

基金管理人:前海开源基金管理有限公司
基金托管人:中国邮政储蓄银行股份有限公司

报告送出日期:2019年01月22日

重要提示

基金管理人的承诺及本基金的名称、基金的运作方式等基本信息见基金份额说明书,详见前述或重大遗漏,并对内容的真实性、准确性和完整性承担法律责任。

基金托管人:中国邮政储蓄银行股份有限公司承诺基金合同规定的各项义务,于2019年01月22日披露了报告书中的基金资产净值、净收益及收益率,并保证不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人和基金托管人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,并对其真实性、准确性及完整性承担法律责任。本基金是根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其他法律法规规定,由基金管理人和基金托管人共同编制并经中国证监会注册的。

本报告期(2018年10月01日至2018年12月31日)。

本基金名称:前海开源润和债券型证券投资基金

基金简称:前海开源润和债券

基金代码:000660

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2010年03月21日

报告期末基金资产总额:300,095,220.91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债性基准的长期稳定回报。

本基金的投资策略主要以下四方面内容:

1.大类资产配置:在本基金的资产配置中,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运行状况的基础上,判断宏观经济运行所处的阶段,从而确定资产配置比例。

2.债券投资策略:

本基金将主要采用久期匹配策略,通过组合久期调整,以获取超额收益。

3.信用风险控制:

本基金将通过信用评级对信用债进行筛选,本基金管理人将定期评估信用债的信用风险,并根据信用风险的实际情况,适时调整信用债的配置比例。

4.资产支持证券投资策略:

本基金将通过信用评级对资产支持证券进行筛选,并根据信用评级的实际情况,适时调整资产支持证券的配置比例。

本基金将综合运用多种投资策略,通过系统化和工具化的方法,在各业务环节严格执行风险管理,以获得超越业绩基准的收益。

本基金的业绩比较基准:中债综合全价(总值)指数收益率*100%+一年期定期存款利率(税后)*1%

注:①上述基金业指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后与不计费用的业绩表现可能存在差异。

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

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2018年10月01日-2018年12月31日)

1.本期每万份收益 13.1059 0.987,725.02

2.本期利润 40,980,039 2,206,952.02

3.加权平均基金份额利润率 0.0230 0.0217

4.期末基金资产净值 2,542,264.56 320,631,062.41

5.期末基金份额净值 1.0943 10748

注:①上述基金业指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后与不计费用的业绩表现可能存在差异。

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 本期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

前海开源润和债券A净值增长率

前海开源润和债券C净值增长率

业绩比较基准收益率

注:①本基金业绩比较基准:中债综合全价(总值)指数收益率*100%+一年期定期存款利率(税后)*1%

②本基金在评价期内未出现连续二十个工作日基金净值增长率低于百分之五的情形。

3.3 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2018年10月01日-2018年12月31日)

1.净值增长率为正的份额 13.1059 0.987,725.02

2.净值增长率为负的份额 -0.0005 0.0000

3.加权平均基金份额净值 0.0230 0.0217

4.期末基金份额净值 1.0943 10748

5.期末基金份额净值增长率 2.10% 0.00% 1.99% 0.00% 0.20% 0.001%

注:①上述基金业指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后与不计费用的业绩表现可能存在差异。

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。

3.4 本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

前海开源润和债券A净值增长率

前海开源润和债券C净值增长率

业绩比较基准收益率

注:①本基金业绩比较基准:中债综合全价(总值)指数收益率*100%+一年期定期存款利率(税后)*1%

②本基金在评价期内未出现连续二十个工作日基金净值增长率低于百分之五的情形。

3.5 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2018年10月01日-2018年12月31日)

