

前海开源优势蓝筹股票型证券投资基金 2016 年半年度报告摘要

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：前海开源基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示

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

基金托管人招商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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	前海开源优势蓝筹股票	
基金主代码	001162	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 4 月 28 日	
基金管理人	前海开源基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	64,797,983.91 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	前海开源优势蓝筹股票 A	前海开源优势蓝筹股票 C
下属分级基金的交易代码:	001162	001638
报告期末下属分级基金的份额总额	36,798,020.00 份	27,999,963.91 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在关系国计民生的支柱性产业和代表中国国际竞争优势的行业中，精选具有核心竞争力、经营稳健、业绩优良、治理结构健康、持续分红能力较强的蓝筹公司。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>本基金投资策略有以下五方面内容：</p> <p>1、大类资产配置</p> <p>本基金综合定性和定量分析手段，依据经济周期理论，结合对各大类资产风险收益的评估，制定各类资产配置比例。本基金通过对权益类、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、市场利率等因素以及基金的风险评估进行调整。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金采取自上而下宏观分析和自下而上精选个股相结合的投资策略，在遵循本基金资产配置比例限制的前提下，确定股票资产的投资比例。</p> <p>本基金股票资产主要投资于优势蓝筹股票，投资于与优势蓝筹主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的 80%。优势蓝筹股票是指在关系国计民生的支柱性产业和代表中国国际竞争优势的行业中，具有核心竞争力、经营稳健、业绩优良、治理结构健康、财务状况良好的上市公司股票。</p> <p>一方面，中国经济结构转型升级，金融、能源、冶金、化工、基建、消费等传统支柱性产业可能兼并整合，具有竞争优势的蓝筹公司的市场份额有望进一步提升。另一方面，全球经济格局新老更替，中国通过国家战略和政策引导，充分发挥国际竞争优势，提高在国际分工中的地位，高铁、核电、军工、互联网、计算机、通信、电子等国际竞争优势行业的龙头公司有望发展壮大。本基金通过定性和定量相结合的方法筛选股票。定性方面主要研究上市公司的商业模式、竞争优势、行业地位、市场空间、治理结构等。定量方面主要分析上市公</p>

	<p>司的盈利能力、运营效率、资产质量、财务状况、分红能力、估值水平等。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本基金实施积极主动的组合管理，从宏观环境分析和微观市场定价分析两方面进行债券投资。宏观上结合对宏观经济、市场利率等因素的分析，确定不同资产的权重。微观上以中长期利率趋势分析为基础，结合经济趋势、货币政策等因素，选择质量较高的品种。</p> <p>4、权证投资策略</p> <p>本基金根据权证对应公司基本面情况确定合理估值，通过权证与证券组合投资，达到改善组合风险收益特征的目的。</p> <p>5、股指期货投资策略</p> <p>本基金以套期保值为目的参与股指期货交易。</p> <p>本基金股指期货投资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，结合股票投资的规模，以及中国证监会要求确定参与股指期货交易的投资比例。</p> <p>基金管理人投资股指期货前将建立股指期货投资决策部门或小组，同时制定流程制度，经基金管理人董事会批准后执行。</p>	
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%。	
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及风险水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金，属于高风险收益特征的开放式基金。	
	前海开源优势蓝筹股票 A	前海开源优势蓝筹股票 C

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	招商银行股份有限公司	
信息披露负责人	姓名	傅成斌	张燕
	联系电话	0755-88601888	0755-83199084
	电子邮箱	qhky@qhkyfund.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话	4001666998	95555	
传真	0755-83181169	0755-83195201	

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.qhkyfund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	前海开源优势蓝筹股票 A	前海开源优势蓝筹股票 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-7,609,151.72	-1,469,683.00
本期利润	-9,026,177.66	-141,630.74
加权平均基金份额本期利润	-0.2362	-0.0082
本期基金份额净值增长率	-20.86%	-10.41%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)	
期末可供分配基金份额利润	-0.1502	-0.0680
期末基金资产净值	31,271,304.57	26,271,439.59
期末基金份额净值	0.850	0.938

