前海开源鼎瑞债券型证券投资基金

2019 年半年度报告

2019 年 06 月 30 日

基金管理人:前海开源基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

送出日期:2019 年 08 月 24 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年8月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。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及其更新。

本报告中财务资料未经审计 。

本报告期自2019年01月01日起至2019年06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
§2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 6
2.4 信息披露方式 7
2.5 其他相关资料 7
§3 主要财务指标和基金净值表现 7
3.1 主要会计数据和财务指标 7
3.2 基金净值表现 8
3.3 其他指标 10
§4 管理人报告 10
4.1 基金管理人及基金经理情况 10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 14
§5 托管人报告 14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 14
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 14
§6 半年度财务会计报告(未经审计) 14
6.1 资产负债表 15
6.2 利润表 16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 18
6.4 报表附注 20
§7 投资组合报告 43
7.1 期末基金资产组合情况 43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 43
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 47
7.6 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 47
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 48
7.8 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 48
7.9 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 48
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 49
7.12 投资组合报告附注 49
§8 基金份额持有人信息 50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 50

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 51
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 51
§9 开放式基金份额变动 52
§10 重大事件揭示 52
10.1 基金份额持有人大会决议 52
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 52
10.4 基金投资策略的改变 52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 52
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 53
10.8 其他重大事件 55
§11 影响投资者决策的其他重要信息 58
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 59
§12 备查文件目录 59
12.1 备查文件目录 59
12.2 存放地点 59
12.3 查阅方式 59

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	前海开源鼎瑞债券型证券投资基金	
基金简称	前海开源鼎瑞债券	
基金主代码	003167	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年08月16日	
基金管理人	前海开源基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,841,865,456.40份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	前海开源鼎瑞债券A	前海开源鼎瑞债券C
下属分级基金的交易代码	003167	003168
报告期末下属分级基金的份额总额	1,841,802,879.40份	62,577.00份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在追求本金安全、保持资产流动性的基础上，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。
投资策略	本基金的投资策略主要有以下五方面内容： 1、资产配置策略 在大类资产配置中，本基金综合运用定性和定量的分析手段，在充分研究宏观经济因素的基础上，判断宏观经济周期所处阶段和未来发展趋势。本基金将依据经济周期理论，结合对证券市场的研究、分析和风险评估，分析未来一段时期内本基金在大类资产的配置方面的风险和收益预期，评估相关投资标的的投资价值，制定本基金在固定收益类、权益类和现金等大类资产之间的配置比例。 2、债券投资策略 本基金债券投资将主要采取组合久期配置策略，同时辅之以收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、

	可转换债券、中小企业私募债券投资策略等积极投资策略。 3、股票投资策略 本基金将精选有良好增值潜力的股票构建股票投资组合。股票投资策略将从定性和定量两方面入手，定性方面主要考察上市公司所属行业发展前景、行业地位、竞争优势、管理团队、创新能力等多种因素；定量方面考量公司估值、资产质量及财务状况，比较分析各优质上市公司的估值、成长及财务指标，优先选择具有相对比较优势的公司作为最终股票投资对象。 4、国债期货投资策略 本基金对国债期货的投资以套期保值为主要目的。本基金将结合国债交易市场和期货交易市场的收益性、流动性的情况，通过多头或空头套期保值等投资策略进行套期保值，以获取超额收益。 5、资产支持证券投资策略 本基金通过对资产支持证券发行条款的分析、违约概率和提前偿付比率的预估，借用必要的数量模型来谋求对资产支持证券的合理定价，在严格控制风险、充分考虑风险补偿收益和市场流动性的条件下，谨慎选择风险调整后收益较高的品种进行投资。 本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。
业绩比较基准	中债综合指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10%。
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		前海开源基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责	姓名	傅成斌	郭明
	联系电话	0755-88601888	010-66105799

人	电子邮箱	qhky@qhkyfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4001666998	95588
传真		0755-83181169	010-66105798
注册地址		深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		深圳市福田区深南大道7006号万科富春东方大厦2206	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		518040	100140
法定代表人		王兆华	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.qhkyfund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	前海开源基金管理有限公司	深圳市福田区深南大道7006号万科富春东方大厦2206

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年01月01日-2019年06月30日)	
	前海开源鼎瑞债券A	前海开源鼎瑞债券C
本期已实现收益	38,007,520.45	1,044.34
本期利润	54,702,311.26	740.15

加权平均基金份额本期利润	0.0289	0.0119
本期加权平均净值利润率	2.70%	1.12%
本期基金份额净值增长率	2.61%	2.40%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年06月30日)	
期末可供分配利润	125,001,461.40	3,495.57
期末可供分配基金份额利润	0.0679	0.0559
期末基金资产净值	1,993,751,787.04	66,981.68
期末基金份额净值	1.0825	1.0704
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	8.25%	7.04%

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。

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。

③期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润期末余额和未分配利润中已实现部分期末余额的孰低数。表中的"期末"均指报告期最后一个自然日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

前海开源鼎瑞债券A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	1.50%	0.17%	0.79%	0.10%	0.71%	0.07%
过去三个月	0.06%	0.21%	-0.27%	0.14%	0.33%	0.07%
过去六个月	2.61%	0.18%	2.78%	0.14%	-0.17%	0.04%

