

(八)风险控制委员会负责识别、预防、控制基金运作各个环节的风险全面负责，尤其重点关注投资组合的风险状况；基金经理评估岗及风险管理重点控制基金投资组合的市场风险与流动性风险。

(九)业绩比较基准

本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率×80%+中证金融债指数收益率×20%。

业绩比较基准选择理由：

沪深300指数是由中证指数公司编制发布、表征A股市场走势的权威指数。该指数是由上海和深圳证券交易所中选取30只A股作为样本股票而形成的成份股指数。其样本覆盖了沪深两市六成左右市值的股票，具有良好的市场代表性。本基金选择该指数衡量基金投资股票市场部分的投资绩效。该指数的样本由银行间市场和证券交易所市场的国债、金融债券及企业债券构成，中证指数公司每日计算并发布中证金融债的收益数据以相应的债券属性指标。该指数的一级分类权重按照对平均持仓价格和数量进行了加权处理，能更为真实反映债券的实际价值或权重。本基金选择该指数来衡量债券部分投资的绩效。

根据本基金的资产配置和资产配置约束，设定本基金的基础为沪深300指数收益率×80%+中证金融债收益率×20%，该基准能够客观地衡量本基金的投资绩效。

当后续法律法规发生变化，或有更有代表性的、更能体现市场普遍受影响的业绩比较基准出现时，或者因市场上出现更加适合用于本基金的资金业绩比较基准时，本基金管理人协商基金份额持有人或在征得中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，但不需要召集基金份额持有人大会。

(十)基金风险特征

(1)本基金属于股票型证券，其预期收益及风险水平高于混合基金，债券基金与货币市场基金，属于高风险收益特征的开放式基金。

(七)投资策略

(一)组合管理

本基金的投资组合应遵循以下限制：

(1)本基金股票资产占基金资产的比例为80%-95%；投资于优势蓝筹主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的80%；

(2)本基金股票资产交易日的日均在扣除股指期货合约所需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值5%现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；

(3)本基金持有一家上市公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的10%；

(4)本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的10%；

(5)本基金管理人管理的公募基金持有的同一权证，不得超过该权证的10%；

(6)本基金在任何交易日买入权证的总额，不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%；

(7)本基金持有同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券总额的10%；

(8)本基金持有的所有资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%；

(9)本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券总额的10%；

(10)本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%；

(11)本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%；

(12)本基金应当遵守中国银保监会关于BBB以上（含BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以调整；

(13)本基金参与股指期货交易时，本基金所持仓的多头合约价值不得超过基金总资产，本基金所持有的股票市值和买入股指期货合约价值之和，不得超过基金净资产的95%；

(14)本基金在全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的10%；

(15)本基金在全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为1年，债券到期回购不得展期；

(16)一只基金持有一家上市公司发行的流通受限证券，其市值不得超过基金资产净值的5%；且本基金持有的所有流通受限证券，其市值不得超过基金资产净值的15%；基金管理人和托管人协商一致，可以对此比例进行调整；

(17)本基金管理人管理的全部基金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15%；本基金管理人管理的全部基金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总量的10%；

(18)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%。因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等导致基金资产净值中的因素致使基金不符合前述限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(19)本基金为私募基金资产管理产品且在中国证监会认定的其他主体为对象开展逆回购融资业务，其质押接受标的资产公允价值与融出资金的比例不得超过基金资产净值的10%；

(20)本基金在任何交易日终，持有的买入期货合约价值不得超过基金资产净值的10%；

(21)本基金在任何交易日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的95%；其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

(22)本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，其市值不得超过该证券总市值的20%；本基金管理人应当按照中国期货业协会的要求，格式与时向交易所报告交易数据并持有卖出期货合约情况、交易目的以及对应的证券资产情况等；

(23)本基金所持证券的信用评级应符合国家有关规定，包括短期融资券、中期票据等；

(24)本基金在任何交易日终，持有的买入股指期货合约价值与股指期货持仓价值不得超过上一交易日基金资产净值的20%；

(25)本基金总资产不得超过基金资产净值的140%；

(26)本基金参与股指期货交易和基金合同约定的其他投资限制。

基金管理人运用基金财产进行证券投资时，应当根据风险管理的原则，制定科学合理的投资决策流程和风险控制制度，健全基金管理人内部控制，适当分散投资风险的具体办法，应当符合中国证监会的有关规定。

基金管理人应当在进入股指期货投资之前，应与基金托管人就股指期货清算、估值、交割等事宜另行具体协议。

除上述第(二)、(四)、(七)、(八)(项)外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权集中度过高、支付比例不当等因素使基金投资组合不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内将基金的投资组合比例符合基金合同的约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

如本基金不再受相关限制，基金管理人有权调整，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

(三)禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或活动：

(1)承销证券；

(2)违反规定向他人贷款或提供担保；

(3)从事无限责任的投资；

(4)买卖其他基金份额，但是国务院证券监督管理机构另有规定的除外；

(5)向其基金管理人、基金托管人融资；

(6)从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

(7)法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

法律法规或监管部门以后颁布上述禁止性规定，基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和授权机制，按照市场公平合理价格执行，相关交易必须事先取得基金管理人同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经三分之二以上的独立董事审议通过。基金管理人董事会应当至少每半年对关联交易事项进行一次审查。（八）基金管理人代表基金行使股东权利或债权人权利的原则及方法

