

前海开源可转债债券型发起式证券投资基金 2016 年年度报告

2016-12-31

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

报告送出日期：2017-03-30

[目录全部展开](#) [目录全部](#)

[收拢](#)

[重要提示](#)

[基金简介](#)

[基金基本情况](#)

[基金产品说明](#)

[基金管理人和基金托管人](#)

[信息披露方式](#)

[其他相关资料](#)

[主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况](#)

[主要会计数据和财务指标](#)

[基金净值表现](#)

[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](#)

[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](#)

[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](#)

[过去三年基金的利润分配情况](#)

[过去三年基金的利润分配情况](#)

[管理人报告](#)

[基金管理人及基金经理情况](#)

[基金管理人及其管理基金的经验](#)

[基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介](#)
[管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明](#)

管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

公平交易制度和控制方法
公平交易制度的执行情况
异常交易行为的专项说明
管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内基金的业绩表现
管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

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

托管人报告

报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

审计报告

审计报告基本信息

审计报告的基本内容

年度财务报表

资产负债表

利润表

所有者权益（基金净值）

变动表

报表附注

基金基本情况

会计报表的编制基础

遵循企业会计准则及其他

有关规定的声明

重要会计政策和会计估计

投资目标

本基金主要利用可转债品种兼具债券和股票的特性，在合理控制风险、保持适当流动性的基础上，力争取得超越基金业绩比较基准的收益。

本基金的投资策略主要有以下三方面内容：

1、资产配置策略：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，在充分研究宏观经济因素的基础上，判断宏观经济周期所处阶段和未来发展趋势。本基金将依据经济周期理论，结合对证券市场的研究、分析和风险评估，分析未来一段时期内本基金在大类资产的配置方面的风险和收益预期，评估相关投资标的的投资价值，制定本基金在固定收益类、权益类和现金等大类资产之间的配置比例；2、债券投资策略：本基金债券投资将主要采取组合久期配置策略，同时辅之以收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略等积极投资策略。针对本基金主要投资标的的可转债，在投资策略上将根据可转债自身特点，分析发行主体赋予其可转债的各项条款，结合分析市场行情，在转股期内做出合理的投资决策；3、股票投资策略：本基金将精选有良好增值潜力的股票构建股票投资组合。股票投资策略将从定性和定量两方面入手，定性方面主要考察上市公司所属行业发展前景、行业地位、竞争优势、管理团队、创新能力等多种因素；定量方面考量公司估值、资产质量及财务状况，比较分析各优质上市公司的估值、成长及财务指标，优先选择具有相对比较优势的公司作为最终股票投资对象。

投资策略

业绩比较基

准

中证可转换债券指数收益率×70%+中证综合债指数收益率×20%+沪深300指数收益率×10%

风险收益特

征

本基金为债券型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金，低于混合型基金、股票型基金。



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
	联系电话	0755-88601888
	电子邮箱	qhky@qhkyfund.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）	
	办公地址	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

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
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

项目	名称	办公地址
会计师事务所	瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区永定门西滨河路8号院7号楼中海地产广场西塔5-11层
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

金额单位：人民币元

期间 数据 和指 标	2016年	2015年	2014-03-25 至 2014-12-31
	本期 已实 现收	-1,569,843.13	16,443,067.42

注：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 2014 年 3 月 25 日生效, 截至 2014 年 12 月 31 日成立不满 1 年, 故 2014 年年度数据与指标为不完整会计年度数据。

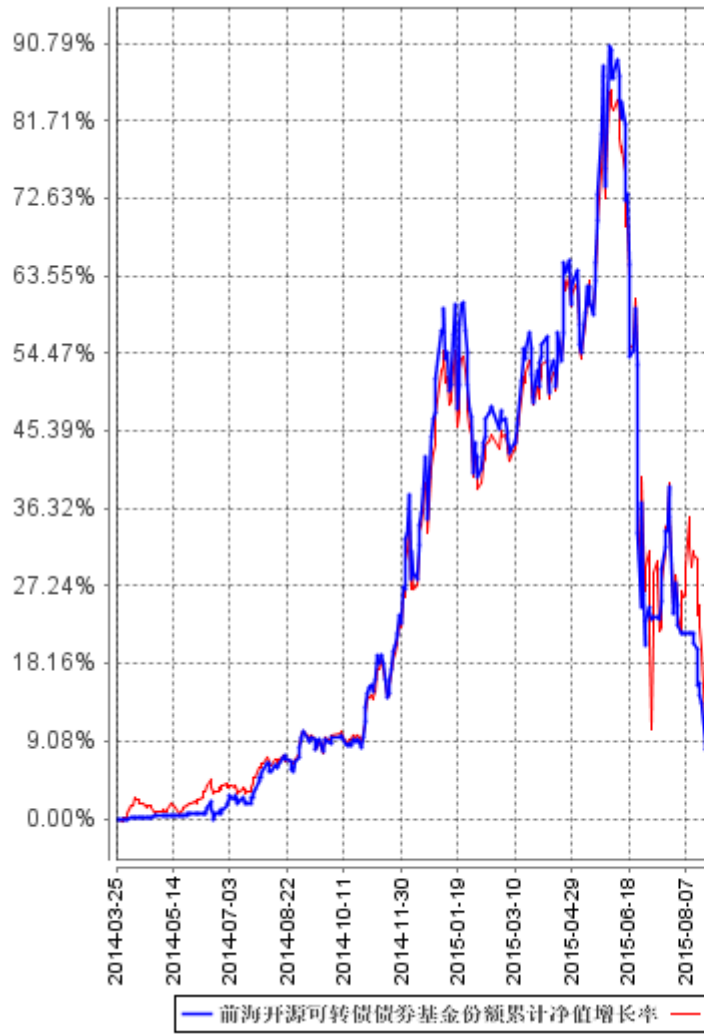
基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	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	-3.79%	0.55%	-2.73%	0.45%	-1.06%	0.10%
过去六个月	-1.17%	0.49%	0.74%	0.41%	-1.91%	0.08%
过去一年	-13.11%	0.76%	-8.87%	0.61%	-4.24%	0.15%
自基金合同生效起至今	8.79%	1.57%	12.83%	1.56%	-4.04%	0.01%

