

前海开源强势共识 100 强等权重股票型证 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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	10
3.1 主要会计数据和财务指标.....	10
3.2 基金净值表现.....	10
3.3 其他指标.....	12
§4 管理人报告	13
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	13
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.....	16
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.....	16
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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.....	17
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	17
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	18
6.1 资产负债表.....	18
6.2 利润表.....	19

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	21
6.4 报表附注.....	23
§7 投资组合报告.....	43
7.1 期末基金资产组合情况.....	43
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	43
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.....	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	50
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.....	50
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.....	51
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.....	51
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.....	51
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	51
7.12 投资组合报告附注.....	52
§8 基金份额持有人信息.....	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	54
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.....	54
§9 开放式基金份额变动.....	55
§10 重大事件揭示.....	56
10.1 基金份额持有人大会决议.....	56
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.....	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	56
10.4 基金投资策略的改变.....	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	56
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.....	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	56
10.8 其他重大事件.....	58
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	63

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	63
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	63
§12 备查文件目录	64
12.1 备查文件目录	64
12.2 存放地点	64
12.3 查阅方式	64

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	前海开源强势共识 100 强等权重股票型证券投资基金
基金简称	前海开源强势共识 100 强股票
基金主代码	001849
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 12 月 10 日
基金管理人	前海开源基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	49,424,936.50 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在深入研究融资融券市场运行规律的基础上，把握市场中长期趋势和短期热点，通过精选融资融券活跃的个股，在合理控制风险并保持基金资产良好流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>本基金的投资策略主要有以下六方面内容：</p> <p>1、大类资产配置</p> <p>本基金将综合运用定性和定量的分析方法，在深入研究的基础上，合理确定本基金在股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金所指的强势共识 100 强股票是基金管理人在深入研究融资融券市场的基础上，根据特定的筛选流程，以两融成交活跃度为指标，从作为融资融券标的的沪深 A 股中精选 100 只股票构建的股票投资组合。具体投资策略包含以下五个方面：（1）强势共识 100 强股票的界定；（2）定期调整策略；（3）不定期调整策略；（4）强势共识 100 强股票中个股出现停牌情形的处理；（5）其他策略。</p>

	<p>3、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>4、权证投资策略</p> <p>本基金将权证的投资作为提高基金投资组合收益的辅助手段。根据权证对应公司基本面研究成果确定权证的合理估值，发现市场对股票权证的非理性定价；利用权证衍生工具的特性，通过权证与证券的组合投资，来达到改善组合风险收益特征的目的。</p> <p>5、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金通过对资产支持证券发行条款的分析、违约概率和提前偿付比率的预估，借用必要的数量模型来谋求对资产支持证券的合理定价，在严格控制风险的前提下，谨慎选择风险调整后收益较高的品种进行投资。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。</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。本基金参与股指期货投资时机和数量的决策建立在对证券市场总体行情的判断和组合风险收益分析的基础上。基金管理人将根据宏观经济因素、政策及法规因素和资本市场因素，结合定性和定量方法，确定投资时机。基金管理人将结合股票投资的总体规模，以及中国证监会的相关限定和要求，确定参与股指期货交易的投资比例。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及风险水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称	前海开源基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司	
信息披露负责人	姓名	傅成斌	郭明
	联系电话	0755-88601888	(010) 66105799
	电子邮箱	qhky@qhkyfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话	4001666998	95588	
传真	0755-83181169	(010) 66105798	
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)	北京市西城区复兴门内大街 55 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 55 号	
邮政编码	518040	100140	
法定代表人	王兆华	易会满	

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	-2,013,320.28
本期利润	483,229.65
加权平均基金份额本期利润	0.0088
本期加权平均净值利润率	0.95%
本期基金份额净值增长率	0.65%
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	-4,273,798.47
期末可供分配基金份额利润	-0.0865
期末基金资产净值	45,839,303.34
期末基金份额净值	0.927
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	-7.30%

