

# 前海开源新经济灵活配置混合型证券投资基金

## 2017 年年度报告

2017 年 12 月 31 日

基金管理人:前海开源基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

送出日期:2018 年 03 月 29 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 2018 年 3 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中的财务资料已经审计。瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2017 年 01 月 01 日起至 2017 年 12 月 31 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                                 | 5  |
| 2.1 基金基本情况                              | 5  |
| 2.2 基金产品说明                              | 5  |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 7  |
| 2.4 信息披露方式                              | 7  |
| 2.5 其他相关资料                              | 7  |
| §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况                 | 7  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 8  |
| 3.2 基金净值表现                              | 8  |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况                       | 10 |
| §4 管理人报告                                | 10 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 10 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 11 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 12 |
| 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             | 12 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 13 |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况                 | 14 |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 14 |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 15 |
| 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明       | 15 |
| §5 托管人报告                                | 15 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 15 |
| 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 | 15 |
| 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见       | 15 |
| §6 审计报告                                 | 15 |
| 6.1 审计报告基本信息                            | 16 |
| 6.2 审计报告的基本内容                           | 16 |
| §7 年度财务报表                               | 18 |
| 7.1 资产负债表                               | 18 |
| 7.2 利润表                                 | 20 |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表                      | 22 |
| 7.4 报表附注                                | 23 |
| §8 投资组合报告                               | 48 |
| 8.1 期末基金资产组合情况                          | 49 |
| 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 49 |
| 8.3 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       | 50 |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 53 |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 57 |
| 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细      | 57 |
| 8.7 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   | 57 |
| 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细   | 57 |
| 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细      | 57 |
| 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明               | 57 |

|   |    |
|---|----|
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....          | 57 |
| 8.12 投资组合报告附注.....                      | 58 |
| §9 基金份额持有人信息.....                       | 59 |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....              | 59 |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....           | 59 |
| 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....   | 59 |
| §10 开放式基金份额变动.....                      | 59 |
| §11 重大事件揭示.....                         | 59 |
| 11.1 基金份额持有人大会决议.....                   | 59 |
| 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....   | 59 |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....        | 60 |
| 11.4 基金投资策略的改变.....                     | 60 |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....              | 60 |
| 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....      | 60 |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....             | 60 |
| 11.8 其他重大事件.....                        | 62 |
| §12 影响投资者决策的其他重要信息.....                 | 70 |
| 12.1 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..... | 70 |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....                | 71 |
| §13 备查文件目录.....                         | 71 |
| 13.1 备查文件目录.....                        | 71 |
| 13.2 存放地点.....                          | 71 |
| 13.3 查阅方式.....                          | 71 |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                      |
|------------|----------------------|
| 基金名称       | 前海开源新经济灵活配置混合型证券投资基金 |
| 基金简称       | 前海开源新经济混合            |
| 基金主代码      | 000689               |
| 基金运作方式     | 契约型开放式               |
| 基金合同生效日    | 2014年08月20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 | 332,687,650.51份      |
| 基金合同存续期    | 不定期                  |

### 2.2 基金产品说明

|      |  |
|------|--|
| 投资目标 | <p>本基金主要通过精选投资与新经济相关的优质证券，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。新经济是指以知识、制度创新为支柱的经济发展方向，不仅仅是经济总量的增长，更包括素质提高、体制改革和福利增长。新经济涵盖新能源、新材料、新海洋、新TMT、新生物、新制造、新技术等各新兴行业的发展。</p>  |
| 投资策略 | <p>本基金的投资策略主要有以下五方面内容：</p> <p>1、大类资产配置：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，对宏观经济因素进行充分研究，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评估，制定本基金在股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例，根据其参与市场基本要素的变动，调整各类资产在基金投资组合中的比例。</p> <p>2、股票投资策略：本基金采取自上而下的宏观分析和自下而上精选个股的投资策略。首先对新经济相关行业进行重点关注，然后自下而上精选代表产业发展的新经济类型的典型上市公司，构建核心股票池，再通过本基金已有的个股筛选打分体系，构建投资组</p> |

|        |   |
|--------|---|
|        | <p>合，其后根据具体情况的变化，调整投资组合，以期追求超额收益。</p> <p>3、债券投资策略：在债券投资策略方面，本基金将以新经济相关债券为主线，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。在宏观环境分析方面，结合对宏观经济、市场利率、债券供求等因素的综合分析，确定不同类属资产的最优权重。在微观市场定价分析方面，本基金以中长期利率趋势分析为基础，结合经济趋势、货币政策及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，重点选择那些流动性较好、风险水平合理、到期收益率与信用质量相对较高的债券品种。具体投资策略有收益率曲线策略、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：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、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。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，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。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 | $\text{沪深300指数收益率} \times 70\% + \text{中证全债指数收益率} \times 30\%。$   |
| 风险收益特征 | <p>本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益水</p>  |

|  |                         |
|--|-------------------------|
|  | 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                            | 中国工商银行股份有限公司        |
| 信息披露<br>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5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5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      | 中国证券报、上海证券报、证券时报 |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | www.qhkyfund.com |
| 基金年度报告备置地点          | 基金管理人、基金托管人处     |

### 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称               | 办公地址                             |
|--------|------------------|----------------------------------|
| 会计师事务所 | 瑞华会计师事务所（特殊普通合伙） | 北京市东城区永定门西滨河路8号院7号楼中海地产广场西塔5-11层 |
| 注册登记机构 | 前海开源基金管理有限公司     | 深圳市福田区深南大道7006号万科富春东方大厦2206      |

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

|                      |                |                |                |
|----------------------|----------------|----------------|----------------|
| <b>3.1.1 期间数据和指标</b> | 2017年          | 2016年          | 2015年          |
| 本期已实现收益              | 27,448,398.74  | -29,991,670.59 | 49,758,594.12  |
| 本期利润                 | 39,030,075.85  | -39,282,554.64 | 28,471,834.04  |
| 加权平均基金份额本期利润         | 0.1271         | -0.1581        | 0.1159         |
| 本期加权平均净值利润率          | 10.68%         | -13.96%        | 9.11%          |
| 本期基金份额净值增长率          | 11.65%         | -12.74%        | 6.44%          |
| <b>3.1.2 期末数据和指标</b> | 2017年末         | 2016年末         | 2015年末         |
| 期末可供分配利润             | 32,516,943.86  | 20,147,011.07  | 58,327,267.38  |
| 期末可供分配基金份额利润         | 0.0977         | 0.0819         | 0.2400         |
| 期末基金资产净值             | 365,204,594.37 | 266,199,307.93 | 301,353,262.29 |
| 期末基金份额净值             | 1.098          | 1.082          | 1.240          |
| <b>3.1.3 累计期末指标</b>  | 2017年末         | 2016年末         | 2015年末         |
| 基金份额累计净值增长率          | 20.70%         | 8.20%          | 24.00%         |

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    |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月 | -1.87%   | 0.47%       | 3.35%      | 0.56%         | -5.22% | -0.09% |
| 过去六个月 | 1.60%    | 0.54%       | 6.88%      | 0.49%         | -5.28% | 0.05%  |
| 过去一年  | 11.55%   | 0.64%       | 14.79%     | 0.45%         | -3.24% | 0.19%  |



|            |        |       |        |       |         |       |
|------------|--------|-------|--------|-------|---------|-------|
| 过去三年       | 3.61%  | 1.23% | 15.55% | 1.18% | -11.94% | 0.05% |
| 自基金合同生效起至今 | 20.70% | 1.23% | 55.34% | 1.17% | -34.64% | 0.06% |

注：本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×70%+中证全债指数收益率×30%。

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



### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金的基金合同于2014年8月20日生效，2014年本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率按本基金实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

| 年度    | 每10份基金份额分红数 | 现金形式发放总额      | 再投资形式发放总额  | 年度利润分配合计      | 备注 |
|-------|-------------|---------------|------------|---------------|----|
| 2015年 | -           | -             | -          | -             | -  |
| 2016年 | -           | -             | -          | -             | -  |
| 2017年 | 1.10        | 36,252,753.66 | 299,908.89 | 36,552,662.55 | -  |
| 合计    | 1.10        | 36,252,753.66 | 299,908.89 | 36,552,662.55 | -  |

## § 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64只开放式基金，资产管理规模超过529亿元。

#### 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 |        |   |
| 丁骏 | 本基金的基金经理、公司联席投资总监 | 2014-08-20      | -    | 15年    | 丁骏先生，博士研究生。历任中国建设银行浙江省分行国际业务部本外币交易员、经济师，国泰君安证券股份有限公司企业融资部业务经理、高级经理，长盛基金管理有限公司研究发展部行业研究员、机构理财部组合经理助理，基金同盛、长盛同智基金经理。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。 |

注：①对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期，对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金

