

前海开源沪港深农业主题精选灵活配置混
合型证券投资基金（LOF）（前海开源中证
大农业指数分级证券投资基金转型而来）
2016 年第 3 季度报告

2016 年 9 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：中国银河证券股份有限公司

报告送出日期：2016 年 10 月 26 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会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责任。

基金托管人中国银河证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年10月21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。

本报告中财务资料未经审计。

本基金系原前海开源中证大农业指数分级证券投资基金转型而来。2016年6月8日起至2016年7月6日，前海开源中证大农业指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，会议审议了《关于前海开源中证大农业指数分级证券投资基金转型相关事宜的议案》，该议案于2016年7月8日表决通过。自2016年7月20日（含当日）起，“前海开源中证大农业指数分级证券投资基金”更名为“前海开源沪港深农业主题精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）”，原《前海开源中证大农业指数分级证券投资基金基金合同》失效，《前海开源沪港深农业主题精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》生效。

本报告中，原前海开源中证大农业指数分级证券投资基金报告期自2016年7月1日起至2016年7月19日止，前海开源沪港深农业主题精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）报告期自2016年7月20日起至2016年9月30日止。

§ 2 基金产品概况

转型后：

基金简称	前海开源沪港深农业混合（LOF）
场内简称	农业精选
交易代码	164403
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2016年7月20日
报告期末基金份额总额	139,753,471.76份
投资目标	本基金主要通过精选投资于农业主题相关证券，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。
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</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金采取自上而下宏观分析和自下而上精选个股相结合的投资策略，在遵循本基金资产配置比例限制的前提下，确定各类资产的投资比例。本基金将精选具有巨大增长潜力、与农业主题相关的上市公司股票构建股票投资组合，投资于农业主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的80%。本基金所指的农业主题包括种植业、畜禽养殖、林业、渔业、农产品加工等农业基础领域，亦包括为农业提供服务支持的相关上下游行业，包括但不限于化肥、农药、动物保健、饲料、农业互联网化、农业机械化等等相关细分子行业。基于前述概念的界定，本基金投资的股票主要包括：</p> <p>（1）基础农业生产商</p> <p>基础的农业板块是指种植业、畜禽养殖、林业、渔业、农产品加工等等细分子行业，本基金将仔细甄别各细分子行业所处的景气周期，精选景气周期向上的子行业，及具有规模化竞争优势的企业作为重要投资方向。</p> <p>（2）农业相关上下游产业链</p> <p>农业相关上下游产业链包括但不限于化肥、农药、动物保健、饲料、农业互联网化、农业机械化等等细分子行业，这些相关子行业对基础农业的发展具有重要的支持作用。本基金将从政策导向、技术领先、商业模式优选等多个维度对农业相关上下游产业链进行筛选，精选子行业及投资标的。</p> <p>农业主题的范畴会随着中国经济结构调整优化的进程不断变化，基金管理人将持续跟踪相关行业最新发展变化，发现不断涌现的投资机会，对该范畴进行动态调整。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本基金主要基于流动性管理需求投资于债券。本基金将结合宏观经济变化趋势、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，运用久期调整、凸度挖掘、信用分析、波动性交易、回购套利等策略，权衡到期收益率与市场流动性，精选个券并构建和调整债券组合，在追求债券资产投资收益的同时兼顾流动性和安全性。</p> <p>4、权证投资策略</p>

	<p>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、中小企业私募债券投资策略</p> <p>本基金对中小企业私募债的投资综合考虑安全性、收益性和流动性等方面特征进行全方位的研究和比较，对个券发行主体的性质、行业、经营情况、以及债券的增信措施等进行全面分析，选择具有优势的品种进行投资，并通过久期控制和调整、适度分散投资来管理组合的风险。</p> <p>6、股指期货投资策略</p> <p>本基金以套期保值为目的，参与股指期货交易。</p> <p>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限定和要求，确定参与股指期货交易的投资比例。</p> <p>若相关法律法规发生变化时，基金管理人期货投资管理从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。</p>
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境外市场的风险。
基金管理人	前海开源基金管理有限公司
基金托管人	中国银河证券股份有限公司

