

前海开源沪深 300 指数型证券投资基金 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	前海开源沪深 300 指数
基金主代码	000656
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 6 月 17 日
基金管理人	前海开源基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	46,938,152.91 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪沪深 300 指数，在严格控制基金的日均跟踪偏离度和年跟踪误差的前提下，力争获取与标的指数相似的投资收益。
投资策略	<p>本基金采用完全复制标的指数的方法，进行被动式指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合复制标的指数，并根据标的指数变动而进行相应调整。本基金在严格控制基金日均跟踪偏离度和年跟踪误差的前提下，力争获取与标的指数相似的投资收益。由于标的指数编制方法调整、成份股及其权重变化的原因，或因基金的申购和赎回等其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。</p> <p>1、大类资产配置：本基金管理人主要按照沪深 300 指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的 90%，投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的 85%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。</p> <p>2、股票投资策略：（1）股票投资组合构建：本基金采用完全复制标的指数的方法，按照标的指数成份股组成及其权重构建股票投资组合。若出现特殊情况，本基金将采用替代性的方法构建组合，以减少跟踪误差。（2）股票投资组合的调整：本基金股票投资组合根据沪深 300 指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况等，对其进行适时调整。在正常市场情况下，力争控制本基金的份额净值与业绩比较基准的收益率日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免误差进一步扩大。</p> <p>3、债券投资策略：本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，降低跟踪误差，主要采取组合久期配置策略，同时辅之以收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略等积极投资策略构建债券投资组合。</p>

	<p>4、权证投资策略：根据权证对应公司基本面研究成果确定权证的合理估值，发现市场对股票权证的非理性定价；通过权证与证券的组合投资，来达到改善组合风险收益特征的目的。</p> <p>5、股指期货投资策略：本基金以套期保值为目的，参与股指期货交易。运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，以达到降低投资组合的整体风险的目的。基金管理人将建立股指期货投资决策部门或小组，经董事会批准后执行。若相关法律法规发生变化时，基金管理人从其最新规定。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金属于采用指数化操作的股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金，为证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		前海开源基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	傅成斌	林葛
	联系电话	0755-88601888	010-66060069
	电子邮箱	qhky@qhkyfund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4001666998	95599
传真		0755-83181169	010-68121816

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	2014 年 6 月 17 日 (基金合同生效日)-2014 年 12 月 31 日
本期已实现收益	6,996,569.56	16,243,122.14	11,778,297.93
本期利润	9,287,423.44	7,974,663.71	20,061,230.11

加权平均基金份额本期利润	0.0638	0.6866	0.3230
本期基金份额净值增长率	-1.01%	-7.96%	49.50%
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	0.0804	0.3762	0.4160
期末基金资产净值	50,710,082.36	4,764,423.43	39,490,098.31
期末基金份额净值	1.080	1.376	1.495

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 6 月 17 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。