过去一年	2.61%	0.16%	3.69%	0.15%	-1.08%	0.01%
自基金合同生效起至今	8.25%	0.17%	0.62%	0.13%	7.63%	0.04%

前海开源鼎瑞债券C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	1.47%	0.18%	0.79%	0.10%	0.68%	0.08%
过去三个月	-0.04%	0.21%	-0.27%	0.14%	0.23%	0.07%
过去六个月	2.40%	0.18%	2.78%	0.14%	-0.38%	0.04%
过去一年	2.20%	0.16%	3.69%	0.15%	-1.49%	0.01%
自基金合同生效起至今	7.04%	0.17%	0.62%	0.13%	6.42%	0.04%

注：本基金的业绩比较基准为：中债综合指数收益率×90%＋沪深 300 指数收益率×10%。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

3.3 其他指标

无。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

前海开源基金管理有限公司（以下简称"前海开源基金"）于2012年12月27日经中国证监会批准，2013年1月23日注册成立，截至报告期末，注册资本为2亿元人民币。其中，开源证券股份有限公司、北京市中盛金期投资管理有限公司、北京长和世纪资产管理有限公司和深圳市和合投信资产管理合伙企业(有限合伙)各持股权25%。目前，前海开源基金分别在北京、上海设立分公司。经中国证监会批准，前海开源基金全资控股子公司--前海开源资产管理有限公司（以下简称"前海开源资管"）已于2013年9月5日在深圳市注册成立，并于2013年9月18日取得中国证监会核发的《特定客户资产管理业务资格证书》，截至报告期末，注册资本为1.8亿元人民币。

截至报告期末，前海开源基金旗下管理83只开放式基金，资产管理规模超过626.78亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吴国清	本基金的基金经理、公司执行投资总监	2016-08-16	-	11年	吴国清先生，清华大学博士研究生。历任南方基金管理有限公司研究员、基金经理助理、投资经理。2015年8月加入前海开源基金管理有限公司，现任公司执行投资总监。
李炳智	本基金的基金经理	2018-09-26	-	6年	李炳智先生，金融学学士。2011年6月至2013年2月担任天津信唐货币经纪有限公司货币经纪人，2013年3月至2016年5月担任中航证券投资经理助理、交易员，现任职于前海开源基金管理有限公司固定收益部。
王旭巍	本基金的基金经理、公司董事总经理	2019-05-09	-	21年	王旭巍先生，硕士研究生，历任宏达期货经纪有限公司营业部总经理、中信证券股份有限公司投资经理，2003年至2010年担任华宝兴业基金管理有限公司基金经理，2010年3月至2016年9月担任信诚基金管理有限公司固定收益总监、基金经理，现任前海开源基金管理有限公司董事总经理。

注：①对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"分别指根据公司决定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。

4.2 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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、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规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 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成交量的5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

固定收益方面：上半年我国宏观经济稳中略降，工业增加值小幅回落，消费增速在汽车消费大幅下滑的带动下略有下降，商品房销售面积同比继续小幅负增长；出口方面增速虽较去年有所下降，但略好于预期，固定资产投资基建投资增速提高对冲了制造业投资下滑的影响，房地产投资继续维持相对高位，整体固定资产投资增速维持较高水平，通货膨胀率虽然在猪周期带动下略有抬升，但整体影响相对可控；在此宏观环境下，货币政策维持流动性合理充裕，财政政策积极发力，维持经济动能。

操作上，继续坚持以中高等级信用债获取稳定票息收益、长久期利率债波段操作增厚资本利得的投资策略，对部分中短期收益较低债券进行置换，积极配置高息安全资产，

以提升票息收益，另外略降低长久期信用债持仓比例，优化组合持仓期限结构，调整后基金久期适中、维持较高流动性。

权益方面：上半年，A股指数在2018年大跌之后，1季度大幅快速反弹，二季度部分回调，走出了先扬后抑的态势。年初至今，上证指数上涨19.45%，深证成指上涨26.78%，中小板指上涨20.75%，创业板指上涨20.87%，整体上呈现出大盘白马股跑赢中小盘成长股，尤其是核心资产得到了持续抱团上涨的现象。

在此期间，宏观数据和市场情绪也走出了先扬后抑的趋势。年初社融增速大幅提升，房地产销售数据回暖，消费数据也好于预期，美联储的加息步伐放缓，外资大幅流入A股，国内市场流动性较为宽松，上市公司业绩整体好于预期，股市整体估值偏低，诸多因素推动市场大幅反弹。进入2季度，货币政策开始回归中性，社融增速冲高回落，房地产销售数据再次走弱，汽车家电消费一直低迷，贸易战烽烟再起，市场避险情绪增加，股指高位回调，回吐部分涨幅。

在此背景下，本基金权益部分主要配置消费金融等白马股，取得了一定的绝对收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末前海开源鼎瑞债券A基金份额净值为1.0825元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为2.61%，同期业绩比较基准收益率为2.78%；截至报告期末前海开源鼎瑞债券C基金份额净值为1.0704元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为2.40%，同期业绩比较基准收益率为2.78%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