转型前：

基金简称	前海开源农业分级
场内简称	农业分级
交易代码	164403
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年6月4日
报告期末基金份额总额	142,966,943.05份
投资目标	本基金紧密跟踪标的指数——中证大农业指数，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大农业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大农业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。

	<p>3、债券投资策略</p> <p>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。</p>		
业绩比较基准	中证大农业指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%		
风险收益特征	<p>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，为证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种。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。</p> <p>从本基金所分拆的两类基金份额来看，前海开源中证大农业A份额为稳健收益类份额，具有低风险且预期收益相对较低的特征；前海开源中证大农业B份额为积极收益类份额，具有高风险且预期收益相对较高的特征。</p>		
基金管理人	前海开源基金管理有限公司		
基金托管人	中国银河证券股份有限公司		
下属分级基金简称	前海开源农业分级	前海开源大农业A	前海开源大农业B
下属分级场内简称	农业分级	大农业A	大农业B
下属分级基金交易代码	164403	150253	150254
下属分级基金报告期末基金份额总额	142,966,943.05份	0份	0份
下属分级基金的风险收益特征	<p>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，为证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种。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。</p>	<p>前海开源中证大农业A份额为稳健收益类份额，具有低风险且预期收益相对较低的特征。</p>	<p>前海开源中证大农业B份额为积极收益类份额，具有高风险且预期收益相对较高的特征。</p>

注：（1）本基金于2016年7月19日（份额折算日）将前海开源大农业A份额、前海开源大农业B份额折算为前海开源农业分级份额。

（2）本基金自2016年7月20日（含当日）起，转型为“前海开源沪港深农业主题精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）”。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	转型后
	报告期（2016年7月20日—2016年9月30日）
1. 本期已实现收益	1,135,654.44
2. 本期利润	-4,948,451.64
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0351
4. 期末基金资产净值	124,315,909.95
5. 期末基金份额净值	0.890

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本基金于2016年7月19日（份额折算日）将前海开源大农业A份额、前海开源大农业B份额折算为前海开源农业分级份额，折算后单位净值为0.925元。

3.1 主要财务指标

主要财务指标	转型前
	报告期（2016年7月1日—2016年7月19日）
1. 本期已实现收益	129,413.76
2. 本期利润	6,695,852.48
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0468
4. 期末基金资产净值	132,200,837.72
5. 期末基金份额净值	0.925

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本基金于 2016 年 7 月 19 日（份额折算日）将前海开源大农业 A 份额、前海开源大农业 B 份额折算为前海开源农业分级份额，折算后单位净值为 0.925 元。

