	文化、体育和娱乐业	892,118.14	1.86
S	综合	236,999.85	0.49
	合计	45,457,516.19	94.72

7.2.2 期末积极投资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	-	-
B	采掘业	60,706.00	0.13
C	制造业	-	-
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	60,706.00	0.13

7.2.3 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

7.3.1 期末指数投资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	601318	中国平安	60,973	1,953,574.92	4.07
2	600016	民生银行	134,416	1,200,334.88	2.50
3	601166	兴业银行	75,022	1,143,335.28	2.38
4	600036	招商银行	57,835	1,012,112.50	2.11
5	601328	交通银行	154,079	867,464.77	1.81
6	600519	贵州茅台	2,760	805,699.20	1.68
7	600000	浦发银行	48,566	756,172.62	1.58
8	600030	中信证券	43,948	713,276.04	1.49
9	600837	海通证券	45,089	695,272.38	1.45
10	601398	工商银行	136,667	606,801.48	1.26
11	601169	北京银行	57,222	593,392.14	1.24
12	600887	伊利股份	33,758	562,745.86	1.17
13	601601	中国太保	17,610	476,174.40	0.99
14	601766	中国中车	51,898	475,904.66	0.99
15	600900	长江电力	37,105	463,441.45	0.97
16	601668	中国建筑	84,929	451,822.28	0.94
17	000333	美的集团	18,000	426,960.00	0.89
18	601988	中国银行	118,316	379,794.36	0.79
19	600104	上汽集团	18,493	375,222.97	0.78
20	600048	保利地产	39,858	343,974.54	0.72
21	000858	五粮液	10,400	338,312.00	0.70
22	601818	光大银行	89,319	335,839.44	0.70
23	000001	平安银行	38,540	335,298.00	0.70
24	601688	华泰证券	17,693	334,751.56	0.70
25	601989	中国重工	52,315	331,153.95	0.69
26	600276	恒瑞医药	7,884	316,227.24	0.66
27	000725	京东方 A	134,400	310,464.00	0.65
28	600015	华夏银行	30,074	297,431.86	0.62
29	600028	中国石化	58,864	277,838.08	0.58
30	000776	广发证券	16,500	276,540.00	0.58
31	300104	乐视网	5,100	269,841.00	0.56
32	600999	招商证券	16,235	267,877.50	0.56
33	300059	东方财富	11,860	263,292.00	0.55

34	600518	康美药业	16,501	250,650.19	0.52
35	002450	康得新	14,589	249,471.90	0.52
36	600958	东方证券	14,800	248,788.00	0.52
37	002736	国信证券	13,800	238,050.00	0.50
38	002304	洋河股份	3,300	237,336.00	0.49
39	002024	苏宁云商	20,900	226,974.00	0.47
40	601390	中国中铁	31,906	222,384.82	0.46
41	002415	海康威视	10,251	219,986.46	0.46
42	000783	长江证券	18,500	214,600.00	0.45
43	601006	大秦铁路	33,293	214,406.92	0.45
44	002594	比亚迪	3,433	209,447.33	0.44
45	002739	万达院线	2,600	207,740.00	0.43
46	000166	申万宏源	24,600	206,886.00	0.43
47	601939	建设银行	43,349	205,907.75	0.43
48	002673	西部证券	7,804	201,811.44	0.42
49	601857	中国石油	27,294	197,335.62	0.41
50	601628	中国人寿	9,383	195,354.06	0.41
51	601186	中国铁建	19,606	195,275.76	0.41
52	601377	兴业证券	26,246	193,957.94	0.40
53	600795	国电电力	66,141	193,793.13	0.40
54	601009	南京银行	20,346	191,048.94	0.40
55	001979	招商蛇口	13,400	190,950.00	0.40
56	601336	新华保险	4,705	190,082.00	0.40
57	000063	中兴通讯	13,200	189,288.00	0.39
58	600050	中国联通	47,391	180,559.71	0.38
59	601985	中国核电	26,365	180,072.95	0.38
60	000538	云南白药	2,800	180,040.00	0.38
61	601899	紫金矿业	53,103	178,957.11	0.37
62	600570	恒生电子	2,659	177,541.43	0.37
63	600637	东方明珠	7,252	176,006.04	0.37
64	600011	华能国际	23,396	175,937.92	0.37
65	601901	方正证券	22,874	175,214.84	0.37
66	300017	网宿科技	2,580	173,376.00	0.36
67	000625	长安汽车	12,500	170,875.00	0.36
68	600111	北方稀土	12,403	165,083.93	0.34
69	002230	科大讯飞	4,954	162,738.90	0.34
70	002142	宁波银行	11,000	162,580.00	0.34
71	000503	海虹控股	4,004	161,000.84	0.34
72	600585	海螺水泥	11,050	160,667.00	0.33

73	600010	包钢股份	55,305	158,172.30	0.33
74	601088	中国神华	11,111	156,331.77	0.33
75	600547	山东黄金	4,000	155,640.00	0.32
76	601555	东吴证券	11,613	155,614.20	0.32
77	601099	太平洋	25,360	155,456.80	0.32
78	300024	机器人	6,120	155,386.80	0.32
79	600893	中航动力	4,371	151,455.15	0.32
80	601211	国泰君安	8,474	150,752.46	0.31
81	600690	青岛海尔	16,940	150,427.20	0.31
82	600705	中航资本	25,491	149,887.08	0.31
83	600100	同方股份	9,940	148,702.40	0.31
84	000423	东阿阿胶	2,800	147,924.00	0.31
85	300027	华谊兄弟	10,895	147,518.30	0.31
86	600066	宇通客车	7,412	146,757.60	0.31
87	002241	歌尔股份	5,104	146,382.72	0.31
88	600271	航天信息	6,100	145,180.00	0.30
89	600019	宝钢股份	29,400	144,060.00	0.30
90	600703	三安光电	7,194	143,664.18	0.30
91	600029	南方航空	19,810	139,858.60	0.29
92	600009	上海机场	5,327	138,768.35	0.29
93	600109	国金证券	10,163	136,997.24	0.29
94	601198	东兴证券	5,600	136,864.00	0.29
95	000100	TCL 集团	41,200	135,548.00	0.28
96	601669	中国电建	23,400	133,614.00	0.28
97	002202	金风科技	8,700	131,631.00	0.27
98	600383	金地集团	12,672	131,281.92	0.27
99	002465	海格通信	10,108	130,595.36	0.27
100	600535	天士力	3,602	128,807.52	0.27
101	300070	碧水源	8,618	128,235.84	0.27
102	600649	城投控股	8,906	127,890.16	0.27
103	000839	中信国安	6,000	127,860.00	0.27
104	600115	东方航空	19,182	126,793.02	0.26
105	600886	国投电力	19,028	125,584.80	0.26
106	601727	上海电气	16,603	125,518.68	0.26
107	600089	特变电工	14,609	124,468.68	0.26
108	000009	中国宝安	9,000	123,300.00	0.26
109	000728	国元证券	7,306	122,156.32	0.25
110	600196	复星医药	6,394	121,613.88	0.25
111	600340	华夏幸福	4,959	120,900.42	0.25

