

前海开源沪港深智慧生活优选灵活配置混合型证券投资基金 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 1 月 26 日（基金合同生效日）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.....	7
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	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
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.....	11
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.....	11
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.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
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	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	13
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.....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	36
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.....	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	41
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.....	41
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.....	41
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.....	41
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.....	42
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	42
7.12 投资组合报告附注.....	42

§8 基金份额持有人信息	43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	43
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.....	43
§9 开放式基金份额变动	43
§10 重大事件揭示	44
10.1 基金份额持有人大会决议.....	44
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.....	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	44
10.4 基金投资策略的改变.....	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	44
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.....	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	44
10.8 其他重大事件.....	45
§11 影响投资者决策的其他重要信息	50
§12 备查文件目录	50
12.1 备查文件目录.....	50
12.2 存放地点.....	50
12.3 查阅方式.....	50

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	前海开源沪港深智慧生活优选灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	前海开源沪港深智慧生活混合
基金主代码	001972
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 1 月 26 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	110,084,509.14 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过精选投资于智慧生活主题相关证券，挖掘“互联网+”全面渗透和居民消费结构升级过程中的投资机会，在合理控制风险并保持基金资产良好流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>本基金的投资策略主要有以下六方面内容：</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>（1）智慧生活主题的定义</p> <p>本基金所指的智慧生活，是指通过科学技术的创新或者应用，或是新的商业模式的构建或者应用，使得居民生活（包括衣、食、住、行等）更加便捷高效，或更加安全健康，或更加绿色环保。</p> <p>具体地，本基金将“智慧生活”主题聚焦于以下几方面的投资标的：一是衣，包括智能穿戴等，指对日常穿戴进行智能化设计、开发出可以穿戴设备的公司；二是食，包括智能农业等，是集新兴的互联网、移动互联网、云计算和物联网技术为一体，为农业生产提供精准化种植、可视化管理、智能化决策的企业；三是住，包括智能家居等，是以住宅为平台，利用综合布线技术、网络通信技术、自动控制技术、音视频技术将家居生活有关的设施集成，构建高效的住宅设施与家庭日程事务管理的公司；四是行，包括智能交通等，指辅助实现交通的智能监管和调控的公司，它综合运用信息技术、电子控制、影像处理等多种</p>

技术，能快速准确实现交通信息采集、处理、决策、指挥调度。

智慧生活主题相关行业的范畴会随着技术的进步不断变化，基金管理人将持续跟踪相关行业最新技术及商业模式的发展，对智慧生活主题相关行业的定义进行动态更新。

（2）个股投资策略

在个股选择上，除了筛选出与智慧生活主题相关的上市公司外，本基金还将根据上市公司所处行业特点，综合考虑公司质地和业绩弹性等因素，寻找基本面健康、业绩向上弹性较大、估值有优势的公司进行投资。在公司质地方面，选择治理结构优良、竞争优势强、管理水平高、资产负债表健康的公司；在业绩弹性方面，重点考虑盈利能力相对产能利用率、价格、成本弹性较大的公司；在估值方面，综合考虑市净率、市销率、EV/EBITDA、重置价值、市盈率等估值指标，选择估值具有较好安全边际的公司。通过对备选公司以上方面的分析，本基金将优选出具有综合优势的股票构建投资组合，并根据行业趋势、估值水平等因素进行动态调整。

（3）港股通标的股票投资策略

本基金可通过沪港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，不使用合格境内机构投资者(QDII)境外投资额度进行境外投资。本基金将遵循智慧生活主题相关股票的投资策略，优先将基本面健康、业绩向上弹性较大、具有估值优势的港股纳入本基金的股票投资组合。

3、债券投资策略

在债券投资策略方面，本基金将以智慧生活主题相关债券为主线，在综合研究的基础上实施积极主动的组合管理，采用宏观环境分析和微观市场定价分析两个方面进行债券资产的投资。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。

4、权证投资策略

在权证投资方面，本基金根据权证对应公司基本面研究成果确定权证的合理估值，发现市场对股票权证的非理性定价；利用权证衍生工具的特性，通过权证与证券的组合投资，来达到改善组合风险收益特征的目的。

5、资产支持证券投资策略

本基金通过对资产支持证券发行条款的分析、违约概率和提前偿付比率的预估，借用必要的数量模型来谋求对资产支持证券的合理定价，在严格控制风险、充分考虑风险补偿收益和市场流动性的条件下，谨慎选择风险调整后收益较高的品种进行投资。

