

前海开源睿远稳健增利混合型证券投资基金  
金  
2017 年半年度报告 摘要

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：前海开源基金管理有限公司

基金托管人：广发证券股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 28 日

## § 1 重要提示

### 1.1 重要提示

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

基金托管人广发证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

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

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	前海开源睿远稳健增利混合	
基金主代码	000932	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 1 月 14 日	
基金管理人	前海开源基金管理有限公司	
基金托管人	广发证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	45,124,559.07 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	前海开源睿远稳健增利混合 A	前海开源睿远稳健增利混合 C
下属分级基金的交易代码:	000932	000933
报告期末下属分级基金的份额总额	3,995,858.13 份	41,128,700.94 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点投资于债券和现金类资产，力争在严格控制风险和保持基金资产流动性的前提下，实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>本基金的投资策略主要有以下六方面内容：</p> <p>1、大类资产配置</p> <p>在大类资产配置中，本基金综合运用定性和定量的分析手段，在对宏观经济因素进行充分研究的基础上，判断宏观经济周期所处阶段。本基金将依据经济周期理论，结合对证券市场的系统性风险以及未来一段时期内各大类资产风险和预期收益率的评估，制定本基金在债券、股票、现金等大类资产之间的配置比例。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>在债券投资策略方面，本基金将在综合研究的基础上实施积极主动的组合管理，采用宏观环境分析和微观市场定价分析两个方面进行债券资产的投资。</p> <p>3、股票投资策略</p> <p>本基金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。</p> <p>4、可转债策略</p> <p>基于行业分析、企业基本面分析和可转换债券估值模型分析，并结合市场环境情况等，本基金在一、二级市场投资可转换债券，以达到在严格控制风险的基础上，实现基金资产稳健增值的目的。可转债的策略具体包括：1) 个券选择策略、2) 转股策略、3) 条款博弈策略、4) 套利策略。</p>

	<p>5、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>6、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> <p>若相关法律法规发生变化时，基金管理人期货投资管理从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。</p>
业绩比较基准	中证全债指数收益率×85%+沪深 300 指数收益率×15%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金，低于股票型基金。

### 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	广发证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	傅成斌	崔瑞娟
	联系电话	0755-88601888	020-87555888
	电子邮箱	qhky@qhkyfund.com	cuirj@gf.com.cn
客户服务电话		4001666998	95575
传真		0755-83181169	020-87555129

### 2.4 信息披露方式

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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	前海开源睿远稳健增利混合 A	前海开源睿远稳健增利混合
------	----------------	--------------

		C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017年1月1日-2017年6月30日)	报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	-63,654.57	275,601.90
本期利润	44,419.50	4,757,274.13
加权平均基金份额本期利润	0.0089	0.0423
本期基金份额净值增长率	0.62%	0.27%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)	
期末可供分配基金份额利润	0.0227	-0.0038
期末基金资产净值	4,568,308.56	45,873,983.03
期末基金份额净值	1.143	1.115

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

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

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

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

前海开源睿远稳健增利混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.18%	0.06%	1.77%	0.11%	-1.59%	-0.05%
过去三个月	-0.87%	0.11%	1.02%	0.12%	-1.89%	-0.01%
过去六个月	0.62%	0.10%	1.40%	0.11%	-0.78%	-0.01%
过去一年	2.51%	0.18%	2.50%	0.14%	0.01%	0.04%
自基金合同生效起至今	14.30%	0.45%	10.78%	0.28%	3.52%	0.17%

