

前海开源沪深 300 指数型证券投资基金 2017 年半年度报告

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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

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。

基金托管人中国农业银行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。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	8
2.5 其他相关资料.....	8
§3 主要财务指标和基金净值表现	9
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2 基金净值表现.....	9
3.3 其他指标.....	11
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	16
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.....	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20
6.4 报表附注.....	22
§7 投资组合报告.....	46
7.1 期末基金资产组合情况.....	46
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	46
7.3 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.....	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	60
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	62
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.....	62
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	62
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.....	62
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.....	62
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	62
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	63
7.12 投资组合报告附注.....	63
§8 基金份额持有人信息.....	65
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	65
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	65
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	65
§9 开放式基金份额变动.....	66
§10 重大事件揭示.....	67
10.1 基金份额持有人大会决议.....	67
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.....	67
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	67
10.4 基金投资策略的改变.....	67
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	67
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.....	67
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	67
10.8 其他重大事件.....	69
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	73

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	73
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	74
§12 备查文件目录.....	75
12.1 备查文件目录.....	75
12.2 存放地点.....	75
12.3 查阅方式.....	75

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	前海开源沪深 300 指数型证券投资基金
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	8,224,975.20 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。

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
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)	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	

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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

§ 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

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)
本期已实现收益	2,806,446.18
本期利润	1,476,351.56
加权平均基金份额本期利润	0.0381
本期加权平均净值利润率	3.43%
本期基金份额净值增长率	6.57%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	1,243,627.34
期末可供分配基金份额利润	0.1512
期末基金资产净值	9,468,602.54
期末基金份额净值	1.151
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	45.17%

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。

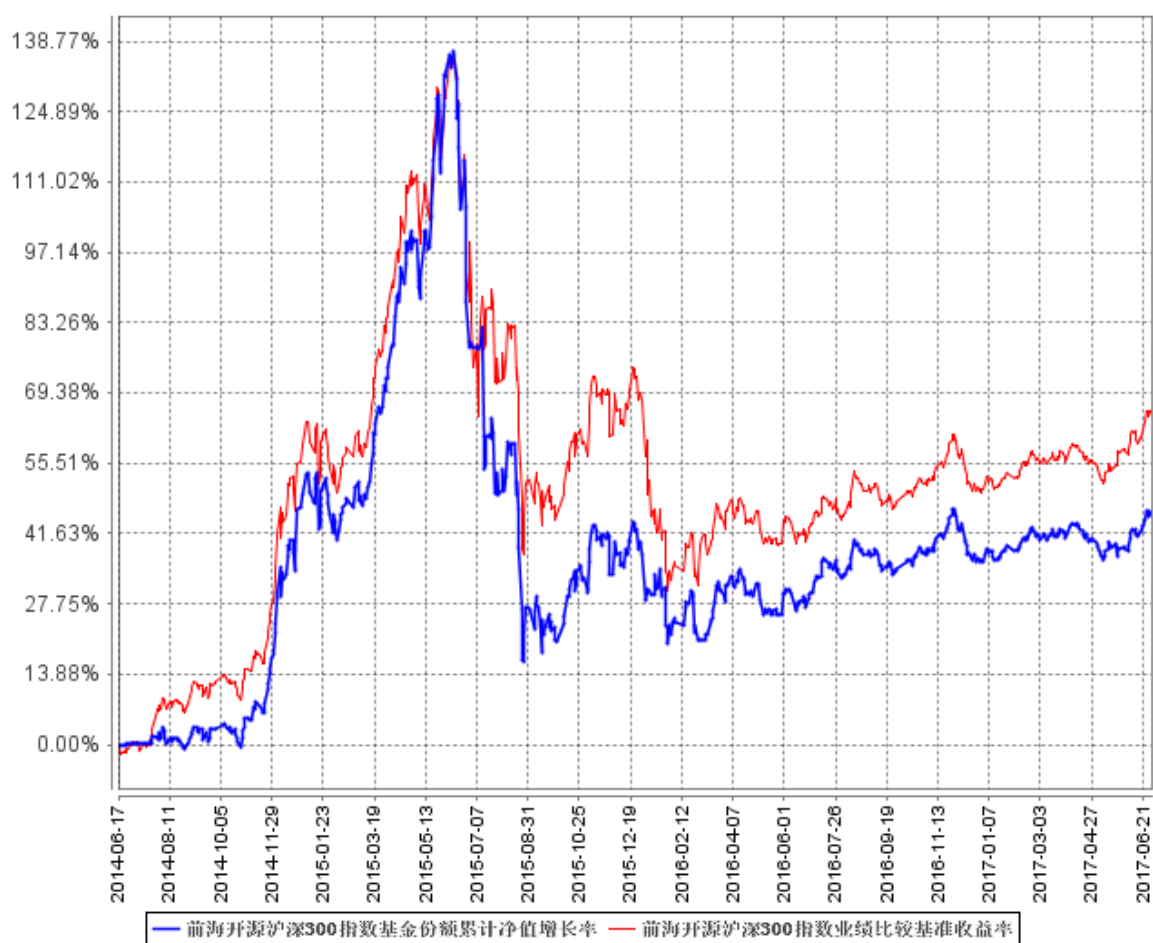
3.2 基金净值表现

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

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	4.45%	0.58%	4.73%	0.64%	-0.28%	-0.06%
过去三个月	2.77%	0.59%	5.79%	0.59%	-3.02%	0.00%
过去六个月	6.57%	0.54%	10.23%	0.54%	-3.66%	0.00%
过去一年	11.86%	0.63%	15.44%	0.63%	-3.58%	0.00%
过去三年	45.02%	1.65%	65.95%	1.66%	-20.93%	-0.01%
自基金合同 生效起至今	45.17%	1.64%	65.62%	1.65%	-20.45%	-0.01%