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

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（2011 年修订）的规定，针对股票市场、债券市场交易等投资管理活动，以及授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动相关的各个环节，制定了《前海开源基金管理有限公司公平交易管理办法》、《前海开源基金管理有限公司异常交易监控管理办法》等公平交易相关的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执行的内部控制，完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017年A股市场整体上呈现价值股和概念股两极分化的走势。前者受到投资者认同追捧，后者泡沫破裂一路下跌。以上证50指数为代表的价值股在2017年上涨了25.08%，而同期创业板指数则在2016年下跌20.35%的基础上，2017年再次下跌15.32%，两者表现天差地别，一定程度上反应了整个市场投资理念的默默演变。公司的价值成为投资的优先考虑要素，炒作的风气逐渐远去。

如上所述，2017年的投资主线是随着宏观经济变化中把握上市公司和行业板块的盈利能力变动趋势。本基金在年初就根据这一思路比较早的锁定了有良好发展预期的电子信息产业方向，重点布局了苹果产业链、新能源车等投资标的，取得了相对较好的投资回报。本基金合同约定了本基金的主要投资方向集中在国防军工、TMT行业、新能源、新技术等细分领域，相信这些领域在未来我国经济结构调整的过程中依然会有很多的投资机会涌现。

2018年，本基金将会继续秉持产品约定的投资方向，采取稳健的投资策略，在兼顾组合的进攻性和防御性前提下，守中带攻。在当期宏观经济实际情况和市场趋势演化过程中，我们将选择符合国家经济发展战略方向的新经济领域内优势行业进行投资，围绕景气度提高、基本面扎实和成长性良好的优质个股进行布局，力争为投资者带来稳定的投资回报。具体而言，我们在2018年优先配置的行业及板块主要有资源股、军工股、新金融类股及其他部分优质大盘蓝筹股。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末前海开源新经济混合基金份额净值为1.098元；本报告期内，基金份额净值增长率为11.55%，同期业绩比较基准收益率为14.79%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2018年，随着全球经济的复苏，国内宏观经济也将逐步走出低谷，全年实际GDP增速可能小幅回升，但经济结构将进一步优化。需要注意的新关键词主要有“美联储进入加息周期”、“我国供给侧改革的持续”、“中美贸易摩擦”、“金融去杠杆”。

宏观经济对市场的不利影响将淡化，随着经济回升和市场泡沫逐步出清，我们相信市场在2018年能够在前期上涨基础上保持稳定。在大类资产的投资机会来看，房地产、债券、大宗商品和股市中，我们认为大宗商品和股市都有投资机会。当然，需要密切关注的经济指标主要包括原油价格变动、国内PPI及CPI的变动，如果这些因素出现预期外的上涨，我们要审慎考虑其对市场的连锁反应冲击。

在行业走势方面，2018年我们重点关注并优先配置包括能源类板块、军工行业、新金融类板块和其他部分优质大盘蓝筹股。以军工行业为例，在当前国际局势变化中，军工企业是我们面对复杂局势的定海神针，而且多年的技术引进消化和自我革新也带来了军工企业脱胎换骨的时机，整个行业的后续改革和厚积薄发也将在2018年拉开序幕。受制于2017年的市场对企业盈利的严苛要求，军工股在2017年的表现只是昙花一现。我们相信，2018年军工股会有更好的投资机会。

2018年，我们认为A股市场将继续震荡向上，但是震荡的幅度可能会加大。基于这一判断，我们认为2018年A股市场存在较好的结构性投资机会，本基金将精选个股并在适宜的价格投资布局，争取能获取较好的投资收益。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益的角度出发，依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。公司监察稽核部门按照规定的权限和程序，通过实时监控、现场检查、重点抽查和人员询问等方法，独立地开展基金运作和公司管理的合规性稽核，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事会和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，本基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

(1) 本年度，我公司采取外聘律师和内部专业人士相结合的方式，对各业务部门进行了相关法律法规培训和职业道德培训，进一步提高了我公司从业人员的合规素质和职业道德修养。

(2) 本年度，我公司按照证监会的要求对公司治理、投资、研究、交易、基金会计、注册登记、人力资源、基金销售等主要业务进行定期稽核工作。同时，对信息技术、用户权限、通信管理与视频监控、基金直销、后台运营、内幕交易防控等相关业务开展了专项稽核工作，检查业务开展的合规性和制度执行的有效性等。

(3) 通过事前合规防范、事中系统控制、事后完善纠偏的方式，全面加强了对公司产品日常投资运作的管理与监控，保证投资符合既定的投资决策程序与业务流程，基金投资组合及个股投资符合比例控制的要求，严格执行分级授权制度，保证基金投资独立、公平。

(4) 全面参与新产品设计、新业务拓展工作，负责日常合同审查，监督客户投诉处理。积极参与证监会新规定出台前的讨论并提出修改建议。

(5) 完成各基金及公司的各项信息披露工作，保证所披露信息的真实性、准确性和完整性；重视媒体监督和投资者关系管理工作。

(6) 按照规定向人民银行报送反洗钱相关报表和报告，按监管要求制定客户洗钱风险划分的标准，并升级了客户洗钱风险划分系统。

本基金管理人承诺将依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设有估值委员会，负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指

导和监督整个估值流程。估值委员会由执行董事长、督察长、基金核算部、基金事务部、研究部、投资部、监察稽核部、金融工程部、交易部负责人及其他指定相关人员组成。估值委员会成员均具备专业胜任能力和相关从业资格，精通各自领域的理论知识，熟悉相关政策法规，并具有丰富的实践经验。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供固定收益品种的估值数据。

本基金本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内实施利润分配一次，每10份基金份额分配1.10元，共分配利润36,552,662.55元。

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

本基金本报告期内，未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

### § 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新经济混合的托管过程中，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，前海开源新经济混合的管理人——前海开源基金管理有限公司在前海开源新经济混合的投资运作、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，前海开源新经济混合未进行利润分配。

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

本托管人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新经济混合2017年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 审计报告

## 6.1 审计报告基本信息

|            |                     |
|------------|---------------------|
| 财务报表是否经过审计 | 是                   |
| 审计意见类型     | 标准无保留意见             |
| 审计报告编号     | 瑞华审字【2018】48460097号 |

## 6.2 审计报告的基本内容

|           |  |
|-----------|--|
| 审计报告标题    | 审计报告   |
| 审计报告收件人   | 前海开源新经济灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人  |
| 审计意见      | 我们审计了前海开源新经济灵活配置混合型证券投资基金的财务报表，包括2017年12月31日的资产负债表，2017年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了前海开源新经济灵活配置混合型证券投资基金2017年12月31日的财务状况以及2017年度的经营成果和基金净值变动情况。 |
| 形成审计意见的基础 | 我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于前海开源新经济灵活配置混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。  |
| 强调事项      | 无  |
| 其他事项      | 无  |
| 其他信息      | 无  |



|                        |   |
|------------------------|---|
| <p>管理层和治理层对财务报表的责任</p> | <p>前海开源新经济灵活配置混合型证券投资基金的基金管理人前海开源基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估前海开源新经济灵活配置混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算前海开源新经济灵活配置混合型证券投资基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督前海开源新经济灵活配置混合型证券投资基金的财务报告过程。</p>  |
| <p>注册会计师对财务报表审计的责任</p> | <p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：（一）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。（二）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制</p> |

|           |   |
|-----------|---|
|           | <p>的有效性发表意见。（三）评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。（四）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对前海开源新经济灵活配置混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致前海开源新经济灵活配置混合型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>（五）评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p> |
| 会计师事务所的名称 | 瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）  |
| 注册会计师的姓名  | 邢向宗 刘昕  |
| 会计师事务所的地址 | 北京市东城区永定门西滨河路8号院7号楼中海地产广场西塔5-11层  |
| 审计报告日期    | 2018-03-23  |

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：前海开源新经济灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017年12月31日

