

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

2019年第二季度报告

基金净值表现

基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×70%+中证全债指数收益率×30%

注：本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×70%+中证全债指数收益率×30%

4.6 报告期内基金业绩表现

4.6.1 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

4.6.2 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

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) 占基金资产的比例(%)

1 权益投资 41,230,437.00 79.07

其中：股票 41,230,437.00 79.07

2 固定收益投资 2,367,930.00 5.01

其中：债券 -

货币市场基金 -

3 衍生品及期权投资 -

其中：权证 -

4 贵金属投资 -

5 金融衍生品投资 -

6 其他资产 26,000.00 0.05

其中：应收券商款项 -

7 银行存款和结算备付金合计 6,969,538.00 13.46

8 其他资产 1,023,370.00 1.97

9 合计 61,330,767.00 100.00

注：权益投资通过港股通交易机制投资的港股公允价值为13,064,446.40元，占资产净值比例为20.56%。

5.2 报告期内按行业分类的股票投资组合

序号 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 农林、牧业、渔业 -

2 制造业 2,312,693.00 4.51

3 制造业 19,046,422.00 37.17

4 电力、热力、燃气及水生产和供应业 -

5 建筑业 -

6 批发和零售业 2,064,819.00 4.01

7 交通运输、仓储和邮政业 -

8 住宿和餐饮业 -

9 信息传输、软件和信息技术服务业 -

10 其他 -

11 合计 20,174,991.46 64.08

注：以上所列行业分类采用证监会行业分类标准（GICS）。

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

5.3.1 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

5.3.2 中国平安保险(集团)股份有限公司

5.3.3 中国光大银行股份有限公司

5.3.4 中国银行股份有限公司

5.3.5 中国工商银行股份有限公司

5.3.6 中国建设银行股份有限公司

5.3.7 中国农业银行股份有限公司

5.3.8 中国民生银行股份有限公司

5.3.9 中国人寿保险(集团)公司

5.3.10 中国太平洋保险(集团)股份有限公司

5.3.11 中国中信有限公司

5.3.12 中国平安人寿保险股份有限公司

5.3.13 中国光大银行股份有限公司

5.3.14 中国建设银行股份有限公司

5.3.15 中国农业银行股份有限公司

5.3.16 中国民生银行股份有限公司

5.3.17 中国人寿保险(集团)公司

5.3.18 中国太平洋保险(集团)股份有限公司

5.3.19 中国中信有限公司

5.3.20 中国平安人寿保险股份有限公司

5.3.21 中国光大银行股份有限公司

5.3.22 中国建设银行股份有限公司

5.3.23 中国农业银行股份有限公司

5.3.24 中国民生银行股份有限公司

5.3.25 中国人寿保险(集团)公司

5.3.26 中国太平洋保险(集团)股份有限公司

5.3.27 中国中信有限公司

5.3.28 中国平安人寿保险股份有限公司

5.3.29 中国光大银行股份有限公司

5.3.30 中国建设银行股份有限公司

5.3.31 中国农业银行股份有限公司

5.3.32 中国民生银行股份有限公司

5.3.33 中国人寿保险(集团)公司

5.3.34 中国太平洋保险(集团)股份有限公司

5.3.35 中国中信有限公司

5.3.36 中国平安人寿保险股份有限公司

5.3.37 中国光大银行股份有限公司

5.3.38 中国建设银行股份有限公司

5.3.39 中国农业银行股份有限公司

5.3.40 中国民生银行股份有限公司

