

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。
本报告所载资料未构成任何投资建议，投资者应当认真阅读本报告，投资者在作出投资决策前应参阅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 (前海开源大安全混合), 场内简称 (000869), 基金运作方式 (契约型开放式), 基金合同生效日 (2015-02-06), 报告期末基金份额总额 (244,615,938.93), 投资目标, 投资策略, 业绩比较基准 (沪深300指数收益率\*70%+中证全指指数收益率\*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).

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). Includes 本期已实现收益 (5,044,275.47), 本期利润 (-21,604,765.78), 加权平均基金份额本期利润 (-0.0876), 期末基金资产净值 (238,033,047.85), 期末基金份额净值 (0.973).

基金净值表现

Table with 7 columns: 阶段 (Period), 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. Includes data for 过去三个月 (过去三个月) and 过去一年 (过去一年).

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). Includes 基金管理人及基金托管人履行诚信义务的说明 (Statement of integrity of the fund manager and custodian).

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 曹楠 (Cao Nan) as the fund manager.

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、本基金《基金合同》及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
本基金在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。短端的、美联储的货币政策出现了转向的迹象。而国内经济经历了1季度的反复以后，2季度再度回暖，最新公布的PMI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，我们会主动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大安全混合基金份额净值为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着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 Yuan), 占基金总资产的比例 (%) (Percentage of Total Assets). Lists 权益类投资 (216,960,951.44), 固定收益投资 (13,450,231.20), 资产支持证券 (13,450,231.20), 基金投资, 金融衍生品投资, 买入返售金融资产, 其他金融资产, 银行存款和结算备付金合计 (8,441,012.03), 其他资产 (208,027.05), 合计 (239,060,221.72).

报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 行业类别 (Industry Category), 公允价值 (元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Assets). Lists 农林牧渔, 医药, 制造业, 信息技术, 金融, 房地产, 其他, 合计 (216,960,951.44).

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 Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Assets). Lists 中航光电, 四创电子, 启明星辰, 海格通信, 中航股份, 国睿科技, 浪潮微, 三安光电, 中航飞机, 中航电器.

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 Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Assets). Lists 国家债券 (13,450,231.20), 央行票据, 金融债券, 企业债券, 中期票据, 可转债 (可交换债), 同业存单, 其他, 合计 (13,450,231.20).

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 Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Assets). Lists 019801.

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有资产支持证券投资。

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有贵金属投资。

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未有权证投资。

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 Yuan), 公允价值变动(元) (Fair Value Change in Yuan), 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

本基金本报告期末未投资国债期货。

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table with 5 columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Position), 合约市值(元) (Contract Value in Yuan), 公允价值变动(元) (Fair Value Change in Yuan), 风险指标说明 (Risk Indicator). Shows no active positions.

报告期末本基金投资的股指期货投资评价

本基金本报告期末未投资股指期货。

投资组合报告附注

受处罚基金及处罚情况
本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有受到监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库
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。

Table with 3 columns: 序号 (Serial Number), 名称 (Name), 金额 (元) (Amount in Yuan). Lists 存出保证金 (27,283.20), 应收证券清算款 (0), 应收股利 (0), 应收利息 (182,189.79), 其他应收款 (0), 其他 (0), 其他 (0), 合计 (208,027.05).

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注：本基金本报告期末未有可转换债券。

报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

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，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). Lists 报告期期初基金份额总额 (250,837,538.07), 报告期期间基金总申购份额 (6,913,785.70), 减：报告期期间基金总赎回份额 (13,135,392.95), 报告期期间基金净申购份额 (申购减少“-”填列) (0), 报告期末基金份额总额 (244,615,938.93).

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). Lists 报告期末基金管理人持有的基金份额 (0), 报告期末基金管理人持有的基金份额 (0), 报告期末基金管理人持有的基金份额 (0), 报告期末基金管理人持有的基金份额 (0).

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 Shares), 发起份额总数 (Initiated Shares), 发起份额占基金总份额比例 (Percentage of Total Shares), 发起份额承诺持有期限 (Commitment Period). Lists 基金管理人自有资金, 基金管理人高级管理人员, 基金管理人基金经理, 基金管理人股东, 其他, 合计.

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 Shares), 申购份额 (Purchase Shares), 赎回份额 (Redemption Shares), 持有份额 (Current Shares), 份额占比 (Percentage). Shows no instances.

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”。
2、本报告期内，基金管理人于2019年6月21日在中国证监会指定媒介上发布《前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资于科创板股票的公告》，本基金可参与科创板股票的投资，投资者敬请查阅基金管理人投资科创板基金组合公告上的有关公告。

备查文件目录

- (1) 中国证监会核准前海开源大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) 《前海开源大安全核心精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
(3) 《前海开源大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) 前海开源大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