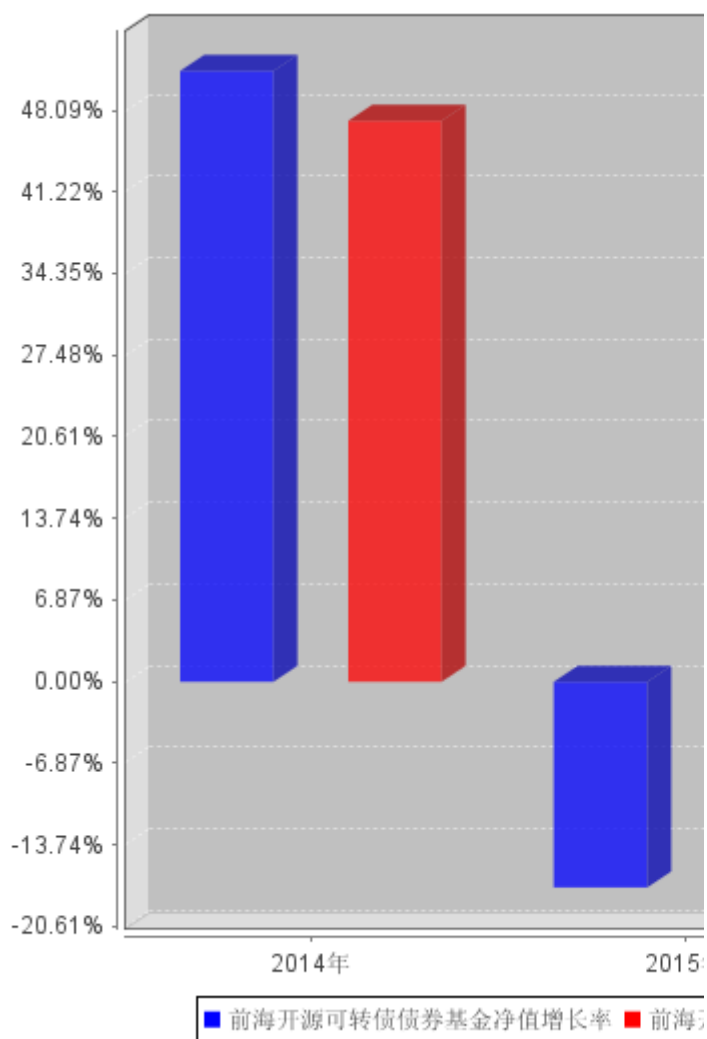
注：注：本基金业绩比较基准为：中证可转换债券指数收益率

×70%+中证综合债指数收益率×20%+沪深 300 指数收益率×10%。

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



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：注：本基金的基金合同于2014年3月25日生效，2014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。

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
2014	0.0000	0.00	0.00	0.00	
2015	3.7000	397,436,997.95	332,624.61	397,769,622.56	
2016	0.0000	0.00	0.00	0.00	
合计	3.7000	397,436,997.95	332,624.61	397,769,622.56	

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。

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 理期限		证券 从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
倪枫	本基金的 基金经理	2015-09-25	-	6 年	倪枫先生，北京大学硕士研究生，历任中国航天科工集团公司财务科员、航天科工资产管理有限公司证券投资部总经理、航天科工财务有限责任公司资产管理部总经理。2015 年 8 月加入前海开源基金管理有限公司。

注：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。

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。

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。

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。

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。

报告期内基金投资策略和运作分析

2016年上半年A股市场经历了一月份系统性暴跌,二、三、四月低位震荡反弹,五、六月震荡下跌,转债市场走势基本与股市同步。基于一月份市场的系统性风险,本基金年初在转债配置上从偏股转债为主向偏股与偏债转债均衡配置调整,并快速降低了股票仓位。春节前后因判断市场系统性下跌基本结束,逐步增加了偏股弹性转债的配置,并提高了股票的配置比例。

三季度A股市场出现一定反弹而后震荡下跌,转债市场走势亦步亦趋。本基金维持了较高的转债仓位,但在三季度后期配置上再次调整为偏股与偏债转债均衡配置以增加组合的防御性。

四季度A股市场反弹创出年内新高后有所回调,转债市场先期跟随A股市场反弹,最后一个月大幅下跌将全年反弹幅度全部抹去并创出年内新低,走势弱于A股。

转债市场系统性下跌创出新低的原因主要是受到无风险利率持续上行的影响,对转债的估值造成较大冲击,同时A股年末下跌造成了转债市场的“戴维斯双杀”。

本基金在四季度的转债配置上仍然延续均衡配置思路,整体转债仓位体现出一定的防御性;股票配置整体对组合有正贡献。失误在于对转债市场的系统性风险估计不足,错失了最佳的调仓时间窗口。