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



3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

前海开源基金管理有限公司（以下简称“前海开源基金”）于 2012 年 12 月 27 日经中国证监会批准，2013 年 1 月 23 日注册成立，截至报告期末，注册资本为 2 亿元人民币。其中，开源证券股份有限公司、北京市中盛金期投资管理有限公司、北京长和世纪资产管理有限公司和深圳市和合投信资产管理合伙企业(有限合伙)各持股 25%。目前，前海开源基金分别在北京、上海设立分公司，在深圳设立华南营销中心；直销中心覆盖珠三角、长三角和京津冀环渤海经济区，为公司的快速发展奠定了组织和区域基础。经中国证监会批准，前海开源基金全资控股子公司——前海开源资产管理有限公司（以下简称“前海开源资管”）已于 2013 年 9 月 5 日在深圳市注册成立，并于 2013 年 9 月 18 日取得中国证监会核发的《特定客户资产管理业务资格证书》，截至报告期末，注册资本为 1.8 亿元人民币。截至报告期末，前海开源基金旗下管理 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		
付海宁	本基金的 基金经 理、公司 投资副总 监	2017 年 2 月 14 日	-	7 年	付海宁先生，硕士研究生。2009 年至 2010 年担任摩根士丹利商业分析师，2010 年-2012 年担任美银美林量化风险分析师，2013 年至 2015 年担任美国标准普尔资管助理、投资经理，2015

					年 11 月加盟前海开源基金管理有限公司，现任公司投资副总监。
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。
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	2017 年 6 月 13 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。
--	--	--	--	--	-----

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

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 6.57%，同期业绩比较基准收益率为 10.23%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年货币政策以收紧为基调，政府调控手段加强，证券市场维持震荡格局，结构性趋势不大，相比之下沪深 300 等大盘股票走势会比较稳定。

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。

本基金本报告期内，从 2017 年 5 月 19 日至 2017 年 6 月 30 日连续 29 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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 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半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。

§ 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：前海开源沪深 300 指数型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	701,477.94	4,205,696.99
结算备付金		-	-
存出保证金		11,451.77	4,015.51
交易性金融资产	6.4.7.2	8,977,074.07	46,708,457.34
其中：股票投资		8,977,074.07	46,708,457.34
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		105,270.61	-
应收利息	6.4.7.5	138.95	695.13
应收股利		-	-
应收申购款		3,444.44	43,574.39
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		9,798,857.78	50,962,439.36
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日

负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		152,297.27	6,386.84
应付管理人报酬		7,821.02	44,057.54
应付托管费		1,173.15	6,608.63
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	29,042.46	5,279.94
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	139,921.34	190,024.05
负债合计		330,255.24	252,357.00
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	8,224,975.20	46,938,152.91
未分配利润	6.4.7.10	1,243,627.34	3,771,929.45
所有者权益合计		9,468,602.54	50,710,082.36
负债和所有者权益总计		9,798,857.78	50,962,439.36

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.151 元，基金份额总额 8,224,975.20 份。

6.2 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	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
一、收入		1,926,047.23	8,836,195.60
1.利息收入		14,602.95	1,220,853.01
其中：存款利息收入	6.4.7.11	14,582.29	1,220,852.26
债券利息收入		20.66	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）		3,210,006.95	-702,846.07
其中：股票投资收益	6.4.7.12	3,073,593.33	-1,092,361.93
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	878.34	60.45
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	135,535.28	389,455.41
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-1,330,094.62	144,962.34
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	31,531.95	8,173,226.32
减：二、费用		449,695.67	1,954,533.06
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	214,252.03	1,365,170.56
2. 托管费	6.4.10.2.2	32,137.81	204,775.58
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	73,180.45	253,759.26
5. 利息支出		-	-

其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	130,125.38	130,827.66
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,476,351.56	6,881,662.54
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,476,351.56	6,881,662.54

6.3 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：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）	46,938,152.91	3,771,929.45	50,710,082.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,476,351.56	1,476,351.56
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）	-38,713,177.71	-4,004,653.67	-42,717,831.38
其中：1.基金申购款	3,933,565.73	456,985.82	4,390,551.55
2.基金赎回款	-42,646,743.44	-4,461,639.49	-47,108,382.93
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)	8,224,975.20	1,243,627.34	9,468,602.54
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)	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)	-	6,881,662.54	6,881,662.54
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)	43,173,824.33	1,684,066,688.75	1,727,240,513.08
其中：1.基金申购款	6,854,059,729.75	1,411,776,504.22	8,265,836,233.97
2.基金赎回款	-6,810,885,905.42	272,290,184.53	-6,538,595,720.89
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)	46,635,785.32	1,357,364.35	47,993,149.67

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《关于准予前海开源沪深 300 指数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]第 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。

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》、《前海开源沪深 300 指数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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期未发生会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2015 年 9 月 8 日起，对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 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	701,477.94
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	701,477.94

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	8,001,841.06	8,977,074.07	975,233.01
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	8,001,841.06	8,977,074.07	975,233.01

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

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	134.27
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	-
应收债券利息	-
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	4.68
合计	138.95

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	29,042.46
银行间市场应付交易费用	-
合计	29,042.46

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	330.96
预提费用	99,590.38
指数使用费	40,000.00
合计	139,921.34

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	46,938,152.91	46,938,152.91
本期申购	3,933,565.73	3,933,565.73
本期赎回(以“-”号填列)	-42,646,743.44	-42,646,743.44
- 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	8,224,975.20	8,224,975.20

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	68,329,417.84	-64,557,488.39	3,771,929.45
本期利润	2,806,446.18	-1,330,094.62	1,476,351.56
本期基金份额交易产生的变动数	-57,307,008.08	53,302,354.41	-4,004,653.67
其中：基金申购款	5,888,631.08	-5,431,645.26	456,985.82
基金赎回款	-63,195,639.16	58,733,999.67	-4,461,639.49
本期已分配利润	-	-	-
本期末	13,828,855.94	-12,585,228.60	1,243,627.34

