前海开源沪港深大消费主题精选灵活配置混合型证券投资基金 2016年年度报告摘要

基金管理人:前海开源基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
送出日期:2017年3月30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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年3月24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2016年9月29日(基金合同生效日)起至12月31日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

§2 基金简介

2.1基金基本情况

基金简称	前海开源沪港深大消费主题混合	
基金主代码	002662	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年9月29日	
基金管理人	前海开源基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	361,967,436.28份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	前海开源沪港深大消费主题混合A	前海开源沪港深大消费主题混合C
下属分级基金的交易代码:	002662	002663
报告期末下属分级基金的份额总额	136,473,536.04份	225,493,900.24份

2.2基金产品说明

投资目标	本基金主要通过精选投资于大消费主题相关证券,把握“新常态”下中国经济和社会转型过程中的投资机会,在合理控制风险并保持基金资产良好流动性的前提下,力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	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,制定本基金在股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例。 本基金通过对股票等权益类、债券等固定收益类和现金资产分布的实时监控,根据经济运行周期变动、市场利率变化、市场估值、证券市场变化等因素以及基金的风险评估进行灵活调整。在各类资产中,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。 2、股票投资策略 (1)大消费主题相关行业的界定 本基金所称的大消费主题相关行业是指居民购买商品和服务而产生的行业,按照申万行业分类标准,划分为三类,即必需消费、可选消费和其他消费。必需消费是指为满足居民基本消费需求而购买的商品和服务;可选消费是指为满足居民额外较高层次需求而购买的商品和服务;其他消费是指目前尚未被划入消费行业,但是其属性已经基本具备消费行业属性,形成实际的消费需求,并拉动一系列与其相关的行业发展的新兴商品和服务。 根据前文定义,必需消费包括食品饮料、农林牧渔、纺织服装、医药生物、交通运输、公用事业等;可选消费包括汽车、家用电器、轻工制造、休闲服务、商业贸易、金融、电子、通信、计算机等;其他消费包括日用化学产品、民用军工用品、教育、传媒、能源产业等。对于以上行业之外的其他行业,如果其中某些细分行业符合消费行业的定义,本基金也会酌情将其纳入消费行业的范围。 若申银万国证券公司调整或停止行业分类,或者基金管理人认为有更适当的消费相关行业划分标准,基金管理人在履行适当程序后有权对消费相关行业的界定方法进行调整并及时公告。 本基金将持续跟踪国家政策、产业发展趋势、技术、工艺、商业模式的最新变化,根据消费趋势的发展,对大消费主题相关行业的范围进行动态调整。经基金管理人确认后,可纳入消费相关行业股票库。 (2)大消费主题相关股票的投资策略 本基金将精选有良好增值潜力的、与大消费主题相关的上市公司股票构建股票投资组合。在个股选择上,本基金将根据上市公司所处行业特点,综合考虑公司质地和业绩增性等因素,寻找基本面健康、业绩向上弹性较大、估值有优势的公司进行投资。在公司质地方面,选择治理结构优良、竞争优势强、管理水平高、资产负债表健康的公司;在业绩弹性方面,重点考虑盈利能力相对较高、成长性较大、成本弹性较大的公司;在估值方面,综合考虑市净率、市销率、EV/EBITDA、盈置价值、市盈率等估值指标,选择估值具有较好安全边际的公司。通过对备选公司以上方面的分析,本基金将优选出具有综合优势的股票构建投资组合,并根据行业趋势,动态水平等因素进行动态调整。 (3)港股通标的股票投资策略 本基金可通过沪港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场,不使用合格境内机构投资者(QDII)境外投资额度进行境外投资。本基金将遵循大消费主题相关股票的投资策略,优先将基本面健康、业绩向上弹性较大、具有估值优势的港股纳入本基金的股票投资组合。 3、债券投资策略 在债券投资策略方面,本基金将以大消费主题相关债券为主线,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。 4、权证投资策略 在权证投资方面,本基金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。 5、资产支持证券投资策略 本基金通过对资产支持证券发行条款的分析、违约概率和提前偿付比率的预估,借用必要的数量模型来谋求对资产支持证券的合理定价,在严格控制风险、充分考虑风险补偿收益和市场流动性的条件下,谨慎选择风险调整后收益较高的品种进行投资。 本基金严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资,以降低流动性风险。 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。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×70%+中证全债指数收益率×30%
风险收益特征	本基金为混合型基金,属于中高风险收益的投资品种,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。本基金如果投资港股通标的股票,需承担汇率风险以及国外市场的风险。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	傅成斌	田青
	联系电话	0755-83601888	010-67596096
	电子邮箱	qhkyf@qhkyfund.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话?		4001666998	010-67596096
传真		0755-83181169	010-66275853