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。

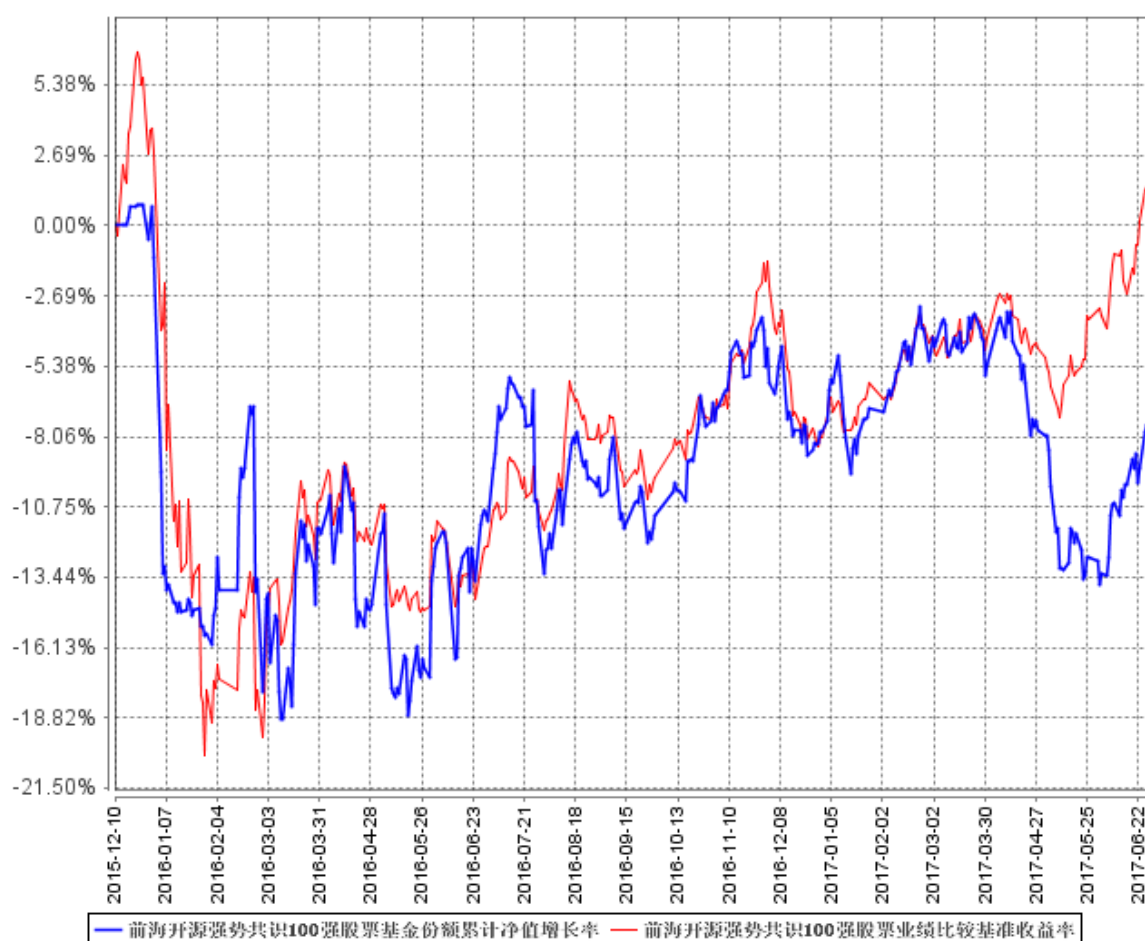
3.2 基金净值表现

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	6.31%	0.77%	4.73%	0.64%	1.58%	0.13%
过去三个月	-2.11%	0.84%	5.79%	0.59%	-7.90%	0.25%
过去六个月	0.65%	0.77%	10.23%	0.54%	-9.58%	0.23%
过去一年	4.16%	0.84%	15.44%	0.63%	-11.28%	0.21%
自基金合同生效起至今	-7.30%	1.31%	1.31%	1.14%	-8.61%	0.17%