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-13.11%,同期业绩比较基准收益率为-8.87%。

2017年国内面临积极财政政策、中性货币政策及抑制房地产市场泡沫的政策环境,国际上面临美国新任总统上台后贸易摩擦加大的可能性。因此大概率宏观经济仍然维持缓慢下行的格局。

A股市场影响因素中货币政策的边际变化造成无风险利率缓慢抬升,持续性有待观察;各项改革政策特别是国企改革政策逐步落地将提升风险偏好;经济的缓慢下行市场已有认知。因此,再考虑到股票市场流动性状况后(全年看股票市场资金供给或大于需求)对市场看法平衡偏乐观,大概率市场在震荡中中枢缓慢抬升。

转债市场2016年全年表现较差,中证转债指数下跌11.8%,核心原因是转债品种的稀缺造成估值水平难以回到低位,无风险利率的长期低位也对转债的较高估值推波助澜,转债市场表现为在偏高的估值水平上围绕A股市场走势波动,估值更易向下变动的情况下走势羸弱。展望2017年,转债市场扩容加速将是大概率事件,无风险利率亦出现一定抬升,再叠加对股票市场的判断,全年需在低估值的偏股型转债和高到期收益率的偏债型转债中进行精选和平衡,趋势性机会需等待转债市场回归合理估值水平。

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。

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。

本报告期内，本基金未进行利润分配。

-

本基金本报告期内，出现了连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，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。

本基金为发起式基金，截止 2016 年 12 月 31 日，本基金成立未满三年。《公开募集证券投资基金运作管理办法》关于基金份额持有人数量及基金资产净值的限制性条款暂不适用于本基金。

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。

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，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

财务报表是否经过审计	是
审计意见	标准无保留意见
审计报告编号	瑞华审字【2017】48460036号

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	前海开源可转债债券型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的前海开源可转债债券型发起式证券投资基金的财务报表，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。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是基金管理人前海开源基金管理有限公司的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会（以下简称“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财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，

会计主体：前海开源可转债债券型发起式证券投资基金
报告截止日：2016-12-31

单位：人民币元

资产	本期末	上年度末
	2016-12-31	2015-12-31
资产：		
银行存款	876,519.02	208,976.34
结算备付金	8,990.89	100,898.64
存出保证金	2,225.49	24,153.66
交易性金融资产	14,334,693.00	17,829,316.80
其中：股票投资	1,761,258.00	2,949,500.00
基金投资	-	-
债券投资	12,573,435.00	14,879,816.80
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	-	127,003.60
应收利息	34,475.02	68,364.75
应收股利	-	-
应收申购款	1,160.62	44,711.38
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	15,258,064.04	18,403,425.18
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2016-12-31	2015-12-31
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	-	106,509.45
应付赎回款	-	18,217.02
应付管理人报酬	12,802.13	14,836.58
应付托管费	2,560.44	2,967.34
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	774.87	20,776.17
应交税费	-	-
应付利息	-	-

应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	200,000.00	150,013.67
负债合计	216,137.44	313,320.23
所有者权益：	-	-
实收基金	19,730,836.19	20,630,358.64
未分配利润	-4,688,909.59	-2,540,253.72
所有者权益合计	15,041,926.60	18,090,104.92
负债和所有者权益总计	15,258,064.04	18,403,425.15

注：注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.762 元，基金份额总额 19,730,836.19 份。

会计主体：前海开源可转债债券型发起式证券投资基金

本报告期：2016-01-01 至 2016-12-31

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016-01-01 至 2016-12-31	2015-01-01 至 2015-12-31
一、收入	-1,980,568.91	-4,273,557.50
1. 利息收入	88,170.81	384,480.68
其中：存款利息收入	4,272.90	167,230.25
债券利息收入	79,308.17	146,871.74
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	4,589.74	70,378.69
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-1,290,249.89	16,776,389.15
其中：股票投资收益	510,751.67	1,670,050.16
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-1,803,251.27	15,071,328.99
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生工具	-	-
股利	2,249.71	35,010.00
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-780,447.54	-21,704,501.74
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	1,957.71	270,074.41

会计主体：前海开源可转债债券型发起式证券投资基金

本报告期：2016-01-01 至 2016-12-31

单位：人民币元

项目	本期 2016-01-01 至 2016-12-31		
	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）	20,630,358.64	-2,540,253.72	18,090,104.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-2,350,290.67	-2,350,290.67
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）	-899,522.45	201,634.80	-697,887.65
其中：1. 基金申购款	9,653,472.72	-2,118,219.91	7,535,252.81
2. 基金赎回款	-10,552,995.17	2,319,854.71	-8,233,140.46
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）	19,730,836.19	-4,688,909.59	15,041,926.60
项目	上年度可比期间 2015-01-01 至 2015-12-31		
	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）	68,204,398.77	35,053,390.24	103,257,789.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-5,261,434.32	-5,261,434.32
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）	-47,574,040.13	365,437.92	-47,208,602.21
其中：1. 基金申购款	1,145,605,356.73	253,230,917.05	1,398,836,273.78
2. 基金赎回款	-1,193,179,396.86	112,206,495.87	-1,080,972,900.99
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	-	-397,769,622.56	-397,769,622.56