2.4信息披露方式

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、基金托管人的办公地址

§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

3.1.1 期间数据和指标	2016年9月29日(基金合同生效日)-2016年12月31日		2015年		2014年	
	前海开源沪港深大消费主题混合A	前海开源沪港深大消费主题混合C	前海开源沪港深大消费主题混合A	前海开源沪港深大消费主题混合C	前海开源沪港深大消费主题混合A	前海开源沪港深大消费主题混合C
本期已实现收益	-1,780,048.17	-3,358,904.06	-	-	-	-
本期利润	-6,753,690.96	-12,630,817.40	-	-	-	-
加权平均基金份额本期利润	-0.0476	-0.0422	-	-	-	-
本期基金份额净值增长率	-4.90%	-4.90%	-	-	-	-
3.1.2 期末数据和指标	2016年末		2015年末		2014年末	
期末可供分配基金份额利润	-0.0487	-0.0494	-	-	-	-
期末基金资产净值	129,827,421.54	214,364,629.13	-	-	-	-
期末基金份额净值	0.951	0.951	-	-	-	-

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和未余额和未分配利润中已实现部分期末余额的较低数。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。

④ 本基金的基金合同于2016年9月29日生效,截止2016年12月31日成立不满1年,故2016年年度数据与指标为不完整会计年度数据。

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

前海开源沪港深大消费主题混合A

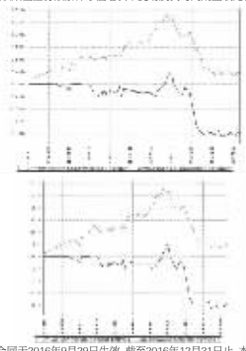
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-4.90%	0.61%	0.70%	0.51%	-5.60%	0.10%
自基金合同生效起至今	-4.90%	0.60%	1.21%	0.51%	-6.11%	0.09%

前海开源沪港深大消费主题混合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
过去三个月	-4.90%	0.61%	0.70%	0.51%	-5.60%	0.10%
自基金合同生效起至今	-4.90%	0.60%	1.21%	0.51%	-6.11%	0.09%

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%。

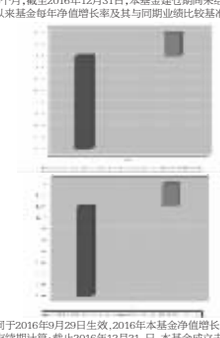
3.2.2自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:①本基金的基金合同于2016年9月29日生效,截至2016年12月31日止,本基金成立未满1年。

②本基金的建仓期为6个月,截至2016年12月31日,本基金建仓期尚未结束。

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2016年9月29日生效,截至2016年12月31日止,本基金成立未满1年。基金合同规定,本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期,截至建仓期末,本基金各类资产的投资比例应符合基金合同第十二部分投资组合的规定。建仓期末,本基金各项投资比例尚未达到基金合同规定的投资比例。

3.3其他指标

无。

3.4过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

前海开源沪港深大消费主题混合A					
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
2016	0.0000	0.00	0.00	0.00	?
合计	0.0000	0.00	0.00	0.00	?

单位:人民币元

前海开源沪港深大消费主题混合C					
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
2016	0.0000	0.00	0.00	0.00	?
合计	0.0000	0.00	0.00	0.00	?

