前海开源沪港深蓝筹精选灵活配置混合型证券投资基金2019年第2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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2019-07-18

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、误导性陈述或者重大遗漏，并对报告内容的真实性、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。

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。

投资有风险，请投资人在作出投资决策前仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告内容摘要来自全文，投资者欲了解详情，请认真阅读本基金的季度报告全文。

本报告财务指标和净值表现的数据截至2019年6月30日。

基金基本情况

	概述
基金简称	前海开源沪港深蓝筹精选混合
交易代码	005827
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015-12-08
报告期末基金份额总额	2,126,748,101.60
投资目标	本基金主要投资于沪深港股市场内的具有较高盈利潜力的优质上市公司股票，通过投资于蓝筹股，在控制风险的前提下，获取长期稳定的资本增值收益。
投资策略	1、资产配置策略 本基金综合运用宏观经济分析方法，在对宏观经济环境及其变化分析的基础上，判断宏观经济周期的运行，根据经济周期的变化，动态调整资产配置，在合理控制风险的前提下，以期获取长期稳定的资本增值收益。 2、行业配置策略 本基金根据宏观经济周期，在长期趋势、结构转型、政策导向等因素的基础上，分析不同行业的配置比例，此外，对行业内部的竞争格局、盈利能力、估值水平等因素进行分析，根据其长期盈利潜力和估值水平，动态调整行业配置比例。 3、个股配置策略 本基金根据宏观经济周期，自下而上精选个股，个股选择方面，本基金将从盈利、估值、成长性、流动性等方面进行综合考虑，选择具有较高盈利潜力、较低估值、较高成长性、较高流动性的优质上市公司股票。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×25%+恒生指数收益率×75%（港元换算为人民币计算）×25%+中证全债指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益高于本基金下属债券型基金，属于较高风险、较高收益的品种。主要投资于中国大陆证券市场及香港证券市场，本基金面临汇率风险和香港证券市场风险。本基金通过深入研究国内外宏观经济形势、国内证券市场及香港证券市场的运行特点，在有效控制风险的前提下，通过灵活的资产配置、行业配置、个股选择，力争获取较高的超额收益。
基金管理人	前海开源基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2019-04-01 至 2019-06-30）
本期已实现收益	-16,404,897.17
金额单位	元
期末可供出售金融资产期初数	0.00
期末基金资产净值	2,126,747,816.44
期末基金份额净值	1.000

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类费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

②本期已实现收益指本期利息收入、投资收益、其他收入扣除公允价值变动损益后的余额，本期间内未发生任何应分配给持有人的收益。

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

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
过去三个月	-5.82 %	1.39 %	0.17 %	0.88 %	-5.99 %	0.50 %

注：本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率×25%+恒生指数收益率（港元换算）×75%+中证全债指数收益率×50%。

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的比较

其他指标

单位：人民币元

其他指标	报告期（2019-04-01至2019-06-30）
其他指标	0.00

注：无。

基金经理（投资总计理之日）简介

姓名	职务	任本基金基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
郑晓	本基金的基金经理，公司董事总经理，国际业务总监兼投资总监，投资委员会主席。	2015-12-08	-	19Y	郑晓先生，清华大学博士研究生，拥有注册金融管理师证书和证券从业资格证书，基金经理资格，曾为多家知名基金公司管理过投资组合，投资经验丰富，拥有证券从业年限19年，投资业绩优秀，投资风格稳健。

注：①证券从业年限计算标准：以证券业协会公布的《证券从业人员名单》中的时间为准。②任职日期：指本基金基金经理对本基金的投资决策生效日期。③离任日期：指本基金基金经理对本基金的投资决策失效日期。

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》及其相关法规规则，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，为投资者谋取利益。报告期内，基金运作整体合规合法，没有违规行为发生。

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》，注重在研究决策、投资指令下达、交易执行、资产估值等环节的控制和监督力度，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

本基金不存在报告期内异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的投资组合均为证券投资基金及股票型证券投资基金，投资风格稳健，投资决策独立，投资指令下达、交易执行、资产估值等环节均有严格的控制和监督，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

报告期内基金投资策略和业绩表现说明

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》及其相关规定，本基金《基金合同》所规定的投资目的和投资方向，在严格控制风险的基础上，为投资者谋取利益。报告期内，基金运作整体合规合法，没有违规或违反合同行为的情况发生。报告期内，投资决策独立，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

报告期内基金持有的股票投资情况

报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	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	-	-
C	制造业	1,455,816,651.52	68.38
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	1,455,816,651.52	68.38

注：报告期末按申万行业分类统计。

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	603799	华友钴业	700,000	155,155,700.00	7.29
2	300003	乐普医疗	21,905,000	155,050,590.00	7.28
3	603993	洛阳钼业	12,818,000	148,108,713.70	6.96
4	002304	洋河股份	1,100,000	117,481,439.72	5.52
5	002415	海康威视	3,400,000	115,566,000.72	5.43
6	300015	爱尔眼科	21,100,000	115,155,599.92	5.41
7	002340	格林美	24,504,000	115,902,644.80	5.45
8	000333	美的集团	1,900,000	115,406,107.72	5.42
9	002714	牧原股份	3,432,000	117,371,571.42	5.51
10	002557	洽洽食品	3,900,000	107,901,855.72	5.07

注：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。

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债(含分离交易可转债)	-	-
7	资产支持证券	-	-
8	其他	-	-
9	合计	-	-

注：报告期末按债券品种分类统计。

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资产支持证券投资明细

序号	证券代码	证券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
-	-	-	-	-	-

注：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资产支持证券投资明细。

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

序号	贵金属代码	贵金属名称	数量（盎司）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
-	-	-	-	-	-