本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。

6、股指期货投资策略

本基金以套期保值为目的，参与股指期货交易。

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

	<p>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遵从其最新规定，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。本基金如果投资港股通标的的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		前海开源基金管理有限公司	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、证券日报
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26日 - 2016年6月30日)
本期已实现收益	9,878,082.20
本期利润	11,369,930.91
加权平均基金份额本期利润	0.0964
本期加权平均净值利润率	9.44%
本期基金份额净值增长率	6.00%
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	6,616,738.23
期末可供分配基金份额利润	0.0601
期末基金资产净值	116,701,247.37
期末基金份额净值	1.060
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	6.00%

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

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

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

④ 本基金的基金合同于2016年1月26日生效，截止2016年6月30日，本基金成立未满1年。

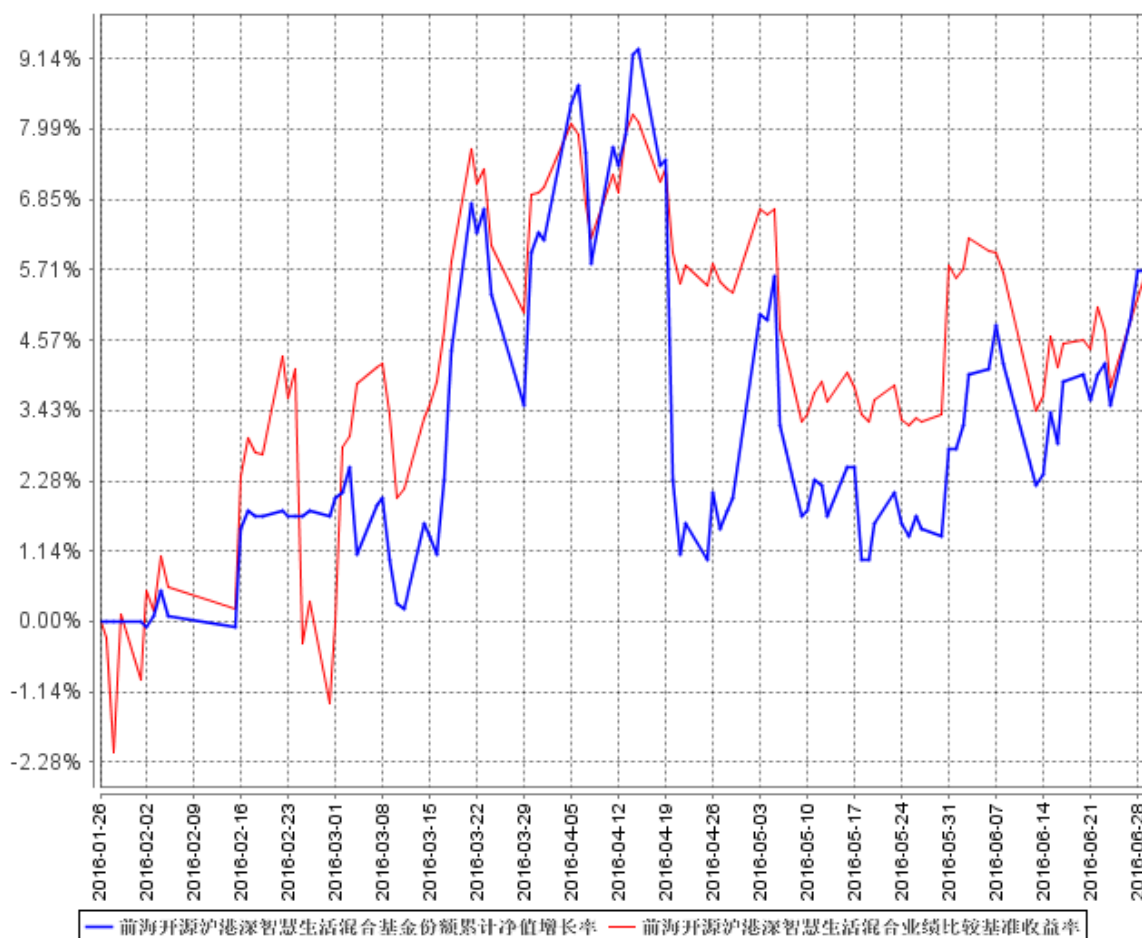
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	3.11%	0.73%	-0.11%	0.69%	3.22%	0.04%
过去三个月	-0.28%	1.13%	-1.23%	0.71%	0.95%	0.42%
自基金合同生效起至今	6.00%	1.03%	5.66%	0.99%	0.34%	0.04%