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

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



3.3 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		
谢屹	本基金的基金经理、公司执行投资总监	2015 年 12 月 10 日	-	8 年	谢屹先生，金融与经济数学、工程物理学硕士，国籍：德国。历任汇丰银行（德国）股票研究所及投资银行部分析师、高级分析师、副总裁。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

2017 年第 1 季度 A 股市场整体呈现上涨格局，主要由于去年 4 季度资金面的扰动因素逐渐消失，市场重新回到基本面驱动的模式中。而基本面短期依旧呈现出积极的一面。所以 A 股市场回到了上升的趋势中。从两融交易的角度看，我们发现强势的行业同时呈现周期与非周期的特征，既包括了食品饮料、家电等消费类行业，也包括了煤炭、钢铁、有色等周期性行业。进入第 2 季度中国经济基本面有所放缓，以 PMI 为代表的景气程度指标下滑。我们认为其主要原因在于过去

3 个月的信贷发放在边际上的连续收紧，并叠加管理层对市场流动性的更审慎的监管。在股市层面，A 股分化明显，以沪深 300 为代表的蓝筹以及白马股上涨，而其他偏周期的高弹性的行业以及中小创板块则下跌。相应的，我们发现两融交易者的投资偏好在第 2 季度前期主要集中在食品饮料和家电等消费类行业。而进入 6 月，随着市场企稳，煤炭、建材和军工等行业均有资金流入。所以我们的组合目前依然相对均衡，既包括了非周期消费类行业也包含了周期性的行业。

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 0.65%，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

下半年我们认为全球的经济基本面将呈现逐步见顶回落的格局，因为本轮经济周期基本面向上的时间将逐步进入尾声。全球的通胀还会随着大宗商品的反弹而回升，未来会在基本面见顶之后逐渐回落。历史上看，大类资产在经济基本面顶部的前后会经历一次切换。风险资产比如美股、港股包括 A 股等权益市场会同步见顶回落。黄金资产将逐步成为优势资产。在通胀逐步回落以后，同为避险资产的债券将迎来第一次有配置意义的机会。行业上，强势的行业也会经历一次切换，在经济见顶之前，周期性行业可能会领先消费类行业反弹。而在整个股市见顶之后，两者会同步下跌。从相对收益的角度，大盘蓝筹以及非周期行业可能再度领先。本基金将密切关注宏观经济的动向，采取相对灵活的行业策略，争取绝对收益。

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 4 月 19 日至 2017 年 6 月 30 日连续 50 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强势共识 100 强股票的托管过程中，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，前海开源强势共识 100 强股票的管理人——前海开源基金管理有限公司在前海开源强势共识 100 强股票的投资运作、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，前海开源强势共识 100 强股票未进行利润分配。

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强势共识 100 强股票 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：前海开源强势共识 100 强等权重股票型证券投资基金

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	2,628,845.70	5,520,161.91
结算备付金		-	-
存出保证金		17,699.98	35,218.71
交易性金融资产	6.4.7.2	43,487,989.38	52,887,259.86
其中：股票投资		43,487,989.38	52,887,259.86
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		45,571.29	-
应收利息	6.4.7.5	571.22	1,045.95
应收股利		-	-
应收申购款		99.85	199.70
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		46,180,777.42	58,443,886.13
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		-	2,091,566.39
应付赎回款		92,534.79	228,415.18
应付管理人报酬		55,744.57	79,321.64
应付托管费		9,290.78	13,220.28
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	34,139.64	143,218.40
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	149,764.30	350,420.31
负债合计		341,474.08	2,906,162.20
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	49,424,936.50	60,274,505.95
未分配利润	6.4.7.10	-3,585,633.16	-4,736,782.02
所有者权益合计		45,839,303.34	55,537,723.93
负债和所有者权益总计		46,180,777.42	58,443,886.13

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.927 元，基金份额总额 49,424,936.50 份。