固定收益方面：展望下半年，宏观经济依然存在下行压力，在外围经济逐步走弱、货币政策逐步宽松的背景下，我国货币政策依然大概率维持相对宽松，利好债市，但注意要防范去杠杆过程中的信用风险，在严控风险的前提下追求较高收益。

权益方面：展望下半年，在贸易战和金融去杠杆的大背景下，预计宏观经济下行压力不小，但是货币政策和财政政策仍将保持适度灵活宽松。贸易战在经历了上半年的反复谈判拉锯之后，压力有望减小，将带动市场情绪回暖。市场主要矛盾从外部转为内部，经济的复苏态势将成为市场走势的主导力量。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会由督察长、基金核算部、监察稽核部、金融工程部、

交易部、投资研究部门负责人及其他指定相关人员组成。估值委员会成员均具备专业胜任能力和相关从业资格，精通各自领域的理论知识，熟悉相关政策法规，并具有丰富的实践经验。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供固定收益品种的估值数据。

本基金本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内，未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

本基金本报告期内，从2019年5月9日至2019年6月5日连续20个工作日基金份额持有人数量不满二百人。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对前海开源鼎瑞债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，前海开源鼎瑞债券型证券投资基金的管理人--前海开源基金管理有限公司在前海开源鼎瑞债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，前海开源鼎瑞债券型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对前海开源基金管理有限公司编制和披露的前海开源鼎瑞债券型证券投资基金2019年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：前海开源鼎瑞债券型证券投资基金

报告截止日：2019年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	694,471.53	843,270.91
结算备付金		14,452,508.75	15,370,577.63
存出保证金		419,633.16	411,059.89
交易性金融资产	6.4.7.2	2,518,448,609.84	2,994,338,624.88
其中：股票投资		198,806,287.10	100,872,991.16
基金投资		-	-
债券投资		2,047,436,502.20	2,692,709,994.00
资产支持证券投资		272,205,820.54	200,755,639.72
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	29,000,163.50
应收证券清算款		10,353,474.76	2,663,559.96
应收利息	6.4.7.5	35,409,740.96	60,402,532.31
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,579,778,439.00	3,103,029,789.08
负债和所有者权益	**附注号**	本期末 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-

交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		574,699,800.20	780,200,000.00
应付证券清算款		8,727,707.40	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		973,716.97	1,181,921.30
应付托管费		243,429.24	295,480.34
应付销售服务费		22.05	12.97
应付交易费用	6.4.7.7	709,012.23	834,720.60
应交税费		173,447.45	142,123.08
应付利息		224,117.76	731,568.12
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	208,416.98	460,000.00
负债合计		585,959,670.28	783,845,826.41
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	1,841,865,456.40	2,198,364,562.47
未分配利润	6.4.7.10	151,953,312.32	120,819,400.20
所有者权益合计		1,993,818,768.72	2,319,183,962.67
负债和所有者权益总计		2,579,778,439.00	3,103,029,789.08

报告截止日2019年6月30日，前海开源鼎瑞债券型证券投资基金A基金份额净值1.0825元，基金份额总额1,841,802,879.40份；前海开源鼎瑞债券型证券投资基金C基金份额净值1.0704元，基金份额总额62,577.00份。

6.2 利润表

会计主体：前海开源鼎瑞债券型证券投资基金

本报告期：2019年01月01日至2019年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期2019年01月01日 至2019年06月30日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日

一、收入		74,362,013.38	56,827,529.89
1.利息收入		49,034,180.26	47,994,375.39
其中：存款利息收入	6.4.7.11	200,932.78	210,349.55
债券利息收入		44,565,656.56	42,383,721.76
资产支持证券利息收入		4,167,210.88	5,262,744.93
买入返售金融资产收入		100,380.04	137,559.15
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		8,633,015.36	5,548,632.66
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-30,804,005.28	-7,509,078.48
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	37,371,765.83	9,299,703.50
资产支持证券投资收益	6.4.7.14.5	-24,300.82	-148,143.84
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	2,089,555.63	3,906,151.48
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	16,694,486.62	3,284,521.52
4.汇兑收益（损失以“－”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	331.14	0.32
减：二、费用		19,658,961.97	26,865,215.21
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	6,047,567.71	6,851,724.36
2．托管费	6.4.10.2.2	1,511,891.93	1,712,931.07
3．销售服务费	6.4.10.2.3	130.62	94.21

4．交易费用	6.4.7.20	2,256,628.35	2,929,472.27
5．利息支出		9,603,184.43	15,017,158.03
其中：卖出回购金融资产支出		9,603,184.43	15,017,158.03
6．税金及附加		100,942.08	104,085.96
7．其他费用	6.4.7.21	138,616.85	249,749.31
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		54,703,051.41	29,962,314.68
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		54,703,051.41	29,962,314.68

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：前海开源鼎瑞债券型证券投资基金

本报告期：2019年01月01日至2019年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	2,198,364,562.47	120,819,400.20	2,319,183,962.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	54,703,051.41	54,703,051.41
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-356,499,106.07	-23,569,139.29	-380,068,245.36
其中：1.基金申购款	93,357,304.50	6,907,676.59	100,264,981.09
2.基金赎回款	-449,856,410.57	-30,476,815.88	-480,333,226.45
四、本期向基金份额	-	-	-