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	14,512.58
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	42.74
其他	26.97
合计	14,582.29

注：“其他”为申购款利息收入及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	40,120,601.31
减：卖出股票成本总额	37,047,007.98
买卖股票差价收入	3,073,593.33

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	878.34
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	878.34

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	62,899.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	62,000.00
减：应收利息总额	20.66
买卖债券差价收入	878.34

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

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

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	135,535.28
基金投资产生的股利收益	-
合计	135,535.28

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	-1,330,094.62
——股票投资	-1,330,094.62
——债券投资	-
——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	-1,330,094.62

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	30,821.45
基金转换费收入	710.50
合计	31,531.95

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	73,180.45
银行间市场交易费用	-
合计	73,180.45

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	24,795.19
汇划费	235.00
指数使用费	80,000.00
其他	300.00
合计	130,125.38

注：“其他”为账户维护费、审计询证费。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

6.4.8.2 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。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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”	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构

基金”)	
中国农业银行股份有限公司 (“中国农业银行”)	基金托管人
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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 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未通过关联方交易单元进行交易，无佣金产生。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 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	214,252.03	1,365,170.56
其中：支付销售机构的客户维护费	1,149.27	21,363.18

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

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托管费	32,137.81	204,775.58

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。

6.4.10.2.3 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。

6.4.10.3 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与关联方无银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.5 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	
	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	
	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	701,477.94	14,512.58	4,818,237.87	939,581.94

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。

6.4.10.6 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未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 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无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

6.4.12.1 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。

6.4.12.2 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
600050	中国联通	2017年4月5日	重大事项	6.85	-	-	45,054	195,012.56	308,619.90	-
300104	乐视网	2017年4月17日	重大资产重组	30.68	-	-	5,300	262,601.13	162,604.00	-
000100	TCL集团	2017年4月21日	重大资产重组	3.43	2017年7月26日	3.47	38,498	139,649.10	132,048.14	-
600100	同方股份	2017年4月21日	重大资产	14.12	-	-	9,070	120,751.06	128,068.40	-

			重							
601919	中远 海控	2017 年 5 月 17 日	重 大 资 产 重 组	5.35	2017 年 7 月 26 日	5.89	19,738	117,818.34	105,598.30	-
002252	上海 莱士	2017 年 4 月 21 日	重 大 事 项	20.24	-	-	5,180	108,621.67	104,843.20	-
000503	海虹 控股	2017 年 5 月 11 日	重 大 资 产 重 组	24.93	-	-	3,804	120,441.17	94,833.72	-
600485	信威 集团	2016 年 12 月 26 日	重 大 资 产 重 组	14.59	-	-	6,281	120,270.46	91,639.79	-
002426	胜利 精密	2017 年 1 月 16 日	重 大 事 项	8.06	-	-	8,800	73,292.00	70,928.00	-
002129	中环	2016	重	8.27	-	-	7,944	67,089.34	65,696.88	-

	股份	年 4 月 25 日	大 事 项								
600666	奥瑞 德	2017 年 4 月 28 日	重 大 资 产 重 组	17.40	-	-	3,749	73,690.80	65,232.60	-	
002049	紫光 国芯	2017 年 2 月 20 日	重 大 资 产 重 组	31.57		2017 年 7 月 17 日	27.74	1,800	58,796.00	56,826.00	-
601872	招商 轮船	2017 年 5 月 2 日	重 大 事 项	5.16	-	-	-	10,934	57,055.79	56,419.44	-
601989	中国 重工	2017 年 5 月 31 日	重 大 资 产 重 组	6.46	-	-	-	6,893	45,450.14	44,528.78	-
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	6,700	35,833.90	37,118.00	-

601088	中国神华	2017年6月5日	重大事项	22.29	-	-	1,551	22,008.63	34,571.79	-
600795	国电电力	2017年6月5日	重大资产重组	3.60	-	-	8,827	26,767.25	31,777.20	-
601727	上海电气	2017年6月23日	重大资产重组	7.57	2017年7月3日	7.54	2,473	20,973.65	18,720.61	-
600959	江苏有线	2017年6月19日	重大资产重组	10.57	-	-	1,202	13,214.22	12,705.14	-
000061	农产品	2017年6月28日	重大资产重组	9.06	-	-	607	7,608.67	5,499.42	-
300085	银之	2017	非	18.50	2017	18.88	200	5,929.73	3,700.00	-

	杰	年 6 月 30 日	公 开 发 行 股 票		年 7 月 7 日					
--	---	------------------	----------------------------	--	-----------------	--	--	--	--	--

注：本基金本报告期末持有的暂时停牌等流通受限股票的复牌情况，统计截止日期为 2017 年 8 月 18 日。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 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。

6.4.12.3.2 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。

6.4.13 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。

6.4.13.1 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级风险管理架构体系。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风险控制执行情况；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，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末未持有短期信用评级的债券。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末未持有长期信用评级的债券。

6.4.13.3 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制的投资品种比例等。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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	701,477.94	-	-	-	701,477.94
存出保证金	11,451.77	-	-	-	11,451.77
交易性金融资产	-	-	-	8,977,074.07	8,977,074.07
应收证券清算款	-	-	-	105,270.61	105,270.61

