

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：兴业银行股份有限公司

报告送出日期：2019-07-16

重要提示

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，并不得以任何形式为基金份额持有人谋取不正当利益，或者从事其他损害基金份额持有人合法权益的活动。
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，并不得以任何形式为基金份额持有人谋取不正当利益，或者从事其他损害基金份额持有人合法权益的活动。

本报告所载数据截至2019年6月30日止。
本报告所载数据截至2019年6月30日止。

基金基本情况
项目 数据
基金类别 契约型开放式基金
基金代码 005323
基金运作方式 契约型开放式
报告合同生效日 2018-01-24
报告期基金资产总额 13,680,989.43
投资目标 本基金在保持资产流动性基础上，通过积极主动的投资管理，力争为投资者提供高于业绩比较基准的长期稳定投资回报。

主要财务指标
主要财务指标 本基金(元) 前海开源泽鑫混合A(元) 前海开源泽鑫混合C(元)
本期已实现收益 -222,727.95 -1,889,043.54
本期利润 -298,397.81 -4,877,012.79

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值。
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。

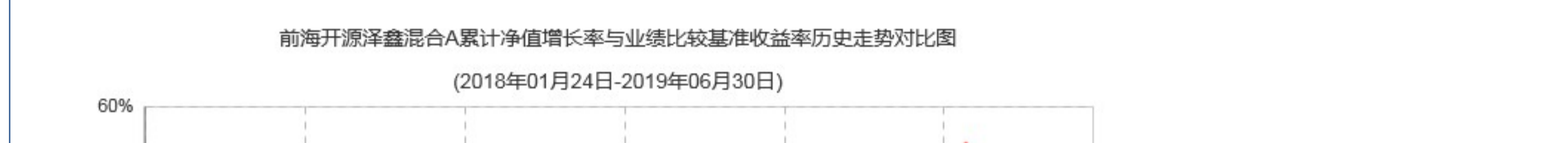
基金净值表现
本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

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

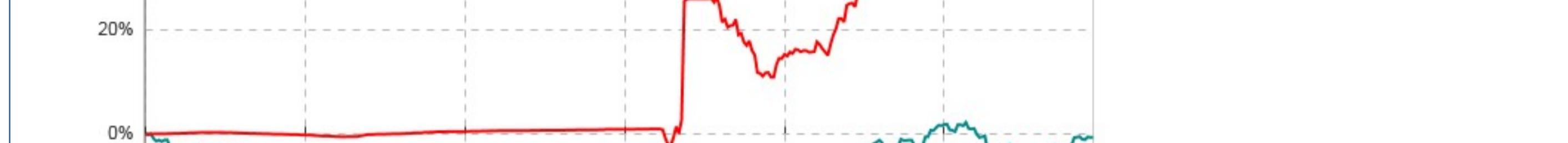
本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

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值。
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。

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
前海开源泽鑫混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2018年01月24日至2019年06月30日)



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
前海开源泽鑫混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2018年01月24日至2019年06月30日)



注：本基金的建仓期为6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。截至2019年6月30日，本基金合同生效未满1年。

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

注：无。

基金经理(或基金经理小组)简介
姓名 职务 任职日期 离任日期 证券从业年限 说明

注：①自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”分别指其最近一次被聘任的日期和解聘日期。
②证券从业的含义遵从证券投资基金《证券基金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
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》及其配套法规、本基金《基金合同》和《招募说明书》的有关规定，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。报告期内，基金运作符合合同约定，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相关法律法规及基金合同的约定。

公平交易专项说明
公平交易制度的执行情况
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成交较多的单边交易没有超过当日正常交易量的情况。

报告期内基金的投资策略和运作分析
报告期内，中美贸易摩擦有所反复，国内GDP增速的降幅超预期7个百分点左右，就业指标连续下滑，综合来看，经济压力持续，国内经济尚未企稳。在此背景下，报告期内A股市场多数板块出现不同程度的下跌。
本基金投资策略保持不变，坚持长期投资、价值投资、分散投资、动态调整、严控回撤、严控回撤、严控回撤。报告期内，本基金投资策略保持不变，坚持长期投资、价值投资、分散投资、动态调整、严控回撤、严控回撤、严控回撤。