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

前海开源优势蓝筹股票 A

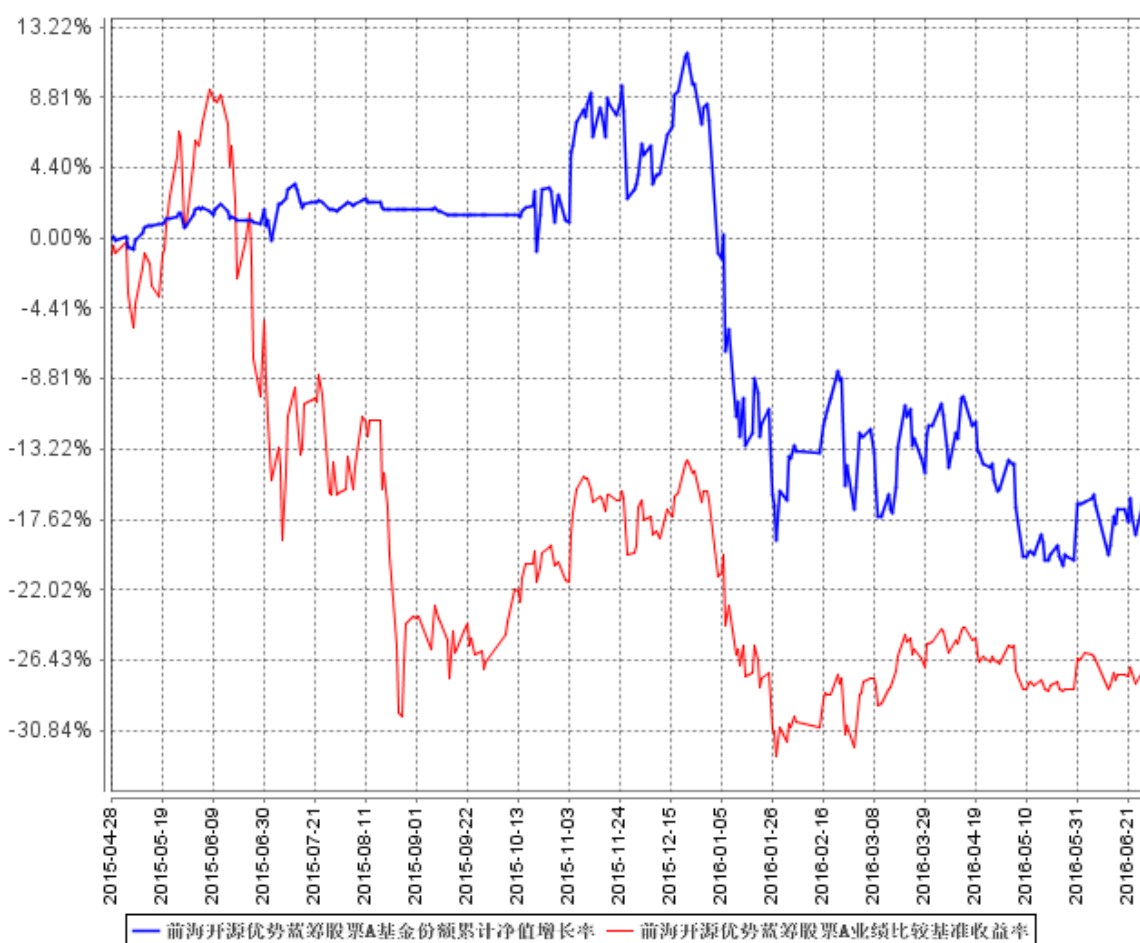
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.04%	1.40%	-0.24%	0.78%	2.28%	0.62%
过去三个月	-3.63%	1.46%	-1.48%	0.81%	-2.15%	0.65%
过去六个月	-20.86%	2.15%	-12.00%	1.48%	-8.86%	0.67%
过去一年	-16.50%	1.69%	-22.51%	1.84%	6.01%	-0.15%
自基金合同生效起至今	-15.00%	1.56%	-26.49%	1.92%	11.49%	-0.36%