应收利息	-	-	-	138.95	138.95
应收申购款	298.21	-	-	3,146.23	3,444.44
资产总计	713,227.92	-	-	9,085,629.86	9,798,857.78
负债					
应付赎回款	-	-	-	152,297.27	152,297.27
应付管理人报酬	-	-	-	7,821.02	7,821.02
应付托管费	-	-	-	1,173.15	1,173.15
应付交易费用	-	-	-	29,042.46	29,042.46
其他负债	-	-	-	139,921.34	139,921.34
负债总计	-	-	-	330,255.24	330,255.24
利率敏感度缺口	713,227.92	-	-	8,755,374.62	9,468,602.54
上年度末 2016 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	4,205,696.99	-	-	-	4,205,696.99
存出保证金	4,015.51	-	-	-	4,015.51
交易性金融资产	-	-	-	46,708,457.34	46,708,457.34
应收利息	-	-	-	695.13	695.13
应收申购款	198.81	-	-	43,375.58	43,574.39
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	4,209,911.31	-	-	46,752,528.05	50,962,439.36
负债					
应付赎回款	-	-	-	6,386.84	6,386.84
应付管理人报酬	-	-	-	44,057.54	44,057.54
应付托管费	-	-	-	6,608.63	6,608.63
应付交易费用	-	-	-	5,279.94	5,279.94
其他负债	-	-	-	190,024.05	190,024.05
负债总计	-	-	-	252,357.00	252,357.00
利率敏感度缺口	4,209,911.31	-	-	46,500,171.05	50,710,082.36

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 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，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日		上年度末 2016年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	8,977,074.07	94.81	46,708,457.34	92.11
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	8,977,074.07	94.81	46,708,457.34	92.11

6.4.13.4.3.2 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%		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2017年6月 30日）	上年度末（2016年12月 31日）
	权益性投资的市场价格上升 5%	453,149.20	2,321,483.88
	权益性投资的市场价格下降 5%	-453,149.20	-2,321,483.88

6.4.14 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 7,345,094.76 元，第二层次的余额为 1,631,979.31 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 45,461,444.04 元,属于第二层次的余额为 1,247,013.30 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	8,977,074.07	91.61
	其中：股票	8,977,074.07	91.61
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	701,477.94	7.16
7	其他各项资产	120,305.77	1.23
8	合计	9,798,857.78	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	19,492.96	0.21
B	采矿业	260,193.92	2.75
C	制造业	3,224,564.15	34.06
D	电力、热力、燃气及水生产和	221,639.11	2.34

	供应业		
E	建筑业	356,380.30	3.76
F	批发和零售业	164,646.16	1.74
G	交通运输、仓储和邮政业	364,310.58	3.85
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	918,796.11	9.70
J	金融业	2,536,452.78	26.79
K	房地产业	269,396.74	2.85
L	租赁和商务服务业	64,623.55	0.68
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	65,540.42	0.69
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	87,584.77	0.93
S	综合	23,395.21	0.25
	合计	8,577,016.76	90.58

7.2.2 期末积极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（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	247,165.50	2.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,063.73	0.06
E	建筑业	-	-

F	批发和零售业	17,422.72	0.18
G	交通运输、仓储和邮政业	5,221.92	0.06
H	住宿和餐饮业	5,420.00	0.06
I	信息传输、软件和信息技术 服务业	26,325.14	0.28
J	金融业	6,548.00	0.07
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	13,303.78	0.14
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理 业	51,671.84	0.55
O	居民服务、修理和其他服务 业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	11,327.62	0.12
R	文化、体育和娱乐业	5,533.92	0.06
S	综合	4,053.14	0.04
	合计	400,057.31	4.23

7.2.3 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所有股票投资明细

7.3.1 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	占基金资产净
----	------	------	-------	------	--------

					值比例 (%)
1	601318	中国平安	7,768	385,370.48	4.07
2	600050	中国联通	45,054	308,619.90	3.26
3	600519	贵州茅台	465	219,410.25	2.32
4	600036	招商银行	7,603	181,787.73	1.92
5	300104	乐视网	5,300	162,604.00	1.72
6	601166	兴业银行	9,597	161,805.42	1.71
7	600016	民生银行	18,246	149,982.12	1.58
8	000651	格力电器	3,300	135,861.00	1.43
9	601328	交通银行	21,835	134,503.60	1.42
10	000333	美的集团	3,102	133,510.08	1.41
11	000100	TCL 集团	38,498	132,048.14	1.39
12	600100	同方股份	9,070	128,068.40	1.35
13	601668	中国建筑	11,290	109,287.20	1.15
14	600000	浦发银行	8,450	106,892.50	1.13
15	601919	中远海控	19,738	105,598.30	1.12
16	002252	上海莱士	5,180	104,843.20	1.11
17	600030	中信证券	5,763	98,086.26	1.04
18	600887	伊利股份	4,526	97,716.34	1.03
19	600837	海通证券	6,424	95,396.40	1.01
20	000503	海虹控股	3,804	94,833.72	1.00
21	600485	信威集团	6,281	91,639.79	0.97
22	601398	工商银行	17,245	90,536.25	0.96
23	601169	北京银行	9,295	85,235.15	0.90
24	600104	上汽集团	2,660	82,593.00	0.87
25	600900	长江电力	5,191	79,837.58	0.84
26	601766	中国中车	7,707	77,994.84	0.82
27	000858	五粮液	1,401	77,979.66	0.82

28	000725	京东方 A	18,303	76,140.48	0.80
29	601601	中国太保	2,173	73,599.51	0.78
30	002426	胜利精密	8,800	70,928.00	0.75
31	601211	国泰君安	3,324	68,175.24	0.72
32	600276	恒瑞医药	1,320	66,778.80	0.71
33	002415	海康威视	2,028	65,504.40	0.69
34	601988	中国银行	16,991	62,866.70	0.66
35	000001	平安银行	6,439	60,462.21	0.64
36	002049	紫光国芯	1,800	56,826.00	0.60
37	601872	招商轮船	10,934	56,419.44	0.60
38	300168	万达信息	3,800	55,290.00	0.58
39	600048	保利地产	5,235	52,192.95	0.55
40	601390	中国中铁	5,990	51,933.30	0.55
41	600028	中国石化	8,632	51,187.76	0.54
42	600518	康美药业	2,350	51,089.00	0.54
43	601818	光大银行	12,390	50,179.50	0.53
44	600019	宝钢股份	6,675	44,789.25	0.47
45	601989	中国重工	6,893	44,528.78	0.47
46	600015	华夏银行	4,811	44,357.42	0.47
47	601688	华泰证券	2,457	43,980.30	0.46
48	002304	洋河股份	500	43,405.00	0.46
49	601186	中国铁建	3,542	42,610.26	0.45
50	002450	康得新	1,890	42,562.80	0.45
51	601006	大秦铁路	4,844	40,641.16	0.43
52	000776	广发证券	2,204	38,019.00	0.40
53	000063	中兴通讯	1,601	38,007.74	0.40
54	000538	云南白药	400	37,540.00	0.40
55	601608	中信重工	6,700	37,118.00	0.39