持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	1,841,865,456.40	151,953,312.32	1,993,818,768.72
项 目	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	2,198,383,267.33	90,953,251.99	2,289,336,519.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	29,962,314.68	29,962,314.68
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-13,737.59	-569.17	-14,306.76
其中:1.基金申购款	1,692.88	82.92	1,775.80
2.基金赎回款	-15,430.47	-652.09	-16,082.56
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	2,198,369,529.74	120,914,997.50	2,319,284,527.24

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

蔡颖	何璁	傅智
————————	————————	————————
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

前海开源鼎瑞债券型证券投资基金（以下简称"本基金"）经中国证券监督管理委员会（以下简称"中国证监会"）证监许可【2016】1715号文《关于准予前海开源鼎瑞债券型证券投资基金注册的批复》，由前海开源基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《前海开源鼎瑞债券型证券投资基金基金合同》及其他法律法规公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次募集期间为2016年8月9日至2016年8月11日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集200,219,024.04元，经瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）瑞华验字[2016]第02030128号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《前海开源鼎瑞债券型证券投资基金基金合同》于2016年8月16日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为200,249,068.05份基金份额，其中认购资金利息折合30,044.01 份基金份额。本基金的基金管理人为前海开源基金管理有限公司，本基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则－基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及其他中国证监会、中国证券投资基金业协会发布的有关规定和指引编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期未发生会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

（1）资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额

（2）对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

（3）对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称"中国结算")提出申请，由中国结算向H股公

司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

（4）基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019年06月30日
活期存款	694,471.53
定期存款	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
合计	694,471.53

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末2019年06月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		187,975,230.49	198,806,287.10	10,831,056.61
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	837,512,811.63	844,158,502.20	6,645,690.57
	银行间市	1,193,976,531.29	1,203,278,000.00	9,301,468.71

	场			
	合计	2,031,489,342.92	2,047,436,502.20	15,947,159.28
资产支持证券		272,205,820.54	272,205,820.54	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		2,491,670,393.95	2,518,448,609.84	26,778,215.89

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年06月30日
应收活期存款利息	218.56
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	5,853.24
应收债券利息	27,106,265.24
应收资产支持证券利息	8,297,234.00
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	169.92
合计	35,409,740.96

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年06月30日
交易所市场应付交易费用	699,425.33
银行间市场应付交易费用	9,586.90
合计	709,012.23

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	208,416.98
合计	208,416.98

6.4.7.9 实收基金

6.4.7.9.1 前海开源鼎瑞债券A

金额单位：人民币元

项目 （前海开源鼎瑞债券A）	本期2019年01月01日至2019年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,198,328,713.01	2,198,328,713.01
本期申购	93,250,949.77	93,250,949.77
本期赎回（以“-”号填列）	-449,776,783.38	-449,776,783.38
本期末	1,841,802,879.40	1,841,802,879.40

6.4.7.9.2 前海开源鼎瑞债券C

金额单位：人民币元

项目 （前海开源鼎瑞债券C）	本期2019年01月01日至2019年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	35,849.46	35,849.46
本期申购	106,354.73	106,354.73
本期赎回（以“-”号填列）	-79,627.19	-79,627.19
本期末	62,577.00	62,577.00

注：申购含红利再投、转换入份（金）额；赎回含转换出份（金）额。

6.4.7.10 未分配利润

6.4.7.10.1 前海开源鼎瑞债券A

单位：人民币元

项目 （前海开源鼎瑞债券A）	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	106,879,469.60	13,938,307.82	120,817,777.42
本期利润	38,007,520.45	16,694,790.81	54,702,311.26
本期基金份额交易产生的变动数	-19,885,528.65	-3,685,652.39	-23,571,181.04
其中：基金申购款	6,536,319.83	364,391.59	6,900,711.42
基金赎回款	-26,421,848.48	-4,050,043.98	-30,471,892.46
本期已分配利润	-	-	-
本期末	125,001,461.40	26,947,446.24	151,948,907.64

6.4.7.10.2 前海开源鼎瑞债券C

单位：人民币元

项目 （前海开源鼎瑞债券C）	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,395.72	227.06	1,622.78
本期利润	1,044.34	-304.19	740.15
本期基金份额交易产生的变动数	1,055.51	986.24	2,041.75
其中：基金申购款	5,725.06	1,240.11	6,965.17
基金赎回款	-4,669.55	-253.87	-4,923.42

本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,495.57	909.11	4,404.68

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2019年01月01日至2019年06月30日
活期存款利息收入	71,421.40
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	125,820.81
其他	3,690.57
合计	200,932.78

注：″其他″为应收结算保证金利息。

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日
卖出股票成交总额	819,207,248.19
减：卖出股票成本总额	850,011,253.47
买卖股票差价收入	-30,804,005.28

6.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期内无基金投资收益。

6.4.7.14 债券投资收益

6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	37,371,765.83

债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	37,371,765.83

6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	2,614,870,412.68
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	2,533,827,804.38
减：应收利息总额	43,670,842.47
买卖债券差价收入	37,371,765.83