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：①本基金的基金合同于 2016 年 1 月 26 日生效，截至 2016 年 6 月 30 日止，本基金成立未满 1 年。

②本基金的建仓期为 6 个月，截至 2016 年 6 月 30 日，本基金建仓期尚未结束。

§ 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		
赵雪芹	本基金的基金经理、公司董事总经理、联席投资总监	2016 年 1 月 26 日	-	13 年	赵雪芹女士，经济学博士研究生，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。
栾菲	本基金的基金经理	2016 年 2 月 16 日	-	7 年	栾菲女士，荷兰蒂尔堡大学硕士研究生，曾任秦皇岛市广播电视中心职员，2008 年至 2015 年 4 月任中国人保资产管理股份有限公司研究员。2015 年 4 月加入前海开源基金管理有限公司。

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、《前海开源沪港深智慧生活优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

年初至今，市场呈普跌态势，报告期内，上证指数累计下跌 17.22%。上证指数最低下探至 2638.3 点，全月跌幅 22.65%，此后 5 个月全球不确定性因素陡增压制增量资金进场热情，市场整体成交量始终难以放大，股市进入存量博弈阶段，各主要指数均呈窄幅震荡走势。一季度，本基金通过审慎择时、合理控制仓位，有效得控制了 2 月份的回撤风险，并积极把握 3 月份战略性做多的时间窗口，从中长期投资角度布局投资品种，始终保持正收益。二季度，在存量博弈的市场环境下，短期资金聚焦个股行情，热点板块轮动迅速且多数缺乏可持续性，本基金淡化短期博弈因素对股价的暂时性影响，重点布局具备长期增长潜力和发展空间的消费与生活产业链，在智能家居、物联网、信息安全、文化娱乐、医药医疗、社会服务、食品饮料等行业中，沿着业绩高增长、景气度向上、政策红利受益三大主线，优选业绩增长和分红稳定的消费股、成长和估值间高性价比预期的成长股以及“十三五规划”政策红利受益股，对持仓结构进行了优化。在上半年的操作过程中，本基金始终恪守震荡市下仓位控制的谨慎性原则，通过适度分散持仓和分步建仓来降低波动性、严控回撤风险，保障了持有人利益。

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 6.00%，同期业绩比较基准收益率为 5.66%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前困扰 A 股市场的主要问题是来自于增长放缓的压力，无论是上市公司财报讯息，还是各种宏观经济指标揭示出的信号，都表明需求下滑带来的增长风险在切实发生。展望下半年，一方

面，预计企业盈利的下降周期仍未见底，增长的风险还未完全消除，通胀结构性高企和经济弱复苏态势仍将延续，股市运行的宏观大环境难有实质性改变。另一方面，在经历了“千股跌停”、去杠杆、人民币贬值、“熔断”等多重利空打击后，顶层设计开始不断释放积极维稳信号、人民币汇率风险已被市场基本消化、市场风险偏好在逐渐恢复，宏观流动性亦趋于稳定，资金大量流入或流出股市的可能性都较低，股市在一段时间内仍将延续存量博弈的震荡格局。预计结构性反弹行情将在震荡过程中不断迸发，个股分化行情亦将愈演愈烈，仓位把握与择时将是决定绝对收益与相对收益的关键。

十三五期间，“改革”的重要性显著提高，“创新”亦被置于突出位置，在供给收缩及需求扩张大环境下，市场走势取决于促改革与稳增长的统筹并进。本基金将沿“十三五规划”主线，重点布局消费与生活产业链，如以智能家居、物联网、服务机器人、大数据和网络安全、环保和新能源消费等为代表的科技消费，和以文化、教育、体育、娱乐、医疗、养老等为代表的现代服务，同时配合审慎合理的仓位控制，力争在下半年为投资者带来较好的投资回报。

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的情形。

本基金 2016 年 4 月 18 日至 2016 年 5 月 9 日连续 15 个工作日基金资产净值低于五千万万元。

§ 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：前海开源沪港深智慧生活优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	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	52,808,830.57
结算备付金		644,644.72
存出保证金		161,780.86
交易性金融资产	6.4.7.2	64,655,088.97
其中：股票投资		64,655,088.97

