

前海开源中国成长灵活配置混合型证券投资基金 2017年第1季度报告 2017年3月31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 报告送出日期:2017年4月21日

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2017年4月18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。

基金的投资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当仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告自2017年1月1日起至3月31日止。

基金产品概况 基金简称:前海开源中国成长混合 交易代码:000788

基金运作方式:契约型开放式 基金合同生效日:2014年9月29日

报告期末基金份额总额:38,768,460.60份

投资目标 本基金力图把握中国经济可持续发展过程中的投资机会,通过行业配置和精选个股,分享中国经济在转型升级、结构调整和可持续发展过程中

投资范围 本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、债券、权证、股指期货、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证、股指期货、资产支持证券、国债期货

投资策略 本基金采取自上而下的宏观分析和自下而上精选个股的投资策略,在明确本基金资产配置比例限制前提下,确定基金在各类资产中的具体投资比例。

业绩比较基准 沪深300指数收益率*70%+中证全指指数收益率*30%。

风险收益特征 本基金为混合型基金,属于中高风险收益的投资品种,其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金,低于股票型基金。

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

3.1 主要财务指标 单位:人民币元

1.本期已实现收益 -649,502.91

2.本期利润 1,459,058.22

3.加权平均基金份额本期利润 0.0318

4.期末基金资产净值 43,776,378.49

5.期末基金份额净值 1.129

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

Table with 5 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率标准差④, ①-③, ②-④

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率*70%+中证全指指数收益率*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的比较

2.54% 0.84% 2.98% 0.36% -0.44% 0.48%

4.5 报告期内基金的业绩表现 本基金报告期内,基金份额净值增长率为2.54%,同期业绩比较基准收益率为2.98%。

4.6 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明 本基金报告期内,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。

5.1 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(%)

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元) / 占基金总资产的比例(%)

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 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.3 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: 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(%)

5.2.4 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债券投资明细

Table with 5 columns: 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(%)

5.2.5 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

Table with 5 columns: 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(%)

5.2.6 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 5 columns: 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(%)

5.2.7 报告期末持有的资产支持证券明细

Table with 5 columns: 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(%)

5.2.8 报告期末持有的股指期货合约

Table with 5 columns: 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(%)

5.2.9 报告期末持有的国债期货合约

Table with 5 columns: 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(%)

5.2.10 报告期末持有的权证

Table with 5 columns: 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(%)

5.2.11 报告期末持有的其他金融工具

Table with 5 columns: 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(%)

5.2.12 报告期末持有的其他金融工具

Table with 5 columns: 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(%)

5.2.13 报告期末持有的其他金融工具

Table with 5 columns: 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(%)

5.2.14 报告期末持有的其他金融工具

Table with 5 columns: 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(%)

5.2.15 报告期末持有的其他金融工具

Table with 5 columns: 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(%)

5.2.16 报告期末持有的其他金融工具

Table with 5 columns: 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(%)

5.2.17 报告期末持有的其他金融工具

Table with 5 columns: 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(%)

5.2.18 报告期末持有的其他金融工具

Table with 5 columns: 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(%)

5.2.19 报告期末持有的其他金融工具

Table with 5 columns: 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(%)

5.2.20 报告期末持有的其他金融工具

Table with 5 columns: 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(%)

5.2.21 报告期末持有的其他金融工具

Table with 5 columns: 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(%)

5.2.22 报告期末持有的其他金融工具

Table with 5 columns: 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(%)

5.2.23 报告期末持有的其他金融工具

Table with 5 columns: 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(%)

5.2.24 报告期末持有的其他金融工具

Table with 5 columns: 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(%)

5.2.25 报告期末持有的其他金融工具

Table with 5 columns: 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(%)

5.2.26 报告期末持有的其他金融工具

Table with 5 columns: 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(%)

5.2.27 报告期末持有的其他金融工具

Table with 5 columns: 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(%)

5.2.28 报告期末持有的其他金融工具

Table with 5 columns: 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(%)

前海开源沪深300指数型证券投资基金 2017年第1季度报告 2017年3月31日

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:2017年4月21日

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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年4月18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。

基金的投资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当仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告自2017年1月1日起至3月31日止。