1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益。

2、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利，保护基金份额持有人的利益。

(九)基金的融资融券

本基金可以根据有关法律法规和政策的规定进行融资融券。

(十)基金投资组合报告

本基金管理人将按照相关法律法规和政策的有关规定进行融资融券。

基金管理人将根据基金合同约定定期或不定期在指定信息披露平台披露基金投资组合报告，并对内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

基金管理人根据基金合同约定定期或不定期在指定信息披露平台披露基金投资组合报告，并对内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

本投资组合报告所载数据截至2018年9月30日（未经审计）。1.报告期末基金资产组合情况

项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
权益投资	35,964,990.02	88.14
其中：股票	35,964,990.02	88.14
固定收益投资	-	-
其中：债券	-	-
资产支持证券	-	-
贵金属投资	-	-
金融衍生品投资	-	-
买入返售金融资产	-	-
其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
银行存款和结算备付金合计	4,122,533.60	10.10
其他资产	717,494.40	1.76
合计	40,895,018.02	100.00

2.报告期末按行业分类的股票投资组合

1)报告期末按行业分类的股票投资组合

行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
农、林、牧、渔业	-	-
煤炭、石油、天然气	2,830,399.00	6.51
有色金属	14,088,531.56	36.10
医药生物	2,760,193.00	4.53
计算机、电子、通信设备	-	-
建筑与工程	2,025,268.10	5.21
交通运输、仓储和邮政业	-	-
住宿和餐饮业	-	-
信息传输、软件和信息技术服务业	12,133,746.36	31.20
房地产业	2,218,803.00	5.70
租赁和商务服务业	2,288,730.00	3.24
科学研究和技术服务业	-	-
水利、环境和公共设施管理业	-	-
居民服务、修理和其他服务业	-	-
教育	-	-
卫生和社会工作	-	-
文化、体育和娱乐业	-	-
综合	85,964,990.02	92.48

2)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。

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

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(%)
601985	招商银行	450,300	2,598,231.00	6.68
601088	中国神华	124,100	2,530,399.00	6.51
601288	农业银行	600,700	2,360,063.00	6.07
001979	招商港口	118,700	2,218,503.00	5.70
600519	贵州茅台	3,000	2,190,000.00	5.63
601318	中国平安	30,900	2,116,650.00	5.44
601166	兴业银行	120,900	1,728,355.00	4.56
600011	浦发国际	228,300	1,760,193.00	4.53
601601	中国人寿	44,436	1,577,922.36	4.06
600271	航天信息	56,200	1,564,064.00	4.02

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.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。

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。

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。

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。

9.报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

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。

2)本基金报告期内无股指期货交易情况。

10.报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

11.投资组合报告附

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)				
1	存出保证金	21,669.06				
2	应收证券清算款	650,822.72				
3	应收股利	-				
4	应收利息	1,068.30				
5	应收中购款	44,674.32				
6	其他应收款	-				
7	待摊费用	-				
8	其他	-				
9	合计	717,494.40				

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处于转股期的可转换债券。

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。

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。

八、基金的投资

基金管理人依照恪尽职守、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,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现,投资有风险,投资者在前海开源优势蓝筹股票A

基金管理人依照恪尽职守、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,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现,投资有风险,投资者在前海开源优势蓝筹股票A

阶段	份额净值增长率 ①	份额净值增长率 ②	业绩比较基准 ③	业绩比较基准 收益率④	①-③	②-④
基金合同生效日-2015.12.31	7.40%	0.92%	-16.46%	2.19%	23.86%	-1.27%
2016.1.1-2016.12.31	-14.99%	1.67%	-8.42%	1.12%	-6.57%	0.55%
2017.1.1-2017.12.31	32.97%	0.84%	17.08%	0.51%	15.89%	0.33%
2018.1.1-2018.9.30	-19.28%	1.58%	-10.73%	0.98%	-8.53%	0.60%
基金合同生效日-2018.9.30	-2.00%	1.32%	-20.04%	1.26%	18.04%	0.06%

前海开源优势蓝筹股票C

阶段	份额净值增长率 ①	份额净值增长率 ②	业绩比较基准 ③	业绩比较基准 收益率④	①-③	②-④
基金合同生效日-2015.12.31	4.70%	1.04%	-2.45%	2.09%	7.15%	-1.05%
2016.1.1-2016.12.31	-3.92%	0.75%	-8.42%	1.12%	4.50%	0.63%
2017.1.1-2017.12.31	32.70%	0.84%	17.08%	0.51%	15.62%	0.33%
2018.1.1-2018.9.30	-19.40%	1.58%	-10.73%	0.98%	-8.67%	0.60%
基金合同生效日-2018.9.30	7.60%	1.38%	-6.62%	1.16%	14.22%	0.22%

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×80%+中证全指指数收益率×20%。

(一)基金费用的种类

1、基金管理人的管理费;