注:本基金的基金合同于2016年9月29日生效,截止2016年12月31日,本基金成立未满三年。

§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,前海开源资管的股东结构为:前海开源基金管理有限公司出资18000万,占比100%。

截至报告期末,前海开源基金旗下管理45只开放式基金,资产管理规模超过600亿元。

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		
赵雪芹	本基金的基金经理、公司董事总经理、联席投资总监、研究部负责人	2016年9月29日	-	14年	赵雪芹女士,经济学博士研究生,历任山东财经大学讲师、海通证券股份有限公司首席分析师、中信证券股份有限公司首席分析师。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、研究部负责人。

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(试行)》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

报告期内,上证指数下跌12.31%,沪深300指数下跌11.28%,创业板下跌27.71%。2016年,全球经济整体难以摆脱调整压力,而各经济体复苏格局的分化又加剧了市场波动和多重风险,国际上“黑天鹅”事件此起彼伏,不确定性因素不断累积,压制增量资金进场热情,A股市场整体呈存量博弈格局。本基金成立后,本着价值投资的原则,精选估值低、业绩优、财务风险小的各消费子行业龙头,通过合理控制仓位,有效得控制了年末市场大幅回调的风险。本基金投资理念为中长期价值投资,沿着业绩高增长、景气度向上、政策红利受益三大主线,积极加仓业绩增长和分红稳定的消费股,成长和估值间高性价比预期的成长股以及国企改革受益股。具体到行业方面,重点布局消费与生活产业链,如医药医疗、食品饮料、社会服务、家电、汽车、信息安全、文化娱乐等行业。另外,在主题和合同允许的范围内,对一带一路、国内基建和国企改革主题项下的优质公司也进行了布局。在不同市场阶段配置方面,考虑到港股消费类公司业绩优良且估值大幅低于A股,所以本基金对港股亦进行了合理的战略性配置。

在全年的操作过程中,本基金始终将风险控制摆在首位,恪守震荡市下交易操作和仓位控制的谨慎性原则,通过适度分散持仓和分步建仓来降低波动性、严控回撤风险,保障了持有人利益。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内,A类基金份额净值增长率为-4.90%,同期业绩比较基准收益率为1.21%,C类基金份额净值增长率为-4.90%,同期业绩比较基准收益率为1.21%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中央政府近年来一方面大力推进供给侧改革帮助企业去杠杆、去产能、去库存以推进产业结构转型升级,另一方面推出一系列稳增长措施以维持经济的健康增长。在供给侧改革加调结构、稳增长组合拳政策措施推动下,预计2017年财政政策将继续保持积极扩张的基调,结构调整将在保持总量平衡的调控节奏下,循序渐进,经济总体将呈现稳中有升的上行趋势。

展望2017年,在“资产荒”的大背景下,A股和H股的配置价值均将进一步提升。一方面,银行理财规模增大、成本提高,而保险资产规模也在迅速膨胀,倒逼对高收益资产的配置需求;另一方面,债券收益率下行、信用风险快速上升、房地产新投性高位、商品波动率大幅加大、非标规模收缩,其他大类资产的性价比显著下降。另外,在全球资本流动中,中国作为新兴市场“领头羊”,国内优质资产受海外资本关注度不断提高,随着人民币国际化的加速,海外配置A股的渠道势必进一步拓宽深化。港股方面,其较低的估值水平为稳定存量资金提供了较厚的安全垫,而内资尤其是以保险资金为代表的长期机构投资者逐渐成为增量资金的主导也优化了港股市场的投资结构,以上因素均有望推动港股估值进一步向A股靠拢。

改革进入深水区,围绕着“内需”和“创新”展开的,以投资主导转向消费主导的经济转型和结构调整仍将是未来经济发展的主旋律。在“内需”层面,传统消费提质升级、新兴消费加速扩容以及市场流通体系的不断完善将成为三大主要方向;在“创新”层面,提高全要素生产率、提高管理水平、促进服务业和战略性新兴产业比重提高和水平提升,将是以创新驱动转型的主要路径。基于上述逻辑,我们认为,立足消费和生活产业链上的传统消费品和科技消费品制造业、服务性消费行业将是未来孵化新的增长点和增长极的重点领域,坚持在上述领域的长期投资和价值投资仍大有可为。

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,通过定时监控、现场检查、重点抽查和入员询问等方法,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证券投资、投资决策、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)通过事前合规前置、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,保证基金投资收益、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