单位：人民币元

| 资产  | 附注号 | 本期末<br>2017年12月31日 | 上年度末<br>2016年12月31日 |
|-----|-----|--------------------|---------------------|
| 资产： |     |                    |                     |

|                 |            |                            |                             |
|-----------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 银行存款            | 7.4.7.1    | 143,274,380.02             | 39,815,831.19               |
| 结算备付金           |            | 803,083.81                 | 1,556,739.90                |
| 存出保证金           |            | 193,463.91                 | 229,658.93                  |
| 交易性金融资产         | 7.4.7.2    | 212,071,784.17             | 233,829,453.44              |
| 其中：股票投资         |            | 212,071,784.17             | 233,829,453.44              |
| 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          | 7.4.7.3    | -                          | -                           |
| 买入返售金融资产        | 7.4.7.4    | -                          | -                           |
| 应收证券清算款         |            | 10,370,858.60              | -                           |
| 应收利息            | 7.4.7.5    | 26,697.05                  | 9,171.53                    |
| 应收股利            |            | -                          | -                           |
| 应收申购款           |            | 17,954.97                  | 99.85                       |
| 递延所得税资产         |            | -                          | -                           |
| 其他资产            | 7.4.7.6    | -                          | -                           |
| 资产总计            |            | 366,758,222.53             | 275,440,954.84              |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2017年12月31日</b> | <b>上年度末<br/>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          | 7.4.7.3    | -                          | -                           |
| 卖出回购金融资产款       |            | -                          | -                           |
| 应付证券清算款         |            | 281,094.50                 | 3,432,262.38                |
| 应付赎回款           |            | 20,727.28                  | 4,562,721.40                |
| 应付管理人报酬         |            | 468,930.61                 | 349,086.25                  |
| 应付托管费           |            | 78,155.12                  | 58,181.05                   |
| 应付销售服务费         |            | -                          | -                           |
| 应付交易费用          | 7.4.7.7    | 154,709.18                 | 383,663.90                  |

|               |              |                |                |
|---------------|--------------|----------------|----------------|
| 应交税费          |              | -              | -              |
| 应付利息          |              | -              | -              |
| 应付利润          |              | -              | -              |
| 递延所得税负债       |              | -              | -              |
| 其他负债          | 7.4.7.8      | 550,011.47     | 455,731.93     |
| 负债合计          |              | 1,553,628.16   | 9,241,646.91   |
| <b>所有者权益:</b> |              |                |                |
| 实收基金          | 7.4.7.9      | 332,687,650.51 | 246,052,296.86 |
| 未分配利润         | 7.4.7.1<br>0 | 32,516,943.86  | 20,147,011.07  |
| 所有者权益合计       |              | 365,204,594.37 | 266,199,307.93 |
| 负债和所有者权益总计    |              | 366,758,222.53 | 275,440,954.84 |

注：报告截止日2017年12月31日，前海开源新经济基金份额净值1.098元，基金份额总额332,687,650.51份。

## 7.2 利润表

会计主体：前海开源新经济灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017年01月01日至2017年12月31日

单位：人民币元

| 项目          | 附注号          | 本期2017年01月01日至2017年12月31日 | 上年度可比期间2016年01月01日至2016年12月31日 |
|-------------|--------------|---------------------------|--------------------------------|
| <b>一、收入</b> |              | 47,913,918.02             | -29,139,286.60                 |
| 1. 利息收入     |              | 863,662.85                | 925,212.15                     |
| 其中：存款利息收入   | 7.4.7.1<br>1 | 850,512.16                | 925,212.15                     |
| 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  |              | 13,150.69                 | -                              |
| 其他利息收入      |              | -                         | -                              |

|                        |                |               |                |
|------------------------|----------------|---------------|----------------|
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |                | 35,397,665.90 | -20,803,525.47 |
| 其中：股票投资收益              | 7.4.7.1<br>2   | 32,112,974.30 | -21,582,787.87 |
| 基金投资收益                 | 7.4.7.1<br>3   | -             | -              |
| 债券投资收益                 | 7.4.7.1<br>4   | -             | -              |
| 资产支持证券投资收益             | 7.4.7.1<br>4.5 | -             | -              |
| 贵金属投资收益                | 7.4.7.1<br>5   | -             | -              |
| 衍生工具收益                 | 7.4.7.1<br>6   | -             | -              |
| 股利收益                   | 7.4.7.1<br>7   | 3,284,691.60  | 779,262.40     |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.1<br>8   | 11,581,677.11 | -9,290,884.05  |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）     |                | -             | -              |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）     | 7.4.7.1<br>9   | 70,912.16     | 29,910.77      |
| <b>减：二、费用</b>          |                | 8,883,842.17  | 10,143,268.04  |
| 1. 管理人报酬               | 7.4.10.<br>2.1 | 5,422,037.76  | 4,218,158.38   |
| 2. 托管费                 | 7.4.10.<br>2.2 | 903,672.93    | 703,026.45     |
| 3. 销售服务费               | 7.4.10.<br>2.3 | -             | -              |
| 4. 交易费用                | 7.4.7.2<br>0   | 2,187,237.53  | 4,852,131.60   |
| 5. 利息支出                |                | -             | -              |

|                     |              |               |                |
|---------------------|--------------|---------------|----------------|
| 其中: 卖出回购金融资产支出      |              | -             | -              |
| 6. 其他费用             | 7.4.7.2<br>1 | 370,893.95    | 369,951.61     |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) |              | 39,030,075.85 | -39,282,554.64 |
| 减: 所得税费用            |              | -             | -              |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列)   |              | 39,030,075.85 | -39,282,554.64 |

### 7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 前海开源新经济灵活配置混合型证券投资基金

本报告期: 2017年01月01日至2017年12月31日

单位: 人民币元

| 项 目                                    | 本期<br>2017年01月01日至2017年12月31日 |                |                |
|--|-------------------------------|----------------|----------------|
|  | 实收基金                          | 未分配利润          | 所有者权益合计        |
| 一、期初所有者权益(基金净值)                        | 246,052,296.86                | 20,147,011.07  | 266,199,307.93 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -                             | 39,030,075.85  | 39,030,075.85  |
| 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)      | 86,635,353.65                 | 9,892,519.49   | 96,527,873.14  |
| 其中: 1. 基金申购款                           | 124,350,978.73                | 15,843,717.44  | 140,194,696.17 |
| 2. 基金赎回款                               | -37,715,625.08                | -5,951,197.95  | -43,666,823.03 |
| 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) | -                             | -36,552,662.55 | -36,552,662.55 |
| 五、期末所有者权益(基金净值)                        | 332,687,650.51                | 32,516,943.86  | 365,204,594.37 |
| 项 目                                    | 上年度可比期间                       |                |                |

|  | 2016年01月01日至2016年12月31日 |                |                |
|--|-------------------------|----------------|----------------|
|  | 实收基金                    | 未分配利润          | 所有者权益合计        |
| 一、期初所有者权益(基金净值)                        | 243,025,994.91          | 58,327,267.38  | 301,353,262.29 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -                       | -39,282,554.64 | -39,282,554.64 |
| 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)      | 3,026,301.95            | 1,102,298.33   | 4,128,600.28   |
| 其中：1. 基金申购款                            | 14,634,088.48           | 2,482,052.48   | 17,116,140.96  |
| 2. 基金赎回款                               | -11,607,786.53          | -1,379,754.15  | -12,987,540.68 |
| 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)                        | 246,052,296.86          | 20,147,011.07  | 266,199,307.93 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

蔡颖

何隽

傅智

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

前海开源新经济灵活配置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】560号文《关于核准前海开源新经济灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》，由前海开源基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《前海开源新经济灵活配置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2014年7月21日至2014年8月15日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集654,490,970.93元，经瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）瑞华验字[2014]02030028号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《前海开源新经济灵活配置混合型证券投资

基金基金合同》于2014年8月20日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为654,678,057.66份基金份额，其中认购资金利息折合187,086.73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。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。



本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交

易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理费和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为6次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的30%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；

(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时

的交易不活跃)等情况,本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》,根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2)于2017年12月25日前,对于在锁定期内的非公开发行股票,根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》,若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本,按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值;若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本,按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。自2017年12月25日起,对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票,根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”),按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》,对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票,本基金自2017年12月25日起改为按估

值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。该估值技术变更使本基金2017年12月31日的基金资产净值及2017年度/会计期间净损益减少0.00元。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期未发生会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

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

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目           | 本期末<br>2017年12月31日 | 上年度末<br>2016年12月31日 |
|--------------|--------------------|---------------------|
| 活期存款         | 143,274,380.02     | 39,815,831.19       |
| 定期存款         | -                  | -                   |
| 其中：存款期限1-3个月 | -                  | -                   |
| 其他存款         | -                  | -                   |
| 合计           | 143,274,380.02     | 39,815,831.19       |

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            |       | 本期末2017年12月31日  |                |               |
|---------------|-------|-----------------|----------------|---------------|
|               |       | 成本              | 公允价值           | 公允价值变动        |
| 股票            |       | 209,886,985.30  | 212,071,784.17 | 2,184,798.87  |
| 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            |       | 209,886,985.30  | 212,071,784.17 | 2,184,798.87  |
| 项目            |       | 上年度末2016年12月31日 |                |               |
|               |       | 成本              | 公允价值           | 公允价值变动        |
| 股票            |       | 243,226,331.68  | 233,829,453.44 | -9,396,878.24 |
| 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     | 243,226,331.68 | 233,829,453.44 | -9,396,878.24 |