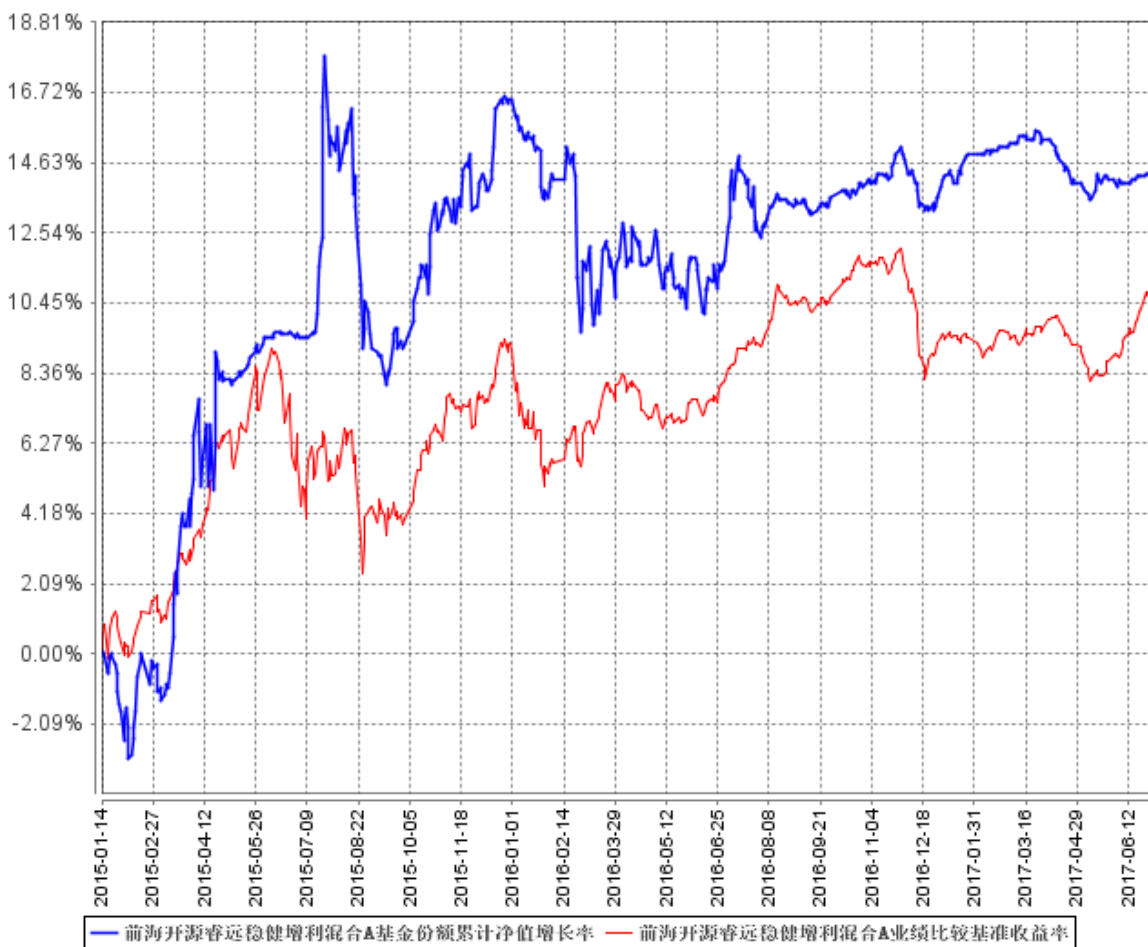
前海开源睿远稳健增利混合 C

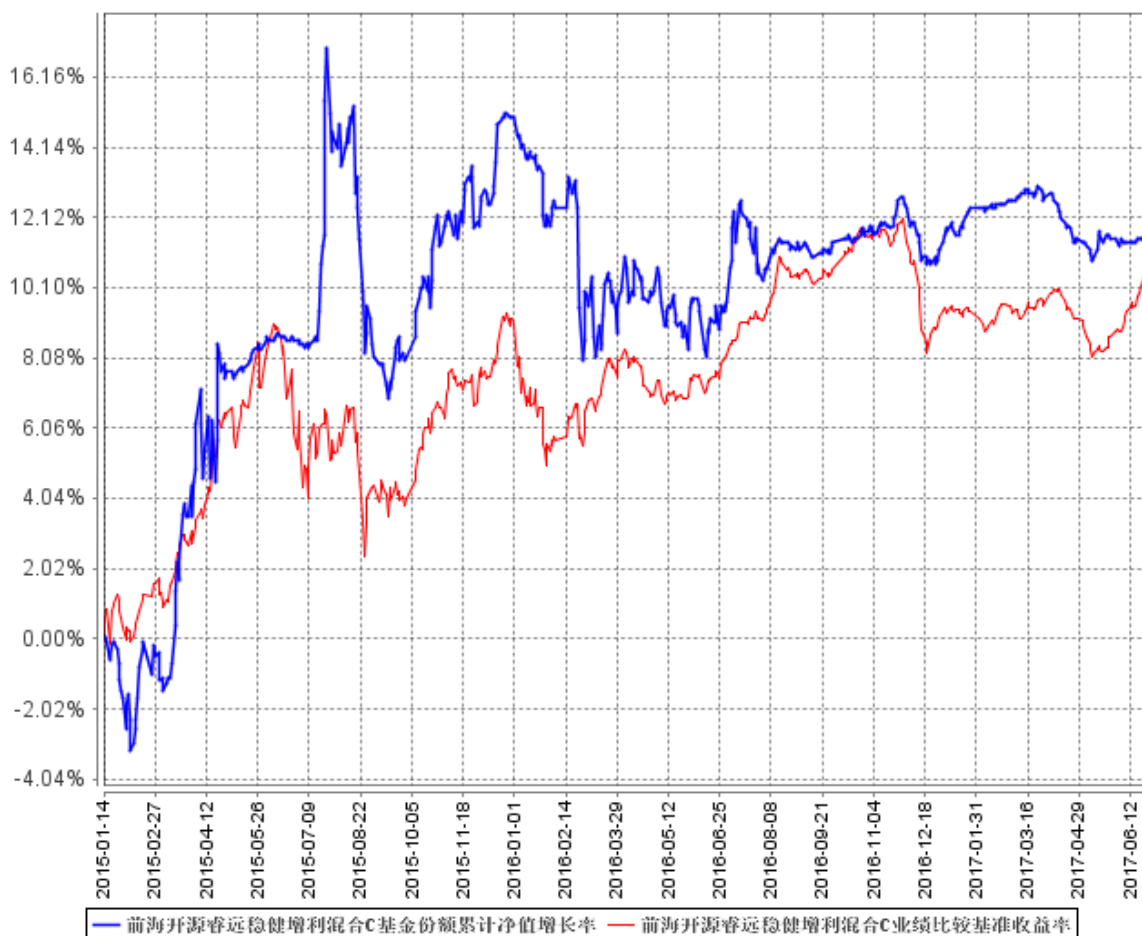
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.00%	0.06%	1.77%	0.11%	-1.77%	-0.05%
过去三个月	-1.06%	0.11%	1.02%	0.12%	-2.08%	-0.01%

过去六个月	0.27%	0.10%	1.40%	0.11%	-1.13%	-0.01%
过去一年	1.92%	0.18%	2.50%	0.14%	-0.58%	0.04%
自基金合同生效起至今	11.50%	0.45%	10.78%	0.28%	0.72%	0.17%

注：本基金的业绩比较基准为：中证全债指数收益率×85%+沪深 300 指数收益率×15%。

### 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





## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