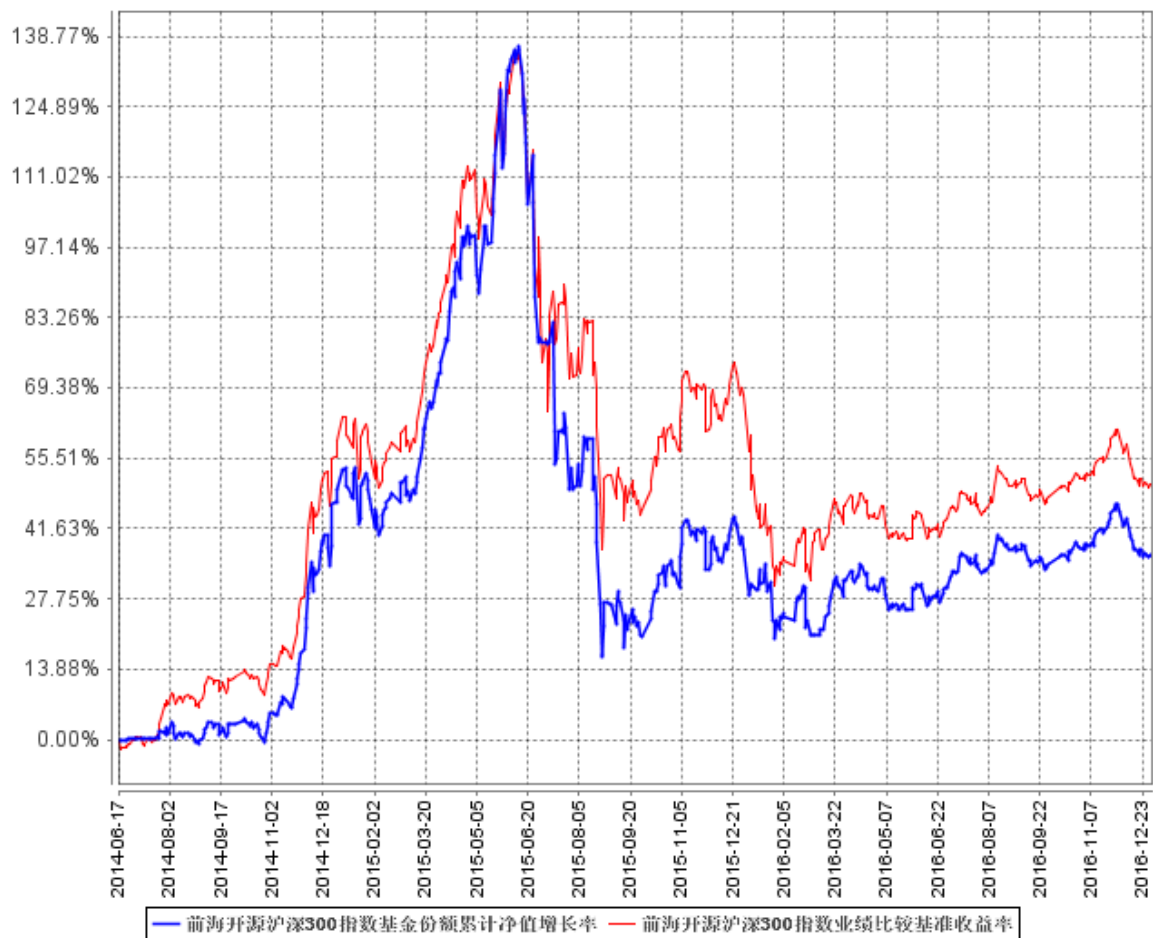
3.2 基金净值表现

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

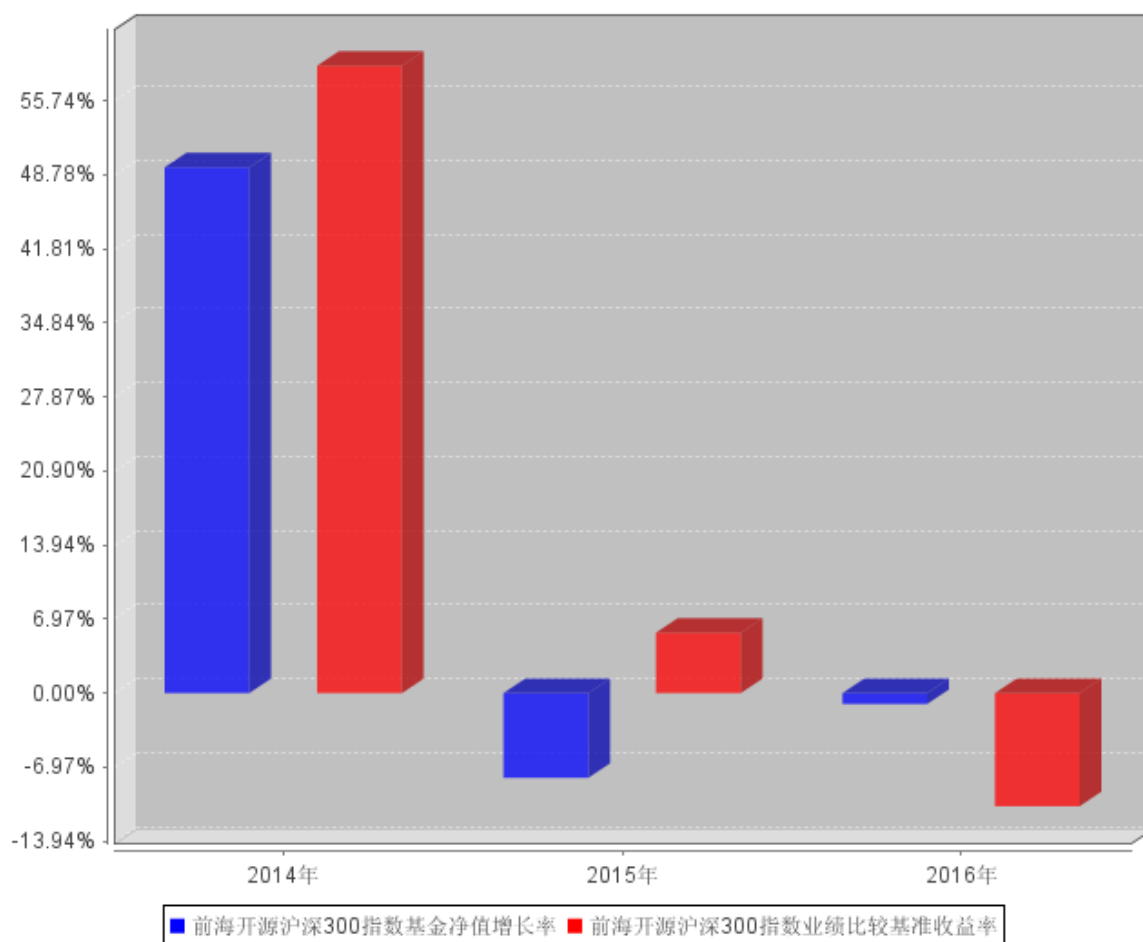
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	1.22%	0.66%	1.67%	0.67%	-0.45%	-0.01%
过去六个月	4.96%	0.71%	4.72%	0.72%	0.24%	-0.01%
过去一年	-1.01%	1.18%	-10.63%	1.33%	9.62%	-0.15%
自基金合同生效起至今	36.21%	1.77%	50.25%	1.79%	-14.04%	-0.02%

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

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



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 2014 年 6 月 17 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。

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
2014	0.0000	0.00	0.00	0.00	
2015	0.0000	0.00	0.00	0.00	
2016	2.5000	1,689,698,358.92	1,195,090.46	1,690,893,449.38	
合计	2.5000	1,689,698,358.92	1,195,090.46	1,690,893,449.38	

§ 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		
苏天杉	本基金的基金经理、公司执行投资总监	2016 年 4 月 21 日	-	5 年	苏天杉先生，美国罗彻斯特大学商学院 MBA、对外经济贸易大学管理学硕士、美国注册金融分析师（CFA）。2011 年加入美国领航基金（Vanguard Group）费城总部，任投资管理部投资分析师。曾任英特尔（Intel）全球新兴市场情报分析经理，高级分析师。现任前海开源基金管理有限公司执行投资总监。
王霞	本基金的基金经理、公司执行投资总监	2014 年 6 月 17 日	-	13 年	王霞女士，北京交通大学管理学硕士，中国注册会计师（CPA）。历任南方基金管理有限公司商业、贸易、旅游行业研究员、房地产行业首席

					研究员。现任前海开源基金管理有限公司执行投资总监。
--	--	--	--	--	---------------------------

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

报告期内，本基金紧密跟踪指数，降低跟踪误差。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内，基金份额净值增长率为-1.01%，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

2016 年全年沪深 300 指数收益为-11.28%，主要是因为 2015 年前半年的快速上涨导致了估值过高，本年估值逐渐回落至合理水平。价值投资的理念逐步回归股市，公司业绩成为了决定股价的最主要因素，蓝筹股表现抢眼。

2016 年四季度在经历了美国大选，美联储加息等重大政治经济事件的冲击之后，国际资本市场的流动性较之前大幅收紧。尤其是对于新兴市场，由于美元的强势地位，国际资金大量回流美元相关资产。美国新总统预计会采取和往届总统有所差别的财政，经济，以及外交军事政策。美联储预计相应的会采取紧缩的货币政策。2017 年 1 季度在美国新总统上任以及新的政策出台之前，国际资本市场处于一个震荡中寻找方向的阶段。

