

前海开源股息率 100 强等权重股票型证券投资基金 2016 年年度报告摘要

2016 年 12 月 31 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：2017 年 3 月 30 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 2017 年 3 月 24 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。

本报告中的财务资料已经审计。瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2016 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

1.1

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	前海开源股息率 100 强股票
基金主代码	000916
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 1 月 13 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	1,814,449,294.61 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沪深 A 股中具有高现金分红的股票，运用股息率 100 强等权重投资策略，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五方面内容：</p> <p>1、大类资产配置</p> <p>本基金将综合运用定性和定量的分析方法，在对宏观经济进行深入研究的基础上，判断宏观经济周期所处阶段及变化趋势，并结合估值水平、政策取向等因素，综合评估各大类资产的预期收益率和风险，合理确定本基金在股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例，以最大限度降低投资组合的风险、提高投资组合的收益。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金将遵循“股息率 100 强”等权重股票投资策略，精选 100 只具有高盈利能力、高现金分红的上市公司股票作为股息率 100 强股票，并构建股票投资组合，具体策略包括以下四个方面的内容：（1）股息率 100 强股票的选取及股票投资组合建仓策略；（2）股息率 100 强股票组合中个股出现重大风险时实施的不定期调整策略；（3）因资产配置需求需要增加基金在各只股票上资金配置时实施的相关股票替代策略；（4）更新股息率 100 强股票组合及各只股票权重时实施的定期调整策略。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本基金主要基于流动性管理需求投资于债券。本基金将结合宏观经济变化趋势、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，运用久期调整、凸度挖掘、信用分析、波动性交易、回购套利等策略，权衡到期收益率与市场流动性，精选个券并构建和调整债券组合，在追求债券资产投资收益的同时兼顾流动性和安全性。</p> <p>4、权证投资策略</p> <p>本基金将权证的投资作为提高基金投资组合收益的辅助手段。根据权证对应公司基本面研究成果确定权证的合理估值，发现市场对股票权证的非理性定价；利用权证衍生工具的特性，通过权证与证券的组合投资，来达到改善组合风险收益特征的目的。</p>

	<p>5、股指期货投资策略</p> <p>本基金以套期保值为目的，参与股指期货交易。</p> <p>本基金参与股指期货投资时机和数量的决策建立在对证券市场总体行情的判断和组合风险收益分析的基础上。基金管理人将根据宏观经济因素、政策及法规因素和资本市场因素，结合定性和定量方法，确定投资时机。基金管理人将结合股票投资的总体规模，以及中国证监会的相关限定和要求，确定参与股指期货交易的投资比例。</p>
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	本基金为股票型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		前海开源基金管理有限公司	中国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

2.4 信息披露方式

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

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2016 年	2015 年 1 月 13 日 (基金合同生效日)– 2015 年 12 月 31 日	2014 年
本期已实现收益	157,300,839.63	252,045,405.60	–
本期利润	44,826,284.53	311,490,621.42	–
加权平均基金份额本期利润	0.0395	0.4201	–
本期基金份额净值增长率	-4.31%	35.40%	–
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末

期末可供分配基金份额利润	0.1020	0.2581	-
期末基金资产净值	1,999,460,311.41	485,058,959.77	-
期末基金份额净值	1.102	1.354	-

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 2015 年 1 月 13 日生效，截止 2015 年 12 月 31 日成立不满 1 年，故 2015 年年度数据与指标为不完整会计年度数据。

