

# 前海开源沪港深强固产业灵活配置混合型证券投资基金

## 2019年第二季度报告

基金管理人：前海开源基金管理有限公司  
基金托管人：交通银行股份有限公司  
报告送出日期：2019年07月16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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年7月12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。

本报告期自2019年4月1日起至2019年6月30日止。

**2 基金产品概况**

基金名称	前海开源沪港深强固产业灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	前海强固
基金代码	004451
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	2015年09月01日
基金管理人	前海开源基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	150,460,930.00份

**3.1 主要财务指标**

主要财务指标		报告期末(2019年04月01日至2019年06月30日)	
1.本期已实现收益	3,672,414.94		
2.本期利润	3,122,898.88		
3.期末可供分配利润	60,017.91		
期末基金份额净值	1.03		

**3.2 基金净值表现**

阶段		净值增长率①	净值增长率②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-③
过去三个月		1.74%	0.28%	-0.07%	0.81%	-0.40%

**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**

姓名	职务	任本基金基金经理时间	证券从业年限	说明
吴国辉	本基金的基金经理、公司执行副总裁	2017-03-01	11年	吴国辉先生，清华大学博士，曾任中信证券资产管理部副经理、中信证券基金管理部副经理、前海开源基金管理有限公司基金经理。2015年9月加入前海开源基金管理有限公司，历任基金经理。2017年3月1日起担任前海开源沪港深强固产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2018年11月至2019年1月期间兼任前海开源中证健康产业指数证券投资基金基金经理。现任前海开源基金管理有限公司副总经理、投资决策委员会成员、公募业务部负责人。
陈皓	本基金的基金经理、公司董事、首席风控官、国际业务部负责人、投资决策委员会成员	2018-03-01	10年	陈皓先生，上海交通大学硕士，曾任招商基金管理有限公司基金经理。2018年3月1日起担任前海开源沪港深强固产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理。现任前海开源基金管理有限公司基金经理。

**4.2 管理人对于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》及其他各项法律法规、基金合同和基金托管协议的有关规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作符合法律法规，没有损害基金持有人的利益。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约定。

**4.3 公平交易专项说明**

4.3.1 公平交易制度的执行情况

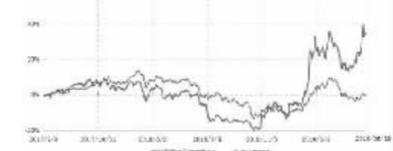
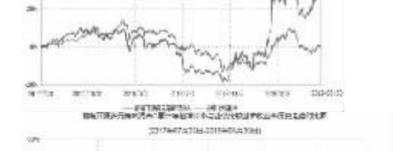
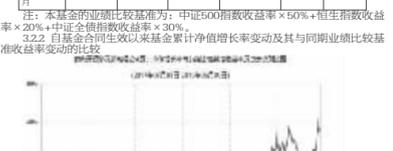
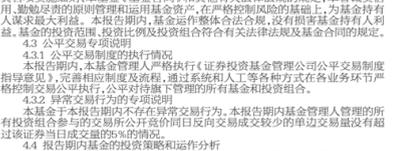
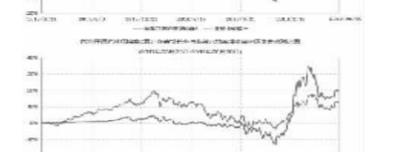
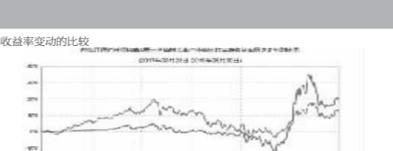
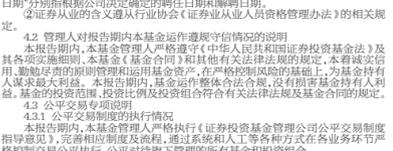
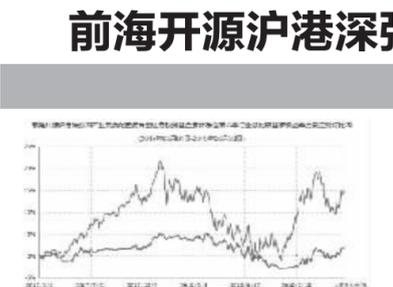
本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易管理制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待下管理的所有基金和投资组合。

