

基金管理人:前海开源基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

报告送出日期:2018年10月24日

\$1 重要提示

基金管理人和基金托管人承诺本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其中的真实、准确性和完整性承担个别及连带责任。本基金在2018年10月22日复权调整了部分份额的份额净值，净值表现和投资运作指标可能因此产生不利影响，但并不保证基金份额一定盈利。基金份额过往业绩并不代表其未来表现。

基金管理人承诺诚守信用，勤勉尽责地管理基金财产和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。基金管理人提醒投资者注意基金投资风险，审慎选择基金。

本基金中行货币基金未进行复权。

本基金自2018年7月1日起至2018年10月24日止。

\$2 基金产品概况

基金名称:前海开源股息率100强等权重股票型证券投资基金

报告送出日期:2018年10月24日

\$3 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2018年07月01日 - 2018年09月30日)

1.本期已实现收益 -14,700,343.04

2.本期利润 -14,811,907.49

3.期末基金资产净值 629,029,452.13

4.期末基金份额净值 1.030

5.期末可供分配基金份额净值 0.000

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将低于所列数字。

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本基金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

份额 净值增长率为% 净值增长率为% 基金份额净值 基金份额净值 (1-3) (2-4)

过去三个月 -2.00% 1.3% -1.0% 1.2% -0.7% -0.1%

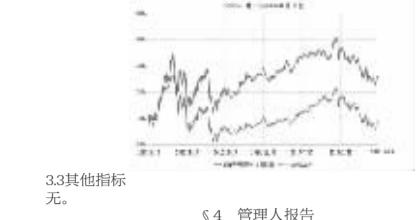
注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期

前海开源股息率100强等权重股票型证券投资基金

2018年第三季度报告

本报告期内,基金份额净值增长率为-2.69%,同期业绩比较基准收益率为-1.92%。

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

§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	任本基金基金经理的日期	证券业从业年限	说明
陈立	基金经理	2018-03-13	-	独立董事、证券投资部、风险管理部、量化分析部、策略研究部、行业研究部、宏观策略部、固定收益部、量化投资部、量化策略部、量化投资总监、基金经理助理、基金经理、公司总经理。

注:①对本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证券从业的含义从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的规定。

4.2 管理人报告期内本基金运作遵循法律法规的情况

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,本基金管理人诚信经营,勤勉尽责的履行职责和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋取最大利益。本基金报告期内,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合同关于基金投资方面的各项规定。

4.3 公司治理专项说明

4.3.1 平交交易制度的执行情况

本报告期内,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》,完善平交制度及流程,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

本基金由基金经理负责,基金经理对投资组合的买卖行为所公开竞价出现1%以上的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况,基金经理将按相关规定履行了审批程序。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度国内经济继续下行,消费和投资增速持续下滑,出口压力开始显现, CPI略有回升, PPI低位徘徊;“去杠杆”方向未变,节奏和力度略有调整;中美贸易战逐步显性化,受经济下行及中美关系影响,三季度A股市场继续走弱,沪深300指数下跌1.2%。

本基金以股息率为主要选股指标,其投资标的主要有高分红、高股息率的大盘蓝筹,受市场下跌的影响,三季度净值略有下跌。在后续的投资操作中,本基金仍将坚持以定量分析为主,辅以定性分析的方法,在高股息率的行业中进行适当精选,力争为投资者创造超越基准的投资回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末前海开源股息率100强股票基金份额净值为1.028元,

基金份额的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期

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将低于所列数字。

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。

3.2.2 本基金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

份额 净值增长率为% 净值增长率为% 基金份额净值 基金份额净值 (1-3) (2-4)

过去三个月 -2.00% 1.3% -1.0% 1.2% -0.7% -0.1%

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×30%+中证全债指数

收益率×70%+银行活期存款利率×3%。

4.6 报告期内基金的费用概览

4.6.1 交易费用

4.6.2 基金管理费

4.6.3 基金托管费

4.6.4 风险准备金

4.6.5 其他费用

4.7 报告期内确认的清算费用

4.8 其他费用

4.9 报告期利息

4.10 报告期税金及附加费用

4.11 其他费用

4.12 报告期其他费用

4.13 报告期未确认的清算费用

4.14 报告期未支付的佣金

4.15 报告期预提费用

4.16 报告期摊销费用

4.17 报告期未支付的申购费

4.18 报告期未支付的赎回费

4.19 报告期未支付的定期定额费用

4.20 报告期未支付的转换费

4.21 报告期未支付的其他费用

4.22 报告期未收到的佣金

4.23 报告期未收到的预付款项

4.24 报告期未收到的其他款项

4.25 报告期未支付的其他款项

4.26 报告期未收到的其他款项

4.27 报告期未支付的其他款项

4.28 报告期未收到的其他款项

4.29 报告期未支付的其他款项

4.30 报告期未收到的其他款项

4.31 报告期未支付的其他款项

4.32 报告期未收到的其他款项

4.33 报告期未支付的其他款项

4.34 报告期未收到的其他款项

4.35 报告期未支付的其他款项

4.36 报告期未收到的其他款项

4.37 报告期未支付的其他款项

4.38 报告期未收到的其他款项

4.39 报告期未支付的其他款项

4.40 报告期未收到的其他款项

4.41 报告期未支付的其他款项

4.42 报告期未收到的其他款项

4.43 报告期未支付的其他款项

4.44 报告期未收到的其他款项

4.45 报告期未支付的其他款项

4.46 报告期未收到的其他款项

4.47 报告期未支付的其他款项

4.48 报告期未收到的其他款项

4.49 报告期未支付的其他款项

4.50 报告期未收到的其他款项

4.51 报告期未支付的其他款项

4.52 报告期未收到的其他款项

4.53 报告期未支付的其他款项

4.54 报告期未收到的其他款项

4.55 报告期未支付的其他款项

4.56 报告期未收到的其他款项

4.57 报告期未支付的其他款项

4.58 报告期未收到的其他款项

4.59 报告期未支付的其他款项

4.60 报告期未收到的其他款项

4.61 报告期未支付的其他款项

4.62 报告期未收到的其他款项

4.63 报告期未支付的其他款项

4.64 报告期未收到的其他款项

4.65 报告期未支付的其他款项

4.66 报告期未收到的其他款项

4.67 报告期未支付的其他款项

4.68 报告期未收到的其他款项

4.69 报告期未支付的其他款项

4.70 报告期未收到的其他款项

4.71 报告期未支付的其他款项

4.72 报告期未收到的其他款项

4.73 报告期未支付的其他款项

4.74 报告期未收到的其他款项

4.75 报告期未支付的其他款项

4.76 报告期未收到的其他款项

4.77 报告期未支付的其他款项

4.78 报告期未收到的其他款项

4.79 报告期未支付的其他款项

4.80 报告期未收到的其他款项

4.81 报告期未支付的其他款项

4.82 报告期未收到的其他款项

4.83 报告期未支付的其他款项

4.84 报告期未收到的其他款项

4.85 报告期未支付的其他款项

4.86 报告期未收到的其他款项

</