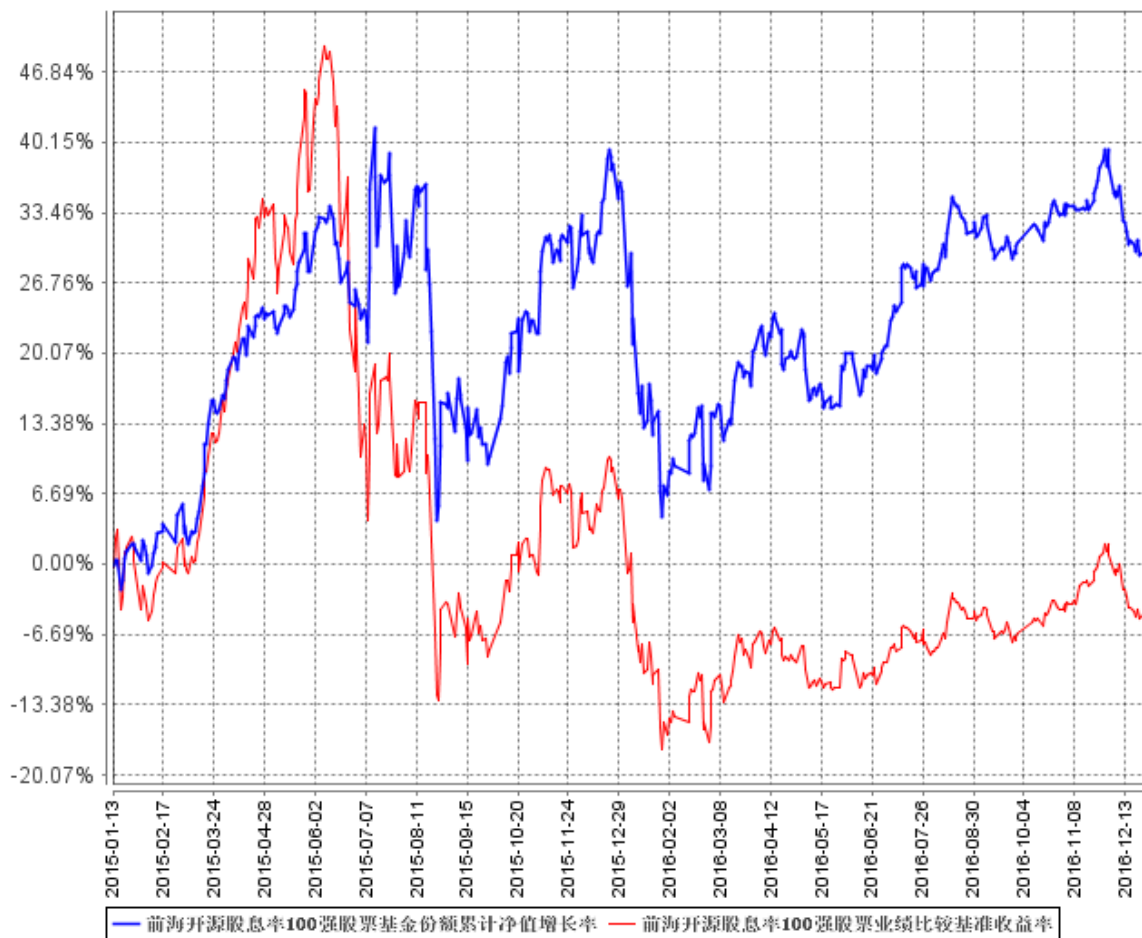
3.2 基金净值表现

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

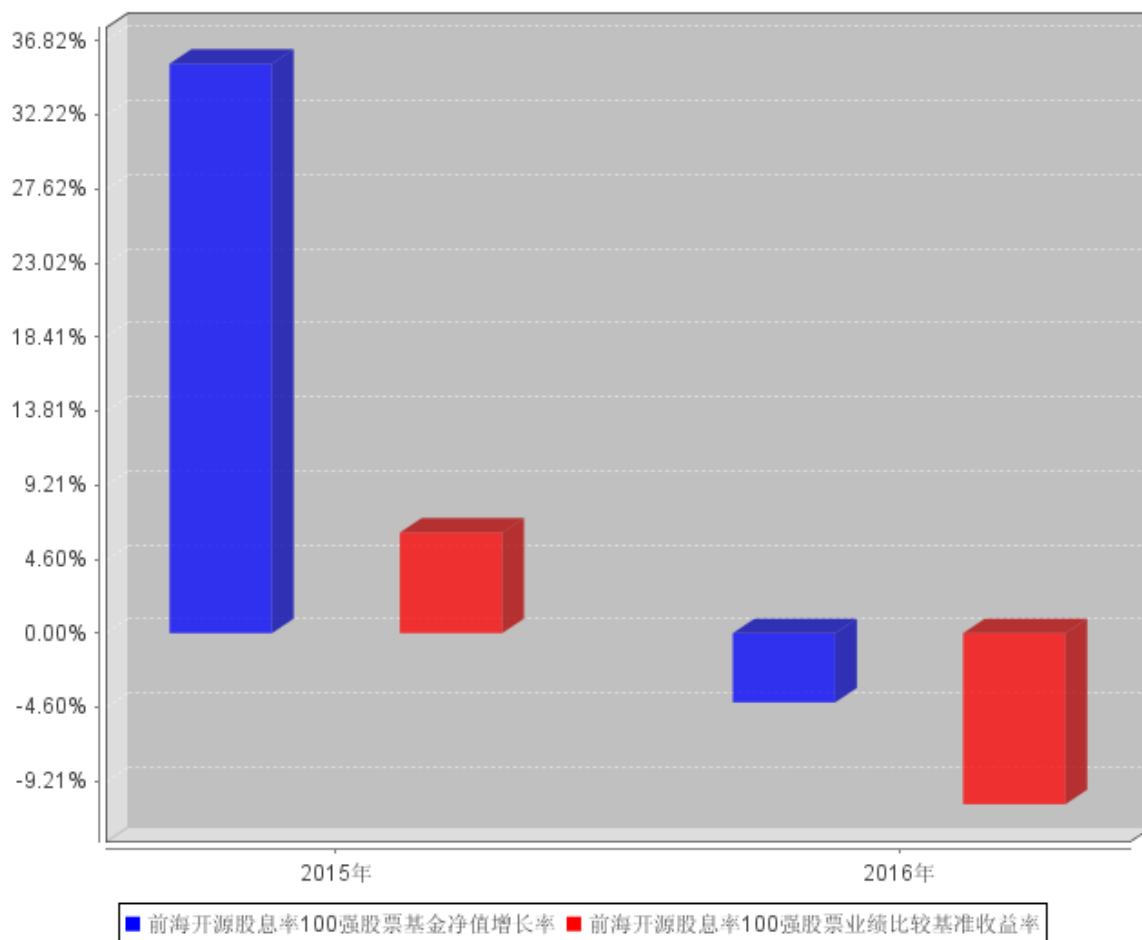
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-0.87%	0.68%	1.67%	0.67%	-2.54%	0.01%
过去六个月	7.35%	0.77%	4.72%	0.72%	2.63%	0.05%
过去一年	-4.31%	1.41%	-10.63%	1.33%	6.32%	0.08%
自基金合同生效起至今	29.57%	1.66%	-5.04%	1.92%	34.61%	-0.26%

注：本基金的业绩比较基准为：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



3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金的基金合同于 2015 年 1 月 13 日生效，2015 年本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率按本基金实际存续期计算。

3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年 度	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	年度利润分配合 计	备注
2015	0.0000	0.00	0.00	0.00	
2016	2.0000	489,068,046.31	30,696,150.01	519,764,196.32	
合 计	2.0000	489,068,046.31	30,696,150.01	519,764,196.32	

注：本基金的基金合同于 2015 年 1 月 13 日生效，截止 2016 年 12 月 31 日，本基金成立未满足三年。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

前海开源基金管理有限公司（以下简称“前海开源基金”）于 2012 年 12 月 27 日经中国证监会批准，2013 年 1 月 23 日注册成立，截至报告期末，注册资本为 2 亿元人民币。其中，开源证券股份有限公司、北京市中盛金期投资管理有限公司、北京长和世纪资产管理有限公司和深圳市和合投信资产管理合伙企业(有限合伙)各持股权 25%。目前，前海开源基金分别在北京、上海设立分公司，在深圳设立华南营销中心；直销中心覆盖珠三角、长三角和京津冀环渤海经济区，为公司的快速发展奠定了组织和区域基础。经中国证监会批准，前海开源基金控股子公司——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，前海开源资管的股东结构为：前海开源基金管理有限公司出资 18000 万，占比 100%。