112	000768	中航飞机	6,100	120,109.00	0.25
113	000069	华侨城 A	18,500	118,400.00	0.25
114	601888	中国国旅	2,690	118,306.20	0.25
115	002456	欧菲光	4,000	118,000.00	0.25
116	600177	雅戈尔	8,513	117,394.27	0.24
117	000895	双汇发展	5,606	117,053.28	0.24
118	002252	上海莱士	3,100	116,808.00	0.24
119	600023	浙能电力	22,897	116,545.73	0.24
120	601600	中国铝业	30,833	116,240.41	0.24
121	600485	信威集团	6,500	115,960.00	0.24
122	601607	上海医药	6,419	115,862.95	0.24
123	600804	鹏博士	6,281	114,502.63	0.24
124	300315	掌趣科技	10,900	114,341.00	0.24
125	000793	华闻传媒	11,516	113,778.08	0.24
126	600153	建发股份	9,426	113,112.00	0.24
127	000568	泸州老窖	3,805	113,008.50	0.24
128	600118	中国卫星	3,310	111,216.00	0.23
129	600061	国投安信	6,185	110,216.70	0.23
130	601788	光大证券	6,483	109,822.02	0.23
131	600352	浙江龙盛	12,730	109,732.60	0.23
132	002008	大族激光	4,800	109,632.00	0.23
133	601919	中国远洋	21,559	109,519.72	0.23
134	600489	中金黄金	9,733	109,398.92	0.23
135	600867	通化东宝	5,278	109,201.82	0.23
136	600406	国电南瑞	8,150	108,965.50	0.23
137	600660	福耀玻璃	7,782	108,948.00	0.23
138	600031	三一重工	21,520	108,030.40	0.23
139	601018	宁波港	21,720	107,514.00	0.22
140	300168	万达信息	4,100	106,559.00	0.22
141	000338	潍柴动力	13,600	106,216.00	0.22
142	600739	辽宁成大	6,817	106,140.69	0.22
143	002236	大华股份	8,100	106,110.00	0.22
144	600221	海南航空	33,270	105,465.90	0.22
145	002500	山西证券	6,306	104,427.36	0.22
146	600309	万华化学	6,007	103,921.10	0.22
147	000157	中联重科	24,900	102,837.00	0.21
148	300124	汇川技术	5,300	102,820.00	0.21
149	000917	电广传媒	6,200	102,486.00	0.21
150	601618	中国中冶	27,746	102,382.74	0.21

151	600674	川投能源	12,370	102,176.20	0.21
152	600718	东软集团	5,532	101,346.24	0.21
153	002475	立讯精密	5,152	101,236.80	0.21
154	000686	东北证券	7,786	100,517.26	0.21
155	002183	怡亚通	7,000	100,240.00	0.21
156	000559	万向钱潮	6,400	99,840.00	0.21
157	000540	中天城投	15,800	98,434.00	0.21
158	600741	华域汽车	7,025	98,420.25	0.21
159	601998	中信银行	17,300	98,091.00	0.20
160	601111	中国国航	14,457	97,729.32	0.20
161	000876	新希望	11,700	97,344.00	0.20
162	000623	吉林敖东	3,900	97,305.00	0.20
163	600446	金证股份	2,700	97,065.00	0.20
164	000630	铜陵有色	37,920	96,316.80	0.20
165	601933	永辉超市	22,977	94,895.01	0.20
166	600415	小商品城	15,292	94,504.56	0.20
167	600663	陆家嘴	4,112	93,548.00	0.19
168	600018	上港集团	18,299	93,324.90	0.19
169	603993	洛阳钼业	22,168	91,997.20	0.19
170	600839	四川长虹	20,807	91,966.94	0.19
171	002385	大北农	11,350	91,481.00	0.19
172	600068	葛洲坝	15,683	91,275.06	0.19
173	601800	中国交建	8,668	91,274.04	0.19
174	000060	中金岭南	8,600	89,698.00	0.19
175	600085	同仁堂	2,995	89,221.05	0.19
176	002081	金螳螂	8,900	89,178.00	0.19
177	000963	华东医药	1,300	87,620.00	0.18
178	300003	乐普医疗	4,800	87,552.00	0.18
179	000750	国海证券	11,800	87,202.00	0.18
180	000826	启迪桑德	2,853	87,159.15	0.18
181	600150	中国船舶	3,909	87,014.34	0.18
182	002292	奥飞娱乐	2,900	86,855.00	0.18
183	000792	盐湖股份	4,104	86,594.40	0.18
184	000046	泛海控股	8,500	85,935.00	0.18
185	000413	东旭光电	10,000	85,900.00	0.18
186	600583	海油工程	12,410	85,753.10	0.18
187	600398	海澜之家	7,573	85,574.90	0.18
188	600816	安信信托	5,000	84,350.00	0.18
189	600369	西南证券	11,503	83,511.78	0.17

