

(上接B020版)

82	北京创世金嘉投资管理有限公司	北京创世金嘉投资管理有限公司 注册地址:北京市西城区民丰胡同31号5号楼15A 法定代表人:梁睿 客服电话:400-6262-818 网址:www.sirich.com
83	乾道盈泰基金销售有限公司(北京)有限公司	乾道盈泰基金销售有限公司(北京)有限公司 注册地址:北京市西城区德胜门内大街合生财富广场1302室 法定代表人:董云巍 客服电话:400-088-8080 网址:www.qiandaoj.com
84	交通银行股份有限公司	交通银行股份有限公司 注册地址:上海市浦东新区银城中路189号 法定代表人:牛锡明 客服电话:95559 网址:www.bankcomm.com
85	上海天天基金销售有限公司	上海天天基金销售有限公司 注册地址:上海市徐汇区宛平南路88号东方财富大厦 法定代表人:其实 客服电话:400-918-188 网址:www.1224667.com.cn
86	众升财富(北京)基金销售有限公司	众升财富(北京)基金销售有限公司 注册地址:北京市朝阳区望京花园四区13号楼A座9层909室 法定代表人:李昉勇 客服电话:400-659-8888 网址:www.zsfund.com
87	浙江同花顺基金销售有限公司	浙江同花顺基金销售有限公司 注册地址:浙江省杭州市文二西路元茂大厦903室 法定代表人:凌顺平 客服电话:400-772-7722 网址:www.5ifund.com
88	上海有鱼基金销售有限公司	上海有鱼基金销售有限公司 注册地址:上海市自贸试验区浦东南路2122号3层328-265室 法定代表人:林展 客服电话:400767268 网址:www.youyufund.com
89	深圳市前海排网基金销售有限公司	深圳市前海排网基金销售有限公司 注册地址:深圳市福田区福强路4001号深圳市世纪工艺品文化市场313栋3-403 法定代表人:李春瑜 客服电话:400-680-3828 网址:www.shimuwang.com
90	嘉鼎财富基金销售有限公司	嘉鼎财富基金销售有限公司 注册地址:西藏拉萨市柳梧新区柳梧大道1515室 法定代表人:陈皓 客服电话:0891-6177483 网址:www.xjqcfund.com
91	上海万得基金销售有限公司	上海万得基金销售有限公司 注册地址:上海市浦东新区浦明路1500号万得大厦1楼 法定代表人:王廷富 客服电话:400-921-0203 网址:www.w52fund.com.cn
92	北京富国大通基金销售有限公司	北京富国大通基金销售有限公司 注册地址:北京市朝阳区安颐路6号院3号楼中融国际中心26层 法定代表人:宋宝峰 客服电话:400-088-0088 网址:www.juguowealth.com
93	江苏汇林保大基金销售有限公司	江苏汇林保大基金销售有限公司 办公地址:江苏省南京市鼓楼区中山北路104号中银国际411室 法定代表人:吴卫林 联系人:黄静卿 传真:9,0256663409 客服电话:025-56634049 网址:www.huilinfund.com
94	上海凯石财富基金销售有限公司	上海凯石财富基金销售有限公司 办公地址:上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4楼 法定代表人:陈健武 联系人:陈嘉楠 客服电话:4006-433-389 网址:www.vestonwealth.com
95	东莞证券股份有限公司	东莞证券股份有限公司 注册地址:广东省东莞市莞城区可园南路一号金源中心 法定代表人:张波明 客服电话:(0769) 961130 网址:www.dgzq.com.cn
96	中信证券股份有限公司	中信证券股份有限公司 注册地址:广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座 法定代表人:王东明 客服电话:95548 网址:www.citics.com
97	北京晟视天下基金销售有限公司	北京晟视天下基金销售有限公司 注册地址:北京市怀柔区九渡河镇钱坨村750号3室 法定代表人:蒋鹏 客服电话:400-818-8866 网址:www.shengshiview.com
98	上海好买基金销售有限公司	上海好买基金销售有限公司 注册地址:上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼H室 法定代表人:杨文斌 客服电话:400-700-9665 网址:www.ehowbuy.com
99	联储证券有限责任公司	联储证券有限责任公司 注册地址:广东省深圳市福田区华强北路圣廷苑酒店B座26楼 法定代表人:沙勇明 客服电话:400-029-8868 网址:www.lczq.com
100	渤海证券股份有限公司	渤海证券股份有限公司 注册地址:天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室 法定代表人:王春峰 客服电话:400-651-5888 网址:www.bhsec.com
101	东海证券股份有限公司	东海证券股份有限公司 注册地址:上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼H室 法定代表人:赵俊 客服电话:95531;400-8888-588 网址:www.longone.com.cn
102	北京鹏鼎金融信息服务有限公司	北京鹏鼎金融信息服务有限公司 注册地址:北京市朝阳区呼家楼安联大厦17层 法定代表人:许良昆 客服电话:400-6677098 网址:www.lanpai.com
103	民商基金销售有限公司(上海)有限公司	民商基金销售有限公司(上海)有限公司 注册地址:上海市浦东新区张杨路707号生命人寿大厦32层 法定代表人:黄震宇 传真:9,0210206001 客服电话:021-52060003 网址:www.msfc.com
104	信达证券股份有限公司	信达证券股份有限公司 注册地址:北京市西城区闹市口大街9号院2号楼 法定代表人:张志刚 客服电话:95321 网址:www.cindasc.com
105	华安证券股份有限公司	华安证券股份有限公司 注册地址:合肥市政务文化新区天鹅湖路199号 法定代表人:李工 客服电话:95318 网址:www.haazq.com
106	中山证券有限责任公司	中山证券有限责任公司 注册地址:深圳市南山区科技一路一路华强高新大厦7楼7.3层 法定代表人:黄钦良 客服电话:95320 网址:www.zszq.com
107	联讯证券股份有限公司	联讯证券股份有限公司 注册地址:广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼 法定代表人:涂润 客服电话:95664 网址:www.lxsec.com
108	英大证券有限责任公司	英大证券有限责任公司 注册地址:深圳市福田区深南中路能大厦二十一层 法定代表人:梁英 客服电话:400-029-1988 网址:www.ydsc.com.cn
109	珠海盈米基金销售有限公司	珠海盈米基金销售有限公司 注册地址:珠海市横琴新区宝华路6号106室-3401 法定代表人:肖雯 客服电话:020-88620066 网址:www.yingmicn.com
110	上海汇付基金销售有限公司	上海汇付基金销售有限公司 注册地址:上海市中山南路100号金外滩国际广场19楼 法定代表人:张磊 客服电话:400-029-2819 网址:www.chinapay.com
111	福建海峡银行股份有限公司	福建海峡银行股份有限公司 注册地址:公司福州市台江区江滨中大道369号 法定代表人:俞敏 客服电话:400-883-9999 网址:www.fjbank.com