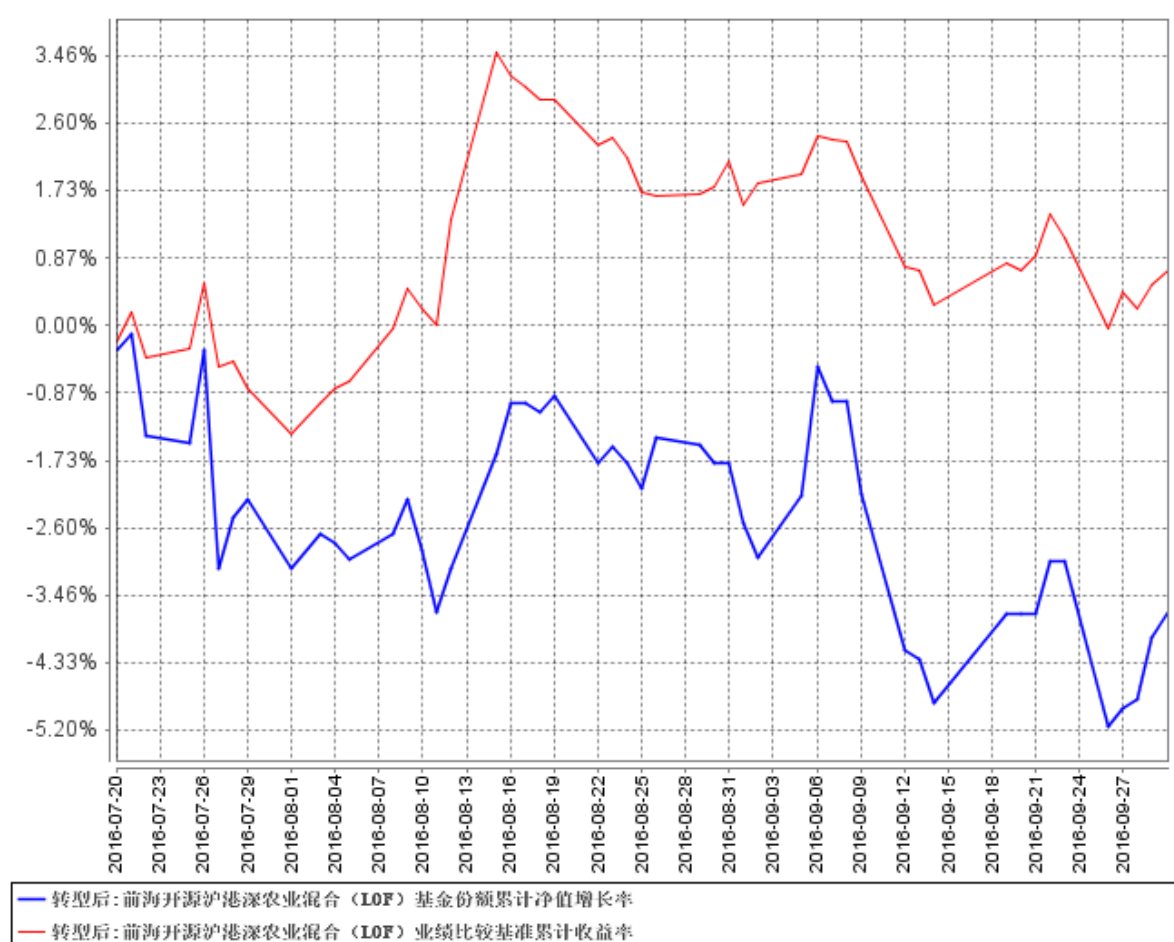
3.2 基金净值表现（转型后）

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

阶段	净值增长率①	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
2016 年 7 月 20 日 -2016 年 9 月 30 日	-3.78%	0.85%	0.63%	0.57%	-4.41%	0.28%

注：2016 年 7 月 20 日（含当日）起，本基金转型为“前海开源沪港深农业主题精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）”，转型后，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：①2016 年 7 月 20 日（含当日）起，本基金转型为“前海开源沪港深农业主题精选灵活配置

