
前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金

2019 年半年度报告

2019 年 06 月 30 日

基金管理人:前海开源基金管理有限公司

基金托管人:国信证券股份有限公司

送出日期:2019 年 08 月 24 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人国信证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年8月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年01月01日起至2019年06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	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	8
2.4 信息披露方式	9
2.5 其他相关资料	9
§3 主要财务指标和基金净值表现	9
3.1 主要会计数据和财务指标	9
3.2 基金净值表现	10
3.3 其他指标	11
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
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	13
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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 半年度财务会计报告(未经审计)	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	18
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	48
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	48
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	48
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	48
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.12 投资组合报告附注	49
§8 基金份额持有人信息	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50

8.2 期末上市基金前十名持有人.....	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	51
8.4 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.....	52
§9 开放式基金份额变动.....	52
§10 重大事件揭示.....	53
10.1 基金份额持有人大会决议.....	53
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	53
10.4 基金投资策略的改变.....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	53
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	53
10.8 其他重大事件.....	54
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	59
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	60
§12 备查文件目录.....	60
12.1 备查文件目录.....	60
12.2 存放地点.....	60
12.3 查阅方式.....	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金		
基金简称	前海开源健康分级		
场内简称	健康分级		
基金主代码	164401		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015年04月16日		
基金管理人	前海开源基金管理有限公司		
基金托管人	国信证券股份有限公司		
报告期末基金份额总额	353,791,186.95份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2015-05-08		
下属分级基金的基金简称	前海开源健康分级	前海开源健康A	前海开源健康B
下属分级基金场内简称	健康分级	健康A	健康B
下属分级基金的交易代码	164401	150219	150220
报告期末下属分级基金的份额总额	36,835,064.95份	158,478,061.00份	158,478,061.00份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金紧密跟踪标的指数——中证健康产业指数，通过严谨数量化管理和投资纪律约束，力争保持基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过【0.35%】，年跟踪误差不超过【4%】。
投资策略	本基金采用动态复制标的指数的投资方法，参照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整，以复制和跟踪标的指数。本基金在严

格控制基金的日均跟踪偏离度和年跟踪误差的前提下，力争获取与标的指数相似的投资收益。

当预期成份股发生调整或成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。

本基金力争前海开源中证健康份额净值增长率与同期业绩比较基准的增长率之间的日均跟踪偏离度不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

1、资产配置策略

为实现跟踪标的指数的投资目标，本基金将以不低于非现金基金资产的90%的比例投资于标的指数成份股及其备选成份股，并保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

2、股票投资策略

（1）股票投资组合的构建

本基金在建仓期内，将参照标的指数各成份股的基准权重对其逐步买入，在力求跟踪误差最小化的前提下，本基金可采取适当方法，以降低买入成本。当遇到成份股停牌、流动性不足等其他市场因素而无法依指数权重购买某成份股及预期标的指数的成份股即将调整或其他影响指数复制的因素时，本基金可以根据市场情况，结合研究分析，对基金财产进行适当调整，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。

（2）股票投资组合的调整

本基金所构建的股票投资组合将根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，本基金

	还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、新股增发因素等变化,对其进行适时调整,以保证前海开源中证健康份额净值增长率与标的指数收益率间的高度正相关和跟踪误差最小化。基金管理人将对成份股的流动性进行分析,如发现流动性欠佳的个股将可能采用合理方法寻求替代。由于受到各项持股比例限制,基金可能不能按照成份股权重持有成份股,基金将会采用合理方法寻求替代。 1) 定期调整 根据标的指数的调整规则和备选股票的预期,对股票投资组合及时进行调整。 2) 不定期调整 根据指数编制规则,当标的指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重新调整时,本基金将根据各成份股的权重变化进行相应调整;根据本基金的申购和赎回情况,对股票投资组合进行调整,从而有效跟踪标的指数;根据法律、法规规定,成份股在标的指数中的权重因其它特殊原因发生相应变化的,本基金可以对投资组合管理进行适当变通和调整,力求降低跟踪误差。 3、债券投资策略 本基金可以根据流动性管理需要,选取到期日在一年以内的政府债券进行配置。本基金债券投资组合将采用自上而下的投资策略,根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来利率变化,并利用债券定价技术,进行个券选择。
业绩比较基准	中证健康产业指数收益率$\times 95\%$ + 银行人民币活期存款利率(税后)$\times 5\%$
风险收益特征	本基金属于股票型基金,其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数基金,通过跟踪标的指数表现,具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。 从本基金所分拆的两类基金份额来看,前海开

	源中证健康A份额为稳健收益类份额；前海开源中证健康B份额为积极收益类份额。		
下属分级基金的风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数基金，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。	前海开源中证健康A份额为稳健收益类份额。	前海开源中证健康B份额为积极收益类份额。

