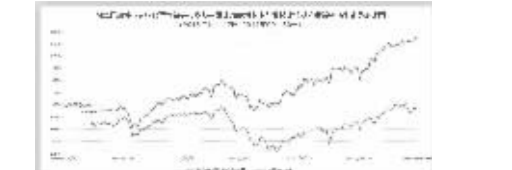


前海开源外向企业股票型证券投资基金

2017年第三季度报告

注:本基金的业绩比较基准为:中证500指数收益率*80%+中证债指数收益率*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



注:①本基金的基金合同于2016年11月17日生效,截至2017年9月30日止,本基金成立未满1年。
②本基金的建仓期为6个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。截至2017年9月30日,本基金建仓期结束未满1年。

3.3 其他指标
无。

Table with 4 columns: Name, Position, Term, and Description. Lists the fund manager and other key personnel.

注:①对基金的责任基金经理,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,对此后的非责任基金经理,“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。

4.2 管理人对于报告期内本基金运作遵规守信情况说明
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。本报告期内,基金运作整体合法合规,没有损害基金份额持有人利益,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
市场在第三季度继续维持震荡行情,本基金运作继续以稳健为目标,坚持价值投资理念,完善资产配置策略,保持仓位高位,坚持在行业层面精选个股,选取在国际市场有竞争力的标的,此外,结合宏观判断,选取了受益于流动性改善的标的。

4.5 报告期内基金的业绩表现
本基金本报告期内,基金份额净值增长率为9.35%,同期业绩比较基准收益率为6.19%。

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况。

5.1 投资组合报告
5.1.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 5 columns: No., Item, Amount (元), and Percentage of Net Assets. Lists the top 10 holdings of the fund.

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

Table with 5 columns: Code, Industry, Amount (元), and Percentage of Net Assets. Lists the top 10 industry holdings.

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
本基金本报告期末未通过港股通机制投资港股。

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 with 5 columns: No., Stock Code, Stock Name, Quantity, Fair Value (元), and Percentage of Net Assets. Lists the top 10 stock holdings.

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末未持有债券。

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
本基金本报告期末未持有债券。

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
本基金本报告期末未持有债券。

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
本基金本报告期末未持有贵金属。

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
本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
本基金本报告期末未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现过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。

5.12 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。

5.13 其他资产构成

Table with 2 columns: Item and Amount (元). Lists the fund's other assets.

5.11.1 报告期末未持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.11.5 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。

5.11.6 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

Table with 2 columns: Item and Amount. Shows the change in fund shares.

注:总申购份额含红利再投、转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况
本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

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

Table with 2 columns: Investor Name and Shareholding Information. Lists investors holding over 20% of shares.

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外向企业股票型证券投资基金设立的文件

(2) 前海开源外向企业股票型证券投资基金基金合同

(3) 前海开源外向企业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、营业执照和公司章程

(5) 前海开源外向企业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(免长途费)

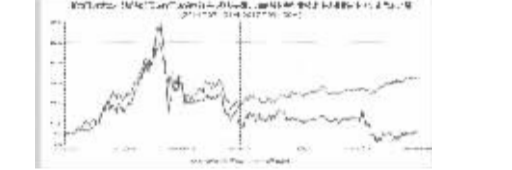
(3) 投资者可访问本基金管理人公司网站,网址:www.qhkyfund.com

前海开源基金管理有限公司 二〇一七年十月二十六日

前海开源大海洋战略经济灵活配置混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率*70%+中证债指数收益率*30%。
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



3.3 其他指标
无。

Table with 4 columns: Name, Position, Term, and Description. Lists the fund manager and other key personnel.

注:①对基金的责任基金经理,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,对此后的非责任基金经理,“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。

4.2 管理人对于报告期内本基金运作遵规守信情况说明
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。本报告期内,基金运作整体合法合规,没有损害基金份额持有人利益,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
报告期内宏观经济增长运行平稳,但从固定资产配置、消费升级、出口增速等月度数据开始显现下行压力,PMI和PPI低位震荡,CPI低位有所回升,货币政策依然维持宽松,资金面宽松,尤其是中债票据,利率债资产表现较好;此外基本面在本报告期内之内,影响不大。在此期间,周期股受估值重构和业绩超预期刺激表现突出,创业板受人工智能等主题驱动出现反弹,指数整体呈现震荡和上涨态势,三季度,组合配置以军工为主,在前期深度回调之后,板块筑底企稳,获得了一定的正收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现
本基金本报告期内,基金份额净值增长率为3.41%,同期业绩比较基准收益率为3.42%。

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况。

5.1 投资组合报告
5.1.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 5 columns: No., Item, Amount (元), and Percentage of Net Assets. Lists the top 10 holdings of the fund.