6.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

6.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券申购差价收入。

6.4.7.14.5 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日
卖出资产支持证券成交总额	40,886,680.00
减：卖出资产支持证券成本总额	40,031,857.53
减：应收利息总额	879,123.29
资产支持证券投资收益	-24,300.82

6.4.7.15 贵金属投资收益

6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15.2 贵金属投资收益--买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

6.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属赎回差价收入。

6.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属申购差价收入。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无买卖权证差价收入。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无其他衍生工具投资收益。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日
股票投资产生的股利收益	2,089,555.63
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,089,555.63

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年01月01日至2019年06月30日
1.交易性金融资产	16,694,486.62

——股票投资	47,894,898.66
——债券投资	-31,200,412.04
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	16,694,486.62

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日
基金赎回费收入	318.66
转换费收入	12.48
合计	331.14

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日
交易所市场交易费用	2,234,078.35
银行间市场交易费用	22,550.00
合计	2,256,628.35

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日
审计费用	49,588.57
信息披露费	58,828.41
汇划手续费	8,599.87
账户维护费	18,600.00
律师费	3,000.00
合计	138,616.85

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
前海开源基金管理有限公司（“前海开源基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人
开源证券股份有限公司（“开源证券”）	基金管理人股东、基金代销机构
北京市中盛金期投资管理有限公司	基金管理人股东
北京长和世纪资产管理有限公司	基金管理人股东
深圳市和合投信资产管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
前海开源资产管理有限公司	基金管理人的子公司

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易，无佣金产生。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	6,047,567.71	6,851,724.36
其中：支付销售机构的客户维护费	275.71	-

本基金的管理费按前一日资产净值的0.60%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.60%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。本基金管理人按照与基金代销机构签订的基金销售协议约定，依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客

户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，客户维护费从基金管理费中列支。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,511,891.93	1,712,931.07

本基金的托管费按前一日资产净值的0.15%年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.15%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2019年01月01日至2019年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	前海开源鼎瑞债券A	前海开源鼎瑞债券C	合计
前海开源基金管理有限公司	0.00	4.33	4.33
合计	0.00	4.33	4.33
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	前海开源鼎瑞债券A	前海开源鼎瑞债券C	合计
前海开源基金管理	0.00	1.81	1.81

有限公司			
合计	0.00	1.81	1.81

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.40%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务。

销售服务费按前一日C类基金资产净值的0.40%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×0.40%÷当年天数

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。销售服务费由登记机构代收并按照相关合同规定支付给基金销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间与关联方无银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年01月01日至2019年06月30日		上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	694,471.53	71,421.40	19,164,394.74	70,713.09

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按适用利率或约定利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况--非货币市场基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2019年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发或增发而持有流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
101800900	18中建MTN002	2019-07-04	103.40	560,000	57,904,000.00
合计				560,000	57,904,000.00

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2019年6月30日止,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额521,500,000.00元，于2019年7月5日前先后到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要是信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以监察及风险控制委员会、督察长、风险控制委员会、监察稽核部、金融工程部和相关业务部门构成的多层级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立监察及风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；本基金的基金管理人设立督察长制度，积极对公司各项制度、业务的合法合规性及内部控制制度的执行情况进行监察、稽核，定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部、金融工程部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款由基金托管人保管，与该银行存款相关的信用风险不重大。 本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级，通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，且通过分散化投资以分散信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日

A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	-	90,207,000.00
合计	-	90,207,000.00

注：未评级债券为国债、央票及政策性金融债等。债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有短期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末未持有短期信用评级的同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
AAA	1,206,654,000.00	1,735,098,000.00
AAA以下	209,896,502.20	59,994.00
未评级	630,886,000.00	867,345,000.00
合计	2,047,436,502.20	2,602,502,994.00

注：未评级债券为国债、央票及政策性金融债等。债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
AAA	171,068,743.83	150,517,220.54
AAA以下	-	-
未评级	101,137,076.71	50,238,419.18
合计	272,205,820.54	200,755,639.72

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末未持有长期信用评级的同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大部分证券在证券交易所或银行间同业市场交易，除在"期末本基金持有的流通受限证券"中列示的部分基金资产流通暂时受限制的情况外，其余均能及时变现。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自2017年10月1日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不超过该上市公司可流通股票的15%；本基金与由本基金的基金管理人管理的其他全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)，同时，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能

以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2019年06月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	694,471.53	-	-	-	694,471.53
结算备	14,452,508.75	-	-	-	14,452,508.75

付金					
存出保证金	419,633.16	-	-	-	419,633.16
交易性金融资产	240,162,556.16	1,555,825,766.58	523,654,000.00	198,806,287.10	2,518,448,609.84
应收证券清算款	-	-	-	10,353,474.76	10,353,474.76
应收利息	-	-	-	35,409,740.96	35,409,740.96
资产总计	255,729,169.60	1,555,825,766.58	523,654,000.00	244,569,502.82	2,579,778,439.00
负债					
卖出回购金融资产款	574,699,800.20	-	-	-	574,699,800.20
应付证券清算款	-	-	-	8,727,707.40	8,727,707.40
应付管理人报酬	-	-	-	973,716.97	973,716.97
应付托管费	-	-	-	243,429.24	243,429.24
应付销售服务费	-	-	-	22.05	22.05
应付交易费用	-	-	-	709,012.23	709,012.23
应交税费	-	-	-	173,447.45	173,447.45
应付利息	-	-	-	224,117.76	224,117.76
其他负债	-	-	-	208,416.98	208,416.98
负债总计	574,699,800.20	-	-	11,259,870.08	585,959,670.28