112	中国农业银行股份有限公司	中国农业银行股份有限公司 注册地址:北京市东城区建国门内大街69号 法定代表人:周慕冰 客服电话:95599 网址:www.abchina.com
113	深圳市新兰德证券投资咨询有限公司	深圳市新兰德证券投资咨询有限公司 注册地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1008F 法定代表人:杨锦 客服电话:400-166-1188 网址:http://fz.jrj.com.cn
114	上海量基金销售有限公司	上海量基金销售有限公司 注册地址:上海市浦东新区东方路1287号11层 法定代表人:张联伟 客服电话:400-520-2889 网址:www.erichfund.com
115	上海利得基金销售有限公司	上海利得基金销售有限公司 注册地址:上海市宝山区蕴川路5475号1033室 法定代表人:李兴春 客服电话:400-921-7755 网址:www.laobanbank.com.cn
116	北京汇成基金销售有限公司	北京汇成基金销售有限公司 注册地址:北京市海淀区中关村大街11号11层1108号 法定代表人:王莉娟 客服电话:400-619-3059 网址:www.hicfund.com
117	北京微动利基金销售有限公司	北京微动利基金销售有限公司 注册地址:北京市石景山区古城南路113号弘善财富中心341 法定代表人:梁洪军 客服电话:4008-196-665 网址:www.buyifund.com.cn
118	中衍期货有限公司	中衍期货有限公司 注册地址:北京市朝阳区东四环中路82号长安大厦1009层 法定代表人:王海波 客服电话:4000881117 网址:www.cdficn.com.cn