截至报告期末，前海开源基金旗下管理 45 只开放式基金，资产管理规模超过 600 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		
邱杰	本基金的基金经理、公司执行投资总监	2015 年 1 月 13 日	-	9 年	邱杰先生，经济学硕士。历任南方基金管理有限公司研究部行业研究员、中小盘股票研究员、制造业组组长；建信基金管理有限公司研究员。现任前海开源基金管理有限公司执行投资总监。

注：①对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”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、《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 公平交易制度和控制方法

基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（2011 年修订）的规定，针对股票市场、债券市场交易等投资管理活动，以及授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动相关的各个环节，制定了《前海开源基金管理有限公司公平交易管理办法》、《前海开源基金管理有限公司异常交易监控管理办法》等公平交易相关的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执行的内部控制，完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

4.3.2 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。

4.3.3 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

2016 年中国经济短期企稳复苏，GDP 走势平稳，全年增速 6.7%。从三大需求来看，消费保持平稳，全年增速 10.4%，GDP 贡献率达到 64.6%，是经济增长最重要动能；投资增速在制造业拖累下小幅下降至 8.1%，进出口仍持续负增长。全年通胀有所上行，PPI 由于煤炭、钢铁、原油等大宗商品价格上涨而大幅上升，CPI 则低位略有回升。

2016 年年初股票市场受汇率等因素影响出现大幅下跌，随后在经济企稳、供给侧改革推进

的背景下逐步回升；4 季度货币政策略有收紧，市场无风险利率显著回升，债市出现大幅下跌。年初股票市场大跌后，我们判断中短期市场风险已得到较充分释放，因此适当提高了股票仓位；个股方面，我们仍然结合定性与定量分析，在高股息率股票中优选价值低估、盈利增速稳健的大盘蓝筹股进行配置，取得了较好的效果。

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-4.31%，同期业绩比较基准收益率为-10.63%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们判断 2017 年中国经济可能前高后低，GDP 增速小幅回落，通胀温和上升；在汇率约束和降杠杆、防风险的政策背景下，货币政策将稳中趋紧，财政政策仍然发挥托底作用。

鉴于经济相对稳定，存量流动性仍较充裕以及股票资产的估值优势，我们预计 2017 年股票市场仍然存在结构性投资机会，但同时我们也会密切关注全球政治博弈加剧、可能的输入性通胀压力以及美国经济复苏和加息进程不确定性带来的阶段性风险。行业和个股方面，低估值高股息率的优质蓝筹、稳健增长的消费龙头仍然具备明显配置价值，同时随着市场估值体系逐步调整到位，成长性企业中的优质公司也可能出现较好的长期配置机会。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益的角度出发，依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。公司监察稽核部门按照规定的权限和程序，通过实时监控、现场检查、重点抽查和人员询问等方法，独立地开展基金运作和公司管理的合规性稽核，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事会和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，本基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

(1) 本年度，我公司采取外聘律师和内部专业人士相结合的方式，对各业务部门进行了相关法律法规培训和职业道德培训，进一步提高了我公司从业人员的合规素质和职业道德修养。

(2) 本年度，我公司按照证监会的要求对公司治理、投资、研究、交易、基金会计、注册登记、人力资源、基金销售等主要业务进行定期稽核工作。同时，对信息技术、用户权限、通信管理与视频监控、基金直销、后台运营、内幕交易防控等相关业务开展了专项稽核工作，检查业务开展的合规性和制度执行的有效性等。

(3) 通过事前合规防范、事中系统控制、事后完善纠偏的方式，全面加强了对公司产品日

常投资运作的管理与监控，保证投资符合既定的投资决策程序与业务流程，基金投资组合及个股投资符合比例控制的要求，严格执行分级授权制度，保证基金投资独立、公平。

(4) 全面参与新产品设计、新业务拓展工作，负责日常合同审查，监督客户投诉处理。积极参与证监会新规定出台前的讨论并提出修改建议。

(5) 完成各基金及公司的各项信息披露工作，保证所披露信息的真实性、准确性和完整性；重视媒体监督和投资者关系管理工作。

(6) 按照规定向人民银行报送反洗钱相关报表和报告，按监管要求制定客户洗钱风险划分的标准，并升级了客户洗钱风险划分系统。

本基金管理人承诺将依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 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、金融工程部、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。

4.8 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 2.00 元，共分配利润 519,764,196.32 元。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内，未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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 12 月 31 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,除 1 月 11 日至 1 月 22 日,前海开源股息率 100 强等权重股票型证券投资基金,连续 10 个交易日,投资于债券、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占比超过基金资产的 10%,违反了基金合同规定。前海开源基金管理有限公司在前海开源股息率 100 强等权重股票型证券投资基金的投资运作、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。

5.3 托管人对本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,未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 审计报告

瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)审计了本基金的财务报表,包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表,2016 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注,并出具了无保留意见的审计报告。

投资者欲了解详细内容,可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：前海开源股息率 100 强等权重股票型证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	55,097,029.19	50,023,646.50
结算备付金	27,340,115.61	-
存出保证金	2,203,574.77	704,974.76
交易性金融资产	1,953,387,723.18	439,043,735.88
其中：股票投资	1,863,492,223.18	439,043,735.88
基金投资	-	-
债券投资	89,895,500.00	-
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	-	-
应收利息	1,604,354.71	8,680.92
应收股利	-	-
应收申购款	88,781.50	637,546.20
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	2,039,721,578.96	490,418,584.26
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2016 年 12 月 31 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	20,662,386.54	2,817,673.04
应付赎回款	12,209,200.55	1,515,218.71
应付管理人报酬	2,782,109.75	606,741.47
应付托管费	463,684.98	101,123.58
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	3,665,655.43	64,756.79
应交税费	-	-