1.本期每万份收益 13.1059 0.987,725.02

2.本期利润 40,980,039 2,206,952.02

3.加权平均基金份额利润率 0.0230 0.0217

4.期末基金资产净值 2,542,264.56 320,631,062.41

5.期末基金份额净值 1.0943 10748

注:①上述基金业指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后与不计费用的业绩表现可能存在差异。

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。

3.6 本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

前海开源润和债券A净值增长率

前海开源润和债券C净值增长率

业绩比较基准收益率

注:①本基金业绩比较基准:中债综合全价(总值)指数收益率*100%+一年期定期存款利率(税后)*1%

②本基金在评价期内未出现连续二十个工作日基金净值增长率低于百分之五的情形。

3.7 本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

前海开源润和债券A净值增长率

前海开源润和债券C净值增长率

业绩比较基准收益率

注:①本基金业绩比较基准:中债综合全价(总值)指数收益率*100%+一年期定期存款利率(税后)*1%

②本基金在评价期内未出现连续二十个工作日基金净值增长率低于百分之五的情形。

3.8 本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

前海开源润和债券A净值增长率

前海开源润和债券C净值增长率

业绩比较基准收益率

注:①本基金业绩比较基准:中债综合全价(总值)指数收益率*100%+一年期定期存款利率(税后)*1%

②本基金在评价期内未出现连续二十个工作日基金净值增长率低于百分之五的情形。

3.9 本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

前海开源润和债券A净值增长率

前海开源润和债券C净值增长率

业绩比较基准收益率

注:①本基金业绩比较基准:中债综合全价(总值)指数收益率*100%+一年期定期存款利率(税后)*1%

②本基金在评价期内未出现连续二十个工作日基金净值增长率低于百分之五的情形。

3.10 本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

前海开源润和债券A净值增长率

前海开源润和债券C净值增长率

业绩比较基准收益率

注:①本基金业绩比较基准:中债综合全价(总值)指数收益率*100%+一年期定期存款利率(税后)*1%

②本基金在评价期内未出现连续二十个工作日基金净值增长率低于百分之五的情形。

3.11 本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

前海开源润和债券A净值增长率

前海开源润和债券C净值增长率

业绩比较基准收益率

注:①本基金业绩比较基准:中债综合全价(总值)指数收益率*100%+一年期定期存款利率(税后)*1%

②本基金在评价期内未出现连续二十个工作日基金净值增长率低于百分之五的情形。

3.12 本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

前海开源润和债券A净值增长率

前海开源润和债券C净值增长率

业绩比较基准收益率

注:①本基金业绩比较基准:中债综合全价(总值)指数收益率*100%+一年期定期存款利率(税后)*1%

②本基金在评价期内未出现连续二十个工作日基金净值增长率低于百分之五的情形。

3.13 本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

前海开源润和债券A净值增长率

前海开源润和债券C净值增长率

业绩比较基准收益率

注:①本基金业绩比较基准:中债综合全价(总值)指数收益率*100%+一年期定期存款利率(税后)*1%

②本基金在评价期内未出现连续二十个工作日基金净值增长率低于百分之五的情形。

3.14 本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

前海开源润和债券A净值增长率

前海开源润和债券C净值增长率

业绩比较基准收益率

注:①本基金业绩比较基准:中债综合全价(总值)指数收益率*100%+一年期定期存款利率(税后)*1%

②本基金在评价期内未出现连续二十个工作日基金净值增长率低于百分之五的情形。

3.15 本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

前海开源润和债券A净值增长率

前海开源润和债券C净值增长率

业绩比较基准收益率

注:①本基金业绩比较基准:中债综合全价(总值)指数收益率*100%+一年期定期存款利率(税后)*1%

②本基金在评价期内未出现连续二十个工作日基金净值增长率低于百分之五的情形。

3.16 本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

前海开源润和债券A净值增长率

前海开源润和债券C净值增长率

业绩比较基准收益率

注:①本基金业绩比较基准:中债综合全价(总值)指数收益率*100%+一年期定期存款利率(税后)*1%

②本基金在评价期内未出现连续二十个工作日基金净值增长率低于百分之五的情形。

3.17 本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

前海开源润和债券A净值增长率

前海开源润和债券C净值增长率

业绩比较基准收益率

注:①本基金业绩比较基准:中债综合全价(总值)指数收益率*100%+一年期定期存款利率(税后)*1%

②本基金在评价期内未出现连续二十个工作日基金净值增长率低于百分之五的情形。

3.18 本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

前海开源润和债券A净值增长率

前海开源润和债券C净值增长率

业绩比较基准收益率

注:①本基金业绩比较基准:中债综合全价(总值)指数收益率*100%+一年期定期存款利率(税后)*1%

②本基金在评价期内未出现连续二十个工作日基金净值增长率低于百分之五的情形。

3.19 本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

<p