(二) 登记机构名称:前海开源基金管理有限公司  
注册地址:深圳前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)  
办公地址:深圳市福田区深南大道706号万科富春东方大厦22楼  
法定代表人:王兆华  
联系人:任福利  
电话:(0755) 83180910  
传真:(0755) 83181121  
(三) 律师事务所和经办律师  
名称:广东信达律师事务所  
注册地址:深圳市福田区益田路6001号太平金融大厦12楼  
负责人:麻云燕  
经办律师:杨畅、胡云云  
电话:(0755) 88265288  
传真:(0755) 88265537  
(四) 会计师事务所和经办注册会计师  
名称:瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)  
注册地址:北京市海淀区西四环中路16号院2号楼4层  
办公地址:北京市东城区永定门西滨河路8号院7号楼中海地产广场西塔5-11层  
法定代表人:杨剑涛  
联系人:郭红霞  
经办会计:张雷楠、郭红霞  
联系电话:(010) 88096588  
传真:(010) 88091199

四、基金名称  
前海开源沪港深智慧生活优选灵活配置混合型证券投资基金  
五、基金的类型  
混合型  
六、基金的运作方式  
开放式  
七、基金的投资  
(一) 投资目标  
本基金主要通过精选投资于智慧生活主题相关证券,挖掘“互联网+”全面渗透和居民消费结构升级过程中的投资机会,在合理控制风险并保持基金资产良好流动性的前提下,力争实现基金资产的长期稳定增值。

(二) 投资范围  
本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,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上市的股票)、沪港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券及其他中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。  
如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。  
基金的投资组合比例为:本基金股票投资占基金资产的比例为0-96%(其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的0-96%,投资于港股通标的股票的比例占基金资产的0-96%),投资于智慧生活主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的80%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。  
如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。  
(三) 投资策略  
本基金的投资策略主要有以下六方面内容:

1. 大类资产配置  
在大类资产配置中,本基金综合运用定性和定量的分析手段,在对宏观经济运行进行充分研究的基础上,判断宏观经济周期所处阶段,本基金将依据经济周期理论,结合对证券市场的系统性风险以及未来一段时期内各大类资产风险和预期收益率的评估,制定本基金在股票、债券、现金等大类资产间的配置比例。  
本基金通过对股票等权益类、债券等固定收益类和现金资产分布的实时监控,根据经济运行周期变动、市场利率变化、市场估值、证券市场整体等因素以及基金的风险评估进行灵活调整。在各类资产中,根据其参与市场基本要素的变化,调整各类资产在基金投资组合中的比例。  
2. 股票投资策略  
(1) 智慧生活主题的定义  
本基金所指的智慧生活,是指通过科学技术的应用或创新或者应用,或是新的商业模式的结构化或者应用,使得居民生活(包括衣、食、住、行等)更加便捷高效,或更加安全健康,或更加绿色环保。  
具体地,本基金将“智慧生活”主题聚焦于以下几方面的投资标的:一是衣,包括智能穿戴等,指对日常穿着进行智能化设计,开发可以穿戴的设备的公司;二是食,包括智能农业等,是集新兴的互联网、移动互联网、云计算和物联网技术为一体,为农业生产提供精准化种植、可视化管理、智能化决策的企业;三是住,包括智能家居等,是以住宅为平台,利用综合布线技术、网络通信技术、自动控制技术、音视频技术将家居生活有关的设施集成,构建高效的住宅设施与家庭日程事务管理的企业;四是行,包括智能交通等,指辅助实现交通的智能监管和调控的公司,它综合运用信息技术、电子控制、影像处理等多种技术,能快速准确地实现交通信息采集、处理、决策、指挥调度。  
智慧生活主题相关行业范畴会随着科技的进步不断变化,基金管理人将持续跟踪相关行业最新技术及商业模式的发展,对智慧生活主题相关行业的定义进行动态更新。

(2) 个股投资策略  
在个股选择上,除了筛选出与智慧生活主题相关的上市公司外,本基金还将根据上市公司所处行业特点,综合考虑公司质地和业绩弹性等因素,寻找基本面健康、业绩向上弹性较大、估值有优势的上市公司进行投资。在公司质地方面,选择治理结构优良、竞争优势较强、管理水平高、资产负债率健康的公司;在业绩弹性方面,重点考虑盈利能力相对较强、利用率、价格、成本弹性较大的公司;在估值方面,综合考虑市盈率、市销率、EV/EBITDA、重置价值、市盈率等估值指标,选择估值具有较好安全边际的公司。通过对备选公司以上方面的分析,本基金将优选出具有综合优势的股票构建投资组合,并根据行业趋势、估值水平等因素进行动态调整。

