

前海开源安全核心精选灵活配置混合型证券投资基金2019年第二季度报告

2019-06-30

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

报告送出日期：2019-07-16

重要提示

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责任。
基金管理人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2019年7月12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预示其未来表现，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。
本报告自2019年4月1日起至2019年6月30日止。

基金基本情况

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 数值 (Value). Includes fields like 基金名称 (Qihai Open Safe Core Selection Flexible Allocation Hybrid Fund), 场内简称 (场内简称), 基金代码 (Fund Code), 基金运作方式 (Fund Operation Mode), 基金合同生效日 (Fund Contract Effective Date), 报告期末基金份额总额 (Report End Total Share Amount), 投资目标 (Investment Objective), 投资策略 (Investment Strategy), 业绩比较基准 (Benchmark), 风险收益特征 (Risk and Return Characteristics), 基金管理人 (Fund Manager), 基金托管人 (Fund Custodian).

主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标 (Main Financial Indicators) and 报告期 (2019-04-01至2019-06-30) (Reporting Period). Includes 本期已实现收益 (Realized Income), 本期利润 (Current Profit), 加权平均基金份额本期利润 (Weighted Average Profit per Share), 期末基金资产净值 (End of Period Net Assets), 期末基金份额净值 (End of Period Net Asset Value).

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。

基金净值表现

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

Table with 7 columns: 阶段 (Period), 净值增长率① (Net Value Growth Rate), 净值增长率标准差② (Net Value Growth Rate Standard Deviation), 业绩比较基准收益率③ (Benchmark Return), 业绩比较基准收益率标准差④ (Benchmark Return Standard Deviation), ①-③ (Difference), ②-④ (Difference). Includes data for 过去三个月 (Last 3 Months).

注：本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×70%+中证全指指数收益率×30%。

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



其他指标

Table with 2 columns: 其他指标 (Other Indicators) and 报告期 (2019-04-01至2019-06-30) (Reporting Period). Includes 其他指标 (Other Indicators) and 报告期 (2019-06-30).

注：无。

基金经理 (或基金经理小组) 简介

Table with 5 columns: 姓名 (Name), 职务 (Position), 任本基金的基金经理期限 (Tenure as Fund Manager), 证券从业年限 (Years of Securities Industry Experience), 说明 (Remarks). Lists 董斌 (Dong Bin) as the fund manager.

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。

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》及其各项实施准则、本基金《基金合同》和其他相关法律法规的规定，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，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益，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。

公平交易专项说明

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。

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。

报告期内基金的投资策略和运作分析

2019年第二季度美国经济的景气程度持续疲弱，延续了2018年4季度以来的下行趋势。欧洲、美联储的货币政策出现了转向的迹象。国内经济经历了1季度的反复以后，2季度再度回暖，最新公布的中国景气指标回到了50以下。总体来说，上半年中国经济处于低位企稳的区间。本基金主题是“国家安全”，其核心为保障国防、信息安全等相关的领域，这是我们未来主要配置的行业，我们会主题选择长期优秀的标的，争取获得超额收益。

报告期内基金的业绩表现

截至报告期末前海开源安全核心精选灵活配置混合型证券投资基金净值为0.973元，本报告期内，基金份额净值增长率为8.29%，同期业绩比较基准收益率为0.58%。

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基金资产净值低于五千万元的情形。

投资组合报告

报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 项目 (Item), 金额 (元) (Amount in RMB), 占基金总资产的比例 (%) (Percentage of Total Assets). Lists categories like 权益类投资 (Equity Investment), 固定收益投资 (Fixed Income Investment), 资产支持证券 (Asset-Backed Securities), 金融衍生品投资 (Financial Derivatives Investment), 买入返售金融资产 (Repurchase Agreements), 其他资产 (Other Assets).

报告期末按行业分类的股票投资组合

报告期末按行业分类的境内股票投资组合

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 行业类别 (Industry Category), 公允价值 (元) (Fair Value in RMB), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Assets). Lists various industry categories like 农林牧渔 (Agriculture, Forestry, Animal Husbandry, Fishing), 医药 (Pharmaceuticals), 食品饮料 (Food and Beverage), etc.

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

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量 (股) (Quantity in Shares), 公允价值 (元) (Fair Value in RMB), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Assets). Lists top 10 stocks like 中航光电 (AVIC Optoelectronics), 四创电子 (SICR Electronics), etc.

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 债券品种 (Bond Type), 公允价值 (元) (Fair Value in RMB), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Assets). Lists 国家债券 (Government Bonds), 央行票据 (Central Bank Bills), etc.

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

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 债券代码 (Bond Code), 债券名称 (Bond Name), 数量 (张) (Quantity in Tens of Thousand), 公允价值 (元) (Fair Value in RMB), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Assets). Lists 0319611 (19国债01).

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

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

注：本基金本报告期末未持有权证。

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

Table with 6 columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Position), 合约市值(元) (Contract Value in RMB), 公允价值变动(元) (Fair Value Change in RMB), 风险说明 (Risk Statement). Shows no active positions.

报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

基金投资组合报告的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，合理之和与合计可能有尾差。

开放式基金份额变动

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 数量 (Quantity). Shows 报告期初基金份额总额 (Report Start Total Share Amount), 报告期间基金份额申购份额 (Report Period Share Subscription), etc.

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 基金份额 (Share Amount). Shows 报告期初管理人持有的基金份额 (Report Start Share Amount Held by Manager), etc.

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 交易方式 (Transaction Mode), 交易日期 (Transaction Date), 交易份额 (份) (Share Amount), 交易金额 (元) (Transaction Amount in RMB), 适用费率 (Applicable Rate).

报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

Table with 5 columns: 项目 (Item), 持有份额总数 (Total Share Amount), 发起份额总数 (Initiated Share Amount), 发起份额占基金总份额比例 (Percentage of Total Shares), 发起份额承诺持有年限 (Commitment Holding Period).

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

Table with 6 columns: 投资者类别 (Investor Category), 序号 (Serial Number), 持有基金份额比例达到或超过20%的时间区间 (Time Interval), 期初份额 (Start Share Amount), 申购份额 (Subscription Share Amount), 赎回份额 (Redemption Share Amount), 持有份额 (Current Share Amount), 份额占比 (Percentage).

注：无。

影响投资者决策的其他重要信息

1、2019年4月14日，由中国证券报主办的第十六届中国基金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主题B灵活配置混合型证券投资基金(基金代码：001303)荣获“三年期开放式混合型持续优胜金牛基金”。

备查文件目录

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

存放地点

基金管理人、基金托管人处

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) 投资者对本基金如有疑问，可咨询本基金管理人前海开源基金管理有限公司，客户服务热线：4001-666-998(免长途话费)
(3) 投资者可访问本基金管理人网站，网址：www.qhkyfund.com