减少以“-”号填列)

五、期末所有者权益（基金净值）	20,630,358.64	-2,540,253.72	18,090,104.92
-----------------	---------------	---------------	---------------

本报告第 7.1 页至第 7.4 页财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：蔡颖
主管会计工作负责人：李志祥
会计机构负责人：任福利

注：此处为 PDF 文件中的章节数或者页数。

基金基本情况

前海开源可转债债券型发起式证券投资基金（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】108 号文《关于核准前海开源可转债债券型发起式证券投资基金募集的批复》核准，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》、《前海开源可转债债券型发起式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 3 月 3 日至 2014 年 3 月 21 日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 147,769,483.56 元经瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）瑞华验字[2014]第 02030005 号验证报告予以验证。经向中国证监会备案，《前海开源可转债债券型发起式证券投资基金基金合同》于 2014 年 3 月 25 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 147,792,458.95 份基金份额，其中认购资金利息折合 22,975.39 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。

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》、《前海开源可转债债券型发起式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。

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。

重要会计政策和会计估计

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。

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。

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。

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。

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。

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。

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。

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)”。

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。

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。

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。

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。

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。

会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

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。

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。

差错更正的说明

本基金本报告期未发生会计差错更正。

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。

重要财务报表项目的说明

银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2016-12-31	2015-12-31
活期存款	876,519.02	208,976.34
定期存款	-	-
其中：存款期限1-3个月	-	-
其他存款	-	-
合计	876,519.02	208,976.34

交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016-12-31		公允价值变 动
	成本	公允价值	
股票	1,773,911.08	1,761,258.00	-12,653.08
贵金属投资-金交所黄金合 约	-	-	-
交易所市场	13,064,437.40	12,573,435.00	-491,002.40
债券 银行间市场	-	-	-
合计	13,064,437.40	12,573,435.00	-491,002.40
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	14,838,348.48	14,334,693.00	-503,655.48
项目	上年度末 2015-12-31		公允价值变 动
	成本	公允价值	
股票	2,920,625.79	2,949,500.00	28,874.21
贵金属投资-金交所黄金合 约	-	-	-
交易所市场	14,631,898.95	14,879,816.80	247,917.85
债券 银行间市场	-	-	-
合计	14,631,898.95	14,879,816.80	247,917.85
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	17,552,524.74	17,829,316.80	276,792.06

衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末			备注
	2016-12-31			
	合同/名义金额	公允价值		
	资产	负债		
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	-	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	-	-	-	

项目	上年度末			备注
	2015-12-31			
	合同/名义金额	公允价值		
	资产	负债		
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	-	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	-	-	-	

注：本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

买入返售金融资产

各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末	
	账面余额	其中：买断式逆回购
2016-12-31		
项目	上年度末	
	账面余额	其中：买断式逆回购
2015-12-31		

注：本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

期末买断式逆回购交易中取得的债券

单位：人民币元

		本期末						
		2016-12-31						
项目	债券代码	债券名称	约定返售日	估值单价	数量(张)	估值总额	其中:已出售或再质押总额	
		上年度末						
		2015-12-31						
项目	债券代码	债券名称	约定返售日	估值单价	数量(张)	估值总额	其中:已出售或再质押总额	

注:本基金本报告期末及上年度末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

应收利息

单位:人民币元

项目	本期末	上年度末
	2016-12-31	2015-12-31
应收活期存款利息	141.78	76.39
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	4.00	45.40
应收债券利息	34,328.24	68,232.04
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	1.00	10.90
合计	34,475.02	68,364.73

注:注:“其他”为应收结算保证金利息。

其他资产

单位:人民币元

项目	本期末	上年度末
	2016-12-31	2015-12-31
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	-

注:本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2016-12-31	2015-12-31
交易所市场应付交易费用	774.87	20,776.15
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	774.87	20,776.15

其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2016-12-31	2015-12-31
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	13.67
预提费用	200,000.00	150,000.00
合计	200,000.00	150,013.67

实收基金

单位：人民币元

项目	本期	
	2016-01-01 至 2016-12-31	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	20,630,358.64	20,630,358.64
本期申购	9,653,472.72	9,653,472.72
本期赎回（ 以“-”号填 列）	-10,552,995.17	-10,552,995.17
本期末	19,730,836.19	19,730,836.19

注：注：申购含红利再投、转换入份（金）额；赎回含转换出份（金）额。

未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,116,993.23	-6,657,246.95	-2,540,253.72
本期利润	-1,569,843.13	-780,447.54	-2,350,290.67
本期基金份额交易产生的变动数	-143,421.28	345,056.08	201,634.80
其中：基金申购款	1,167,761.87	-3,285,981.78	-2,118,219.91
基金赎回款	-1,311,183.15	3,631,037.86	2,319,854.71
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,403,728.82	-7,092,638.41	-4,688,909.59

存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016-01-01至2016-12-31	2015-01-01至2015-12-31
活期存款利息收入	2,884.75	118,699.50
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	1,132.00	21,398.21
其他	256.15	27,132.54
合计	4,272.90	167,230.25

注：注：“其他”为申购款利息收入及结算保证金利息收入。

股票投资收益

股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016-01-01至2016-12-31	2015-01-01至2015-12-31
卖出股票成交总额	21,068,879.26	48,314,708.49
减：卖出股票成本总额	20,558,127.59	46,644,658.33
买卖股票差价收入	510,751.67	1,670,050.16