**4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析**

2季度，宏观经济数据企稳，通胀增速再次回落，房地产销售数据走弱，汽车家电销售一直低迷，仅有必需消费板块相对较好，随着3季度补库存周期以及宏观经济企稳，4月份流动性再次宽松，叠加贸易摩擦缓和，股市企稳，股指高位回落，在此背景下，本基金主要配置大类蓝筹股等，基金净值回报较小，相对稳健。

**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强固产业灵活配置混合型证券投资基金净值为1.032元，本报告期内，基金份额净值增长率为1.74%，同期业绩比较基准收益率为-0.07%，本报告期内，本基金持有人人数或基金资产净值预警说明



**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	41,743,004.14	27.35
2	其中:股票	41,743,004.14	27.35
3	固定收益投资	97,124,000.00	63.16
4	其中:债券	97,124,000.00	63.16
5	资产支持证券	-	-
6	贵金属投资	-	-
7	金融衍生品投资	-	-
8	买入返售金融资产	-	-
9	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
10	银行存款和结算备付金合计	12,410,343.61	8.07
11	其他资产	2,486,796.26	1.62
12	合计	153,764,134.10	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	1,531,222.00	1.00
B	采矿业	1,352,193.10	0.88
C	制造业	21,536,118.17	14.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,363,320.00	1.54
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,206,180.00	1.44
G	交通运输、仓储和邮政业	2,790,881.89	1.82
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	321,561.16	0.21
J	金融业	4,494,220.04	2.90
K	房地产业	2,771,295.53	1.77
L	租赁和商务服务业	640,785.00	0.38
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	教育	-	-
P	文化、体育和娱乐业	22,106.60	0.02
Q	综合	39,840,728.39	26.90

**5.2.2 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合**

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例(%)
金融业	1,262,213.38	0.89
制造业	550,150.40	0.36
其他	1,302,284.71	0.87

**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**

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	000001	平安银行	3,600	3,542,400.00	2.21
2	01280	农业银行	240,000	690,327.17	0.45
3	601288	农业银行	461,800	1,062,480.00	0.68
3	08988	中国银行	228,000	601,866.18	0.43
3	601988	中国银行	418,500	1,558,468.00	1.01
4	000061	格力电器	38,300	2,134,000.00	1.39
4	000858	五粮液	15,973	1,894,015.26	1.23
6	000791	甘味股份	362,700	1,559,610.00	1.02
7	300048	长园股份	42,700	1,531,222.00	1.00
8	600289	信发铝业	112,300	1,383,170.00	0.90
9	600030	中信证券	50,550	1,202,405.00	0.78
10	600022	万科A	42,327	1,177,113.87	0.77

**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	国债逆回购	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
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	资产支持证券	97,124,000.00	63.30
9	其他	-	-
10	合计	97,124,000.00	63.30

**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**

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	11190344	华润信托CD344	200,000	39,720,000.00	12.61
2	11190340	华润信托CD340	200,000	39,320,000.00	12.43
3	11190349	华润信托CD349	200,000	39,310,000.00	12.41
4	11191776	光大银行CD76	200,000	19,314,000.00	6.29
5	11191939	招商银行CD39	200,000	19,314,000.00	6.29

**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五名贵金属投资**

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权证投资**

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**

无。

**5.9 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**

无。

**5.10 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**

无。

**5.11 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**

无。

**5.12 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**

无。

**5.13 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**

无。

**5.14 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**

无。

**5.15 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**

无。

**5.16 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**

无。

**5.17 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**

无。

**5.18 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**

无。

**5.19 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**

无。

**5.20 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**

无。

**5.21 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**

无。

**5.22 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**

无。

**5.23 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**

无。

**5.24 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**

无。

**5.25 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**

无。

**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五名权证投资**

无。

**5.27 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**

无。

**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权证投资**

无。

**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五名权证投资**

无。

**5.30 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**

无。

**5.31 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**

无。

**5.32 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**

无。

**5.33 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**

无。

**5.34 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**

无。

**5.35 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**

无。

**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五名权证投资**

无。

**5.37 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**

无。

**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权证投资**

无。

**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五名权证投资**

无。

**5.40 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**

无。

**5.11 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。**

**5.12 其他资产构成**

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	39,104.64
2	应收股利	-
3	应收利息	56,388.00
4	应收申购款	2,368,163.24
5	其他应收款	1,804.72
6	其他	-
7	合计	2,465,458.60

