

前海开源中国成长灵活配置混合型证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015年9月30日

基金管理人：前海开源基金管理有限公司
基金管理人：交银国际资产管理有限公司
报告送出日期：2015年10月24日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事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，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金管理人交银国际资产管理有限公司对本基金合同规定，于2015年10月23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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失，且对基金净值的不确定性不承担保证责任。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。

本报告自2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金名称	前海开源中国成长灵活配置混合型
交易代码	000788
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日	2015年11月14日
报告期末基金份额总额	53,526,373.32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，分享中国经济增长和改革红利，谋求实现基金资产的长期增值。本基金追求超越业绩比较基准的投资回报。

投资策略

本基金的投资策略主要有以下方面内容：

1. 资产配置策略

本基金在资产配置中，本基金综合运用定性和定量的分析手段，在宏观经济、行业景气度、估值水平、流动性、市场情绪等因素的综合考量下，对大类资产配置和预期收益进行判断，制定资产配置策略。本基金在资产配置中，主要考虑宏观经济、行业景气度、估值水平、流动性、市场情绪等因素的综合考量，在宏观、行业景气度、估值水平、流动性、市场情绪等因素的综合考量下，对大类资产配置和预期收益进行判断，制定资产配置策略。

风险收益特征

本基金为混合型证券投资基金，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：交银国际资产管理有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

项目	报告期(2015年7月1日-2015年9月30日)
1.本期利润总额	-20,120,460.00
2.本期净利润	-43,093,702.17
3.加权平均基金份额本期利润	-0.6410
4.期末基金份额净值	60.522,719.00
5.期末基金资产净值	3,231,113.11

注：1.上述基金净值增长率及基金份额净值增长率均按照基金合同规定的方法计算，且采用四舍五入的方式保留至小数点后四位。2.本基金自2015年11月14日成立以来，尚未开始计提管理费、托管费、销售服务费、基金赎回费等费用。3.本基金自2015年11月14日成立以来，尚未开始计提管理费、托管费、销售服务费、基金赎回费等费用。

§4 基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率*70%+中证500指数收益率*30%

§5 基金投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	37,669,112.20	61.52
2	其中：股票	37,669,112.20	61.52
3	固定收益投资	-	-
4	其中：债券	-	-
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	其他投资	-	-
10	银行存款和结算备付金合计	2,847,521.87	4.63
11	其他资产	20,718,453.18	33.83
12	合计	61,235,087.25	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股权投资投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	-	-
B	医药、生物业	-	-
C	制造业	28,497,588.00	46.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	信息技术业	2,809,520.00	4.64
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	房地产业	-	-
I	批发和零售业	6,118,056.20	10.11
J	金融业	-	-
K	采矿业	-	-
L	国防军工	-	-
M	公用事业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	有色金属、非金属矿物制品业	-	-
P	卫生和社会工作	544,178.00	0.90
Q	教育、文体和娱乐业	-	-
R	综合	37,669,112.20	62.24

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

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	002179	中航光电	89,200	3,159,464.00	5.21
2	600893	中航动力	69,000	2,843,456.00	4.70
3	601983	永新股份	276,800	2,809,520.00	4.64
4	300017	利科技	49,600	2,644,416.00	4.32
5	000768	中航飞机	115,500	2,590,665.00	4.28
6	300097	智信股份	69,600	2,453,400.00	4.05
7	000778	中航控制	101,150	2,284,978.50	3.78
8	300113	顺络科技	51,500	2,254,970.00	3.74
9	600463	联讯股份	99,000	2,261,160.00	3.71
10	603288	南微光电	59,638	1,870,844.06	3.09

5.4 报告期末按市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。

5.6 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明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

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明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 本报告期间本基金未投资股指期货。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本报告期间本基金未投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 报告期内本基金未持有股票期权。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内本基金未持有股票期权。

5.12 基金投资组合报告附注

5.12.1 报告期内本基金未持有股票期权。

5.13 基金投资组合报告附注

5.13.1 报告期内本基金未持有股票期权。

5.14 基金投资组合报告附注

5.14.1 报告期内本基金未持有股票期权。

5.15 基金投资组合报告附注

5.15.1 报告期内本基金未持有股票期权。

5.16 基金投资组合报告附注

5.16.1 报告期内本基金未持有股票期权。

5.17 基金投资组合报告附注

5.17.1 报告期内本基金未持有股票期权。

5.18 基金投资组合报告附注

5.18.1 报告期内本基金未持有股票期权。

5.19 基金投资组合报告附注

5.19.1 报告期内本基金未持有股票期权。

5.20 基金投资组合报告附注

5.20.1 报告期内本基金未持有股票期权。

5.21 基金投资组合报告附注

5.21.1 报告期内本基金未持有股票期权。

中国经济“新常态”下的长期稳定发展。本基金管理人认为，中国经济在“新常态”下，长期稳定发展，为投资者提供了良好的投资环境。本基金管理人认为，中国经济在“新常态”下，长期稳定发展，为投资者提供了良好的投资环境。

§5 重要提示

基金管理人的董事会及董事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，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

§6 基金产品概况

基金名称	前海开源睿远稳健增利混合
交易代码	000032
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日	2015年11月14日
报告期末基金份额总额	50,000,788.00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，分享中国经济增长和改革红利，谋求实现基金资产的长期增值。本基金追求超越业绩比较基准的投资回报。

投资策略

本基金的投资策略主要有以下方面内容：

1. 资产配置策略

本基金在资产配置中，本基金综合运用定性和定量的分析手段，在宏观经济、行业景气度、估值水平、流动性、市场情绪等因素的综合考量下，对大类资产配置和预期收益进行判断，制定资产配置策略。