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		95,517.70
应收利息	6.4.7.5	8,660.36
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		118,374,523.18
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年6月30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		0.24
应付赎回款		1,218,127.35
应付管理人报酬		125,988.17
应付托管费		20,998.03
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	194,843.61
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	113,318.41
负债合计		1,673,275.81
所有者权益:		
实收基金	6.4.7.9	110,084,509.14
未分配利润	6.4.7.10	6,616,738.23
所有者权益合计		116,701,247.37
负债和所有者权益总计		118,374,523.18

注：①报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.060 元，基金份额总额 110,084,509.14 份。

②本基金的基金合同于 2016 年 1 月 26 日生效，无上年度末可比数据。

6.2 利润表

会计主体：前海开源沪港深智慧生活优选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 26 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016 年 1 月 26 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		13,120,135.30
1.利息收入		450,831.50
其中：存款利息收入	6.4.7.11	182,029.16
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		268,802.34
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		10,243,500.33
其中：股票投资收益	6.4.7.12	10,052,711.23
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-
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	190,789.10
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,491,848.71
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	933,954.76
减：二、费用		1,750,204.39
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	786,898.28
2. 托管费	6.4.10.2.2	131,149.67
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 交易费用	6.4.7.19	716,586.06
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	115,570.38
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		11,369,930.91
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		11,369,930.91

注：本基金的基金合同于 2016 年 1 月 26 日生效，实际报告期间为 2016 年 1 月 26 日（基金合同生效日）到 2016 年 6 月 30 日，无上年度可比期间数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：前海开源沪港深智慧生活优选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 26 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 26 日(基金合同生效日)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)	277,514,848.36	-	277,514,848.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	11,369,930.91	11,369,930.91
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)	-167,430,339.22	-4,753,192.68	-172,183,531.90
其中：1.基金申购款	73,390,638.22	1,435,322.89	74,825,961.11
2.基金赎回款	-240,820,977.44	-6,188,515.57	-247,009,493.01
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)	110,084,509.14	6,616,738.23	116,701,247.37

注：本基金的基金合同于 2016 年 1 月 26 日生效，实际报告期间为 2016 年 1 月 26 日（基金合同生效日）到 2016 年 6 月 30 日，无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

 蔡颖 李志祥 任福利
 基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

前海开源沪港深智慧生活优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】2372 号文《关于准予前海开源沪港深智慧生活优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》、《前海开源沪港深智慧生活优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 2016 年 1 月 4 日至 2016 年 1 月 22 日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 277,417,195.96 元，经瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）瑞华验字[2016]02230014 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《前海开源沪港深智慧生活优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 1 月 26 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 277,514,848.36 份基金份额，其中认购资金利息折合 97,652.40 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》、《前海开源沪港深智慧生活优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

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系自 2016 年 1 月 26 日（基金合同生效日）起至 2016 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图

和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但

最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，

将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理费和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 30%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股

票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

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	52,808,830.57
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	52,808,830.57

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	63,163,240.26	64,655,088.97	1,491,848.71
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	63,163,240.26	64,655,088.97	1,491,848.71
----	---------------	---------------	--------------

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	8,333.75
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	261.09
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	65.52
合计	8,660.36

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	194,843.61
银行间市场应付交易费用	-
合计	194,843.61

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	2,818.67
预提费用	110,499.74
合计	113,318.41

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月26日(基金合同生效日)至2016年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	277,514,848.36	277,514,848.36
本期申购	73,390,638.22	73,390,638.22
本期赎回(以“-”号填列)	-240,820,977.44	-240,820,977.44
- 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	110,084,509.14	110,084,509.14

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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	9,878,082.20	1,491,848.71	11,369,930.91
本期基金份额交易产生的变动数	-534,258.94	-4,218,933.74	-4,753,192.68
其中：基金申购款	4,778,557.16	-3,343,234.27	1,435,322.89
基金赎回款	-5,312,816.10	-875,699.47	-6,188,515.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,343,823.26	-2,727,085.03	6,616,738.23

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月26日(基金合同生效日)至2016年6月30日
活期存款利息收入	163,919.03
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	15,826.68
其他	2,283.45
合计	182,029.16