前海开源基金管理有限公司（以下简称“前海开源基金”）于 2012 年 12 月 27 日经中国证监会批准，2013 年 1 月 23 日注册成立，截至报告期末，注册资本为 2 亿元人民币。其中，开源证券股份有限公司、北京市中盛金期投资管理有限公司、北京长和世纪资产管理有限公司和深圳市和合投信资产管理合伙企业(有限合伙)各持股权 25%。目前，前海开源基金分别在北京、上海设立分公司，在深圳设立华南营销中心；直销中心覆盖珠三角、长三角和京津冀环渤海经济区，为公司的快速发展奠定了组织和区域基础。经中国证监会批准，前海开源基金全资控股子公司——前海开源资产管理有限公司（以下简称“前海开源资管”）已于 2013 年 9 月 5 日在深圳市注册成立，并于 2013 年 9 月 18 日取得中国证监会核发的《特定客户资产管理业务资格证书》，截至报告期末，注册资本为 1.8 亿元人民币。截至报告期末，前海开源基金旗下管理 58 只开放式基金，资

产管理规模超过 620 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		
刘静	本基金的基金经理、公司董事总经理、联席投资总监、固定收益部负责人	2015 年 1 月 14 日	-	15 年	刘静女士，经济学硕士。历任长盛基金管理有限公司债券高级交易员、基金经理助理、长盛货币市场基金基金经理、长盛全债指数增强型债券投资基金基金经理、长盛积极配置债券投资基金基金经理，现任前海开源基金管理有限公司董事总经理、联席投资总监、固定收益部负责人。