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2017年12月31日 | 上年度末<br>2016年12月31日 |
|------------|--------------------|---------------------|
| 应收活期存款利息   | 26,248.55          | 8,367.73            |
| 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  | 361.40             | 700.50              |
| 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         | 87.10              | 103.30              |
| 合计         | 26,697.05          | 9,171.53            |

注：“其他”为应收结算保证金利息。

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2017年12月31日 | 上年度末<br>2016年12月31日 |
|-------------|--------------------|---------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 154,709.18         | 383,663.90          |
| 银行间市场应付交易费用 | -                  | -                   |
| 合计          | 154,709.18         | 383,663.90          |

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2017年12月31日 | 上年度末<br>2016年12月31日 |
|-------------|--------------------|---------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                  | -                   |
| 应付赎回费       | 11.47              | 5,731.93            |
| 预提费用        | 550,000.00         | 450,000.00          |
| 合计          | 550,011.47         | 455,731.93          |

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期2017年01月01日至2017年12月31日 |                |
|---------------|---------------------------|----------------|
|               | 基金份额（份）                   | 账面金额           |
| 上年度末          | 246,052,296.86            | 246,052,296.86 |
| 本期申购          | 124,350,978.73            | 124,350,978.73 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -37,715,625.08            | -37,715,625.08 |



|     |                |                |
|-----|----------------|----------------|
| 本期末 | 332,687,650.51 | 332,687,650.51 |
|-----|----------------|----------------|

注：申购含红利再投、转换入份（金）额；赎回含转换出份（金）额。

#### 7.4.7.10 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           | 127,454,981.45 | -107,307,970.38 | 20,147,011.07  |
| 本期利润           | 27,448,398.74  | 11,581,677.11   | 39,030,075.85  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 43,648,540.57  | -33,756,021.08  | 9,892,519.49   |
| 其中：基金申购款       | 63,791,124.59  | -47,947,407.15  | 15,843,717.44  |
| 基金赎回款          | -20,142,584.02 | 14,191,386.07   | -5,951,197.95  |
| 本期已分配利润        | -36,552,662.55 | -               | -36,552,662.55 |
| 本期末            | 161,999,258.21 | -129,482,314.35 | 32,516,943.86  |

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期2017年01月01日至2017年12月31日 | 上年度可比期间2016年01月01日至2016年12月31日 |
|-----------|---------------------------|--------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 834,019.79                | 893,020.06                     |
| 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 | 10,664.70                 | 26,849.12                      |
| 其他        | 5,827.67                  | 5,342.97                       |
| 合计        | 850,512.16                | 925,212.15                     |

注：“其他”为申购款利息收入和结算保证金利息收入。

#### 7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2017年01月01日至2017年 | 上年度可比期间<br>2016年01月01日至2016年 |
|----|-------------------------|------------------------------|
|----|-------------------------|------------------------------|

|            | 12月31日         | 12月31日           |
|------------|----------------|------------------|
| 卖出股票成交总额   | 835,332,355.04 | 1,761,855,760.89 |
| 减：卖出股票成本总额 | 803,219,380.74 | 1,783,438,548.76 |
| 买卖股票差价收入   | 32,112,974.30  | -21,582,787.87   |

#### 7.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间内无基金投资收益。

#### 7.4.7.14 债券投资收益

##### 7.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期内及上年度可比期间内无债券投资收益。

##### 7.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间内无债券买卖差价收入。

##### 7.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间内无债券赎回差价收入。

##### 7.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间内无债券申购差价收入。

##### 7.4.7.14.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间内无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.15 贵金属投资收益

##### 7.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内及上年度可比期间内无贵金属投资收益。

**7.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

本基金本报告期内及上年度可比期间内无贵金属买卖差价收入。

**7.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期内及上年度可比期间内无贵金属赎回差价收入。

**7.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期内及上年度可比期间内无贵金属申购差价收入。

**7.4.7.16 衍生工具收益****7.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期内及上年度可比期间内无买卖权证差价收入。

**7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本基金本报告期内及上年度可比期间内无其他衍生工具投资收益。

**7.4.7.17 股利收益**

单位：人民币元

| 项目          | 本期<br>2017年01月01日至2017年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2016年01月01日至2016年<br>12月31日 |
|-------------|-----------------------------------|--|
| 股票投资产生的股利收益 | 3,284,691.60                      | 779,262.40                             |
| 基金投资产生的股利收益 | -                                 | -                                      |
| 合计          | 3,284,691.60                      | 779,262.40                             |

**7.4.7.18 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期<br>2017年01月01日至2017年 | 上年度可比期间<br>2016年01月01日至2016年 |
|------|-------------------------|------------------------------|
|------|-------------------------|------------------------------|

|            | 12月31日        | 12月31日        |
|------------|---------------|---------------|
| 1. 交易性金融资产 | 11,581,677.11 | -9,290,884.05 |
| ——股票投资     | 11,581,677.11 | -9,290,884.05 |
| ——债券投资     | -             | -             |
| ——资产支持证券投资 | -             | -             |
| ——基金投资     | -             | -             |
| ——贵金属投资    | -             | -             |
| ——其他       | -             | -             |
| 2. 衍生工具    | -             | -             |
| ——权证投资     | -             | -             |
| 3. 其他      | -             | -             |
| 合计         | 11,581,677.11 | -9,290,884.05 |

## 7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2017年01月01日至2017年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2016年01月01日至2016年<br>12月31日 |
|---------|-----------------------------------|--|
| 基金赎回费收入 | 69,605.51                         | 28,677.04                              |
| 基金转换费收入 | 1,306.65                          | 1,233.73                               |
| 合计      | 70,912.16                         | 29,910.77                              |

## 7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2017年01月01日至2017年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2016年01月01日至2016年<br>12月31日 |
|-----------|-----------------------------------|--|
| 交易所市场交易费用 | 2,187,237.53                      | 4,852,131.60                           |
| 银行间市场交易费用 | -                                 | -                                      |
| 合计        | 2,187,237.53                      | 4,852,131.60                           |

## 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

| 项目    | 本期<br>2017年01月01日至2017年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2016年01月01日至2016年<br>12月31日 |
|-------|-----------------------------------|--|
| 审计费用  | 50,000.00                         | 50,000.00                              |
| 信息披露费 | 300,000.00                        | 300,000.00                             |
| 汇划手续费 | 2,893.95                          | 1,951.61                               |
| 账户维护费 | 18,000.00                         | 18,000.00                              |
| 合计    | 370,893.95                        | 369,951.61                             |

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

## 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

## 7.4.8.2 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。

## 7.4.9 关联方关系

| 关联方名称                  | 与本基金的关系             |
|------------------------|---------------------|
| 前海开源基金管理有限公司（“前海开源基金”） | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国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           |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 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。

###### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行交易，无佣金产生。

###### 7.4.10.1.4 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 7.4.10.1.5 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2017年01月01日至201<br>7年12月31日 | 上年度可比期间<br>2016年01月01日至201<br>6年12月31日 |
|-----------------|-----------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 5,422,037.76                      | 4,218,158.38                           |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 14,127.51                         | 140,813.84                             |

注：本基金的管理费按前一日资产净值的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。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2017年01月01日至2017<br>年12月31日 | 上年度可比期间<br>2016年01月01日至2016<br>年12月31日 |
|----------------|-----------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 903,672.93                        | 703,026.45                             |

注：本基金的托管费按前一日资产净值的0.25%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管理费

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。

#### 7.4.10.2.3 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。

#### 7.4.10.3 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。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 7.4.10.4.2 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

本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 7.4.10.5 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01月01日至2017年<br>12月31日 |                | 2016年01月01日至2016年1<br>2月31日 |            |
|--------------|-----------------------------|----------------|-----------------------------|------------|
|              | 期末余额                        | 当期利息<br>收入     | 期末余额                        | 当期利息收<br>入 |
| 中国工商银行股份有限公司 | 143,274,38<br>0.02          | 834,019.7<br>9 | 39,815,831.<br>19           | 893,020.06 |

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。

#### 7.4.10.6 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。

#### 7.4.10.7 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。

#### 7.4.11 利润分配情况—非货币市场基金

单位：人民币元

| 序号 | 权益登记<br>日      | 除息日            | 每10份基<br>金<br>份额分红<br>数 | 现金形式<br>发放总额      | 再投资形<br>式发放总<br>额 | 本期利润<br>分配合计      | 备注 |
|----|----------------|----------------|-------------------------|-------------------|-------------------|-------------------|----|
| 1  | 2017-12-<br>01 | 2017-12-<br>01 | 1.100                   | 36,252,75<br>3.66 | 299,908.<br>89    | 36,552,66<br>2.55 | -  |
| 合计 |                |                | 1.100                   | 36,252,75<br>3.66 | 299,908.<br>89    | 36,552,66<br>2.55 | -  |