债券投资收益

债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016-01-01 至 2016-12-31	2015-01-01 至 2015-12-31
债券投资收益——		
买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-1,803,251.27	15,071,328.99
债券投资收益——		
赎回差价收入	-	-
债券投资收益——		
申购差价收入	-	-
合计	-1,803,251.27	15,071,328.99

债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016-01-01 至 2016-12-31	2015-01-01 至 2015-12-31
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	28,143,014.94	194,340,717.77
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	29,822,775.01	178,457,091.88
减：应收利息总额	123,491.20	812,296.99
买卖债券差价收入	-1,803,251.27	15,071,328.99

债券投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016-01-01 至 2016-12-31	2015-01-01 至 2015-12-31
赎回基金份额对价总额	-	-
减：现金支付赎回款总额	-	-
减：赎回债券成本总额	-	-
减：赎回债券应收利息总额	-	-
赎回差价收入	-	-

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内无债券赎回差价收入。

债券投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016-01-01 至 2016-12-31	2015-01-01 至 2015-12-31
	-31	-31
申购基金份额对价总额	-	-
减：现金支付申购款总额	-	-
减：申购债券成本总额	-	-
减：申购债券应收利息总额	-	-
申购差价收入	-	-

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内无债券申购差价收入。

资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016-01-01 至 2016-12-31	2015-01-01 至 2015-12-31
	-31	-31
卖出资产支持证券成交总额	-	-
减：卖出资产支持证券成本总额	-	-
减：应收利息总额	-	-
资产支持证券投资收益	-	-

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内无资产支持证券投资收益。

衍生工具收益

衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016-01-01 至 2016-12-31	2015-01-01 至 2015-12-31
	-31	-31
卖出权证成交总额	-	-
减：卖出权证成本总额	-	-
买卖权证差价收入	-	-

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内无买卖权证差价收入。

衍生工具收益——其他投资收益

项目	本期收益金额	上年度可比期间收益金
	2016-01-01 至 2016-12-31	2015-01-01 至 2015-12-31
	-31	-31

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内无其他衍生工具投资收益。

股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016-01-01 至 2016-12-31	2015-01-01 至 2015-12-31
	-31	-31
股票投资产生的股利收益	2,249.71	35,010.00
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	2,249.71	35,010.00

公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016-01-01 至 2016-12-31	2015-01-01 至 2015-12-31
	-31	-31
1. 交易性金融资产	-780,447.54	-21,704,501.74
——股票投资	-41,527.29	-625,925.79
——债券投资	-738,920.25	-21,078,575.95
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	-780,447.54	-21,704,501.74

其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016-01-01 至 2016-12-31	2015-01-01 至 2015-12-31
基金赎回费收入	1,693.48	266,620.19
基金转换费收入	264.23	3,454.29
合计	1,957.71	270,074.48

交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016-01-01 至 2016-12-31	2015-01-01 至 2015-12-31
交易所市场交易费用	54,642.54	116,313.91
银行间市场交易费用	-	-
合计	54,642.54	116,313.91

其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016-01-01 至 2016-12-31	2015-01-01 至 2015-12-31
审计费用	50,000.00	40,000.00
信息披露费	50,000.00	125,000.00
汇划费	1,498.42	3,340.30
债券托管账户维护费	18,000.00	-
其他	400.00	4,700.00
合计	119,898.42	173,040.30

注：注：“其他”为证券账户开户费、托管银行账户维护费及审计询证费。

或有事项、资产负债表日后事项的说明

或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

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。

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：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。

本报告期及上年度可比期间的关联方交易

通过关联方交易单元进行的交易

股票交易

单位：人民币万

关联方名称	本期 2016-01-01 至 2016-12-31		上年度可比期间 2015-01-01 至 2015-12-31	
	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

注：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。

权证交易

单位：人民币万

关联方名称	本期 2016-01-01 至 2016-12-31		上年度可比期间 2015-01-01 至 2015-12-31	
	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

注：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。

应支付关联方的佣金

金额单位：人民币万

关联方名称	本期 2016-01-01 至 2016-12-31			
	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
关联方名称	上年度可比期间 2015-01-01 至 2015-12-31			
	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

注：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。

关联方报酬

基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016-01-01 至 2016-12-31	2015-01-01 至 2015-12-31
	-31	-31
当期发生的基金应支付的管理费	157,277.94	525,192.09
其中：支付销售机构的客户维护费	34,096.60	244,184.56

注：注：本基金的管理费按前一日资产净值的 1.00% 年费率计提。

管理费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 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。

基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016-01-01 至 2016-12-31	2015-01-01 至 2015-12-31
	-31	-31
当期发生的基金应支付的托管费	31,455.65	105,038.44

注：注：本基金的托管费按前一日资产净值的 0.20% 的年费率计提。

托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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

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
	2016-01-01 至 2016-12-31
	当期发生的基金应支付的销售服务费
	上年度可比期间
获得销售服务费的各关联方名称	2015-01-01 至 2015-12-31
	当期应支付的销售服务费

注：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。

与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期					
	2016-01-01 至 2016-12-31					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买	基金卖	交易金	利息收	交易金	利息支
	入	出	额	入	额	出
	上年度可比期间					
	2015-01-01 至 2015-12-31					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买	基金卖	交易金	利息收	交易金	利息支
	入	出	额	入	额	出