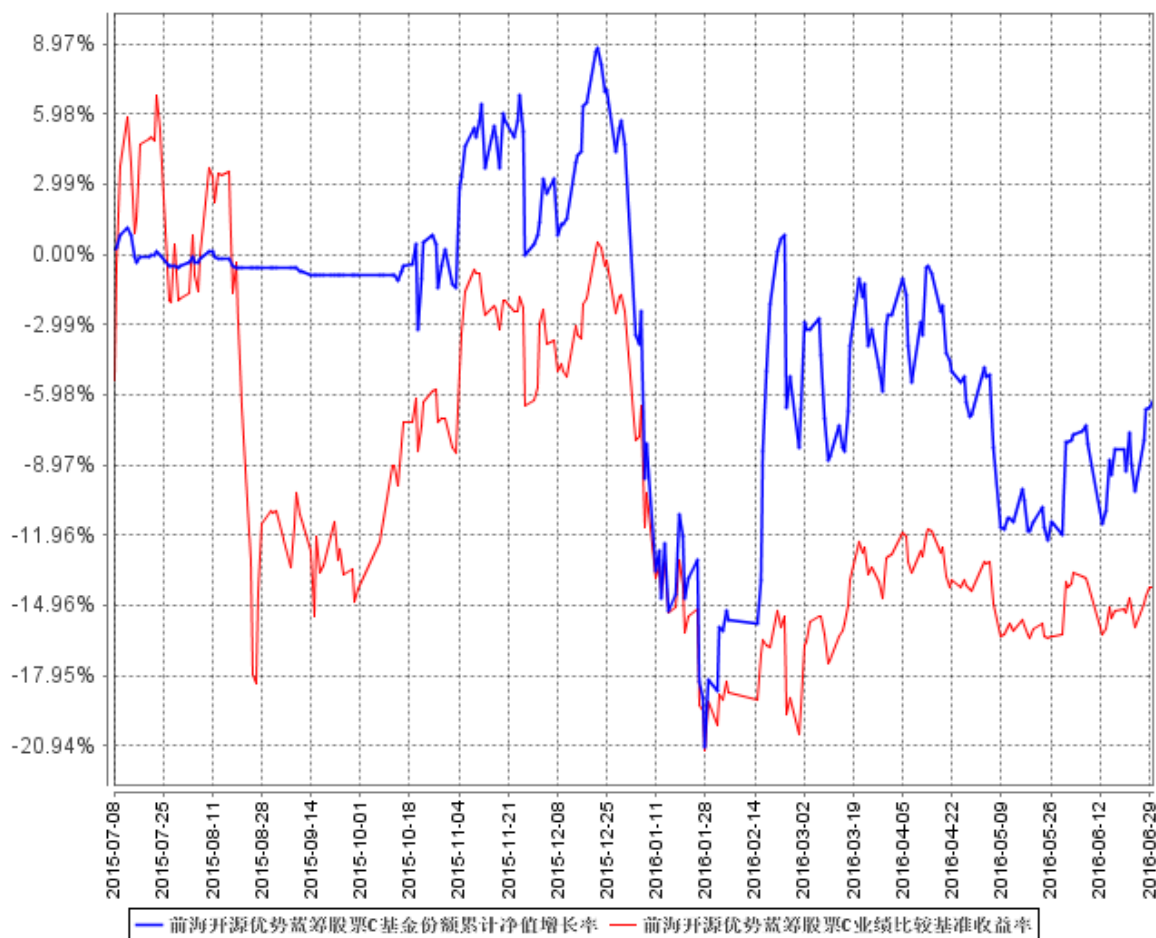
前海开源优势蓝筹股票 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.96%	1.42%	-0.24%	0.78%	2.20%	0.64%
过去三个月	-3.70%	1.48%	-1.48%	0.81%	-2.22%	0.67%
过去六个月	-10.41%	2.29%	-12.00%	1.48%	1.59%	0.81%
自基金合同生效起至今	-6.20%	1.77%	-14.15%	1.81%	7.95%	-0.04%

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%。

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本基金自 2015 年 7 月 6 日起，增加 C 类基金份额并设置对应基金代码；2015 年 7 月 6 日、2015 年 7 月 7 日 C 类基金份额为零。前海开源优势蓝筹股票 C 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起始日为 2015 年 7 月 8 日。