基金产品概况 基金简称:前海开源沪深300指数 交易代码:000656

基金运作方式:契约型开放式 基金合同生效日:2014年6月17日

报告期末基金份额总额:47,343,638.12份

投资目标 本基金采用指数化投资策略,紧密跟踪沪深300指数,在严格控制基金的风险前提下,力争获取与标的指数相类似的收益。

投资范围 本基金采用完全复制指数的方法进行被动式指数化投资,股票资产组合的构建主要按照标的指数的成份股及其权重和复制指数的方法,并根据标的指数变动进行相应调整。

投资策略 本基金采取自上而下的宏观分析和自下而上精选个股的投资策略,在明确本基金资产配置比例限制前提下,确定基金在各类资产中的具体投资比例。

业绩比较基准 沪深300指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%。

风险收益特征 本基金属于采用指数化操作的股票型基金,其预期的风险和收益高于货币型基金、债券型基金,低于股票型基金。

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

3.1 主要财务指标 单位:人民币元

1.本期已实现收益 -47,806.19

2.本期利润 1,877,013.00

3.加权平均基金份额本期利润 0.0396

4.期末基金资产净值 53,029,488.50

5.期末基金份额净值 1.120

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

Table with 5 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率标准差④, ①-③, ②-④

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(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的比较

Table with 5 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率标准差④, ①-③, ②-④

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(税后)*5%。

3.2.3 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的比较

Table with 5 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率标准差④, ①-③, ②-④

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(税后)*5%。

3.2.4 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的比较

Table with 5 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率标准差④, ①-③, ②-④

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(税后)*5%。

3.2.5 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的比较

Table with 5 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率标准差④, ①-③, ②-④

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(税后)*5%。

3.2.6 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的比较

Table with 5 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率标准差④, ①-③, ②-④

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(税后)*5%。

3.2.7 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的比较

Table with 5 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率标准差④, ①-③, ②-④

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(税后)*5%。

3.2.8 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的比较

Table with 5 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率标准差④, ①-③, ②-④

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(税后)*5%。

3.2.9 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的比较

Table with 5 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率标准差④, ①-③, ②-④

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(税后)*5%。

3.2.10 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的比较

Table with 5 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率标准差④, ①-③, ②-④

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(税后)*5%。

3.2.11 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的比较

Table with 5 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率标准差④, ①-③, ②-④

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(税后)*5%。

3.2.12 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的比较

Table with 5 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率标准差④, ①-③, ②-④

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(税后)*5%。

4.5 报告期内基金的业绩表现 本基金报告期内,基金份额净值增长率为2.54%,同期业绩比较基准收益率为2.98%。

4.6 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明 本基金报告期内,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。

5.1 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(%)

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元) / 占基金总资产的比例(%)

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 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.3 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: 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(%)

5.2.4 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债券投资明细

Table with 5 columns: 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(%)

5.2.5 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

Table with 5 columns: 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(%)

5.2.6 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 5 columns: 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(%)

5.2.7 报告期末持有的资产支持证券明细

Table with 5 columns: 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(%)

5.2.8 报告期末持有的股指期货合约

Table with 5 columns: 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(%)

5.2.9 报告期末持有的国债期货合约

Table with 5 columns: 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(%)

5.2.10 报告期末持有的权证

Table with 5 columns: 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(%)

5.2.11 报告期末持有的其他金融工具

Table with 5 columns: 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(%)

5.2.12 报告期末持有的其他金融工具

Table with 5 columns: 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(%)

5.2.13 报告期末持有的其他金融工具

Table with 5 columns: 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(%)

5.2.14 报告期末持有的其他金融工具

Table with 5 columns: 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(%)

5.2.15 报告期末持有的其他金融工具

Table with 5 columns: 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(%)

5.2.16 报告期末持有的其他金融工具

Table with 5 columns: 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(%)

5.2.17 报告期末持有的其他金融工具

Table with 5 columns: 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(%)

5.2.18 报告期末持有的其他金融工具

Table with 5 columns: 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(%)

5.2.19 报告期末持有的其他金融工具

Table with 5 columns: 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(%)

5.2.20 报告期末持有的其他金融工具

Table with 5 columns: 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(%)

5.2.21 报告期末持有的其他金融工具

Table with 5 columns: 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(%)

5.2.22 报告期末持有的其他金融工具

Table with 5 columns: 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(%)

5.2.23 报告期末持有的其他金融工具

Table with 5 columns: 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(%)

5.2.24 报告期末持有的其他金融工具

Table with 5 columns: 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(%)

5.2.25 报告期末持有的其他金融工具

Table with 5 columns: 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(%)