

重要提示

基金管理人承诺基金及本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏... 基金管理人承诺基金及本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏...

基金基本情况

Table with columns: 项目 (Item), 数值 (Value). Includes 基金简称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 基金管理人, 基金托管人, etc.

主要财务指标

Table with columns: 主要财务指标 (Main Financial Indicators), 本基金(元) (This Fund (Yuan)), 前海开源裕瑞混合(A) (2019-04-01 - 2019-06-30), 前海开源裕瑞混合(C) (2019-04-01 - 2019-06-30). Includes 本期已实现收益, 本期利润, 加权平均基金份额本期利润, etc.

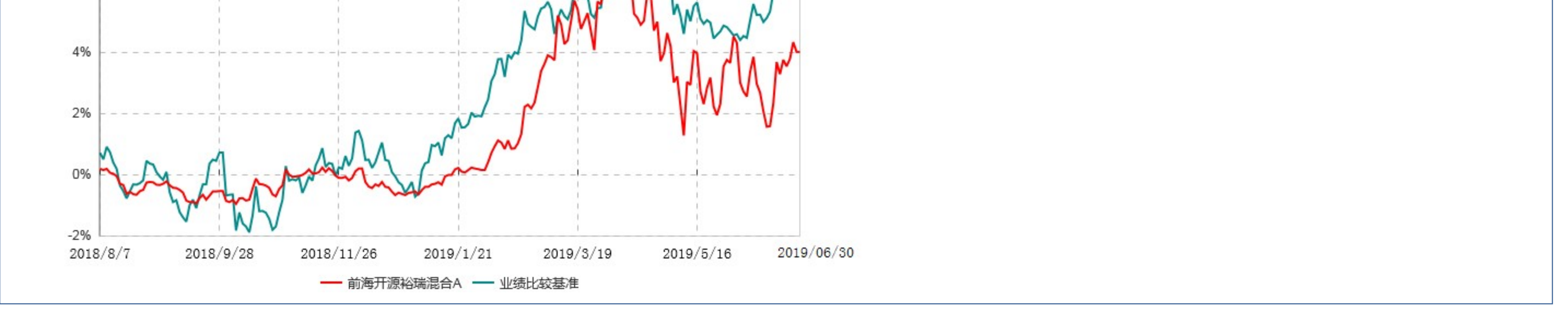
注：①上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用... ②本期已实现收益基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额...

基金净值表现

Table with columns: 阶段 (Period), 净值增长率① (Net Value Growth Rate), 净值增长率标准差② (Net Value Growth Rate Standard Deviation), 业绩比较基准收益率③ (Benchmark Return Rate), 业绩比较基准收益率标准差④ (Benchmark Return Rate Standard Deviation), ①-③ (①-③), ④-① (④-①).

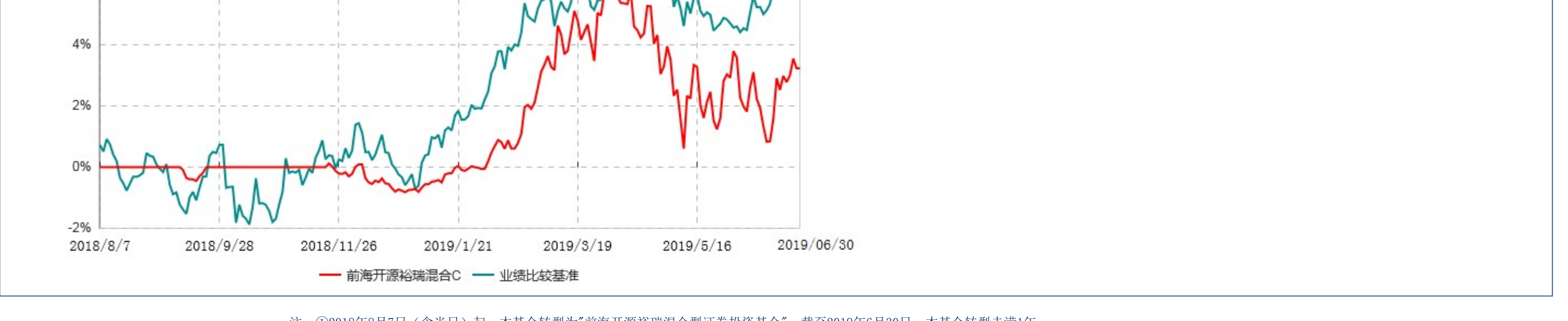
注：①上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用... ②本期已实现收益基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额...

前海开源裕瑞混合(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



注：①2018年9月1日(含当日)起，本基金转为“前海开源裕瑞混合型证券投资基金”。截至2019年6月30日，本基金转型未满一年... ②本基金转型后的建仓期为6个月，建仓期结束前各项资产配置比例符合基金合同约定...

前海开源裕瑞混合(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



注：①2018年9月1日(含当日)起，本基金转为“前海开源裕瑞混合型证券投资基金”。截至2019年6月30日，本基金转型未满一年... ②本基金转型后的建仓期为6个月，建仓期结束前各项资产配置比例符合基金合同约定...

其他指标

Table with columns: 其他指标 (Other Indicators), 报告期 (2019-06-01至2019-06-30), 报告期 (2019-06-30). Includes 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, etc.

基金投研(或基金经理小组)简介

Table with columns: 姓名 (Name), 职务 (Position), 任职日期 (Start Date), 离任日期 (End Date), 证券从业年限 (Securities Industry Experience), 说明 (Remarks). Includes 刘劭, 由恬, etc.