混合型证券投资基金（LOF）”，转型后，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%。

②本基金的建仓期为 6 个月，截至 2016 年 9 月 30 日，本基金建仓尚未结束。

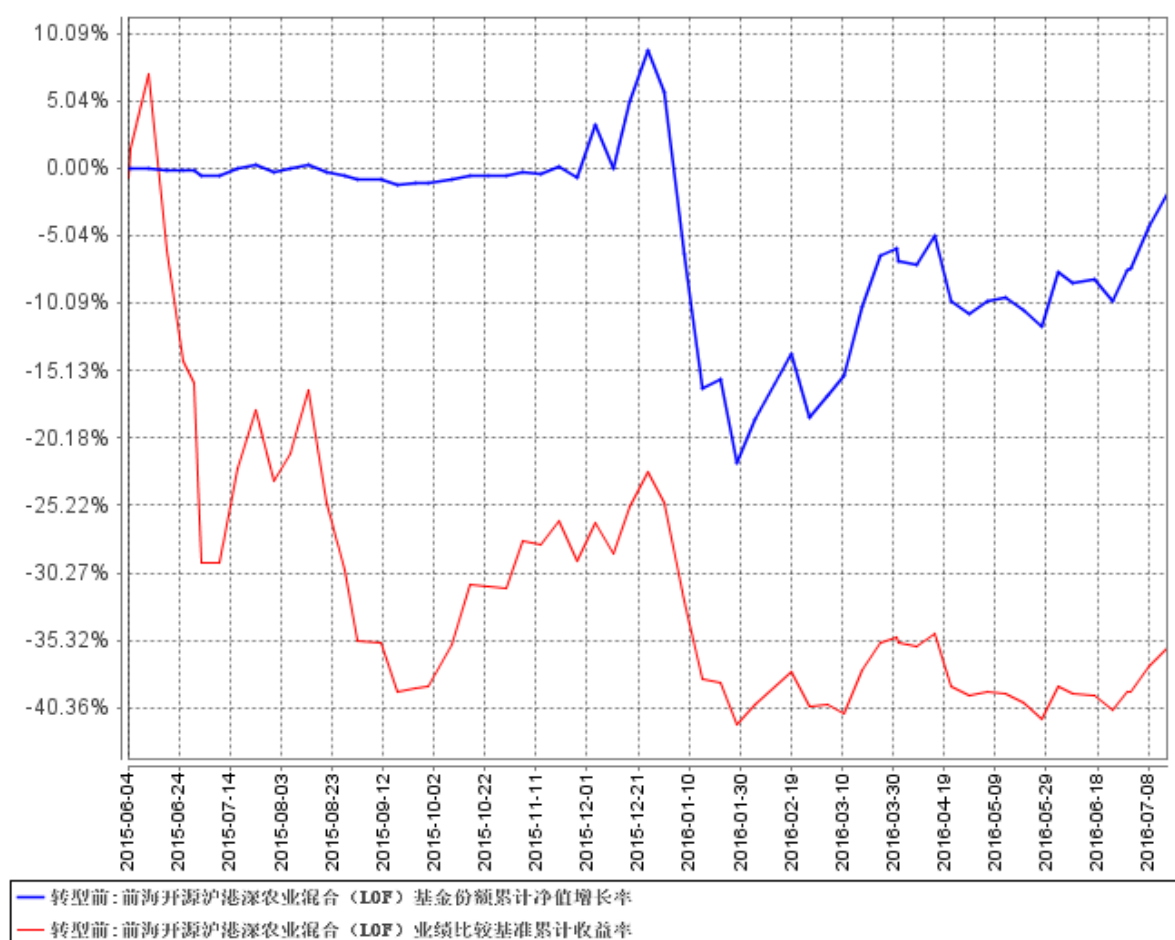
3.2 基金净值表现（转型前）

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

阶段	净值增长率①	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
2016 年 7 月 1 日 - 2016 年 7 月 19 日	5.35%	0.75%	4.91%	0.74%	0.44%	0.01%

注：转型前，本基金的业绩比较基准为：中证大农业指数收益率×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



注：①前海开源农业分级的建仓期为 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同规定。

截止 2016 年 7 月 19 日，前海开源农业分级建仓期结束未满 1 年。

②2016 年 7 月 20 日（含当日）起，本基金转型为“前海开源沪港深农业主题精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）”，转型后，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%。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型前）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
孙亚超	本基金的基金经理、公司执行投资总监	2015年6月4日	-	7年	孙亚超先生，数学科博士后。历任爱建证券研究所创新发展部经理、高级研究员；光大证券理财产品部量化产品系列负责人；齐鲁证券机构部创新业务研究总监。现任前海开源基金管理有限公司执行投资总监。

