

前海开源沪深300指数型证券投资基金

【2015】第二季度报告

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
报告送出日期：2015年7月20日

基金管理人及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法律责任。

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2015年7月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。投资者有风险，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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告自2015年4月1日起至6月30日止。

基金概况	
场内简称	前海开源300指数
交易代码	000656
前场交易代码	-
前场交易代码	-
基金合同生效日	2014年6月17日
报告期末基金份额总额	31,578,523.729
投资目标	本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪沪深300指数，在严格控制基金跟踪误差的前提下，力争获取与标的指数相近的投资收益。
投资策略	本基金采用完全复制法，即按照标的指数的成份股组成，进行被动式指数投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股及其权重来构建，并随着标的指数成份股及其权重的变化而进行相应调整。同时，本基金还将根据标的指数的成份股及其权重变化，对投资组合进行动态调整，力争获取与标的指数相近的投资收益。同时，本基金还将根据标的指数的成份股及其权重变化，对投资组合进行动态调整，力争获取与标的指数相近的投资收益。同时，本基金还将根据标的指数的成份股及其权重变化，对投资组合进行动态调整，力争获取与标的指数相近的投资收益。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属于中高风险品种，其预期的风险和收益高于货币型基金、债券型基金、混合型基金，为证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。
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

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2015年4月1日至2015年6月30日)
1.本期已实现收益	11,924,297.94
2.本期利润	3,477,091.98
3.加权平均基金份额本期利润	0.4541
4.期末基金资产净值	36,659,317.49
5.期末基金份额净值	1.1794

注：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额。

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

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

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

3.2 基金净值表现

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	4,058,922.77	7.05
2	固定收益投资	4,058,922.77	7.05
3	其中：债券	-	-
4	银行存款	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	507,566.85	0.88
7	其他资产	53,023,469.79	92.07
8	合计	37,589,959.41	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔	1,359.42	0.00
B	采矿业	70,732.49	0.12
C	制造业	1,268,584.04	2.24
D	电力、热力、燃气及生产供应业	65,871.58	0.12
E	建筑业	96,512.60	0.17
F	金融业	134,534.43	0.24
G	交通运输、仓储和邮政业	97,872.04	0.17
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	477,947.81	0.84
J	金融业	1,173,287.03	2.07
K	房地产业	361,831.58	0.64
L	租赁和商务服务业	123,626.19	0.22
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	34,545.56	0.06
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	12,904.09	0.02
R	文化、体育和娱乐业	127,295.04	0.22
S	综合	11,318.96	0.02
合计	-	4,058,922.77	7.16

5.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.1 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.4 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.5 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.6 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.7 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.8 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.9 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.10 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.11 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.12 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.13 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.14 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.15 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.16 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.17 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.18 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.19 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.20 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.21 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.22 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.23 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.24 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.25 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.26 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.27 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.28 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.29 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.30 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.31 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.32 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.33 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.34 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.35 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.36 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.37 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.38 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.39 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.40 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.41 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.42 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.43 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.44 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.45 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.46 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.47 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.48 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.49 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.50 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.51 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.52 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.53 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.54 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.55 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.56 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.57 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.58 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.59 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.60 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.61 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.62 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.63 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.64 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.65 报告期末按行业分类的股票投资组合

前海开源可转债债券型发起式证券投资基金

【2015】第二季度报告

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
报告送出日期：2015年7月20日

基金管理人及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法律责任。

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2015年7月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。投资者有风险，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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告自2015年4月1日起至6月30日止。

基金概况	前海开源可转债债券
场内简称	-
交易代码	000636
前场交易代码	-
基金合同生效日	2014年3月25日
报告期末基金份额总额	15,278,053.83
投资目标	本基金主要投资于可转债品种，在严格控制基金跟踪误差的前提下，力争获取与标的指数相近的投资收益。
投资策略	本基金的投资策略主要有以下三方面内容： 1. 资产配置策略：本基金主要投资于可转债品种，在严格控制基金跟踪误差的前提下，力争获取与标的指数相近的投资收益。 2. 可转债投资策略：本基金主要投资于可转债品种，在严格控制基金跟踪误差的前提下，力争获取与标的指数相近的投资收益。 3. 股票投资策略：本基金主要投资于可转债品种，在严格控制基金跟踪误差的前提下，力争获取与标的指数相近的投资收益。
业绩比较基准	中证可转债指数收益率×70%+中证综合债指数收益率×30%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期的风险和收益高于货币型基金，低于股票型基金、混合型基金。
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

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2015年4月1日至2015年6月30日)
1.本期已实现收益	1,866,761.33
2.本期利润	-1,792,288.53
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1090
4.期末基金资产净值	20,937,564.65
5.期末基金份额净值	1.378

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

3.2.2 本报告期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

3.2.3 本报告期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

3.2.4 本报告期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

3.2.5 本报告期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

3.2.6 本报告期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

3.2.7 本报告期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

3.2.8 本报告期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

3.2.9 本报告期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

3.2.10 本报告期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

3.2.11 本报告期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

3.2.12 本报告期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

3.2.13 本报告期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

3.2.14 本报告期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

3.2.15 本报告期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

3.2.16 本报告期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

3.2.17 本报告期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

3.2.18 本报告期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

3.2.19 本报告期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

3.2.20 本报告期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

3.2.21 本报告期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

3.2.22 本报告期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

3.2.23 本报告期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

3.2.24 本报告期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

3.2.25 本报告期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

3.2.26 本报告期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

3.2.27 本报告期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

3.2.28 本报告期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

3.2.29 本报告期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

3.2.30 本报告期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

3.2.31 本报告期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

3.2.32 本报告期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

3.2.33 本报告期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

3.2.34 本报告期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

3.2.35 本报告期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

3.2.36 本报告期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