

---

# 前海开源强势共识100强等权重股票型证券投资基金

## 2021年第4季度报告

### 2021年12月31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

报告送出日期:2022年01月24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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年1月20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。

本报告期自2021年10月1日起至2021年12月31日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	前海开源强势共识100强股票
基金主代码	001849
基金运作方式	契约型普通开放式
基金合同生效日	2015年12月10日
报告期末基金份额总额	7,663,684.42份
投资目标	本基金在深入研究融资融券市场运行规律的基础上，把握市场中长期趋势和短期热点，通过精选融资融券活跃的个股，在合理控制风险并保持基金资产良好流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>本基金的投资策略主要有以下六方面内容：</p> <p>1、大类资产配置</p> <p>本基金将综合运用定性和定量的分析方法，在深入研究的基础上，合理确定本基金在股票、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>本基金所指的强势共识100强股票是基金管理人在深入研究融资融券市场的基础上，根据特定的筛选流程，以两融成交活跃度为指标，从作为融资融券标的的沪深A股中精选100只股票构建的股票投资组合。具体投资策略包含以下</p>

	<p>五个方面：（1）强势共识100强股票的界定；（2）定期调整策略；（3）不定期调整策略；（4）强势共识100强股票中个股出现停牌情形的处理；（5）其他策略。</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>本基金将权证的投资作为提高基金投资组合收益的辅助手段。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，在严格控制风险的前提下，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> <p>本基金以套期保值为目的，参与股指期货交易。本基金参与股指期货投资时机和数量的决策建立在对证券市场总体行情的判断和组合风险收益分析的基础上。基金管理人将根据宏观经济因素、政策及法规因素和资本市场因素，结合定性和定量方法，确定投资时机。基金管理人将结合股票投资的总体规模，以及中国证监会的相关限定和要求，确定参与股指期货交易的投资比例。</p>
业绩比较基准	$\text{沪深300指数收益率} \times 95\% + \text{银行活期存款利率} \times 5\%$
风险收益特征	<p>本基金属于股票型基金，其预期收益及风险水</p>

	平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。
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

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2021年10月01日 - 2021年12月31日）
1. 本期已实现收益	227,523.49
2. 本期利润	-348,132.17
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0449
4. 期末基金资产净值	13,786,031.34
5. 期末基金份额净值	1.799

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

##### 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

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	-2.44%	0.91%	1.46%	0.75%	-3.90%	0.16%
过去六个月	-0.83%	1.18%	-5.13%	0.97%	4.30%	0.21%
过去一年	6.01%	1.17%	-4.85%	1.11%	10.86%	0.06%
过去三年	125.44%	1.22%	60.63%	1.22%	64.81%	0.00%
过去	95.33%	1.22%	47.04%	1.14%	48.29%	0.08%

五年						
自基金合同生效起至今	79.90%	1.27%	35.14%	1.17%	44.76%	0.10%

### 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

前海开源强势共识100强等权重股票型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



## § 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		
陆琦	本基金的基金经理、公司金融工程部执行总监	2021-01-14	-	10年	陆琦先生，南京大学硕士研究生。2011年至2015年任南方基金管理有限公司

					风险管理部量化分析高级经理，2015年10月加盟前海开源基金管理有限公司，现任公司金融工程部执行总监。
--	--	--	--	--	---

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》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

从国内股票的风险收益情况来看，四季度呈现上涨行情，主要指数中，国证2000指数涨幅最多，为11.39%。市场风格上成长股上涨幅度较大。从中国的宏观情况来看，四季度经济数据有企稳迹象；具体来看，生产、消费数据回升，出口增速依旧保持高位，但投资对经济拉动作用依旧较低。基数效应叠加需求转弱，但托底政策将加大力度，明年一季度GDP可能会延续四季度企稳的趋势。我们认为，在短期稳健的货币政策和长期的居民财富搬家趋势双重因素的驱动下，预计未来一段时间权益市场依然会维持相对充裕的流动性，整体环境有利于基本面景气的成长性行业，结构性的投资机会可能会持续涌现。