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26日(基金合同生效日)至2016 年6月30日
卖出股票成交总额	254,599,090.38
减：卖出股票成本总额	244,546,379.15
买卖股票差价收入	10,052,711.23

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

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.13.2 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26日(基金合同生效日)至2016年6 月30日
----	--

股票投资产生的股利收益	190,789.10
基金投资产生的股利收益	-
合计	190,789.10

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26日(基金合同生效日)至2016 年6月30日
1. 交易性金融资产	1,491,848.71
——股票投资	1,491,848.71
——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	1,491,848.71

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月26日(基金合同生效日)至2016 年6月30日
基金赎回费收入	933,823.96
基金转换费收入	130.80
合计	933,954.76

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月26日(基金合同生效日)至2016 年6月30日
交易所市场交易费用	716,586.06
银行间市场交易费用	-
合计	716,586.06

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月26日(基金合同生效日)至2016 年6月30日
审计费用	23,020.91

信息披露费	87,478.83
其他	550.00
证券组合费	11.46
汇划费	4,509.18
合计	115,570.38

注：“其他”为证券账户开户费、托管户开户费及账户维护费。

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、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。

6.4.10 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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月26日(基金合同生效日)至2016年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
开源证券股份有限公司	228,118,775.58	40.58%

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 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26日(基金合同生效日)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
开源证券股份有限公司	166,823.54	40.58%	68,993.43	35.41%

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 2016年1月26日(基金合同生效日)至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	786,898.28
其中:支付销售机构的客户维护费	281,356.68

注：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 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	
	2016年1月26日(基金合同生效日)至2016年6月30日	
当期发生的基金应支付的托管费	131,149.67	

注：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、公休日等，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	
	2016年1月26日(基金合同生效日)至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	52,808,830.57	163,919.03

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

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300520	科大国创	2016年6月30日	2016年7月8日	新股流通受限	10.05	10.05	771	7,748.55	7,748.55	-
603016	新宏泰	2016年6月23日	2016年7月1日	新股流通受限	8.49	8.49	725	6,155.25	6,155.25	-
002805	丰元股份	2016年6月29日	2016年7月7日	新股流通受限	5.80	5.80	971	5,631.80	5,631.80	-

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
601611	中国核建	2016年6月30日	临时停牌	20.92	2016年7月1日	23.01	2,117	7,345.99	44,287.64	-

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级风险管理架构体系。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	52,808,830.57	-	-	-	52,808,830.57
结算备付金	644,644.72	-	-	-	644,644.72
存出保证金	161,780.86	-	-	-	161,780.86
交易性金融资产	-	-	-	-64,655,088.97	64,655,088.97
应收证券清算款	-	-	-	95,517.70	95,517.70
应收利息	-	-	-	8,660.36	8,660.36
资产总计	53,615,256.15	-	-	-64,759,267.03	118,374,523.18
负债					
应付证券清算款	-	-	-	0.24	0.24
应付赎回款	-	-	-	1,218,127.35	1,218,127.35
应付管理人报酬	-	-	-	125,988.17	125,988.17
应付托管费	-	-	-	20,998.03	20,998.03
应付交易费用	-	-	-	194,843.61	194,843.61
其他负债	-	-	-	113,318.41	113,318.41
负债总计	-	-	-	1,673,275.81	1,673,275.81
利率敏感度缺口	53,615,256.15	-	-	-63,085,991.22	116,701,247.37
上年度末 2015 年 12 月 31 日	1-5 年	5 年以上	不计息	合计	
资产					
负债					

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，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

外汇风险敞口：截至 2016 年 06 月 30 日，以外币计价的资产中，资产合计 1,106,797.65 元人民币，负债合计 0，资产负债表外汇风险敞口净额 1,106,797.65 元人民币。

外汇风险的敏感性分析：假设除汇率外其他市场变量保持不变，所有外币相对人民币升值 5%，对资产负债表日基金资产净值的影响金额为 55,339.88 元人民币；所有外币相对人民币贬值 5%，对资产负债表日基金资产净值的影响金额-55,339.88 元人民币。

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。本基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例为 0-95%（其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的 0-95%，投资于港股通标的股票的比例占基金资产的 0-95%），投资于智慧生活主题相关证券的比例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。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	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	64,655,088.97	55.40
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	64,655,088.97	55.40

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 30 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）