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，“离职日期”为根据公司决定确定的解聘日期，对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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、本基金《基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。



### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量没有超过该证券当日成交量的 5%的情况。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

债市方面，本报告期内，经济企稳态势延续，通胀整体低位运行，基本面对债市影响有限。货币政策方面，1 季度央行两次上调 MLF、OMO 及 SLF 利率，旨在稳汇率和配合监管去杠杆。监管政策方面，2 季度监管机构密集发文限制同业套利、资金池等业务，监管力度明显加强，叠加银行对半年末流动性较为悲观，4、5 月份收益率大幅上行。整个上半年来看，在去杠杆周期下，利率债收益曲线平坦化上行，信用债收益曲线陡峭化上行，主因风险偏好下降导致市场对长期信用债要求更高的风险补偿所致。

操作上，因管理人基于前期对债市的前瞻性分析认为债市风险还未充分释放，在债券投资上比较谨慎，债券投资比例相对较低，主要以流动性管理为主，有效避免了市场下跌。前 4 个月组合保持了一定的权益仓位，后在市场波动中，逐步降低了权益仓位。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内，本基金 A 级份额净值增长率为 0.62%，同期业绩比较基准收益率为 1.40%；本基金 C 级份额净值增长率为 0.27%，同期业绩比较基准收益率为 1.40%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年，尽管经济基本面较上半年走弱，但基于目前的情况看经济失速的可能性不大。尽管在去杠杆取得一定成效的情况下监管力度可能会有所缓和，但因去杠杆的大方向不变，在去杠杠达到监管合意水平之前，货币政策明显放松的可能性不大，银行负债成本下行空间有限，债市趋势性机会仍需等待。基于上述判断，我们对债市下半年行情保持谨慎，固收部分在趋势性机会没有到来之前依旧以防御为主，坚持短久期操作，做好流动性管理。如果判断市场出现趋势性机会，我们将择机拉长组合久期，提高债券仓位，提高组合的进攻性。另外，我们会关注可转债市场扩容带来的投资机会，并积极参与一级申购。权益方面，我们仍将结合自上而下和自下而上的研究方法，优选长期发展前景好、业绩增长确定性高、估值处于较低水平的行业和个股进行配置，争

取为投资者获得良好的投资收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会由执行董事长、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。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未进行利润分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内，未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

本基金 2017 年 3 月 20 日至 2017 年 6 月 7 日连续 53 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

本报告期内，本基金托管人在对前海开源睿远稳健增利混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，前海开源睿远稳健增利混合型证券投资基金的管理人——前海开源基金管理有

限公司在前海开源睿远稳健增利混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，前海开源睿远稳健增利混合型证券投资基金未进行利润分配。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对前海开源基金管理有限公司编制和披露的前海开源睿远稳健增利混合型证券投资基金 2017 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：前海开源睿远稳健增利混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	3,380,084.06	5,645,254.48
结算备付金	234,304.10	1,119,340.11
存出保证金	105,583.02	77,337.27
交易性金融资产	757,079.00	378,630,588.84
其中：股票投资	410,514.00	82,371,463.96
基金投资	-	-
债券投资	346,565.00	254,534,733.10
资产支持证券投资	-	41,724,391.78
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	45,964,149.95	9,900,134.85
应收证券清算款	501,360.68	-
应收利息	72,047.45	4,604,905.05
应收股利	-	-
应收申购款	408.80	6,769.92
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-

资产总计	51,015,017.06	399,984,330.52
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2017年6月30日</b>	<b>2016年12月31日</b>
<b>负 债:</b>		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	137,050.34	2,038.40
应付管理人报酬	32,243.82	406,832.49
应付托管费	3,582.64	67,805.41
应付销售服务费	18,937.28	199,961.81
应付交易费用	7,256.40	210,299.60
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	373,654.99	450,000.00
负债合计	572,725.47	1,336,937.71
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	45,124,559.07	358,508,420.88
未分配利润	5,317,732.52	40,138,971.93
所有者权益合计	50,442,291.59	398,647,392.81
负债和所有者权益总计	51,015,017.06	399,984,330.52

注: 报告截止日 2017 年 6 月 30 日, 前海开源睿远稳健增利混合 A 基金份额净值 1.143 元, 基金份额总额 3,995,858.13 份, 前海开源睿远稳健增利混合 C 基金份额净值 1.115 元, 基金份额总额 41,128,700.94 份。

