

# 前海开源沪港深隆鑫灵活配置混合型证券投资基金

## 2023 年第 2 季度报告

2023 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：平安银行股份有限公司

报告送出日期：2023 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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 07 月 18 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 2023 年 04 月 01 日起至 2023 年 06 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

### 2.1 基金基本情况

|            |   |
|------------|---|
| 基金简称       | 前海开源沪港深隆鑫混合   |
| 基金主代码      | 001901  |
| 基金运作方式     | 契约型普通开放式  |
| 基金合同生效日    | 2017 年 03 月 01 日  |
| 报告期末基金份额总额 | 402,888,301.49 份  |
| 投资目标       | 本基金通过积极主动的资产配置，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七方面内容：</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>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</p> |

类资产在基金投资组合中的比例。

## 2、股票投资策略

本基金股票投资包括国内依法发行上市的股票和港股通标的股票。本基金股票投资策略主要包括股票投资策略、港股通标的股票投资策略和本基金参与融资业务的投资策略。

### (1) 行业配置策略

在行业配置方面，本基金将通过对行业景气度和行业竞争格局的深入分析，对各行业的投资价值进行综合评估，从而确定并动态调整行业配置比例。

### (2) 个股投资策略

本基金在行业分析、公司基本面分析及估值水平分析的基础上，进行股票组合的构建。当行业、公司的基本面、股票的估值水平出现较大变化时，本基金将对股票组合适时进行动态调整。

### (3) 港股通标的股票投资策略

本基金将通过沪港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，但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。

### (4) 本基金参与融资业务的投资策略

本基金参与融资业务时将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的个股。本基金力争利用融资业务的杠杆作用，降低股票仓位调整所带来的交易成本、提高基金财产的运用效率，从而更好的实现本基金的投资目标。

## 3、存托凭证投资策略

对于存托凭证投资，本基金将在深入研究的基础上，通过定性分析和定量分析相结合的方式，精选出具有比较优势的存托凭证进行投资。

## 4、债券投资策略

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。具体投资策略有收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略等积极投资策略。

## 5、权证投资策略

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。

## 6、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。<br>7、股指期货投资策略<br>本基金以套期保值为目的，参与股指期货交易。 |                |
| 业绩比较基准          | 沪深 300 指数收益率×70%+中证全债指数收益率×30%。   |                |
| 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。本基金若投资港股通标的股票，需承担汇率风险、流动性风险以及境外市场的风险等特别风险。          |                |
| 基金管理人           | 前海开源基金管理有限公司  |                |
| 基金托管人           | 平安银行股份有限公司  |                |
| 下属分级基金的基金简称     | 前海开源沪港深隆鑫混合 A   | 前海开源沪港深隆鑫混合 C  |
| 下属分级基金的交易代码     | 001901  | 001902         |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 401,726,537.74 份  | 1,161,763.75 份 |

### § 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（2023 年 04 月 01 日-2023 年 06 月 30 日） |               |
|-----------------|--|---------------|
|                 | 前海开源沪港深隆鑫混合 A                          | 前海开源沪港深隆鑫混合 C |
| 1. 本期已实现收益      | -4,777,288.21                          | -13,481.13    |
| 2. 本期利润         | -7,868,443.95                          | -23,111.43    |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0196                                | -0.0197       |
| 4. 期末基金资产净值     | 393,375,059.76                         | 1,172,721.19  |
| 5. 期末基金份额净值     | 0.979                                  | 1.009         |

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)扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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

前海开源沪港深隆鑫混合 A

| 阶段             | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③    | ②-④    |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月          | -2.00%     | 0.51%         | -3.02%         | 0.58%                 | 1.02%  | -0.07% |
| 过去六个月          | -2.59%     | 0.47%         | 0.44%          | 0.59%                 | -3.03% | -0.12% |
| 过去一年           | -9.85%     | 0.57%         | -8.81%         | 0.69%                 | -1.04% | -0.12% |
| 过去三年           | 20.29%     | 0.67%         | -0.79%         | 0.84%                 | 21.08% | -0.17% |
| 过去五年           | 46.00%     | 0.69%         | 16.92%         | 0.89%                 | 29.08% | -0.20% |
| 自基金合同生效起<br>至今 | 59.58%     | 0.64%         | 20.16%         | 0.84%                 | 39.42% | -0.20% |