190	600157	永泰能源	21,094	83,110.36	0.17
191	600208	新湖中宝	19,400	82,062.00	0.17
192	300015	爱尔眼科	2,225	81,279.25	0.17
193	002007	华兰生物	2,583	81,106.20	0.17
194	000402	金融街	8,300	80,676.00	0.17
195	600588	用友网络	4,086	80,003.88	0.17
196	300144	宋城演艺	3,200	79,712.00	0.17
197	000651	格力电器	3,600	79,452.00	0.17
198	600895	张江高科	4,356	78,756.48	0.16
199	000002	万科A	4,300	78,260.00	0.16
200	600074	保千里	5,200	77,584.00	0.16
201	000977	浪潮信息	3,300	77,385.00	0.16
202	601106	中国一重	14,823	77,227.83	0.16
203	600060	海信电器	4,367	77,208.56	0.16
204	300058	蓝色光标	7,897	76,679.87	0.16
205	002152	广电运通	4,600	75,624.00	0.16
206	601333	广深铁路	19,018	74,360.38	0.15
207	002422	科伦药业	4,800	73,968.00	0.15
208	600820	隧道股份	8,807	73,890.73	0.15
209	600332	白云山	2,983	73,501.12	0.15
210	000425	徐工机械	23,900	73,134.00	0.15
211	600642	申能股份	12,676	72,760.24	0.15
212	600256	广汇能源	17,640	72,324.00	0.15
213	600688	上海石化	11,825	72,132.50	0.15
214	601098	中南传媒	3,960	71,715.60	0.15
215	601866	中海集运	17,963	71,133.48	0.15
216	002470	金正大	8,808	70,904.40	0.15
217	601258	庞大集团	25,502	70,130.50	0.15
218	600376	首开股份	6,300	70,056.00	0.15
219	300002	神州泰岳	6,500	69,160.00	0.14
220	600252	中恒集团	15,681	68,055.54	0.14
221	600027	华电国际	13,675	67,691.25	0.14
222	000709	河钢股份	23,900	66,203.00	0.14
223	601718	际华集团	8,660	66,162.40	0.14
224	000738	中航动控	2,500	66,000.00	0.14
225	600005	武钢股份	23,900	65,964.00	0.14
226	002129	中环股份	7,944	65,855.76	0.14
227	601991	大唐发电	16,922	65,826.58	0.14
228	600875	东方电气	6,669	65,489.58	0.14

229	601021	春秋航空	1,364	65,390.16	0.14
230	600873	梅花生物	10,500	65,205.00	0.14
231	600737	中粮屯河	5,600	64,680.00	0.13
232	600373	中文传媒	3,008	62,416.00	0.13
233	600362	江西铜业	4,629	62,398.92	0.13
234	601117	中国化学	11,152	61,670.56	0.13
235	600170	上海建工	16,060	61,509.80	0.13
236	300133	华策影视	3,860	60,100.20	0.13
237	600704	物产中大	6,400	59,904.00	0.12
238	002027	分众传媒	3,600	59,436.00	0.12
239	000729	燕京啤酒	7,800	59,202.00	0.12
240	601179	中国西电	11,645	59,040.15	0.12
241	601225	陕西煤业	11,281	58,322.77	0.12
242	600372	中航电子	2,995	58,312.65	0.12
243	000039	中集集团	4,100	58,097.00	0.12
244	300251	光线传媒	5,020	58,031.20	0.12
245	600037	歌华有线	3,800	57,798.00	0.12
246	601633	长城汽车	6,783	57,248.52	0.12
247	000061	农产品	4,707	57,237.12	0.12
248	000778	新兴铸管	12,300	57,072.00	0.12
249	601872	招商轮船	11,899	55,687.32	0.12
250	300146	汤臣倍健	4,100	55,514.00	0.12
251	601992	金隅股份	7,017	54,381.75	0.11
252	600038	中直股份	1,302	54,006.96	0.11
253	601898	中煤能源	10,315	53,225.40	0.11
254	601216	君正集团	7,072	52,827.84	0.11
255	600008	首创股份	13,523	52,604.47	0.11
256	000712	锦龙股份	2,500	51,900.00	0.11
257	002195	二三四五	4,200	51,618.00	0.11
258	600827	百联股份	4,270	51,581.60	0.11
259	000883	湖北能源	11,114	51,457.82	0.11
260	000999	华润三九	2,103	50,934.66	0.11
261	603000	人民网	3,053	50,710.33	0.11
262	002153	石基信息	1,900	50,122.00	0.10
263	000800	一汽轿车	4,606	50,113.28	0.10
264	002146	荣盛发展	7,400	49,728.00	0.10
265	600863	内蒙华电	16,335	49,331.70	0.10
266	600021	上海电力	4,760	48,885.20	0.10
267	002294	信立泰	1,783	48,497.60	0.10

268	000156	华数传媒	2,500	46,375.00	0.10
269	600959	江苏有线	3,293	45,970.28	0.10
270	600666	奥瑞德	1,303	45,292.28	0.09
271	300085	银之杰	1,500	44,850.00	0.09
272	601958	金铂股份	5,491	44,751.65	0.09
273	601928	凤凰传媒	4,244	44,731.76	0.09
274	600600	青岛啤酒	1,519	44,157.33	0.09
275	000027	深圳能源	6,800	43,384.00	0.09
276	600582	天地科技	9,200	41,400.00	0.09
277	002424	贵州百灵	2,400	41,280.00	0.09
278	000825	太钢不锈	12,800	40,448.00	0.08
279	601808	中海油服	3,328	40,435.20	0.08
280	000898	鞍钢股份	10,400	39,832.00	0.08
281	601608	中信重工	7,369	39,571.53	0.08
282	600648	外高桥	2,005	39,518.55	0.08
283	002399	海普瑞	2,203	38,464.38	0.08
284	600871	石化油服	9,997	38,388.48	0.08
285	601118	海南橡胶	6,661	37,234.99	0.08
286	600317	营口港	10,914	36,671.04	0.08
287	600098	广州发展	4,601	35,979.82	0.07
288	600685	中船防务	1,410	35,757.60	0.07
289	600783	鲁信创投	1,617	34,943.37	0.07
290	600578	京能电力	7,740	33,127.20	0.07
291	600998	九州通	1,836	32,148.36	0.07
292	002568	百润股份	1,100	24,200.00	0.05
293	600188	兖州煤业	2,148	23,499.12	0.05
294	600606	绿地控股	2,127	23,014.14	0.05
295	600022	山东钢铁	9,513	22,545.81	0.05
296	603885	吉祥航空	798	20,947.50	0.04
297	601016	节能风电	1,179	11,707.47	0.02
298	002065	东华软件	400	10,040.00	0.02
299	000415	渤海金控	1,400	9,548.00	0.02

7.3.2 期末积极投资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	000629	*ST 钒钛	25,400	60,706.00	0.13