## 6.2 利润表

会计主体: 前海开源睿远稳健增利混合型证券投资基金

本报告期: 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项 目	本期 2017年1月1日至2017 年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至 2016年6月30日
<b>一、收入</b>	6,389,057.78	-3,215,996.48
1.利息收入	2,129,957.96	618,691.97
其中: 存款利息收入	85,336.68	155,428.39
债券利息收入	1,392,099.70	307,128.61
资产支持证券利息收入	191,687.18	-

买入返售金融资产收入	460,834.40	156,134.97
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-343,920.65	-1,666,487.19
其中：股票投资收益	1,544,352.59	-1,770,479.45
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-1,586,722.97	41,292.26
资产支持证券投资收益	-298,135.07	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-3,415.20	62,700.00
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	4,589,746.30	-2,193,309.55
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	13,274.17	25,108.29
<b>减：二、费用</b>	<b>1,587,364.15</b>	<b>803,330.05</b>
1. 管理人报酬	632,261.17	362,863.39
2. 托管费	77,557.55	60,477.22
3. 销售服务费	382,566.57	152,277.00
4. 交易费用	287,057.96	82,393.44
5. 利息支出	-	11,517.86
其中：卖出回购金融资产支出	-	11,517.86
6. 其他费用	207,920.90	133,801.14
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>4,801,693.63</b>	<b>-4,019,326.53</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>4,801,693.63</b>	<b>-4,019,326.53</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：前海开源睿远稳健增利混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	358,508,420.88	40,138,971.93	398,647,392.81

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	0.00	4,801,693.63	4,801,693.63
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）	-313,383,861.81	-39,622,933.04	-353,006,794.85
其中：1.基金申购款	28,694,586.52	3,302,741.94	31,997,328.46
2.基金赎回款	-342,078,448.33	-42,925,674.98	-385,004,123.31
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）	0.00	0.00	0.00
五、期末所有者权益（基金净值）	45,124,559.07	5,317,732.52	50,442,291.59
项目	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	170,060,753.27	25,661,294.98	195,722,048.25
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-4,019,326.53	-4,019,326.53
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）	-140,702,900.11	-18,715,334.48	-159,418,234.59
其中：1.基金申购款	19,807,459.94	2,119,852.42	21,927,312.36
2.基金赎回款	-160,510,360.05	-20,835,186.90	-181,345,546.95
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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	29,357,853.16	2,926,633.97	32,284,487.13

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

蔡颖  
基金管理人负责人

何璁  
主管会计工作负责人

任福利  
会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

前海开源睿远稳健增利混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可【2014】1268 号文《关于准予前海开源睿远稳健增利混合型证券投资基金注册的批复》，由前海开源基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《前海开源睿远稳健增利混合型证券投资基金基金合同》及其他法律法规公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次募集期间为 2015 年 1 月 5 日至 2015 年 1 月 12 日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 303,866,359.21 元，经瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）瑞华验字[2015]第 02030002 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《前海开源睿远稳健增利混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 1 月 14 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 303,948,857.19 份基金份额，其中认购资金利息折合 82,497.98 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，本基金托管人为广发证券股份有限公司。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《前海开源睿远稳健增利混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期未发生会计差错更正。

## 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[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。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款



单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
活期存款	3,380,084.06
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	3,380,084.06

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	438,388.00	410,514.00	-27,874.00
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	347,120.86	346,565.00
	银行间市场	-	-
	合计	347,120.86	346,565.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	785,508.86	757,079.00	-28,429.86

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券	26,000,000.00	-
买入返售证券_银行间	19,964,149.95	-
合计	45,964,149.95	-

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日						
	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
合计					-	-	-

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

**6.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应收活期存款利息	646.23
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	94.95
应收债券利息	6,067.50
应收买入返售证券利息	65,196.02
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	42.75
合计	72,047.45

注：“其他”为应收结算保证金利息。

**6.4.7.6 其他资产**

本基金本报告期末未持有其他资产。

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	7,106.45
银行间市场应付交易费用	149.95
合计	7,256.40

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	94.09
预提费用	373,560.90
合计	373,654.99