③本基金的建仓期为 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同规定。截至 2016 年 6 月 30 日，本基金建仓期结束未满 1 年。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

前海开源基金管理有限公司（以下简称“前海开源基金”）于 2012 年 12 月 27 日经中国证监会批准，2013 年 1 月 23 日注册成立，截至报告期末，注册资本为 2 亿元人民币。其中，开源证券股份有限公司、北京市中盛金期投资管理有限公司、北京长和世纪资产管理有限公司和深圳市和合投信资产管理合伙企业(有限合伙)各持股 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		
曲扬	本基金的基金经理、公司执行投资总监	2015 年 4 月 28 日	-	7 年	曲扬先生，清华大学博士研究生。历任南方基金管理有限公司研究员、基金经理助理、南方全球精选基金经理，2009 年 11 月至 2013 年 1 月担任南方基金香港子公司投资经理助理、投资经理。现任前海开源基金管理有限公司执行投资总监。

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、《前海开源优势蓝筹股票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

回顾 2016 年上半年，在受到了国内宏观经济不振、人民币持续贬值压力以及英国脱欧等海外不确定性因素的影响下，A 股市场整体走势偏弱，上涨综指下跌 17.22%。但市场不乏结构性机会，包括食品饮料、贵金属等板块具有正收益。本基金一季度投资品配置比例较高，对基金净值的拖累较大。二季度降低了投资品配置比例，增加了下游消费品配置比例，对基金净值带来正面贡献。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内，A 类基金份额净值增长率为-20.86%，同期业绩比较基准收益率为-12.00%；C 类基金份额净值增长率为-10.41%，同期业绩比较基准收益率为-12.00%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，预计中国宏观经济仍将维持 L 型走势，境内和境外利率维持低位、流动性充裕，经济基本面和资金面对股市影响偏正面。投资和出口对经济增长的拉动作用继续减弱，供给侧改革和国企改革是传统经济部门投资机会的主要看点。消费和新兴产业对经济增长的贡献比例将继续提升，消费品和新兴成长股可能是阿尔法的主要来源。

下半年 A 股市场依旧存在结构性机会，本基金将从基本面出发，精选具备长期发展潜力、业绩增长速度较快、增长确定性和安全边际较高的行业和个股，努力为投资者创造超额收益。

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 1 月 4 日至 2016 年 2 月 2 日连续 22 个工作日，2016 年 2 月 17 日至 2016 年 3 月 21 日连续 24 个工作日基金资产净值低于五千万元。

§ 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

托管人声明，在本报告期内，基金托管人招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》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、投资组合报告等数据真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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：前海开源优势蓝筹股票型证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	4,509,530.49	4,284,208.59
结算备付金	80,896.97	429,637.87
存出保证金	36,910.64	132,503.33
交易性金融资产	53,404,300.15	38,728,621.20
其中：股票投资	53,404,300.15	38,728,621.20
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	33,027.01	-
应收利息	1,004.15	1,557.45
应收股利	-	-
应收申购款	109,161.26	50,412.61
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	58,174,830.67	43,626,941.05
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2016 年 6 月 30 日	2015 年 12 月 31 日
负 债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	450,684.30	92,230.93
应付管理人报酬	46,591.06	38,051.61
应付托管费	11,647.78	9,512.89
应付销售服务费	2,101.12	-
应付交易费用	70,748.34	188,591.81
应交税费	-	-
应付利息	-	-

应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	50,313.91	50,128.19
负债合计	632,086.51	378,515.43
所有者权益：		
实收基金	64,797,983.91	40,262,054.95
未分配利润	-7,255,239.75	2,986,370.67
所有者权益合计	57,542,744.16	43,248,425.62
负债和所有者权益总计	58,174,830.67	43,626,941.05

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，前海开源优势蓝筹股票 A 基金份额净值 0.850 元，基金份额总额 36,798,020.00 份，前海开源优势蓝筹股票 C 基金份额净值 0.938 元，基金份额总额 27,999,963.91 份。