	业绩比较基准增加 5%	3,424,285.34	-
	业绩比较基准减少 5%	-3,424,285.34	

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 64,591,265.73 元，属于第二层次的余额为 63,823.24 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。

(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	64,655,088.97	54.62
	其中：股票	64,655,088.97	54.62
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	53,453,475.29	45.16
7	其他各项资产	265,958.92	0.22
8	合计	118,374,523.18	100.00

注：权益投资中通过沪港通交易机制投资的港股公允价值为 1,106,797.65 元，占资产净值比例 0.95%。

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	47,269,695.66	40.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	5,833,387.64	5.00
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	3,693,287.00	3.16
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,740,911.40	5.78
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	11,009.62	0.01
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	63,548,291.32	54.45

7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
日常消费品	1,106,797.65	0.95
合计	1,106,797.65	0.95

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

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	600690	青岛海尔	747,448	6,637,338.24	5.69
2	002007	华兰生物	203,200	6,380,480.00	5.47
3	600660	福耀玻璃	449,992	6,299,888.00	5.40
4	600332	白云山	245,000	6,036,800.00	5.17
5	600820	隧道股份	690,000	5,789,100.00	4.96
6	002252	上海莱士	130,000	4,898,400.00	4.20
7	600637	东方明珠	195,000	4,732,650.00	4.06
8	600887	伊利股份	280,000	4,667,600.00	4.00
9	600276	恒瑞医药	96,000	3,850,560.00	3.30
10	600118	中国卫星	81,000	2,721,600.00	2.33
11	600279	重庆港九	349,900	2,494,787.00	2.14
12	002415	海康威视	105,000	2,253,300.00	1.93
13	000917	电广传媒	120,000	1,983,600.00	1.70
14	002030	达安基因	60,950	1,694,410.00	1.45
15	600771	广誉远	57,000	1,660,980.00	1.42
16	601021	春秋航空	25,000	1,198,500.00	1.03
17	1112	合生元	50,000	1,106,797.65	0.95
18	601611	中国核建	2,117	44,287.64	0.04

19	603131	上海沪工	623	37,816.10	0.03
20	300515	三德科技	786	36,839.82	0.03
21	601127	小康股份	1,259	30,052.33	0.03
22	002799	环球印务	648	28,278.72	0.02
23	300518	盛讯达	361	16,912.85	0.01
24	002802	洪汇新材	905	13,647.40	0.01
25	603909	合诚股份	599	11,009.62	0.01
26	603958	哈森股份	684	9,918.00	0.01
27	300520	科大国创	771	7,748.55	0.01
28	603016	新宏泰	725	6,155.25	0.01
29	002805	丰元股份	971	5,631.80	0.00

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	002007	华兰生物	13,064,646.05	11.19
2	600196	复星医药	11,664,612.88	10.00
3	600690	青岛海尔	11,618,765.00	9.96
4	600637	东方明珠	10,669,919.36	9.14
5	002030	达安基因	9,875,034.70	8.46
6	600660	福耀玻璃	8,292,343.94	7.11
7	600360	华微电子	7,659,122.77	6.56
8	600332	白云山	7,372,374.76	6.32
9	002252	上海莱士	7,225,627.14	6.19
10	600171	上海贝岭	7,142,238.50	6.12
11	600529	山东药玻	6,981,613.75	5.98
12	300369	绿盟科技	6,731,915.00	5.77
13	600820	隧道股份	6,725,744.68	5.76
14	300408	三环集团	6,605,640.43	5.66
15	600100	同方股份	6,501,263.00	5.57
16	000917	电广传媒	6,298,276.48	5.40
17	000895	双汇发展	5,990,484.50	5.13
18	300383	光环新网	5,918,556.95	5.07
19	600887	伊利股份	5,788,042.06	4.96
20	600037	歌华有线	5,396,445.86	4.62