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	601318	中国平安	5,998,588.05	125.90
2	600016	民生银行	4,490,451.00	94.25
3	601166	兴业银行	3,411,025.00	71.59
4	601398	工商银行	3,180,641.00	66.76
5	601857	中国石油	2,694,410.97	56.55
6	600036	招商银行	2,587,845.50	54.32
7	601328	交通银行	2,236,982.00	46.95
8	600030	中信证券	2,178,720.50	45.73
9	600000	浦发银行	2,111,304.00	44.31
10	600837	海通证券	1,990,480.40	41.78
11	601988	中国银行	1,981,016.00	41.58
12	601169	北京银行	1,802,615.00	37.83
13	600519	贵州茅台	1,542,981.00	32.39
14	600887	伊利股份	1,515,403.39	31.81
15	601766	中国中车	1,346,844.50	28.27
16	600028	中国石化	1,306,131.00	27.41
17	601668	中国建筑	1,293,498.05	27.15
18	601601	中国太保	1,231,917.32	25.86
19	601628	中国人寿	1,191,673.00	25.01
20	600048	保利地产	1,009,574.00	21.19
21	000725	京东方 A	979,703.00	20.56
22	600104	上汽集团	970,440.00	20.37
23	601989	中国重工	917,105.00	19.25
24	601818	光大银行	859,024.00	18.03
25	000001	平安银行	846,406.00	17.77
26	600015	华夏银行	845,253.97	17.74
27	601688	华泰证券	828,895.00	17.40
28	600276	恒瑞医药	792,302.00	16.63
29	600518	康美药业	781,420.00	16.40
30	600999	招商证券	747,774.00	15.69
31	600637	东方明珠	741,643.00	15.57

32	000858	五 粮 液	741,309.00	15.56
33	601377	兴业证券	705,941.60	14.82
34	601088	中国神华	695,322.00	14.59
35	002024	苏宁云商	680,234.00	14.28
36	000776	广发证券	674,778.00	14.16
37	601390	中国中铁	662,008.00	13.89
38	300059	东方财富	659,724.00	13.85
39	002450	康得新	657,374.00	13.80
40	601006	大秦铁路	591,516.00	12.42
41	600900	长江电力	570,441.00	11.97
42	601186	中国铁建	560,694.72	11.77
43	601939	建设银行	559,384.00	11.74
44	601998	中信银行	541,592.00	11.37
45	000166	申万宏源	536,463.00	11.26
46	000783	长江证券	532,157.00	11.17
47	002304	洋河股份	529,988.00	11.12
48	600050	中国联通	529,106.00	11.11
49	001979	招商蛇口	522,144.00	10.96
50	002415	海康威视	519,875.00	10.91
51	601899	紫金矿业	514,810.00	10.81
52	601009	南京银行	511,199.00	10.73
53	000100	TCL 集团	509,962.00	10.70
54	601099	太平洋	504,404.80	10.59
55	601985	中国核电	502,352.00	10.54
56	600795	国电电力	501,254.08	10.52
57	601211	国泰君安	490,549.51	10.30
58	600585	海螺水泥	477,638.00	10.03
59	601901	方正证券	462,699.00	9.71
60	600011	华能国际	452,164.00	9.49
61	002594	比亚迪	449,424.00	9.43
62	000538	云南白药	441,952.00	9.28
63	600111	北方稀土	440,679.00	9.25
64	600010	包钢股份	423,612.00	8.89
65	000333	美的集团	420,123.00	8.82
66	600066	宇通客车	419,107.05	8.80
67	600958	东方证券	418,865.00	8.79

68	601555	东吴证券	417,283.00	8.76
69	600383	金地集团	416,543.00	8.74
70	600893	中航动力	414,239.00	8.69
71	300024	机器人	408,681.00	8.58
72	000423	东阿阿胶	408,511.00	8.57
73	601800	中国交建	406,059.50	8.52
74	002736	国信证券	405,951.00	8.52
75	002142	宁波银行	402,165.00	8.44
76	600009	上海机场	401,290.00	8.42
77	300027	华谊兄弟	395,496.00	8.30
78	600690	青岛海尔	393,423.54	8.26
79	300017	网宿科技	393,260.00	8.25
80	600089	特变电工	391,050.00	8.21
81	601669	中国电建	391,038.00	8.21
82	002202	金风科技	390,371.00	8.19
83	601727	上海电气	377,309.14	7.92
84	600018	上港集团	376,484.00	7.90
85	601600	中国铝业	375,419.00	7.88
86	002252	上海莱士	372,312.00	7.81
87	600019	宝钢股份	371,606.00	7.80
88	600570	恒生电子	370,424.00	7.77
89	600109	国金证券	369,671.00	7.76
90	002673	西部证券	363,817.00	7.64
91	600703	三安光电	361,848.00	7.59
92	600352	浙江龙盛	358,617.00	7.53
93	600705	中航资本	356,865.00	7.49
94	600535	天士力	355,750.12	7.47
95	600804	鹏博士	352,962.00	7.41
96	601336	新华保险	349,238.00	7.33
97	002230	科大讯飞	347,525.00	7.29
98	002241	歌尔股份	346,402.00	7.27
99	600196	复星医药	345,315.96	7.25
100	600100	同方股份	344,041.00	7.22
101	600029	南方航空	341,070.00	7.16
102	600886	国投电力	339,948.00	7.14
103	601018	宁波港	338,858.00	7.11

104	600177	雅戈尔	334,601.00	7.02
105	300070	碧水源	330,646.28	6.94
106	002236	大华股份	327,959.00	6.88
107	600660	福耀玻璃	322,103.00	6.76
108	000157	中联重科	321,410.00	6.75
109	000338	潍柴动力	321,041.00	6.74
110	600340	华夏幸福	320,415.00	6.73
111	000069	华侨城 A	319,660.00	6.71
112	600031	三一重工	318,738.00	6.69
113	600369	西南证券	314,279.55	6.60
114	600406	国电南瑞	312,283.00	6.55
115	300315	掌趣科技	306,426.00	6.43
116	600867	通化东宝	305,731.00	6.42
117	002027	分众传媒	304,300.00	6.39
118	601618	中国中冶	303,108.00	6.36
119	601919	中国远洋	302,250.00	6.34
120	601607	上海医药	301,677.00	6.33
121	600547	山东黄金	297,843.00	6.25
122	600415	小商品城	296,698.00	6.23
123	600649	城投控股	295,598.00	6.20
124	600739	辽宁成大	295,410.00	6.20
125	600115	东方航空	290,701.00	6.10
126	600221	海南航空	289,291.00	6.07
127	000009	中国宝安	288,898.00	6.06
128	000503	海虹控股	286,472.00	6.01
129	002008	大族激光	284,740.00	5.98
130	601788	光大证券	281,481.00	5.91
131	000623	吉林敖东	281,108.00	5.90
132	600674	川投能源	279,814.00	5.87
133	600118	中国卫星	276,753.00	5.81
134	000768	中航飞机	275,294.00	5.78
135	000895	双汇发展	274,215.00	5.76
136	002465	海格通信	273,841.00	5.75
137	600606	绿地控股	272,093.00	5.71
138	002456	欧菲光	271,935.00	5.71
139	000728	国元证券	269,744.00	5.66