但是从长期来看，中国经济的增速仍远大于世界的平均水平，中国市场的估值也处于合理区间。中国市场仍然是一个非常有吸引力的投资机会。以中国蓝筹为代表的公司，会是中国经济增长最明显的受益者。

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 2.50 元，共分配利润 1,689,698,358.92 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的情形。

本基金 2016 年 1 月 14 日至 2016 年 2 月 29 日连续 28 个工作日，2016 年 3 月 11 日至 2016 年 5 月 24 日连续 51 个工作日，2016 年 5 月 27 日至 2016 年 7 月 12 日连续 31 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

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，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。

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：前海开源沪深 300 指数型证券投资基金

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	4,205,696.99	562,682.21
结算备付金	-	-
存出保证金	4,015.51	30,699.93
交易性金融资产	46,708,457.34	4,348,139.50
其中：股票投资	46,708,457.34	4,348,139.50
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	19,221.06
应收利息	695.13	129.05
应收股利	-	-
应收申购款	43,574.39	19,276.86
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	50,962,439.36	4,980,148.61
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	-	1,610.14
应付赎回款	6,386.84	18,666.37
应付管理人报酬	44,057.54	4,012.37
应付托管费	6,608.63	601.87
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	5,279.94	764.08
应交税费	-	-

应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	190,024.05	190,070.35
负债合计	252,357.00	215,725.18
所有者权益：		
实收基金	46,938,152.91	3,461,960.99
未分配利润	3,771,929.45	1,302,462.44
所有者权益合计	50,710,082.36	4,764,423.43
负债和所有者权益总计	50,962,439.36	4,980,148.61

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.080 元，基金份额总额 46,938,152.91 份。

7.2 利润表

会计主体：前海开源沪深 300 指数型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 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 1 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入	11,681,732.22	8,802,169.51
1.利息收入	1,234,467.24	42,788.12
其中：存款利息收入	1,234,466.49	42,788.12
债券利息收入	0.75	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-24,212.61	16,692,739.49
其中：股票投资收益	-928,706.55	16,615,567.97
基金投资收益	-	-
债券投资收益	60.45	-
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	904,433.49	77,171.52
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	2,290,853.88	-8,268,458.43
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	8,180,623.71	335,100.33

减：二、费用	2,394,308.78	827,505.80
1. 管理人报酬	1,621,723.88	185,664.30
2. 托管费	243,258.60	27,849.64
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	267,871.54	262,388.33
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	261,454.76	351,603.53
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	9,287,423.44	7,974,663.71
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	9,287,423.44	7,974,663.71

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：前海开源沪深 300 指数型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 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）	3,461,960.99	1,302,462.44	4,764,423.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	9,287,423.44	9,287,423.44
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	43,476,191.92	1,684,075,492.95	1,727,551,684.87
其中：1. 基金申购款	6,859,920,806.85	1,412,316,984.62	8,272,237,791.47
2. 基金赎回款	-6,816,444,614.93	271,758,508.33	-6,544,686,106.60
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-1,690,893,449.38	-1,690,893,449.38
五、期末所有者权益（基金净值）	46,938,152.91	3,771,929.45	50,710,082.36
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 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）	26,422,222.95	13,067,875.36	39,490,098.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	7,974,663.71	7,974,663.71
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）	-22,960,261.96	-19,740,076.63	-42,700,338.59
其中：1. 基金申购款	143,642,626.96	81,804,003.10	225,446,630.06
2. 基金赎回款	-166,602,888.92	-101,544,079.73	-268,146,968.65
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）	3,461,960.99	1,302,462.44	4,764,423.43

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：

<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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

前海开源沪深 300 指数型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可【2014】494 号文《关于核准前海开源沪深 300 指数型证券投资基金募集的批复》，由前海开源基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《前海开源沪深 300 指数型证券投资基金基金合同》及其他法律法规公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次募集期间为 2014 年 6 月 3 日至 2014 年 6 月 13 日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 234,687,022.67 元，经瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）瑞华验字[2014]02030017 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《前海开源沪深 300 指数型证券投资基金基金合同》于 2014 年 6 月 17 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 234,720,620.35 份基金份额，其中认购资金利息折合 33,597.68 份基金份额。本基金的基金管理人为前海开源基金管理有限公司，本基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

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》、《前海开源沪深 300 指数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。

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。

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、托管费和指数使用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

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。

7.4.8.1.2 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。

7.4.8.1.3 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。

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

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。

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	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,621,723.88	185,664.30
其中：支付销售机构的客户维护费	31,254.86	37,779.38

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

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

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	243,258.60	27,849.64

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

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。

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		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年12月31日		2015年1月1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	4,205,696.99	952,598.27	562,682.21	38,503.29

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

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。

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
------	------	------	------	--------	------	--------	-------	--------	--------	----

000166	申万宏源	2016 年 12 月 21 日	重大事项	6.25	2017 年 1 月 26 日	6.29	32,413	201,885.43	202,581.25	-
300104	乐视网	2016 年 12 月 7 日	重大事项	35.80	2017 年 1 月 16 日	36.88	5,300	262,601.13	189,740.00	-
600649	城投控股	2016 年 12 月 6 日	重大资产重组	20.34	-	-	8,906	130,276.53	181,148.04	-
601727	上海电气	2016 年 8 月 31 日	重大事项	8.42	-	-	16,273	138,012.23	137,018.66	-
600406	国电南瑞	2016 年 12 月 29 日	重大资产重组	16.63	-	-	7,416	100,889.67	123,328.08	-
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	15,300	102,904.51	106,029.00	-
600485	信威集团	2016 年 12 月 26 日	重大事项	14.60	-	-	6,281	120,270.46	91,702.60	-
000750	国海证券	2016 年 12 月 15 日	重大事项	6.97	2017 年 1 月 20 日	6.27	11,402	79,151.30	79,471.94	-
600875	东方电气	2016 年 12 月 9 日	重大事项	10.79	-	-	6,515	68,139.53	70,296.85	-
002129	中环股份	2016 年 4 月 25 日	重大资产重组	8.27	-	-	7,944	67,089.34	65,696.88	-

