

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：交通银行股份有限公司
报告截止日期：2019-07-16

重要提示

基金管理人承诺严格遵守法律法规及基金合同的规定，恪守诚信、勤勉尽责，切实维护基金份额持有人的合法权益。基金管理人承诺严格遵守法律法规及基金合同的规定，恪守诚信、勤勉尽责，切实维护基金份额持有人的合法权益。基金管理人承诺严格遵守法律法规及基金合同的规定，恪守诚信、勤勉尽责，切实维护基金份额持有人的合法权益。

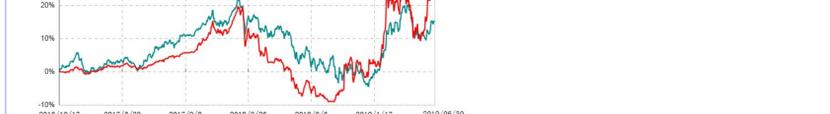
基金基本情况
项目 数值
基金名称 前海开源沪港深核心资源混合
基金代码 903301
基金运作方式 契约开放式
基金合同生效日 2016-10-17
报告期末基金份额总额 45,603,566.55
投资目标 本基金主要通过精选投资于核心资源相关证券，在合理控制风险并保障基金资产良好流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。

主要财务指标
主要财务指标 本基金(元) 前海开源沪港深核心资源混合(A类) 2019-01-01 - 2019-06-30 前海开源沪港深核心资源混合(C类) 2019-04-01 - 2019-06-30
本期已实现收益 1,036,945.38 2,702,684.01
本期净利润 994,144.52 3,490,284.14
加权平均基金份额本期利润 0.0814 0.1889
期末基金份额净值 18,434,286.18 38,824,586.98
期末基金份额净值 1.262 1.258

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

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

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



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

基金经理(或基金经理小组)简介
姓名 职务 在任本基金基金经理年限 证券从业年限 说明

基金管理人内部控制制度的说明
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》及其他法律法规、基金《基金合同》和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，为基金份额持有人谋求最大利益。

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》，完善相关制度及流程，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
本报告期本基金不存在异常交易行为，本报告期内基金管理人管理的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没有超过该证券当日成交量5%的情况。

报告期末基金的投资策略和运作分析
2季度，宏观经济数据企稳，通胀数据再次回升，房地产销售数据走弱，汽车家电消费一直低迷，仅有必需消费数据相对较好。随着1季度社融增速以及央行降准的较快反弹，4月信贷社融再次转弱，叠加贸易战压力再起，股市承压，权益高估回调。在此期间，全球宏观经济持续低迷，黄金价格持续走强。

报告期末基金的投资表现
截至报告期末前海开源沪港深核心资源混合基金份额净值为1.262元。本报告期内，该类基金份额净值增长率为6.72%，同期业绩比较基准收益率为-0.50%。截至报告期末前海开源沪港深核心资源混合基金份额净值为1.258元。本报告期内，该类基金份额净值增长率为6.67%，同期业绩比较基准收益率为-0.50%。

报告期末基金持有人户数或基金份额净值说明
本报告报告期内，自2019年4月1日至2019年6月30日止期间基金资产净值低于五万元。
本报告报告期内，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情形。

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(%)

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(%)

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(%)

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(%)

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 债券代码 债券名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

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权证投资明细
序号 权证代码 权证名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

报告期末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量和损益明细

报告期末基金投资的国债期货交易情况说明
报告期末本基金投资的国债期货持仓量和损益明细

投资组合报告附注
受到处罚以及处罚情况
本报告期基金及基金管理人的主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

其他资产构成
序号 名称 金额(元)

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
序号 名称 金额(元)

报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
序号 名称 金额(元)

投资组合报告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误差。

开放式基金份额变动
项目 前海开源沪港深核心资源混合 前海开源沪港深核心资源混合A 前海开源沪港深核心资源混合C

基金管理人持有本基金份额变动情况
项目 前海开源沪港深核心资源混合 前海开源沪港深核心资源混合A 前海开源沪港深核心资源混合C

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 交易价格(份) 交易金额(元) 说明

报告期末按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 发起份额来源持有期限

报告期末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%的期间 期初份额 申购份额 赎回份额 报告期末持有基金份额 持股比例

影响投资决策的其他重要信息
1. 2019年4月1日，由中国人民银行主办的第十六届中国基金业金牛奖评选颁奖典礼，前海开源基金管理有限公司荣获“金牛基金管理公司”、“公募基金服务用户满意度最佳公募基金(基金代码：901103荣获“三年新开放式混合类最佳权益类金牛基金”。

备查文件目录
(1) 中国证券监督管理委员会备案的前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金设立的文件
(2) 《前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
(3) 《前海开源沪港深核心资源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) 前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金在指定网站上各项公告的披露

存放地点
基金管理人、基金托管人处

查阅方式
(1) 投资者可在业务时间内免费查阅，也可按工本费查阅复印件
(2) 投资者对本报告书如有疑问，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：4001-666-988(免长途费)
(3) 投资者可访问本基金管理人公司网站，网址：www.qhkyfund.com