应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	478,230.30	254,110.90
负债合计	40,261,267.55	5,359,624.49
所有者权益：		
实收基金	1,814,449,294.61	358,206,042.60
未分配利润	185,011,016.80	126,852,917.17
所有者权益合计	1,999,460,311.41	485,058,959.77
负债和所有者权益总计	2,039,721,578.96	490,418,584.26

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.102 元，基金份额总额

1,814,449,294.61 份。

7.2 利润表

会计主体：前海开源股息率 100 强等权重股票型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 13 日(基 金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
一、收入	79,834,387.09	335,435,944.06
1. 利息收入	2,205,057.66	4,077,857.01
其中：存款利息收入	1,118,013.65	1,534,187.72
债券利息收入	705,065.80	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	381,978.21	2,543,669.29
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	183,313,587.59	263,715,501.36
其中：股票投资收益	150,590,980.32	256,568,684.22
基金投资收益	-	-
债券投资收益	191,930.31	-
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	32,530,676.96	7,146,817.14
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-112,474,555.10	59,445,215.82
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6,790,296.94	8,197,369.87

减：二、费用	35,008,102.56	23,945,322.64
1. 管理人报酬	20,668,786.64	12,483,472.45
2. 托管费	3,444,797.71	2,080,578.77
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	10,525,758.76	9,030,762.97
5. 利息支出	7,806.84	-
其中：卖出回购金融资产支出	7,806.84	-
6. 其他费用	360,952.61	350,508.45
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	44,826,284.53	311,490,621.42
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	44,826,284.53	311,490,621.42

注：本基金的基金合同于 2015 年 1 月 13 日生效，上年度可比期间为 2015 年 1 月 13 日（基金合同生效日）到 2015 年 12 月 31 日。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：前海开源股息率 100 强等权重股票型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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）	358,206,042.60	126,852,917.17	485,058,959.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	44,826,284.53	44,826,284.53
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）	1,456,243,252.01	533,096,011.42	1,989,339,263.43
其中：1. 基金申购款	2,700,675,992.44	737,210,451.94	3,437,886,444.38
2. 基金赎回款	-1,244,432,740.43	-204,114,440.52	-1,448,547,180.95
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）	-	-519,764,196.32	-519,764,196.32

五、期末所有者权益（基金净值）	1,814,449,294.61	185,011,016.80	1,999,460,311.41
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 13 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,707,595,123.52	-	1,707,595,123.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	311,490,621.42	311,490,621.42
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）	-1,349,389,080.92	-184,637,704.25	-1,534,026,785.17
其中：1. 基金申购款	473,561,754.50	117,949,688.35	591,511,442.85
2. 基金赎回款	-1,822,950,835.42	-302,587,392.60	-2,125,538,228.02
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）	358,206,042.60	126,852,917.17	485,058,959.77

注：本基金的基金合同于 2015 年 1 月 13 日生效，上年度可比期间为 2015 年 1 月 13 日（基金合同生效日）到 2015 年 12 月 31 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

前海开源股息率 100 强等权重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【2014】1208 号文《关于准予前海开源股息率 100 强等权重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》、《前海开源股息率 100 强等权重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 2014 年 12 月 18 日至 2015 年 1 月 9 日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 1,707,217,574.73 元，

经瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）瑞华验字[2015]02030001 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《前海开源股息率 100 强等权重股票型证券投资基金基金合同》于 2015 年 1 月 13 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,707,595,123.52 份基金份额，其中认购资金利息折合 377,548.79 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。

7.4.2 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》、《前海开源股息率 100 强等权重股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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。

7.4.3 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。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 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。

7.4.4.2 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。

7.4.4.3 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

产负债表中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。

7.4.4.4 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。

7.4.4.5 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 and 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。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 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。

7.4.4.8 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)”。

7.4.4.9 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。

7.4.4.10 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。

7.4.4.11 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。

7.4.4.12 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。

7.4.4.13 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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期未发生会计差错更正。

7.4.6 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[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》、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》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。

7.4.7 关联方关系

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”）	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”）	基金管理人股东、基金代销机构
北京市中盛金期投资管理有限公司	基金管理人股东
北京长和世纪资产管理有限公司	基金管理人股东
深圳市和合投信资产管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
前海开源资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 13 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例
开源证券股份 有限公司	2,575,352,779.32	30.31%	212,131,007.03	3.09%

7.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 13 日 (基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 日	
	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 成交总额的 比例
开源证券股份 有限公司	30,950,038.30	100.00%	-	-

7.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 13 日 (基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例
开源证券股份 有限公司	124,400,000.00	7.27%	1,460,000,000.00	10.59%

7.4.8.1.4 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。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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	1,883,357.82	30.31%	90.64	0.00%
关联方名称	上年度可比期间 2015 年 1 月 13 日 (基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 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	150,993.73	3.08%	10,377.50	16.03%

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 13 日(基金合同生效 日)至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	20,668,786.64	12,483,472.45
其中：支付销售机构的客户维护费	1,162,459.81	3,018,205.48

注：本基金的管理费按前一日资产净值的 1.5% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

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。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 13 日(基金合同生效 日)至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	3,444,797.71	2,080,578.77

注：本基金的托管费按前一日资产净值的 0.25% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，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。

7.4.8.2.3 销售服务费

本报告期内及上年度可比期间内关联方未从本基金获得销售服务费。

7.4.8.3 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。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用自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自有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 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。

7.4.8.5 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12月 31日		上年度可比期间 2015年1月13日(基金合同生效日)至 2015年12月31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	55,097,029.19	950,625.53	50,023,646.50	1,380,118.99

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。

7.4.8.6 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。

7.4.8.7 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。

7.4.9 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 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

7.4.12.1.1 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
601375	中原证券	2016年12月	2017年1月	新股流通受限	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	-