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。

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 45,461,444.04 元, 属于第二层次的余额为 1,247,013.3 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 4,072,505.82 元, 属于第二层次的余额为 275,633.68 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	46,708,457.34	91.65
	其中：股票	46,708,457.34	91.65
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	4,205,696.99	8.25
7	其他各项资产	48,285.03	0.09
8	合计	50,962,439.36	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	139,781.12	0.28
B	采矿业	1,651,714.21	3.26
C	制造业	15,453,941.92	30.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,298,705.48	2.56
E	建筑业	2,211,873.63	4.36
F	批发和零售业	1,028,406.76	2.03
G	交通运输、仓储和邮政业	1,373,777.45	2.71
H	住宿和餐饮业	23,568.00	0.05

I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,034,874.44	5.98
J	金融业	16,214,554.02	31.98
K	房地产业	2,424,071.89	4.78
L	租赁和商务服务业	547,408.81	1.08
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	373,500.29	0.74
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	63,537.50	0.13
R	文化、体育和娱乐业	647,705.22	1.28
S	综合	221,036.60	0.44
	合计	46,708,457.34	92.11

8.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

8.2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未通过沪港通机制投资港股。

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

8.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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	601318	中国平安	55,668	1,972,317.24	3.89
2	601166	兴业银行	68,897	1,111,997.58	2.19
3	600016	民生银行	122,446	1,111,809.68	2.19
4	600036	招商银行	53,103	934,612.80	1.84
5	600519	贵州茅台	2,565	857,094.75	1.69
6	601328	交通银行	141,835	818,387.95	1.61
7	600000	浦发银行	44,723	724,959.83	1.43
8	000002	万科A	33,607	690,623.85	1.36

9	601668	中国建筑	77,090	683,017.40	1.35
10	600837	海通证券	41,724	657,153.00	1.30

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。

8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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	601318	中国平安	5,998,588.05	125.90
2	600016	民生银行	4,490,451.00	94.25
3	601166	兴业银行	3,411,025.00	71.59
4	601398	工商银行	3,180,641.00	66.76
5	601857	中国石油	2,694,410.97	56.55
6	600036	招商银行	2,587,845.50	54.32
7	601328	交通银行	2,236,982.00	46.95
8	600030	中信证券	2,178,720.50	45.73
9	600000	浦发银行	2,111,304.00	44.31
10	600837	海通证券	1,990,480.40	41.78
11	601988	中国银行	1,981,016.00	41.58
12	601169	北京银行	1,802,615.00	37.83
13	600519	贵州茅台	1,542,981.00	32.39
14	600887	伊利股份	1,515,403.39	31.81
15	601766	中国中车	1,346,844.50	28.27
16	600028	中国石化	1,306,131.00	27.41
17	601668	中国建筑	1,293,498.05	27.15
18	601601	中国太保	1,231,917.32	25.86
19	601628	中国人寿	1,191,673.00	25.01
20	000002	万科 A	1,018,555.00	21.38
21	600048	保利地产	1,009,574.00	21.19
22	000725	京东方 A	979,703.00	20.56

23	600104	上汽集团	970,440.00	20.37
24	601989	中国重工	917,105.00	19.25
25	000001	平安银行	913,820.00	19.18
26	601818	光大银行	859,024.00	18.03
27	600015	华夏银行	845,253.97	17.74
28	601688	华泰证券	836,059.00	17.55
29	600276	恒瑞医药	792,302.00	16.63
30	600518	康美药业	781,420.00	16.40
31	601211	国泰君安	780,276.51	16.38
32	600999	招商证券	747,774.00	15.69
33	000858	五粮液	744,603.00	15.63
34	600637	东方明珠	741,643.00	15.57
35	601390	中国中铁	737,012.43	15.47
36	601377	兴业证券	705,941.60	14.82
37	601088	中国神华	695,322.00	14.59
38	002024	苏宁云商	680,234.00	14.28
39	000776	广发证券	674,778.00	14.16
40	300059	东方财富	659,724.00	13.85
41	002450	康得新	657,374.00	13.80
42	601186	中国铁建	618,871.72	12.99
43	601006	大秦铁路	591,516.00	12.42
44	000333	美的集团	583,940.00	12.26
45	600900	长江电力	570,441.00	11.97
46	601939	建设银行	559,384.00	11.74
47	601998	中信银行	541,592.00	11.37
48	000166	申万宏源	537,085.00	11.27
49	601899	紫金矿业	533,346.00	11.19
50	000783	长江证券	532,157.00	11.17
51	002304	洋河股份	529,988.00	11.12
52	600050	中国联通	529,106.00	11.11
53	000651	格力电器	522,233.00	10.96
54	001979	招商蛇口	522,144.00	10.96
55	002415	海康威视	519,875.00	10.91
56	601009	南京银行	511,199.00	10.73
57	000100	TCL 集团	509,962.00	10.70
58	601099	太平洋	504,893.80	10.60

59	601985	中国核电	502,352.00	10.54
60	600795	国电电力	501,254.08	10.52
61	600585	海螺水泥	477,638.00	10.03
62	601901	方正证券	462,699.00	9.71
63	600011	华能国际	452,164.00	9.49
64	002594	比亚迪	449,424.00	9.43
65	600958	东方证券	446,724.00	9.38
66	000538	云南白药	441,952.00	9.28
67	600111	北方稀土	440,679.00	9.25
68	600010	包钢股份	423,612.00	8.89
69	600066	宇通客车	419,107.05	8.80
70	600089	特变电工	417,494.00	8.76
71	601555	东吴证券	417,283.00	8.76
72	600383	金地集团	416,543.00	8.74
73	600893	中航动力	414,239.00	8.69
74	300024	机器人	408,681.00	8.58
75	000423	东阿阿胶	408,511.00	8.57
76	601800	中国交建	406,059.50	8.52
77	002736	国信证券	405,951.00	8.52
78	002142	宁波银行	402,165.00	8.44
79	600009	上海机场	401,290.00	8.42
80	300027	华谊兄弟	395,496.00	8.30
81	601600	中国铝业	394,904.00	8.29
82	600690	青岛海尔	393,423.54	8.26
83	300017	网宿科技	393,260.00	8.25
84	601669	中国电建	391,038.00	8.21
85	002202	金风科技	390,371.00	8.19
86	600109	国金证券	384,139.00	8.06
87	601727	上海电气	377,309.14	7.92
88	600018	上港集团	376,484.00	7.90
89	002252	上海莱士	372,312.00	7.81
90	600019	宝钢股份	371,606.00	7.80
91	600570	恒生电子	370,424.00	7.77
92	600606	绿地控股	364,517.00	7.65
93	002673	西部证券	363,817.00	7.64
94	600703	三安光电	361,848.00	7.59