6.2 利润表

会计主体：前海开源强势共识 100 强等权重股票型证券投资基金

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		1,145,767.31	-7,926,256.82
1.利息收入		13,798.90	82,154.45
其中：存款利息收入	6.4.7.11	13,798.90	82,154.45
债券利息收入		-	-
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）		-1,373,588.45	-13,927,885.40
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-1,679,249.71	-14,541,842.42
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
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	305,661.26	613,957.02
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	2,496,549.93	5,806,217.91
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	9,006.93	113,256.22
减：二、费用		662,537.66	2,152,708.85
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	379,139.23	817,303.31
2. 托管费	6.4.10.2.2	63,189.87	136,217.22
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	169,105.18	1,023,176.18
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	51,103.38	176,012.14

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		483,229.65	-10,078,965.67
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		483,229.65	-10,078,965.67

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：前海开源强势共识 100 强等权重股票型证券投资基金

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）	60,274,505.95	-4,736,782.02	55,537,723.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	483,229.65	483,229.65
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）	-10,849,569.45	667,919.21	-10,181,650.24
其中：1.基金申购款	1,164,508.70	-88,235.37	1,076,273.33
2.基金赎回款	-12,014,078.15	756,154.58	-11,257,923.57
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)	49,424,936.50	-3,585,633.16	45,839,303.34
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)	109,705,904.82	-1,316,521.26	108,389,383.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-10,078,965.67	-10,078,965.67
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	34,603,780.24	-4,507,180.95	30,096,599.29
其中：1.基金申购款	69,844,101.45	-9,551,606.47	60,292,494.98
2.基金赎回款	-35,240,321.21	5,044,425.52	-30,195,895.69
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)	144,309,685.06	-15,902,667.88	128,407,017.18

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

何隽
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

前海开源强势共识 100 强等权重股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可【2015】2042 号文《关于准予前海开源强势共识 100 强等权重股票型证券投资基金注册的批复》，由前海开源基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《前海开源强势共识 100 强等权重股票型证券投资基金基金合同》及其他法律法规公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次募集期间为 2015 年 10 月 14 日至 2015 年 12 月 8 日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 280,250,205.42 元，经瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）瑞华验字[2015]02230087 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《前海开源强势共识 100 强等权重股票型证券投资基金基金合同》于 2015 年 12 月 10 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 280,373,902.08 份基金份额，其中认购资金利息折合 123,696.66 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工商银行股份有限公司。

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》、《前海开源强势共识 100 强等权重股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 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 重要会计政策和会计估计

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	2,628,845.70
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	2,628,845.70

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	40,910,479.23	43,487,989.38	2,577,510.15
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	40,910,479.23	43,487,989.38	2,577,510.15

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	564.02
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	7.20
合计	571.22

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	34,139.64
银行间市场应付交易费用	-
合计	34,139.64

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	173.92
预提费用	149,590.38
合计	149,764.30

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	60,274,505.95	60,274,505.95
本期申购	1,164,508.70	1,164,508.70
本期赎回(以“-”号填列)	-12,014,078.15	-12,014,078.15
- 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	49,424,936.50	49,424,936.50

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	-2,875,814.52	-1,860,967.50	-4,736,782.02
本期利润	-2,013,320.28	2,496,549.93	483,229.65
本期基金份额交易产生的变动数	615,336.33	52,582.88	667,919.21
其中：基金申购款	-60,904.35	-27,331.02	-88,235.37
基金赎回款	676,240.68	79,913.90	756,154.58
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-4,273,798.47	688,165.31	-3,585,633.16

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	13,078.66
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	466.07
其他	254.17
合计	13,798.90

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	66,780,690.80
减：卖出股票成本总额	68,459,940.51
买卖股票差价收入	-1,679,249.71

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

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内无债券买卖差价收入。

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	305,661.26
基金投资产生的股利收益	-
合计	305,661.26

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	2,496,549.93
——股票投资	2,496,549.93
——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	2,496,549.93