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	国信证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	傅成斌	孙常新
	联系电话	0755-88601888	0755-22940646
	电子邮箱	qhky@qhkyfund.com	03356@guosen.com.cn
客户服务电话		4001666998	95536
传真		0755-83181169	0755-22940165
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）	广东省深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
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	深圳市南山区学府路85号软件产业基地1栋A座22楼
邮政编码		518040	518000
法定代表人		王兆华	何如

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.qhkyfund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§ 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）
本期已实现收益	2,130,650.68
本期利润	81,624,117.03
加权平均基金份额本期利润	0.2273
本期加权平均净值利润率	26.25%
本期基金份额净值增长率	33.04%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2019年06月30日）
期末可供分配利润	14,024,318.52
期末可供分配基金份额利润	0.0396
期末基金资产净值	326,071,797.02
期末基金份额净值	0.922
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2019年06月30日）
基金份额累计净值增长率	4.28%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.77%	1.31%	1.72%	1.38%	-0.95%	-0.07%
过去三个月	-3.25%	1.73%	-7.96%	1.58%	4.71%	0.15%
过去六个月	33.04%	1.73%	17.00%	1.63%	16.04%	0.10%
过去一年	4.78%	1.64%	-10.85%	1.54%	15.63%	0.10%
过去三年	4.39%	1.21%	-14.80%	1.17%	19.19%	0.04%
自基金合同生效起至今	4.28%	1.34%	-27.36%	1.72%	31.64%	-0.38%

注：本基金的业绩比较基准为：中证健康产业指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%。

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

前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



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		
陶曙 斌	本基金的基金经理、公司 投资副总监	2017- 12-14	-	11 年	陶曙斌先生，金融学硕士， 2005年7月至2008年3月任 职德勤会计师事务所审计 部；2008年4月至2015年12 月任南方基金管理有限公司 运作保障部、ETF业务负 责人。2016年1月加盟前海 开源基金管理有限公司， 现任公司投资副总监。

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、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

本报告期内，在无大额申购或赎回等特殊情况下，基本保持了基金合同所允许的90%到95%的仓位，指数跟踪效果良好，本报告期内实现了相对业绩比较基准16.04%的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末前海开源健康分级基金份额净值为0.922元，本报告期内，基金份额净值增长率为33.04%，同期业绩比较基准收益率为17.00%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金为指数基金，作为基金管理人，我们将通过严格的投资管理流程、精确的数量化计算、精益求精的工作态度、恪守指数化投资的宗旨，实现对标的指数的有效跟踪，为持有人提供与之相近的收益。投资者可以根据自身对证券市场的判断及投资风格，借助投资本基金参与市场。

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

在存续期内，本基金（包括前海开源中证健康份额、前海开源中证健康A份额、前海开源中证健康B份额）不进行收益分配。

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

托管人声明，在本报告期间，本基金托管人——国信证券股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、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，遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

基金管理人本半年度报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告等内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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：前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金

报告截止日：2019年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	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	6.4.7.1	21,722,795.72	25,307,361.44
结算备付金		117,765.52	53,361.84
存出保证金		213,564.30	56,948.78
交易性金融资产	6.4.7.2	301,644,122.89	237,979,603.93
其中：股票投资		301,644,122.89	237,979,603.93
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		3,253,428.48	-
应收利息	6.4.7.5	10,522.52	11,104.55
应收股利		-	-
应收申购款		31,199.24	19,124.17
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		326,993,398.67	263,427,504.71
负债和所有者权益	附注号	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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	7,256,029.64
应付赎回款		176,582.13	14,433.76
应付管理人报酬		262,625.72	224,195.41
应付托管费		52,525.15	44,839.10
应付销售服务费		-	-

应付交易费用	6.4.7.7	75,871.59	123,629.60
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	353,997.06	490,054.37
负债合计		921,601.65	8,153,181.88
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	312,047,478.50	325,291,804.19
未分配利润	6.4.7.10	14,024,318.52	-70,017,481.36
所有者权益合计		326,071,797.02	255,274,322.83
负债和所有者权益总计		326,993,398.67	263,427,504.71

注：报告截止日2019年06月30日，前海开源健康分级基金份额净值0.922元，前海开源健康A基金份额净值1.030元，前海开源健康B基金份额净值0.814元；基金份额总额353,791,186.95份，其中，前海开源健康分级基金份额36,835,064.95份，前海开源健康A基金份额158,478,061.00份，前海开源健康B基金份额158,478,061.00份。

6.2 利润表

会计主体：前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金

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	附注号	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		84,027,777.51	-23,501,141.04
1. 利息收入		167,552.79	242,262.43
其中：存款利息收入	6.4.7.11	167,552.79	242,262.43
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产		-	-