注：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。

各关联方投资本基金的情况

报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2016-01-01 至 2016-12-31	2015-01-01 至 2015-12-31
基金合同生效日（2014-03-25）持有的基金份额	9,999,525.00	-
报告期初持有的基金份额	9,999,525.00	9,999,525.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	9,999,525.00	9,999,525.00
报告期末持有的基金份额占基金总额比例	50.68%	48.47%

注：注：基金管理人运用固有资金投资本基金相关费率按照基金合同及招募说明书规定执行。

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

份额单位：份

项目	本期末		上年度末	
	2016-12-31		2015-12-31	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例

注：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。

由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2016-01-01 至 2016-12-31		2015-01-01 至 2015-12-31	
	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	876,519.02	2,884.75	208,976.34	118,699.50

注：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。

本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

本期 2016-01-01 至 2016-12-31					基金在承销 期内买入	
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	数量（单 位：股/ 张）	总 金 额	
上年度可比期间 2015-01-01 至 2015-12-31					基金在承销 期内买入	
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	数量（单 位：股/ 张）	总 金 额	

注：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。

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。

利润分配情况

利润分配情况——非货币市场基金

单位：人民币元

序号	权益登记 日	除息日	每 10 份基 金份 额分 红数	现金 形式 发放 总额	再投 资形 式发 放总 额	本期 利润 分配 合计	备注
----	-----------	-----	------------------------------	----------------------	---------------------------	----------------------	----

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

期末（2016-12-31）本基金持有的流通受限证券

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

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

受限证券类别：债券

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（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	-------	------	--------	------	--------	-------	--------	--------	----

注：本基金本报告期末无因认购新发或增发而持有流通受限证券。

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	复牌开盘价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300065	海兰信	2016-12-08	重大资产重组	35.89	-	-	5,000	204,849.00	179,450.00	-

注：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2017年3月23日。

期末债券正回购交易中作为抵押的债券

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
------	------	-------	--------	-------	--------

金额单位：人民币元

注：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。

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。

金融工具风险及管理

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要是信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以监察及风险控制委员会、督察长、风险控制委员会、监察稽核部、金融工程部和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立监察及风险控制委员会，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；本基金的基金管理人设立督察长制度，积极对公司各项制度、业务的合法合规性及内部控制制度的执行情况进行监察、稽核，定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况；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，将风险控制可在承受的范围内。

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；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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。

按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币万

短期信用评级	本期末	上年度末
	2016-12-31	2015-12-31
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

注：本基金本报告期末未持有短期信用评级的债券。

按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末	上年度末
	2016-12-31	2015-12-31
AAA	6,782,801.00	12,169,596.80
AAA 以下	4,990,634.00	1,710,120.00
未评级	800,000.00	1,000,100.00
合计	12,573,435.00	14,879,816.80

注：注：未评级债券为国债、央票及政策性金融债等。债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

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的投资品种比例等。本基金所持大部分证券在证券交易所或银行间同业市场交易，除在“期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制的情况外，其余均能及时变现。

金融资产和金融负债的到期期限分析

单位：人民币元

本期末 2016-12-31	合计
资产	
资产总计	
负债	
负债总计	-
流动性净额	
上年度末 2015-12-31	合计
资产	
资产总计	
负债	
负债总计	-
流动性净额	

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。

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。

利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016-12-31	1年以内	1-5年	不计息	合计
资产				
银行存款	876,519.02	-	-	876,519.02
结算备付金	8,990.89	-	-	8,990.89
存出保证金	2,225.49	-	-	2,225.49
交易性金融资产	9,359,041.00	3,214,394.00	1,761,258.00	14,334,693.00
应收利息	-	-	34,475.02	34,475.02
应收申购款	-	-	1,160.62	1,160.62
资产总计	10,246,776.40	3,214,394.00	1,796,893.64	15,258,064.04
负债				

注：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。

利率风险的敏感性分析

假设	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（ 相关风险变量的 单位：人民币元）	
	本期末 2016-12-31	上年度末 2015-12-31
除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
变动		
分析 基准点利率增加 0.25%	-264.91	
基准点利率减少 0.25%	265.12	

外汇风险

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

外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末			合
	2016-12-31			
	美元折合人民	港币折合人民	其他币种折合人民	
	币	币	币	计
以外币计价的资产				
资产合计	-	-	-	-
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表				
外汇风险敞口净额	-	-	-	-
项目	上期末			合
	2015-12-31			
	美元折合人民	港币折合人民	其他币种折合人民	
	币	币	币	计
以外币计价的资产				
资产合计	-	-	-	-
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表				
外汇风险敞口净额	-	-	-	-

外汇风险的敏感性分析

假设	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）		
	相关风险变量的变动	本期末	上年度末
		2016-12-31	2015-12-31

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。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。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。

其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末		上年度末	
	2016-12-31	占基金资产净值比例 (%)	2015-12-31	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,761,258.00	11.71	2,949,500.00	16.30
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	1,761,258.00	11.71	2,949,500.00	16.30

其他价格风险的敏感性分析

假设	若其他市场变量保持不变，对市场价格敏感的权益性投资的市场价格上升或下降 5%	对资产负债表日基金资产净值的影响	
		金额（单位：人民币元）	
	相关风险变量的变动	本期末	上年度末
分析		2016-12-31	2015-12-31
	权益性投资的市场价格上升 5%	111,535.95	198,676.50
	权益性投资的市场价格下降 5%	-111,535.95	-198,676.50