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。

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型后）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
孙亚超	本基金的基金经理、公司执行投资总监	2015年6月4日	-	7年	孙亚超先生，数学科博士后。历任爱建证券研究所创新发展部经理、高级研究员；光大证券理财产品部量化产品系列负责人；齐鲁证券机构部创新业务研究总监。现任前海开源基金管理有限公司执行投资总监。

柯海东	本基金的基金经理、公司投资副总监	2016年7月20日		6年	柯海东先生，中山大学管理学硕士。历任中国中投证券研究总部食品饮料行业分析师，国泰君安证券研究所食品饮料行业分析师。现任前海开源基金管理有限公司投资副总监。
-----	------------------	------------	--	----	---

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》及其各项实施细则、原《前海开源中证大农业指数分级证券投资基金基金合同》、《前海开源沪港深农业主题精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）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 公平交易专项说明

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 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内，受猪周期见顶回落，及鸡周期价格大幅波动的影响，上半年表现较好的养殖股出现整体调整，拖累中证大农业指数及申万农林牧渔指数等市场主流的农业行业指数出现调整，基金管理人根据对基本面的判断适当减持了部分养殖股，进行了风险控制，并且加强了对养殖后

周期的配置。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金由前海开源中证大农业指数分级证券投资基金转型为前海开源沪港深农业主题精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）。转型前，自2016年7月1日至2016年7月19日，前海开源中证大农业指数分级证券投资基金基金份额净值增长率为5.35%，同期业绩比较基准收益率为4.91%；转型后，自2016年7月20日至报告期末，前海开源沪港深农业主题精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金份额净值增长率为-3.78%，同期业绩比较基准收益率为0.63%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

转型后：

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	113,975,369.12	89.21
	其中：股票	113,975,369.12	89.21
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	3,000,000.00	2.35
	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	10,614,963.84	8.31
8	其他资产	168,390.94	0.13
9	合计	127,758,723.90	100.00

注：权益投资中通过沪港通交易机制投资的港股公允价值为7,381,138.86元，占资产净值比例5.94%。

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	14,056,429.46	11.31
B	采矿业	-	-
C	制造业	70,010,675.18	56.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	500,500.00	0.40
E	建筑业	10,914,380.00	8.78
F	批发和零售业	294,886.76	0.24
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	3,104,358.06	2.50
J	金融业	3,299,400.00	2.65
K	房地产业	1,969,700.00	1.58
L	租赁和商务服务业	580.80	0.00
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,443,320.00	1.97
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	106,594,230.26	85.74

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
工业	1,742,603.28	1.40
日常消费品	2,547,024.77	2.05
金融	911,836.11	0.73
信息技术	1,006,689.17	0.81
公用事业	1,172,985.53	0.94
合计	7,381,138.86	5.94

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	000895	双汇发展	376,381	8,878,827.79	7.14
2	002311	海大集团	514,239	8,520,940.23	6.85
3	300197	铁汉生态	495,000	5,875,650.00	4.73
4	000915	山大华特	110,000	4,934,600.00	3.97

5	002299	圣农发展	190,000	4,755,700.00	3.83
6	000902	新洋丰	376,197	4,740,082.20	3.81
7	600068	葛洲坝	544,000	4,303,040.00	3.46
8	002456	欧菲光	92,800	3,374,208.00	2.71
9	603609	禾丰牧业	226,000	3,265,700.00	2.63
10	000998	隆平高科	163,898	3,256,653.26	2.62

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未参与股指期货投资。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金未参与国债期货投资。

5.10.2 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。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金未参与国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	119,801.35
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	10,560.42
4	应收利息	2,395.17
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	35,634.00
8	其他	-
9	合计	168,390.94

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告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的情况。

