前海开源睿远稳健增利混合型证券投资基金 2019年半年度报告摘要

基金管理人:前海开源基金管理有限公司
基金托管人:广发证券股份有限公司
送出日期:2019年08月24日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。
基金托管人广发证券股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年8月20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。
本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。
本报告期自2019年01月01日起至2019年06月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	前海开源睿远稳健增利混合型证券投资基金	
基金简称	前海开源睿远稳健增利混合	
基金主代码	000932	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年01月14日	
基金管理人	前海开源基金管理有限公司	
基金托管人	广发证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	38,489,298.66份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	前海开源睿远稳健增利混合A	前海开源睿远稳健增利混合C
下属分级基金的交易代码	000932	000933
报告期末下属分级基金的份额总额	4,125,960.14份	34,363,338.52份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点投资于债券和现金类资产,力争在严格控制风险和保持基金资产流动性的前提下,实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金的投资策略主要有以下六方面内容: 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,在对宏观经济因素进行充分研究的基础上,判断宏观经济周期所处阶段。本基金将依据经济周期理论,结合对证券市场的系统性风险以及未来一段时期内各大类资产风险和预期收益率的评估,制定本基金在债券、股票、现金等大类资产之间的配置比例。 2.债券投资策略 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。 3.股票投资策略 本基金精选有良好增值潜力的股票构建股票投资组合。股票投资策略将从定性和定量两方面入手。定性方面主要考察上市公司所属行业发展前景、行业地位、竞争优势、管理团队、创新能力等多种因素;定量方面考量公司估值、资产质量及财务状况,比较分析各估值上市公司的估值、成长及财务指标,优先选择具有相对比较优势的公司作为最终投票投资对象。 4.可转债策略 基于行业分析、企业基本面分析和可转换债券估值模型分析,并结合市场环境情况等,本基金在一、二级市场投资可转换债券,以达到在严格控制风险的基础上,实现基金资产稳健增值的目的。可转债的策略具体包括:1)个券选择策略,2)转股策略,3)条款博弈策略,4)套利策略。 5.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。 6.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。 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规定和要求,确定参与股指期货交易的投资比例。 若相关法律法规发生变化时,基金管理人则按投资管理人其最新规定,以符合上述法律法规和监管要求的变化。
业绩比较基准	中证全债指数收益率×85%+沪深300指数收益率×15%。
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金,低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		前海开源基金管理有限公司	广发证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	傅成斌	崔瑞娟
	联系电话	0755-83901888	020-66338888
	电子邮箱	qhky@qhkyfund.com	cuirj@gf.com.cn
客户服务电话		4001666998	95575
传真		0755-83181169	020-87555129

2.4 信息披露方式

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

§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(2019年01月01日-2019年06月30日)	
	前海开源睿远稳健增利混合A	前海开源睿远稳健增利混合C
本期已实现收益	684,713.18	5,587,506.26
本期利润	575,473.50	7,286,746.33
加权平均基金份额本期利润	0.1397	0.1878
本期基金份额净值增长率	14.73%	14.36%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年06月30日)	
期末可供分配基金份额利润	0.2489	0.2009
期末基金资产净值	5,691,430.16	45,695,714.85
期末基金份额净值	1.379	1.330

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

前海开源睿远稳健增利混合A

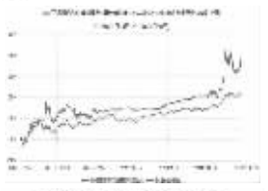
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	3.68%	0.51%	1.30%	0.16%	2.38%	0.35%
过去三个月	-0.14%	0.63%	0.45%	0.21%	-0.59%	0.42%
过去六个月	14.73%	0.99%	5.68%	0.22%	9.05%	0.77%
过去一年	15.20%	0.72%	7.23%	0.22%	7.97%	0.50%
过去三年	23.68%	0.43%	13.26%	0.17%	10.42%	0.26%
自基金合同生效起至今	37.90%	0.48%	22.41%	0.25%	15.49%	0.23%

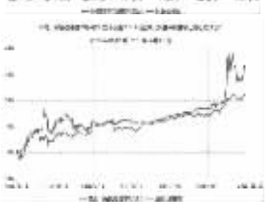
前海开源睿远稳健增利混合C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	3.66%	0.51%	1.30%	0.16%	2.36%	0.35%
过去三个月	-0.23%	0.64%	0.45%	0.21%	-0.68%	0.43%
过去六个月	14.36%	0.99%	5.68%	0.22%	8.68%	0.77%
过去一年	14.56%	0.72%	7.23%	0.22%	7.33%	0.50%
过去三年	21.57%	0.43%	13.26%	0.17%	8.31%	0.26%
自基金合同生效起至今	33.00%	0.48%	22.41%	0.25%	10.59%	0.23%