(3) 港股通标的股票投资策略  
本基金可通过沪港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场,不使用合格境内机构投资者(QDII)境外投资额度进行境外投资。本基金将遵循智慧生活主题相关股票的投资策略,优先将基本面健康、业绩向上弹性较大、具有估值优势的港股纳入本基金的投资组合。

3. 债券投资策略  
在债券投资策略方面,本基金将以智慧生活主题相关债券为主线,在综合研究的基础上实施积极主动的组合管理,采用宏观环境分析和微观市场定价两个方面进行债券投资决策。在宏观环境分析方面,结合对宏观经济、市场利率、债券供求等因素的综合分析,根据交易所市场与银行间市场类属资产的风险收益特征,定期对投资组合类属资产进行优化配置和调整,确定不同类属资产的优化比例。  
在微观市场定价分析方面,本基金以中长期利率趋势分析为基础,结合经济趋势、货币政策及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素,重点选择那些流动性较好、风险水平合理、到期收益率与信用质量相对较高的债券品种。具体投资策略有收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略等积极投资策略。

4. 权证投资策略  
在权证投资方面,本基金根据权证对应公司基本面研究成果确定权证的合理估值,发现市场对股票权证的非理性定价;利用权证衍生工具的特性,通过权证与证券的组合投资,来达到改善组合风险收益特征的目的。

目的。  
5. 资产支持证券投资策略  
本基金通过对资产支持证券发行条款的分析、违约概率和提前偿付比例的预估,借用必要的数量模型来谋求对资产支持证券的合理定价,在严格控制风险、充分考虑风险补偿收益和市场流动性的条件下,谨慎选择风险调整后收益较高的品种进行投资。  
本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资,以降低流动性风险。

6. 股指期货投资策略  
本基金以套期保值为目的,参与股指期货交易。  
本基金参与股指期货投资时机和数量的决策建立在在对证券市场总体行情的判断和组合风险收益分析的基础上。基金管理人将根据宏观经济因素、政策及法规因素和市场因素等,结合定性和定量方法,确定投资时机。基金管理人将结合股票投资的总体规模,以及中国证监会的相关限定和要求,确定参与股指期货交易的投资比例。  
基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征,运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等;利用金融衍生品进行杠杆作用,以达到降低投资组合的整体风险的目的。

基金管理人将在进行股指期货投资前将建立股指期货投资决策部门或小组,负责股指期货的投资管理的相关事项,同时针对股指期货投资管理制定投资决策流程和风险控制等制度,并经基金管理人董事会批准后方可执行。  
若相关法律法规发生变化时,基金管理人期货投资管理遵从其最新规定,以符合上述法律法规和监管要求的变化。  
(四) 投资决策依据及程序  
1. 决策依据  
基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征,运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等;利用金融衍生品进行杠杆作用,以达到降低投资组合的整体风险的目的。

基金管理人将在进行股指期货投资前将建立股指期货投资决策部门或小组,负责股指期货的投资管理的相关事项,同时针对股指期货投资管理制定投资决策流程和风险控制等制度,并经基金管理人董事会批准后方可执行。  
若相关法律法规发生变化时,基金管理人期货投资管理遵从其最新规定,以符合上述法律法规和监管要求的变化。  
(四) 投资决策依据及程序  
1. 决策依据  
基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征,运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等;利用金融衍生品进行杠杆作用,以达到降低投资组合的整体风险的目的。

基金管理人将在进行股指期货投资前将建立股指期货投资决策部门或小组,负责股指期货的投资管理的相关事项,同时针对股指期货投资管理制定投资决策流程和风险控制等制度,并经基金管理人董事会批准后方可执行。  
若相关法律法规发生变化时,基金管理人期货投资管理遵从其最新规定,以符合上述法律法规和监管要求的变化。  
(四) 投资决策依据及程序  
1. 决策依据  
基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征,运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等;利用金融衍生品进行杠杆作用,以达到降低投资组合的整体风险的目的。