56	601628	中国人寿	1,349	36,396.02	0.38
57	001979	招商蛇口	1,701	36,333.36	0.38
58	600585	海螺水泥	1,546	35,140.58	0.37
59	601088	中国神华	1,551	34,571.79	0.37
60	600690	青岛海尔	2,257	33,967.85	0.36
61	600958	东方证券	2,399	33,370.09	0.35
62	601336	新华保险	627	32,227.80	0.34
63	601939	建设银行	5,232	32,176.80	0.34
64	600795	国电电力	8,827	31,777.20	0.34
65	002024	苏宁云商	2,801	31,511.25	0.33
66	601009	南京银行	2,753	30,861.13	0.33
67	000568	泸州老窖	605	30,600.90	0.32
68	600703	三安光电	1,545	30,436.50	0.32
69	600999	招商证券	1,759	30,289.98	0.32
70	601857	中国石油	3,933	30,244.77	0.32
71	601899	紫金矿业	8,661	29,707.23	0.31
72	601901	方正证券	2,963	29,422.59	0.31
73	600009	上海机场	779	29,064.49	0.31
74	002142	宁波银行	1,502	28,988.60	0.31
75	000423	东阿阿胶	400	28,756.00	0.30
76	601985	中国核电	3,650	28,506.50	0.30
77	601669	中国电建	3,547	28,092.24	0.30
78	600309	万华化学	973	27,866.72	0.29
79	600660	福耀玻璃	1,064	27,706.56	0.29
80	002241	歌尔股份	1,410	27,184.80	0.29
81	002466	天齐锂业	500	27,175.00	0.29
82	601607	上海医药	929	26,829.52	0.28
83	601377	兴业证券	3,585	26,636.55	0.28

84	300070	碧水源	1,420	26,483.00	0.28
85	000166	申万宏源	4,713	26,392.80	0.28
86	002230	科大讯飞	655	26,134.50	0.28
87	300072	三聚环保	700	25,935.00	0.27
88	600089	特变电工	2,473	25,546.09	0.27
89	002456	欧菲光	1,400	25,438.00	0.27
90	002736	国信证券	1,903	25,214.75	0.27
91	600886	国投电力	3,156	24,932.40	0.26
92	600196	复星医药	797	24,699.03	0.26
93	002008	大族激光	700	24,248.00	0.26
94	600066	宇通客车	1,070	23,507.90	0.25
95	600029	南方航空	2,672	23,246.40	0.25
96	600010	包钢股份	10,604	23,222.76	0.25
97	000069	华侨城 A	2,301	23,148.06	0.24
98	601788	光大证券	1,540	22,992.20	0.24
99	600068	葛洲坝	2,043	22,963.32	0.24
100	601888	中国国旅	760	22,906.40	0.24
101	600637	东方明珠	1,055	22,861.85	0.24
102	002236	大华股份	1,000	22,810.00	0.24
103	600340	华夏幸福	679	22,800.82	0.24
104	000783	长江证券	2,407	22,794.29	0.24
105	300059	东方财富	1,877	22,561.54	0.24
106	000338	潍柴动力	1,702	22,466.40	0.24
107	600741	华域汽车	924	22,397.76	0.24
108	600535	天士力	534	22,182.36	0.23
109	601600	中国铝业	4,880	22,057.60	0.23
110	000625	长安汽车	1,503	21,673.26	0.23
111	002594	比亚迪	433	21,628.35	0.23

112	601099	太平洋	5,356	21,531.12	0.23
113	600406	国电南瑞	1,216	21,462.40	0.23
114	600705	中航资本	3,798	21,458.70	0.23
115	601618	中国中冶	4,226	21,172.26	0.22
116	601933	永辉超市	2,938	20,801.04	0.22
117	600031	三一重工	2,525	20,528.25	0.22
118	000839	中信国安	2,052	20,499.48	0.22
119	300124	汇川技术	801	20,457.54	0.22
120	002739	万达院线	400	20,388.00	0.22
121	000768	中航飞机	1,100	20,284.00	0.21
122	600383	金地集团	1,757	20,152.79	0.21
123	000963	华东医药	400	19,880.00	0.21
124	600111	北方稀土	1,711	19,385.63	0.20
125	000895	双汇发展	806	19,142.50	0.20
126	002475	立讯精密	652	19,064.48	0.20
127	601800	中国交建	1,184	18,813.76	0.20
128	601727	上海电气	2,473	18,720.61	0.20
129	600023	浙能电力	3,407	18,602.22	0.20
130	002202	金风科技	1,201	18,579.47	0.20
131	002673	西部证券	1,304	18,542.88	0.20
132	601555	东吴证券	1,643	18,450.89	0.19
133	600109	国金证券	1,554	18,212.88	0.19
134	600739	辽宁成大	1,008	18,174.24	0.19
135	000623	吉林敖东	780	17,854.20	0.19
136	600893	航发动力	649	17,717.70	0.19
137	002007	华兰生物	483	17,629.50	0.19
138	601018	宁波港	3,067	17,328.55	0.18
139	600271	航天信息	838	17,296.32	0.18

