

前海开源沪深强双产业灵活配置混合型证券投资基金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：中国建设银行股份有限公司
报告送出日期：2019-07-16

重要提示

基金管理人及基金托管人承诺本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年7月13日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。
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，但不保证基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的本金不受损失。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。
本报告期内基金管理人及基金托管人不存在任何违法违规行为。
本报告自2019年4月1日起至2019年6月30日止。

基金基本情况

Table with columns: 项目 (Item), 数值 (Value). Includes 基金名称 (前海开源沪深强双产业), 基金代码 (004321), 基金运作方式 (契约型开放式), 基金合同生效日 (2017-03-01), 报告期末基金份额总额 (150,800,976.62), 投资策略 (本基金主要通过投资沪深强双产业主题相关证券...), 投资目标 (本基金的投资策略包括六个方面...), 业绩比较基准 (沪深300指数收益率x40%+恒生指数收益率x30%+中证全指指数收益率x30%).

主要财务指标

Table with columns: 主要财务指标, 报告期 (2019-04-01至2019-06-30), 单位: 人民币元. Includes 本期已实现收益 (3,172,414.94), 本期净利润 (2,623,896.86), 期末基金资产净值 (153,446,335.28).

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可能低于所列数字。
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)扣除相关费用后的金额, 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

Table with columns: 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. Includes 过去三个月 (1.74%, 0.38%, -0.67%, 0.84%, 2.41%, -0.46%).

注: 本基金业绩比较基准为: 沪深300指数收益率x40%+恒生指数收益率x30%+中证全指指数收益率x30%。

自基金成立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



其他指标

Table with columns: 其他指标, 报告期 (2019-01-01至2019-06-30), 单位: 人民币元. Includes 其他指标 (无).

基金经理 (或基金经理小组) 简介

Table with columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 证券从业年限, 说明. Includes 吴国清 (基金经理, 2017-03-01), 曲扬 (基金经理, 2018-02-09).

注: ①对基金经理的姓名, 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确定的聘任日期和解聘日期。
②证券从业的含义遵从行业协会《证券业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》及其各项实施准则、本基金《基金合同》和其他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。本报告期内, 基金运作整体合法合规, 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有关法律法规及基金合同的约定。

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, 公平对待管理下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。本报告期内本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数量没有超过该证券当日成交量的5%的情况。

报告期内基金的投资策略和运作分析

二季度, 宏观经济保持企稳, 通胀率保持低位, 央行销售债券走强, 汽车家电消费一直低迷, 既有必选消费数据相对较好, 随着二季度的补库存增加以及宏观经济的较快反弹, 4月份流动性再次宽松, 叠加货币宽松压力再起, 股市承压, 股指指向回调。在此背景下, 本基金主要配置大盘蓝筹股等, 基金净值回撤较小, 相对稳健。

报告期内基金的投资表现

截至报告期末前海开源沪深强双产业基金份额净值为1.0222元, 本报告期内, 基金份额净值增长率为1.74%, 同期业绩比较基准收益率为-0.67%。

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 columns: 序号, 项目, 金额 (元), 占基金总资产的比例 (%). Includes 权益类投资 (27.11%), 固定收益投资 (63.16%), 买入金融资产 (1.02%), 银行存款和结算备付金合计 (8.07%), 其他资产 (1.62%).

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1,902,264.75元, 占资产净值比例: 21%。

报告期末按行业分类的境内股票投资组合

Table with columns: 序号, 行业类别, 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). Includes 农林牧渔 (1.04%), 医药生物 (0.86%), 制造业 (14.03%), 电力、热力、燃气及水生产和供应业 (1.54%), 建筑业 (1.44%), 批发和零售业 (1.82%), 交通运输、仓储和邮政业 (1.44%), 住宿和餐饮业 (0.21%), 信息技术、软件和信息技术服务业 (2.95%), 金融业 (2.77%), 房地产业 (0.35%), 租赁和商务服务业 (1.29%), 科学技术和服务业 (1.02%), 水利、环境和公共设施管理业 (1.29%), 农林牧渔 (1.02%), 教育 (1.29%), 卫生和社会工作 (1.02%), 文化、体育和娱乐业 (0.02%), 综合 (25.96%), 合计 (25.96%).

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, 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). Includes 金融 (0.88%), 工业 (0.26%), 合计 (1.14%).

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, 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 (%). Includes 贵州茅台 (2.31%), 工商银行 (0.45%), 招商银行 (1.08%), 中信银行 (0.43%), 中国银行 (1.01%), 格力电器 (1.29%), 五粮液 (1.23%), 甘肃电投 (1.02%), 福民股份 (1.06%), 佛吉智能 (0.95%), 神思电子 (0.78%), 万邦A (0.77%).

注: 所用证券代码采用当地市场代码。

报告期末按品种分类的债券投资组合

Table with columns: 序号, 债券品种, 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). Includes 国债 (63.36%), 央行票据 (0.00%), 金融债券 (0.00%), 企业债券 (0.00%), 企业短期融资券 (0.00%), 中期票据 (0.00%), 可转债 (0.00%), 其他 (0.00%), 合计 (63.36%).

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, 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 (%). Includes 11180044 (12.95%), 11180130 (12.63%), 111815270 (12.63%), 111817176 (12.69%), 111810389 (12.69%).