95	600886	国投电力	358,656.00	7.53
96	600352	浙江龙盛	358,617.00	7.53
97	600705	中航资本	356,865.00	7.49
98	600535	天士力	355,750.12	7.47
99	600804	鹏博士	352,962.00	7.41
100	300070	碧水源	351,754.28	7.38
101	601336	新华保险	349,238.00	7.33
102	002230	科大讯飞	347,525.00	7.29
103	002241	歌尔股份	346,402.00	7.27
104	600196	复星医药	345,315.96	7.25
105	600100	同方股份	344,041.00	7.22
106	601788	光大证券	342,152.00	7.18
107	600029	南方航空	341,070.00	7.16
108	600369	西南证券	339,110.55	7.12
109	601018	宁波港	338,858.00	7.11
110	600177	雅戈尔	334,601.00	7.02
111	002236	大华股份	327,959.00	6.88
112	600660	福耀玻璃	322,103.00	6.76
113	000157	中联重科	321,410.00	6.75
114	000338	潍柴动力	321,041.00	6.74
115	600340	华夏幸福	320,415.00	6.73
116	000069	华侨城 A	319,660.00	6.71
117	600031	三一重工	318,738.00	6.69
118	600406	国电南瑞	312,283.00	6.55
119	600115	东方航空	306,587.00	6.43
120	300315	掌趣科技	306,426.00	6.43
121	600867	通化东宝	305,731.00	6.42
122	002027	分众传媒	304,300.00	6.39
123	601618	中国中冶	303,108.00	6.36
124	601919	中远海控	302,250.00	6.34
125	601607	上海医药	301,677.00	6.33
126	000768	中航飞机	300,779.00	6.31
127	600221	海南航空	299,531.00	6.29
128	600547	山东黄金	297,843.00	6.25
129	600415	小商品城	296,698.00	6.23
130	600649	城投控股	295,598.00	6.20

131	600739	辽宁成大	295,410.00	6.20
132	000009	中国宝安	288,898.00	6.06
133	000503	海虹控股	286,472.00	6.01
134	002008	大族激光	284,740.00	5.98
135	000623	吉林敖东	281,108.00	5.90
136	600674	川投能源	279,814.00	5.87
137	600118	中国卫星	276,753.00	5.81
138	000895	双汇发展	274,215.00	5.76
139	002465	海格通信	273,841.00	5.75
140	002456	欧菲光	271,935.00	5.71
141	000728	国元证券	269,744.00	5.66
142	000793	华闻传媒	268,376.76	5.63
143	600085	同仁堂	267,478.00	5.61
144	600023	浙能电力	265,516.00	5.57
145	002385	大北农	263,875.00	5.54
146	600489	中金黄金	262,652.44	5.51
147	000559	万向钱潮	261,271.00	5.48
148	600068	葛洲坝	257,875.00	5.41
149	300124	汇川技术	256,334.00	5.38
150	601888	中国国旅	255,468.00	5.36
151	600718	东软集团	255,326.00	5.36
152	601111	中国国航	252,457.00	5.30
153	601933	永辉超市	252,297.00	5.30
154	600741	华域汽车	251,232.00	5.27
155	000917	电广传媒	250,423.16	5.26
156	600150	中国船舶	245,257.05	5.15
157	000060	中金岭南	244,559.00	5.13
158	600839	四川长虹	244,065.00	5.12
159	600583	海油工程	242,797.86	5.10
160	300058	蓝色光标	242,127.00	5.08
161	600309	万华化学	239,739.83	5.03
162	000876	新希望	239,168.00	5.02
163	300104	乐视网	239,077.00	5.02
164	002292	奥飞娱乐	235,937.00	4.95
165	000568	泸州老窖	235,448.00	4.94
166	000983	西山煤电	234,687.00	4.93

167	600895	张江高科	232,602.00	4.88
168	600252	中恒集团	224,847.00	4.72
169	000963	华东医药	224,679.00	4.72
170	600157	永泰能源	224,582.00	4.71
171	600315	上海家化	224,104.65	4.70
172	600256	广汇能源	221,053.00	4.64
173	000425	徐工机械	220,057.00	4.62
174	000686	东北证券	217,675.48	4.57
175	002475	立讯精密	217,200.00	4.56
176	000540	中天城投	216,499.00	4.54
177	300003	乐普医疗	213,025.00	4.47
178	601106	中国一重	212,853.00	4.47
179	000413	东旭光电	212,234.00	4.45
180	601198	东兴证券	211,500.00	4.44
181	601333	广深铁路	210,865.00	4.43
182	601866	中远海发	209,998.00	4.41
183	600820	隧道股份	209,406.00	4.40
184	000402	金融街	208,549.00	4.38
185	002081	金螳螂	206,282.00	4.33
186	600688	上海石化	205,750.00	4.32
187	600398	海澜之家	205,456.00	4.31
188	600642	申能股份	205,434.00	4.31
189	601718	际华集团	205,148.00	4.31
190	000750	国海证券	204,086.00	4.28
191	300144	宋城演艺	202,960.00	4.26
192	000826	启迪桑德	201,658.49	4.23
193	600875	东方电气	198,220.00	4.16
194	000630	铜陵有色	197,867.00	4.15
195	002739	万达院线	195,907.00	4.11
196	000629	*ST 钒钛	193,924.00	4.07
197	600027	华电国际	193,600.00	4.06
198	002422	科伦药业	191,433.00	4.02
199	601633	长城汽车	188,928.00	3.97
200	000709	河钢股份	187,908.00	3.94
201	600959	江苏有线	186,484.00	3.91
202	601991	大唐发电	184,979.00	3.88

