
前海开源弘丰债券型发起式证券投资基金
(原前海开源润鑫灵活配置混合型证券投资基金转型)

2020年第2季度报告

2020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:上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期:2020年07月21日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2020年7月17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。

本报告中财务资料未经审计。

本基金系前海开源润鑫灵活配置混合型证券投资基金转型而来。2020年3月17日起至2020年4月17日，前海开源润鑫灵活配置混合型证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，会议审议了《关于前海开源润鑫灵活配置混合型证券投资基金变更注册并修改基金合同等事项的议案》，该议案于2020年4月20日表决通过。自2020年4月21日（含当日）起，“前海开源润鑫灵活配置混合型证券投资基金”更名为“前海开源弘丰债券型发起式证券投资基金”，原《前海开源润鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》失效，《前海开源弘丰债券型发起式证券投资基金基金合同》生效。

本报告中，前海开源润鑫灵活配置混合型证券投资基金报告期自2020年4月1日起至2020年4月20日止，前海开源弘丰债券型发起式证券投资基金报告期自2020年4月21日起至2020年6月30日止。

§ 2 基金产品概况

转型后

基金简称	前海开源弘丰债券
基金主代码	005138
基金运作方式	契约型发起式开放式
基金转型合同生效日	2020年04月21日
报告期末基金份额总额	635,895,374.75份
投资目标	本基金在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6个方面内容： 1、大类资产配置 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，在对宏观经济因素进行充分研究的基础上，判断宏观经济周期所处阶段。本基金将依据经济周期理论，结合对证券市场的系统性风险以及未来一段时期内各大类资产风险和预期收益率的评估，制定本基金在股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例。

本基金通过对股票等权益类、债券等固定收益类和现金资产分布的实时监控，根据经济运行周期变动、市场利率变化、市场估值、证券市场变化等因素以及基金的风险评估进行灵活调整。在各类资产中，根据其参与市场基本要素的变动，调整各类资产在基金投资组合中的比例。

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、可转换债券投资策略、中小企业私募债券投资策略、证券公司短期公司债券投资策略等积极投资策略。

3、股票投资策略

本基金将结合定量和定性分析构建股票投资组合。定量分析方面，本基金将主要根据PEG（即市盈率相对盈利增长比率）等指标来考察未来一段时期内公司的投资价值。该指标既通过市盈率考察公司的估值状况，又通过盈利增长速度度量股票潜在成长力。本基金将综合历史PEG和预期PEG等多个维度的数据对公司当前的价值和未来成长性进行评估，并结合其他定量指标精选出具有成长性且估值合理的上市公司。定性分析方面，本基金将综合考量企业家精神、公司治理、竞争优势、核心壁垒、产业地位、过往业绩等方面，通过对上市公司的成长性和价值进行综合评判，最终构建股票投资组合，并优先采用等权重的方式投资。本基金也将根据市场行情变化及实际投资需要进行动态灵活调整。

另外，本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，不使用合格境内机构投资者（QDII）境外投资额度进行境外投资。本基金将从港股通标的股票中精选出具有增长潜力且估值合理或被低估的港股纳入本基金的股票投资组

	<p>合。</p> <p>4、权证投资策略</p> <p>在权证投资方面，本基金根据权证对应公司基本面研究成果确定权证的合理估值，发现市场对股票权证的非理性定价；利用权证衍生工具的特性，通过权证与证券的组合投资，来达到改善组合风险收益特征的目的。</p> <p>5、资产支持证券投资策略</p> <p>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。</p> <p>6、国债期货投资策略</p> <p>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。</p>	
业绩比较基准	中证全债指数收益率×80%+中证500指数收益率×10%+恒生指数收益率×10%	
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险和预期收益水平高于货币型基金，低于混合型基金和股票型基金。本基金如果投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。	
基金管理人	前海开源基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	前海开源弘丰债券A	前海开源弘丰债券C
下属分级基金的交易代码	005138	005139
报告期末下属分级基金的份额总额	632,269,168.63份	3,626,206.12份