5.11.6 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。

转型前：

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	122,723,964.69	92.66
	其中：股票	122,723,964.69	92.66
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	9,534,794.23	7.20
8	其他资产	192,684.91	0.15
9	合计	132,451,443.83	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	26,737,275.83	20.22
B	采矿业	-	-
C	制造业	87,077,246.27	65.87
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	2,818,660.18	2.13
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	2,807,250.57	2.12
L	租赁和商务服务业	3,080,187.84	2.33
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	122,520,620.69	92.68

5.2.2 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	203,344.00	0.15
B	采掘业	-	-
C	制造业	-	-
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	-	-
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	-	-
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	203,344.00	0.15

5.2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

转型前本基金未通过沪港通机制投资港股。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

5.3.1 报告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前十名股票投资明细

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	000895	双汇发展	264,381	5,967,079.17	4.51
2	000876	新希望	587,601	5,159,136.78	3.90
3	002385	大北农	592,743	5,062,025.22	3.83
4	600201	生物股份	164,573	4,820,343.17	3.65
5	000792	盐湖股份	208,733	4,441,838.24	3.36
6	002299	圣农发展	128,895	3,860,405.25	2.92
7	600737	中粮屯河	294,109	3,752,830.84	2.84
8	002470	金正大	433,481	3,680,253.69	2.78
9	002004	华邦健康	387,199	3,635,798.61	2.75
10	000998	隆平高科	167,298	3,347,632.98	2.53

5.3.2 报告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前五名股票投资明细

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	002447	壹桥海参	28,400	203,344.00	0.15

注：本基金本报告期末仅持有以上积极投资股票。

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	76,354.30
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,224.36
5	应收申购款	111,106.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	192,684.91

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告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的情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002447	壹桥海参	203,344.00	0.15	重大资产重组

5.11.6 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。

§ 6 开放式基金份额变动

转型前：前海开源中证大农业指数分级证券投资基金

报告期：（2016年7月1日 - 2016年7月19日）

单位：份

项目	前海开源农业分级	前海开源大农业 A	前海开源大农业 B
报告期期初基金份额总额	113,851,147.18	15,019,424.00	15,019,424.00
报告期期间基金总申购份额	883,235.61	-	-
减:报告期期间基金总赎回份额	1,806,286.74	-	-
报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	30,038,847.00	-15,019,424.00	-15,019,424.00
报告期期末基金份额总额	142,966,943.05	0.00	0.00

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。

转型后：前海开源沪港深农业主题精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

报告期：（2016年7月20日 - 2016年9月30日）

单位：份

基金合同生效日（2016年7月20日）基金份额总额	142,966,943.05
报告期期初基金份额总额	-
报告期期间基金总申购份额	732,469.81
减:报告期期间基金总赎回份额	3,945,941.10
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	139,753,471.76

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。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型后）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型后）

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细（转型后）

本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型前）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型前）

本报告期内基金管理人未持有前海开源农业分级份额。

本报告期内基金管理人未持有前海开源大农业 A 份额。

本报告期内基金管理人未持有前海开源大农业 B 份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细（转型前）

本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

2016年6月8日起至2016年7月6日止，前海开源中证大农业指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，会议审议了《关于前海开源中证大农业指数分级证券投资基金转型相关事宜的议案》，该议案于2016年7月8日表决通过。自2016年7月20日（含当日）起，“前海开源中证大农业指数分级证券投资基金”更名为“前海开源沪港深农业主题精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）”，原《前海开源中证大农业指数分级证券投资基金基金合同》失效，《前海开源沪港深农业主题精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》生效，本基金转型为“前海开源沪港深农业主题精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）”。具体信息详见基金管理人在中国证监会指定媒介发布的相关公告。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- (1) 中国证券监督管理委员会批准前海开源沪港深农业主题精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）设立的文件
- (2) 《前海开源沪港深农业主题精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》
- (3) 《前海开源沪港深农业主题精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）托管协议》
- (4) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- (5) 前海开源沪港深农业主题精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）在指定报刊上各项公告的原稿

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

9.3 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
2016年10月26日