203	600060	海信电器	184,212.00	3.87
204	000778	新兴铸管	183,805.00	3.86
205	000792	盐湖股份	180,903.00	3.80
206	600332	白云山	180,125.00	3.78
207	002007	华兰生物	179,791.00	3.77
208	600005	武钢股份	179,476.00	3.77
209	000738	中航动控	178,137.00	3.74
210	601098	中南传媒	176,615.00	3.71
211	000063	中兴通讯	176,031.00	3.69
212	603993	洛阳钼业	170,796.00	3.58
213	002500	山西证券	169,760.00	3.56
214	601898	中煤能源	169,607.00	3.56
215	000039	中集集团	168,111.95	3.53
216	300002	神州泰岳	166,987.98	3.50
217	600362	江西铜业	165,526.00	3.47
218	601179	中国西电	163,677.00	3.44
219	601117	中国化学	162,740.00	3.42
220	601258	庞大集团	161,629.00	3.39
221	600588	用友网络	161,002.00	3.38
222	000625	长安汽车	158,689.00	3.33
223	600208	新湖中宝	158,368.00	3.32
224	601872	招商轮船	156,801.00	3.29
225	000800	一汽轿车	155,790.00	3.27
226	000061	农产品	154,671.00	3.25
227	601992	金隅股份	154,431.00	3.24
228	300015	爱尔眼科	150,736.00	3.16
229	600827	百联股份	148,453.00	3.12
230	000729	燕京啤酒	148,124.00	3.11
231	002129	中环股份	147,514.00	3.10
232	600863	内蒙华电	146,710.00	3.08
233	300072	三聚环保	142,748.00	3.00
234	601238	广汽集团	142,579.00	2.99
235	000598	兴蓉环境	141,951.00	2.98
236	002470	金正大	141,225.00	2.96
237	002146	荣盛发展	139,588.00	2.93
238	600373	中文传媒	137,354.00	2.88

239	600271	航天信息	136,611.00	2.87
240	600372	中航电子	136,346.00	2.86
241	300133	华策影视	135,460.00	2.84
242	601216	君正集团	134,303.00	2.82
243	000831	*ST 五稀	133,991.00	2.81
244	601808	中海油服	133,516.00	2.80
245	600061	国投安信	133,500.00	2.80
246	600021	上海电力	133,444.00	2.80
247	601021	春秋航空	133,258.16	2.80
248	603000	人民网	128,944.00	2.71
249	002038	双鹭药业	126,689.00	2.66
250	000883	湖北能源	125,694.41	2.64
251	000839	中信国安	124,809.96	2.62
252	300251	光线传媒	122,128.00	2.56
253	601928	凤凰传媒	121,381.00	2.55
254	600166	福田汽车	121,288.00	2.55
255	600038	中直股份	118,558.00	2.49
256	000027	深圳能源	117,945.00	2.48
257	000581	威孚高科	117,189.00	2.46
258	300146	汤臣倍健	115,702.00	2.43
259	600008	首创股份	115,463.57	2.42
260	000999	华润三九	114,487.00	2.40
261	000898	鞍钢股份	112,578.00	2.36
262	002294	信立泰	112,111.00	2.35
263	000825	太钢不锈	111,668.00	2.34
264	002410	广联达	111,155.00	2.33
265	600633	浙报传媒	109,402.00	2.30
266	600485	信威集团	109,363.00	2.30
267	601225	陕西煤业	108,933.00	2.29
268	002183	怡亚通	107,661.72	2.26
269	000400	许继电气	105,550.00	2.22
270	000712	锦龙股份	104,898.78	2.20
271	600663	陆家嘴	104,858.00	2.20
272	002195	二三四五	104,567.00	2.19
273	300168	万达信息	104,287.00	2.19
274	601958	金钼股份	103,076.00	2.16

275	002375	亚厦股份	103,075.00	2.16
276	601118	海南橡胶	101,992.00	2.14
277	600153	建发股份	101,745.00	2.14
278	600717	天津港	101,609.00	2.13
279	600600	青岛啤酒	100,032.00	2.10
280	603885	吉祥航空	99,199.00	2.08
281	002466	天齐锂业	98,948.00	2.08
282	000046	泛海控股	98,816.00	2.07
283	600317	营口港	97,974.00	2.06
284	600446	金证股份	97,315.00	2.04
285	600549	厦门钨业	96,293.00	2.02
286	603288	海天味业	95,780.00	2.01
287	002065	东华软件	95,704.00	2.01

注：买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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	601318	中国平安	4,416,719.49	92.70
2	600016	民生银行	3,445,620.25	72.32
3	601398	工商银行	2,733,532.59	57.37
4	601857	中国石油	2,524,788.90	52.99
5	601166	兴业银行	2,437,537.90	51.16
6	600036	招商银行	1,806,610.97	37.92
7	601988	中国银行	1,639,910.35	34.42
8	600030	中信证券	1,559,144.36	32.72
9	600000	浦发银行	1,502,789.73	31.54
10	601328	交通银行	1,500,060.24	31.48
11	600837	海通证券	1,461,586.10	30.68
12	601169	北京银行	1,302,239.69	27.33
13	600887	伊利股份	1,123,209.76	23.57
14	600028	中国石化	1,071,302.79	22.49
15	601628	中国人寿	1,009,664.30	21.19
16	600519	贵州茅台	1,009,184.44	21.18
17	601668	中国建筑	916,791.55	19.24