收入			
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		4,297,437.97	-3,311,520.93
其中：股票投资收益	6.4.7.12	2,283,807.74	-5,689,224.90
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资 收益	6.4.7.14. 5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	2,013,630.23	2,377,703.97
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.18	79,493,466.35	-20,663,850.91
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.19	69,320.40	231,968.37
减：二、费用		2,403,660.48	2,861,996.16
1. 管理人报酬	6.4.10.2. 1	1,533,295.40	1,900,908.26
2. 托管费	6.4.10.2. 2	306,659.09	380,181.63
3. 销售服务费	6.4.10.2. 3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	367,329.61	297,392.59
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.21	196,376.38	283,513.68
三、利润总额（亏损总额		81,624,117.03	-26,363,137.20

以“-”号填列)			
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		81,624,117.03	-26,363,137.20

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金

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）	325,291,804.19	-70,017,481.36	255,274,322.83
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	81,624,117.03	81,624,117.03
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）	-13,244,325.69	2,417,682.85	-10,826,642.84
其中：1. 基金申购款	30,094,140.75	1,221,811.17	31,315,951.92
2. 基金赎回款	-43,338,466.44	1,195,871.68	-42,142,594.76
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）	312,047,478.50	14,024,318.52	326,071,797.02
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)	391,119,707.31	28,539,908.34	419,659,615.65
二、本期经营活动产生 的基金净值变动 数(本期利润)	-	-26,363,137.20	-26,363,137.20
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)	-55,616,380.67	-3,412,220.54	-59,028,601.21
其中: 1. 基金申购款	24,180,782.47	931,006.62	25,111,789.09
2. 基金赎回 款	-79,797,163.14	-4,343,227.16	-84,140,390.30
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)	335,503,326.64	-1,235,449.40	334,267,877.24

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

何璵

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

前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可【2015】139号文《关于准予前海开源中证健康产业指数分级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》、《前海开源中证健康产业指数分级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3月30日至2015年4月10日,首次设立募集不包括认购资金利息共募集

351,034,309.00元，经瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）瑞华验字[2015]02030029号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金基金合同》于2015年4月16日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为351,085,447.02份基金份额，其中认购资金利息折合51,138.02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，本基金托管人为国信证券股份有限公司。

根据《前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金基金合同》并报中国证监会备案，本基金的基金份额包括前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金之基础份额（以下简称“前海开源健康分级份额”）、前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金之A份额（以下简称“前海开源健康A份额”）、前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金之B份额（以下简称“前海开源健康B份额”）。前海开源健康分级份额为可以申购、赎回但不能上市交易的基金份额，前海开源健康A份额与前海开源健康B份额为可以上市交易但不能申购、赎回的基金份额。前海开源健康A份额与前海开源健康B份额的配比始终保持1:1的比率不变。本基金基金合同生效后，前海开源健康分级份额与前海开源健康A份额、前海开源健康B份额之间可以按约定的规则进行场内份额配对转换。

在前海开源健康A份额、前海开源健康分级份额存续期内的每个会计年度（除基金合同生效日所在会计年度外）第一个工作日，本基金将进行基金的定期份额折算。除定期份额折算外，本基金还将在前海开源健康分级份额的基金份额净值达到1.500元时或前海开源健康B份额的基金份额参考净值跌至0.250元时进行不定期份额折算。基金份额折算后基金份额净值相应调整。经深圳证券交易所（以下简称“深交所”）深证上[2015]第179号文审核同意，本基金前海开源健康A份额126,701,967.00份基金份额和前海开源健康B份额126,701,967.00份基金份额于2015年5月8日在深交所挂牌交易。对于托管在场内的前海开源健康分级份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其分拆为前海开源健康A份额和前海开源健康B份额即可上市流通；对于托管在场外的前海开源健康分级份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其跨系统转托管至深交所场内后分拆为前海开源健康A份额和前海开源健康B份额即可上市流通。

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实务操作，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 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019年06月30日
活期存款	21,722,795.72
定期存款	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
合计	21,722,795.72

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末2019年06月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		260,944,204.24	301,644,122.89	40,699,918.65
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		260,944,204.24	301,644,122.89	40,699,918.65

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年06月30日
应收活期存款利息	10,373.42
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	53.00
应收债券利息	—
应收资产支持证券利息	—
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	96.10
合计	10,522.52

注：“其他”为应收结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年06月30日
交易所市场应付交易费用	75,871.59
银行间市场应付交易费用	—
合计	75,871.59

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年06月30日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	620.68
预提费用	313,376.38
指数使用费	40,000.00
合计	353,997.06

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2019年01月01日至2019年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	353,190,839.56	325,291,804.19
本期申购	24,144.26	22,241.13
本期赎回（以“-”号填列）	-25,932.68	-23,888.64
2019年01月02日基金拆分/份额折算前	353,189,051.14	325,290,156.68
基金拆分/份额折算调整	15,609,674.79	-
本期申购	34,092,774.95	30,071,899.62
本期赎回（以“-”号填列）	-49,100,313.93	-43,314,577.80
本期末	353,791,186.95	312,047,478.50

注：①根据本基金的基金合同、招募说明书及深圳证券交易所和中国证券登记结算有限公司的规定，本基金以2019年1月2日为份额折算基准日，对前海开源健康分级的场外份额、场内份额以及前海开源健康A份额实施定期份额折算。