假设	-		
	-		
分析	风险价值（金额单位：人民币元）	本期末	上年度末
		2016-12-31	2015-12-31

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 8,556,372.00 元，属于第二层次的余额为 5,778,321.00 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 6,899,102.00 元，属于第二层次的余额为 10,930,214.80 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。

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益类投资	1,761,258.00	11.54
	其中：股票	1,761,258.00	11.54
2	固定收益投资	12,573,435.00	82.41
	其中：债券	12,573,435.00	82.41
	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	-	-
	银行存款和结算备付金	-	-
6	合计	885,509.91	5.80
7	其他各项资产	37,861.13	0.25
8	合计	15,258,064.04	100.00

报告期末按行业分类的股票投资组合

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	1,399,898.00	9.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	361,360.00	2.40
S	综合	-	-
	合计	1,761,258.00	11.71

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 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	002366	台海核电	10,000	536,200.00	3.56
2	002343	慈文传媒	8,000	361,360.00	2.40
3	603085	天成自控	6,900	347,208.00	2.31
4	000915	山大华特	8,000	337,040.00	2.24
5	300065	海兰信	5,000	179,450.00	1.19

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	002407	多氟多	1,883,117.00	10.41
2	002458	益生股份	1,404,921.00	7.71
3	300091	金通灵	1,190,183.00	6.58
4	600054	黄山旅游	1,150,347.54	6.36
5	000909	数源科技	1,108,962.00	6.13
6	300065	海兰信	813,873.00	4.50
7	002013	中航机电	777,422.00	4.30
8	600029	南方航空	769,185.00	4.25
9	300302	同有科技	720,843.00	3.98
10	002074	国轩高科	619,199.00	3.42
11	002583	海能达	609,048.00	3.31
12	600867	通化东宝	553,328.00	3.06
13	002511	中顺洁柔	551,077.00	3.05
14	600559	老白干酒	542,363.26	3.00
15	002366	台海核电	525,178.00	2.90
16	601689	拓普集团	452,011.00	2.50
17	600419	天润乳业	431,176.00	2.38
18	002299	圣农发展	376,605.00	2.08
19	300252	金信诺	375,806.00	2.08
20	603085	天成自控	368,176.00	2.04

注：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。

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	002407	多氟多	1,901,297.00	10.51
2	002458	益生股份	1,527,199.00	8.44
3	300091	金通灵	1,406,996.00	7.78
4	000909	数源科技	1,214,051.00	6.71
5	600054	黄山旅游	1,170,366.00	6.47
6	002013	中航机电	821,523.09	4.54
7	300302	同有科技	771,690.00	4.27
8	002583	海能达	691,400.00	3.82
9	600029	南方航空	656,752.97	3.63
10	002511	中顺洁柔	652,061.20	3.60
11	002074	国轩高科	617,935.00	3.42
12	600559	老白干酒	616,900.00	3.41
13	600419	天润乳业	586,145.00	3.24
14	600562	国睿科技	531,710.00	2.94
15	600867	通化东宝	523,390.00	2.89
16	300065	海兰信	516,404.00	2.85
17	600172	黄河旋风	456,600.00	2.52
18	603308	应流股份	421,613.00	2.33
19	601689	拓普集团	413,755.05	2.29
20	300333	兆日科技	390,973.00	2.16
21	300098	高新兴	383,757.40	2.12

注：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。

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	19,411,412.88
卖出股票收入（成交）总额	21,068,879.26

注：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。

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	800,000.00	5.35
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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）	11,773,435.00	78.25
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	12,573,435.00	83.59

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（元）	占基金资产净值比例 (%)
1	110033	国贸转债	16,740	1,918,404.00	12.75
2	113009	广汽转债	12,000	1,393,440.00	9.26
3	132005	15 国资 EB	12,000	1,332,000.00	8.86
4	110035	白云转债	9,000	1,121,040.00	7.45
5	113008	电气转债	8,900	1,018,427.00	6.77

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

序号	贵金属代码	贵金属名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
----	-------	-------	-------	---------	---------------

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

注：本基金本报告期末未持有权证。

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量 (买/卖)	合约市值	公允价值 变动	风险说明
	公允价值变动总额合计			-	
	股指期货投资本期收益			-	
	股指期货投资本期公允价值变动			-	

本基金投资股指期货的投资政策

-

本期国债期货投资政策

代码	名称	持仓量 (买/卖)	合约市值 (元)	公允价值 变动(元)	风险指标 说明
	公允价值变动总额合计(元)			-	
	国债期货投资本期收益(元)			-	
	国债期货投资本期公允价值变动 (元)			-	

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

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。

本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚情况的说明

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未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。

基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

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	2,225.49
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	34,475.02
5	应收申购款	1,160.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	37,861.13

期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110033	国贸转债	1,918,404.00	12.75
2	113009	广汽转债	1,393,440.00	9.26
3	132005	15 国资 EB	1,332,000.00	8.86
4	110035	白云转债	1,121,040.00	7.45
5	113008	电气转债	1,018,427.00	6.71
6	110034	九州转债	853,650.00	5.68
7	113010	江南转债	809,400.00	5.38
8	123001	蓝标转债	652,260.00	4.34
9	132004	15 国盛 EB	593,760.00	3.95
10	132001	14 宝钢 EB	566,050.00	3.76
11	132002	15 天集 EB	530,550.00	3.53
12	128010	顺昌转债	118,530.00	0.79
13	132003	15 清控 EB	109,440.00	0.73
14	128012	辉丰转债	107,840.00	0.72