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	7,792.13
基金转换费收入	1,214.80
合计	9,006.93

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	169,105.18
银行间市场交易费用	-
合计	169,105.18

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	1,513.00
合计	51,103.38

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”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	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

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内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内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内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内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内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	379,139.23	817,303.31
其中：支付销售机构的客户维护费	78,384.58	210,900.31

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

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	63,189.87	136,217.22
----------------	-----------	------------

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

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内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 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
中国工商银行股份有限公司	2,628,845.70	13,078.66	7,439,699.62	72,888.86

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商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内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内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
300088	长信科技	2016年9月12日	重大资产重组	14.95	2017年8月9日	14.50	63,700	1,061,242.00	952,315.00	-
600559	老白干酒	2017年1月23日	重大资产重组	28.42	-	-	20,900	479,384.59	593,978.00	-

601001	大同 煤业	2017 年 6 月 22 日	重 大 事 项	5.25	2017 年 7 月 21 日	5.78	77,600	394,208.00	407,400.00	-
--------	----------	--------------------------	------------------	------	--------------------------	------	--------	------------	------------	---

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。

6.4.12.3 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	2,628,845.70	-	-	-	2,628,845.70
存出保证金	17,699.98	-	-	-	17,699.98
交易性金融资产	-	-	-	43,487,989.38	43,487,989.38
应收证券清算款	-	-	-	45,571.29	45,571.29
应收利息	-	-	-	571.22	571.22

应收申购款	-	-	-	99.85	99.85
资产总计	2,646,545.68	-	-	43,534,231.74	46,180,777.42
负债					
应付赎回款	-	-	-	92,534.79	92,534.79
应付管理人报酬	-	-	-	55,744.57	55,744.57
应付托管费	-	-	-	9,290.78	9,290.78
应付交易费用	-	-	-	34,139.64	34,139.64
其他负债	-	-	-	149,764.30	149,764.30
负债总计	-	-	-	341,474.08	341,474.08
利率敏感度缺口	2,646,545.68	-	-	43,192,757.66	45,839,303.34
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	5,520,161.91	-	-	-	5,520,161.91
存出保证金	35,218.71	-	-	-	35,218.71
交易性金融资产	-	-	-	52,887,259.86	52,887,259.86
应收利息	-	-	-	1,045.95	1,045.95
应收申购款	-	-	-	199.70	199.70
资产总计	5,555,380.62	-	-	52,888,505.51	58,443,886.13
负债					
应付证券清算款	-	-	-	2,091,566.39	2,091,566.39
应付赎回款	-	-	-	228,415.18	228,415.18
应付管理人报酬	-	-	-	79,321.64	79,321.64
应付托管费	-	-	-	13,220.28	13,220.28
应付交易费用	-	-	-	143,218.40	143,218.40
其他负债	-	-	-	350,420.31	350,420.31
负债总计	-	-	-	2,906,162.20	2,906,162.20
利率敏感度缺口	5,555,380.62	-	-	49,982,343.31	55,537,723.93

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	43,487,989.38	94.87	52,887,259.86	95.23
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	43,487,989.38	94.87	52,887,259.86	95.23

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%	2,986,397.30	2,985,675.31
	权益性投资的市场价格下降 5%	-2,986,397.30	-2,985,675.31

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41,534,296.38元，属于第二层次的余额为1,953,693.00元，属于第三层次的余额为0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 51,780,376.54 元，属于第二层次的余额为 1,106,883.32 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 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	43,487,989.38	94.17
	其中：股票	43,487,989.38	94.17
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	2,628,845.70	5.69
7	其他各项资产	63,942.34	0.14
8	合计	46,180,777.42	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（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	5,924,496.00	12.92
C	制造业	30,268,729.78	66.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供	-	-

	应业		
E	建筑业	3,583,484.60	7.82
F	批发和零售业	856,082.00	1.87
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	2,855,197.00	6.23
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	43,487,989.38	94.87