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, 名称, 持仓量 (买/卖), 合约数量 (元), 公允价值 (元), 风险指标说明. Includes 公允价值变动总额合计 (元), 股指期货投资本期收益 (元), 股指期货投资本期公允价值变动 (元).

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

本基金本报告期末未投资国债期货。

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, 名称, 持仓量 (买/卖), 合约数量 (元), 公允价值 (元), 风险指标说明. Includes 公允价值变动总额合计 (元), 国债期货投资本期收益 (元), 国债期货投资本期公允价值变动 (元).

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发生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、处罚的情况。

申明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 columns: 序号, 名称, 金额 (元), 单位: 人民币元. Includes 存出保证金 (26,106.59), 应收证券清算款 (0), 应收股利 (59,388.80), 应收利息 (2,388,151.23), 其他应收款 (139.73), 待摊费用 (0), 其他 (0), 合计 (2,483,786.35).

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。

开放式基金申购变动

Table with columns: 项目, 数量, 单位: 份. Includes 报告期期初基金份额总额 (150,279,570.14), 报告期期初基金总申购份额 (529,435.39), 减: 报告期期初基金总赎回份额 (498,628.95), 报告期期初基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列) (0), 报告期末基金份额总额 (150,800,976.62).

注: 总申购份额含红利再投、转入份额, 总额扣除赎回份额转出份额。

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 columns: 项目, 基金份额 (单位: 份). Includes 报告期末管理人持有的本基金份额 (0), 报告期初管理人持有的本基金份额 (0), 报告期间买入、申购份额 (0), 报告期间卖出、赎回份额 (0), 报告期末管理人持有的本基金份额 (0), 报告期末持有的本基金基金份额占本报告期末基金份额总额比例 (%) (0).

注: 本报告期内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明细

Table with columns: 序号, 交易方式, 交易日期, 交易数量 (份), 交易金额 (元), 适用费率. Includes 合计 (0, 0, 0, 0, 0).

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及发起资金持有份额情况

Table with columns: 项目, 持有份额数量, 持有份额占基金总份额比例, 发起份额数量, 发起份额占基金总份额比例, 发起份额承诺持有期限. Includes 基金管理人固有资金 (无), 基金管理人固有资金 (无), 基金管理人固有资金 (无), 基金管理人固有资金 (无), 其他 (无), 合计 (无).

报告期内基金持有人持有基金份额比例达到或超过20%的情况

Table with columns: 投资者姓名, 持有基金份额, 持有基金份额占基金总份额比例, 报告期初, 申购份额, 赎回份额, 持有份额, 份额占比. Includes 个人 (1, 20190101-20190630, 100,051,500.00, 0.00, 0.00, 100,051,500.00, 66.52%), 机构 (1, 20190101-20190630, 50,051,500.00, 0.00, 0.00, 50,051,500.00, 33.28%).

产品特有风险

- 1. 巨额赎回风险
(1) 本基金单一投资者持有的基金份额占比较大, 单一投资者的巨额赎回, 可能导致基金管理人被迫抛售流动性资产以应付基金赎回的现金需要, 对基金的投资运作及净值表现产生较大影响。
(2) 本基金为大额赎回时容易引发本基金发生巨额赎回, 在发生巨额赎回时, 可在基金合同约定的范围内, 对基金份额持有人进行延期办理的措施; 如果连续2个工作日以上(含)发生巨额赎回, 基金管理人可根据《基金合同》的约定暂停接受基金赎回申请, 并全额赎回投资者的赎回申请或延期办理赎回申请。
2. 转换运作方式或终止基金合同的风险
单一投资者大额赎回, 若本基金连续60个工作日基金份额持有人少于200人或基金资产净值低于5000万元, 基金管理人应当向中国证监会提出解决方案, 或经基金合同约定, 转换运作方式或终止基金合同, 其他投资者可能面临基金转换运作方式或终止基金合同的风险。
3. 流动性风险
单一投资者巨额赎回可能导致本基金在短期内无法变现足够的资产予以应对, 可能会对基金的投资策略调整, 导致流动性风险。
巨额赎回可能导致基金资产规模过小, 导致部分投资变现而不能实现基金合同约定的投资目标和投资策略。

影响投资者决策的其他重要信息

- 1、2019年4月14日, 由中国证券业协会主办的第十六届中国基金金牛奖评选结果公布, 前海开源基金管理有限公司荣获“金牛基金管理公司”, 公司旗下前海开源军工改革4号灵活配置混合型证券投资基金(基金代码: 001103)荣获“三年期开放式基金金牛奖”。
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》, 本基金本着谨慎和风险可控的原则, 可参与科创板股票的投资, 投资者敬请阅读基金管理人刊登在中国证监会指定网站上的有关公告。

备查文件目录

- (1) 中国证监会基金备案证明及前海开源沪深强双产业灵活配置混合型证券投资基金设立的文件
(2) 《前海开源沪深强双产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
(3) 《前海开源沪深强双产业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文、营业执照和公司章程
(5) 前海开源沪深强双产业灵活配置混合型证券投资基金在指定网站上各项公告的编辑

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, 也可工本费购买复印件
(2) 投资者可至基金托管人处查阅, 可至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(免长途话费)
(3) 投资者可访问本基金管理人公司网站, 网址: www.qhkyfund.com