6.2 利润表

会计主体：前海开源优势蓝筹股票型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 4 月 28 日(基金合同生效日) 至 2015 年 6 月 30 日
一、收入	-8,522,126.72	5,164,113.16
1.利息收入	25,544.66	328,677.99
其中：存款利息收入	25,544.66	138,057.13
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	-	190,620.86
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-8,635,441.69	3,087,910.98
其中：股票投资收益	-8,909,903.90	3,043,345.03
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	274,462.21	44,565.95
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-88,973.68	1,221,763.16
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	176,743.99	525,761.03
减：二、费用	645,681.68	1,118,204.45
1. 管理人报酬	245,432.54	537,468.12

2. 托管费	61,358.11	89,578.01
3. 销售服务费	8,171.26	-
4. 交易费用	279,607.18	461,721.20
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	51,112.59	29,437.12
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-9,167,808.40	4,045,908.71
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-9,167,808.40	4,045,908.71

注：本基金的基金合同于 2015 年 4 月 28 日生效，上年度可比期间为 2015 年 4 月 28 日（基金合同生效日）到 2015 年 6 月 30 日。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：前海开源优势蓝筹股票型证券投资基金

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）	40,262,054.95	2,986,370.67	43,248,425.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-9,167,808.40	-9,167,808.40
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）	24,535,928.96	-1,073,802.02	23,462,126.94
其中：1.基金申购款	66,029,787.77	-6,653,618.48	59,376,169.29
2.基金赎回款	-41,493,858.81	5,579,816.46	-35,914,042.35
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）	64,797,983.91	-7,255,239.75	57,542,744.16
项目	上年度可比期间 2015 年 4 月 28 日（基金合同生效日）至 2015 年 6 月 30 日		

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	239,319,765.41	-	239,319,765.41
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	-	4,045,908.71	4,045,908.71
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)	-88,639,762.34	-1,307,104.99	-89,946,867.33
其中：1.基金申购款	8,828,285.21	104,467.76	8,932,752.97
2.基金赎回款	-97,468,047.55	-1,411,572.75	-98,879,620.30
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)	150,680,003.07	2,738,803.72	153,418,806.79

注：本基金的基金合同于 2015 年 4 月 28 日生效，上年度可比期间为 2015 年 4 月 28 日（基金合同生效日）到 2015 年 6 月 30 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

前海开源优势蓝筹股票型证券投资基金（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】405 号文《关于准予前海开源优势蓝筹股票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》、《前海开源优势蓝筹股票型证券投资基金基金合同》及其他法律法规公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次募集期间为 2015 年 4 月 14 日至 2015 年 4 月 24 日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 239,248,291.84 元，经瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）瑞华验字[2015]02030036 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《前海开源优势蓝筹股票型证券投资基金基金合同》于 2015 年 4 月 28 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为

239,319,765.41 份基金份额，其中认购资金利息折合 71,473.57 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，本基金托管人为招商银行股份有限公司。

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》、《前海开源优势蓝筹股票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

本基金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 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
前海开源基金管理有限公司（“前海开源基金公司”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.8.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.8.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行交易，无佣金产生。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6 月30日	上年度可比期间 2015年4月28日(基金合同生效日) 至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	245,432.54	537,468.12
其中：支付销售机构的客户维护费	38,565.57	0.34

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，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 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。

根据《前海开源优势蓝筹股票型证券投资基金基金合同（2015 年 7 月修订）》及《前海开源优势蓝筹股票型证券投资基金托管协议（2015 年 7 月修订）》约定，自 2015 年 7 月 6 日起，本基金的管理费率由 1.50%/年调整为 1.00%/年。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6	上年度可比期间 2015年4月28日(基金合同生效日)
----	------------------------	--------------------------------

	月 30 日	至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	61,358.11	89,578.01

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，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 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。

6.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	前海开源优势蓝筹股票 A	前海开源优势蓝筹股票 C	合计
前海开源基金管理有限公司（基金管理人、注册登记机构、基金销售机构）	-	7,281.69	7,281.69
开源证券股份有限公司（“开源证券”）	-	889.57	889.57
合计	0.00	8,171.26	8,171.26

