

前海开源沪深300指数型证券投资基金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：中国农业银行股份有限公司
报告送出日期：2019-07-16

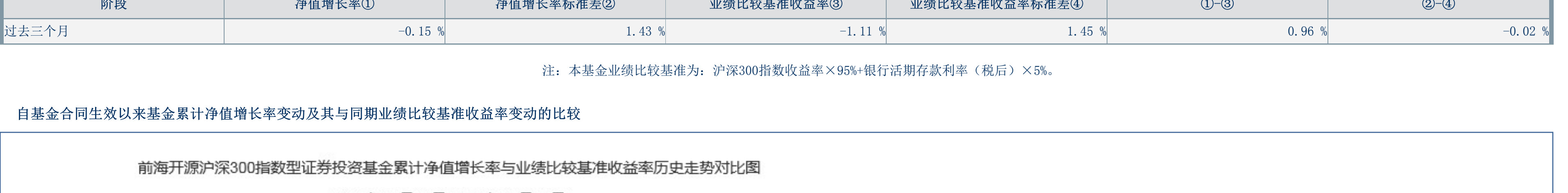
目录全部展开 目录全部收起
基金基本情况
主要财务指标和基金净值表现
主要财务指标
基金净值表现
基金管理人报告
公平交易制度的执行情况
报告期内基金的投资策略和业绩表现
报告期内基金管理人及基金经理等人员履行职责的情况
报告期内基金资产净值变动情况的说明
基金管理人承诺
基金托管人承诺
基金销售机构承诺
基金管理人承诺
基金托管人承诺
基金销售机构承诺

重要提示
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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失。
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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

基金基本情况
项目 数据
基金简称 前海开源沪深300指数
基金代码 000856
基金运作方式 契约开放式
基金合同生效日 2014-06-17
报告期末基金份额总额 37,414,642.92
投资目标 本基金采用数量化投资策略，紧密跟踪沪深300指数，在严格控制基金日均跟踪偏离度和年度跟踪误差的前提下，力争获取与标的指数相类似的投资收益。

主要财务指标
主要财务指标 报告期(2019-04-01至2019-06-30) 单位：人民币元
本期已实现收益 953,426.21
本期净利润 493,929.69
加权平均基金份额本期利润 0.0232
期末基金资产净值 48,478,968.02
期末基金份额净值 1.300

基金净值表现
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 -0.15% 1.83% -1.11% 1.45% 0.96% -0.02%



其他指标
其他指标 报告期(2019-04-01至2019-06-30) 单位：人民币元
其他指标 报告期(2019-06-30)

基金管理人、基金经理、基金经理助理
姓名 职务 任本基金基金经理时间 任职日期 离任日期 证券从业年限 说明
付海宁 本基金的基金经理、公司投资副总监 2017-02-14 - 9年 付海宁先生，硕士研究生，2009年至2010年担任摩根士丹利基金分析师，2010年-2012年担任美国美林量化风险分析师，2013年至2015年担任美国标准普尔资产管理、投资组合、2015年11月加盟前海开源基金管理有限公司，现任公司投资副总监。

管理人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》及其各项配套法规、本基金《基金合同》和其他有关法律、法规和基金合同的约定，勤勉尽责、诚实守信，按照基金合同的约定，独立、客观、公正地履行职责，切实维护基金份额持有人的合法权益，没有损害基金份额持有人的利益。基金的投资运作符合有关法律法规及基金合同的约定。

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《证券投资基金管理人公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统化人工等各种方式在各业务环节严格控制系统公平执行，公平对待所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
根据基金合同约定，跟踪沪深300指数，力争为投资者提供投资沪深300指数的工具。

报告期内基金的业绩表现
截至报告期末前海开源沪深300指数基金份额净值为1.300元，本报告期内，基金份额净值增长率为-0.15%，同期业绩比较基准收益率为-1.11%。

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的情形。
本基金本报告期内，2019年4月29日至2019年6月28日连续11个工作日基金份额净值低于五元。

投资组合报告
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 权益类投资 48,394,390.74 99.89
2 固定收益投资 2,140,283.40 4.40
3 贵金属投资 - -
4 金融衍生品投资 - -
5 买入返售金融资产 - -
6 银行存款和结算备付金合计 1,248,687.30 2.54
7 其他资产 294,936.56 0.60
8 合计 49,078,297.94 100.00

报告期末指数投资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 658,128.40 1.35
B 采矿业 1,864,966.24 3.80
C 制造业 17,861,880.98 36.86
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 1,070,580.94 2.17
E 建筑业 1,376,312.72 2.83
F 批发和零售业 619,404.23 1.27
G 交通运输、仓储和邮政业 1,377,671.09 2.83
H 住宿和餐饮业 - -
I 信息传输、软件和信息技术服务业 1,634,972.55 3.36
J 金融业 15,343,630.83 31.52
K 房地产业 2,061,548.23 4.25
L 租赁和商务服务业 - -
M 科学研究和技术服务业 625,292.38 1.28
N 水利、环境和公共设施管理业 34,672.00 0.07
O 居民服务、修理和其他服务业 53,906.80 0.11
P 教育 - -
Q 卫生和社会工作 - -
R 文化、体育和娱乐业 228,718.53 0.47
S 综合 240,741.00 0.43
合计 44,669,943.87 91.76