**5.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末持有可转换债券。

**5.15 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

**5.16 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。

**5.17 开放式基金份额变动**

单位:份	报告期初基金份额总额	报告期间基金份额变动	报告期末基金份额总额
报告期初基金份额总额	150,460,930.00	-	150,460,930.00
报告期间基金份额变动	-	-	-
报告期末基金份额总额	150,460,930.00	-	150,460,930.00

**5.18 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末持有可转换债券。

**5.19 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

**5.20 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。

**5.21 开放式基金份额变动**

单位:份	报告期初基金份额总额	报告期间基金份额变动	报告期末基金份额总额
报告期初基金份额总额	150,460,930.00	-	150,460,930.00
报告期间基金份额变动	-	-	-
报告期末基金份额总额	150,460,930.00	-	150,460,930.00

**5.22 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末持有可转换债券。

**5.23 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

**5.24 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。

**5.25 开放式基金份额变动**

单位:份	报告期初基金份额总额	报告期间基金份额变动	报告期末基金份额总额
报告期初基金份额总额	150,460,930.00	-	150,460,930.00
报告期间基金份额变动	-	-	-
报告期末基金份额总额	150,460,930.00	-	150,460,930.00

**5.26 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末持有可转换债券。

**5.27 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

**5.28 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。

**5.29 开放式基金份额变动**

单位:份	报告期初基金份额总额	报告期间基金份额变动	报告期末基金份额总额
报告期初基金份额总额	150,460,930.00	-	150,460,930.00
报告期间基金份额变动	-	-	-
报告期末基金份额总额	150,460,930.00	-	150,460,930.00

**5.30 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末持有可转换债券。

**5.31 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

**5.32 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。

**5.33 开放式基金份额变动**

单位:份	报告期初基金份额总额	报告期间基金份额变动	报告期末基金份额总额
报告期初基金份额总额	150,460,930.00	-	150,460,930.00
报告期间基金份额变动	-	-	-
报告期末基金份额总额	150,460,930.00	-	150,460,930.00

**5.34 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末持有可转换债券。

**5.35 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

**5.36 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。

**5.37 开放式基金份额变动**

单位:份	报告期初基金份额总额	报告期间基金份额变动	报告期末基金份额总额
报告期初基金份额总额	150,460,930.00	-	150,460,930.00
报告期间基金份额变动	-	-	-
报告期末基金份额总额	150,460,930.00	-	150,460,930.00

**5.38 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末持有可转换债券。

**5.39 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

**5.40 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。

**5.41 开放式基金份额变动**

单位:份	报告期初基金份额总额	报告期间基金份额变动	报告期末基金份额总额
报告期初基金份额总额	150,460,930.00	-	150,460,930.00
报告期间基金份额变动	-	-	-
报告期末基金份额总额	150,460,930.00	-	150,460,930.00

**5.42 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末持有可转换债券。

**5.43 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

**5.44 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。

**5.45 开放式基金份额变动**

单位:份	报告期初基金份额总额	报告期间基金份额变动	报告期末基金份额总额
报告期初基金份额总额	150,460,930.00	-	150,460,930.00
报告期间基金份额变动	-	-	-
报告期末基金份额总额	150,460,930.00	-	150,460,930.00

**5.46 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末持有可转换债券。

**5.47 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

**5.48 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。

**5.49 开放式基金份额变动**

单位:份	报告期初基金份额总额	报告期间基金份额变动	报告期末基金份额总额
报告期初基金份额总额	150,460,930.00	-	15