②本期申购含转换转入份（金）额，本期赎回含转出份（金）额。

③根据《基金合同》规定，投资者可申购、赎回前海开源健康分级基础份额，前海开源健康A份额和前海开源健康B份额只可在深圳证券交易所上市交易，故本表不再单独披露前海开源健康A和前海开源健康B份额的情况。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	28,036,272.73	-98,053,754.09	-70,017,481.36
本期利润	2,130,650.68	79,493,466.35	81,624,117.03
本期基金份额交易产生的变动数	-1,145,035.73	3,562,718.58	2,417,682.85
其中：基金申购款	2,017,675.29	-795,864.12	1,221,811.17
基金赎回款	-3,162,711.02	4,358,582.70	1,195,871.68
本期已分配利润	-	-	-
本期末	29,021,887.68	-14,997,569.16	14,024,318.52

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2019年01月01日至2019年06月30日
活期存款利息收入	163,419.94
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	2,868.92
其他	1,263.93
合计	167,552.79

注：“其他”为申购款利息收入和结算保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日
卖出股票成交总额	145,324,470.72
减：卖出股票成本总额	143,040,662.98
买卖股票差价收入	2,283,807.74

6.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期内无基金投资收益。

6.4.7.14 债券投资收益**6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成**

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内无债券买卖差价收入。

6.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

6.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券申购差价收入。

6.4.7.14.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.15 贵金属投资收益**6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

6.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属赎回差价收入。

6.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属申购差价收入。

6.4.7.16 衍生工具收益**6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期内无买卖权证差价收入。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无其他衍生工具投资收益。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日
股票投资产生的股利收益	2,013,630.23
基金投资产生的股利收益	—
合计	2,013,630.23

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年01月01日至2019年06月30日
1. 交易性金融资产	79,493,466.35
——股票投资	79,493,466.35
——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	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	—
合计	79,493,466.35

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日
基金赎回费收入	69,288.17
转换费收入	32.23
合计	69,320.40

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日
交易所市场交易费用	367,329.61

银行间市场交易费用	—
合计	367,329.61

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	58,828.41
指数使用费	80,000.00
律师费	3,000.00
基金上市费	29,752.78
合计	196,376.38

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
前海开源基金管理有限公司（“前海开源基金”）	基金管理人、基金销售机构
国信证券股份有限公司（“国信证券”）	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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

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
国信证券股份有限公司（“国信证券”）	111,063,167.27	41.02%	77,412,456.03	38.59%

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

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债券回购交易。

6.4.10.1.5 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	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总

		量的比例		额的比例
国信证券股份有限公司(“国信证券”)	81,220.33	41.02%	75,871.59	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
国信证券股份有限公司(“国信证券”)	56,611.68	38.59%	—	—

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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	1,533,295.40	1,900,908.26
其中：支付销售机构的客户维护费	29,618.47	9,321.29

注：本基金的管理费按前一日资产净值的1.0%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$

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。

本基金管理人按照与基金代销机构签订的基金销售协议约定，依据销售机构销售基金的

保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，客户维护费从基金管理费中列支。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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	306,659.09	380,181.63

注：本基金的托管费按前一日资产净值的0.2%年费率计提。托管费的计算方法如下：

$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前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。

6.4.10.2.3 销售服务费

本报告期内及上年度可比期间内关联方未从本基金获得销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

无。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况—非货币市场基金

在存续期内，本基金（包括前海开源中证健康份额、前海开源中证健康A份额、前海开源中证健康B份额）不进行收益分配。

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2019年06月30日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601236	红塔证券	2019-06-26	2019-07-05	新股流通受限	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-
300788	中信出版	2019-06-27	2019-07-05	新股流通受限	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末2019年6月30日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2019年6月30日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要是信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以监察及风险控制委员会、督察长、风险控制委员会、监察稽核部、金融工程部和相关业务部门构成的多层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。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款由基金托管人保管，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级，通过单

只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，且通过分散化投资以分散信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末未持有短期信用评级的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有短期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末未持有短期信用评级的同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末未持有长期信用评级的债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有长期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末未持有长期信用评级的同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限的投资品种比例等。本基金所持大部分证券在证券交易所或银行间同业市场交易，除在“期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制的情况外，其余均能及时变现。

6.4.13.3.1 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、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期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公司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票不超过该上市公司可流通股票的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票，不得超过该上市公司可流通股票的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6.4.12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。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利

率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2019年06月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	21,722,795.72	-	-	-	21,722,795.72
结算备付金	117,765.52	-	-	-	117,765.52
存出保证金	213,564.30	-	-	-	213,564.30
交易性金融资产	-	-	-	301,644,122.89	301,644,122.89
应收证券清算款	-	-	-	3,253,428.48	3,253,428.48
应收利息	-	-	-	10,522.52	10,522.52
应收申购款	-	-	-	31,199.24	31,199.24
资产总计	22,054,125.54	-	-	304,939,273.13	326,993,398.67
负债					
应付赎回款	-	-	-	176,582.13	176,582.13
应付管理人报酬	-	-	-	262,625.72	262,625.72