本基金管理人根据企业会计准则、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。估值委员会由总经理、督察长、基金事务部、研究部、投资部、监察稽核部、金融工程部、交易部负责人及其他指定相关人员组成。估值委员会成员均具备专业胜任能力和相关从业资格,精通各自领域的理论知识,熟悉相关政策法规,并具有丰富的实践经验。基金经理可参与估值原则和方法的讨论,但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

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

本基金本报告期内,参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.8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。

4.9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,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在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,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

§6 审计报告

瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)审计了本基金的财务报表,包括2016年12月31日的资产负债表,2016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,并出具了无保留意见的审计报告。投资者欲了解详细内容,可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1资产负债表

会计主体:前海开源沪港深大消费主题精选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日:2016年12月31日

单位:人民币元

资产	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
资产:		
银行存款	77,373,108.66	-
结算备付金	1,434,355.99	-
存出保证金	121,010.92	-
交易性金融资产	267,058,507.65	-
其中:股票投资	267,058,507.65	-
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	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	17,454.67	-
应收股利	-	-
应收申购款	118,774.61	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	346,123,212.50	-
负债和所有者权益	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015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	9.71	-
应付赎回款	384,242.31	-
应付管理人报酬	453,300.37	-
应付托管费	75,550.09	-
应付销售服务费	18,946.62	-
应付交易费用	933,877.64	-
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	65,235.09	-
负债合计	1,931,161.83	-
所有者权益:		
实收基金	361,967,436.28	-
未分配利润	-17,775,385.61	-
所有者权益合计	344,192,050.67	-
负债和所有者权益总计	346,123,212.50	-

注:①报告截止日2016年12月31日,前海开源沪港深大消费混合A基金份额净值0.951元,基金份额总额136,473,536.04份;前海开源沪港深大消费混合C基金份额净值0.951元,基金份额总额225,493,900.24份。

②本基金的基金合同于2016年9月29日生效,无上年度末可比数据。

7.2利润表

会计主体:前海开源沪港深大消费主题精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2016年9月29日(基金合同生效日)至2016年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2016年9月29日(基金合同生效日)至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
一、收入	-15,667,039.49	-
1.利息收入	539,053.31	-
其中:存款利息收入	280,906.40	-
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	258,146.91	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	-2,031,130.53	-
其中:股票投资收益	-2,133,130.53	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	102,000.00	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-14,245,556.13	-
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	70,593.86	-
减:二、费用	3,717,468.87	-
1. 管理人报酬	1,694,931.64	-
2. 托管费	282,488.65	-
3. 销售服务费	77,270.12	-
4. 交易费用	1,590,980.68	-
5. 利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	71,797.78	-
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-19,384,508.36	-
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	-19,384,508.36	-

注:本基金的基金合同于2016年9月29日生效,实际报告期间为2016年9月29日(基金合同生效日)到2016年12月31日,无上年度可比期间数据。

7.3所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:前海开源沪港深大消费主题精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2016年9月29日(基金合同生效日)至2016年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2016年9月29日(基金合同生效日)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)	549,001,254.10	-	549,001,254.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-19,384,508.36	-19,384,508.36
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)	-187,033,817.82	1,609,122.75	-185,424,695.07
其中:1.基金申购款	3,205,099.65	-47,030.80	3,158,068.85
2.基金赎回款	-190,238,917.47	1,656,153.55	-188,582,763.92
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)	361,967,436.28	-17,775,385.61	344,192,050.67

注:①报告截止日2016年12月31日,前海开源沪港深大消费混合A基金份额净值0.951元,基金份额总额136,473,536.04份;前海开源沪港深大消费混合C基金份额净值0.951元,基金份额总额225,493,900.24份。

②本报告期末,本基金托管人无重大人事变动:
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

本基金本报告期未改变投资策略。

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	
中信建投	2	870,561,389.10	71.07%	639,910.03	68.52%	-
渤海证券	1	155,917,703.90	12.73%	114,022.36	12.21%	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	246,063,600.18	20.09%	179,945.25	19.27%	-

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	
	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
中信建投	-	-	300,000,000.00	90.91%	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	30,000,000.00	9.09%	-	-

§12 影响投资者决策的其他重要信息

无

前海开源基金管理有限公司

2017年3月30日