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	300088	长信科技	63,700	952,315.00	2.08
2	600559	老白干酒	20,900	593,978.00	1.30

3	002302	西部建设	24,900	552,033.00	1.20
4	600516	方大炭素	36,600	520,452.00	1.14
5	000651	格力电器	11,800	485,806.00	1.06
6	000921	海信科龙	28,000	481,880.00	1.05
7	000983	西山煤电	54,100	474,457.00	1.04
8	000877	天山股份	37,400	473,858.00	1.03
9	000786	北新建材	29,400	465,696.00	1.02
10	000333	美的集团	10,800	464,832.00	1.01
11	000858	五粮液	8,300	461,978.00	1.01
12	600855	航天长峰	21,800	461,724.00	1.01
13	600879	航天电子	52,400	460,596.00	1.00
14	002372	伟星新材	24,600	459,528.00	1.00
15	600372	中航电子	26,400	458,568.00	1.00
16	600801	华新水泥	47,700	454,581.00	0.99
17	600887	伊利股份	20,900	451,231.00	0.98
18	600809	山西汾酒	13,000	450,970.00	0.98
19	002271	东方雨虹	12,100	448,910.00	0.98
20	600893	航发动力	16,400	447,720.00	0.98
21	601699	潞安环能	56,700	443,394.00	0.97
22	600188	兖州煤业	36,200	443,088.00	0.97
23	000761	本钢板材	84,600	442,458.00	0.97
24	600971	恒源煤电	54,300	441,459.00	0.96
25	600038	中直股份	9,600	439,392.00	0.96
26	000404	华意压缩	55,700	438,359.00	0.96
27	600808	马钢股份	123,300	436,482.00	0.95
28	600702	沱牌舍得	16,400	436,404.00	0.95
29	002032	苏泊尔	10,600	435,130.00	0.95
30	600802	福建水泥	50,200	433,728.00	0.95

31	600387	海越股份	33,400	433,198.00	0.95
32	000596	古井贡酒	8,500	433,075.00	0.94
33	000825	太钢不锈	99,500	432,825.00	0.94
34	000895	双汇发展	18,200	432,250.00	0.94
35	000898	鞍钢股份	76,300	431,858.00	0.94
36	601898	中煤能源	73,300	431,004.00	0.94
37	002179	中航光电	13,800	430,422.00	0.94
38	600395	盘江股份	58,700	430,271.00	0.94
39	600073	上海梅林	44,977	429,530.35	0.94
40	002242	九阳股份	21,800	428,806.00	0.94
41	002142	宁波银行	22,200	428,460.00	0.93
42	600597	光明乳业	33,600	428,400.00	0.93
43	600197	伊力特	21,900	427,707.00	0.93
44	601666	平煤股份	81,100	427,397.00	0.93
45	000901	航天科技	15,700	426,412.00	0.93
46	600170	上海建工	111,500	425,930.00	0.93
47	600391	航发科技	15,900	425,643.00	0.93
48	000568	泸州老窖	8,400	424,872.00	0.93
49	000860	顺鑫农业	21,200	424,212.00	0.93
50	600348	阳泉煤业	62,500	423,750.00	0.92
51	002190	成飞集成	15,800	423,440.00	0.92
52	600336	澳柯玛	72,800	422,968.00	0.92
53	600677	航天通信	30,800	422,884.00	0.92
54	600585	海螺水泥	18,600	422,778.00	0.92
55	600019	宝钢股份	63,000	422,730.00	0.92
56	600316	洪都航空	26,200	421,034.00	0.92
57	600123	兰花科创	55,200	420,624.00	0.92
58	600690	青岛海尔	27,900	419,895.00	0.92