转型前

基金简称	前海开源润鑫混合
基金主代码	005138

基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年03月27日
报告期末基金份额总额	132,931,850.99份
投资目标	本基金在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	<p>本基金的投资策略主要有以下七个方面内容：</p> <p>1、大类资产配置</p> <p>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，在对宏观经济因素进行充分研究的基础上，判断宏观经济周期所处阶段。本基金将依据经济周期理论，结合对证券市场的系统性风险以及未来一段时期内各大类资产风险和预期收益率的评估，制定本基金在股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金将精选有良好增值潜力的上市公司股票构建股票投资组合。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>在债券投资策略方面，本基金将在综合研究的基础上实施积极主动的组合管理，采用宏观环境分析和微观市场定价分析两个方面进行债券资产的投资。</p> <p>4、权证投资策略</p> <p>在权证投资方面，本基金根据权证对应公司基本面研究成果确定权证的合理估值，发现市场对股票权证的非理性定价；利用权证衍生工具的特性，通过权证与证券的组合投资，来达到改善组合风险收益特征的目的。</p> <p>5、资产支持证券投资策略</p> <p>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。</p> <p>6、股指期货投资策略</p>

	本基金将在风险可控的前提下，本着谨慎原则，适度参与股指期货投资。 7、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。	
业绩比较基准	沪深300指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%	
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金，低于股票型基金。	
基金管理人	前海开源基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	前海开源润鑫混合A	前海开源润鑫混合C
下属分级基金的交易代码	005138	005139
报告期末下属分级基金的份额总额	113,159,124.18份	19,772,726.81份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标(转型后)

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2020年04月21日 - 2020年06月30日)	
	前海开源弘丰债券A	前海开源弘丰债券C
1. 本期已实现收益	946,778.67	20,894.76
2. 本期利润	-880,438.95	-77,710.73
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0034	-0.0104
4. 期末基金资产净值	952,066,959.00	5,432,630.69
5. 期末基金份额净值	1.5058	1.4982

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。

3.1 主要财务指标(转型前)

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2020年04月01日 - 2020年04月20日)	
	前海开源润鑫混合A	前海开源润鑫混合C

1. 本期已实现收益	51,171.37	40,839.97
2. 本期利润	51,176.79	40,834.55
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0017	0.0020
4. 期末基金资产净值	171,402,734.35	29,820,912.97
5. 期末基金份额净值	1.5147	1.5082

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。

3.2 基金净值表现(转型后)

3.2.1 本报告期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

前海开源弘丰债券A净值表现

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
自基金合同生效起至今	-0.59%	0.05%	-0.28%	0.20%	-0.31%	-0.15%

前海开源弘丰债券C净值表现

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
自基金合同生效起至今	-0.66%	0.05%	-0.28%	0.20%	-0.38%	-0.15%

注：2020年04月21日（含当日）起，本基金转型为“前海开源弘丰债券型发起式证券投资基金”，转型后，本基金的业绩比较基准为：中证全债指数收益率×80%+中证500指数收益率×10%+恒生指数收益率×10%。

3.2.2 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的比较

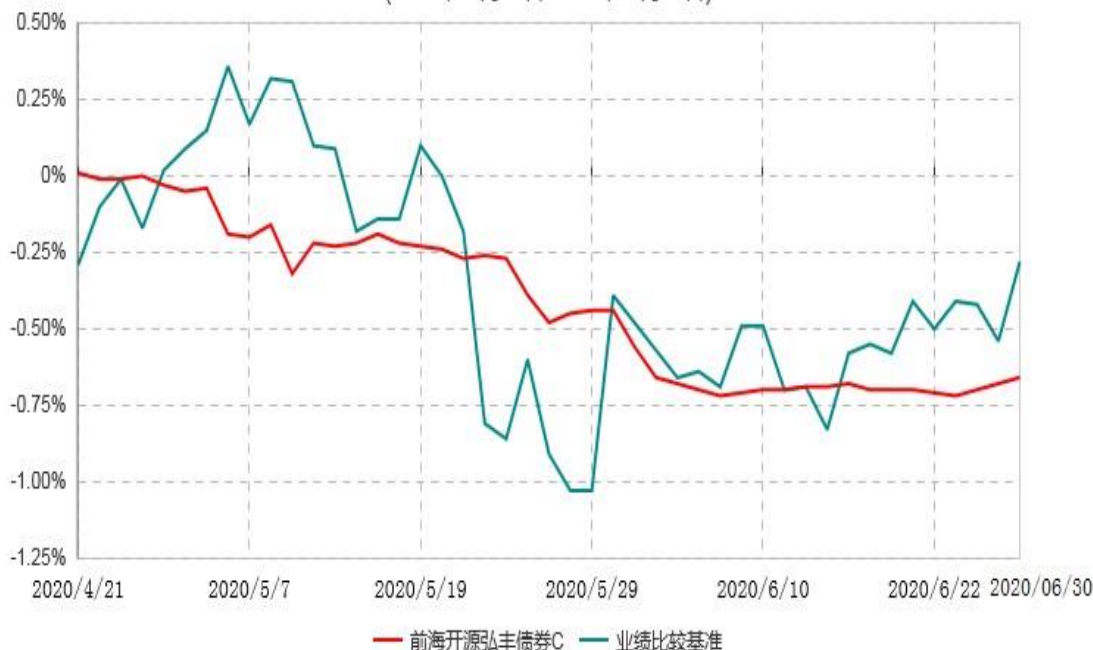
前海开源弘丰债券A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2020年04月21日-2020年06月30日)