报告期内基金的业绩表现
截至报告期末前海开源泽鑫混合A基金份额净值为1.3614元，本报告期内，该基金份额净值增长率为-3.50%，同期业绩比较基准收益率为-0.11%，截至报告期末前海开源泽鑫混合C基金份额净值为1.3615元，本报告期内，该基金份额净值增长率为-3.54%，同期业绩比较基准收益率为-0.11%。

报告期内基金持有人户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，从2019年5月31日至2019年6月30日连续二十个工作日基金资产净值低于五万元。

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) 占基金总资产比例(%)

报告期末按行业分类的境内股票投资组合
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前五名的债券投资明细
序号 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(%)

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
序号 资产名称 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贵金属投资明细
序号 贵金属代码 贵金属名称 数量(克) 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和损益明细

报告期末基金投资的国债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) 风险指标说明

报告期末基金投资的期权持仓和损益明细
代码 名称 持仓量(买/卖) 合约市值(元) 公允价值变动(元) 风险指标说明

报告期末基金投资的资产支持证券投资明细
代码 名称 持仓量(买/卖) 合约市值(元) 公允价值变动(元) 风险指标说明

报告期末基金投资的衍生品投资情况
代码 名称 持仓量(买/卖) 合约市值(元) 公允价值变动(元) 风险指标说明

报告期末基金投资的衍生品投资情况
代码 名称 持仓量(买/卖) 合约市值(元) 公允价值变动(元) 风险指标说明

报告期末基金投资的衍生品投资情况
代码 名称 持仓量(买/卖) 合约市值(元) 公允价值变动(元) 风险指标说明

报告期末基金投资的衍生品投资情况
代码 名称 持仓量(买/卖) 合约市值(元) 公允价值变动(元) 风险指标说明

报告期末基金投资的衍生品投资情况
代码 名称 持仓量(买/卖) 合约市值(元) 公允价值变动(元) 风险指标说明

报告期末基金投资的衍生品投资情况
代码 名称 持仓量(买/卖) 合约市值(元) 公允价值变动(元) 风险指标说明

报告期末基金投资的衍生品投资情况
代码 名称 持仓量(买/卖) 合约市值(元) 公允价值变动(元) 风险指标说明

报告期末基金投资的衍生品投资情况
代码 名称 持仓量(买/卖) 合约市值(元) 公允价值变动(元) 风险指标说明

报告期末基金投资的衍生品投资情况
代码 名称 持仓量(买/卖) 合约市值(元) 公允价值变动(元) 风险指标说明

报告期末基金投资的衍生品投资情况
代码 名称 持仓量(买/卖) 合约市值(元) 公允价值变动(元) 风险指标说明

报告期末基金投资的衍生品投资情况
代码 名称 持仓量(买/卖) 合约市值(元) 公允价值变动(元) 风险指标说明

报告期末基金投资的衍生品投资情况
代码 名称 持仓量(买/卖) 合约市值(元) 公允价值变动(元) 风险指标说明

报告期末基金投资的衍生品投资情况
代码 名称 持仓量(买/卖) 合约市值(元) 公允价值变动(元) 风险指标说明

报告期末基金投资的衍生品投资情况
代码 名称 持仓量(买/卖) 合约市值(元) 公允价值变动(元) 风险指标说明

报告期末基金投资的衍生品投资情况
代码 名称 持仓量(买/卖) 合约市值(元) 公允价值变动(元) 风险指标说明

报告期末基金投资的衍生品投资情况
代码 名称 持仓量(买/卖) 合约市值(元) 公允价值变动(元) 风险指标说明

报告期末基金投资的衍生品投资情况
代码 名称 持仓量(买/卖) 合约市值(元) 公允价值变动(元) 风险指标说明

报告期末基金投资的衍生品投资情况
代码 名称 持仓量(买/卖) 合约市值(元) 公允价值变动(元) 风险指标说明

报告期末基金投资的衍生品投资情况
