

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%

4.62 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形。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	1076,020,980.72	90.33
2	债券投资	107,620,980.72	9.03
3	基金投资	-	-
4	银行存款	30,147,000.00	2.57
5	应收利息	30,147,000.00	2.57
6	资产支持证券	-	-
7	其他资产	-	-
8	负债	-	-
9	净资产	30,147,000.00	2.57

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

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	180004	18国债04	200,000	30,147,000.00	4.79

注:本基金本报告期内未持有上述债券。

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资产支持证券。

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

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

5.10.1 本期国债期货投资政策
本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 投资组合报告附注
5.11.1.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	项目	金额(元)
1	存出保证金	101,238.00
2	应收证券清算款	209,149.00
3	其他应收款	-
4	其他资产	986,252.00
5	合计	77,447.00

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

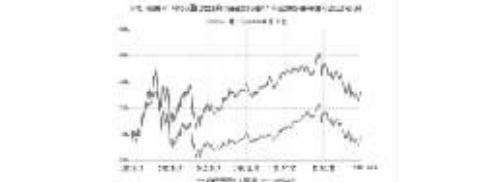
本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	000004	中水集团	16,524,160.00	2,471,000.00	2.47

存款利率(税后) > 5%。

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:本基金自2015年12月2日起,增加C类基金份额并设置对应基金代码,前海开源金銀珠宝混合C基金份额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起始日为2015年12月2日。

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	性别	任本基金基金经理时间	简历
曹伟	男	2015-03-11	1980年3月11日出生,中国国籍,本科学历,工学硕士,曾任招商基金管理有限公司研究员、基金经理助理,现任前海开源基金管理有限公司基金经理。

注:①对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”为根据公司决定确定的解聘日期,对此后的非首任基金经理,“任职日期”和“离任日期”分别指根据基金合同规定确定的聘任日期和解聘日期。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 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、《基金合同》和《基金管理人基金投资行为自律公约》等有关规定,恪守诚信,勤勉尽责,没有出现损害基金份额持有人利益的行为。

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《证券投资基金管理人公平交易管理制度》,完善相应制度和流程,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
本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内,因组合投资策略需要,基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价出现1次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,基金投资运作未执行了审批程序。

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行,出口压力开始显现,CPI略有回升,PPI高位徘徊;“去杠杆”方向未变,节奏和力度有调整;中美战略冲突逐步显性化,受经济下行及中美关系的影响,三季度A股市场继续走弱,沪深300指数下跌21%,创业板指数下跌12.2%。

本基金以股息率为主要选股指标,其投资标的主要是高分红、高股息率的大蓝筹、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,本基金仍将坚持定量分析为主,辅以定性分析的方法,在高风险个股中进行适当精选,争取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。

注: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规定。截至2018年9月30日,本基金建仓期结束未满1年。

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2018年07月01日至2018年09月30日)	单位:人民币元
1.本期已实现收益	-3,471,283.27	-3,471,283.27
2.本期公允价值变动收益	-4,091,749.76	-4,091,749.76
3.本期基金费用	-1,000.00	-1,000.00
4.本期基金份额持有人收益	620,380.23	620,380.23
5.期末基金份额持有人收益	1,000.00	1,000.00

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。

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

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差
过去3个月	-2.69%	1.33%	-1.92%	1.29%
过去6个月	-0.77%	0.97%	-0.77%	0.97%

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×