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

前海开源睿远稳健增利混合 A		
项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,553,629.69	5,553,629.69
本期申购	970,810.97	970,810.97
本期赎回(以“-”号填列)	-2,528,582.53	-2,528,582.53
jiJinChaiFHFEZSQRQA 基金拆分/份 额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	3,995,858.13	3,995,858.13

前海开源睿远稳健增利混合 C		
项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	352,954,791.19	352,954,791.19
本期申购	27,723,775.55	27,723,775.55
本期赎回(以“-”号填列)	-339,549,865.80	-339,549,865.80
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	41,128,700.94	41,128,700.94

注：申购含红利再投、转换入份（金）额；赎回含转换出份（金）额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

前海开源睿远稳健增利混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	200,821.86	553,303.80	754,125.66
本期利润	-63,654.57	108,074.07	44,419.50
本期基金份额交易产生的变动数	-46,612.95	-179,481.78	-226,094.73
其中：基金申购款	21,139.01	115,895.37	137,034.38
基金赎回款	-67,751.96	-295,377.15	-363,129.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	90,554.34	481,896.09	572,450.43

前海开源睿远稳健增利混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,586,852.82	34,797,993.45	39,384,846.27
本期利润	275,601.90	4,481,672.23	4,757,274.13
本期基金份额交易产生的变动数	-5,020,717.17	-34,376,121.14	-39,396,838.31
其中：基金申购款	-132,599.37	3,298,306.93	3,165,707.56
基金赎回款	-4,888,117.80	-37,674,428.07	-42,562,545.87
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-158,262.45	4,903,544.54	4,745,282.09

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	76,968.88
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	7,351.25
其他	1,016.55
合计	85,336.68

注：“其他”为结算保证金利息收入。

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	122,211,809.54

减：卖出股票成本总额	120,667,456.95
买卖股票差价收入	1,544,352.59

### 6.4.7.13 债券投资收益

#### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-1,586,722.97
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	-1,586,722.97

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	361,827,418.49
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	357,746,941.10
减：应收利息总额	5,667,200.36
买卖债券差价收入	-1,586,722.97

#### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

#### 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券申购差价收入。

#### 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	41,647,159.15
减：卖出资产支持证券成本总额	41,724,391.78

减：应收利息总额	220,902.44
资产支持证券投资收益	-298,135.07

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

##### 6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无贵金属买卖差价收入。

##### 6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属赎回差价收入。

##### 6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属申购差价收入。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

##### 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无买卖权证差价收入。

##### 6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无其他衍生工具投资收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	-3,415.20
基金投资产生的股利收益	-
合计	-3,415.20

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
------	----------------------------

1. 交易性金融资产	4,589,746.30
——股票投资	1,985,769.90
——债券投资	2,603,976.40
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	4,589,746.30

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	13,120.87
基金转换费收入	153.30
合计	13,274.17

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	285,007.96
银行间市场交易费用	2,050.00
合计	287,057.96

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	148,765.71
债券托管账户维护费	18,200.00
律师费	15,000.00
其他	1,160.00
合计	207,920.90

注：“其他”为账户维护费、年度报告审计询证费。

## 6.4.8 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.8.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
前海开源基金管理有限公司（“前海开源基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
广发证券股份有限公司（“广发证券”）	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

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.9.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月 30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月 30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
广发证券股份有限公司	158,751,957.14	100.00%	53,383,447.68	100.00%

#### 6.4.9.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30 日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30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
广发证券股份有限 公司	157,797,201.70	100.00%	33,282,543.99	100.00%

### 6.4.9.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30 日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30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
广发证券股份有限	779,800,000.00	100.00%	25,000,000.00	100.00%

### 6.4.9.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行权证交易。

### 6.4.9.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量 的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总 额的比例
广发证券股份有限 公司	147,847.60	100.00%	7,106.45	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量 的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总 额的比例
广发证券股份有限 公司	49,716.02	100.00%	17,898.21	100.00%

## 6.4.9.2 关联方报酬

### 6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	632,261.17	362,863.39
其中：支付销售机构的客户维护费	117,907.46	123,296.96

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.9% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.9\% \div \text{当年天数}$$

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 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

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

#### 6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	77,557.55	60,477.22

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

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前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 6.4.9.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费