#### 7.4.12 期末（2017年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 7.4.12.1.1 受限证券类别：股票 |          |               |              |                |           |                |                  |                |                |    |
|----------------------|----------|---------------|--------------|----------------|-----------|----------------|------------------|----------------|----------------|----|
| 证券<br>代码             | 证券<br>名称 | 成功<br>认购<br>日 | 可流<br>通日     | 流通<br>受限<br>类型 | 认购<br>价格  | 期末<br>估值<br>单价 | 数量<br>(单<br>位：股) | 期末<br>成本<br>总额 | 期末<br>估值<br>总额 | 备注 |
| 0024<br>66           | 天齐<br>锂业 | 2017<br>-12-  | 2018<br>-01- | 配股<br>流通       | 11.0<br>6 | 53.2<br>1      | 1,815            | 20,0<br>73.9   | 96,5<br>76.1   | -  |



|        |      |            |            |        |       |       |       |           |           |   |
|--------|------|------------|------------|--------|-------|-------|-------|-----------|-----------|---|
|        |      | 26         | 03         | 受限     |       |       |       | 0         | 5         |   |
| 300664 | 鹏鹞环保 | 2017-12-28 | 2018-01-05 | 新股流通受限 | 8.88  | 8.88  | 3,640 | 32,323.20 | 32,323.20 | - |
| 603161 | 科华控股 | 2017-12-28 | 2018-01-05 | 新股流通受限 | 16.75 | 16.75 | 1,239 | 20,753.25 | 20,753.25 | - |
| 002923 | 润都股份 | 2017-12-28 | 2018-01-05 | 新股流通受限 | 17.01 | 17.01 | 954   | 16,227.54 | 16,227.54 | - |
| 603080 | 新疆火炬 | 2017-12-25 | 2018-01-03 | 新股流通受限 | 13.60 | 13.60 | 1,187 | 16,143.20 | 16,143.20 | - |

#### 7.4.12.2 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 |
|--------|------|------------|----------|--------|------------|--------|---------|-----------|-----------|----|
| 600485 | 信威集团 | 2016-12-26 | 重大资产重组   | 14.59  | -          | -      | 274,000 | 4,800.49  | 3,997.66  | -  |
| 002919 | 名臣健康 | 2017-12-28 | 股票交易异常波动 | 35.26  | 2018-01-02 | 38.79  | 821     | 10,311.76 | 28,948.46 | -  |

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2018年3月23日。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2017年12月31日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2017年12月31日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

#### 7.4.13 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。

##### 7.4.13.1 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次风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立监察及风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；本基金的基金管理人设立督察长制度，积极对公司各项制度、业务的合法合规性及内部控制制度的执行情况进行监察、稽核，定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部、金融工程部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

##### 7.4.13.2 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。

#### 7.4.13.2.1 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。

#### 7.4.13.2.2 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。

#### 7.4.13.3 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。

#### 7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股股票不超过该上市公司可流通股股票的 15%；本基金与由本基金的基金管理人管理的其他全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制），同时，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末2017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           | 143,274,380.02 | -    | -    | -   | 143,274,380.02 |
| 结算备付金          | 803,083.81     | -    | -    | -   | 803,083.81     |
| 存出保证金          | 193,463.91     | -    | -    | -   | 193,463.91     |

|                     |                    |      |          |                    |                    |
|---------------------|--------------------|------|----------|--------------------|--------------------|
| 交易性金融资产             | -                  | -    | -        | 212,071,78<br>4.17 | 212,071,78<br>4.17 |
| 应收证券清算款             | -                  | -    | -        | 10,370,858.<br>60  | 10,370,858.<br>60  |
| 应收利息                | -                  | -    | -        | 26,697.05          | 26,697.05          |
| 应收申购款               | -                  | -    | -        | 17,954.97          | 17,954.97          |
| 资产总计                | 144,270,92<br>7.74 | -    | -        | 222,487,29<br>4.79 | 366,758,22<br>2.53 |
| 负债                  |                    |      |          |                    |                    |
| 应付证券清算款             | -                  | -    | -        | 281,094.50         | 281,094.50         |
| 应付赎回款               | -                  | -    | -        | 20,727.28          | 20,727.28          |
| 应付管理人报酬             | -                  | -    | -        | 468,930.61         | 468,930.61         |
| 应付托管费               | -                  | -    | -        | 78,155.12          | 78,155.12          |
| 应付交易费用              | -                  | -    | -        | 154,709.18         | 154,709.18         |
| 其他负债                | -                  | -    | -        | 550,011.47         | 550,011.47         |
| 负债总计                | -                  | -    | -        | 1,553,628.1<br>6   | 1,553,628.1<br>6   |
| 利率敏感度缺口             | 144,270,92<br>7.74 | -    | -        | 220,933,66<br>6.63 | 365,204,59<br>4.37 |
| 上年度末2016年12<br>月31日 | 1年以内               | 1-5年 | 5年以<br>上 | 不计息                | 合计                 |
| 资产                  |                    |      |          |                    |                    |
| 银行存款                | 39,815,831.<br>19  | -    | -        | -                  | 39,815,831.<br>19  |
| 结算备付金               | 1,556,739.9<br>0   | -    | -        | -                  | 1,556,739.9<br>0   |
| 存出保证金               | 229,658.93         | -    | -        | -                  | 229,658.93         |
| 交易性金融资产             | -                  | -    | -        | 233,829,45<br>3.44 | 233,829,45<br>3.44 |
| 应收利息                | -                  | -    | -        | 9,171.53           | 9,171.53           |
| 应收申购款               | -                  | -    | -        | 99.85              | 99.85              |
| 资产总计                | 41,602,230.        | -    | -        | 233,838,72         | 275,440,95         |

|         |               |   |   |                |                |
|---------|---------------|---|---|----------------|----------------|
|         | 02            |   |   | 4.82           | 4.84           |
| 负债      |               |   |   |                |                |
| 应付证券清算款 | -             | - | - | 3,432,262.38   | 3,432,262.38   |
| 应付赎回款   | -             | - | - | 4,562,721.40   | 4,562,721.40   |
| 应付管理人报酬 | -             | - | - | 349,086.25     | 349,086.25     |
| 应付托管费   | -             | - | - | 58,181.05      | 58,181.05      |
| 应付交易费用  | -             | - | - | 383,663.90     | 383,663.90     |
| 其他负债    | -             | - | - | 455,731.93     | 455,731.93     |
| 负债总计    | -             | - | - | 9,241,646.91   | 9,241,646.91   |
| 利率敏感度缺口 | 41,602,230.02 | - | - | 224,597,077.91 | 266,199,307.93 |

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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

截至2017年12月31日，本基金未持有交易性债券投资（2016年12月31日：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2016年12月31日：同）。

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2017年12月31日 |                          | 上年度末<br>2016年12月31日 |                  |
|---------------|--------------------|--------------------------|---------------------|------------------|
|               | 公允价值               | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) | 公允价值                | 占基金资产净<br>值比例(%) |
| 交易性金融资产-股票投资  | 212,071,784.17     | 58.07                    | 233,829,453.44      | 87.84            |
| 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            | 212,071,784.17     | 58.07                    | 233,829,453.44      | 87.84            |

#### 7.4.13.4.3.2 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<br>2017年12月31日          | 上年度末<br>2016年12月31日 |
|    | 权益性投资的市场价格上升5%                        | 12,655,225.39               | 14,350,134.81       |
|    | 权益性投资的市场价格下降5%                        | -12,655,225.39              | -14,350,134.81      |

#### 7.4.14 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207,863,152.37元，属于第二层次的余额为4,208,631.80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226,427,762.58元，属于第二层次的余额为7,401,690.86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12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(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) 增值税

根据财政部、国家税务总局于2016年12月21日颁布的财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定：(1)金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2)纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。上述政策自2016年5月1日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于2017年1月10日颁布的财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及2017年6月30日颁布的财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。上述税收政策对本基金截至2017年12月31日止的财务状况和经营成果无影响。

## § 8 投资组合报告



## 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额             | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|----------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | 212,071,784.17 | 57.82         |
|    | 其中：股票             | 212,071,784.17 | 57.82         |
| 2  | 基金投资              | -              | -             |
| 3  | 固定收益投资            | -              | -             |
|    | 其中：债券             | -              | -             |
|    | 资产支持证券            | -              | -             |
| 4  | 贵金属投资             | -              | -             |
| 5  | 金融衍生品投资           | -              | -             |
| 6  | 买入返售金融资产          | -              | -             |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -              | -             |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 144,077,463.83 | 39.28         |
| 8  | 其他各项资产            | 10,608,974.53  | 2.89          |
| 9  | 合计                | 366,758,222.53 | 100.00        |