		20 日	3 日							
603228	景旺电子	2016 年 12 月 28 日	2017 年 1 月 6 日	新股流 通受限	23.16	23.16	3,117	72,189.72	72,189.72	-
603877	太平鸟	2016 年 12 月 29 日	2017 年 1 月 9 日	新股流 通受限	21.30	21.30	3,180	67,734.00	67,734.00	-
300583	赛托生物	2016 年 12 月 29 日	2017 年 1 月 6 日	新股流 通受限	40.29	40.29	1,582	63,738.78	63,738.78	-
603689	皖天然气	2016 年 12 月 30 日	2017 年 1 月 10 日	新股流 通受限	7.87	7.87	4,818	37,917.66	37,917.66	-
603035	常熟汽饰	2016 年 12 月 27 日	2017 年 1 月 5 日	新股流 通受限	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04	-
603266	天龙股份	2016 年 12 月 30 日	2017 年 1 月 10 日	新股流 通受限	14.63	14.63	1,562	22,852.06	22,852.06	-
300587	天铁股份	2016 年 12 月 28 日	2017 年 1 月 5 日	新股流 通受限	14.11	14.11	1,438	20,290.18	20,290.18	-
002840	华统股份	2016 年 12 月 29 日	2017 年 1 月 10 日	新股流 通受限	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-
002838	道恩股份	2016 年 12 月 28 日	2017 年 1 月 6 日	新股流 通受限	15.28	15.28	682	10,420.96	10,420.96	-
603186	华正新材	2016 年 12 月 26 日	2017 年 1 月 3 日	新股流 通受限	5.37	5.37	1,874	10,063.38	10,063.38	-
603032	德新交运	2016 年 12 月 27 日	2017 年 1 月 5 日	新股流 通受限	5.81	5.81	1,628	9,458.68	9,458.68	-
300586	美联新材	2016 年 12 月 26 日	2017 年 1 月 4 日	新股流 通受限	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-
300591	万里马	2016 年 12 月 30 日	2017 年 1 月 10 日	新股流 通受限	3.07	3.07	2,396	7,355.72	7,355.72	-
300588	熙菱信息	2016 年 12 月 27 日	2017 年 1 月 5 日	新股流 通受限	4.94	4.94	1,380	6,817.20	6,817.20	-

7.4.9.2 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
000540	中天城投	2016 年 11 月 28 日	重大资产重组	6.93	2017 年 1 月 3 日	7.00	3,249,187	21,782,023.58	22,516,865.91	-

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 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。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 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。

7.4.10 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 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 1,840,494,322.39 元，属于第二层次的余额为 112,893,400.79 元，属于第三层次的余额为 0 元；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 413,122,962.88 元，属于第二层次的余额为 25,920,773.00 元，属于第三层次的余额为 0 元。

(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 12 月 31 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。

§8 投资组合报告

8.1 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	1,863,492,223.18	91.36
	其中：股票	1,863,492,223.18	91.36
2	固定收益投资	89,895,500.00	4.41
	其中：债券	89,895,500.00	4.41
	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	82,437,144.80	4.04
7	其他各项资产	3,896,710.98	0.19
8	合计	2,039,721,578.96	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	86,678,309.05	4.34
C	制造业	811,053,629.06	40.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	161,760,159.46	8.09
E	建筑业	60,988,459.66	3.05
F	批发和零售业	36,548,452.01	1.83
G	交通运输、仓储和邮政业	178,306,032.73	8.92
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	241,692.20	0.01
J	金融业	348,041,603.59	17.41
K	房地产业	179,873,885.42	9.00
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	1,863,492,223.18	93.20

8.2.2 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。

8.3 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	000651	格力电器	1,681,250	41,392,375.00	2.07
2	000910	大亚科技	1,483,340	28,331,794.00	1.42
3	601088	中国神华	1,613,168	26,101,058.24	1.31
4	000540	中天城投	3,249,187	22,516,865.91	1.13
5	601668	中国建筑	2,522,732	22,351,405.52	1.12
6	601333	广深铁路	4,181,034	21,197,842.38	1.06
7	000333	美的集团	744,249	20,965,494.33	1.05
8	600028	中国石化	3,735,877	20,211,094.57	1.01
9	000488	晨鸣纸业	1,929,040	19,984,854.40	1.00
10	600383	金地集团	1,530,050	19,829,448.00	0.99

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官方网站（www.qhkyfund.com）上的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	601398	工商银行	95,151,163.58	19.62
2	600030	中信证券	67,463,362.21	13.91
3	000776	广发证券	55,130,386.67	11.37
4	000895	双汇发展	53,096,735.78	10.95
5	601088	中国神华	52,138,679.06	10.75
6	600398	海澜之家	49,360,181.41	10.18
7	600376	首开股份	48,532,902.84	10.01
8	600023	浙能电力	48,339,308.06	9.97
9	002701	奥瑞金	47,978,736.22	9.89
10	002311	海大集团	45,993,585.06	9.48
11	000651	格力电器	44,825,628.30	9.24
12	300146	汤臣倍健	44,540,347.85	9.18
13	002242	九阳股份	44,521,149.14	9.18
14	601601	中国太保	44,036,912.86	9.08