140	600177	雅戈尔	1,677	16,971.24	0.18
141	600547	山东黄金	584	16,895.12	0.18
142	600352	浙江龙盛	1,769	16,858.57	0.18
143	600674	川投能源	1,706	16,752.92	0.18
144	600221	海航控股	5,146	16,570.12	0.18
145	000793	华闻传媒	1,617	16,364.04	0.17
146	600570	恒生电子	347	16,197.96	0.17
147	600804	鹏博士	907	16,099.25	0.17
148	600018	上港集团	2,539	16,097.26	0.17
149	300024	机器人	821	16,009.50	0.17
150	600153	建发股份	1,236	15,981.48	0.17
151	600415	小商品城	2,198	15,913.52	0.17
152	000826	启迪桑德	453	15,909.36	0.17
153	000413	东旭光电	1,402	15,730.44	0.17
154	600816	安信信托	1,153	15,669.27	0.17
155	000728	国元证券	1,259	15,384.98	0.16
156	601198	东兴证券	892	15,378.08	0.16
157	600115	东方航空	2,250	15,300.00	0.16
158	002065	东华软件	700	15,253.00	0.16
159	601111	中国国航	1,556	15,171.00	0.16
160	600820	隧道股份	1,499	15,139.90	0.16
161	002310	东方园林	900	15,048.00	0.16
162	600085	同仁堂	429	14,997.84	0.16
163	601998	中信银行	2,374	14,932.46	0.16
164	000157	中联重科	3,302	14,825.98	0.16
165	000709	河钢股份	3,503	14,677.57	0.16
166	000540	中天城投	2,100	14,595.00	0.15
167	600606	绿地控股	1,846	14,435.72	0.15

168	603993	洛阳钼业	2,801	14,173.06	0.15
169	600157	永泰能源	3,964	14,151.48	0.15
170	002465	海格通信	1,309	14,058.66	0.15
171	600489	中金黄金	1,400	14,042.00	0.15
172	300315	掌趣科技	1,701	13,880.16	0.15
173	600663	陆家嘴	585	13,829.40	0.15
174	000630	铜陵有色	4,824	13,700.16	0.14
175	300017	网宿科技	1,129	13,627.03	0.14
176	600008	首创股份	2,023	13,311.34	0.14
177	600061	国投安信	853	13,264.15	0.14
178	002081	金螳螂	1,200	13,176.00	0.14
179	600208	新湖中宝	2,928	13,176.00	0.14
180	000876	新希望	1,600	13,152.00	0.14
181	000009	中国宝安	1,617	13,081.53	0.14
182	601155	新城控股	700	12,978.00	0.14
183	600718	东软集团	822	12,782.10	0.13
184	600959	江苏有线	1,202	12,705.14	0.13
185	600118	中国卫星	454	12,639.36	0.13
186	600150	中国船舶	552	12,624.24	0.13
187	002074	国轩高科	400	12,620.00	0.13
188	600297	广汇汽车	1,660	12,499.80	0.13
189	300033	同花顺	200	12,442.00	0.13
190	600332	白云山	425	12,342.00	0.13
191	000060	中金岭南	1,100	12,320.00	0.13
192	000938	紫光股份	200	12,224.00	0.13
193	600170	上海建工	3,183	12,159.06	0.13
194	000750	国海证券	2,202	12,111.00	0.13
195	601633	长城汽车	902	11,987.58	0.13

196	600369	西南证券	2,117	11,876.37	0.13
197	601333	广深铁路	2,583	11,675.16	0.12
198	600688	上海石化	1,766	11,673.26	0.12
199	000425	徐工机械	3,096	11,610.00	0.12
200	600583	海油工程	1,838	11,469.12	0.12
201	000686	东北证券	1,087	10,924.35	0.12
202	600362	江西铜业	640	10,790.40	0.11
203	000559	万向钱潮	1,001	10,630.62	0.11
204	000402	金融街	901	10,559.72	0.11
205	000983	西山煤电	1,200	10,524.00	0.11
206	300027	华谊兄弟	1,295	10,476.55	0.11
207	300144	宋城演艺	500	10,435.00	0.11
208	600588	用友网络	609	10,426.08	0.11
209	600895	张江高科	611	10,313.68	0.11
210	600038	中直股份	225	10,298.25	0.11
211	600373	中文传媒	438	10,297.38	0.11
212	600649	城投控股	970	10,194.70	0.11
213	000917	电广传媒	900	10,170.00	0.11
214	600498	烽火通信	400	10,140.00	0.11
215	600256	广汇能源	2,401	9,940.14	0.10
216	600060	海信电器	652	9,890.84	0.10
217	002146	荣盛发展	1,000	9,870.00	0.10
218	002385	大北农	1,552	9,762.08	0.10
219	600704	物产中大	1,327	9,673.83	0.10
220	002174	游族网络	300	9,528.00	0.10
221	601216	君正集团	1,945	9,511.05	0.10
222	600074	保千里	742	9,505.02	0.10
223	002183	怡亚通	1,101	9,501.63	0.10