21	600066	宇通客车	5,396,018.90	4.62
22	601318	中国平安	5,384,387.00	4.61
23	600771	广誉远	5,263,297.00	4.51
24	600161	天坛生物	5,157,204.76	4.42
25	600279	重庆港九	5,141,142.75	4.41
26	600195	中牧股份	5,046,173.00	4.32
27	600570	恒生电子	4,924,553.72	4.22
28	601021	春秋航空	4,775,944.28	4.09
29	601727	上海电气	4,532,277.24	3.88
30	600270	外运发展	4,444,911.00	3.81
31	000423	东阿阿胶	4,158,154.05	3.56
32	300310	宜通世纪	4,000,054.00	3.43
33	002739	万达院线	3,799,356.32	3.26
34	600729	重庆百货	3,797,765.00	3.25
35	600276	恒瑞医药	3,726,427.00	3.19
36	600104	上汽集团	3,672,555.00	3.15
37	300197	铁汉生态	3,625,775.40	3.11
38	002245	澳洋顺昌	3,551,895.00	3.04
39	601991	大唐发电	3,410,558.73	2.92
40	300017	网宿科技	3,359,056.28	2.88
41	600879	航天电子	3,225,241.00	2.76
42	000501	鄂武商A	3,223,135.90	2.76
43	002292	奥飞娱乐	3,213,011.69	2.75
44	600739	辽宁成大	3,137,411.00	2.69
45	002396	星网锐捷	3,096,705.50	2.65
46	600598	北大荒	3,082,722.50	2.64
47	000952	广济药业	3,005,656.54	2.58
48	002037	久联发展	3,005,647.00	2.58
49	600750	江中药业	3,001,600.00	2.57
50	000768	中航飞机	3,001,020.00	2.57
51	002308	威创股份	2,859,835.00	2.45
52	600118	中国卫星	2,746,515.00	2.35
53	002368	太极股份	2,515,687.00	2.16

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600196	复星医药	11,927,974.50	10.22
2	002030	达安基因	8,636,197.43	7.40
3	600360	华微电子	8,559,949.00	7.33
4	600171	上海贝岭	7,307,528.36	6.26
5	002007	华兰生物	7,178,870.43	6.15
6	600529	山东药玻	7,164,995.13	6.14
7	300408	三环集团	7,164,919.44	6.14
8	300369	绿盟科技	7,095,751.00	6.08
9	600100	同方股份	7,059,798.20	6.05
10	300383	光环新网	6,434,071.00	5.51
11	600637	东方明珠	6,406,155.00	5.49
12	000895	双汇发展	6,004,105.32	5.14
13	600037	歌华有线	5,577,717.30	4.78
14	600066	宇通客车	5,541,315.00	4.75
15	601318	中国平安	5,511,472.01	4.72
16	600195	中牧股份	5,314,327.00	4.55
17	600570	恒生电子	5,232,600.00	4.48
18	600690	青岛海尔	5,042,357.90	4.32
19	600161	天坛生物	4,930,043.00	4.22
20	000917	电广传媒	4,704,946.00	4.03
21	000423	东阿阿胶	4,603,013.95	3.94
22	601727	上海电气	4,550,578.80	3.90
23	600270	外运发展	4,471,530.15	3.83
24	600729	重庆百货	4,410,301.50	3.78
25	002739	万达院线	4,306,063.00	3.69
26	600771	广誉远	4,285,587.00	3.67
27	300197	铁汉生态	4,229,404.19	3.62
28	300310	宜通世纪	4,087,232.00	3.50
29	002245	澳洋顺昌	3,854,219.00	3.30
30	601021	春秋航空	3,714,306.48	3.18
31	600104	上汽集团	3,697,719.49	3.17
32	002292	奥飞娱乐	3,530,194.00	3.02
33	300017	网宿科技	3,443,853.00	2.95
34	601991	大唐发电	3,378,892.81	2.90

35	002037	久联发展	3,363,951.80	2.88
36	002396	星网锐捷	3,320,736.79	2.85
37	000501	鄂武商 A	3,294,908.00	2.82
38	600739	辽宁成大	3,290,262.00	2.82
39	600750	江中药业	3,237,970.00	2.77
40	000768	中航飞机	3,171,911.69	2.72
41	600598	北大荒	3,044,420.92	2.61
42	600279	重庆港九	2,941,920.00	2.52
43	600879	航天电子	2,722,922.00	2.33
44	600309	万华化学	2,623,717.64	2.25
45	000952	广济药业	2,524,642.33	2.16
46	002308	威创股份	2,450,255.00	2.10
47	002566	益盛药业	2,402,705.00	2.06
48	002252	上海莱士	2,341,678.68	2.01

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	307,709,619.41
卖出股票收入（成交）总额	254,599,090.38