2、基金托管人的托管费;

3、从C类基金份额的基金财产中计提的销售服务费;

4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;

5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;

6、基金份额持有人大会费用;

7、基金的证券交易费用;

8、基金的银行汇划费用;

9、基金的相关账户的开户及维护费用;

10、按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

(二)基金费用计提方法、计提标准和支付方式

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.00%费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×1.00%÷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,经基金管理人与基金托管人双方

核对无误后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前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。

3、从C类基金份额的基金财产中计提的销售服务费年费率为0.1%。

本基金的销售服务费按前一日C类基金资产净值的0.1%年费率计提。

销售服务费的计算方法如下:

H=E×0.1%÷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个工作日内从基金财产中一次性划出,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。

上述“一、基金费用的种类”中第4—10项费用,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

1、证券账户开户费用:证券账户开户费经基金管理人与基金托管人核对无误后,由产品成立一个内由基金托管人从基金财产中划付,如基金财产余额不足支付该开户费用,由基金管理人于产品成立一个月后的5个工作日内进行补付,基金托管人不承担垫付开户费用义务。

上述开户费用不由基金管理人承担。

下列费用不列入基金费用:

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;

3、《基金合同》生效前的相关费用;

4、其他根据相关法律法规及中国证监会有关规定不得列入基金费用的项目。

(四) 基金管理人及基金托管人可根据基金发展情况,调整基金管理费率、基金托管费率和销售费率等费率水平。降低基金管理费率、基金托管费率和销售费率,须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照有关规定于新的费率实施日前在指定媒介和基金管理人网站上刊登公告。

(五) 基金税收

基金运作过程中涉及的各项纳税主体,其纳税义务按照国家税收法律、法规执行。

十、其他应披露事项

(一)前海开源基金管理有限公司(以下简称“本公司”)的从业人员在前海开源资产管理有限公

(二)本公司总经理、董事蔡颖女士兼任前海开源资管公司董事长;

本公司督察长傅成斌先生兼任前海开源资管公司董事;

本公司风控女士兼任前海开源资管公司监事;

上述人员除在前海开源资管公司领薪外,本公司除上述人员以外未有从业人员在前海开源资管公司兼任任何职务。

(二)2018年04月28日至2018年10月28日披露的公告:

2018-10-24 前海开源优势蓝筹股票型证券投资基金2018年第3季度报告

2018-10-16 关于调整前海开源旗下部分证券投资基金通过基金公理定位业务起点金额的公告

2018-09-29 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

2018-09-13 前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金参加国际金融股份有限公司开通定投业务并参与其费率优惠活动公告的公告

2018-09-03 前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金参加东方财富证券开通定投业务并参与其费率优惠活动公告的公告

2018-08-27 前海开源优势蓝筹股票型证券投资基金2018年半年度报告摘要

2018-08-27 前海开源优势蓝筹股票型证券投资基金2018年半年度报告

2018-08-18 前海开源优势蓝筹股票型证券投资基金基金变更基金经理的公告

2018-07-30 前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加汇林大为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告

2018-07-27 前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加汇林大为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告

2018-07-23 前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加汇林大为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告

2018-07-19 前海开源优势蓝筹股票型证券投资基金2018年第2季度报告

2018-07-16 前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加招商证券为代销机构并开通转换业务和参与其费率优惠活动的公告

2018-07-06 前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加招商证券为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告

2018-06-29 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

2018-06-27 前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加招商证券为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告

2018-06-14 前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加招商证券为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告

2018-06-11 前海开源优势蓝筹股票型证券投资基金招募说明书(更新)(2018年第1号)

2018-05-31 前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加招商证券为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告

2018-05-21 前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加招商证券为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告

2018-05-08 前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加招商证券为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告

2018-05-08 前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加招商证券为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告

十一、备查文件

(一)备查文件包括:

1、中国证监会准予注册前海开源优势蓝筹股票型证券投资基金募集的文件

2、《前海开源优势蓝筹股票型证券投资基金基金合同》

3、《前海开源优势蓝筹股票型证券投资基金托管协议》

4、法律意见书

5、基金管理人业务资格批件、营业执照

6、基金托管人业务资格批件、营业执照

(二)备查文件的存放地点和投资人查阅方式:

1、存放地点:《基金合同》、《托管协议》存放在基金管理人和基金托管人处;其余备查文件存放在基金管理人处。

2、查阅方式:投资人可在营业时间免费到存放地点查阅,也可按文本购买复印件。

十二、对招募说明书更新部分的说明

本基金基金管理人依据《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》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求,结合本基金实际情况对本基金实施的投资管理活动,对本基金的招募说明书进行了更新,主要更新的内容如下:

1、对“基金管理人”相关信息进行了更新。

2、对“基金管理人”相关信息进行了更新。

3、对“相关服务机构”相关信息进行了更新。

4、在“基金的投资”部分,更新了“基金的投资组合报告”、“基金的业绩”相关信息。

5、在“其他应披露事项”部分相关信息进行了更新,披露了期间涉及本基金资产。

6、对本部分表述进行了更新。

前海开源基金管理有限公司

二〇一八年十二月十一日