代码 名称 持仓量(买/卖) 合约市值(元) 公允价值变动(元) 风险指标说明

报告期末基金投资的衍生品投资情况
代码 名称 持仓量(买/卖) 合约市值(元) 公允价值变动(元) 风险指标说明

报告期末基金投资的衍生品投资情况
代码 名称 持仓量(买/卖) 合约市值(元) 公允价值变动(元) 风险指标说明

报告期末基金投资的衍生品投资情况
代码 名称 持仓量(买/卖) 合约市值(元) 公允价值变动(元) 风险指标说明

报告期末基金投资的衍生品投资情况
代码 名称 持仓量(买/卖) 合约市值(元) 公允价值变动(元) 风险指标说明

报告期末基金投资的衍生品投资情况
代码 名称 持仓量(买/卖) 合约市值(元) 公允价值变动(元) 风险指标说明

报告期末基金投资的衍生品投资情况
代码 名称 持仓量(买/卖) 合约市值(元) 公允价值变动(元) 风险指标说明

报告期末基金投资的衍生品投资情况
代码 名称 持仓量(买/卖) 合约市值(元) 公允价值变动(元) 风险指标说明

报告期末基金投资的衍生品投资情况
代码 名称 持仓量(买/卖) 合约市值(元) 公允价值变动(元) 风险指标说明

报告期末基金投资的衍生品投资情况
代码 名称 持仓量(买/卖) 合约市值(元) 公允价值变动(元) 风险指标说明

报告期末基金投资的衍生品投资情况
代码 名称 持仓量(买/卖) 合约市值(元) 公允价值变动(元) 风险指标说明

报告期末基金投资的衍生品投资情况
代码 名称 持仓量(买/卖) 合约市值(元) 公允价值变动(元) 风险指标说明

报告期末基金投资的衍生品投资情况
代码 名称 持仓量(买/卖) 合约市值(元) 公允价值变动(元) 风险指标说明

报告期末基金投资的衍生品投资情况
代码 名称 持仓量(买/卖) 合约市值(元) 公允价值变动(元) 风险指标说明

报告期末基金投资的衍生品投资情况
代码 名称 持仓量(买/卖) 合约市值(元) 公允价值变动(元) 风险指标说明

报告期末基金投资的衍生品投资情况
代码 名称 持仓量(买/卖) 合约市值(元) 公允价值变动(元) 风险指标说明

报告期末基金投资的衍生品投资情况
代码 名称 持仓量(买/卖) 合约市值(元) 公允价值变动(元) 风险指标说明

报告期末基金投资的衍生品投资情况
代码 名称 持仓量(买/卖) 合约市值(元) 公允价值变动(元) 风险指标说明

报告期末基金投资的衍生品投资情况
代码 名称 持仓量(买/卖) 合约市值(元) 公允价值变动(元) 风险指标说明

报告期末基金投资的衍生品投资情况
代码 名称 持仓量(买/卖) 合约市值(元) 公允价值变动(元) 风险指标说明

报告期末基金投资的衍生品投资情况
代码 名称 持仓量(买/卖) 合约市值(元) 公允价值变动(元) 风险指标说明

报告期末基金投资的衍生品投资情况
代码 名称 持仓量(买/卖) 合约市值(元) 公允价值变动(元) 风险指标说明

报告期末基金投资的衍生品投资情况
代码 名称 持仓量(买/卖) 合约市值(元) 公允价值变动(元) 风险指标说明

报告期末基金投资的衍生品投资情况
代码 名称 持仓量(买/卖) 合约市值(元) 公允价值变动(元) 风险指标说明

报告期末基金投资的衍生品投资情况
代码 名称 持仓量(买/卖) 合约市值(元) 公允价值变动(元) 风险指标说明

报告期末基金投资的衍生品投资情况
代码 名称 持仓量(买/卖) 合约市值(元) 公允价值变动(元) 风险指标说明

报告期末基金投资的衍生品投资情况
代码 名称 持仓量(买/卖) 合约市值(元) 公允价值变动(元) 风险指标说明

报告期末基金投资的衍生品投资情况
代码 名称 持仓量(买/卖) 合约市值(元) 公允价值变动(元) 风险指标说明

报告期末基金投资的衍生品投资情况
代码 名称 持仓量(买/卖) 合约市值(元) 公允价值变动(元) 风险指标说明

报告期末基金投资的衍生品投资情况
代码 名称 持仓量(买/卖) 合约市值(元) 公允价值变动(元) 风险指标说明

报告期末基金投资的衍生品投资情况
代码 名称 持仓量(买/卖) 合约市值(元) 公允价值变动(元) 风险指标说明

报告期末基金投资的衍生品投资情况
代码 名称 持仓量(买/卖) 合约市值(元) 公允价值变动(元) 风险指标说明

报告期末基金投资的衍生品投资情况
代码 名称 持仓量(买/卖) 合约市值(元) 公允价值变动(元) 风险指标说明

报告期末基金投资的衍生品投资情况
代码 名称 持仓量(买/卖) 合约市值(元) 公允价值变动(元) 风险指标说明