	前海开源睿远稳健增利混合A	前海开源睿远稳健增利混合C	合计
前海开源基金管理有限公司	-	9.05	9.05
广发证券股份有限公司	-	47,812.43	47,812.43
合计	-	47,821.48	47,821.48
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	前海开源睿远稳健增利混合A	前海开源睿远稳健增利混合C	合计
前海开源基金管理有限公司	-	61,184.41	61,184.41
广发证券股份有限公司	-	69,939.54	69,939.54
合计	-	131,123.95	131,123.95

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.60%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务。销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.6%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

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

#### 6.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 6.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.9.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.9.4.2 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

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

**6.4.9.5 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 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
广发证券股份有限公司	3,380,084.06	76,968.88	2,757,672.91	67,435.43

注：本基金的银行存款由基金托管人广发证券股份有限公司保管，按适用利率或约定利率计息。

**6.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期内及上年度可比期间内未在承销期内参与关联方承销证券。

**6.4.9.7 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期内及上年度可比期间内无其他关联交易事项。

**6.4.10 期末（2017年6月30日）本基金持有的流通受限证券****6.4.10.1 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。

**6.4.10.2 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
601608	中信重工	2017年4月19日	重大事项	5.54	2017年7月26日	5.26	74,100	438,388.00	410,514.00	-

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 8 月 18 日。

**6.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****6.4.10.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

### 6.4.10.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止, 本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款, 无抵押债券。

### 6.4.11 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 2017 年 6 月 30 日, 本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 0.00 元, 属于第二层次的余额为 757,079.00 元, 属于第三层次的余额为 0.00 元; 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 86,701,632.84 元, 属于第二层次的余额为 291,928,956.00 元, 属于第三层次的余额为 0.00 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 2017 年 6 月 30 日, 本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2016 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。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	410,514.00	0.80
	其中：股票	410,514.00	0.80
2	固定收益投资	346,565.00	0.68
	其中：债券	346,565.00	0.68
	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	45,964,149.95	90.10
	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	3,614,388.16	7.08
7	其他各项资产	679,399.95	1.33
8	合计	51,015,017.06	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	410,514.00	0.81
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	410,514.00	0.81

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未通过港股通机制投资港股。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601608	中信重工	74,100	410,514.00	0.81

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600030	中信证券	8,902,617.04	2.23
2	601857	中国石油	7,980,314.00	2.00
3	600267	海正药业	5,226,857.00	1.31
4	000921	海信科龙	4,095,993.64	1.03
5	000915	山大华特	3,523,876.20	0.88
6	600418	江淮汽车	1,186,909.47	0.30
7	600963	岳阳林纸	822,875.25	0.21
8	002138	顺络电子	822,785.00	0.21
9	002466	天齐锂业	817,703.00	0.21
10	600585	海螺水泥	789,922.00	0.20
11	601877	正泰电器	479,772.00	0.12
12	600703	三安光电	477,844.00	0.12
13	000983	西山煤电	477,000.00	0.12
14	601608	中信重工	438,388.00	0.11
15	600487	亨通光电	266,076.00	0.07
16	600825	新华传媒	231,215.00	0.06
17	603626	科森科技	47,049.60	0.01
18	300580	贝斯特	23,869.51	0.01
19	002845	同兴达	16,757.52	0.00
20	300600	瑞特股份	15,418.79	0.00

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

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601398	工商银行	17,488,030.04	4.39
2	600000	浦发银行	10,330,372.44	2.59
3	601939	建设银行	10,068,543.16	2.53
4	600030	中信证券	8,997,909.34	2.26
5	601857	中国石油	8,723,889.02	2.19
6	002294	信立泰	7,456,003.00	1.87
7	600267	海正药业	5,379,966.88	1.35



8	000915	山大华特	5,154,028.00	1.29
9	000895	双汇发展	5,152,471.00	1.29
10	600418	江淮汽车	5,083,327.48	1.28
11	600963	岳阳林纸	4,989,054.51	1.25
12	000858	五粮液	4,897,457.00	1.23
13	000568	泸州老窖	4,416,115.26	1.11
14	000921	海信科龙	4,298,512.62	1.08
15	000910	大亚科技	2,877,118.04	0.72
16	002179	中航光电	2,719,242.53	0.68
17	000429	粤高速 A	1,811,336.00	0.45
18	000651	格力电器	1,571,990.46	0.39
19	600739	辽宁成大	1,472,889.94	0.37
20	601288	农业银行	1,269,528.00	0.32