应付托管费	-	-	-	52,525.15	52,525.15
应付交易费用	-	-	-	75,871.59	75,871.59
其他负债	-	-	-	353,997.06	353,997.06
负债总计	-	-	-	921,601.65	921,601.65
利率敏感度缺口	22,054,125.54	-	-	304,017,671.48	326,071,797.02
上年度末2018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	25,307,361.44	-	-	-	25,307,361.44
结算备付金	53,361.84	-	-	-	53,361.84
存出保证金	56,948.78	-	-	-	56,948.78
交易性金融资产	-	-	-	237,979,603.93	237,979,603.93
应收利息	-	-	-	11,104.55	11,104.55
应收申购款	-	-	-	19,124.17	19,124.17
资产总计	25,417,672.06	-	-	238,009,832.65	263,427,504.71
负债					
应付证券清算款	-	-	-	7,256,029.64	7,256,029.64
应付赎回款	-	-	-	14,433.76	14,433.76
应付管理人报	-	-	-	224,195.41	224,195.41

酬					
应付托 管费	-	-	-	44,839.10	44,839.10
应付交 易费用	-	-	-	123,629.60	123,629.60
其他负 债	-	-	-	490,054.37	490,054.37
负债总 计	-	-	-	8,153,181.88	8,153,181.88
利率敏 感度缺 口	25,417,672.06	-	-	229,856,650.77	255,274,322.83

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的账面价值，并按照合约规定的重新定价日期或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变化而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
----	--------------------	---------------------

	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	301,644,122.89	92.51	237,979,603.93	93.23
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
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	301,644,122.89	92.51	237,979,603.93	93.23

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	若其他市场变量保持不变，对市场价格敏感的权益性投资的市场价格上升或下降5%		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
	权益性投资的市场价格上升5%	14,521,036.75	11,308,944.92
	权益性投资的市场价格下降5%	-14,521,036.75	-11,308,944.92

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项
无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	301,644,122.89	92.25
	其中：股票	301,644,122.89	92.25
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	21,840,561.24	6.68
8	其他各项资产	3,508,714.54	1.07
9	合计	326,993,398.67	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末（指数投资）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	57,963,191.50	17.78
B	采矿业	—	—
C	制造业	186,252,780.91	57.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,060,601.47	4.01
E	建筑业	3,285,298.30	1.01
F	批发和零售业	2,701,656.96	0.83
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术	3,556,000.00	1.09

	术服务业		
J	金融业	-	-
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	7,034,438.54	2.16
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	18,316,185.23	5.62
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	292,170,152.91	89.60

7.2.2 报告期末（积极投资）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	204,082.40	0.06
C	制造业	9,173,307.28	2.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	39,603.76	0.01
J	金融业	33,869.94	0.01
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-

M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	23,106.60	0.01
S	综合	-	-
	合计	9,473,969.98	2.91

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未通过港股通机制投资港股。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

7.3.1 期末指数投资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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000661	长春高新	75,000	25,350,000.00	7.77
2	002714	牧原股份	401,085	23,579,787.15	7.23
3	300498	温氏股份	486,895	17,460,054.70	5.35
4	300122	智飞生物	361,096	15,563,237.60	4.77
5	300015	爱尔眼科	501,459	15,530,185.23	4.76
6	600276	恒瑞医药	229,824	15,168,384.00	4.65
7	600887	伊利股份	368,896	12,324,815.36	3.78
8	600332	白云山	300,001	12,291,040.97	3.77
9	000538	云南白药	117,316	9,786,500.72	3.00

10	600436	片仔癀	81,847	9,428,774.40	2.89
11	002007	华兰生物	220,000	6,707,800.00	2.06
12	300203	聚光科技	268,015	6,405,558.50	1.96
13	600201	生物股份	402,056	6,308,258.64	1.93
14	000998	隆平高科	385,993	5,589,178.64	1.71
15	002299	圣农发展	212,130	5,371,131.60	1.65
16	600195	中牧股份	309,960	4,292,946.00	1.32
17	002672	东江环保	367,626	4,168,878.84	1.28
18	002001	新 和 成	210,650	4,063,438.50	1.25
19	000423	东阿阿胶	100,566	4,004,538.12	1.23
20	300567	精测电子	75,000	3,939,000.00	1.21
21	600323	瀚蓝环境	232,254	3,920,447.52	1.20
22	000598	兴蓉环境	788,328	3,586,892.40	1.10
23	300349	金卡智能	200,000	3,556,000.00	1.09
24	002840	华统股份	200,000	3,400,000.00	1.04
25	000735	罗 牛 山	330,003	3,257,129.61	1.00
26	000999	华润三九	110,547	3,243,448.98	0.99
27	601952	苏垦农发	421,380	3,236,198.40	0.99
28	300601	康泰生物	60,000	3,150,000.00	0.97
29	002695	煌上煌	218,600	3,136,910.00	0.96
30	600085	同仁堂	104,560	3,032,240.00	0.93
31	600597	光明乳业	279,971	3,009,688.25	0.92
32	000639	西王食品	345,236	2,948,315.44	0.90
33	002726	龙大肉食	257,650	2,803,232.00	0.86
34	600388	龙净环保	225,986	2,799,966.54	0.86
35	300094	国联水产	599,980	2,705,909.80	0.83
36	000685	中山公用	304,986	2,604,580.44	0.80
37	000895	双汇发展	100,000	2,489,000.00	0.76
38	600803	新奥股份	230,400	2,407,680.00	0.74
39	002422	科伦药业	75,000	2,229,750.00	0.68
40	600196	复星医药	87,524	2,214,357.20	0.68