基金管理人将在进行股指期货投资前将建立股指期货投资决策部门或小组,负责股指期货的投资管理的相关事项,同时针对股指期货投资管理制定投资决策流程和风险控制等制度,并经基金管理人董事会批准后方可执行。  
若相关法律法规发生变化时,基金管理人期货投资管理遵从其最新规定,以符合上述法律法规和监管要求的变化。  
(四) 投资决策依据及程序  
1. 决策依据  
基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征,运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等;利用金融衍生品进行杠杆作用,以达到降低投资组合的整体风险的目的。

(五) 业绩比较基准  
本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×70%+中证转债指数收益率×30%。  
业绩比较基准选择理由:  
沪深300指数是由中证指数公司编制发布、表征A股市场走势的权威指数。该指数是由上海和深圳证券交易所中选取300只A股作为样本编制而成的成份股指数。其样本覆盖了沪深市场六成左右的市场,具有良好的市场代表性。本基金选择该指数来衡量股票投资部分的绩效。  
中证全债指数是中证指数公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数。该指数的样本由银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券组成,中证指数公司每日计算并发布中证全债的收盘指数及相应的债券属性指标。该指数的一个重要特点在于对异常价格和无效价情况下使用了模型价,能更为真实地反映债券的实际价值和取收益特征。本基金选择该指数来衡量债券投资部分的绩效。

根据本基金的投资范围和比例约束,设定本基金的基准为沪深300指数收益率×70%+中证全债指数收益率×30%,该基准能客观衡量本基金的投资绩效。

如果上述基准指数停止计算编制或更改名称,或者今后法律法规发生变化,又或者市场推出更具权威、且更能够表征本基金风险收益特征的投资,则本基金管理人可与本基金托管人协商一致后,调整或变更本基金的业绩比较基准并及时公告。若变更基准指数对基金投资范围和投资策略无实质性影响(包括但不限于指数编制单位变更、指数更名等事项),则无需召开基金份额持有人大会,基金管理人应与基金托管人协商一致后,报中国证监会备案并及时公告。若变更基准指数涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更,则基金管理人应就变更基准指数召开基金份额持有人大会,并报中国证监会备案。

(六) 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。本基金如果投资港股通标的股票,需承担汇率风险以及境外市场的风险。  
(七) 投资限制  
1. 组合限制  
基金的投资组合应遵循以下限制:  
(1) 本基金股票投资占基金资产的比例为0-96%(其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的0-96%,投资于港股通标的股票的比例占基金资产的0-96%),投资于智慧生活主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的80%;  
(2) 本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等;  
(3) 本基金持有一家上市公司发行的证券,其市值(同一家公司在境内和香港同时上市的A+H股合并计算)不超过基金资产净值的10%;  
(4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家上市公司发行的证券,不超过该证券的10%;  
(5) 本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的3%;  
(6) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不得超过该权证的10%;  
(7) 本基金在任何交易日买入权证的总金额,不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%;  
(8) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例,不得超过该基金资产净值的10%;  
(9) 本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的20%;  
(10) 本基金持有的同一(同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的10%;  
(11) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%;  
(12) 本基金投资于信用评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券,应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出;  
(13) 基金财产参与股票发行申购,本基金所申报的金额不超过本基金的总资产,本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;  
(14) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%;债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不得展期;  
(15) 本基金投资流通受限证券,基金管理人应事先根据中国证监会相关规定,与基金托管人在本基金托管协议中明确基金投资流通受限证券的比例,根据比例进行投资。基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度,防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险;  
(16) 基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的15%;基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的30%;

(17) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。因证券波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外因素致使基金不符合该比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;  
(18) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的,可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致;  
(19) 本基金投资单只中期票据的余额不得超过其发行总规模的10%,并且不得超过基金资产净值的10%;  
(20) 本基金在任何交易日日终,持有的买入股指期货合约价值不得超过基金资产净值的10%;  
(21) 本基金在任何交易日日终,持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的95%;其中,有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、权证、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等;  
(22) 本基金在任何交易日日终,持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%;本基金管理人应当按照中国证监会要求的内容、格式与时向向交易所报告所交易和持有的卖出期货合约情况、交易目的及对应的证券资产情况等;  
(23) 本基金持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)应当符合基金合同关于股票投资比例的有关规定;  
(24) 本基金在任何交易日日内交易(不包括平仓)的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%;  
(25) 本基金资产净值不得超过基金净资产的140%;  
(26) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