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

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





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。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83只开放式基金,资产管理规模超过626.78亿元。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘静	本基金的基金经理、公司董事总经理、联邦投资总监、固定收益部负责人	2015-01-14	-	17年	刘静女士,经济学硕士,历任长盛基金管理有限公司债券高级交易员、基金经理助理、长盛货币市场基金基金经理、长盛全债指数增强型债券投资基金基金经理、长盛积极配置债券投资基金基金经理,现任前海开源基金管理有限公司董事总经理、联邦投资总监、固定收益部负责人。

注:①对基金的首任基金经理,其"任职日期"为基金合同生效日,"离任日期"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细则、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

一季度信贷放量、非标降幅收窄、地方债发行前置等因素共同推动社融增速企稳,3月份PMI上升至荣枯线以上。受这些积极信号影响,权益市场显著回暖,驱动因素主要来自估值修复。而由于社融结构改善不明显,阶段性货币政策收紧,震荡成为债市的主基调,收益率上行。二季度后贸易摩擦卷土重来,同时内需走弱,5月和6月制造业PMI皆掉到荣枯线以下,经济面临较大压力,股市震荡回调。同时包商事件后,央行出于对冲经济下行压力,以及维护市场稳定,投放了较多流动性。债市收益率高位回落,迎来了一波行情。

运作上,我们对权益市场总体乐观,判断结构性行情会持续。组合保持了较高的股票仓位,在重点看好的行业均衡配置,弹性和稳健相结合。转债仓位保持了较高的弹性,择机进行了操作,给组合增加了相对收益。其他固收方面,组合保持良好的流动性,配置以高等级信用债及中等久期国开债为主,组合久期控制在中性水平,表现平稳。总体上组合取得了较好收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末前海开源睿远稳健增利混合A基金份额净值为1.379元,本报告期内,该类基金份额净值增长率为14.73%,同期业绩比较基准收益率为5.68%;截至报告期末前海开源睿远稳健增利混合C基金份额净值为1.330元,本报告期内,该类基金份额净值增长率为14.36%,同期业绩比较基准收益率为5.68%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

未来宽货币能否有效传导至宽信用将决定债市的长期趋势。由于非标基数较低,3季度社融增速有望维持企稳态势,4季度随着地债发行放缓,社融增速大概率趋于回落。而CPI由于基数较低,且猪价同比超季节性上涨的压力仍在,CPI可能冲高。总体来看,债市有一定机会,利率债和高等级信用债收益率和下行的概率大于上行的概率。宏观经济基本面受多重影响,不确定性较大。虽然贸易摩擦有所缓和,但双边长期博弈的形势已无法逆转,未来主要看内需,部分行业受政策和科技更新将突出重围。减税降负对实体经济影响比较缓慢,对股市和债市而言,都需密切关注财政政策变化。海外方面,受贸易摩擦影响,全球经济放缓,各央行开启新一轮宽松周期。

后续组合在继续维持较高的权益仓位和债券基础仓位下,通过转债积极择时,参与阶段性行情机会,并通过转债进可攻退可守的特性防止回撤。

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。估值委员会由督察长、基金核算部、监察稽核部、金融工程部、交易部、投资研究部门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债金融估值中心有限公司、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睿远稳健增利混合型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

本报告期内,前海开源睿远稳健增利混合型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对前海开源基金管理有限公司编制和披露的前海开源睿远稳健增利混合型证券投资基金2019年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:前海开源睿远稳健增利混合型证券投资基金
报告截止日:2019年06月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
资 产:		
银行存款	3,268,207.45	1,334,572.32
结算备付金	1,469,570.89	184,768.10
存出保证金	24,638.58	17,439.23
交易性金融资产	43,331,761.36	50,735,436.95
其中:股票投资	15,163,132.36	15,079,530.70
基金投资	-	-
债券投资	28,168,629.00	35,655,906.25
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	4,500,000.00	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	322,382.32	275,028.85
应收股利	-	-
应收申购款	631,569.95	7,428.12
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	53,548,120.55	52,554,673.57
负债和所有者权益	本期末 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	1,575,306.54	-
应付赎回款	191,281.07	28,243.52
应付管理人报酬	39,375.89	40,426.92
应付托管费	4,375.09	4,491.86
应付销售服务费	23,524.51	24,771.16
应付交易费用	12,976.38	14,301.00
应交税费	679.78	568.46
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	313,456.28	300,016.68
负债合计	2,160,975.54	412,819.60
所有者权益:		
实收基金	38,489,298.66	44,733,513.91
未分配利润	12,897,846.35	7,408,340.06
所有者权益合计	51,387,145.01	52,141,853.97
负债和所有者权益总计	53,548,120.55	52,554,673.57

注:报告截止日2019年06月30日,前海开源睿远稳健增利混合A基金份额净值1.379元,基金份额总额4,125,960.14份,前海开源睿远稳健增利混合C基金份额净值1.330元,基金份额总额34,363,338.52份。