41	300237	美晨生态	520,000	2,043,600.00	0.63
42	600535	天士力	118,783	1,965,858.65	0.60
43	600251	冠农股份	300,000	1,902,000.00	0.58
44	601607	上海医药	100,000	1,815,000.00	0.56
45	600008	首创股份	485,531	1,709,069.12	0.52
46	000826	启迪环境	141,011	1,662,519.69	0.51
47	300355	蒙草生态	398,120	1,632,292.00	0.50
48	300070	碧水源	200,000	1,558,000.00	0.48
49	300347	泰格医药	20,000	1,542,000.00	0.47
50	002573	清新环境	181,817	1,463,626.85	0.45
51	603858	步长制药	51,940	1,338,493.80	0.41
52	002044	美年健康	100,000	1,244,000.00	0.38
53	002431	棕榈股份	314,354	1,241,698.30	0.38
54	600874	创业环保	149,531	1,239,611.99	0.38
55	600998	九州通	71,736	886,656.96	0.27
56	300197	铁汉生态	200,000	718,000.00	0.22
57	603658	安图生物	10,000	683,600.00	0.21
58	002341	新纶科技	50,000	292,000.00	0.09
59	600566	济川药业	5,000	150,550.00	0.05
60	300760	迈瑞医疗	100	16,320.00	0.01

7.3.2 期末积极投资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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002157	正邦科技	540,000	8,996,400.00	2.76
2	600968	海油发展	57,488	204,082.40	0.06
3	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.02

4	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.01
5	603863	松炆资源	1,612	37,204.96	0.01
6	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.01
7	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.01
8	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.01
9	300788	中信出版	1,556	23,106.60	0.01

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002477	*ST雏鹰	16,233,931.00	6.36
2	600276	恒瑞医药	13,983,891.76	5.48
3	000661	长春高新	8,001,074.00	3.13
4	002124	天邦股份	6,613,779.97	2.59
5	002007	华兰生物	6,287,488.50	2.46
6	300122	智飞生物	6,179,598.00	2.42
7	002567	唐人神	5,888,069.04	2.31
8	300498	温氏股份	4,408,150.00	1.73
9	600332	白云山	4,364,518.00	1.71
10	002714	牧原股份	4,087,440.00	1.60
11	000538	云南白药	3,951,916.00	1.55
12	300349	金卡智能	3,556,967.00	1.39
13	002174	游族网络	3,493,303.00	1.37
14	300094	国联水产	3,317,859.40	1.30
15	002299	圣农发展	3,276,730.00	1.28
16	002157	正邦科技	2,959,141.00	1.16
17	000895	双汇发展	2,584,590.00	1.01
18	002672	东江环保	2,214,387.00	0.87
19	000423	东阿阿胶	2,198,133.00	0.86

20	002639	雪人股份	2, 116, 358. 00	0. 83
----	--------	------	-----------------	-------

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002124	天邦股份	15, 285, 252. 63	5. 99
2	002477	*ST雏鹰	12, 940, 603. 00	5. 07
3	002567	唐人神	11, 368, 130. 60	4. 45
4	002157	正邦科技	10, 581, 344. 37	4. 15
5	002458	益生股份	8, 412, 279. 81	3. 30
6	000895	双汇发展	7, 670, 412. 93	3. 00
7	002299	圣农发展	5, 182, 045. 00	2. 03
8	600598	北大荒	4, 395, 286. 00	1. 72
9	603259	药明康德	4, 312, 000. 34	1. 69
10	002041	登海种业	3, 871, 663. 36	1. 52
11	002174	游族网络	3, 287, 778. 22	1. 29
12	002044	美年健康	3, 200, 591. 40	1. 25
13	600201	生物股份	3, 122, 073. 53	1. 22
14	002007	华兰生物	3, 028, 081. 00	1. 19
15	002639	雪人股份	2, 609, 731. 00	1. 02
16	002515	金字火腿	2, 575, 811. 78	1. 01
17	000623	吉林敖东	2, 569, 428. 06	1. 01
18	000513	丽珠集团	2, 470, 005. 10	0. 97
19	603568	伟明环保	2, 440, 808. 82	0. 96
20	603658	安图生物	2, 307, 676. 10	0. 90