140	000793	华闻传媒	268,376.76	5.63
141	600085	同仁堂	267,478.00	5.61
142	600023	浙能电力	265,516.00	5.57
143	002385	大北农	263,875.00	5.54
144	600489	中金黄金	262,652.44	5.51
145	000559	万向钱潮	261,271.00	5.48
146	600068	葛洲坝	257,875.00	5.41
147	300124	汇川技术	256,334.00	5.38
148	601888	中国国旅	255,468.00	5.36
149	600718	东软集团	255,326.00	5.36
150	601111	中国国航	252,457.00	5.30
151	601933	永辉超市	252,297.00	5.30
152	600741	华域汽车	251,232.00	5.27
153	000917	电广传媒	250,423.16	5.26
154	600150	中国船舶	245,257.05	5.15
155	000060	中金岭南	244,559.00	5.13
156	600839	四川长虹	244,065.00	5.12
157	600583	海油工程	242,797.86	5.10
158	300058	蓝色光标	242,127.00	5.08
159	600309	万华化学	239,739.83	5.03
160	000876	新希望	239,168.00	5.02
161	002292	奥飞娱乐	235,937.00	4.95
162	000568	泸州老窖	235,448.00	4.94
163	600895	张江高科	232,602.00	4.88
164	300104	乐视网	230,231.00	4.83
165	600252	中恒集团	224,847.00	4.72
166	000963	华东医药	224,679.00	4.72
167	600315	上海家化	224,104.65	4.70
168	600256	广汇能源	221,053.00	4.64
169	000425	徐工机械	220,057.00	4.62
170	000686	东北证券	217,675.48	4.57
171	000540	中天城投	216,499.00	4.54
172	002475	立讯精密	215,186.00	4.52
173	300003	乐普医疗	213,025.00	4.47
174	601106	中国一重	212,853.00	4.47
175	601333	广深铁路	210,865.00	4.43

176	601866	中海集运	209,998.00	4.41
177	000402	金融街	208,549.00	4.38
178	000413	东旭光电	206,502.00	4.33
179	002081	金螳螂	206,282.00	4.33
180	601198	东兴证券	205,531.00	4.31
181	600398	海澜之家	205,456.00	4.31
182	600642	申能股份	205,434.00	4.31
183	601718	际华集团	205,148.00	4.31
184	000750	国海证券	204,086.00	4.28
185	600688	上海石化	203,965.00	4.28
186	300144	宋城演艺	202,960.00	4.26
187	600157	永泰能源	201,678.00	4.23
188	000826	启迪桑德	201,658.49	4.23
189	600875	东方电气	198,220.00	4.16
190	000630	铜陵有色	197,867.00	4.15
191	600820	隧道股份	197,025.00	4.14
192	002739	万达院线	195,907.00	4.11
193	000629	*ST 钒钛	193,924.00	4.07
194	600027	华电国际	193,600.00	4.06
195	002422	科伦药业	191,433.00	4.02
196	601633	长城汽车	188,928.00	3.97
197	000709	河钢股份	187,908.00	3.94
198	601991	大唐发电	184,979.00	3.88
199	600060	海信电器	184,212.00	3.87
200	000778	新兴铸管	183,805.00	3.86
201	000792	盐湖股份	180,903.00	3.80
202	000738	中航动控	178,137.00	3.74
203	600332	白云山	177,676.00	3.73
204	601098	中南传媒	176,615.00	3.71
205	000063	中兴通讯	176,031.00	3.69
206	002007	华兰生物	172,697.00	3.62
207	600005	武钢股份	171,679.00	3.60
208	603993	洛阳钼业	170,796.00	3.58
209	002500	山西证券	169,760.00	3.56
210	601898	中煤能源	169,607.00	3.56
211	000039	中集集团	168,111.95	3.53

212	000983	西山煤电	166,656.00	3.50
213	600362	江西铜业	165,526.00	3.47
214	601179	中国西电	163,677.00	3.44
215	601117	中国化学	162,740.00	3.42
216	601258	庞大集团	161,629.00	3.39
217	300002	神州泰岳	161,166.98	3.38
218	600588	用友网络	161,002.00	3.38
219	000625	长安汽车	158,689.00	3.33
220	600208	新湖中宝	158,368.00	3.32
221	601872	招商轮船	156,801.00	3.29
222	000800	一汽轿车	155,790.00	3.27
223	000061	农产品	154,671.00	3.25
224	601992	金隅股份	154,431.00	3.24
225	300015	爱尔眼科	150,736.00	3.16
226	600827	百联股份	148,453.00	3.12
227	000729	燕京啤酒	148,124.00	3.11
228	002129	中环股份	147,514.00	3.10
229	600863	内蒙华电	146,710.00	3.08
230	600959	江苏有线	142,757.00	3.00
231	601238	广汽集团	142,579.00	2.99
232	000598	兴蓉环境	141,951.00	2.98
233	002470	金正大	141,225.00	2.96
234	002146	荣盛发展	139,588.00	2.93
235	600373	中文传媒	137,354.00	2.88
236	600271	航天信息	136,611.00	2.87
237	600372	中航电子	136,346.00	2.86
238	300133	华策影视	135,460.00	2.84
239	601216	君正集团	134,303.00	2.82
240	000831	*ST 五稀	133,991.00	2.81
241	601808	中海油服	133,516.00	2.80
242	600061	国投安信	133,500.00	2.80
243	600021	上海电力	133,444.00	2.80
244	601021	春秋航空	133,258.16	2.80
245	603000	人民网	128,944.00	2.71
246	002038	双鹭药业	126,689.00	2.66
247	000883	湖北能源	125,694.41	2.64