15	000539	粤电力 A	43,947,026.09	9.06
16	600583	海油工程	43,911,100.38	9.05
17	000600	建投能源	43,752,601.07	9.02
18	000783	长江证券	43,476,719.30	8.96
19	600104	上汽集团	43,375,592.10	8.94
20	600015	华夏银行	43,309,125.24	8.93
21	601179	中国西电	43,272,150.25	8.92
22	002004	华邦健康	43,235,145.96	8.91
23	600894	广日股份	43,164,381.02	8.90
24	600089	特变电工	43,136,687.57	8.89
25	000625	长安汽车	43,116,226.69	8.89
26	601555	东吴证券	43,097,674.35	8.89
27	600270	外运发展	43,091,817.37	8.88
28	601515	东风股份	43,073,315.06	8.88
29	600315	上海家化	43,018,241.61	8.87
30	601688	华泰证券	42,910,237.55	8.85
31	600018	上港集团	42,889,325.65	8.84
32	002146	荣盛发展	42,617,696.04	8.79
33	600340	华夏幸福	42,614,582.14	8.79
34	600717	天津港	42,559,509.61	8.77
35	600236	桂冠电力	42,547,423.65	8.77
36	600383	金地集团	42,450,972.28	8.75
37	600837	海通证券	42,404,688.58	8.74
38	000540	中天城投	42,398,781.00	8.74
39	601000	唐山港	42,383,349.68	8.74
40	601333	广深铁路	42,351,877.04	8.73
41	601998	中信银行	42,341,332.33	8.73
42	600266	北京城建	42,340,198.55	8.73
43	600000	浦发银行	42,307,383.80	8.72
44	000728	国元证券	42,289,371.66	8.72
45	600900	长江电力	42,241,483.16	8.71
46	000963	华东医药	42,123,680.85	8.68
47	000333	美的集团	42,119,279.14	8.68
48	600999	招商证券	42,042,308.27	8.67
49	000338	潍柴动力	41,997,991.98	8.66
50	603288	海天味业	41,961,038.14	8.65

51	601788	光大证券	41,864,818.11	8.63
52	600704	物产中大	41,817,865.52	8.62
53	000581	威孚高科	41,793,788.07	8.62
54	600027	华电国际	41,630,949.50	8.58
55	600312	平高电气	41,542,321.88	8.56
56	601877	正泰电器	41,415,343.31	8.54
57	601006	大秦铁路	41,344,086.00	8.52
58	600578	京能电力	41,285,036.58	8.51
59	600011	华能国际	41,262,412.31	8.51
60	600741	华域汽车	41,224,724.22	8.50
61	600566	济川药业	41,182,850.88	8.49
62	002304	洋河股份	41,157,440.19	8.49
63	600170	上海建工	40,950,657.58	8.44
64	002563	森马服饰	40,870,971.21	8.43
65	600177	雅戈尔	40,791,198.84	8.41
66	600660	福耀玻璃	40,610,172.51	8.37
67	002202	金风科技	40,606,125.53	8.37
68	600886	国投电力	40,565,319.90	8.36
69	600066	宇通客车	40,541,365.72	8.36
70	000012	南玻A	40,477,492.43	8.34
71	601328	交通银行	40,456,443.80	8.34
72	601166	兴业银行	40,374,155.41	8.32
73	601818	光大银行	40,365,541.00	8.32
74	600036	招商银行	40,324,214.10	8.31
75	600377	宁沪高速	40,296,588.60	8.31
76	600060	海信电器	40,243,282.69	8.30
77	601988	中国银行	40,241,339.86	8.30
78	600028	中国石化	40,230,627.00	8.29
79	600548	深高速	40,117,788.97	8.27
80	002294	信立泰	40,075,253.89	8.26
81	000550	江铃汽车	39,823,773.37	8.21
82	600585	海螺水泥	39,786,860.04	8.20
83	600068	葛洲坝	39,777,048.05	8.20
84	600612	老凤祥	39,569,983.42	8.16
85	600004	白云机场	39,494,913.44	8.14
86	601668	中国建筑	38,843,884.47	8.01

87	000858	五 粮 液	38,776,343.94	7.99
88	600519	贵州茅台	38,744,881.18	7.99
89	600350	山东高速	38,691,084.64	7.98
90	600690	青岛海尔	38,443,506.87	7.93
91	000402	金 融 街	38,337,170.13	7.90
92	601939	建设银行	38,254,742.00	7.89
93	000488	晨鸣纸业	37,723,838.83	7.78
94	600048	保利地产	37,660,362.40	7.76
95	000568	泸州老窖	37,527,226.57	7.74
96	000876	新 希 望	36,442,498.53	7.51
97	600887	伊利股份	34,667,299.63	7.15
98	000002	万 科A	30,513,376.84	6.29
99	000910	大亚科技	27,730,179.78	5.72
100	000983	西山煤电	26,005,145.50	5.36
101	601991	大唐发电	21,716,954.36	4.48
102	600739	辽宁成大	17,234,746.85	3.55
103	002498	汉缆股份	16,987,148.25	3.50
104	601169	北京银行	16,849,577.78	3.47
105	601928	凤凰传媒	16,452,983.74	3.39
106	000157	中联重科	16,439,106.20	3.39
107	601107	四川成渝	16,257,450.96	3.35
108	601899	紫金矿业	16,233,148.00	3.35
109	000786	北新建材	16,139,957.48	3.33
110	600617	国新能源	15,871,890.37	3.27
111	600406	国电南瑞	15,789,902.80	3.26
112	002142	宁波银行	15,594,137.41	3.21
113	601699	潞安环能	15,498,262.50	3.20
114	600362	江西铜业	15,178,751.98	3.13
115	000543	皖能电力	15,050,869.60	3.10
116	000100	TCL 集团	14,908,965.00	3.07
117	002440	闰土股份	14,617,376.55	3.01
118	601158	重庆水务	13,803,980.09	2.85
119	601633	长城汽车	12,819,310.00	2.64
120	600183	生益科技	12,326,454.40	2.54
121	000418	小天鹅A	12,282,002.88	2.53
122	601336	新华保险	11,997,337.00	2.47

123	600418	江淮汽车	11,575,917.00	2.39
124	600497	驰宏锌锗	10,757,823.61	2.22
125	300232	洲明科技	10,390,906.00	2.14