## 前海开源沪港深隆鑫混合 C

| 阶段             | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③    | ②-④    |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月          | -2.04%     | 0.51%         | -3.02%         | 0.58%                 | 0.98%  | -0.07% |
| 过去六个月          | -2.61%     | 0.46%         | 0.44%          | 0.59%                 | -3.05% | -0.13% |
| 过去一年           | -9.99%     | 0.57%         | -8.81%         | 0.69%                 | -1.18% | -0.12% |
| 过去三年           | 19.92%     | 0.67%         | -0.79%         | 0.84%                 | 20.71% | -0.17% |
| 过去五年           | 45.29%     | 0.69%         | 16.92%         | 0.89%                 | 28.37% | -0.20% |
| 自基金合同生效起<br>至今 | 59.53%     | 0.65%         | 21.27%         | 0.85%                 | 38.26% | -0.20% |

### 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

## 前海开源沪港深隆鑫混合 A



前海开源沪港深隆鑫混合 C



注：本基金 C 类基金份额自 2017 年 5 月 25 日起余额不为零，其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起始日为 2017 年 5 月 25 日。

## § 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 年 07 月 02 日 | -    | 13 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，现任公司投资部基金经理。 |
| 吴彦  | 本基金的基金经理 | 2021 年 06 月 17 日 | -    | 11 年   | 吴彦女士，北京大学硕士。历任财达证券固定收益部债券研究员，2014 年 4 月加盟前海开源基金管理有限公司，现任公司固收产品策略团队基金经理。              |

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

固定收益方面，本报告期内，经济基本面、政策预期及流动性是主导债券走势的关键因素。具体来看：尽管 3 月数据较好，但 4 月份因高频数据走弱，债市开启了一轮较为强劲的趋势性行情，长久期高等级信用债领涨。5 月份，债市大涨后进入宽幅震荡，由于资金转松，且前期长久期品种大涨后期限利差已压缩至极限，短端表现明显好于长端；由于高等级信用债和利率债的利差已压缩至接近历史极值水平，利率债表现明显好于高等级信用债。6 月上旬，在地产强刺激政策被证伪后，债市开启了一轮新的上涨，在 OMO 降息后，债市上涨加速，长久期高等级信用债表现好于长久期利率债好于短久期品种。之后由于经济数据不及预期，市场焦点转向宽信用，债市陷入调整，高等级信用债调整幅度明显大于利率债。6 月 20 日，因 LPR 下调幅度并未超过 10BP，债市止跌回升。由于临近季末，机构有调仓需求，利率债表现好于高等级信用债，高等级信用债机构仓位较轻的长端表现好于机构仓位较重的中短端。整个季度来看，高等级信用债表现好于同期限利率债好于长久期利率债。

操作上，组合以高等级信用债和利率债为主。4 月份基于经济数据不及预期及政策难有强刺激，将组合久期拉至略高于中性水平，5 月后进一步将久期拉长至中性水平以上。报告期内，组合运作较为平稳。

权益投资方面，报告期内本产品 2023 年通过配置 AH 股优质公司以追求和优质公司长期共同成长，未来继续以稳健品种为主，以期实现净值稳定增长。2023 年中国经济将进一步复苏，虽然道路可能依旧曲折，但长期向好方向不变。这一背景下，中国优势产业和优势资源将继续得到较好的发展，与此同时，投资资本市场相关优势行业及公司长期看也将收获回报。

### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末前海开源沪港深隆鑫混合 A 基金份额净值为 0.979 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-2.00%，同期业绩比较基准收益率为-3.02%；截至报告期末前海开源沪港深隆鑫混合 C 基金份额净值为 1.009 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-2.04%，同期业绩比较基准收益率为-3.02%。

### 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

### 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              | 67,015,805.75  | 16.72        |
|    | 其中：股票             | 67,015,805.75  | 16.72        |
| 2  | 基金投资              | -              | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 221,508,200.77 | 55.27        |
|    | 其中：债券             | 221,508,200.77 | 55.27        |
|    | 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          | 69,973,997.25  | 17.46        |
|    | 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      | 41,788,405.23  | 10.43        |
| 8  | 其他资产              | 460,839.54     | 0.11         |
| 9  | 合计                | 400,747,248.54 | 100.00       |

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 6,323,427.12 元，占资产净值比例 1.60%。

### 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              | 4,151,250.00  | 1.05         |
| C  | 制造业              | 56,244,748.65 | 14.26        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 242,947.47    | 0.06         |
| E  | 建筑业              | -             | -            |
| F  | 批发和零售业           | 24,673.35     | 0.01         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -             | -            |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 27,451.96     | 0.01         |
| J  | 金融业              | -             | -            |
| K  | 房地产业             | -             | -            |
| L  | 租赁和商务服务业         | -             | -            |

|   |               |               |       |
|---|---------------|---------------|-------|
| M | 科学研究和技术服务业    | -             | -     |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 1,307.20      | 0.00  |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | -             | -     |
| P | 教育            | -             | -     |
| Q | 卫生和社会工作       | -             | -     |
| R | 文化、体育和娱乐业     | -             | -     |
| S | 综合            | -             | -     |
|   | 合计            | 60,692,378.63 | 15.38 |