从香港市场的情况来看，四季度香港行情寡淡，恒生指数涨幅为-4.79%。展望明年一季度，对港股不宜特别乐观，但机会应较今年更多。房地产行业部分企业的危机，对互联网行业监管政策、澳门博彩立法生变以及中美对中概股上市问题的争论等事件也让市场整体持有谨慎的心态。与此同时，众多优秀公司的估值在一整年的磨底中已经达到历史低位的状态。我们认为未来一段时间应紧密跟踪监管政策的边际变动，投资者信心以及美国的货币政策变化，相信港股市场可能在整体企稳的同时，呈现出一些结构性的投资机会。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末前海开源强势共识100强股票基金份额净值为1.799元，本报告期内，基金份额净值增长率为-2.44%，同期业绩比较基准收益率为1.46%。

#### 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的情形。

本基金本报告期内，从2021年10月08日至2021年12月31日连续61个工作日基金资产净值低于五千万元，我公司已根据法律法规及基金合同要求拟定相关应对方案上报中国证券监督管理委员会。

### § 5 投资组合报告

#### 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	12,561,848.00	88.21
	其中：股票	12,561,848.00	88.21
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	8,330.40	0.06
	其中：债券	8,330.40	0.06
	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	1,282,646.70	9.01

	计		
8	其他资产	387,241.72	2.72
9	合计	14,240,066.82	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

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	499,764.00	3.63
C	制造业	8,303,237.00	60.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	487,004.00	3.53
E	建筑业	254,828.00	1.85
F	批发和零售业	267,257.00	1.94
G	交通运输、仓储和邮政业	121,275.00	0.88
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	351,546.00	2.55
J	金融业	484,029.00	3.51
K	房地产业	118,482.00	0.86
L	租赁和商务服务业	262,146.00	1.90
M	科学研究和技术服务业	254,773.00	1.85
N	水利、环境和公共设施管理业	246,246.00	1.79
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	362,296.00	2.63
R	文化、体育和娱乐业	426,310.00	3.09
S	综合	122,655.00	0.89
	合计	12,561,848.00	91.12

### 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

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	601928	凤凰传媒	18,400	148,856.00	1.08
2	600150	中国船舶	5,900	146,261.00	1.06
3	600373	中文传媒	11,800	145,848.00	1.06
4	603939	益丰药房	2,600	143,286.00	1.04
5	600219	南山铝业	29,600	139,416.00	1.01
6	600499	科达制造	5,600	138,992.00	1.01
7	002701	奥瑞金	19,700	137,900.00	1.00
8	600418	江淮汽车	7,900	137,460.00	1.00
9	600702	舍得酒业	600	136,380.00	0.99
10	603678	火炬电子	1,800	136,170.00	0.99

## 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	8,330.40	0.06
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	8,330.40	0.06

## 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	110082	宏发转债	60	8,330.40	0.06

注：本基金本报告期末仅持有以上债券。

## 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	8,144.46
2	应收证券清算款	377,576.82

3	应收股利	-
4	应收利息	147.95
5	应收申购款	1,372.49
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	387,241.72

**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

单位：份

报告期期初基金份额总额	7,867,310.50
报告期期间基金总申购份额	196,269.14
减：报告期期间基金总赎回份额	399,895.22
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	7,663,684.42

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

**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 影响投资者决策的其他重要信息

**8.1 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**  
无。

## 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于2021年10月26日发布公告，前海开源基金管理有限公司督察长傅成斌先生离任，并由董事长王兆华先生代任督察长一职。上述事项经前海开源基金管理有限公司董事会审议通过，并已按相关法律法规的规定进行备案。具体情况详见基金管理人在中国证监会规定媒介发布的相关公告。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

(1) 中国证券监督管理委员会批准前海开源强势共识100强等权重股票型证券投资基金设立的文件

(2) 《前海开源强势共识100强等权重股票型证券投资基金基金合同》

(3) 《前海开源强势共识100强等权重股票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

(5) 前海开源强势共识100强等权重股票型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

### 9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

### 9.3 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

(3) 投资者可访问本基金管理人公司网站，网址：[www.qhkyfund.com](http://www.qhkyfund.com)

前海开源基金管理有限公司

2022年01月24日