注：①自基金的前任基金经理、其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决议确定的解聘日期... ②证券从业年限的认定参照中国证监会《证券投资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

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》及其配套法规、基金合同和基金招募说明书的有关规定... 基金管理人承诺基金及本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏...

公平交易专项说明

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》，完善相应制衡及流程... 基金管理人承诺基金及本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏...

异常交易行为的专项说明

本基金于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没有超过该证券当日成交量5%的情况。

报告期内基金的投资策略和运作分析

权益投资方面：2019年一季度宏观经济表现平稳，外部环境变化较大，A股和港股均大幅震荡... 债券投资方面：本报告期内，债券市场震荡下行，但由中债利率走低且地方债发行前置，利率期限结构企稳...

报告期内基金的业绩表现

截至报告期末前海开源裕瑞混合(A)基金份额净值为1.0215元，本报告期，该类基金份额净值增长率为2.13%... 截至报告期末前海开源裕瑞混合(C)基金份额净值为1.0252元，本报告期，该类基金份额净值增长率为2.29%...

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或基金资产净值低于五千万元的情形。

投资组合报告

Table with columns: 序号 (Serial Number), 项目 (Item), 金额(元) (Amount in Yuan), 占基金总资产的比例(%) (Percentage of Total Assets). Includes 权益类投资, 其中:股票, 其中:沪股通, etc.

注：权益类资产通过港股通交易机制投资的港股公允价值为7,913,446.49元，占资产净值比例15.69%。

报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with columns: 序号 (Serial Number), 行业类别 (Industry Category), 公允价值(元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Asset Value). Includes A 农、林、牧、渔业, B 采矿业, etc.

报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

Table with columns: 行业类别 (Industry Category), 公允价值(元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Asset Value). Includes 日常生活消费品, 信息技术, etc.

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

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

Table with columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量(股) (Quantity in Shares), 公允价值(元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Asset Value). Includes 000681, 002088, etc.

注：①本基金本报告期末未持有沪股通股票... ②前项证券代码使用当前市场代码。

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with columns: 序号 (Serial Number), 债券品种 (Bond Type), 公允价值(元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Asset Value). Includes 固定收益, 央行票据, etc.

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

Table with columns: 序号 (Serial Number), 债券代码 (Bond Code), 债券名称 (Bond Name), 数量(张) (Quantity in Tens of Thousands), 公允价值(元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Asset Value). Includes 1 180204, 2 180208, etc.

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

Table with columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量(买/卖) (Position Size (Buy/Sell)), 合约市值(元) (Contract Value in Yuan), 公允价值变动(元) (Fair Value Change in Yuan), 风险说明 (Risk Statement).

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

本基金投资股指期货的投资政策

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

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table with columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量(买/卖) (Position Size (Buy/Sell)), 合约市值(元) (Contract Value in Yuan), 公允价值变动(元) (Fair Value Change in Yuan), 风险说明 (Risk Statement).

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

投资组合报告附注

受到调查以及处罚情况

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现在监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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

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。

其他资产构成

Table with columns: 序号 (Serial Number), 项目 (Item), 名称 (Name), 数量 (Quantity), 金额(元) (Amount in Yuan), 单位:人民币元 (Unit: RMB Yuan). Includes 1 存出保证金, 2 应收证券清算款, etc.

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with columns: 序号 (Serial Number), 债券代码 (Bond Code), 债券名称 (Bond Name), 公允价值(元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Asset Value). Includes 1 120020, etc.

报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

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

Table with columns: 项目 (Item), 前海开源裕瑞混合, 前海开源裕瑞混合(A), 前海开源裕瑞混合(C). Includes 报告期初基金份额总额, 报告期间基金总申购额, etc.

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

Table with columns: 项目 (Item), 前海开源裕瑞混合, 前海开源裕瑞混合(A), 前海开源裕瑞混合(C). Includes 报告期末基金管理人持有的本基金份额, 报告期末基金管理人持有的基金份额, etc.

注：本报告期基金管理人未持有本基金份额。

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

Table with columns: 序号 (Serial Number), 交易方式 (Transaction Method), 交易日期 (Transaction Date), 交易金额(元) (Transaction Amount in Yuan), 交易金额(元) (Transaction Amount in Yuan), 适用费率 (Applicable Rate).

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

Table with columns: 基金管理人固有资金, 基金管理人高级管理人员, 基金管理人基金经理, 基金管理人股东, 其他, 合计. Includes 持有份额总数, 持有份额占基金总份额比例, etc.

报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过10%的情况

Table with columns: 投资者类别 (Investor Category), 序号 (Serial Number), 持有基金份额比例达到或超过10%的期间(区间) (Period when holding share ratio reaches or exceeds 10%), 期初份额 (Start Period Shares), 申购份额 (Purchase Shares), 赎回份额 (Redemption Shares), 持有份额 (Holding Shares), 份额占比 (Share Ratio).

注：无。

影响投资决策的其他重要事项

- 1、2019年4月14日，中国证监会对主承销商十六届中国基金业金牛奖评选结果公布，前海开源基金管理有限公司荣获“金牛基金管理奖”。
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》...

备查文件目录

- (1) 中国证监会准予前海开源裕瑞混合型证券投资基金设立的文件
(2) 《前海开源裕瑞混合型证券投资基金基金合同》
(3) 《前海开源裕瑞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) 前海开源裕瑞混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的链接

存放地点

基金管理人、基金托管人

查阅方式

- (1) 投资者可在本业务时间内免费查阅，也可按工本费和复印费
(2) 投资者对本基金如有疑问，可致电本基金管理人前海开源基金管理有限公司，客户服务热线：400-666-9988(长话长传)
(3) 投资者可访问本基金管理人公司网站，网址：www.qhkyfund.com