风险收益特征

本基金为混合型证券投资基金，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：交银国际资产管理有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

项目	报告期(2015年7月1日-2015年9月30日)
1.本期利润总额	-48,663,717.00
2.本期净利润	-50,703,000.00
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0075
4.期末基金份额净值	10.588,266.63
5.期末基金资产净值	43,713,293.55

注：1.上述基金净值增长率及基金份额净值增长率均按照基金合同规定的方法计算，且采用四舍五入的方式保留至小数点后四位。2.本基金自2015年11月14日成立以来，尚未开始计提管理费、托管费、销售服务费、基金赎回费等费用。

§4 基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率*70%+中证500指数收益率*30%

§5 基金投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	3,679,936.20	6.64
2	其中：股票	3,679,936.20	6.64
3	固定收益投资	22,143,403.40	39.94
4	其中：债券	22,143,403.40	39.94
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	其他投资	-	-
10	银行存款和结算备付金合计	5,895,261.31	10.63
11	其他资产	726,038.94	1.31
12	合计	55,444,640.75	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股权投资投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	153.10	0.00
B	医药、生物业	-	-
C	制造业	3,679,936.20	6.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	信息技术业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	房地产业	-	-
I	批发和零售业	-	-
J	金融业	-	-
K	采矿业	-	-
L	国防军工	-	-
M	公用事业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	有色金属、非金属矿物制品业	-	-
P	卫生和社会工作	-	-
Q	教育、文体和娱乐业	-	-
R	综合	-	-

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

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	000893	中航动力	1,498,000	0.00	0.00
2	600280	中央商场	275,100	0.00	0.00

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	股票代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000083	中航动力	1,498,000	0.00	0.00
2	600280	中央商场	275,100	0.00	0.00

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。

5.6 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明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

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明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 本报告期间本基金未投资股指期货。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本报告期间本基金未投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 报告期内本基金未持有股票期权。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内本基金未持有股票期权。

5.12 基金投资组合报告附注

5.12.1 报告期内本基金未持有股票期权。

5.13 基金投资组合报告附注

5.13.1 报告期内本基金未持有股票期权。

5.14 基金投资组合报告附注

5.14.1 报告期内本基金未持有股票期权。

5.15 基金投资组合报告附注

5.15.1 报告期内本基金未持有股票期权。

5.16 基金投资组合报告附注

5.16.1 报告期内本基金未持有股票期权。

5.17 基金投资组合报告附注

5.17.1 报告期内本基金未持有股票期权。

5.18 基金投资组合报告附注

5.18.1 报告期内本基金未持有股票期权。

5.19 基金投资组合报告附注

5.19.1 报告期内本基金未持有股票期权。

前海开源股息率100强等权重股票型证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015年9月30日

基金管理人：前海开源基金管理有限公司
基金管理人：交银国际资产管理有限公司
报告送出日期：2015年10月24日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事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，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

§2 基金产品概况

基金名称	前海开源股息率100强等权重
交易代码	000916
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日	2015年7月13日
报告期末基金份额总额	417,742,725.90份

投资目标

本基金主要投资于沪深两市具有较高股息率的股票，运用股息率100强等权重投资策略，在合理控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期增值。

投资策略

本基金的投资策略主要有以下方面内容：

1. 资产配置策略

本基金在资产配置中，本基金综合运用定性和定量的分析手段，在宏观经济、行业景气度、估值水平、流动性、市场情绪等因素的综合考量下，对大类资产配置和预期收益进行判断，制定资产配置策略。

风险收益特征

本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金、混合型基金。

基金管理人：前海开源基金管理有限公司
基金托管人：交银国际资产管理有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

项目	报告期(2015年7月1日-2015年9月30日)
1.本期利润总额	-22,366,722.11
2.本期净利润	-75,330,125.31
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1560
4.期末基金份额净值	460,829,320.46
5.期末基金资产净值	1,103,140.00
6.期末基金份额净值增长率	1.103
7.期末基金份额净值增长率	1.103
8.期末基金份额净值增长率	1.103
9.期末基金份额净值增长率	1.103
10.期末基金份额净值增长率	1.103

注：1.上述基金净值增长率及基金份额净值增长率均按照基金合同规定的方法计算，且采用四舍五入的方式保留至小数点后四位。2.本基金自2015年7月13日成立以来，尚未开始计提管理费、托管费、销售服务费、基金赎回费等费用。

§4 基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率*70%+中证500指数收益率*30%

§5 基金投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	3,679,936.20	6.64
2	其中：股票	3,679,936.20	6.64
3	固定收益投资	22,143,403.40	39.94
4	其中：债券	22,143,403.40	39.94
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	其他投资	-	-
10	银行存款和结算备付金合计	5,895,261.31	10.63
11	其他资产	726,038.94	1.31
12	合计	55,444,640.75	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股权投资投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	153.10	0.00
B	医药、生物业	-	-
C	制造业	3,679,936.20	6.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	信息技术业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	房地产业	-	-
I	批发和零售业	-	-
J	金融业	-	-
K	采矿业	-	-
L	国防军工	-	-
M	公用事业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	有色金属、非金属矿物制品业	-	-
P	卫生和社会工作	-	-
Q	教育、文体和娱乐业	-	-
R	综合	-	-

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

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	000893	中航动力	1,498,000	0.00	0.00
2	600280	中央商场	275,100	0.00	0.00

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	股票代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000083	中航动力	1,498,000	0.00	0.00
2	600280	中央商场	275,100	0.00	0.00

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。

5.6 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明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

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明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 本报告期间本基金未投资股指期货。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本报告期间本基金未投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 报告期内本基金未持有股票期权。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内本基金未持有股票期权。