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

## 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）        | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|----------------|---------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -              | -             |
| B  | 采矿业              | 1,276,040.00   | 0.35          |
| C  | 制造业              | 160,778,570.23 | 44.02         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 16,143.20      | 0.00          |
| E  | 建筑业              | -              | -             |
| F  | 批发和零售业           | -              | -             |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 2,290,962.94   | 0.63          |
| H  | 住宿和餐饮业           | 2,998,589.00   | 0.82          |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 16,718,646.20  | 4.58          |

|   |               |                |       |
|---|---------------|----------------|-------|
| J | 金融业           | 27,960,509.40  | 7.66  |
| 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 | 32,323.20      | 0.01  |
| 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            | 212,071,784.17 | 58.07 |

### 8.2.2 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。

### 8.3 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  | 600038 | 中直股份 | 440,484   | 20,495,720.52 | 5.61         |
| 2  | 600563 | 法拉电子 | 366,063   | 18,599,661.03 | 5.09         |
| 3  | 600660 | 福耀玻璃 | 563,589   | 16,344,081.00 | 4.48         |
| 4  | 000768 | 中航飞机 | 845,800   | 14,285,562.00 | 3.91         |
| 5  | 601009 | 南京银行 | 1,533,840 | 11,871,921.60 | 3.25         |
| 6  | 002241 | 歌尔股份 | 554,104   | 9,613,704.40  | 2.63         |
| 7  | 600585 | 海螺水泥 | 321,500   | 9,429,595.00  | 2.58         |

|    |        |      |         |              |      |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 8  | 300258 | 精锻科技 | 609,400 | 9,134,906.00 | 2.50 |
| 9  | 600893 | 航发动力 | 312,200 | 8,401,302.00 | 2.30 |
| 10 | 000895 | 双汇发展 | 246,900 | 6,542,850.00 | 1.79 |
| 11 | 600816 | 安信信托 | 469,185 | 6,136,939.80 | 1.68 |
| 12 | 300059 | 东方财富 | 470,900 | 6,098,155.00 | 1.67 |
| 13 | 300408 | 三环集团 | 299,500 | 6,037,920.00 | 1.65 |
| 14 | 000776 | 广发证券 | 336,200 | 5,607,816.00 | 1.54 |
| 15 | 601689 | 拓普集团 | 216,200 | 5,348,788.00 | 1.46 |
| 16 | 002138 | 顺络电子 | 304,654 | 5,051,163.32 | 1.38 |
| 17 | 600485 | 信威集团 | 274,000 | 3,997,660.00 | 1.09 |
| 18 | 002174 | 游族网络 | 170,964 | 3,812,497.20 | 1.04 |
| 19 | 600570 | 恒生电子 | 77,900  | 3,614,560.00 | 0.99 |
| 20 | 002179 | 中航光电 | 86,000  | 3,386,680.00 | 0.93 |
| 21 | 002460 | 赣锋锂业 | 46,500  | 3,336,375.00 | 0.91 |
| 22 | 300115 | 长盈精密 | 159,300 | 3,197,151.00 | 0.88 |
| 23 | 300113 | 顺网科技 | 174,600 | 3,193,434.00 | 0.87 |
| 24 | 603160 | 汇顶科技 | 31,100  | 3,014,834.00 | 0.83 |

|    |        |      |         |              |      |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
|    |        |      |         | 0            |      |
| 25 | 600258 | 首旅酒店 | 111,100 | 2,998,589.00 | 0.82 |
| 26 | 601336 | 新华保险 | 41,700  | 2,927,340.00 | 0.80 |
| 27 | 002635 | 安洁科技 | 98,500  | 2,569,865.00 | 0.70 |
| 28 | 600009 | 上海机场 | 50,500  | 2,273,005.00 | 0.62 |
| 29 | 600741 | 华域汽车 | 73,000  | 2,167,370.00 | 0.59 |
| 30 | 300474 | 景嘉微  | 35,400  | 1,908,768.00 | 0.52 |
| 31 | 600089 | 特变电工 | 173,100 | 1,715,421.00 | 0.47 |
| 32 | 600990 | 四创电子 | 25,100  | 1,458,059.00 | 0.40 |
| 33 | 600958 | 东方证券 | 102,200 | 1,416,492.00 | 0.39 |
| 34 | 000968 | 蓝焰控股 | 76,000  | 1,276,040.00 | 0.35 |
| 35 | 300433 | 蓝思科技 | 38,100  | 1,137,285.00 | 0.31 |
| 36 | 002583 | 海能达  | 60,000  | 1,110,600.00 | 0.30 |
| 37 | 300097 | 智云股份 | 38,300  | 1,087,720.00 | 0.30 |
| 38 | 002466 | 天齐锂业 | 13,915  | 740,417.15   | 0.20 |
| 39 | 002916 | 深南电路 | 3,068   | 267,621.64   | 0.07 |
| 40 | 002920 | 德赛西威 | 4,569   | 178,784.97   | 0.05 |
| 41 | 300735 | 光弘科技 | 3,764   | 54,163.96    | 0.01 |
| 42 | 603477 | 振静股份 | 1,955   | 37,027.70    | 0.01 |

|    |        |      |       |           |      |
|----|--------|------|-------|-----------|------|
| 43 | 300664 | 鹏鹞环保 | 3,640 | 32,323.20 | 0.01 |
| 44 | 002919 | 名臣健康 | 821   | 28,948.46 | 0.01 |
| 45 | 002922 | 伊戈尔  | 1,245 | 22,248.15 | 0.01 |
| 46 | 603161 | 科华控股 | 1,239 | 20,753.25 | 0.01 |
| 47 | 603283 | 赛腾股份 | 1,349 | 19,614.46 | 0.01 |
| 48 | 603329 | 上海雅仕 | 1,183 | 17,957.94 | 0.00 |
| 49 | 002923 | 润都股份 | 954   | 16,227.54 | 0.00 |
| 50 | 603080 | 新疆火炬 | 1,187 | 16,143.20 | 0.00 |
| 51 | 300684 | 中石科技 | 827   | 11,528.38 | 0.00 |
| 52 | 603655 | 朗博科技 | 881   | 8,193.30  | 0.00 |

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计买入金额      | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------------|----------------|
| 1  | 600038 | 中直股份 | 31,266,110.34 | 11.75          |
| 2  | 000768 | 中航飞机 | 29,924,815.11 | 11.24          |
| 3  | 002241 | 歌尔股份 | 21,241,375.76 | 7.98           |
| 4  | 601288 | 农业银行 | 20,229,424.00 | 7.60           |
| 5  | 601818 | 光大银行 | 20,229,327.00 | 7.60           |
| 6  | 601939 | 建设银行 | 20,229,058.30 | 7.60           |
| 7  | 601169 | 北京银行 | 20,229,002.81 | 7.60           |
| 8  | 600000 | 浦发银行 | 20,228,727.76 | 7.60           |
| 9  | 002456 | 欧菲科技 | 19,635,430.98 | 7.38           |
| 10 | 600808 | 马钢股份 | 18,520,933.00 | 6.96           |
| 11 | 601800 | 中国交建 | 18,061,787.40 | 6.79           |
| 12 | 600183 | 生益科技 | 17,634,148.32 | 6.62           |
| 13 | 600563 | 法拉电子 | 17,180,652.79 | 6.45           |
| 14 | 002460 | 赣锋锂业 | 16,655,507.00 | 6.26           |
| 15 | 300433 | 蓝思科技 | 16,227,469.07 | 6.10           |
| 16 | 000807 | 云铝股份 | 15,585,893.00 | 5.85           |