248	000839	中信国安	123,691.96	2.60
249	300251	光线传媒	122,128.00	2.56
250	601928	凤凰传媒	121,381.00	2.55
251	600166	福田汽车	121,288.00	2.55
252	600038	中直股份	118,558.00	2.49
253	000027	深圳能源	117,945.00	2.48
254	000581	威孚高科	117,189.00	2.46
255	300146	汤臣倍健	115,702.00	2.43
256	600008	首创股份	115,463.57	2.42
257	000999	华润三九	114,487.00	2.40
258	000898	鞍钢股份	112,578.00	2.36
259	002294	信立泰	112,111.00	2.35
260	000825	太钢不锈	111,668.00	2.34
261	002410	广联达	111,155.00	2.33
262	600633	浙报传媒	109,402.00	2.30
263	600485	信威集团	109,363.00	2.30
264	601225	陕西煤业	108,933.00	2.29
265	000400	许继电气	105,550.00	2.22
266	000712	锦龙股份	104,898.78	2.20
267	600663	陆家嘴	104,858.00	2.20
268	300168	万达信息	104,287.00	2.19
269	601958	金钼股份	103,076.00	2.16
270	002375	亚厦股份	103,075.00	2.16
271	601118	海南橡胶	101,992.00	2.14
272	600153	建发股份	101,745.00	2.14
273	600717	天津港	101,609.00	2.13
274	002183	怡亚通	100,995.72	2.12
275	600600	青岛啤酒	100,032.00	2.10
276	000046	泛海控股	98,816.00	2.07
277	600317	营口港	97,974.00	2.06
278	600446	金证股份	97,315.00	2.04
279	002195	二三四五	96,510.00	2.03
280	600549	厦门钨业	96,293.00	2.02
281	603288	海天味业	95,780.00	2.01

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	601318	中国平安	4,233,754.90	88.86
2	600016	民生银行	3,336,005.40	70.02
3	601398	工商银行	2,622,787.86	55.05
4	601857	中国石油	2,509,906.38	52.68
5	601166	兴业银行	2,339,580.28	49.11
6	600036	招商银行	1,722,011.40	36.14
7	601988	中国银行	1,611,050.80	33.81
8	600030	中信证券	1,504,118.42	31.57
9	600000	浦发银行	1,440,347.74	30.23
10	601328	交通银行	1,429,239.39	30.00
11	600837	海通证券	1,408,572.28	29.56
12	601169	北京银行	1,245,874.98	26.15
13	600887	伊利股份	1,075,697.38	22.58
14	600028	中国石化	1,050,708.69	22.05
15	601628	中国人寿	992,820.59	20.84
16	600519	贵州茅台	946,251.20	19.86
17	601766	中国中车	869,368.81	18.25
18	601668	中国建筑	855,545.27	17.96
19	601601	中国太保	819,411.76	17.20
20	000725	京东方 A	654,326.00	13.73
21	600048	保利地产	639,555.10	13.42
22	600104	上汽集团	630,252.89	13.23
23	601989	中国重工	588,083.95	12.34
24	601688	华泰证券	569,681.90	11.96
25	600015	华夏银行	559,563.10	11.74
26	601088	中国神华	548,515.68	11.51
27	601818	光大银行	547,587.51	11.49
28	600637	东方明珠	541,838.92	11.37
29	600518	康美药业	536,515.78	11.26
30	000001	平安银行	533,153.00	11.19
31	600276	恒瑞医药	500,979.80	10.52
32	000858	五粮液	494,866.00	10.39
33	601377	兴业证券	492,407.60	10.34
34	600999	招商证券	490,311.55	10.29

35	002024	苏宁云商	463,885.00	9.74
36	601998	中信银行	445,694.00	9.35
37	002450	康得新	442,609.00	9.29
38	000776	广发证券	441,395.00	9.26
39	601390	中国中铁	420,078.06	8.82
40	300059	东方财富	416,210.00	8.74
41	601006	大秦铁路	371,935.87	7.81
42	000783	长江证券	369,293.00	7.75
43	601939	建设银行	367,194.49	7.71
44	000100	TCL 集团	357,916.00	7.51
45	601186	中国铁建	354,954.00	7.45
46	601899	紫金矿业	353,804.86	7.43
47	000166	申万宏源	344,705.00	7.23
48	601009	南京银行	343,834.02	7.22
49	601099	太平洋	343,629.00	7.21
50	601211	国泰君安	341,654.56	7.17
51	600050	中国联通	336,893.83	7.07
52	002415	海康威视	331,780.00	6.96
53	001979	招商蛇口	323,275.00	6.79
54	002304	洋河股份	320,650.12	6.73
55	601985	中国核电	318,363.05	6.68
56	600795	国电电力	309,409.69	6.49
57	600585	海螺水泥	308,854.50	6.48
58	601800	中国交建	304,812.56	6.40
59	601901	方正证券	303,897.16	6.38
60	600111	北方稀土	292,806.41	6.15
61	600011	华能国际	288,431.84	6.05
62	000538	云南白药	287,810.53	6.04
63	600018	上港集团	287,134.11	6.03
64	000423	东阿阿胶	284,603.99	5.97
65	600066	宇通客车	284,231.01	5.97
66	601555	东吴证券	283,890.28	5.96
67	002594	比亚迪	274,626.93	5.76
68	300017	网宿科技	270,682.00	5.68
69	600089	特变电工	266,461.32	5.59
70	600010	宝钢股份	266,142.70	5.59
71	300024	机器人	264,411.00	5.55
72	002252	上海莱士	264,322.00	5.55

73	002142	宁波银行	264,075.40	5.54
74	600570	恒生电子	261,775.46	5.49
75	300027	华谊兄弟	261,365.00	5.49
76	600383	金地集团	261,355.88	5.49
77	600690	青岛海尔	259,694.00	5.45
78	002202	金风科技	259,417.00	5.44
79	600009	上海机场	258,333.84	5.42
80	600893	中航动力	255,402.64	5.36
81	601669	中国电建	247,765.00	5.20
82	600109	国金证券	246,119.94	5.17
83	600352	浙江龙盛	245,998.90	5.16
84	600606	绿地控股	241,939.10	5.08
85	600804	鹏博士	240,828.42	5.05
86	601727	上海电气	240,645.53	5.05
87	601600	中国铝业	240,558.26	5.05
88	600703	三安光电	236,494.24	4.96
89	600535	天士力	235,552.36	4.94
90	002027	分众传媒	230,300.00	4.83
91	600196	复星医药	229,557.98	4.82
92	600100	同方股份	228,949.80	4.81
93	600177	雅戈尔	228,166.73	4.79
94	002241	歌尔股份	227,868.40	4.78
95	002236	大华股份	225,826.00	4.74
96	600029	南方航空	225,757.20	4.74
97	600369	西南证券	224,552.44	4.71
98	600705	中航资本	223,463.91	4.69
99	600886	国投电力	223,046.04	4.68
100	000338	潍柴动力	218,628.00	4.59
101	600660	福耀玻璃	218,516.22	4.59
102	600019	宝钢股份	218,207.00	4.58
103	600315	上海家化	216,742.95	4.55
104	000157	中联重科	215,653.00	4.53
105	000503	海虹控股	211,380.00	4.44
106	002230	科大讯飞	210,289.00	4.41
107	601018	宁波港	209,866.20	4.40
108	600867	通化东宝	208,609.10	4.38
109	600547	山东黄金	208,412.00	4.37
110	600031	三一重工	205,065.00	4.30