18	601766	中国中车	912,324.13	19.15
19	601601	中国太保	859,440.22	18.04
20	000725	京东方 A	685,144.48	14.38
21	600048	保利地产	672,326.86	14.11
22	600104	上汽集团	662,573.18	13.91
23	601989	中国重工	619,952.76	13.01
24	601688	华泰证券	594,748.64	12.48
25	600015	华夏银行	586,587.19	12.31
26	601818	光大银行	574,468.83	12.06
27	600999	招商证券	563,240.79	11.82
28	601088	中国神华	561,753.82	11.79
29	600518	康美药业	557,443.67	11.70
30	600637	东方明珠	553,554.23	11.62
31	000001	平安银行	547,605.45	11.49
32	600276	恒瑞医药	531,489.24	11.16
33	000858	五粮液	519,092.22	10.90
34	601377	兴业证券	508,308.01	10.67
35	002024	苏宁云商	483,225.04	10.14
36	002450	康得新	475,718.25	9.98
37	000776	广发证券	461,783.09	9.69
38	601998	中信银行	454,564.26	9.54
39	600011	华能国际	454,211.67	9.53
40	601390	中国中铁	435,038.55	9.13
41	300059	东方财富	431,008.98	9.05
42	601939	建设银行	412,258.69	8.65
43	601006	大秦铁路	388,774.47	8.16
44	000783	长江证券	382,026.53	8.02
45	000100	TCL 集团	367,005.70	7.70
46	601186	中国铁建	366,692.28	7.70
47	601899	紫金矿业	361,044.52	7.58
48	601009	南京银行	359,372.62	7.54
49	601099	太平洋	357,257.53	7.50
50	002415	海康威视	353,111.89	7.41
51	000166	申万宏源	350,403.95	7.35
52	601211	国泰君安	350,133.36	7.35
53	600050	中国联通	349,423.40	7.33
54	001979	招商蛇口	342,843.41	7.20
55	601985	中国核电	333,703.56	7.00

56	002304	洋河股份	327,538.12	6.87
57	600795	国电电力	323,784.01	6.80
58	600585	海螺水泥	318,830.64	6.69
59	601901	方正证券	315,584.60	6.62
60	601800	中国交建	313,780.46	6.59
61	600111	北方稀土	308,066.38	6.47
62	002594	比亚迪	306,703.93	6.44
63	600066	宇通客车	295,113.95	6.19
64	600018	上港集团	294,597.16	6.18
65	601555	东吴证券	294,311.35	6.18
66	000423	东阿阿胶	290,014.99	6.09
67	000538	云南白药	287,810.53	6.04
68	300027	华谊兄弟	286,147.00	6.01
69	600010	包钢股份	279,477.48	5.87
70	002142	宁波银行	278,814.52	5.85
71	600383	金地集团	276,177.42	5.80
72	300017	网宿科技	275,978.00	5.79
73	002252	上海莱士	273,455.00	5.74
74	300024	机器人	273,390.28	5.74
75	002202	金风科技	272,880.54	5.73
76	600089	特变电工	272,785.29	5.73
77	600690	青岛海尔	272,202.33	5.71
78	600570	恒生电子	268,081.80	5.63
79	600009	上海机场	267,549.76	5.62
80	600893	中航动力	266,439.49	5.59
81	601669	中国电建	262,814.48	5.52
82	600196	复星医药	256,497.47	5.38
83	600352	浙江龙盛	254,855.52	5.35
84	600109	国金证券	251,569.72	5.28
85	600804	鹏博士	250,781.90	5.26
86	600703	三安光电	247,241.73	5.19
87	601600	中国铝业	246,422.44	5.17
88	600606	绿地控股	244,602.30	5.13
89	601727	上海电气	243,285.53	5.11
90	600019	宝钢股份	242,867.35	5.10
91	600535	天士力	242,119.12	5.08
92	600100	同方股份	241,444.02	5.07
93	002241	歌尔股份	238,673.15	5.01

94	600029	南方航空	237,422.24	4.98
95	600705	中航资本	237,037.60	4.98
96	600177	雅戈尔	236,743.51	4.97
97	002027	分众传媒	234,536.00	4.92
98	002236	大华股份	233,854.00	4.91
99	000338	潍柴动力	230,122.81	4.83
100	600115	东方航空	229,758.85	4.82
101	600660	福耀玻璃	229,202.88	4.81
102	600886	国投电力	228,806.20	4.80
103	600369	西南证券	228,153.94	4.79
104	000157	中联重科	226,393.58	4.75
105	300003	乐普医疗	221,191.99	4.64
106	000503	海虹控股	219,749.00	4.61
107	600547	山东黄金	217,218.84	4.56
108	600315	上海家化	216,742.95	4.55
109	002230	科大讯飞	216,191.67	4.54
110	601018	宁波港	216,175.76	4.54
111	600406	国电南瑞	216,117.57	4.54
112	600031	三一重工	215,526.88	4.52
113	600398	海澜之家	212,619.78	4.46
114	601607	上海医药	212,524.54	4.46
115	600340	华夏幸福	212,472.45	4.46
116	600867	通化东宝	212,216.94	4.45
117	601106	中国一重	211,224.21	4.43
118	000069	华侨城 A	210,503.91	4.42
119	600642	申能股份	208,334.61	4.37
120	000002	万科 A	208,122.59	4.37
121	300070	碧水源	207,524.18	4.36
122	002422	科伦药业	205,111.00	4.31
123	002736	国信证券	204,278.58	4.29
124	002008	大族激光	202,103.00	4.24
125	601618	中国中冶	201,996.30	4.24
126	600221	海南航空	198,445.07	4.17
127	002673	西部证券	197,080.17	4.14
128	600739	辽宁成大	196,742.36	4.13
129	600415	小商品城	195,913.59	4.11
130	000623	吉林敖东	195,182.00	4.10
131	601336	新华保险	194,222.05	4.08

132	002385	大北农	193,379.40	4.06
133	300315	掌趣科技	193,322.16	4.06
134	600674	川投能源	192,672.49	4.04
135	600085	同仁堂	192,256.11	4.04
136	600027	华电国际	191,276.45	4.01
137	600068	葛洲坝	188,077.51	3.95
138	000009	中国宝安	187,281.97	3.93
139	600489	中金黄金	187,255.49	3.93
140	002456	欧菲光	185,506.00	3.89
141	600118	中国卫星	185,208.07	3.89
142	601991	大唐发电	182,796.92	3.84
143	000895	双汇发展	181,749.00	3.81
144	601788	光大证券	180,073.72	3.78
145	000793	华闻传媒	179,383.21	3.77
146	601933	永辉超市	179,016.51	3.76
147	601898	中煤能源	178,677.03	3.75
148	601919	中远海控	177,687.22	3.73
149	000629	*ST 钒钛	177,020.00	3.72
150	000983	西山煤电	176,991.00	3.71
151	601098	中南传媒	175,932.56	3.69
152	601117	中国化学	175,638.29	3.69
153	600839	四川长虹	175,536.83	3.68
154	000728	国元证券	175,106.00	3.68
155	300058	蓝色光标	174,178.17	3.66
156	600900	长江电力	173,822.49	3.65
157	000559	万向钱潮	173,779.34	3.65
158	000768	中航飞机	172,450.00	3.62
159	300124	汇川技术	172,358.68	3.62
160	600958	东方证券	170,638.30	3.58
161	002465	海格通信	170,616.75	3.58
162	600649	城投控股	169,765.00	3.56
163	601179	中国西电	168,769.47	3.54
164	601111	中国国航	168,519.44	3.54
165	600309	万华化学	168,331.69	3.53
166	600718	东软集团	167,371.14	3.51
167	000917	电广传媒	166,311.00	3.49
168	600741	华域汽车	165,637.74	3.48
169	600583	海油工程	164,105.64	3.44