|    |        |       |               |      |
|----|--------|-------|---------------|------|
| 17 | 601689 | 拓普集团  | 15,347,776.00 | 5.77 |
| 18 | 000776 | 广发证券  | 14,933,920.00 | 5.61 |
| 19 | 002466 | 天齐锂业  | 14,700,495.90 | 5.52 |
| 20 | 601211 | 国泰君安  | 13,759,834.00 | 5.17 |
| 21 | 600660 | 福耀玻璃  | 13,497,295.00 | 5.07 |
| 22 | 000725 | 京东方 A | 13,319,856.00 | 5.00 |
| 23 | 601009 | 南京银行  | 12,552,578.80 | 4.72 |
| 24 | 600816 | 安信信托  | 12,064,494.00 | 4.53 |
| 25 | 000065 | 北方国际  | 10,835,891.44 | 4.07 |
| 26 | 603328 | 依顿电子  | 10,440,182.25 | 3.92 |
| 27 | 600585 | 海螺水泥  | 9,974,864.73  | 3.75 |
| 28 | 300258 | 精锻科技  | 9,840,294.65  | 3.70 |
| 29 | 601688 | 华泰证券  | 9,327,163.00  | 3.50 |
| 30 | 600990 | 四创电子  | 9,312,131.12  | 3.50 |
| 31 | 002138 | 顺络电子  | 9,283,172.46  | 3.49 |
| 32 | 002475 | 立讯精密  | 9,237,341.70  | 3.47 |
| 33 | 600893 | 航发动力  | 9,212,951.00  | 3.46 |
| 34 | 600068 | 葛洲坝   | 9,065,451.00  | 3.41 |
| 35 | 603611 | 诺力股份  | 8,993,669.98  | 3.38 |
| 36 | 002594 | 比亚迪   | 8,958,719.00  | 3.37 |
| 37 | 601336 | 新华保险  | 8,896,878.39  | 3.34 |
| 38 | 600570 | 恒生电子  | 8,661,153.00  | 3.25 |
| 39 | 002440 | 闰土股份  | 8,526,711.00  | 3.20 |
| 40 | 600562 | 国睿科技  | 8,236,126.06  | 3.09 |
| 41 | 600703 | 三安光电  | 7,960,946.00  | 2.99 |
| 42 | 000895 | 双汇发展  | 7,900,441.00  | 2.97 |
| 43 | 601766 | 中国中车  | 7,222,403.00  | 2.71 |
| 44 | 002217 | 合力泰   | 7,051,586.00  | 2.65 |
| 45 | 600497 | 驰宏锌锗  | 6,660,030.00  | 2.50 |
| 46 | 300115 | 长盈精密  | 6,657,427.00  | 2.50 |
| 47 | 300408 | 三环集团  | 6,592,155.00  | 2.48 |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 48 | 300059 | 东方财富 | 6,055,489.00 | 2.27 |
| 49 | 600019 | 宝钢股份 | 6,025,205.00 | 2.26 |
| 50 | 600352 | 浙江龙盛 | 5,961,340.00 | 2.24 |
| 51 | 300058 | 蓝色光标 | 5,812,304.00 | 2.18 |
| 52 | 002174 | 游族网络 | 5,599,385.50 | 2.10 |
| 53 | 300319 | 麦捷科技 | 5,397,841.24 | 2.03 |

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

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计卖出金额      | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------------|----------------|
| 1  | 002456 | 欧菲科技 | 25,355,829.47 | 9.53           |
| 2  | 600816 | 安信信托 | 23,159,746.07 | 8.70           |
| 3  | 600000 | 浦发银行 | 19,968,470.12 | 7.50           |
| 4  | 601169 | 北京银行 | 19,826,969.49 | 7.45           |
| 5  | 601288 | 农业银行 | 19,805,422.00 | 7.44           |
| 6  | 002174 | 游族网络 | 19,751,599.80 | 7.42           |
| 7  | 601939 | 建设银行 | 19,725,963.00 | 7.41           |
| 8  | 601818 | 光大银行 | 19,670,444.00 | 7.39           |
| 9  | 000807 | 云铝股份 | 19,562,933.00 | 7.35           |
| 10 | 600183 | 生益科技 | 18,717,160.59 | 7.03           |
| 11 | 300433 | 蓝思科技 | 18,673,562.65 | 7.01           |
| 12 | 002460 | 赣锋锂业 | 18,439,484.60 | 6.93           |
| 13 | 002466 | 天齐锂业 | 17,874,810.53 | 6.71           |
| 14 | 600808 | 马钢股份 | 17,451,380.00 | 6.56           |
| 15 | 002241 | 歌尔股份 | 16,926,738.00 | 6.36           |
| 16 | 601800 | 中国交建 | 15,619,648.57 | 5.87           |
| 17 | 000725 | 京东方A | 14,953,978.12 | 5.62           |
| 18 | 002475 | 立讯精密 | 13,693,647.50 | 5.14           |
| 19 | 601211 | 国泰君安 | 13,585,162.96 | 5.10           |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 20 | 000768 | 中航飞机 | 13,516,071.69 | 5.08 |
| 21 | 000065 | 北方国际 | 12,418,095.71 | 4.66 |
| 22 | 600703 | 三安光电 | 11,889,459.42 | 4.47 |
| 23 | 600739 | 辽宁成大 | 11,715,282.49 | 4.40 |
| 24 | 600741 | 华域汽车 | 10,396,207.69 | 3.91 |
| 25 | 600699 | 均胜电子 | 10,373,692.03 | 3.90 |
| 26 | 000776 | 广发证券 | 10,099,858.00 | 3.79 |
| 27 | 600038 | 中直股份 | 10,057,746.98 | 3.78 |
| 28 | 002142 | 宁波银行 | 9,962,051.51  | 3.74 |
| 29 | 002217 | 合力泰  | 8,950,209.07  | 3.36 |
| 30 | 002440 | 闰土股份 | 8,942,870.00  | 3.36 |
| 31 | 600068 | 葛洲坝  | 8,789,658.46  | 3.30 |
| 32 | 603328 | 依顿电子 | 8,750,636.12  | 3.29 |
| 33 | 300348 | 长亮科技 | 8,744,580.40  | 3.28 |
| 34 | 002594 | 比亚迪  | 8,709,288.66  | 3.27 |
| 35 | 000826 | 启迪桑德 | 8,654,062.00  | 3.25 |
| 36 | 601689 | 拓普集团 | 8,651,758.00  | 3.25 |
| 37 | 601688 | 华泰证券 | 8,374,571.50  | 3.15 |
| 38 | 601009 | 南京银行 | 8,049,420.00  | 3.02 |
| 39 | 601336 | 新华保险 | 7,723,102.77  | 2.90 |
| 40 | 600562 | 国睿科技 | 7,549,400.00  | 2.84 |
| 41 | 603611 | 诺力股份 | 7,346,680.52  | 2.76 |
| 42 | 300058 | 蓝色光标 | 7,301,068.56  | 2.74 |
| 43 | 601766 | 中国中车 | 7,024,158.00  | 2.64 |
| 44 | 300298 | 三诺生物 | 6,478,966.37  | 2.43 |
| 45 | 600019 | 宝钢股份 | 6,407,834.55  | 2.41 |
| 46 | 600352 | 浙江龙盛 | 6,122,583.00  | 2.30 |
| 47 | 600990 | 四创电子 | 6,092,913.45  | 2.29 |
| 48 | 600585 | 海螺水泥 | 5,997,977.00  | 2.25 |
| 49 | 002433 | 太安堂  | 5,591,713.01  | 2.10 |
| 50 | 600967 | 内蒙一机 | 5,563,602.24  | 2.09 |



|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 51 | 002002 | 鸿达兴业 | 5,551,477.86 | 2.09 |
| 52 | 600570 | 恒生电子 | 5,439,168.00 | 2.04 |

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

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

|              |                |
|--------------|----------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 769,880,034.36 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 835,332,355.04 |

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

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

##### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

#### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

##### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额            |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 193,463.91    |
| 2  | 应收证券清算款 | 10,370,858.60 |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 26,697.05     |
| 5  | 应收申购款   | 17,954.97     |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 10,608,974.53 |

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数<br>(户) | 户均持有的基<br>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<br>额比例 | 持有份额             | 占总份<br>额比例 |
| 901          | 369, 242. 68  | 319, 089, 802. 75 | 95. 91%    | 13, 597, 847. 76 | 4. 09%     |

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金份额。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

|                            |                   |
|----------------------------|-------------------|
| 基金合同生效日(2014年08月20日)基金份额总额 | 654, 678, 057. 66 |
| 本报告期期初基金份额总额               | 246, 052, 296. 86 |
| 本报告期基金总申购份额                | 124, 350, 978. 73 |
| 减：本报告期基金总赎回份额              | 37, 715, 625. 08  |
| 本报告期基金拆分变动份额               | -                 |
| 本报告期期末基金份额总额               | 332, 687, 650. 51 |

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动；

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易           |              | 应支付该券商的佣金  |            | 备注 |
|------|--------|----------------|--------------|------------|------------|----|
|      |        | 成交金额           | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金         | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 中投证券 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 中航证券 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 山西证券 | 1      | 475,936,029.71 | 29.79%       | 348,049.94 | 28.76%     | -  |
| 光大证券 | 1      | 257,474,805.69 | 16.11%       | 188,291.70 | 15.56%     | -  |
| 招商证券 | 2      | 208,611,152.18 | 13.06%       | 194,279.08 | 16.05%     | -  |
| 国海证券 | 2      | 342,600,210.73 | 21.44%       | 250,544.61 | 20.70%     | -  |
| 东莞证券 | 2      | 62,257,221.04  | 3.90%        | 45,529.28  | 3.76%      | -  |
| 中信证券 | 2      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 浙商证券 | 2      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 华泰证券 | 2      | 250,877,968.05 | 15.70%       | 183,466.46 | 15.16%     | -  |
| 华安证券 | 2      | -              | -            | -          | -          | -  |