59	000937	冀中能源	68,500	419,220.00	0.91
60	600307	酒钢宏兴	146,700	418,095.00	0.91
61	000552	靖远煤电	116,800	416,976.00	0.91
62	000738	中航动控	21,300	416,841.00	0.91
63	000768	中航飞机	22,600	416,744.00	0.91
64	600343	航天动力	23,900	414,426.00	0.90
65	600720	祁连山	52,900	414,207.00	0.90
66	601169	北京银行	45,100	413,567.00	0.90
67	600039	四川路桥	99,200	412,672.00	0.90
68	600820	隧道股份	40,800	412,080.00	0.90
69	600199	金种子酒	51,900	411,567.00	0.90
70	601009	南京银行	36,700	411,407.00	0.90
71	000012	南玻A	44,091	411,369.03	0.90
72	000789	万年青	58,000	411,220.00	0.90
73	002233	塔牌集团	33,700	410,129.00	0.89
74	002646	青青稞酒	23,400	408,564.00	0.89
75	600449	宁夏建材	42,500	408,425.00	0.89
76	600022	山东钢铁	197,990	407,859.40	0.89
77	601001	大同煤业	77,600	407,400.00	0.89
78	600765	中航重机	29,500	406,510.00	0.89
79	600881	亚泰集团	79,800	405,384.00	0.88
80	601288	农业银行	114,800	404,096.00	0.88
81	600118	中国卫星	14,500	403,680.00	0.88
82	601988	中国银行	109,100	403,670.00	0.88
83	601800	中国交建	25,400	403,606.00	0.88
84	600157	永泰能源	112,800	402,696.00	0.88
85	000418	小天鹅A	8,600	402,394.00	0.88
86	600010	宝钢股份	183,300	401,427.00	0.88

87	002051	中工国际	19,320	400,503.60	0.87
88	002570	贝因美	29,400	399,840.00	0.87
89	601668	中国建筑	41,300	399,784.00	0.87
90	002304	洋河股份	4,600	399,326.00	0.87
91	601328	交通银行	64,700	398,552.00	0.87
92	601669	中国电建	50,000	396,000.00	0.86
93	601939	建设银行	64,300	395,445.00	0.86
94	601186	中国铁建	32,600	392,178.00	0.86
95	000778	新兴铸管	57,900	387,930.00	0.85
96	600519	贵州茅台	800	377,480.00	0.82
97	002508	老板电器	8,100	352,188.00	0.77
98	601101	昊华能源	41,800	342,760.00	0.75
99	601390	中国中铁	39,300	340,731.00	0.74
100	000709	河钢股份	81,000	339,390.00	0.74
101	000401	冀东水泥	21,200	326,268.00	0.71

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	601808	中海油服	748,033.00	1.35
2	600583	海油工程	634,034.00	1.14
3	600759	洲际油气	611,203.06	1.10
4	601857	中国石油	591,038.00	1.06
5	600688	上海石化	590,740.00	1.06

6	002476	宝莫股份	559,256.00	1.01
7	002493	荣盛石化	551,983.98	0.99
8	600391	航发科技	550,005.00	0.99
9	600500	中化国际	542,596.00	0.98
10	600677	航天通信	541,063.00	0.97
11	002648	卫星石化	540,593.53	0.97
12	000901	航天科技	539,800.77	0.97
13	600893	航发动力	533,571.00	0.96
14	600256	广汇能源	532,402.00	0.96
15	600316	洪都航空	531,928.00	0.96
16	600175	美都能源	527,440.00	0.95
17	002179	中航光电	527,313.00	0.95
18	000738	中航动控	525,687.00	0.95
19	600038	中直股份	525,197.00	0.95
20	600343	航天动力	523,338.40	0.94

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	600459	贵研铂业	1,828,828.04	3.29
2	600019	宝钢股份	1,227,554.32	2.21
3	000975	银泰资源	1,059,262.00	1.91
4	600456	宝钛股份	881,932.36	1.59
5	600547	山东黄金	816,924.32	1.47
6	601899	紫金矿业	696,531.36	1.25