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别   | 公允价值（人民币）    | 占基金资产净值比例（%） |
|--------|--------------|--------------|
| 通讯     | 1,251,615.51 | 0.32         |
| 非必需消费品 | 5,070,890.00 | 1.29         |
| 材料     | 921.61       | 0.00         |
| 合计     | 6,323,427.12 | 1.60         |

注：以上分类采用彭博行业分类标准（BICS）。

### 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  | 002475 | 立讯精密   | 200,000 | 6,490,000.00 | 1.64         |
| 2  | 002920 | 德赛西威   | 40,997  | 6,387,742.57 | 1.62         |
| 3  | 603596 | 伯特利    | 77,000  | 6,103,020.00 | 1.55         |
| 4  | 002472 | 双环传动   | 160,000 | 5,808,000.00 | 1.47         |
| 5  | 002050 | 三花智控   | 190,000 | 5,749,400.00 | 1.46         |
| 6  | 601689 | 拓普集团   | 70,000  | 5,649,000.00 | 1.43         |
| 7  | 09868  | 小鹏汽车-W | 110,000 | 5,070,890.00 | 1.29         |
| 8  | 601088 | 中国神华   | 135,000 | 4,151,250.00 | 1.05         |
| 9  | 600501 | 航天晨光   | 253,900 | 4,138,570.00 | 1.05         |
| 10 | 000651 | 格力电器   | 110,000 | 4,016,100.00 | 1.02         |

注：所用证券代码采用当地市场代码。

### 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      | 4,080,445.90   | 1.03         |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 187,101,860.88 | 47.42        |
|    | 其中：政策性金融债 | 51,542,819.18  | 13.06        |

|    |           |                |       |
|----|-----------|----------------|-------|
| 4  | 企业债券      | -              | -     |
| 5  | 企业短期融资券   | -              | -     |
| 6  | 中期票据      | 30,325,893.99  | 7.69  |
| 7  | 可转债（可交换债） | -              | -     |
| 8  | 同业存单      | -              | -     |
| 9  | 其他        | -              | -     |
| 10 | 合计        | 221,508,200.77 | 56.14 |

### 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  | 190311  | 19 进出 11     | 200,000 | 20,753,386.30 | 5.26         |
| 2  | 2128051 | 21 工商银行二级 02 | 200,000 | 20,658,044.93 | 5.24         |
| 3  | 2128035 | 21 华夏银行 02   | 200,000 | 20,535,475.07 | 5.20         |
| 4  | 220408  | 22 农发 08     | 200,000 | 20,262,328.77 | 5.14         |
| 5  | 2028013 | 20 农业银行二级 01 | 200,000 | 20,233,890.71 | 5.13         |

### 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 基金投资前十名证券的发行主体本期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、处罚说明

报告期末，本基金投资的前十名证券除“20 农业银行二级 01（证券代码 2028013）”外其他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。

本基金投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

### 5.11.2 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。

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）      |
|----|---------|------------|
| 1  | 存出保证金   | 375,936.36 |
| 2  | 应收证券清算款 | 39,004.12  |
| 3  | 应收股利    | 36,940.74  |
| 4  | 应收利息    | -          |
| 5  | 应收申购款   | 8,958.32   |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 其他      | -          |
| 8  | 合计      | 460,839.54 |

### 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

| 项目                        | 前海开源沪港深隆鑫混合 A  | 前海开源沪港深隆鑫混合 C |
|---------------------------|----------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 401,734,389.95 | 1,218,188.45  |
| 报告期期间基金总申购份额              | 27,523.97      | 83,869.26     |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 35,376.18      | 140,293.96    |
| 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               | 401,726,537.74 | 1,161,763.75  |

## § 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

| 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              | 20230401-20230630       | 399,999,000.00 | -    | -    | 399,999,000.00 | 99.28% |
| 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。如个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定延缓支付赎回款项、部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务的办理；

#### 2. 转换运作方式或终止基金合同的风险

个别投资者大额赎回后，若本基金连续 60 个工作日出现基金份额持有人低于 200 人或基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当终止基金合同，无需召开基金份额持有人大会，其他投资者可能面临相应风险；

#### 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。

## 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 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沪港深隆鑫灵活配置混合型证券投资基金设立的文件
- (2) 《前海开源沪港深隆鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- (3) 《前海开源沪港深隆鑫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件、营业执照
- (5) 前海开源沪港深隆鑫灵活配置混合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  
2023 年 07 月 21 日