5.3.41 中国人寿保险(集团)公司

5.3.42 中国太平洋保险(集团)股份有限公司

5.3.43 中国中信有限公司

5.3.44 中国平安人寿保险股份有限公司

5.3.45 中国光大银行股份有限公司

5.3.46 中国建设银行股份有限公司

5.3.47 中国农业银行股份有限公司

5.3.48 中国民生银行股份有限公司

5.3.49 中国人寿保险(集团)公司

5.3.50 中国太平洋保险(集团)股份有限公司

5.3.51 中国中信有限公司

5.3.52 中国平安人寿保险股份有限公司

5.3.53 中国光大银行股份有限公司

5.3.54 中国建设银行股份有限公司

5.3.55 中国农业银行股份有限公司

5.3.56 中国民生银行股份有限公司

5.3.57 中国人寿保险(集团)公司

5.3.58 中国太平洋保险(集团)股份有限公司

5.3.59 中国中信有限公司

5.3.60 中国平安人寿保险股份有限公司

5.3.61 中国光大银行股份有限公司

5.3.62 中国建设银行股份有限公司

5.3.63 中国农业银行股份有限公司

5.3.64 中国民生银行股份有限公司

5.3.65 中国人寿保险(集团)公司

5.3.66 中国太平洋保险(集团)股份有限公司

5.3.67 中国中信有限公司

5.3.68 中国平安人寿保险股份有限公司

5.3.69 中国光大银行股份有限公司

5.3.70 中国建设银行股份有限公司

5.3.71 中国农业银行股份有限公司

5.3.72 中国民生银行股份有限公司

5.3.73 中国人寿保险(集团)公司

5.3.74 中国太平洋保险(集团)股份有限公司

5.3.75 中国中信有限公司

5.3.76 中国平安人寿保险股份有限公司

5.3.77 中国光大银行股份有限公司

5.3.78 中国建设银行股份有限公司

5.3.79 中国农业银行股份有限公司

5.3.80 中国民生银行股份有限公司

5.3.81 中国人寿保险(集团)公司

5.3.82 中国太平洋保险(集团)股份有限公司

5.3.83 中国中信有限公司

5.3.84 中国平安人寿保险股份有限公司

5.3.85 中国光大银行股份有限公司

5.3.86 中国建设银行股份有限公司

5.3.87 中国农业银行股份有限公司

5.3.88 中国民生银行股份有限公司

5.3.89 中国人寿保险(集团)公司

5.3.90 中国太平洋保险(集团)股份有限公司

5.3.91 中国中信有限公司

5.3.92 中国平安人寿保险股份有限公司

5.3.93 中国光大银行股份有限公司

5.3.94 中国建设银行股份有限公司

5.3.95 中国农业银行股份有限公司

5.3.96 中国民生银行股份有限公司

5.3.97 中国人寿保险(集团)公司

5.3.98 中国太平洋保险(集团)股份有限公司

5.3.99 中国中信有限公司

5.3.100 中国平安人寿保险股份有限公司

5.3.101 中国光大银行股份有限公司

5.3.102 中国建设银行股份有限公司

5.3.103 中国农业银行股份有限公司

5.3.104 中国民生银行股份有限公司

5.3.105 中国人寿保险(集团)公司

5.3.106 中国太平洋保险(集团)股份有限公司

5.3.107 中国中信有限公司

5.3.108 中国平安人寿保险股份有限公司

5.3.109 中国光大银行股份有限公司

5.3.110 中国建设银行股份有限公司

5.3.111 中国农业银行股份有限公司

5.3.112 中国民生银行股份有限公司

5.3.113 中国人寿保险(集团)公司

5.3.114 中国太平洋保险(集团)股份有限公司

5.3.115 中国中信有限公司

5.3.116 中国平安人寿保险股份有限公司

5.3.117 中国光大银行股份有限公司

5.3.118 中国建设银行股份有限公司

5.3.119 中国农业银行股份有限公司

5.3.120 中国民生银行股份有限公司

5.3.121 中国人寿保险(集团)公司

5.3.122 中国太平洋保险(集团)股份有限公司

5.3.123 中国中信有限公司

5.3.124 中国平安人寿保险股份有限公司

5.3.125 中国光大银行股份有限公司

5.3.126 中国建设银行股份有限公司

5.3.127 中国农业银行股份有限公司

5.3.128 中国民生银行股份有限公司

5.3.129 中国人寿保险(集团)公司

5.3.130 中国太平洋保险(集团)股份有限公司

5.3.131 中国中信有限公司

5.3.132 中国平安人寿保险股份有限公司

5.3.133 中国光大银行股份有限公司

5.3.134 中国建设银行股份有限公司