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	127,211,715.59
卖出股票收入（成交）总额	145,324,470.72

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	213,564.30
2	应收证券清算款	3,253,428.48
3	应收股利	—
4	应收利息	10,522.52
5	应收申购款	31,199.24
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	3,508,714.54

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持有 人户 数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总份 额比例
前海 开源 健康 分级	5,677	6,488.47	7,296,692.00	19.81%	29,538,372.95	80.19%
前海 开源 健康A	88	1,800,887.06	156,379,160.00	98.68%	2,098,901.00	1.32%
前海 开源 健康B	3,981	39,808.61	5,809,455.00	3.67%	152,668,606.00	96.33%
合计	9,746	36,301.17	169,485,307.00	47.91%	184,305,879.95	52.09%

注：①分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数(即期末基金份额总额)。

②户均持有的基金份额合计=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

8.2 期末上市基金前十名持有人

前海开源健康A

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额 比例(%)
1	新华人寿保险股份有限公司	131,068,950.00	82.70

2	中意人寿保险有限公司一分红一团体年金	22,138,200.00	13.97
3	中国太保集团股份有限公司一本级一集团自有资金-012G-ZY001深	1,880,000.00	1.19
4	中意人寿保险有限公司	1,291,975.00	0.82
5	肖瑛	1,236,836.00	0.78
6	王伟锋	100,000.00	0.06
7	童建功	100,000.00	0.06
8	邹苏萍	90,014.00	0.06
9	郑斯	55,008.00	0.03
10	周丰瑗	54,000.00	0.03

注：以上信息中，持有人名册及持有份额由中国证券登记结算有限公司提供。

前海开源健康B

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例(%)
1	黎焕金	4,484,400.00	2.83
2	赵升旺	4,210,000.00	2.66
3	中意人寿保险有限公司一分红一团体年金	3,563,961.00	2.25
4	张美芳	3,472,827.00	2.19
5	尹春锦	3,200,000.00	2.02
6	吴克亮	3,000,000.00	1.89
7	谢西就	2,675,000.00	1.69
8	苏栋荣	2,500,499.00	1.58
9	宗学平	2,150,000.00	1.36
10	谭美娜	2,056,450.00	1.30

注：以上信息中，持有人名册及持有份额由中国证券登记结算有限公司提供。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持	前海开源健康	0.00	0.00%

有本基金	分级		
	前海开源健康A	0.00	0.00%
	前海开源健康B	0.00	0.00%
	合计	0.00	0.00%

8.4 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

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	前海开源健康分级	0
	前海开源健康A	0
	前海开源健康B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	前海开源健康分级	0
	前海开源健康A	0
	前海开源健康B	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	前海开源健康分级	前海开源健康A	前海开源健康B
基金合同生效日(2015年04月16日)基金份额总额	351,085,447.02	—	—
本报告期期初基金份额总额	22,160,277.56	165,515,281.00	165,515,281.00
本报告期基金总申购份额	34,116,919.21	—	—
减：本报告期基金总赎回份额	49,126,246.61	—	—
本报告期基金拆分	29,684,114.79	-7,037,220.00	-7,037,220.00

变动份额			
本报告期期末基金份额总额	36,835,064.95	158,478,061.00	158,478,061.00

注：拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额及定期、不定期折算调整的份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动；

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元	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	佣金	占当期佣金总	

	元 数 量		交总额 的比例		量的比 例	
国信 证券	2	111,063,167.27	41.02%	81,220.33	41.02%	-
中投 证券	2	-	-	-	-	-
西藏 东方 财富 证券	2	159,667,671.32	58.98%	116,766.33	58.98%	-

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

A：选择标准

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

B：选择流程

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

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期内租用证券公司交易单元未进行其他证券投资。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
----	------	--------	--------

1	前海开源基金管理有限公司旗下基金2018年12月31日基金资产净值、基金份额净值及基金份额累计净值公告（一）	基金管理人的官方网站	2019-01-02
2	关于前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间前海开源健康分级A份额停复牌的公告	证券时报、基金管理人的官方网站	2019-01-03
3	前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	证券时报、基金管理人的官方网站	2019-01-03
4	关于前海开源健康分级A定期份额折算后次日前收盘价调整的公告	证券时报、基金管理人的官方网站	2019-01-04
5	关于前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金定期份额折算结果及恢复交易的公告	证券时报、基金管理人的官方网站	2019-01-04
6	关于增加腾安基金为前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金的销售机构的公告	证券时报、基金管理人的官方网站	2019-01-04
7	前海开源基金管理有限公司关于增加第一创业证券为旗下部分基金的销售机构并参与其费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人的官方网站	2019-01-08
8	前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	证券时报、基金管理人的官方网站	2019-01-11
9	前海开源中证健康产业指数	证券时报、基金管理人的官	2019-01-18

