前海开源普益稳健利润分配证券投资基金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：广发证券股份有限公司

报告送出日期：2019-07-20

§1 重要提示
§2 基金概况
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况
§4 管理人报告
§5 托管人报告
§6 审计报告
§7 财务报表
§8 投资组合报告
§9 基金份额变动情况
§10 重大事件揭示
§11 影响投资决策的其他重要信息
§12 备查文件目录

重要提示

基金管理人的董事会及董事会成员保证本报告所载资料的真实性、准确性和完整性，对其内容的虚假记载、误导性陈述或重大遗漏负个别及连带责任。

基金托管人广发证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年7月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和利润分配情况的内容，保证复核内容的真实性、准确性和完整性。

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，但不保证投资一定盈利，基金过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在投资本基金前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告财务数据及投资组合报告等内容截至2019年6月30日止。

本报告中涉及的人民币以元为单位，金额不足一元的，予以四舍五入。

§2 基金概况

基金简称	前海开源普益稳健利润分
基金主代码	000012
基金交易代码	000012
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011-10-11
报告期末基金份额总额	29,498,206.98份
投资目标	本基金在追求资产安全性和稳定性基础上，力争在产品存续期内实现超越业绩比较基准的绝对收益。在保证本金不受损失的前提下，实现高于银行存款收益率的绝对回报。
投资策略	1、资产配置策略 本基金将根据宏观经济、证券市场估值水平、利率水平、汇率水平等因素的变化，对资产配置比例进行动态调整。本基金将根据国内证券市场、债券市场、货币市场、衍生品市场等各类资产的预期收益、风险状况，在保证本金不受损失的前提下，实现高于银行存款收益率的绝对回报。 2、大类资产配置 本基金进行资产配置时，本基金综合分析宏观经济、财政政策、货币政策、证券市场、利率水平、汇率水平等因素的变化，对资产配置比例进行动态调整。 3、股票投资策略 本基金将根据宏观经济、财政政策、货币政策、证券市场、利率水平、汇率水平等因素的变化，对资产配置比例进行动态调整。 4、固定收益投资策略 本基金将根据宏观经济、财政政策、货币政策、证券市场、利率水平、汇率水平等因素的变化，对资产配置比例进行动态调整。 5、可转债投资策略 基于安全第一、注重收益的原则，根据国家宏观经济政策、证券市场、利率水平、汇率水平等因素的变化，对资产配置比例进行动态调整。 6、股指期货投资策略 本基金将根据宏观经济、财政政策、货币政策、证券市场、利率水平、汇率水平等因素的变化，对资产配置比例进行动态调整。 7、权证投资策略 本基金将根据宏观经济、财政政策、货币政策、证券市场、利率水平、汇率水平等因素的变化，对资产配置比例进行动态调整。 8、资产支持证券投资策略 本基金将根据宏观经济、财政政策、货币政策、证券市场、利率水平、汇率水平等因素的变化，对资产配置比例进行动态调整。 9、股指期货投资策略 本基金将根据宏观经济、财政政策、货币政策、证券市场、利率水平、汇率水平等因素的变化，对资产配置比例进行动态调整。 10、国债期货投资策略 本基金将根据宏观经济、财政政策、货币政策、证券市场、利率水平、汇率水平等因素的变化，对资产配置比例进行动态调整。
业绩比较基准	中证全国银行间债券市场AAA级企业债指数收益率×75%+中证短债指数收益率×25%。
风险收益特征	本基金为债券型基金，长期预期风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金、偏债型混合型基金。
基金管理人	前海开源基金管理有限公司
基金托管人	广发证券股份有限公司
下属分级基金的基金简称	前海开源普益稳健利润分
下属分级基金的交易代码	000012
下属分级基金的场内简称	
下属分级基金的最低份额	1,125,989.14

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要财务指标

	单位：人民币元
3.1.1 期末数据和指标	报告期(2019-04-01-2019-06-30)
本期已实现收益	106,551.42
本期利润	-18,334.8
加权平均基金份额本期利润	-0.0008
期末基金资产净值	1,481,108.38
期末基金份额净值	1.1368

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或净值增长幅度会低于所列数字。

2、过去三个月指标数据是本季度的数据，按照实际，不足三个月的按照实际天数计算。

3.2 基金净值表现

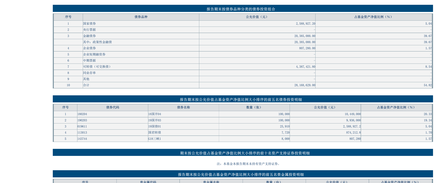
	单位：人民币元
本报告期末或最近一期内收益率记录天数大于等于三个月的，列示过去三个月的情况	
阶段	净值增长率 净值增长率标准差 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率标准差 ①-② ③-④
过去三个月	-0.11 % 0.03 % 0.48 % 0.21 % -0.59 % -0.18 %

本报告期末或最近一期内收益率记录天数大于等于三个月的，列示成立以来的情况

阶段	净值增长率 净值增长率标准差 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率标准差 ①-② ③-④
过去三个月	-0.11 % 0.03 % 0.48 % 0.21 % -0.59 % -0.18 %

注：业绩比较基准收益率=75%*中证全国银行间债券市场AAA级企业债指数收益率+25%*中证短债指数收益率

自基金合同生效以来基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较


前海开源稳健利润分成A累计净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较
(2011/10/11 至 2019-06-30)
2011/10/11 2012/10/11 2013/10/11 2014/10/11 2015/10/11 2016/10/11 2017/10/11 2018/10/11 2019/10/11
-10%
0%
10%
20%
30%
40%
2011/7/14 2012/7/14 2013/7/14 2014/7/14 2015/7/14 2016/7/14 2017/7/14 2018/7/14 2019/7/14
-0.59%
-0.48%
-0.11%
0.48%
2.01%
2.18%
2.18%
2.18