7	601808	中海油服	690,472.18	1.24
8	601009	南京银行	666,306.05	1.20
9	600609	金杯汽车	642,392.00	1.16
10	600298	安琪酵母	635,725.00	1.14
11	300015	爱尔眼科	632,802.32	1.14
12	601088	中国神华	597,456.00	1.08
13	600688	上海石化	590,457.00	1.06
14	601857	中国石油	571,311.00	1.03
15	002648	卫星石化	569,265.08	1.03
16	600583	海油工程	564,518.06	1.02
17	600104	上汽集团	559,214.34	1.01
18	000983	西山煤电	551,413.94	0.99
19	600489	中金黄金	550,657.12	0.99
20	002128	露天煤业	540,599.16	0.97

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	56,564,120.10
卖出股票收入（成交）总额	66,780,690.80

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	17,699.98
2	应收证券清算款	45,571.29
3	应收股利	-
4	应收利息	571.22
5	应收申购款	99.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	63,942.34

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	300088	长信科技	952,315.00	2.08	重大资产重组
2	600559	老白干酒	593,978.00	1.30	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
1,179	41,921.07	0.00	0.00%	49,424,936.50	100.00%

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	104.08	0.00%

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

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

基金合同生效日（2015 年 12 月 10 日）基金份额总额	280,373,902.08
本报告期期初基金份额总额	60,274,505.95
本报告期基金总申购份额	1,164,508.70
减：本报告期基金总赎回份额	12,014,078.15
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	49,424,936.50

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

本基金投资策略没有发生改变。

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		股票交易	应支付该券商的佣金	

	交易单元 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	备注
山西证券	1	46,280,561.90	37.54%	33,844.63	37.03%	-
华安证券	1	28,873,291.31	23.42%	21,115.12	23.10%	-
华泰证券	1	23,933,401.34	19.41%	17,502.44	19.15%	-
光大证券	1	18,007,272.13	14.61%	13,168.58	14.41%	-
招商证券	2	6,182,385.02	5.02%	5,757.31	6.30%	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中投证券	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。

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

本基金本报告期内租用证券公司交易单元未进行其他证券投资。

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	前海开源强势共识 100 强等权重股票型证券投资基金 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	前海开源强势共识 100 强等权重股票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 23 日
5	前海开源强势共识 100 强等权重股票型证券投资基金招募说明书（更新）	基金管理人的官方网站	2017 年 1 月 23 日
6	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
7	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金继续参与交通银行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调整的公告	证券日报、基金管理人的官方网站	2017 年 2 月 24 日

9	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 3 月 23 日
10	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
11	前海开源强势共识 100 强等权重股票型证券投资基金 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
12	前海开源强势共识 100 强等权重股票型证券投资基金 2016 年年度报告	基金管理人的官方网站	2017 年 3 月 30 日
13	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金继续参与中国工商银行申购费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人的官方网站	2017 年 3 月 31 日
14	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
15	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
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 19 日
17	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	证券日报、基金管理人的官方网站	2017 年 4 月 20 日

	方法的提示性公告		
18	前海开源强势共识 100 强等权重股票型证券投资基金 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
19	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金继续参与交通银行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 24 日
20	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
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 9 日
22	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 11 日
23	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
24	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
25	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
26	前海开源基金管理有限公司关于广发证券费率调整的公告	证券日报、基金管理人的官方网站	2017 年 5 月 15 日
27	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

28	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
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 5 月 24 日
30	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
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 2 日
32	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
33	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
34	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
35	前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金在华泰证券开通转换业务的公告	证券日报、基金管理人的官方网站	2017 年 6 月 29 日
36	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	证券日报、基金管理人的官方网站	2017 年 6 月 29 日

	销机构及开通定投业务并参与其费率优惠活动的公告		
--	-------------------------	--	--

§ 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

无。

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强势共识 100 强等权重股票型证券投资基金设立的文件

(2) 《前海开源强势共识 100 强等权重股票型证券投资基金基金合同》

(3) 《前海开源强势共识 100 强等权重股票型证券投资基金托管协议》

(4) 《前海开源强势共识 100 强等权重股票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) 前海开源强势共识 100 强等权重股票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