

前海开源大安全核心精选灵活配置混合型证券投资基金

2018年第二季度报告

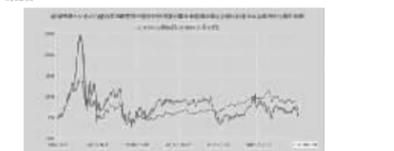
Table with financial data for Q2 2018, including asset management details, performance metrics, and financial statements.

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。

32基金净值表现
32.1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

Table showing performance metrics for the fund, including net asset value growth and benchmark comparison.

注:1.本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率*70%+中证全指指数收益率*30%。
32.2自基金合同生效以来基金资产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基金经理(或基金经理小组)简介

Table with biographical information for the fund manager, including name, tenure, and education.

注:①对基金的曾任基金经理,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,对此后的非曾任基金经理,“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。

42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,为基金份额持有人谋求最大利益。

43公平交易专项说明
43.1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《证券投资基金管理人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投资组合。

43.2异常交易行为的专项说明

本基金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。

44报告期内本基金的投资策略和运作分析

2018年第二季度以美国为首的成熟经济体的经济周期开始转向下的信号,同时,特朗普的贸易政策开始在全面围堵中国,海外经济景气程度的向下概率在加大,受此拖累,中国经济基本面也承受挑战,相应的,在2季度,尤其在6月份A股延续了下行的趋势。

45报告期内基金的投资策略和业绩表现
截至报告期末前海开源大安全混合基金资产净值为106元,本报告期内,基金份额净值增长率为-5.9%,同期业绩比较基准收益率为-6.39%。

46报告期内基金持有人数或基金资产净值简述
截至报告期末,本基金报告期内,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

Table showing the fund's asset composition by industry, including stock, bond, and cash holdings.

5.2报告期末按行业分类的股票投资组合

Table showing the fund's stock portfolio by industry, including financial, technology, and consumer goods.

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

Table listing the top 10 stocks held by the fund, including their names, quantities, and values.

5.4报告期末按品种分类的债券投资组合

Table showing the fund's bond portfolio by type, including government and corporate bonds.

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

Table listing the top 5 bonds held by the fund, including their names, quantities, and values.

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

Table showing the fund's asset-backed securities portfolio.

5.7报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.9报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

5.10报告期末本基金投资的资产支持证券投资持有情况

5.11报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.12报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.13其他资产构成

前海开源鼎安债券型证券投资基金

2018年第二季度报告

Table with financial data for Q2 2018, including asset management details, performance metrics, and financial statements.

3.1主要财务指标

Table showing key financial indicators for the fund, including net asset value and returns.

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。

3.2基金净值表现
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

Table showing performance metrics for the fund, including net asset value growth and benchmark comparison.

注:1.本基金业绩比较基准为:中证全指指数收益率*90%+沪深300指数收益率*10%。
3.2.2自基金合同生效以来基金资产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基金经理(或基金经理小组)简介

Table with biographical information for the fund manager, including name, tenure, and education.

注:①对基金的曾任基金经理,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,对此后的非曾任基金经理,“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。

42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,为基金份额持有人谋求最大利益。

43公平交易专项说明
43.1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《证券投资基金管理人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投资组合。

43.2异常交易行为的专项说明

本基金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。

44报告期内本基金的投资策略和运作分析

决定确定的解聘日期,对此后的非曾任基金经理,“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本基金的投资范围符合《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等相关规定。

42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,为基金份额持有人谋求最大利益。

43公平交易专项说明
43.1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《证券投资基金管理人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投资组合。

43.2异常交易行为的专项说明

本基金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。

44报告期内本基金的投资策略和运作分析

2018年第二季度以美国为首的成熟经济体的经济周期开始转向下的信号,同时,特朗普的贸易政策开始在全面围堵中国,海外经济景气程度的向下概率在加大,受此拖累,中国经济基本面也承受挑战,相应的,2季度利率债市场有所反弹,避险情绪浓厚,根据基金合同,本基金大部分仓位需要配置在债券类资产上,鉴于对债市市场短期态度较为乐观,我们主要配置了利率债品种。

45报告期内基金的投资策略和业绩表现
截至报告期末前海开源鼎安债券基金资产净值为306元,本报告期内,该类基金份额净值增长率为-4.0%,同期业绩比较基准收益率为-4.1%。截至报告期末前海开源鼎安债券基金资产净值为10元,本报告期内,该类基金份额净值增长率为0.40%,同期业绩比较基准收益率为-4.1%。

46报告期内基金持有人数或基金资产净值简述
截至报告期末,本基金报告期内,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

Table showing the fund's asset composition by industry, including stock, bond, and cash holdings.

5.2报告期末按行业分类的股票投资组合

Table showing the fund's stock portfolio by industry, including financial, technology, and consumer goods.

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

Table listing the top 10 stocks held by the fund, including their names, quantities, and values.

5.4报告期末按品种分类的债券投资组合

Table showing the fund's bond portfolio by type, including government and corporate bonds.