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

## A: 选择标准

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

## B: 选择流程

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

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

## 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 |              | 债券回购交易 |                | 权证交易 |              | 基金交易 |              |
|------|------|--------------|--------|----------------|------|--------------|------|--------------|
|      | 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 | 成交金额 | 占当期基金成交总额的比例 |
| 中投证券 | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 中航证券 | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 山西证券 | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 光大证券 | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 招商证券 | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 国海证券 | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 东莞证券 | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 中信证券 | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 浙商证券 | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |

|      |   |   |               |         |   |   |   |   |
|------|---|---|---------------|---------|---|---|---|---|
| 华泰证券 | - | - | 30,000,000.00 | 100.00% | - | - | - | - |
| 华安证券 | - | - | -             | -       | - | - | - | - |

## 11.8 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 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站 | 2017-01-03 |
| 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                  | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站 | 2017-01-17 |
| 3  | 前海开源新经济灵活配置混合型证券投资基金2016年第4季度报告                       | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站 | 2017-01-20 |
| 4  | 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            | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站 | 2017-02-23 |
| 5  | 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                             | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站 | 2017-02-24 |
| 6  | 前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金在中国工商银行开通定投并继续参与中国工商银行定投费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站 | 2017-03-08 |
| 7  | 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                  | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站 | 2017-03-23 |

|    |  |                             |            |
|----|--|-----------------------------|------------|
| 8  | 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 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站 | 2017-03-29 |
| 9  | 前海开源新经济灵活配置混合型证券投资基金2016年年度报告摘要                        | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站 | 2017-03-30 |
| 10 | 前海开源新经济灵活配置混合型证券投资基金2016年年度报告                          | 基金管理人的官方网站                  | 2017-03-30 |
| 11 | 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                | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站 | 2017-03-31 |
| 12 | 前海开源新经济灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2017年第1号）              | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站 | 2017-04-05 |
| 13 | 前海开源新经济灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2017年第1号）                | 基金管理人的官方网站                  | 2017-04-05 |
| 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 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站 | 2017-04-11 |
| 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 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站 | 2017-04-17 |
| 16 | 前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加乾道                               | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官    | 2017-04-18 |

|    |  |                             |            |
|----|--|-----------------------------|------------|
|    | 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                           | 方网站                         |            |
| 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方法的提示性公告                     | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站 | 2017-04-19 |
| 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                     | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站 | 2017-04-20 |
| 19 | 前海开源新经济灵活配置混合型证券投资基金2017年第1季度报告                          | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站 | 2017-04-21 |
| 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                     | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站 | 2017-04-25 |
| 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                     | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站 | 2017-05-09 |
| 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 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站 | 2017-05-11 |
| 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                     | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站 | 2017-05-11 |
| 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                     | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站 | 2017-05-12 |
| 25 | 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                                | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站 | 2017-05-15 |
| 26 | 前海开源基金管理有限公司   | 中国证券报、上海证券报、                | 2017-05-15 |



|    |  |                             |            |
|----|--|-----------------------------|------------|
|    | 关于展恒基金费率调整的公告  | 证券时报、基金管理人的官方网站             |            |
| 27 | 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        | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站 | 2017-05-18 |
| 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                   | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站 | 2017-05-24 |
| 29 | 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 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站 | 2017-05-25 |
| 30 | 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                   | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站 | 2017-06-02 |
| 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                   | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站 | 2017-06-13 |
| 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                   | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站 | 2017-06-17 |
| 33 | 关于前海开源新经济灵活配置混合型证券投资基金限制大额申购、定期定额投资及转换转入业务的公告          | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站 | 2017-06-20 |
| 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 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站 | 2017-06-27 |
| 35 | 前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加挖财                               | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官    | 2017-06-29 |

|    |   |                             |            |
|----|---|-----------------------------|------------|
|    | 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                             | 方网站                         |            |
| 36 | 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                      | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站 | 2017-06-29 |
| 37 | 前海开源基金管理有限公司旗下基金2017年半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 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站 | 2017-07-03 |
| 38 | 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                    | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站 | 2017-07-04 |
| 39 | 前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加凤凰金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  | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站 | 2017-07-06 |
| 40 | 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                    | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站 | 2017-07-08 |
| 41 | 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                    | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站 | 2017-07-12 |
| 42 | 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                    | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站 | 2017-07-18 |
| 43 | 前海开源新经济灵活配置混合型证券投资基金2017年第2季度报告                         | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站 | 2017-07-21 |
| 44 | 前海开源基金管理有限公司关于中泰证券费率调整的公告                               | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站 | 2017-07-25 |

|    |  |                             |            |
|----|--|-----------------------------|------------|
| 45 | 前海开源基金管理有限公司关于华泰证券费率调整的公告                              | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站 | 2017-07-28 |
| 46 | 关于前海开源新经济灵活配置混合型证券投资基金恢复大额申购、定期定额投资及转换转入业务的公告          | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站 | 2017-08-04 |
| 47 | 前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中民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 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站 | 2017-08-07 |
| 48 | 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                   | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站 | 2017-08-25 |
| 49 | 前海开源新经济灵活配置混合型证券投资基金2017年半年度报告摘要                       | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站 | 2017-08-28 |
| 50 | 前海开源新经济灵活配置混合型证券投资基金2017年半年度报告                         | 基金管理人的官方网站                  | 2017-08-28 |
| 51 | 前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加万家财富为代销机构及开通转换业务并参与其费率优惠活动的公告    | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站 | 2017-08-31 |
| 52 | 前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加植信基金为代销机构并参与其费率优惠活动的公告           | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站 | 2017-09-19 |
| 53 | 前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加喜鹊财富为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优       | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站 | 2017-09-20 |

|    |   |                             |            |
|----|---|-----------------------------|------------|
|    | 惠活动的公告  |                             |            |
| 54 | 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                      | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站 | 2017-09-27 |
| 55 | 前海开源基金管理有限公司关于调整旗下部分基金通过中泰证券定投申购起点金额的公告                   | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站 | 2017-09-29 |
| 56 | 前海开源新经济灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2017年第2号）                   | 基金管理人的官方网站                  | 2017-09-30 |
| 57 | 前海开源新经济灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2017年第2号）                 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站 | 2017-09-30 |
| 58 | 前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加苏宁基金为代销机构及开通转换业务并参与其费率优惠活动的公告       | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站 | 2017-10-25 |
| 59 | 前海开源新经济灵活配置混合型证券投资基金2017年第3季度报告                           | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站 | 2017-10-26 |
| 60 | 前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加排排网基金销售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 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站 | 2017-10-31 |
| 61 | 前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加大河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    | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站 | 2017-11-04 |
| 62 | 前海开源新经济灵活配置混  | 中国证券报、上海证券报、                | 2017-11-28 |

|    |  |                             |            |
|----|--|-----------------------------|------------|
|    | 合型证券投资基金第一次收益分配公告                                      | 证券时报、基金管理人的官方网站             |            |
| 63 | 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                   | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站 | 2017-11-28 |
| 64 | 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                   | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站 | 2017-12-06 |
| 65 | 前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加嘉实财富为代销机构及开通转换业务并参与其费率优惠活动的公告    | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站 | 2017-12-06 |
| 66 | 前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加唐鼎耀华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 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站 | 2017-12-22 |
| 67 | 前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加海银基金为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站 | 2017-12-22 |
| 68 | 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                   | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站 | 2017-12-26 |
| 69 | 前海开源基金管理有限公司关于旗下基金调整流通受限股票估值方法的公告                      | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站 | 2017-12-26 |
| 70 | 前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参与中国工商银行定投费率优惠活动的公告              | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人的官方网站 | 2017-12-27 |
| 71 | 前海开源基金管理有限公司   | 中国证券报、上海证券报、                | 2017-12-30 |

|  |                    |                 |  |
|--|--------------------|-----------------|--|
|  | 旗下证券投资关于基金缴纳增值税的公告 | 证券时报、基金管理人的官方网站 |  |
|--|--------------------|-----------------|--|

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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 - 20171231    | 182,840,193.70 | -    | -    | 182,840,193.70 | 54.96% |
| 产品特有风险  |                |                        |                |      |      |                |        |
| <p>1. 巨额赎回风险</p> <p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>2. 转换运作方式或终止基金合同的风险</p> <p>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；</p> <p>3. 流动性风险</p> <p>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；</p> <p>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。</p> |                |                        |                |      |      |                |        |

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录.

(1) 中国证券监督管理委员会批准前海开源新经济灵活配置混合型证券投资基金设立的文件

(2) 《前海开源新经济灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

(3) 《前海开源新经济灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

(4) 《前海开源新经济灵活配置混合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) 前海开源新经济灵活配置混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

### 13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

### 13.3 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](http://www.qhkyfund.com)

前海开源基金管理有限公司

二〇一八年三月二十九日