111	600406	国电南瑞	204,456.50	4.29
112	300070	碧水源	204,227.00	4.29
113	601607	上海医药	203,075.00	4.26
114	600340	华夏幸福	202,925.99	4.26
115	000069	华侨城 A	199,347.00	4.18
116	002008	大族激光	193,188.00	4.05
117	601618	中国中冶	191,065.72	4.01
118	600221	海南航空	190,587.48	4.00
119	000623	吉林敖东	189,137.00	3.97
120	002736	国信证券	188,137.00	3.95
121	002385	大北农	188,136.00	3.95
122	600739	辽宁成大	187,925.46	3.94
123	600415	小商品城	187,464.44	3.93
124	600085	同仁堂	187,060.55	3.93
125	002673	西部证券	186,119.00	3.91
126	002456	欧菲光	185,506.00	3.89
127	300315	掌趣科技	184,874.00	3.88
128	600115	东方航空	184,238.34	3.87
129	600674	川投能源	183,436.70	3.85
130	601336	新华保险	177,989.62	3.74
131	000983	西山煤电	176,991.00	3.71
132	600118	中国卫星	176,819.94	3.71
133	000009	中国宝安	176,420.00	3.70
134	601788	光大证券	175,928.02	3.69
135	600489	中金黄金	175,880.98	3.69
136	600068	葛洲坝	172,541.02	3.62
137	000895	双汇发展	171,354.00	3.60
138	000768	中航飞机	169,998.00	3.57
139	600649	城投控股	169,765.00	3.56
140	300058	蓝色光标	168,475.00	3.54
141	000559	万向钱潮	168,222.00	3.53
142	601919	中国远洋	168,085.15	3.53
143	600839	四川长虹	167,858.64	3.52
144	000793	华闻传媒	166,861.00	3.50
145	300124	汇川技术	166,468.00	3.49
146	601933	永辉超市	162,042.99	3.40
147	600958	东方证券	160,725.00	3.37
148	000917	电广传媒	160,432.00	3.37

149	601111	中国国航	159,877.96	3.36
150	600718	东软集团	159,428.08	3.35
151	600309	万华化学	159,228.32	3.34
152	601238	广汽集团	158,147.00	3.32
153	600741	华域汽车	157,829.68	3.31
154	000568	泸州老窖	157,294.48	3.30
155	002465	海格通信	156,501.00	3.28
156	600583	海油工程	156,165.60	3.28
157	600150	中国船舶	155,409.76	3.26
158	000060	中金岭南	154,787.00	3.25
159	000728	国元证券	152,878.00	3.21
160	600252	中恒集团	150,966.90	3.17
161	600023	浙能电力	146,417.30	3.07
162	600895	张江高科	146,087.60	3.07
163	000876	新希望	145,632.00	3.06
164	000425	徐工机械	145,224.00	3.05
165	600256	广汇能源	144,728.60	3.04
166	601888	中国国旅	143,623.23	3.01
167	002038	双鹭药业	142,645.00	2.99
168	601333	广深铁路	140,508.80	2.95
169	000598	兴蓉环境	139,758.00	2.93
170	000963	华东医药	137,562.40	2.89
171	600900	长江电力	136,363.90	2.86
172	002292	奥飞娱乐	135,808.00	2.85
173	000402	金融街	135,402.00	2.84
174	300003	乐普医疗	134,263.00	2.82
175	601633	长城汽车	133,864.44	2.81
176	600642	申能股份	133,681.00	2.81
177	000413	东旭光电	132,709.00	2.79
178	000750	国海证券	132,061.00	2.77
179	600875	东方电气	130,663.28	2.74
180	600398	海澜之家	130,608.23	2.74
181	601106	中国一重	130,309.87	2.74
182	600688	上海石化	130,073.50	2.73
183	000686	东北证券	128,348.00	2.69
184	601866	中海集运	128,159.37	2.69
185	600820	隧道股份	127,372.57	2.67
186	002422	科伦药业	126,914.00	2.66

187	600166	福田汽车	126,537.00	2.66
188	601718	际华集团	125,642.60	2.64
189	300144	宋城演艺	124,353.00	2.61
190	000831	*ST 五稀	123,362.00	2.59
191	600027	华电国际	123,299.75	2.59
192	600157	永泰能源	123,033.64	2.58
193	600060	海信电器	122,968.47	2.58
194	000581	威孚高科	122,510.44	2.57
195	000826	启迪桑德	121,583.00	2.55
196	600549	厦门钨业	121,542.00	2.55
197	002475	立讯精密	121,178.00	2.54
198	002081	金螳螂	120,766.16	2.53
199	002410	广联达	120,574.63	2.53
200	601898	中煤能源	119,458.75	2.51
201	000778	新兴铸管	119,426.00	2.51
202	600332	白云山	117,894.06	2.47
203	601991	大唐发电	117,777.64	2.47
204	002007	华兰生物	115,297.00	2.42
205	000709	河钢股份	115,014.00	2.41
206	000400	许继电气	114,716.41	2.41
207	000540	中天城投	112,520.00	2.36
208	000629	*ST 钒钛	112,250.00	2.36
209	000792	盐湖股份	112,154.00	2.35
210	600633	浙报传媒	111,354.00	2.34
211	300002	神州泰岳	111,117.00	2.33
212	601098	中南传媒	109,636.64	2.30
213	000738	中航动控	108,434.92	2.28
214	000039	中集集团	108,415.00	2.28
215	002500	山西证券	107,815.00	2.26
216	600362	江西铜业	105,079.68	2.21
217	002375	亚厦股份	103,729.02	2.18
218	603288	海天味业	103,187.00	2.17
219	601179	中国西电	102,427.50	2.15
220	601117	中国化学	101,506.28	2.13
221	600717	天津港	101,478.00	2.13
222	600005	武钢股份	99,546.00	2.09
223	600959	江苏有线	99,537.28	2.09
224	000061	农产品	98,732.00	2.07