注：卖出包括二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，卖出金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	36,720,737.09
卖出股票收入（成交）总额	122,211,809.54

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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	299,670.00	0.59
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	46,895.00	0.09
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	346,565.00	0.69
----	----	------------	------

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	019546	16 国债 18	3,000	299,670.00	0.59
2	122645	12 苏园建	1,000	40,820.00	0.08
3	124227	13 宁国 01	100	6,075.00	0.01

注：本基金本报告期末仅持有以上债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

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

### 7.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	105,583.02
2	应收证券清算款	501,360.68
3	应收股利	-
4	应收利息	72,047.45
5	应收申购款	408.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	679,399.95

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	601608	中信重工	410,514.00	0.81	重大事项

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
前海开源睿远稳健增利混合 A	189	21,142.11	1,269,444.21	31.77%	2,726,413.92	68.23%
前海开源睿远稳健增利混合 C	637	64,566.25	2,500,892.50	6.08%	38,627,808.44	93.92%
合计	826	54,630.22	3,770,336.71	8.36%	41,354,222.36	91.64%

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

② 户均持有的基金份额合计=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	前海开源睿远稳健增利混合 A	8.64	0.0000%
	前海开源睿远稳健增利混合 C	8.90	0.0000%
	合计	17.54	0.0000%

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

本报告期末基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部负责人、本基金基金经理未持有本开放式基金份额。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	前海开源睿远稳健增利混合 A	前海开源睿远稳健增利混合 C
基金合同生效日（2015 年 1 月 14 日）基金份额总额	44,214,320.96	259,734,536.23
本报告期期初基金份额总额	5,553,629.69	352,954,791.19
本报告期基金总申购份额	970,810.97	27,723,775.55
减：本报告期基金总赎回份额	2,528,582.53	339,549,865.80
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	3,995,858.13	41,128,700.94

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金管理人于 2016 年 12 月 7 日至 2017 年 1 月 6 日以通讯方式组织召开了本基金的基金份额持有人大会，会议表决通过了《关于修改前海开源睿远稳健增利混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，本基金管理人根据该议案对本基金的基金合同与托管协议进行了修改，并自 2017 年 1 月 11 日起，将本基金的管理费年费率调整为 0.90%，托管费年费率调整为 0.10%。投资人敬请查阅基金管理人刊登在中国证监会指定媒介上的有关公告。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动；

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
广发证券	2	158,751,957.14	100.00%	147,847.60	100.00%	-

注：根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，我公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序：

#### A：选择标准

- 1、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；
- 2、公司具有较强的研究能力，能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告；
- 3、公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；
- 4、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。

#### B：选择流程

公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比，并根据评比的结果选择席位：

- 1、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座；
- 2、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实，投资建议是否准确；
- 3、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
广发证券	157,797,201.70	100.00%	779,800,000.00	100.00%	-	-

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170101-20170319	332,733,812.95	0.00	332,733,812.95	0.00	0.00%
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-

#### 产品特有风险

##### 1. 巨额赎回风险

(1) 本基金单一投资者所持有的基金份额占比较大，单一投资者的巨额赎回，可能导致基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，对本基金的投资运作及净值表现产生较大影响；

(2) 单一投资者大额赎回时容易造成本基金发生巨额赎回。在发生巨额赎回情形时，在符合基金合同约定情况下，如基金管理人认为有必要，可延期办理本基金的赎回申请，投资者可能面临赎回申请被延期办理的风险；如果连续 2 个开放日以上（含）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；

##### 2. 转换运作方式或终止基金合同的风险

单一投资者巨额赎回后，若本基金连续 60 个工作日基金份额持有人低于 200 人或基金资产净值低于 5000 万情形的，基金管理人应当向中国证监会提出解决方案，或按基金合同约定，转换运作方式或终止基金合同，其他投资者可能面临基金转换运作方式或终止基金合同的风险；

##### 3. 流动性风险

单一投资者巨额赎回可能导致本基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；

4. 巨额赎回可能导致基金资产规模过小，导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略。

### 11.2 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 8 月 28 日