	分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	方网站	
10	前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	证券时报、基金管理人的官方网站	2019-01-18
11	关于调整前海开源旗下部分证券投资基金通过东海证券办理定投业务起点金额的公告	证券时报、基金管理人的官方网站	2019-01-21
12	前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金2018年第4季度报告	证券时报、基金管理人的官方网站	2019-01-22
13	前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	证券时报、基金管理人的官方网站	2019-01-28
14	前海开源基金管理有限公司关于暂停大泰金石基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	证券时报、基金管理人的官方网站	2019-01-31
15	前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	证券时报、基金管理人的官方网站	2019-02-01
16	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申万宏源证券、申万宏源西部证券申购及定投费率优惠的公告	证券时报、基金管理人的官方网站	2019-02-19
17	关于前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金限制大额申购、定期定额投资及	证券时报、基金管理人的官方网站	2019-02-25

	转换转入业务的公告		
18	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平安证券认购、申购及定投费率优惠的公告	证券时报、基金管理人的官方网站	2019-03-04
19	前海开源基金管理有限公司关于增加百度百盈基金为旗下部分基金的销售机构并开通相关业务的公告	证券时报、基金管理人的官方网站	2019-03-04
20	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国信证券申购及定投费率优惠的公告	证券时报、基金管理人的官方网站	2019-03-05
21	关于前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金恢复直销机构大额申购、转换转入和定期定额投资业务并暂停直销机构跨系统转托管(场外转场内)业务的公告	证券时报、基金管理人的官方网站	2019-03-06
22	关于前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金调整代销机构场内大额申购、转换转入、定期定额投资业务和恢复代销机构场外大额申购、转换转入、定期定额投资业务并暂停代销机构跨系统转托管(场外转场内)业务的公告	证券时报、基金管理人的官方网站	2019-03-11
23	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国泰君安认购、申购及定投费率优惠的公告	证券时报、基金管理人的官方网站	2019-03-15
24	前海开源基金管理有限公司关于增加信诚基金为旗下部	证券时报、基金管理人的官方网站	2019-03-15

	分基金的销售机构并参与其费率优惠活动的公告		
25	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凤凰金信转换业务申购补差费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人的官方网站	2019-03-27
26	前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金2018年年度报告	基金管理人的官方网站	2019-03-27
27	前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金2018年年度报告摘要	证券时报、基金管理人的官方网站	2019-03-27
28	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国海证券申购及定投费率优惠的公告	证券时报、基金管理人的官方网站	2019-03-28
29	前海开源基金管理有限公司关于开源宝赎回转认/申购基金业务在电子直销平台实施费率优惠的公告	证券时报、基金管理人的官方网站	2019-03-29
30	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金继续参与交通银行费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人的官方网站	2019-03-29
31	前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金2019年第1季度报告	证券时报、基金管理人的官方网站	2019-04-19
32	关于调整前海开源旗下部分证券投资基金通过恒宇天泽办理定投业务起点金额的公告	证券时报、基金管理人的官方网站	2019-04-25
33	前海开源基金管理有限公司关于增加华福证券为旗下部分基金的销售机构并参与其费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人的官方网站	2019-05-17

34	前海开源基金管理有限公司关于增加玄元保险为旗下部分基金的代销机构并参加其费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人的官方网站	2019-05-27
35	前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金招募说明书（更新）（2019年第1号）	基金管理人的官方网站	2019-05-30
36	前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2019年第1号）	证券时报、基金管理人的官方网站	2019-05-30
37	前海开源基金管理有限公司关于增加中证金牛为旗下部分基金的代销机构并参加其费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人的官方网站	2019-06-17

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

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	20190101-20190630	131,068,950.00	11,585,545.00	11,585,545.00	131,068,950.00	37.05%
产品特有风险							
1. 巨额赎回风险 （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； （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； 2. 转换运作方式或终止基金合同的风险 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；							

3. 流动性风险

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；

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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

2019年4月14日，由中国证券报社主办的第十六届中国基金业金牛奖评选结果公布，前海开源基金管理有限公司荣获“金牛基金管理公司”，公司旗下前海开源工业革命4.0灵活配置混合型证券投资基金(基金代码：001103)荣获“三年期开放式混合型持续优胜金牛基金”。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

(1) 中国证券监督管理委员会批准前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金设立的文件

(2) 《前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金基金合同》

(3) 《前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金托管协议》

(4) 《前海开源中证健康产业指数分级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) 前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

12.3 查阅方式

(1) 投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件

(2) 投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人前海开源基金管理有限公司，客户服务电话：4001-666-998（免长途话费）

(3) 投资者可访问本基金管理人公司网站，网址：www.qhkyfund.com

前海开源基金管理有限公司

二〇一九年八月二十四日