报告期末积极投资行业分类的股票投资组合
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 - -
B 采矿业 80,111.52 0.16
C 制造业 206,898.00 0.43
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 21,827.00 0.05
E 建筑业 72,816.32 0.15
F 批发和零售业 70,511.09 0.14
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 96,038.68 0.20
J 金融业 112,062.80 0.23
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 30,347.46 0.06
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 724,446.87 1.49

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 601318 中国平安 39,389 3,479,626.09 7.15
2 600519 贵州茅台 1,865 1,835,160 3.77
3 600036 招商银行 37,403 1,345,759.94 2.76
4 601166 兴业银行 53,097 971,144.13 1.99
5 000851 格力电器 17,600 868,000 1.79
6 600333 招商局 19,902 876,537.72 1.80
7 000858 五粮液 7,101 837,562.95 1.72
8 600276 恒瑞医药 11,290 716,160 1.47
9 600887 伊泰集团 22,128 739,229.66 1.53
10 600030 中信证券 28,763 684,847.03 1.41

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
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 000739 辽宁成大 5,008 72,816.32 0.15
2 002797 宋都股份 9,620 60,990.8 0.13
3 600839 山东黄金 12,952 82,087.04 0.17
4 600549 厦门钨业 3,620 51,802.2 0.11
5 600969 南京证券 7,800 51,012 0.10

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 2,140,283.40 4.40
其中：政策性金融债 2,140,283.40 4.40
4 企业债券 - -
5 企业短期融资券 - -
6 中期票据 - -
7 可转债(可交换债) - -
8 同业存单 - -
9 其他 - -
10 合计 2,140,283.40 4.40

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
序号 股票代码 债券代码 债券名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)
1 106803 国开1804 21,398 2,140,283.4 4.40
注：本基金本报告期末持有上述债券。

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
注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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
报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
代码 名称 持仓量(买/卖) 合约市值(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：本基金本报告期末未投资股指期货。

本基金股指期货投资的投资政策
本基金本报告期末未投资股指期货。

报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
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。

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
代码 名称 持仓量(买/卖) 合约市值(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：本基金本报告期末未投资国债期货。

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。

投资组合报告附注
受到处罚及处罚情况
本报告期内，本基金管理人及基金经理等人员均无受到监管部门公开谴责、警告、处罚的情况。

申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库
本基金投资的前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票库。

其他资产构成
序号 名称 金额(元)
1 存出保证金 45,221.01
2 应收证券清算款 0
3 应收股利 0
4 应收利息 54,069.38
5 应收申购款 195,640.11
6 其他应收款 -
7 待摊费用 -
8 其他 -
9 合计 294,936.50

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持有可转换债券。

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

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，分项之和与合计可能有尾差。

开放式基金份额变动
单位：份
项目 数量
报告期期初基金份额总额 25,143,296.80
报告期期末基金份额总额 37,414,642.92
报告期期间基金总申购份额 37,893,557.04
减：报告期期间基金总赎回份额 24,822,210.92
报告期期间基金净申购份额(份额减少以“-”填列) 6 0
报告期末基金份额总额 37,414,642.92
注：总申购份额含红利再投、转换入份额、总额赎回份额转出转出份额。

基金管理人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 交易金额(份) 交易金额(元) 适用费率
合计 - - - - -
注：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。

报告期末发起式基金发起资金持有份额情况
项目 持有份额总额 持有份额占基金总份额比例 发起份额总额 发起份额占基金总份额比例 发起份额承诺持有期限
基金管理人报告资金 - % - - -
基金管理人高级管理人员 - - - - -
基金管理人其他人员 - - - - -
基金管理人其他 - - - - -
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
投资者类别 序号 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 持有份额 份额占比
机构 - - - - -
个人 - - - - -
注：无。

影响投资者决策的其他重要信息
1、2019年4月1日，由中国证监会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稳基金4、双债配置混合型证券投资基金(基金代码：001103)荣获“三年期开放式主动管理型优质金牛基金”。
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网站上发布《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》，本基金本着谨慎和风险可控的原则，参与科创板股票投资，投资者敬请阅读基金管理人刊登在中国证监会指定网站上的有关公告。

备查文件目录
(1) 中国证监会基金部备案前海开源沪深300指数型证券投资基金设立的文件
(2) 《前海开源沪深300指数型证券投资基金基金合同》
(3) 《前海开源沪深300指数型证券投资基金托管协议》
(4) 《基金管理人业务规则、基金投资和公司章程》
(5) 《前海开源沪深300指数型证券投资基金在指定网站上各项公告的汇编

存放地点
基金管理人、基金托管人
查阅方式
(1) 投资者可在营业时间内免费查阅，也可按工本费申请复印件
(2) 投资者对本报告如有疑问，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：4001-668-998(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