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

Table with 5 columns: Code, Industry, Amount (元), and Percentage of Net Assets. Lists the top 10 industry holdings.

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
本基金本报告期末未通过港股通机制投资港股。

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 with 5 columns: No., Stock Code, Stock Name, Quantity, Fair Value (元), and Percentage of Net Assets. Lists the top 10 stock holdings.

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末未持有债券。

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
本基金本报告期末未持有债券。

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
本基金本报告期末未持有债券。

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
本基金本报告期末未持有贵金属。

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
本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
本基金本报告期末未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现过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。

5.12 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。

5.13 其他资产构成

Table with 2 columns: Item and Amount (元). Lists the fund's other assets.

5.11.1 报告期末未持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.11.5 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。

5.11.6 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

Table with 2 columns: Item and Amount. Shows the change in fund shares.

注:总申购份额含红利再投、转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况
本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

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

Table with 2 columns: Investor Name and Shareholding Information. Lists investors holding over 20% of shares.

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大海洋战略经济灵活配置混合型证券投资基金设立的文件

(2) 前海开源大海洋战略经济灵活配置混合型证券投资基金基金合同

(3) 前海开源大海洋战略经济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、营业执照和公司章程

(5) 前海开源大海洋战略经济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(免长途费)

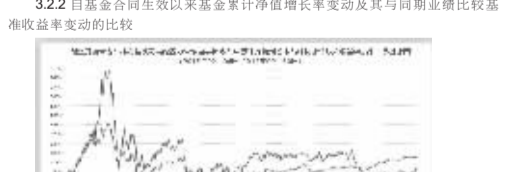
(3) 投资者可访问本基金管理人公司网站,网址:www.qhkyfund.com

前海开源基金管理有限公司 二〇一七年十月二十六日

前海开源大安全核心精选灵活配置混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率*70%+中证债指数收益率*30%。
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



3.3 其他指标
无。

Table with 4 columns: Name, Position, Term, and Description. Lists the fund manager and other key personnel.

注:①对基金的责任基金经理,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,对此后的非责任基金经理,“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。

4.2 管理人对于报告期内本基金运作遵规守信情况说明
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。本报告期内,基金运作整体合法合规,没有损害基金份额持有人利益,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
本报告期内,我们采用动态灵活的投资策略,考虑到国家安全涉及的各个领域中长期发展前景看好,但各个领域的发展力和估值影响因素会有所不同,因此我们自下而上,优选个股,自下而上选公司,同时结合估值水平精选投资标的进行配置。在报告期内,实现了正收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

Table with 5 columns: No., Item, Amount (元), and Percentage of Net Assets. Lists the top 10 holdings of the fund.

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 5 columns: No., Item, Amount (元), and Percentage of Net Assets. Lists the top 10 holdings.

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

Table with 5 columns: Code, Industry, Amount (元), and Percentage of Net Assets. Lists the top 10 industry holdings.

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
本基金本报告期末未通过港股通机制投资港股。

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 with 5 columns: No., Stock Code, Stock Name, Quantity, Fair Value (元), and Percentage of Net Assets. Lists the top 10 stock holdings.

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末未持有债券。

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
本基金本报告期末未持有债券。

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
本基金本报告期末未持有债券。

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
本基金本报告期末未持有贵金属。

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
本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
本基金本报告期末未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现过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。

5.12 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。

5.13 其他资产构成

Table with 2 columns: Item and Amount (元). Lists the fund's other assets.

5.11.1 报告期末未持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.11.5 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。

5.11.6 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

Table with 2 columns: Item and Amount. Shows the change in fund shares.

注:总申购份额含红利再投、转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况
本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

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

Table with 2 columns: Investor Name and Shareholding Information. Lists investors holding over 20% of shares.

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大安全核心精选灵活配置混合型证券投资基金设立的文件

(2) 前海开源大安全核心精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同

(3) 前海开源大安全核心精选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、营业执照和公司章程

(5) 前海开源大安全核心精选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(免长途费)

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

前海开源基金管理有限公司 二〇一七年十月二十六日