224	000792	盐湖股份	906	9,467.70	0.10
225	000415	渤海金控	1,400	9,422.00	0.10
226	600827	百联股份	572	9,295.00	0.10
227	601718	际华集团	1,051	9,238.29	0.10
228	601225	陕西煤业	1,290	9,120.30	0.10
229	002470	金正大	1,208	9,096.24	0.10
230	600376	首开股份	791	9,049.04	0.10
231	600685	中船防务	324	8,871.12	0.09
232	601866	中远海发	2,442	8,791.20	0.09
233	002500	山西证券	907	8,689.06	0.09
234	000977	浪潮信息	500	8,660.00	0.09
235	601021	春秋航空	250	8,407.50	0.09
236	002714	牧原股份	300	8,166.00	0.09
237	000627	天茂集团	1,000	8,080.00	0.09
238	002195	二三四五	1,130	8,079.50	0.09
239	600037	歌华有线	552	8,037.12	0.08
240	601877	正泰电器	400	8,036.00	0.08
241	600021	上海电力	655	7,918.95	0.08
242	000738	中航动控	400	7,828.00	0.08
243	600482	中国动力	300	7,587.00	0.08
244	002424	贵州百灵	400	7,544.00	0.08
245	002152	广电运通	900	7,479.00	0.08
246	000156	华数传媒	500	7,455.00	0.08
247	600737	中粮糖业	779	7,353.76	0.08
248	000671	阳光城	1,200	6,984.00	0.07
249	002027	分众传媒	500	6,880.00	0.07
250	002153	石基信息	300	6,819.00	0.07
251	600446	金证股份	386	6,785.88	0.07

252	002292	奥飞娱乐	400	6,760.00	0.07
253	600549	厦门钨业	300	6,447.00	0.07
254	600372	中航电子	365	6,340.05	0.07
255	300133	华策影视	560	6,272.00	0.07
256	002131	利欧股份	1,850	6,086.50	0.06
257	601611	中国核建	500	5,985.00	0.06
258	002299	圣农发展	400	5,948.00	0.06
259	300251	光线传媒	720	5,896.80	0.06
260	601118	海南橡胶	947	5,378.96	0.06
261	600871	石化油服	1,606	5,364.04	0.06
262	000718	苏宁环球	900	5,274.00	0.06
263	601958	金钼股份	731	5,241.27	0.06
264	000008	神州高铁	700	5,096.00	0.05
265	000555	神州信息	300	5,010.00	0.05
266	601127	小康股份	200	3,990.00	0.04
267	600188	兖州煤业	291	3,561.84	0.04
268	002797	第一创业	320	2,947.20	0.03

7.3.2 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	占基金资产净值比例（%）
1	002129	中环股份	7,944	65,696.88	0.69
2	600666	奥瑞德	3,749	65,232.60	0.69
3	601200	上海环境	1,936	51,671.84	0.55
4	600867	通化东宝	970	17,692.80	0.19
5	002085	万丰奥威	840	16,338.00	0.17

6	300015	爱尔眼科	487	11,327.62	0.12
7	601258	庞大集团	4,000	11,200.00	0.12
8	000039	中集集团	600	10,818.00	0.11
9	000778	新兴铸管	1,602	10,733.40	0.11
10	600839	四川长虹	2,833	10,255.46	0.11
11	300002	神州泰岳	1,101	9,182.34	0.10
12	600873	梅花生物	1,600	9,072.00	0.10
13	600252	中恒集团	2,171	8,770.84	0.09
14	600875	东方电气	915	8,765.70	0.09
15	300146	汤臣倍健	600	8,244.00	0.09
16	300058	蓝色光标	998	7,804.36	0.08
17	300182	捷成股份	800	7,648.00	0.08
18	000712	锦龙股份	400	6,548.00	0.07
19	600648	外高桥	336	6,222.72	0.07
20	000800	一汽轿车	606	6,163.02	0.07
21	000027	深圳能源	901	6,063.73	0.06
22	600582	天地科技	1,320	6,058.80	0.06
23	603000	人民网	440	5,794.80	0.06
24	601928	凤凰传媒	567	5,533.92	0.06
25	000061	农产品	607	5,499.42	0.06
26	600754	锦江股份	200	5,420.00	0.06
27	603885	吉祥航空	344	5,221.92	0.06
28	600783	鲁信创投	238	4,053.14	0.04
29	300085	银之杰	200	3,700.00	0.04
30	002568	百润股份	200	3,324.00	0.04

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	600016	民生银行	106,656.00	0.21
2	600019	宝钢股份	96,148.36	0.19
3	600837	海通证券	56,865.00	0.11
4	000002	万科A	49,384.00	0.10
5	601200	上海环境	39,374.88	0.08
6	600030	中信证券	34,926.00	0.07
7	600000	浦发银行	31,467.00	0.06
8	601668	中国建筑	28,349.00	0.06
9	601169	北京银行	24,882.00	0.05
10	601166	兴业银行	22,954.00	0.05
11	600104	上汽集团	21,798.00	0.04
12	601601	中国太保	16,720.00	0.03
13	002673	西部证券	13,046.13	0.03
14	600873	梅花生物	9,120.00	0.02
15	601328	交通银行	8,610.00	0.02
16	601398	工商银行	6,682.00	0.01
17	600549	厦门钨业	6,585.00	0.01
18	000718	苏宁环球	5,283.00	0.01
19	601988	中国银行	4,784.00	0.01
20	600028	中国石化	4,165.00	0.01

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。

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	601318	中国平安	2,010,309.00	3.96
2	600036	招商银行	958,516.00	1.89
3	601166	兴业银行	955,718.00	1.88
4	600519	贵州茅台	911,490.00	1.80
5	600016	民生银行	909,127.00	1.79
6	601328	交通银行	723,229.00	1.43
7	000002	万科A	719,526.35	1.42
8	000333	美的集团	709,348.00	1.40
9	000651	格力电器	699,838.00	1.38
10	601668	中国建筑	624,005.00	1.23
11	600000	浦发银行	607,287.00	1.20
12	600030	中信证券	580,696.00	1.15
13	600837	海通证券	568,882.00	1.12
14	600887	伊利股份	499,835.00	0.99
15	601169	北京银行	482,381.00	0.95
16	601398	工商银行	481,791.00	0.95
17	600104	上汽集团	435,359.00	0.86
18	000725	京东方A	430,510.00	0.85
19	600900	长江电力	421,528.29	0.83
20	601601	中国太保	410,434.00	0.81