利率敏感度缺口	-318,970,630.60	1,555,825,766.58	523,654,000.00	233,309,632.74	1,993,818,768.72
上年度末2018年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	843,270.91	-	-	-	843,270.91
结算备付金	15,370,577.63	-	-	-	15,370,577.63
存出保证金	411,059.89	-	-	-	411,059.89
交易性金融资产	367,368,413.69	1,849,700,220.03	676,397,000.00	100,872,991.16	2,994,338,624.88
买入返售金融资产	29,000,163.50	-	-	-	29,000,163.50
应收证券清算款	-	-	-	2,663,559.96	2,663,559.96
应收利息	-	-	-	60,402,532.31	60,402,532.31
资产总计	412,993,485.62	1,849,700,220.03	676,397,000.00	163,939,083.43	3,103,029,789.08
负债					
卖出回购金融资产款	780,200,000.00	-	-	-	780,200,000.00
应付管理人报酬	-	-	-	1,181,921.30	1,181,921.30
应付托管费	-	-	-	295,480.34	295,480.34
应付销售服务	-	-	-	12.97	12.97

费					
应付交易费用	-	-	-	834,720.60	834,720.60
应交税费	-	-	-	142,123.08	142,123.08
应付利息	-	-	-	731,568.12	731,568.12
其他负债	-	-	-	460,000.00	460,000.00
负债总计	780,200,000.00	-	-	3,645,826.41	783,845,826.41
利率敏感度缺口	-367,206,514.38	1,849,700,220.03	676,397,000.00	160,293,257.02	2,319,183,962.67

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的账面价值，并按照合约规定的重新定价日期或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
	基准点利率增加0.25%	-13,944,397.96	-18,701,000.80
	基准点利率减少0.25%	14,116,857.46	18,963,760.25

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变化而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019年06月30日		上年度末 2018年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产－股票投资	198,806,287.10	9.97	100,872,991.16	4.35
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	198,806,287.10	9.97	100,872,991.16	4.35

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	若其他市场变量保持不变，对市场价格敏感的权益性投资的市场价格上升或下降5%		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
	权益性投资的市场价格上升5%	12,353,299.59	4,908,735.63

	权益性投资的市场价格下降5%	-12,353,299.59	-4,908,735.63

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	198,806,287.10	7.71
	其中：股票	198,806,287.10	7.71
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,319,642,322.74	89.92
	其中：债券	2,047,436,502.20	79.36
	资产支持证券	272,205,820.54	10.55
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	15,146,980.28	0.59
8	其他各项资产	46,182,848.88	1.79
9	合计	2,579,778,439.00	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-

C	制造业	129,608,027.39	6.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,184,080.00	0.26
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	4,023,613.44	0.20
G	交通运输、仓储和邮政业	6,124,318.00	0.31
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	34,975,964.54	1.75
K	房地产业	7,022,025.00	0.35
L	租赁和商务服务业	5,365,363.95	0.27
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	6,502,894.78	0.33
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	198,806,287.10	9.97

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未通过港股通机制投资港股。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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(%)
1	600519	贵州茅台	36,600	36,014,400.00	1.81
2	000651	格力电器	509,825	28,040,375.00	1.41

3	000858	五 粮 液	170,900	20,157,655.00	1.01
4	600030	中信证券	771,804	18,376,653.24	0.92
5	601318	中国平安	187,330	16,599,311.30	0.83
6	000063	中兴通讯	493,635	16,057,946.55	0.81
7	000333	美的集团	258,400	13,400,624.00	0.67
8	600585	海螺水泥	177,900	7,382,850.00	0.37
9	000002	万 科A	252,500	7,022,025.00	0.35
10	300015	爱尔眼科	209,974	6,502,894.78	0.33
11	600009	上海机场	73,100	6,124,318.00	0.31
12	601888	中国国旅	60,523	5,365,363.95	0.27
13	000791	甘肃电投	1,205,600	5,184,080.00	0.26
14	000661	长春高新	14,087	4,761,406.00	0.24
15	600729	重庆百货	133,056	4,023,613.44	0.20
16	002475	立讯精密	152,996	3,792,770.84	0.19

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	49,445,849.90	2.13
2	600030	中信证券	47,733,849.73	2.06
3	000651	格力电器	45,081,205.23	1.94
4	002475	立讯精密	35,870,186.98	1.55
5	601688	华泰证券	33,602,632.55	1.45
6	000063	中兴通讯	33,132,297.70	1.43
7	601318	中国平安	31,436,225.20	1.36
8	300059	东方财富	26,782,671.61	1.15
9	600036	招商银行	25,625,438.84	1.10
10	000858	五 粮 液	24,468,183.82	1.06
11	000333	美的集团	22,657,629.92	0.98