225	601992	金隅股份	98,712.59	2.07
226	000630	铜陵有色	98,345.00	2.06
227	000800	一汽轿车	98,226.00	2.06
228	000729	燕京啤酒	98,215.00	2.06
229	601699	潞安环能	96,726.00	2.03
230	601872	招商轮船	96,165.72	2.02

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	125,137,651.88
卖出股票收入（成交）总额	83,045,244.92

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所有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

(1) 本基金本报告期末未持有股指期货。(2) 本基金本报告期末未进行股指期货投资。

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

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货。

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

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货。

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	54,543.46
2	应收证券清算款	917,860.24
3	应收股利	-
4	应收利息	880.26
5	应收申购款	6,082.02
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	979,365.98

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**7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000629	*ST 钒钛	60,706.00	0.13	重大资产重组

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息**8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		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
896	52,048.87	38,947,694.11	83.51%	7,688,091.21	16.49%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	1,892,624.17	4.06%

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

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	>100

注：本报告期末本基金基金经理未持有本开放式基金份额。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014 年 6 月 17 日）基金份额总额	234,720,620.35
本报告期期初基金份额总额	3,461,960.99
本报告期基金总申购份额	6,854,059,729.75
减:本报告期基金总赎回份额	6,810,885,905.42
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	46,635,785.32

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

本报告期内本基金投资策略未改变。

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	
中金公司	2	155,921,523.16	74.90%	114,026.29	74.90%	-
东兴证券	2	52,261,373.64	25.10%	38,219.07	25.10%	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-

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
中金公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券	1,061.20	100.00%	-	-	-	-

中泰证券	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	前海开源基金管理有限公司旗下基金 2015 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	中国证券报、基金管理人的官方网站	2016 年 1 月 4 日
2	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加腾元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	中国证券报、基金管理人的官方网站	2016 年 1 月 11 日
3	前海开源基金管理有限公司关于降低旗下开放式基金在天天基金销售平台申购金额下限的公告	中国证券报、基金管理人的官方网站	2016 年 1 月 18 日
4	前海开源沪深 300 指数型证券投资基金 2015 年第 4 季度报告	中国证券报、基金管理人的官方网站	2016 年 1 月 22 日
5	前海开源沪深 300 指数型证券投资基金招募说明书（更新）（2015 年第 2 号）摘要	中国证券报、基金管理人的官方网站	2016 年 1 月 30 日
6	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加平安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	中国证券报、基金管理人的官方网站	2016 年 2 月 29 日
7	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金参加好买基金费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人的官方网站	2016 年 3 月 3 日
8	前海开源沪深 300 指数型证券投资基金 2016 年度第一次收益分配公告	中国证券报、基金管理人的官方网站	2016 年 3 月 4 日
9	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金在大同证券开通定投业务的公告	中国证券报、基金管理人的官方网站	2016 年 3 月 11 日
10	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加利得基金为代销机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人的官方网站	2016 年 3 月 18 日
11	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金参加同花顺费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人的官方网站	2016 年 3 月 22 日
12	前海开源沪深 300 指数型证券投资基金	基金管理人的官方	2016 年 3 月 30 日

	基金 2015 年年度报告	网站	
13	前海开源沪深 300 指数型证券投资基金 2015 年年度报告摘要	中国证券报、基金管理人的官方网站	2016 年 3 月 30 日
14	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加英大证券为代销机构的公告	中国证券报、基金管理人的官方网站	2016 年 3 月 30 日
15	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金参加新兰德费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人的官方网站	2016 年 3 月 31 日
16	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加华龙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	中国证券报、基金管理人的官方网站	2016 年 4 月 6 日
17	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加鑫鼎盛为代销机构及开通定投和转换业务的公告	中国证券报、基金管理人的官方网站	2016 年 4 月 8 日
18	前海开源基金管理有限公司关于银河证券费率调整的公告	中国证券报、基金管理人的官方网站	2016 年 4 月 18 日
19	前海开源基金管理有限公司关于联泰资产费率调整的公告	中国证券报、基金管理人的官方网站	2016 年 4 月 20 日
20	前海开源沪深 300 指数型证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	中国证券报、基金管理人的官方网站	2016 年 4 月 21 日
21	前海开源沪深 300 指数型证券投资基金增聘基金经理公告	中国证券报、基金管理人的官方网站	2016 年 4 月 22 日
22	前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加伯嘉基金为代销机构的公告	中国证券报、基金管理人的官方网站	2016 年 4 月 29 日
23	前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加汇成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	中国证券报、基金管理人的官方网站	2016 年 4 月 29 日
24	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加金斧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	中国证券报、基金管理人的官方网站	2016 年 4 月 29 日
25	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加广州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	中国证券报、基金管理人的官方网站	2016 年 5 月 5 日
26	前海开源基金管理有限公司关于和讯公司费率调整的公告	中国证券报、基金管理人的官方网站	2016 年 5 月 11 日
27	前海开源基金管理有限公司关于降低旗下基金在好买基金申购金	中国证券报、基金管理人的官方网站	2016 年 5 月 23 日

	额下限的公告		
28	前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加联讯证券为代销机构并开通定投和转换业务的公告	中国证券报、基金管理人的官方网站	2016 年 5 月 24 日
29	前海开源基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加盈米财富申购补差费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人的官方网站	2016 年 6 月 1 日
30	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加凯恩斯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	中国证券报、基金管理人的官方网站	2016 年 6 月 6 日
31	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加京西票号为代销机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人的官方网站	2016 年 6 月 7 日
32	前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华泰证券为代销机构并开通定投业务的公告	中国证券报、基金管理人的官方网站	2016 年 6 月 16 日
33	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金参加华泰证券费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人的官方网站	2016 年 6 月 20 日
34	前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金在陆金所资管开通定投业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人的官方网站	2016 年 6 月 24 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (1) 中国证券监督管理委员会批准前海开源沪深 300 指数型证券投资基金设立的文件
- (2) 《前海开源沪深 300 指数型证券投资基金基金合同》
- (3) 《前海开源沪深 300 指数型证券投资基金托管协议》

- (4) 《前海开源沪深 300 指数型证券投资基金招募说明书》
- (5) 基金管理人业务资格批件和营业执照
- (6) 前海开源沪深 300 指数型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

12.3 查阅方式

- (1) 投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件
- (2) 投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人前海开源基金管理有限公司，客户服务电话：4001-666-998（免长途话费）
- (3) 投资者可访问本基金管理人公司网站，网址：www.qhkyfund.com

前海开源基金管理有限公司
2016 年 8 月 29 日