170	000568	泸州老窖	163,783.48	3.44
171	600150	中国船舶	161,821.17	3.40
172	000060	中金岭南	161,613.00	3.39
173	601992	金隅股份	159,577.88	3.35
174	601238	广汽集团	158,147.00	3.32
175	000402	金融街	157,614.29	3.31
176	600252	中恒集团	156,823.98	3.29
177	600023	浙能电力	155,401.74	3.26
178	000876	新希望	153,838.00	3.23
179	000425	徐工机械	153,646.32	3.22
180	000729	燕京啤酒	153,282.22	3.22
181	600895	张江高科	152,340.52	3.20
182	601888	中国国旅	150,561.99	3.16
183	600256	广汇能源	150,225.60	3.15
184	601333	广深铁路	146,171.99	3.07
185	600863	内蒙华电	145,169.39	3.05
186	002038	双鹭药业	142,645.00	2.99
187	002475	立讯精密	141,667.00	2.97
188	000413	东旭光电	140,223.46	2.94
189	601633	长城汽车	139,938.53	2.94
190	000598	兴蓉环境	139,758.00	2.93
191	002292	奥飞娱乐	138,113.00	2.90
192	000963	华东医药	137,562.40	2.89
193	600688	上海石化	134,956.09	2.83
194	000750	国海证券	134,952.00	2.83
195	601808	中海油服	134,597.62	2.83
196	000686	东北证券	134,594.65	2.82
197	601866	中远海发	134,406.45	2.82
198	600875	东方电气	132,208.10	2.77
199	600820	隧道股份	131,188.16	2.75
200	000883	湖北能源	130,994.96	2.75
201	601718	际华集团	130,006.76	2.73
202	300144	宋城演艺	128,544.00	2.70
203	600060	海信电器	128,400.61	2.69
204	000826	启迪桑德	128,089.00	2.69
205	002081	金螳螂	127,787.16	2.68
206	600157	永泰能源	127,596.69	2.68
207	600166	福田汽车	126,537.00	2.66

208	000999	华润三九	125,207.09	2.63
209	000778	新兴铸管	123,991.01	2.60
210	000831	*ST 五稀	123,362.00	2.59
211	000581	威孚高科	122,510.44	2.57
212	000898	鞍钢股份	121,944.00	2.56
213	600332	白云山	121,774.29	2.56
214	600549	厦门钨业	121,542.00	2.55
215	000709	河钢股份	120,739.77	2.53
216	002410	广联达	120,574.63	2.53
217	002294	信立泰	119,907.88	2.52
218	000825	太钢不锈	119,381.00	2.51
219	000792	盐湖股份	115,990.00	2.43
220	000540	中天城投	115,847.00	2.43
221	002007	华兰生物	115,297.00	2.42
222	000400	许继电气	114,716.41	2.41
223	000061	农产品	113,636.00	2.39
224	002500	山西证券	113,098.52	2.37
225	300002	神州泰岳	112,157.49	2.35
226	600362	江西铜业	111,537.21	2.34
227	000039	中集集团	111,415.00	2.34
228	600633	浙报传媒	111,354.00	2.34
229	000738	中航动控	110,954.92	2.33
230	000630	铜陵有色	108,705.54	2.28
231	600600	青岛啤酒	106,969.64	2.25
232	002375	亚厦股份	103,729.02	2.18
233	603288	海天味业	103,187.00	2.17
234	000800	一汽轿车	102,545.00	2.15
235	600717	天津港	101,478.00	2.13
236	600959	江苏有线	101,471.94	2.13
237	000046	泛海控股	101,428.00	2.13
238	601872	招商轮船	101,050.11	2.12
239	600005	武钢股份	100,611.00	2.11
240	600998	九州通	99,321.60	2.08
241	603993	洛阳钼业	99,046.80	2.08
242	600317	营口港	98,713.97	2.07
243	600827	百联股份	97,076.06	2.04
244	601699	潞安环能	96,726.00	2.03
245	300015	爱尔眼科	95,675.00	2.01

246	600588	用友网络	95,339.68	2.00
-----	--------	------	-----------	------

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	129,711,284.31
卖出股票收入（成交）总额	88,738,189.12

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

(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。

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

本报告期内，海通证券股份有限公司（以下简称“海通证券”）因未按规定审查、了解客户真实身份的违法违规行为收到中国证监会《行政处罚决定书》。

海通证券的投资已执行内部严格的投资决策程序，符合法律法规、基金合同和公司制度的规定，不存在损害投资者利益的情况。

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	4,015.51
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	695.13
5	应收申购款	43,574.39
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	48,285.03

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

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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
928	50,579.91	38,947,694.11	82.98%	7,990,458.80	17.02%

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	1,452,043.08	3.09%

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

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014年6月17日）基金份额总额	234,720,620.35
本报告期期初基金份额总额	3,461,960.99
本报告期基金总申购份额	6,859,920,806.85

减:本报告期基金总赎回份额	6,816,444,614.93
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	46,938,152.91

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。

§ 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

本基金本报告期未改变投资策略。

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	

中金公司	2	155,921,523.16	71.38%	114,026.29	71.38%	-
东兴证券	2	53,502,808.57	24.49%	39,126.92	24.49%	-
中泰证券	2	4,883,301.04	2.24%	3,571.44	2.24%	-
中信建投	1	4,141,840.66	1.90%	3,028.75	1.90%	-
银河证券	1	-	-	-	-	-

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
中金公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券	1,061.20	100.00%	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

无

前海开源基金管理有限公司
2017 年 3 月 30 日