12	600585	海螺水泥	22,307,823.49	0.96
13	002916	深南电路	18,307,594.89	0.79
14	000661	长春高新	17,545,524.00	0.76
15	000002	万 科A	16,836,990.16	0.73
16	000860	顺鑫农业	16,517,757.82	0.71
17	601888	中国国旅	16,169,299.85	0.70
18	600340	华夏幸福	16,145,809.24	0.70
19	600031	三一重工	15,757,986.79	0.68
20	300498	温氏股份	14,668,045.23	0.63

注：买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600030	中信证券	36,878,236.45	1.59
2	600729	重庆百货	35,237,416.24	1.52
3	601688	华泰证券	33,408,352.78	1.44
4	002475	立讯精密	31,153,815.26	1.34
5	300059	东方财富	30,506,916.08	1.32
6	300237	美晨生态	27,549,839.85	1.19
7	600036	招商银行	26,520,307.31	1.14
8	002916	深南电路	23,589,239.33	1.02
9	000063	中兴通讯	19,346,313.66	0.83
10	600519	贵州茅台	18,900,678.40	0.81
11	601318	中国平安	16,889,828.00	0.73
12	600031	三一重工	16,712,582.85	0.72
13	601888	中国国旅	16,498,282.21	0.71
14	600585	海螺水泥	16,487,485.23	0.71
15	000651	格力电器	16,420,895.00	0.71

16	600340	华夏幸福	15,293,837.16	0.66
17	000860	顺鑫农业	15,103,950.14	0.65
18	600309	万华化学	13,957,462.78	0.60
19	300498	温氏股份	13,193,252.94	0.57
20	000661	长春高新	12,730,476.30	0.55

注：卖出包括二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，卖出金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	900,049,650.75
卖出股票收入（成交）总额	819,207,248.19

注：买入股票成本、卖出股票收入均按照买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	630,886,000.00	31.64
	其中：政策性金融债	630,886,000.00	31.64
4	企业债券	895,734,600.00	44.93
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	520,747,000.00	26.12
7	可转债(可交换债)	68,902.20	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,047,436,502.20	102.69

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	180206	18国开06	1,000,000	105,530,000.00	5.29
2	100204	10国开04	1,000,000	99,530,000.00	4.99
3	136253	16中油03	900,000	89,649,000.00	4.50
4	150405	15农发05	800,000	81,256,000.00	4.08
5	150210	15国开10	700,000	72,002,000.00	3.61

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	139145	蚁信03A	500,000	50,898,657.53	2.55
2	139053	深借呗2A	500,000	50,394,136.98	2.53
3	139092	深借呗3A	500,000	50,238,419.18	2.52
4	149997	18建花2A	500,000	50,091,226.03	2.51
5	149933	18建花A	300,000	30,583,380.82	1.53
6	139453	链融07A1	300,000	30,000,000.00	1.50
7	139303	万科30A1	100,000	10,000,000.00	0.50

7.8 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

7.12.2 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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	419,633.16
2	应收证券清算款	10,353,474.76
3	应收股利	-
4	应收利息	35,409,740.96
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	46,182,848.88

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	128016	雨虹转债	68,902.20	-

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 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。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
前海开源鼎瑞债券A	142	12,970,442.81	1,841,731,907.04	100.00%	70,972.36	0.00%
前海开源鼎瑞债券C	66	948.14	0.00	0.00%	62,577.00	100.00%

合计	208	8,855,122.39	1,841,731,907.04	99.99%	133,549.36	0.01%

注：① 分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数(即期末基金份额总额)。

② 户均持有的基金份额合计=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	前海开源鼎瑞债券A	2,419.43	0.00%
	前海开源鼎瑞债券C	224.24	0.36%
	合计	2,643.67	0.00%

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	前海开源鼎瑞债券A	0
	前海开源鼎瑞债券C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	前海开源鼎瑞债券A	0
	前海开源鼎瑞债券C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	前海开源鼎瑞债券A	前海开源鼎瑞债券C
基金合同生效日(2016年08月16日)基金份额总额	200,029,994.24	219,073.81
本报告期期初基金份额总额	2,198,328,713.01	35,849.46
本报告期基金总申购份额	93,250,949.77	106,354.73
减：本报告期基金总赎回份额	449,776,783.38	79,627.19
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,841,802,879.40	62,577.00

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。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动；

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期基金管理人、托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚的情形。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
天风证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-

中泰证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
瑞信方正	2	-	-	-	-	-
宏信证券	2	1,719,095,509.14	100.00%	1,257,176.13	100.00%	-
安信证券	4	-	-	-	-	-

注：根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，我公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序：

A：选择标准

1、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；

2、公司具有较强的研究能力,能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告；

3、公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；

4、建立了广泛的信息网络,能及时提供准确的信息资讯服务。

B：选择流程

公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比，并根据评比的结果选择席位：

1、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座；

2、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实，投资建议是否准确；

3、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成	成交金额	占当期债券回	成交	占当期权证成交总	成交	占当期基金成交总

