

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:2019年01月22日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事、监事、高级管理人员遵守法律法规和行业规范,勤勉尽责地履行职务,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承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,不保证基金一定盈利,基金的过往业绩并不代表未来表现。投资人应当仔细阅读基金合同、基金招募说明书等法律文件,了解基金的风险收益特征,根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和自身情况匹配,并根据自身的经济状况进行独立决策,自行承担投资风险。

本报告中财务数据未经审计。

§ 2 基金产品概况

基金简称:前海开源沪港深裕鑫灵活配置混合型证券投资基金

基金代码:000316

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2017年03月21日

报告期末基金份额总额:51,300,958,425份

报告期末基金资产净值:24,016,707,020元

报告期末基金份额净值:0.4730

本基金通过港股通机制与债券等资产的合理配置,在合理控制风险的前提下,力争实现基金净值增长率×20%+中证全债指数收益率×30%+恒生指数收益率×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

## 前海开源沪港深裕鑫灵活配置混合型证券投资基金

### 2018年第四季度报告

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内,A股市场继续震荡下跌,创业板年内新低。国内股票质押风险的暴露,国外中美贸易战的冲击,国内经济下行压力逐步加大的同时,美国的加息仍继续推进,这一系列的利空因素使市场继续承压。

市场的大幅下跌使得场内个股跌跌不休,不管是成交量还是估值水平都已进入历史低位,较大的跌幅的个股仓位水平大幅提升,重点配置了券商股,地产股,以及计算机,新能源汽车,生物医药等成长股。国内市场上市公司的定价得到大幅提升,券商行业的盈利能力显著兑现,战略新兴券商股的投资机会。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金的净值增长率为-11.19%,同期业绩比较基准收益率为-6.70%;截至报告期末前海开源沪港深裕鑫灵活配置混合型证券投资基金的净值为0.4730元,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不满二百人或者基金资产净值低于五亿元人民币的情形。

5.1 报告期内基金组合情况

序号 股票代码 项目 公允价值(元) 占基金总资产的比例(%)

1 601008 海康威视 176,000 2.84%

2 600048 保利地产 236,900 2.79%

3 600049 中国建筑 296,000 6.17

4 600091 中国国航 192,000 2.63%

5 601928 中信银行 292,900 5.63

6 601929 中国银行 114,000 2.54%

7 600069 东方财富 137,300 2.90%

8 000002 万科A 59,600 1.41%

9 300077 丽珠集团 117,400 2.06%

10 300014 亿纬锂能 77,600 1.21%

11 300060 先导智能 37,600 1.08%

12 300069 东方财富 5,000 0.14%

13 300069 东方财富 3,000 0.08%

14 300069 东方财富 2,000 0.05%

15 300069 东方财富 1,000 0.03%

16 300069 东方财富 1,000 0.03%

17 300069 东方财富 1,000 0.03%

18 300069 东方财富 1,000 0.03%

19 300069 东方财富 1,000 0.03%

20 300069 东方财富 1,000 0.03%

21 300069 东方财富 1,000 0.03%

22 300069 东方财富 1,000 0.03%

23 300069 东方财富 1,000 0.03%

24 300069 东方财富 1,000 0.03%

25 300069 东方财富 1,000 0.03%

26 300069 东方财富 1,000 0.03%

27 300069 东方财富 1,000 0.03%

28 300069 东方财富 1,000 0.03%

29 300069 东方财富 1,000 0.03%

30 300069 东方财富 1,000 0.03%

31 300069 东方财富 1,000 0.03%

32 300069 东方财富 1,000 0.03%

33 300069 东方财富 1,000 0.03%

34 300069 东方财富 1,000 0.03%

35 300069 东方财富 1,000 0.03%

36 300069 东方财富 1,000 0.03%

37 300069 东方财富 1,000 0.03%

38 300069 东方财富 1,000 0.03%

39 300069 东方财富 1,000 0.03%

40 300069 东方财富 1,000 0.03%

41 300069 东方财富 1,000 0.03%

42 300069 东方财富 1,000 0.03%

43 300069 东方财富 1,000 0.03%

44 300069 东方财富 1,000 0.03%

45 300069 东方财富 1,000 0.03%

46 300069 东方财富 1,000 0.03%

47 300069 东方财富 1,000 0.03%

48 300069 东方财富 1,000 0.03%

49 300069 东方财富 1,000 0.03%

50 300069 东方财富 1,000 0.03%

51 300069 东方财富 1,000 0.03%

52 300069 东方财富 1,000 0.03%

53 300069 东方财富 1,000 0.03%

54 300069 东方财富 1,000 0.03%

55 300069 东方财富 1,000 0.03%

56 300069 东方财富 1,000 0.03%

57 300069 东方财富 1,000 0.03%

58 300069 东方财富 1,000 0.03%

59 300069 东方财富 1,000 0.03%

60 300069 东方财富 1,000 0.03%

61 300069 东方财富 1,000 0.03%

62 300069 东方财富 1,000 0.03%

63 300069 东方财富 1,000 0.03%

64 300069 东方财富 1,000 0.03%

65 300069 东方财富 1,000 0.03%

66 300069 东方财富 1,000 0.03%

67 300069 东方财富 1,000 0.03%

68 300069 东方财富 1,000 0.03%

69 300069 东方财富 1,000 0.03%

70 300069 东方财富 1,000 0.03%

71 300069 东方财富 1,000 0.03%

72 300069 东方财富 1,000 0.03%

73 300069 东方财富 1,000 0.03%

74 300069 东方财富 1,000 0.03%

75 300069 东方财富 1,000 0.03%

76 300069 东方财富 1,000 0.03%

77 300069 东方财富 1,000 0.03%

78 300069 东方财富 1,000 0.03%

79 300069 东方财富 1,000 0.03%

80 300069 东方财富 1,000 0.03%

81 300069 东方财富 1,000 0.03%

82 300069 东方财富 1,000 0.03%

83 300069 东方财富 1,000 0.03%

84 300069 东方财富 1,000 0.03%

85 300069 东方财富 1,000 0.03%

86 300069 东方财富 1,000 0.03%

87 300069 东方财富 1,000 0.03%

88 300069 东方财富 1,000 0.03%

89 300069 东方财富 1,000 0.03%

90 300069 东方财富 1,000 0.03%

91 300069 东方财富 1,000 0.03%

92 300069 东方财富 1,000 0.03%

93 300069 东方财富 1,000 0.03%

94 300069 东方财富 1,000 0.03%

95 300069 东方财富 1,000 0.03%

96 300069 东方财富 1,000 0.03%

97 300069 东方财富 1,000 0.03%

98 300069 东方财富 1,000 0.03%

99 300069 东方财富 1,000 0.03%

100 300069 东方财富 1,000 0.03%

101 300069 东方财富 1,000 0.03%

102 300069 东方财富 1,000 0.03%

103 300069 东方财富 1,000 0.03%

104 300069 东方财富 1,000 0.03%

105 300069 东方财富 1,000 0.03%

106 300069 东方财富 1,000 0.03%

107 300069 东方财富 1,000 0.03%

108 300069 东方财富 1,000 0.03%

109 300069 东方财富 1,000 0.03%