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

本基金本报告期内未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	161,780.86
2	应收证券清算款	95,517.70
3	应收股利	-
4	应收利息	8,660.36
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	265,958.92

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

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
1,105	99,623.99	68,692,306.18	62.40%	41,392,202.96	37.60%

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、基金投资和研究部负责人、本基金基金经理未持有本开放式基金份额。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年1月26日）基金份额总额	277,514,848.36
本报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	73,390,638.22
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	240,820,977.44

基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	110,084,509.14

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

本报告期内基金投资策略未发生改变。

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	
东兴证券	1	333,070,159.65	59.25%	243,572.14	59.24%	-

开源证券	1	228,118,775.58	40.58%	166,823.54	40.58%	-
中泰证券	2	937,116.36	0.17%	749.68	0.18%	-

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
东兴证券	-	-	1,285,000,000.00	100.00%	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
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	中国证券报、证券日报、基金管理人的官方网站	2016年1月11日

	其费率优惠活动的公告		
2	关于前海开源沪港深智慧生活优选灵活配置混合型证券投资基金增加广发证券为代销机构的公告	中国证券报、证券日报、基金管理人的官方网站	2016 年 1 月 18 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、证券日报、基金管理人的官方网站	2016 年 1 月 18 日
4	前海开源沪港深智慧生活优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同生效公告	中国证券报、证券日报、基金管理人的官方网站	2016 年 1 月 27 日
5	前海开源沪港深智慧生活优选灵活配置混合型证券投资基金增聘基金经理的公告	中国证券报、证券日报、基金管理人的官方网站	2016 年 2 月 17 日
6	关于前海开源沪港深智慧生活优选灵活配置混合型证券投资基金参与部分代销机构费率优惠活动的公告	中国证券报、证券日报、基金管理人的官方网站	2016 年 2 月 26 日
7	前海开源沪港深智慧生活优选灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定投业务的公告	中国证券报、证券日报、基金管理人的官方网站	2016 年 2 月 26 日
8	前海开源沪港深智慧生活优选灵活配置混合型证券投资基金关于非港股通交易日暂停申购、赎回等交易类业务的公告	中国证券报、证券日报、基金管理人的官方网站	2016 年 2 月 29 日
9	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	中国证券报、证券日报、基金管理人的官	2016 年 2 月 29 日

	构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告	方网站	
10	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、证券日报、基金管理人的官方网站	2016 年 3 月 3 日
11	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、证券日报、基金管理人的官方网站	2016 年 3 月 11 日
12	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、证券日报、基金管理人的官方网站	2016 年 3 月 18 日
13	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、证券日报、基金管理人的官方网站	2016 年 3 月 22 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、证券日报、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、证券日报、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、证券日报、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、证券日报、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、证券日报、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、证券日报、基金管理人的官方网站	2016 年 4 月 20 日
20	前海开源沪港深智慧生活优选灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	中国证券报、证券日报、基金管理人的官方网站	2016 年 4 月 21 日
21	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、证券日报、基金管理人的官方网站	2016 年 4 月 29 日
22	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、证券日报、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、证券日报、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、证券日报、基金管理人的官方网站	2016 年 5 月 5 日
25	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、证券日报、基金管理人的官方网站	2016 年 5 月 11 日
26	关于前海开源沪港深智慧生活优选灵活配置混合型证券投资基金	中国证券报、证券日报、基金管理人的官方网站	2016 年 5 月 13 日

	增加盈米财富为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告	方网站	
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额下限的公告	中国证券报、证券日报、基金管理人的官方网站	2016 年 5 月 23 日
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、证券日报、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、证券日报、基金管理人的官方网站	2016 年 6 月 6 日
30	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、证券日报、基金管理人的官方网站	2016 年 6 月 7 日
31	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、证券日报、基金管理人的官方网站	2016 年 6 月 16 日
32	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、证券日报、基金管理人的官方网站	2016 年 6 月 20 日
33	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、证券日报、基金管理人的官方网站	2016 年 6 月 24 日

34	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金继续参与交通银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券日报、基金管理人的官方网站	2016 年 6 月 30 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港深智慧生活优选灵活配置混合型证券投资基金设立的文件

(2) 《前海开源沪港深智慧生活优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

(3) 《前海开源沪港深智慧生活优选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

(4) 《前海开源沪港深智慧生活优选灵活配置混合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) 前海开源沪港深智慧生活优选灵活配置混合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