前海开源弘丰债券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

(2020年04月21日-2020年06月30日)



注：①2020年04月21日（含当日）起，本基金转型为“前海开源弘丰债券型发起式证券投资基金”，截至2020年06月30日止，本基金转型后未满1年。

②本基金转型后的建仓期为6个月，截至2020年06月30日，本基金建仓期尚未结束。

3.2 基金净值表现(转型前)

3.2.1 本报告期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

前海开源润鑫混合A净值表现

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
过去三个月	-0.07%	1.59%	-2.00%	0.97%	1.93%	0.62%
过去六个月	10.61%	1.36%	2.83%	0.72%	7.78%	0.64%
过去一年	11.72%	1.54%	1.35%	0.66%	10.37%	0.88%
自基金合同生效起至今	51.47%	1.30%	8.99%	0.69%	42.48%	0.61%

前海开源润鑫混合C净值表现

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
过去三个月	-0.09%	1.59%	-2.00%	0.97%	1.91%	0.62%
过去六个月	10.56%	1.36%	2.83%	0.72%	7.73%	0.64%
过去一年	11.62%	1.54%	1.35%	0.66%	10.27%	0.88%
自基金合同生效起至今	50.82%	1.30%	8.99%	0.69%	41.83%	0.61%

注：转型前，本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%。

3.2.2 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的比较

前海开源润鑫混合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



前海开源润鑫混合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



3.3 其他指标(转型后)

无。

3.3 其他指标(转型前)

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
肖立强	本基金的基金经理	2019-06-12	-	9年	肖立强先生，中山大学金融学硕士。历任招商证券研究部分析师、蚂蚁金融服务集团战略部高级战略专家，2016年5月加盟前海开源基金管理有限公司，

					现任公司权益投资本部基金经理。
--	--	--	--	--	-----------------

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合规守信情况的说明

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》及其各项实施细则、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 公平交易专项说明

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2020年初新冠疫情对中国乃至世界经济运行造成了广泛的影响。中国政府的高效措施使得经济恢复的速度快于海外。预计经济将平稳，但外部贸易压力较大，减税降费等措施落实将消费得到支撑，专项债的提速也将为上半年基建投资带来增长。预计A股市场的基调将是震荡，结构性机会值得参与。本产品将继续以稳健品种为主，力争业绩平稳运行。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金由前海开源润鑫灵活配置混合型证券投资基金转型为前海开源弘丰债券型发起式证券投资基金。

转型前，截至2020年4月20日，前海开源润鑫混合A基金份额净值为1.5147元；自2020年4月1日至2020年4月20日本基金份额净值增长率为0.13%，同期业绩比较基准收益率为2.86%。

截至2020年4月20日，前海开源润鑫混合C基金份额净值为1.5082元；自2020年4月1日至2020年4月20日本基金份额净值增长率为0.13%，同期业绩比较基准收益率为2.86%。

转型后，截至2020年6月30日，前海开源弘丰债券A基金份额净值为1.5058元；自2020年4月21日至2020年6月30日本基金份额净值增长率为-0.59%，同期业绩比较基准收益率为-0.28%。

截至2020年6月30日，前海开源弘丰债券C基金份额净值为1.4982元；自2020年4月21日至2020年6月30日本基金份额净值增长率为-0.66%，同期业绩比较基准收益率为-0.28%。

4.6 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。

§ 5 投资组合报告(转型后)

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	773,172,022.50	80.57
	其中：债券	722,765,628.80	75.32
	资产支持证券	50,406,393.70	5.25
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	169,441,724.72	17.66
	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	10,866,885.18	1.13
8	其他资产	6,095,873.96	0.64
9	合计	959,576,506.36	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

无。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.3 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

无。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	89,454,371.90	9.34
2	央行票据	-	-
3	金融债券	79,556,076.90	8.31
	其中：政策性金融债	79,556,076.90	8.31
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	529,919,000.00	55.34
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	23,836,180.00	2.49
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	722,765,628.80	75.48