基金管理人运用基金财产投资证券衍生品种的,应当根据风险管理的原则,并制定严格的授权管理制度和投资决策流程。基金管理人运用基金财产投资证券衍生品种的具体比例,应当符合中国证监会的有关规定。在投资证券衍生品种前,应与基金托管人协商一致,并履行适当程序。  
本基金在开始进行股指期货投资之前,应与基金托管人就股指期货清算、估值、交割等事宜另行具体协商。  
除上述第(2)、(12)、(17)、(18)项外,因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外因素致使基金资产净值不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在10个交易日内进行调整,但中国证监会规定的特殊情形除外。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关规定。在上述期间内,基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始执行。  
法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,基金管理人可在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制。

2. 禁止行为  
为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或活动:  
(1) 承销证券;  
(2) 违反规定向他人贷款或提供担保;  
(3) 从事承担无限责任的投资;  
(4) 买卖其他基金份额,但是国务院证券监督管理机构另有规定的除外;  
(5) 向其基金管理人、基金托管人出资;  
(6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;  
(7) 法律、行政法规及国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定,基金管理人可在履行适当程序后不受上述规定的限制。  
基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券,或者从事其他重大关联交易时,应当符合基金的投资目标和投资策略,遵循基金份额持有人利益优先原则,防范利益冲突,建立健全内部审批机制和评估机制,按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意,并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议,并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

(八) 基金管理人代表基金行使股东权利及债权人权利的处理原则及方法  
1. 不谋求对上市公司的控股,不参与所投资上市公司的经营管理;  
2. 有利于基金资产的安全与增值;  
3. 基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利,保护基金份额持有人的利益;  
4. 基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利,保护基金份额持有人的利益。  
(九) 基金的投资组合报告  
基金管理人将定期或不定期对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,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。

基金托管人根据基金合同规定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。  
本投资组合报告所载数据截至2018年12月31日(未经审计)。

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	61,458,140.02	73.21
-	其中:股票	61,458,140.02	73.21
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
-	其中:债券	-	-
-	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	14,100,000.00	16.80
7	银行存款和结算备付金合计	8,184,323.76	9.76
8	其他资产	39,620.18	0.24
9	合计	89,946,083.96	100.00

注:权益投资中通过港股通交易机制投资的港股公允价值为12,688,655.26元,占资产净值比例15.24%。

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合  
2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	6,096,000.00	7.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,881,780.00	2.26
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	22,813,636.00	27.40
J	金融业	7,933,464.00	9.53
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	4,229,115.00	5.14
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	5,765,489.76	6.93
S	综合	-	-
合计		48,769,484.76	58.58

2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例(%)
金融	6,263,306.28	7.52
医疗保健	6,424,718.98	7.72
合计	12,688,025.26	15.24

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。  
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	002174	游族网络	383,100	7,307,720.00	8.78
2	603444	吉比特	43,700	6,467,600.00	7.77
3	00670	中国中药	1,606,000	6,424,718.98	7.72
4	600030	中信证券	194,400	3,112,344.00	3.74
5	06030	中信证券	263,000	3,110,948.10	3.74
6	600977	中国国电	402,618	5,765,489.76	6.93
7	002555	三七互娱	586,300	5,534,672.00	6.65
8	601688	华泰证券	287,600	4,821,120.00	5.79
9	002212	南洋股份	400,000	4,448,000.00	5.34
10	300012	华测检测	653,300	4,229,115.00	5.14
10	00886	HTSC	200,200	3,152,988.18	3.79

注:所用证券代码采用当地市场代码。  
4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合  
本基金本报告期末未持有债券。  
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

本基金本报告期末未持有债券。  
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。  
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。  
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。  
9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明  
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。  
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。  
10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明  
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。  
10.2 本基金本报告期末未投资国债期货。  
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。  
11. 投资组合报告附注  
11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有发生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。  
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。  
11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	140,583.89
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	33,120.38
4	应收股利	29,531.82
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	232,632.18

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。  
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	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600030	中信证券	3,112,344.00	3.74	重大事项停牌

11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分  
由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。

八、基金的业绩  
基金管理人依照恪尽职守、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,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

前海开源沪港深智慧生活混合

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
2016.1.26-2016.12.31	21.49%	0.86%	9.50%	0.78%	2.40%	0.08%
2017.1.1-20						