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	645,719.33
卖出股票收入（成交）总额	40,120,601.31

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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	11,451.77
2	应收证券清算款	105,270.61
3	应收股利	-
4	应收利息	138.95
5	应收申购款	3,444.44

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	120,305.77

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

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	600050	中国联通	308,619.90	3.26	重大事项
2	300104	乐视网	162,604.00	1.72	重大资产重组

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	002129	中环股份	65,696.88	0.69	重大事项
2	600666	奥瑞德	65,232.60	0.69	重大资产重组

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

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	8,863.12	900.79	0.01%	8,224,074.41	99.99%

8.2 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	1,394,834.13	16.96%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§ 9 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	46,938,152.91
本报告期基金总申购份额	3,933,565.73
减:本报告期基金总赎回份额	42,646,743.44
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	8,224,975.20

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动；

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未改变。

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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注

	数量	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	
中泰证券	2	40,144,220.28	99.17%	29,358.08	99.17%	-
东兴证券	2	335,225.79	0.83%	245.16	0.83%	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中信建投	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。

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	成交金额	占当期债 券回购	成交金额	占当期权证 成交总额的

		例		成交总额 的比例		比例
中泰证券	62,899.00	100.00%	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

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 2016 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	证券日报、基金管理人的官方网站	2017 年 1 月 3 日
2	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告	证券日报、基金管理人的官方网站	2017 年 1 月 17 日
3	前海开源沪深 300 指数型证券投资基金 2016 年第 4 季度报告	证券日报、基金管理人的官方网站	2017 年 1 月 20 日
4	前海开源沪深 300 指数型证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2016 年第 2 号）	证券日报、基金管理人的官方网站	2017 年 1 月 26 日
5	前海开源沪深 300 指数型证券投资基金招募说明书（更新）（2016 年第 2 号）	基金管理人的官方网站	2017 年 1 月 26 日
6	前海开源沪深 300 指数型证券投资基金增聘基金经理的公告	证券日报、基金管理人的官方网站	2017 年 2 月 22 日
7	前海开源基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加蚂蚁基金申购补差费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人的官方网站	2017 年 2 月 23 日
8	前海开源基金管理有限公司关于开源证券费率	证券日报、基金管	2017 年 2 月 24 日

	调整的公告	理人的官方网站	
9	前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加西南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	证券日报、基金管理人的官方网站	2017 年 3 月 29 日
10	前海开源沪深 300 指数型证券投资基金 2016 年年度报告摘要	证券日报、基金管理人的官方网站	2017 年 3 月 30 日
11	前海开源沪深 300 指数型证券投资基金 2016 年年度报告	基金管理人的官方网站	2017 年 3 月 30 日
12	前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加万得投顾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	证券日报、基金管理人的官方网站	2017 年 4 月 11 日
13	前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加格上富信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	证券日报、基金管理人的官方网站	2017 年 4 月 17 日
14	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告	证券日报、基金管理人的官方网站	2017 年 4 月 19 日
15	前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加乾道金融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	证券日报、基金管理人的官方网站	2017 年 4 月 20 日
16	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告	证券日报、基金管理人的官方网站	2017 年 4 月 20 日
17	前海开源沪深 300 指数型证券投资基金 2017 年第 1 季度报告	证券日报、基金管理人的官方网站	2017 年 4 月 21 日
18	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告	证券日报、基金管理人的官方网站	2017 年 4 月 25 日
19	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告	证券日报、基金管理人的官方网站	2017 年 5 月 9 日
20	前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加扬州国信嘉利为代销机构及开通定投和转	证券日报、基金管理人的官方网站	2017 年 5 月 11 日

	换业务并参与其费率优惠活动的公告		
21	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告	证券日报、基金管理人的官方网站	2017 年 5 月 11 日
22	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告	证券日报、基金管理人的官方网站	2017 年 5 月 12 日
23	前海开源基金管理有限公司关于锦安基金费率调整的公告	证券日报、基金管理人的官方网站	2017 年 5 月 15 日
24	前海开源基金管理有限公司关于展恒基金费率调整的公告	证券日报、基金管理人的官方网站	2017 年 5 月 15 日
25	前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金在伯嘉基金开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人的官方网站	2017 年 5 月 18 日
26	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告	证券日报、基金管理人的官方网站	2017 年 5 月 24 日
27	前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中衍期货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	证券日报、基金管理人的官方网站	2017 年 5 月 25 日
28	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告	证券日报、基金管理人的官方网站	2017 年 6 月 2 日
29	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告	证券日报、基金管理人的官方网站	2017 年 6 月 13 日
30	前海开源沪深 300 指数型证券投资基金变更基金经理的公告	证券日报、基金管理人的官方网站	2017 年 6 月 15 日
31	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告	证券日报、基金管理人的官方网站	2017 年 6 月 20 日
32	前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加济安财富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	证券日报、基金管理人的官方网站	2017 年 6 月 27 日
33	前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金	证券日报、基金管	2017 年 6 月 29 日

	在华泰证券开通转换业务的公告	理人的官方网站	
34	前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加挖财基金为代销机构及开通定投业务并参与其费率优惠活动的公告	证券日报、基金管 理人的官方网站	2017 年 6 月 29 日

§ 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	20170101-20170523	13,269,194.31	0.00	13,269,194.31	0.00	0.00%
	2	20170101-20170523	9,636,269.43	0.00	9,636,269.43	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。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (1) 中国证券监督管理委员会批准前海开源沪深 300 指数型证券投资基金设立的文件
- (2) 《前海开源沪深 300 指数型证券投资基金基金合同》
- (3) 《前海开源沪深 300 指数型证券投资基金托管协议》
- (4) 《前海开源沪深 300 指数型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) 前海开源沪深 300 指数型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

12.3 查阅方式

- (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

前海开源基金管理有限公司

2017 年 8 月 28 日