注：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。

报告期末按照证券品种分类的衍生品投资明细

序号	衍生品类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
-	-	-	-

注：报告期末按照证券品种分类的衍生品投资明细。

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期末本基金投资股指期货的持仓情况说明

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约价值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
公允价值变动总额合计（元）			-	-	
股指期货投资本期收益（元）			-	-	
股指期货投资本期公允价值变动（元）			-	-	

注：报告期末本基金投资股指期货的交易情况说明。

本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未从事股指期货。

报告期末本基金投资国债期货交易情况说明

报告期末本基金投资国债期货的持仓情况

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约价值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
公允价值变动总额合计（元）			-	-	
国债期货投资本期收益（元）			-	-	
国债期货投资本期公允价值变动（元）			-	-	

注：报告期末本基金投资国债期货的交易情况说明。

本基金投资国债期货的投资政策

本基金本报告期末未从事国债期货。

投资组合报告附注

受到谴责的证券说明

报告期内，本基金投资的前一名股票“康泰生物”（证券代码300601）于2018年2月因涉嫌违反证券市场相关法规被监管部门立案调查，因其投资编制行业一年内受到谴责，处罚到期。

本基金投资一家证券投资咨询机构所对应的股票代码为300601的股票。

中明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

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。

其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	交易保证金	149,208.94
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	11,955,409.94
4	应收利息	96,916.44
5	应收申购款	398,411.34
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,479,946.66

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：报告期末本基金持有处于转股期的可转换债券。

报告期末前十名流通受限股票投资明细

注：报告期末本基金前十名流通受限股票投资明细。

报告期末基金投资的前十名股票中存在超过一定期限未公开披露重大事项的说明

注：报告期末本基金投资的前十名股票中存在超过一定期限未公开披露重大事项的情况。

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，投资组合报告分项之和与合计可能有尾差。

开放式基金份额变动

单位：份

	数量
报告期期初基金份额总额	1,126,228,880.80
报告期期间基金总申购份额	100,426,359.30
报告期期间基金总赎回份额	100,280,102.50
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	2,126,748,101.60

注：①申购份额含红利再投、转换入份额；②赎回份额含转出份额。

基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

项目	基金份额
报告期期初管理人持有的本基金份额	-
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	-
报告期期末持有的基金份额占基金总份额比例(%)	-

注：本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金情况。

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期（日）	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
无					

注：本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、交易本基金份额。

报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人持有的基金份额	-	-	-	-	-
基金管理人持有的基金份额占比	-	-	-	-	-
基金管理人持有的基金份额占比区间	-	-	-	-	-

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	序号	报告期内持有基金份额比例达到或超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	期末份额	报告期末持有基金情况	
							持有份额	份额占比
机构	1	2019-04-01至2019-06-30	1,126,228,880.80	-	-	1,126,228,880.80	1,126,228,880.80	52.96%
个人	-	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

注：无。

影响投资者决策的其他重要信息

1、2019年5月31日，由中国证券登记结算有限公司深圳分公司的第六届董事会第一次决议通过，深圳证券交易所第六届理事会第一次会议通过，深圳证券交易所第六届监事会第一次会议通过，2019年6月3日，中国证监会核准，中国证券登记结算有限公司深圳分公司第六届董事会、监事会成员任职资格的决定，中国证券登记结算有限公司深圳分公司第六届董事会、监事会成员任职资格的决定，自2019年6月3日起，中国证券登记结算有限公司深圳分公司第六届董事会、监事会成员任职资格生效。

2、本报告期内，基金管理人对公司内部组织结构进行了调整，主要内容为：1）将原“投资决策委员会”调整为“投资委员会”；2）将原“投研部”调整为“投研一部”；3）将原“投研二部”调整为“投研二部（海外投资）”；4）将原“交易部”调整为“交易部（股票）”；5）将原“交易部（债券）”调整为“交易部（固定收益）”；6）将原“风控稽核部”调整为“风控稽核部（风险管理）”；7）将原“产品开发部”调整为“产品开发部（产品管理）”；8）将原“基金运营部”调整为“基金运营部（运营管理）”；9）将原“信息技术部”调整为“信息技术部（数字化运营）”；10）将原“综合管理部”调整为“综合管理部（人力资源）”；11）将原“投研部”调整为“投研一部”；12）将原“投研二部”调整为“投研二部（海外投资）”；13）将原“交易部（股票）”调整为“交易部（股票）”；14）将原“交易部（债券）”调整为“交易部（固定收益）”；15）将原“风控稽核部”调整为“风控稽核部（风险管理）”；16）将原“产品开发部”调整为“产品开发部（产品管理）”；17）将原“基金运营部”调整为“基金运营部（运营管理）”；18）将原“信息技术部”调整为“信息技术部（数字化运营）”；19）将原“综合管理部”调整为“综合管理部（人力资源）”。

备查文件目录

1）中国证监会核准本基金募集的文件

2）《前海开源沪港深蓝筹精选灵活配置混合型证券投资基金合同》

3）《前海开源沪港深蓝筹精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

4）《前海开源沪港深蓝筹精选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》

5）基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

6）报告期内根据规则披露的有关临时公告及基金份额持有人申请公告的稿件

存放地点

基金管理人、基金托管人处所

咨询方式

1）投资者可以登录公司网站查询，也可通过本报告披露的管理人信息，客户服务电话：4001-666-0008（电话通话费）

2）投资者可以登录基金管理人官方网站：网址：www.qhfund.com