5.5 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

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（%）
1	010107	21国债(7)	871,790	89,454,371.90	9.34
2	190211	19国开11	500,000	50,095,000.00	5.23
3	012000411	20电网SCP014	500,000	50,080,000.00	5.23
4	012000899	20深圳高速SCP001	500,000	50,065,000.00	5.23
5	012000426	20中油股SCP005	500,000	50,065,000.00	5.23

5.6 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

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	159915	19借01A1	500,000	50,406,393.70	5.26

注：本基金本报告期末仅持有以上资产支持证券。

5.7 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

无。

5.8 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权证投资明细

无。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
----	----	-------

1	存出保证金	23,995.36
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,998,187.59
5	应收申购款	73,691.01
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	6,095,873.96

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	132009	17中油EB	14,043,400.00	1.47
2	132013	17宝武EB	8,791,780.00	0.92
3	132015	18中油EB	1,001,000.00	0.10

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.11.6 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。

§ 5 投资组合报告（转型前）

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
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	202,909,041.72	99.85
8	其他资产	295,288.02	0.15
9	合计	203,204,329.74	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

无。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.3 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

无。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

5.5 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

无。

5.6 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

无。

5.7 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

无。

5.8 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权证投资明细

无。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	14,393.84
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	92,108.73
5	应收申购款	188,785.45
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	295,288.02

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.11.6 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。

§ 6 开放式基金份额变动(转型后)

单位：份

	前海开源弘丰债券A	前海开源弘丰债券C
基金合同生效日(2020年04月21日)基金份额总额	113,159,124.18	19,772,726.81
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	532,762,215.21	3,580,074.26
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	13,652,170.76	19,726,594.95
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	632,269,168.63	3,626,206.12

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。

§ 6 开放式基金份额变动(转型前)

单位：份

	前海开源润鑫混合A	前海开源润鑫混合C
报告期期初基金份额总额	15,204,618.01	16,017,954.30
报告期期间基金总申购份额	100,404,480.39	8,654,259.92
减：报告期期间基金总赎回份额	2,449,974.22	4,899,487.41
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	113,159,124.18	19,772,726.81

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。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况(转型后)

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

	前海开源弘丰债券	前海开源弘丰债券A	前海开源弘丰债券C
基金合同生效日管理人持有的本基金份额	6,601,967.39	6,601,967.39	-
基金合同生效日起至报告期期末买	66,449,597.	66,449,597.9	-

入/申购总份额	98	8	
基金合同生效日起至报告期期末卖出/赎回总份额	-	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	73,051,565.37	73,051,565.37	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	11.49	11.55	-

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
1	基金转换入	2020-04-21	6,601,967.39	10,000,000.00	0
2	基金转换入	2020-06-11	66,449,597.98	100,000,000.00	0
合计			73,051,565.37	110,000,000.00	

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况(转型前)

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§ 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况(转型后)

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	73,051,565.37	11.49%	6,601,967.39	1.04%	不少于三年
基金管理人高级管理人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金经理等人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-

基金管理人股东	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
其他	679.80	0.00%	0.00	0.00%	-
合计	73,052,245.17	11.49%	6,601,967.39	1.04%	不少于三年

注：本基金发起式资金提供方仅为基金管理人，基金管理人高级管理人员、基金经理、其他从业人员持有的基金份额不属于发起份额。

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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	20200416 - 20200630	0.00	198,890,523.44	0.00	198,890,523.44	31.28%
	2	20200602 - 20200609	0.00	66,277,173.91	0.00	66,277,173.91	10.42%
	3	20200416 - 20200601	0.00	33,013,535.82	0.00	33,013,535.82	5.19%
	4	20200610 - 20200630	0.00	252,524,587.99	0.00	252,524,587.99	39.71%

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。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金管理人于2020年3月17日起至2020年4月17日以通讯方式组织召开了本基金的基金份额持有人大会，会议表决通过了《关于前海开源润鑫灵活配置混合型证券投资基金变更注册并修改基金合同等事项的议案》，本基金管理人根据该议案对本基金的基金合同与托管协议进行了修改。本基金自2020年4月21日起正式转型为“前海开源弘丰债券型发起式证券投资基金”。投资人敬请查阅基金管理人刊登在中国证监会规定媒介上的有关公告。

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- （1）中国证券监督管理委员会批准前海开源弘丰债券型发起式证券投资基金设立的文件
- （2）《前海开源弘丰债券型发起式证券投资基金基金合同》
- （3）《前海开源弘丰债券型发起式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）前海开源弘丰债券型发起式证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

10.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

10.3 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

2020年07月21日