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	300065	海兰信	179,450.00	1.19	重大资产重组

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。

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
922	21,400.04	11,035,310.77	55.93%	8,695,525.42	44.07%

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	-	0

注：本报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金份额。

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

注：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。

项目	持有份额		发起份额		发起份 额承诺 持有期 限
	持有份额总数	占基金总 份额比例	发起份额总数	占基金总 份额比例	
基金管 理人固 有资金	9,999,525.00	50.68%	9,999,525.00	50.68%	三年
基金管 理人高 级管理 人员	-	-%	-	-%	-
基金经 理等人 员	-	-%	-	-%	-
基金管 理人股 东	-	-%	-	-%	-
其他	-	-%	-	-%	-
合计	9,999,525.00	50.68%	9,999,525.00	50.68%	-

注：注：①上述份额总数为扣除认购费用并包含利息结转份额后的总份额数。

②本基金发起式资金提供方仅为基金管理人，基金管理人高级管理人员、基金经理、其他从业人员持有的基金份额不属于发起份额。

单位：份

项目	数值
基金合同生效日 (2014-03-25)的 基金份额总额	147,792,458.95
本报告期期初基金 份额总额	20,630,358.64
本报告期间基金 总申购份额	9,653,472.72
减：本报告期间 基金总赎回份额	10,552,995.17
本报告期间基金 拆分变动份额	-
本报告期期末基金 份额总额	19,730,836.19

注：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。

报告期内无基金份额持有人大会决议。

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。

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。

本基金在本报告期内未改变基金的投资策略。

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。

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。

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		基金交 易		债券交 易		债券回 购交易		权证交 易		应支付 该券商 的佣金		备 注
		成 交 金 额	占当 期股 票交 易总 额 的 比 例	成 交 金 额	占当 期基 金交 易总 额 的 比 例	成 交 金 额	占当 期债 券交 易总 额 的 比 例	成 交 金 额	占当 期债 券回 购交 易总 额 的 比 例	成 交 金 额	占当 期权 证交 易总 额 的 比 例	佣 金	占当 期佣 金总 量 的 比 例	
东 兴 证 券	38			51		79						28		
	,9			,3		,8						,4		
	42	96.	-	67	94.	00	98.	-	-	-	78	96.	-	
	2,3	26%		,1	38%	00	76%				.4	26%		
	48			16		00					4			
.1			.7		.0						4			
4			3		0									
1,			1,											
14			77								83	2.8	-	
4,	2.8	-	8,	3.2	-	-	-	-	-	-	7.	3%	-	
2	70	3%	55	7%							12			
3.			9.											
00			39											
36			1,		1,									
8,			27		00						26	0.9	-	
1	17	0.9	8,	2.3	0,	1.2					9.	1%	-	
6.	1%	-	38	5%	00	4%					26			
00			8.		0.									
			94		00									
银 河 证 券	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	

注：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：

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	前海开源基金管理有限公司旗下基金 2015 年度最后一个交易日基金资产净值、基金份额净值及基金份额累计净值公告	上海证券报	2016-01-04
2	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加腾元基金为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告	上海证券报	2016-01-11
3	前海开源可转债债券型发起式证券投资基金 2015 年第 4 季度报告	上海证券报	2016-01-22
4	前海开源基金管理有限公司关于前海开源可转债债券型发起式证券投资基金增聘基金经理公告	上海证券报	2016-02-17
5	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加平安证券为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告	上海证券报	2016-02-29
6	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	上海证券报	2016-03-03
7	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	上海证券报	2016-03-11
8	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	上海证券报	2016-03-18
9	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	上海证券报	2016-03-22
10	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金继续参与中国工商银行申购费率优惠活动的公告	上海证券报	2016-03-25
11	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	上海证券报	2016-03-30

12	前海开源可转债债券型发起式 证券投资基金 2015 年年度报 告	上海证券报、基金 管理人的官方网站	2016-03-30
13	前海开源可转债债券型发起式 证券投资基金 2015 年年度报 告摘要	上海证券报	2016-03-30
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	上海证券报	2016-03-30
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	上海证券报	2016-03-31
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	上海证券报	2016-04-06
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	上海证券报	2016-04-08
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	上海证券报	2016-04-18
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	上海证券报	2016-04-20
20	前海开源可转债债券型发起式 证券投资基金 2016 年第 1 季 度报告	上海证券报	2016-04-21
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	上海证券报	2016-04-29
22	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	上海证券报	2016-04-29
23	前海开源基金管理有限公司关 于旗下部分基金增加汇成基金 为代销机构及开通定投和转换 业务并参与其费率优惠活动的 公告	上海证券报	2016-04-29
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	上海证券报	2016-05-05
25	前海开源可转债债券型发起式 证券投资基金招募说明书（更 新）摘要（2016 年第 1 号）	上海证券报	2016-05-09

无

(1) 中国证券监督管理委员会批准前海开源可转债债券型发起式证券投资基金设立的文件

(2) 《前海开源可转债债券型发起式证券投资基金基金合同》

(3) 《前海开源可转债债券型发起式证券投资基金托管协议》

(4) 《前海开源可转债债券型发起式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) 前海开源可转债债券型发起式证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

基金管理人、基金托管人处

(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。