		交总额的比例		购成交总额的比例	金额	额的比例	金额	额的比例
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
山西证券	450,184,686.59	31.61%	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	254,089,510.41	17.84%	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞信方正	-	-	-	-	-	-	-	-
宏信证券	719,946,382.14	50.55%	14,901,618,000.00	100.00%	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	前海开源基金管理有限公司旗下基金2018年12月31日基金资产净值、基金份额净值及基金份额累计净值公告（一）	基金管理人的官方网站	2019-01-02
2	前海开源基金管理有限公司关于增加第一创业证券为旗下部分基金的销售机构并参	中国证券报、基金管理人的官方网站	2019-01-08

	与其费率优惠活动的公告		
3	关于调整前海开源旗下部分证券投资基金通过东海证券办理定投业务起点金额的公告	中国证券报、基金管理人的官方网站	2019-01-21
4	前海开源鼎瑞债券型证券投资基金2018年第4季度报告	中国证券报、基金管理人的官方网站	2019-01-22
5	前海开源基金管理有限公司关于暂停大泰金石基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证券报、基金管理人的官方网站	2019-01-31
6	前海开源基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加平安证券认购、申购及定投费率优惠的公告	中国证券报、基金管理人的官方网站	2019-03-04
7	前海开源基金管理有限公司关于增加百度百盈基金为旗下部分基金的销售机构并开通相关业务的公告	中国证券报、基金管理人的官方网站	2019-03-04
8	前海开源基金管理有限公司关于增加长城证券为旗下部分基金的销售机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人的官方网站	2019-03-12
9	前海开源基金管理有限公司关于增加信诚基金为旗下部分基金的销售机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人的官方网站	2019-03-15
10	前海开源鼎瑞债券型证券投资基金2018年年度报告	基金管理人的官方网站	2019-03-27
11	前海开源鼎瑞债券型证券投资基金2018年年度报告摘要	中国证券报、基金管理人的官方网站	2019-03-27
12	前海开源基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参	中国证券报、基金管理人的官方网站	2019-03-27

	加凤凰金信转换业务申购补差费率优惠活动的公告		
13	前海开源基金管理有限公司关于开源宝赎回转认/申购基金业务在电子直销平台实施费率优惠的公告	中国证券报、基金管理人的官方网站	2019-03-29
14	前海开源鼎瑞债券型证券投资基金招募说明书（更新）（2019年第1号）	基金管理人的官方网站	2019-04-01
15	前海开源鼎瑞债券型证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2019年第1号）	中国证券报、基金管理人的官方网站	2019-04-01
16	前海开源基金管理有限公司关于增加玄元保险为旗下部分基金的销售机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人的官方网站	2019-04-03
17	前海开源基金管理有限公司关于增加中信建投为旗下部分基金的销售机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人的官方网站	2019-04-16
18	前海开源鼎瑞债券型证券投资基金2019年第1季度报告	中国证券报、基金管理人的官方网站	2019-04-19
19	关于调整前海开源旗下部分证券投资基金通过恒宇天泽办理定投业务起点金额的公告	中国证券报、基金管理人的官方网站	2019-04-25
20	前海开源鼎瑞债券型证券投资基金变更基金经理的公告	中国证券报、基金管理人的官方网站	2019-05-10
21	前海开源基金管理有限公司关于增加华福证券为旗下部分基金的销售机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人的官方网站	2019-05-17
22	前海开源基金管理有限公司	中国证券报、基金管理人的	2019-06-06

	关于增加中信证券等为旗下部分基金代销机构的公告	官方网站	
23	前海开源基金管理有限公司关于增加中证金牛为旗下部分基金的代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人的官方网站	2019-06-17
24	前海开源基金管理有限公司关于增加新华信通为旗下部分基金的销售机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人的官方网站	2019-06-24

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20190101 - 20190128	499,349,845.20	0.00	249,674,922.60	249,674,922.60	13.56%
	2	20190101 - 20190630	1,498,948,045.89	0.00	0.00	1,498,948,045.89	81.38%
产品特有风险							
1.巨额赎回风险 （1）本基金单一投资者所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证券以应付基金赎回的现金需要，对本基金的投资运作及净值表现产生较大影响； （2）单一投资者大额赎回时容易造成本基金发生巨额赎回。在发生巨额赎回情形时，在符合基金合同约定情况下，如基金管理人认为有必要，可延期办理本基金的赎回申请，投资者可能面临赎回申请被延期办理的风险；如果连续2个开放日以上（含）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响； 2.转换运作方式或终止基金合同的风险 单一投资者巨额赎回后，若本基金连续60个工作日基金份额持有人低于200人或基金资产净值低于5000万情形的，基金管理人应当向中国证监会提出解决方案，或按基金合同约定，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时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险； 4.巨额赎回可能导致基金资产规模过小，导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

2019年4月14日，由中国证券报社主办的第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持续优胜金牛基金"。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

（1）中国证券监督管理委员会批准前海开源鼎瑞债券型证券投资基金设立的文件

（2）《前海开源鼎瑞债券型证券投资基金基金合同》

（3）《前海开源鼎瑞债券型证券投资基金托管协议》

（4）《前海开源鼎瑞债券型证券投资基金招募说明书》

（5）基金管理人业务资格批件和营业执照

（6）前海开源鼎瑞债券型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

12.3 查阅方式

（1）投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件

（2）投资者对本报告书如有疑问，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

前海开源基金管理有限公司

二〇一九年八月二十四日