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。

8.4.2 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	601398	工商银行	88,870,675.54	18.32
2	002311	海大集团	48,827,194.81	10.07
3	600030	中信证券	48,478,487.83	9.99
4	000776	广发证券	39,810,051.46	8.21
5	000895	双汇发展	37,378,001.80	7.71
6	600519	贵州茅台	35,035,955.34	7.22
7	601088	中国神华	33,334,691.98	6.87
8	600376	首开股份	33,072,012.60	6.82
9	600398	海澜之家	32,824,283.32	6.77
10	600036	招商银行	32,244,527.54	6.65
11	600023	浙能电力	32,209,769.93	6.64
12	002701	奥瑞金	31,938,145.24	6.58
13	600104	上汽集团	31,523,942.18	6.50
14	600741	华域汽车	30,923,788.31	6.38
15	000858	五粮液	29,768,722.15	6.14
16	601668	中国建筑	29,116,618.67	6.00
17	000568	泸州老窖	28,493,939.22	5.87
18	000728	国元证券	28,343,330.28	5.84
19	601939	建设银行	28,186,726.22	5.81
20	600660	福耀玻璃	28,171,715.13	5.81
21	000550	江铃汽车	27,269,335.50	5.62
22	000581	威孚高科	27,198,669.96	5.61
23	601601	中国太保	27,197,461.08	5.61
24	601555	东吴证券	27,031,135.40	5.57
25	000012	南玻 A	27,009,431.70	5.57
26	600004	白云机场	26,956,016.18	5.56
27	002294	信立泰	26,909,382.67	5.55
28	000783	长江证券	26,772,580.03	5.52

29	002304	洋河股份	26,771,209.95	5.52
30	002202	金风科技	26,622,258.98	5.49
31	600548	深高速	26,474,797.04	5.46
32	601006	大秦铁路	26,439,111.16	5.45
33	600566	济川药业	26,371,243.84	5.44
34	002146	荣盛发展	26,284,505.08	5.42
35	002563	森马服饰	26,233,941.31	5.41
36	002242	九阳股份	26,170,394.47	5.40
37	600068	葛洲坝	26,088,307.50	5.38
38	600060	海信电器	26,087,683.55	5.38
39	601688	华泰证券	26,039,622.80	5.37
40	000488	晨鸣纸业	25,967,004.92	5.35
41	601166	兴业银行	25,882,143.96	5.34
42	601515	东风股份	25,880,122.12	5.34
43	600377	宁沪高速	25,803,268.77	5.32
44	600028	中国石化	25,631,722.61	5.28
45	600015	华夏银行	25,592,942.71	5.28
46	000338	潍柴动力	25,404,523.30	5.24
47	600066	宇通客车	25,213,479.22	5.20
48	600177	雅戈尔	25,184,335.06	5.19
49	600170	上海建工	25,174,596.11	5.19
50	600350	山东高速	25,167,861.54	5.19
51	600340	华夏幸福	25,149,092.37	5.18
52	601818	光大银行	25,115,376.02	5.18
53	600837	海通证券	25,113,591.19	5.18
54	000963	华东医药	25,108,846.89	5.18
55	601333	广深铁路	24,967,715.94	5.15
56	601328	交通银行	24,939,311.09	5.14
57	000402	金融街	24,881,685.36	5.13
58	600717	天津港	24,866,319.94	5.13
59	600585	海螺水泥	24,852,582.19	5.12
60	600583	海油工程	24,718,832.14	5.10
61	600089	特变电工	24,696,913.32	5.09
62	600690	青岛海尔	24,693,494.15	5.09
63	600612	老凤祥	24,685,577.83	5.09
64	000539	粤电力A	24,634,392.47	5.08
65	601988	中国银行	24,626,349.51	5.08
66	601179	中国西电	24,602,313.84	5.07

67	600270	外运发展	24,584,041.43	5.07
68	600011	华能国际	24,556,440.99	5.06
69	601998	中信银行	24,542,168.44	5.06
70	600578	京能电力	24,456,533.08	5.04
71	002004	华邦健康	24,432,312.13	5.04
72	600999	招商证券	24,399,098.35	5.03
73	600383	金地集团	24,351,801.29	5.02
74	601877	正泰电器	24,338,155.95	5.02
75	300146	汤臣倍健	24,323,305.91	5.01
76	600018	上港集团	24,317,529.14	5.01
77	000625	长安汽车	24,269,317.82	5.00
78	000600	建投能源	24,247,249.63	5.00
79	600704	物产中大	24,241,840.31	5.00
80	601000	唐山港	24,137,818.23	4.98
81	600027	华电国际	24,123,066.70	4.97
82	601788	光大证券	24,076,533.24	4.96
83	600886	国投电力	24,057,148.48	4.96
84	600266	北京城建	24,024,033.59	4.95
85	600894	广日股份	23,993,499.58	4.95
86	603288	海天味业	23,799,497.49	4.91
87	600000	浦发银行	23,772,465.64	4.90
88	600900	长江电力	23,581,161.67	4.86
89	000002	万科A	23,396,497.41	4.82
90	600236	桂冠电力	23,375,984.38	4.82
91	600312	平高电气	23,282,207.19	4.80
92	000333	美的集团	23,111,983.90	4.76
93	600315	上海家化	23,017,735.90	4.75
94	600048	保利地产	22,058,351.62	4.55
95	600183	生益科技	21,957,979.24	4.53
96	600887	伊利股份	20,692,561.49	4.27
97	601991	大唐发电	20,643,728.93	4.26
98	600739	辽宁成大	20,161,170.20	4.16
99	000876	新希望	20,110,839.38	4.15
100	000540	中天城投	20,054,830.70	4.13
101	000983	西山煤电	19,755,875.20	4.07
102	000418	小天鹅A	19,621,384.33	4.05
103	000786	北新建材	18,777,561.39	3.87
104	601169	北京银行	17,677,427.42	3.64