6.2 利润表

会计主体:前海开源睿远稳健增利混合型证券投资基金
本报告期:2019年01月01日至2019年06月30日

单位:人民币元

项 目	本期2019年01月01日 至2019年06月30日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日
一、收入	8,423,436.09	1,696,519.65
1.利息收入	324,870.66	953,921.59
其中:存款利息收入	14,833.86	20,964.42
债券利息收入	252,045.91	653,979.93
资产支持证券利息收入	-	48,630.52
买入返售金融资产收入	57,990.89	220,346.72
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	6,428,605.02	196,629.13
其中:股票投资收益	3,212,938.56	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	3,166,305.10	184,946.74
资产支持证券投资收益	-	11,682.39
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	49,361.36	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	1,590,000.39	294,781.58
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	79,960.02	251,187.35
减:二、费用	561,216.26	529,634.37
1. 管理人报酬	246,664.59	263,568.42
2. 托管费	27,407.17	29,285.34
3. 销售服务费	148,184.46	165,360.32
4. 交易费用	53,218.96	1,635.00
5. 利息支出	-	8,862.92
其中:卖出回购金融资产支出	-	8,862.92
6. 税金及附加	330.94	95.99
7. 其他费用	85,410.14	59,968.38
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	7,862,219.83	1,166,885.28
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	7,862,219.83	1,166,885.28

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:前海开源睿远稳健增利混合型证券投资基金
本报告期:2019年01月01日至2019年06月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2019年01月01日至2019年06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)	44,733,513.91	7,408,340.06	52,141,853.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	7,862,219.83	7,862,219.83
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)	-6,244,215.25	-2,372,713.54	-8,616,928.79
其中:1.基金申购款	22,360,606.90	7,321,976.00	29,682,582.90
2.基金赎回款	-28,604,822.15	-9,694,689.54	-38,299,511.69
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)	38,489,298.66	12,897,846.35	51,387,145.01
项 目	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06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)	55,445,748.60	7,766,241.46	63,211,990.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,166,885.28	1,166,885.28
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)	-9,326,191.36	-1,415,772.67	-10,741,964.03
其中:1.基金申购款	60,870,206.24	8,895,455.17	69,765,661.41
2.基金赎回款	-70,196,397.60	-10,311,227.84	-80,507,625.44
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)	46,119,557.24	7,517,354.07	53,636,911.31

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	何璐	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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号(年度报告和半年度报告)》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及其他中国证监会、中国证券投资基金业协会发布的有关规定和指引编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期未发生会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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政策的补充通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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》、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》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和买卖操作,主要税项列示如下:

(1)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。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,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额

(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,股票的股息、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。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,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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利,H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称"中国结算")提出申请,由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册,H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利,由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(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。

基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票,按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
前海开源基金管理有限公司("前海开源基金")	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
广发证券股份有限公司("广发证券")	基金托管人、基金代销机构
开源证券股份有限公司("开源证券")	基金管理人股东、基金代销机构
北京市中盛金期投资管理有限公司	基金管理人股东
北京长和世纪资产管理有限公司	基金管理人股东
深圳市和合投信资产管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人股东
前海开源资产管理有限公司	基金管理人的子公司

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2019年01月01日至2019年06月30日		上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券股份有限公司("广发证券")	31,812,922.23	100.00%	-	-

6.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.3 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2019年01月01日至2019年06月30日		上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日	
	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例
广发证券股份有限公司("广发证券")	138,985,716.91	100.00%	66,202,986.37	100.00%

6.4.8.1.4 债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2019年01月01日至2019年06月30日		上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
广发证券股份有限公司("广发证券")	586,100,000.00	100.00%	552,400,000.00	100.00%

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2019年01月01日至2019年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券股份有限公司("广发证券")	29,627.61	100.00%	12,276.38	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券股份有限公司("广发证券")	-	-	-	-

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	246,664.59	263,568.42
其中:支付销售机构的客户维护费	9,976.61	6,001.61

注:①本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.90%年费率计提。管理费的计算方法如下:H=E×0.90%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

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

②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。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	27,407.17	29,285.34

注:本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.10%年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.10%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费E为前一日的基金资产净值

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

6.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2019年01月01日至2019年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	前海开源睿远稳健增利混合A	前海开源睿远稳健增利混合C	合计
前海开源基金管理有限公司	0.00	94,177.77	94,177.77
广发证券股份有限公司	0.00	27,412.76	27,412.76
合计	0.00	121,590.53	121,590.53
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	前海开源睿远稳健增利混合A	前海开源睿远稳健增利混合C	合计
前海开源基金管理有限公司	0.00	127,367.69	127,367.69
广发证券股份有限公司	0.00	31,452.01	31,452.01
合计	0.00	158,819.70	158,819.70

注:本基金A类基金份额不收取销售服务费,C类基金份额的销售服务费年费率为0.60%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务。

销售服务费按前一日C类基金资产净值的0.60%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.60%÷当年天数

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

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

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有