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

Table listing the top 5 bonds held by the fund, including their names, quantities, and values.

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

Table showing the fund's asset-backed securities portfolio.

5.7报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.9报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

5.10报告期末本基金投资的资产支持证券投资持有情况

5.11报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.12报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.13其他资产构成

新华高端制造灵活配置混合型证券投资基金

2018年第二季度报告

Table with financial data for Q2 2018, including asset management details, performance metrics, and financial statements.

均溢价买入,买入/卖出溢价率以及利益输送金额等多个层面判断不同投资组合之间在某一时段是否存在违反公平交易原则的异常情况,未发生重大异常交易,且不存在报告期内所投资组合与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易超过该证券当日成交量的5%的情况。

44报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

2018年2季度全球市场波动较大,从大宗商品类来看,全球表现最好的资产是能源类商品,美元指数,美国股市;表现较差的商品主要是农产品,农产品以及美元债等。

45报告期内基金的投资策略和业绩表现
截至报告期末新华高端制造灵活配置混合基金资产净值为106元,本报告期内,基金份额净值增长率为-5.9%,同期业绩比较基准收益率为-6.39%。

46报告期内基金持有人数或基金资产净值简述
截至报告期末,本基金报告期内,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

Table showing the fund's asset composition by industry, including stock, bond, and cash holdings.

5.2报告期末按行业分类的股票投资组合

Table showing the fund's stock portfolio by industry, including financial, technology, and consumer goods.

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

Table listing the top 10 stocks held by the fund, including their names, quantities, and values.

5.4报告期末按品种分类的债券投资组合

Table showing the fund's bond portfolio by type, including government and corporate bonds.

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

Table listing the top 5 bonds held by the fund, including their names, quantities, and values.

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

Table showing the fund's asset-backed securities portfolio.

44报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

2018年2季度全球市场波动较大,从大宗商品类来看,全球表现最好的资产是能源类商品,美元指数,美国股市;表现较差的商品主要是农产品,农产品以及美元债等。

45报告期内基金的投资策略和业绩表现
截至报告期末新华高端制造灵活配置混合基金资产净值为106元,本报告期内,基金份额净值增长率为-5.9%,同期业绩比较基准收益率为-6.39%。

46报告期内基金持有人数或基金资产净值简述
截至报告期末,本基金报告期内,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

Table showing the fund's asset composition by industry, including stock, bond, and cash holdings.

5.2报告期末按行业分类的股票投资组合

Table showing the fund's stock portfolio by industry, including financial, technology, and consumer goods.

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

Table listing the top 10 stocks held by the fund, including their names, quantities, and values.

5.4报告期末按品种分类的债券投资组合

Table showing the fund's bond portfolio by type, including government and corporate bonds.

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

Table listing the top 5 bonds held by the fund, including their names, quantities, and values.

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

Table showing the fund's asset-backed securities portfolio.

Table with financial data for Q2 2018, including asset management details, performance metrics, and financial statements.

5.14报告期末持有处于转股期的可转换债券明细

5.15报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.16影响投资者决策的其他重要信息

5.17基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.18基金管理人持有本基金份额变动情况

5.19报告期内基金管理人持有本基金份额

5.20基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

5.21影响投资者决策的其他重要信息

5.22基金管理人、基金托管人住所

5.23其他资产构成

5.24报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

5.25报告期内基金持有人数或基金资产净值简述

5.26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

5.27报告期末按品种分类的债券投资组合

5.28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

5.29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

5.30报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.31报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.32报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

5.33其他资产构成

5.34报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

5.35报告期内基金持有人数或基金资产净值简述

5.36报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

5.37报告期末按品种分类的债券投资组合

5.38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

5.39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

5.40报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.41报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.42报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

5.43其他资产构成

5.44报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

5.45报告期内基金持有人数或基金资产净值简述

5.46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

5.47报告期末按品种分类的债券投资组合

5.48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

5.49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

5.50报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.51报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.52报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

5.53其他资产构成

5.54报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

5.55报告期内基金持有人数或基金资产净值简述

5.56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

5.57报告期末按品种分类的债券投资组合

5.58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

5.59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

5.60报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.61报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.62报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

5.63其他资产构成

5.64报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

5.65报告期内基金持有人数或基金资产净值简述

5.66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

5.67报告期末按品种分类的债券投资组合

5.68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

5.69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

5.70报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.71报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.72报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

5.73其他资产构成

5.74报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

5.75报告期内基金持有人数或基金资产净值简述

5.76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

5.77报告期末按品种分类的债券投资组合

5.78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

5.79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

5.80报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.81报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.82报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

5.83其他资产构成

5.84报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

5.85报告期内基金持有人数或基金资产净值简述

5.86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

5.87报告期末按品种分类的债券投资组合

5.88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

5.89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

5.90报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.91报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.92报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

5.93其他资产构成

5.94报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

5.95报告期内基金持有人数或基金资产净值简述

5.96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

5.97报告期末按品种分类的债券投资组合

5.98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

5.99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

5.100报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.101报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.102报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

5.103其他资产构成