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.1%。

本基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.1% 年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性划出，由注册登记机构代收，注册登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2015 年 4 月 28 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	4,509,530.49	22,766.65	96,963,085.05	131,732.73

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

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间内无其他关联交易事项。

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

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
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	467	3,964.83	3,964.83	-
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	617	3,578.60	3,578.60	-
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	355	3,567.75	3,567.75	-

6.4.9.2 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
600497	驰宏锌锗	2016 年 6 月 13 日	重大事项	9.97	2016 年 7 月 11 日	10.97	136,600	1,433,571.00	1,361,902.00	-
601611	中国	2016	临时	20.92	2016	23.01	1,613	5,597.11	33,743.96	-

	核建	年 6 月	停牌		年 7 月				
		30 日			1 日				

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。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	53,404,300.15	91.80
	其中：股票	53,404,300.15	91.80
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	4,590,427.46	7.89
7	其他各项资产	180,103.06	0.31
8	合计	58,174,830.67	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	6,169,790.00	10.72

B	采矿业	5,840,761.00	10.15
C	制造业	28,103,731.19	48.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	33,743.96	0.06
F	批发和零售业	748,923.00	1.30
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	14,390.10	0.03
J	金融业	12,485,700.80	21.70
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	7,260.10	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	53,404,300.15	92.81

7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未通过沪港通机制投资港股。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	601689	拓普集团	124,310	4,096,014.50	7.12
2	002299	圣农发展	141,800	3,672,620.00	6.38
3	600436	片仔癀	74,170	3,338,391.70	5.80
4	002311	海大集团	188,700	2,975,799.00	5.17
5	600837	海通证券	187,740	2,894,950.80	5.03
6	600109	国金证券	212,300	2,861,804.00	4.97
7	600999	招商证券	166,400	2,745,600.00	4.77

8	002458	益生股份	57,000	2,497,170.00	4.34
9	000568	泸州老窖	79,100	2,349,270.00	4.08
10	600519	贵州茅台	8,000	2,335,360.00	4.06

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

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600436	片仔癀	5,997,996.55	13.87
2	600031	三一重工	4,140,339.96	9.57
3	601689	拓普集团	3,912,537.00	9.05
4	600519	贵州茅台	3,740,812.19	8.65
5	600837	海通证券	3,614,711.00	8.36
6	600585	海螺水泥	3,222,751.00	7.45
7	600999	招商证券	3,055,736.36	7.07
8	002311	海大集团	2,988,393.52	6.91
9	000157	中联重科	2,986,568.00	6.91
10	000581	威孚高科	2,965,069.41	6.86
11	601211	国泰君安	2,912,234.96	6.73
12	000338	潍柴动力	2,842,267.93	6.57
13	002458	益生股份	2,821,440.12	6.52
14	601788	光大证券	2,763,581.15	6.39
15	600958	东方证券	2,555,301.00	5.91
16	600549	厦门钨业	2,496,499.00	5.77
17	603686	龙马环卫	2,270,977.00	5.25
18	000568	泸州老窖	2,259,402.00	5.22
19	000538	云南白药	1,856,326.00	4.29
20	002299	圣农发展	1,785,397.00	4.13
21	601198	东兴证券	1,750,179.00	4.05
22	000686	东北证券	1,720,816.33	3.98
23	002007	华兰生物	1,720,057.03	3.98
24	300294	博雅生物	1,702,899.28	3.94
25	600535	天士力	1,598,730.76	3.70
26	002588	史丹利	1,488,703.00	3.44

27	600497	驰宏锌锗	1,433,571.00	3.31
28	000878	云南铜业	1,432,382.00	3.31
29	600362	江西铜业	1,431,157.86	3.31
30	600109	国金证券	1,401,905.00	3.24
31	601998	中信银行	1,351,274.00	3.12
32	002142	宁波银行	1,343,735.00	3.11
33	600276	恒瑞医药	1,317,784.00	3.05
34	000630	铜陵有色	1,200,967.00	2.78
35	000983	西山煤电	1,181,440.00	2.73
36	002160	常铝股份	1,175,667.70	2.72
37	601555	东吴证券	1,146,187.00	2.65
38	300328	宜安科技	1,132,303.80	2.62
39	000060	中金岭南	1,050,435.00	2.43
40	601318	中国平安	1,017,450.00	2.35
41	601336	新华保险	994,365.00	2.30