105	600406	国电南瑞	17,319,099.28	3.57
106	000157	中联重科	17,149,337.72	3.54
107	601633	长城汽车	16,892,002.87	3.48
108	601928	凤凰传媒	16,630,851.44	3.43
109	601107	四川成渝	16,599,115.41	3.42
110	601158	重庆水务	16,540,864.89	3.41
111	002440	闰土股份	16,395,143.85	3.38
112	002142	宁波银行	16,351,864.45	3.37
113	002498	汉缆股份	16,137,331.04	3.33
114	000543	皖能电力	15,775,955.60	3.25
115	600617	国新能源	15,771,156.62	3.25
116	601899	紫金矿业	15,653,891.66	3.23
117	600362	江西铜业	13,671,836.91	2.82
118	300232	洲明科技	12,996,834.16	2.68
119	600019	宝钢股份	12,040,714.97	2.48
120	601336	新华保险	12,002,826.27	2.47
121	600497	驰宏锌锗	11,907,969.00	2.45
122	000651	格力电器	11,726,458.50	2.42
123	600563	法拉电子	11,373,333.13	2.34
124	002039	黔源电力	11,039,547.38	2.28
125	002206	海利得	10,994,809.11	2.27
126	002394	联发股份	10,971,249.85	2.26
127	002158	汉钟精机	10,966,723.79	2.26
128	002557	洽洽食品	10,880,757.74	2.24
129	600694	大商股份	10,818,916.47	2.23
130	002419	天虹商场	10,705,677.02	2.21
131	600197	伊力特	10,521,335.97	2.17
132	002275	桂林三金	10,486,255.54	2.16
133	002662	京威股份	10,398,709.01	2.14
134	600658	电子城	10,327,528.23	2.13
135	600897	厦门空港	10,209,254.59	2.10
136	601566	九牧王	10,072,651.47	2.08
137	600507	方大特钢	10,045,786.69	2.07

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。

8.4.3 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	4,945,042,370.91
卖出股票收入（成交）总额	3,558,769,440.03

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	29,967,500.00	1.50
2	央行票据	-	-
3	金融债券	59,928,000.00	3.00
	其中：政策性金融债	59,928,000.00	3.00
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	89,895,500.00	4.50

8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	120210	12 国开 10	600,000	59,928,000.00	3.00
2	019539	16 国债 11	250,000	24,967,500.00	1.25
3	019533	16 国债 05	50,000	5,000,000.00	0.25

注：本基金本报告期末仅持有以上债券。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

8.11.2 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。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

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。

8.12.2

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。

8.12.3 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	2,203,574.77
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,604,354.71
5	应收申购款	88,781.50
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,896,710.98

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十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	000540	中天城投	22,516,865.91	1.13	重大资产重组

8.12.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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
14,349	126,451.27	1,641,639,999.95	90.48%	172,809,294.66	9.52%

9.2 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	112,593.77	0.01%

9.3 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、基金投资和研究部门负责人及本基金基金经理未持有本开放式基金份额。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015 年 1 月 13 日）基金份额总额	1,707,595,123.52
本报告期期初基金份额总额	358,206,042.60
本报告期基金总申购份额	2,700,675,992.44
减:本报告期基金总赎回份额	1,244,432,740.43
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	1,814,449,294.61

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。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 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。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未改变。

11.5 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。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
中信建投		13,300,801,872.51	38.85%	2,413,881.37	38.85%	-
银河证券		22,582,734,940.21	30.40%	1,888,774.53	30.40%	-
开源证券		22,575,352,779.32	30.31%	1,883,357.82	30.31%	-
中泰证券	2	36,479,654.24	0.43%	26,678.28	0.43%	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	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。

11.7.2 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
中信建投	-	-	1,537,800,000.00	89.81%	-	-
银河证券	-	-	50,000,000.00	2.92%	-	-

开源证券	30,950,038.30	100.00%	124,400,000.00	7.27%	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-

§12 影响投资者决策的其他重要信息

2016 年 1 月 11 日至 1 月 22 日期间，本基金仅投资沪深交易所股票以及银行活期存款，因期间内股市主要指数连续出现显著回调，本基金持有的股票总市值持续减少，造成股票资产占基金资产净值的比例低于 90%，同时，间接造成基金持有的银行存款被动超过基金资产净值的 10%。该指标自 2016 年 1 月 11 日起，一度连续被动超标 7 个交易日，管理人在该指标被动超标的第 2 个交易日早上即已通知基金经理关注该指标并要求在基金合同规定的时间内完成调整至符合基金合同的规定，但因管理人通过金证投资交易系统的盘后静态风控模块持续跟踪各项指标的合规情况，于 2016 年 1 月 20 日（即该指标连续被动超标的第 8 个交易日）发现收盘数据显示该指标已符合基金合同的规定。因此，管理人未继续跟踪该指标调整事宜。但在 2016 年 1 月 21 日收盘后通过金证投资交易系统的盘后静态风控模块持续跟踪各项指标的合规情况，再次提示本基金该指标超标，管理人对该指标超标情况再次向基金经理进行提示和跟踪，并重新计算连续超标情况。

但根据托管行于 2016 年 1 月 21 日收盘后来函的信息提示，本基金该指标在 2016 年 1 月 20 日（即该指标连续被动超标的第 8 个交易日）当天收盘后仍然超标，因此，该指标被托管行认定为连续超标达到 8 个交易日，该计算结果与管理人使用的金证投资交易系统 2016 年 1 月 20 日所提示的情况不一致。为了更好的履行管理人职责和严格执行基金合同的规定，管理人在收到托管行来函后的第二个交易日（即 2016 年 1 月 22 日）及时采取措施增持股票资产，并满足基金合同的被动超标调整时限的要求。但由于交易所股票交易的清算规则，不能于当日将资金划出，买入股票当日仅在估值表中体现对应的证券清算款负债项，因此，本基金在 2016 年 1 月 22 日（即该指标连续被动超标的第 10 个交易日）收盘后金证投资交易系统显示该指标仍然超标。

事后，管理人及时与金证投资交易系统供应商联系，检查并修复了投资交易系统中的相关模块，此类情况在本基金的后续运作过程中未再次发生。

前海开源基金管理有限公司
2017 年 3 月 30 日