

目录全部展开 目录全部收起
重要提示
基金基本情况
主要财务指标和基金净值表现
投资组合报告
其他重要信息
基金管理人、基金托管人及基金销售机构

重要提示

基金管理人承诺严格遵守法律法规，诚实守信，勤勉尽责，切实履行基金管理人职责，维护基金份额持有人的合法权益。

基金基本情况

Table with 2 columns: 项目 (Item), 数值 (Value). Includes 基金简称, 场内简称, 基金代码, etc.

主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标 (Key Financial Indicators), 报告期 (2019-04-01 至 2019-06-30), 单位: 人民币元 (Unit: RMB Yuan).

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字。

基金净值表现

Table with 7 columns: 阶段 (Period), 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, 1.31%

注：本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率×35%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×35%+中证价值指数收益率×30%。

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情况的比较



其他指标

Table with 2 columns: 其他指标 (Other Indicators), 报告期 (2019-04-01 至 2019-06-30), 报告期 (2019-06-30).

注：无。

基金经理（或基金经理小组）简介

Table with 4 columns: 姓名 (Name), 职务 (Position), 任本基金的基金经理时间 (Tenure), 证券从业年限 (Securities Experience), 说明 (Remarks).

注：①对基金的基金经理，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。

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》及其各项实施条例、本基金《基金合同》和其他有关法律法规的规定。

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》，完善相应制度及流程。

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。本报告期内本基金管理人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交易量的5%的情况。

报告期内基金的投资策略和运作分析

2019年二季度宏观经济数据表现平稳，外部环境变化较大，通胀和通胀预期均大幅回落，沪深300指数二季度下跌1.21%，恒生指数下跌1.75%。

报告期内基金的业绩表现

截至报告期末前海开源沪港深价值精选混合基金份额净值1.294元，本报告期内，基金份额净值增长率为-3.58%，同期业绩比较基准收益率为0.17%。

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者基金资产净值低于五千万元的情形。

投资组合报告

报告期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 序号 (Serial Number), 项目 (Item), 金额 (元) (Amount in RMB Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

注：权益投资中通过港股通交易机制投资的港股公允价值为153,581,000.55元，占资产净值比例48.37%。

报告期末按行业分类的境内股票投资组合

Table with 3 columns: 序号 (Serial Number), 行业类别 (Industry Category), 公允价值 (元) (Fair Value in RMB Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合

Table with 3 columns: 行业类别 (Industry Category), 公允价值 (元) (Fair Value in RMB Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

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 5 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 RMB Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

注：所用证券代码使用当地市场代码。

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 3 columns: 序号 (Serial Number), 债券品种 (Bond Type), 公允价值 (元) (Fair Value in RMB Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

注：本基金本报告期末未持有债券。

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 债券代码 (Bond Code), 债券名称 (Bond Name), 数量 (份) (Quantity in Shares), 公允价值 (元) (Fair Value in RMB Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：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持仓和损益明细

Table with 5 columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Position), 合约市值 (元) (Contract Value in RMB Yuan), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change in RMB Yuan), 风险指标说明 (Risk Indicator).

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

受到调查及处罚情况
本基金投资的前十名证券的发行主体本报告期内没有出现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。

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

其他资产构成

Table with 3 columns: 序号 (Serial Number), 名称 (Name), 金额 (元) (Amount in RMB Yuan), 单位: 人民币元 (Unit: RMB Yuan).

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 2 columns: 项目 (Item), 数值 (Value), 单位: 份 (Unit: Shares).

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

基金管理人持有本基金份额变动情况

Table with 2 columns: 项目 (Item), 基金份额 (Shares), 单位: 份 (Unit: Shares).

基金管理人运用固有资金投资本基金明细

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 交易方式 (Transaction Method), 交易日期 (Transaction Date), 交易金额 (份) (Transaction Amount in Shares), 交易金额 (元) (Transaction Amount in RMB Yuan), 适用费率 (Applicable Rate).

注：本报告期末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 5 columns: 项目 (Item), 持有份额总数 (Total Shares Held), 持有份额占基金总份额比例 (Percentage of Total Shares Held), 发起份额总数 (Total Shares Initiated), 发起份额占基金总份额比例 (Percentage of Total Shares Initiated), 发起份额承诺持有期限 (Commitment Period for Initiated Shares).

报告期内持有人持有基金份额比例达到或超过20%的情况

Table with 5 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20%的时间区间 (Time Interval), 期初份额 (Initial Shares), 申购份额 (Subscription Shares), 赎回份额 (Redemption Shares), 持有份额 (Current Shares), 份额占比 (Percentage of Shares).

注：无。

影响投资者决策的其他重要信息

- 1. 2019年4月1日，由中国证券报社主办的第十六届中国基金金牛奖评选活动公布，前海开源基金管理有限公司旗下前海开源基金“金牛基金管理公司”，公司旗下前海开源工业革命4.0灵活配置混合型证券投资基金(基金代码：001103)荣获“三年期开放式混合型科技先锋金牛基金”称号。

备查文件目录

- (1) 中国证监会监管委员会批准前海开源沪港深价值精选灵活配置混合型证券投资基金设立的文件
(2) 《前海开源沪港深价值精选灵活配置混合型证券投资基金合同》
(3) 《前海开源沪港深价值精选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准、营业执照和公司章程
(5) 前海开源沪港深价值精选灵活配置混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的摘要

存放地点

基金管理人、基金托管人处

查阅方式

- (1) 投资者可在营业时间内免费查阅，也可工本费查阅复印件
(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：4001-666-998(免长话费)
(3) 投资者可回本基金管理人公司网站，网址：www.qhkyfund.com