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	601788	光大证券	4,459,923.15	10.31
2	600031	三一重工	3,699,061.01	8.55
3	600436	片仔癀	3,371,187.37	7.79
4	600398	海澜之家	3,195,480.00	7.39
5	000581	威孚高科	3,024,741.76	6.99
6	600585	海螺水泥	2,976,431.36	6.88
7	000338	潍柴动力	2,741,120.53	6.34
8	601211	国泰君安	2,690,455.29	6.22
9	002294	信立泰	2,668,027.32	6.17
10	000157	中联重科	2,642,298.00	6.11
11	603686	龙马环卫	2,334,710.05	5.40
12	600958	东方证券	1,968,734.00	4.55
13	002299	圣农发展	1,890,767.00	4.37
14	000423	东阿阿胶	1,856,748.00	4.29
15	601336	新华保险	1,740,925.60	4.03

16	000728	国元证券	1,687,892.39	3.90
17	600535	天士力	1,651,747.30	3.82
18	600519	贵州茅台	1,621,903.00	3.75
19	002035	华帝股份	1,607,225.00	3.72
20	002236	大华股份	1,573,035.55	3.64
21	300360	炬华科技	1,424,231.69	3.29
22	600276	恒瑞医药	1,404,604.00	3.25
23	601998	中信银行	1,374,294.00	3.18
24	002142	宁波银行	1,341,293.00	3.10
25	300224	正海磁材	1,335,254.75	3.09
26	300017	网宿科技	1,310,196.20	3.03
27	600362	江西铜业	1,251,773.24	2.89
28	002321	华英农业	1,225,857.00	2.83
29	000878	云南铜业	1,222,144.00	2.83
30	300328	宜安科技	1,198,750.00	2.77
31	000630	铜陵有色	1,057,230.00	2.44
32	601318	中国平安	1,042,455.00	2.41
33	002588	史丹利	927,420.00	2.14
34	600549	厦门钨业	912,016.00	2.11
35	002367	康力电梯	904,637.00	2.09
36	000750	国海证券	883,240.00	2.04
37	002458	益生股份	881,769.00	2.04
38	600837	海通证券	869,474.00	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	122,283,682.87
卖出股票收入（成交）总额	98,609,126.34

注：买入股票成本、卖出股票收入均按照买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

(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	36,910.64
2	应收证券清算款	33,027.01

3	应收股利	-
4	应收利息	1,004.15
5	应收申购款	109,161.26
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	180,103.06

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持有人 户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比 例	持有份额	占总份 额比例
前 海 开 源 优 势 蓝 筹 股 票 A	1,778	20,696.30	2,838,781.86	7.71%	33,959,238.14	92.29%
前 海 开 源 优 势 蓝 筹 股 票 C	10	2,799,996.39	27,998,965.41	100.00%	998.50	0.00%
合计	1,788	36,240.48	30,837,747.27	47.59%	33,960,236.64	52.41%

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

② 户均持有的基金份额合计=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

③ 本基金自 2015 年 7 月 6 日起，增加 C 类基金份额并设置对应基金代码。

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

项目	前海开源优势蓝筹股票 A	前海开源优势蓝筹股票 C
基金合同生效日（2015 年 4 月 28 日）基金份额总额	239,319,765.41	-
本报告期期初基金份额总额	40,261,056.45	998.50
本报告期基金总申购份额	10,637,228.62	55,392,559.15
减：本报告期基金总赎回份额	14,100,265.07	27,393,593.74
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	36,798,020.00	27,999,963.91

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

本基金本报告期内投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金提供审计服务的会计师事务所为瑞华会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期基金管理人、托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚的情形。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券	2	192,954,921.11	87.42%	141,107.04	87.42%	-
东北证券	2	27,772,560.51	12.58%	20,310.04	12.58%	-
申万宏源	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

本基金本报告期内租用证券公司交易单元未进行其他证券投资。

前海开源基金管理有限公司
2016 年 8 月 29 日