

前海开源沪港深优势精选灵活配置混合型证券投资基金

[2016]第四季度报告

2016年12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:中银基金管理有限公司
报告送出日期:2017年1月20日

§ 1 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。
基金托管人中银基金管理有限公司根据本基金合同规定，于2017年1月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现、账户净值等数据，确认报告的内容真实准确完整。
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。
基金投资于境外证券市场，除承担与境内证券投资基金相同的市场风险外，该类基金还将面临汇率风险、政治风险、地区风险和流动性风险。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。

本报告期财务数据未经审计。

本报告期自2016年10月1日起至2016年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称:前海开源沪港深优势精选混合

交易代码:000875

契约型开放式

基金合同生效日:2016年4月19日

报告期末基金份额总额:77,322,122.00份

投资目标:本基金主要投资于中国大陆A股市场和香港股票型基金或港股机构允许投资的特定范围内的港股通股票，通过港股通机制，寻找行业景气度较高、竞争优势明显、估值合理、业绩稳定的港股标的，力争获得超越基准的收益。

本基金在报告期内，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元的情形。

§ 3 投资组合报告

3.1 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 55,709,060.91 60.15

其中:股票 55,709,060.91 60.15

2 基金投资 - -

3 固定收益投资 - -

其中:债券 - -

4 货币市场工具 - -

5 金融衍生品投资 - -

6 其他金融类投资 - -

其中:买入返售的银行存款类金融资产 - -

7 银行存款和结算备付金合计 36,079,613.98 38.62

8 其他资产 865,736.36 0.93

9 合计 92,703,516.96 100.00

注:本基金在报告期内通过港股通机制投资的港股公允价值为90,923,541.91元,占资产净值比例80.24%。

5.2 报告期内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

序号 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 4,835,526.00 5.63

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 - -

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 信息传输、软件和信息技术服务业 - -

J 其他服务业 - -

K 金融业 - -

L 科学研究、技术服务与地质勘查业 - -

M 水利、环境和公共设施管理业 - -

N 居民服务、修理和其他服务业 - -

O 国际组织、机构间组织、非政府间国际组织、非营利组织和社会团体 - -

P 教育 - -

Q 文化、体育和娱乐业 - -

R 社会工作 - -

S 综合 - -

9 合计 4,835,526.00 5.63

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

序号 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

工业 11,000,522.97 12.68

非日常生活消费品 7,236,044.50 8.05

医疗保健 9,272,966.81 1,061

信息技术 22,914,018.62 26.21

合计 50,923,541.91 58.24

注:以上分类采用全球行业分类标准(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

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 07000 腾讯控股 40,400 8,362,614.22 9.69

2 3888 银泰百货 646,000 7,761,376.41 8.87

3 2238 广州酒家 922,000 7,736,044.50 8.85

4 2367 中科曙光 1,146,000 7,394,306.90 8.46

5 000638 云图白药 63,500 4,836,526.00 5.63

6 0670 中信证券 1,432,000 4,598,569.97 5.28

7 2018 瑞凌科技 70,000 4,411,276.07 5.06

8 0392 北京君正 110,000 3,606,217.09 4.12

9 2382 联明光学科技 70,000 2,368,761.93 2.71

10 石油石脑油 270,000 2,059,018.00 2.36

注:本基金的股票投资比例为:25%+恒生指数收益(使用估值汇率计算)+35%+中企全债指数收益*30%。

5.4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名 职务 在本基金的基金任期期间 证券从业年限 离任日期 说明

曲向东 本基金的基金经理、公司股票投资总监 16年: 2016年4月20日 -

本基金的基金经理、公司股票投资总监 2016年10月10日 -

本基金的基金经理、公司股票投资总监 2016年12月31日 -

注:本基金的基金经理包括其“任职日期”、“离任日期”和“辞职日期”三种情形下任一情形的日期。

2)本基金的基金经理在任职期间内未发生过变更基金经理的情况。

3)本基金的基金经理在任职期间内未发生过变更基金经理的情况。

4)本基金的基金经理在任职期间内未发生过变更基金经理的情况。

5)本基金的基金经理在任职期间内未发生过变更基金经理的情况。

6)本基金的基金经理在任职期间内未发生过变更基金经理的情况。

7)本基金的基金经理在任职期间内未发生过变更基金经理的情况。

8)本基金的基金经理在任职期间内未发生过变更基金经理的情况。

9)本基金的基金经理在任职期间内未发生过变更基金经理的情况。

10)本基金的基金经理在任职期间内未发生过变更基金经理的情况。

11)本基金的基金经理在任职期间内未发生过变更基金经理的情况。

12)本基金的基金经理在任职期间内未发生过变更基金经理的情况。

13)本基金的基金经理在任职期间内未发生过变更基金经理的情况。

14)本基金的基金经理在任职期间内未发生过变更基金经理的情况。

15)本基金的基金经理在任职期间内未发生过变更基金经理的情况。

16)本基金的基金经理在任职期间内未发生过变更基金经理的情况。

17)本基金的基金经理在任职期间内未发生过变更基金经理的情况。

18)本基金的基金经理在任职期间内未发生过变更基金经理的情况。

19)本基金的基金经理在任职期间内未发生过变更基金经理的情况。

20)本基金的基金经理在任职期间内未发生过变更基金经理的情况。

21)本基金的基金经理在任职期间内未发生过变更基金经理的情况。

22)本基金的基金经理在任职期间内未发生过变更基金经理的情况。

23)本基金的基金经理在任职期间内未发生过变更基金经理的情况。

24)本基金的基金经理在任职期间内未发生过变更基金经理的情况。

25)本基金的基金经理在任职期间内未发生过变更基金经理的情况。

26)本基金的基金经理在任职期间内未发生过变更基金经理的情况。

27)本基金的基金经理在任职期间内未发生过变更基金经理的情况。

28)本基金的基金经理在任职期间内未发生过变更基金经理的情况。

29)本基金的基金经理在任职期间内未发生过变更基金经理的情况。

30)本基金的基金经理在任职期间内未发生过变更基金经理的情况。

31)本基金的基金经理在任职期间内未发生过变更基金经理的情况。

32)本基金的基金经理在任职期间内未发生过变更基金经理的情况。

33)本基金的基金经理在任职期间内未发生过变更基金经理的情况。

34)本基金的基金经理在任职期间内未发生过变更基金经理的情况。

35)本基金的基金经理在任职期间内未发生过变更基金经理的情况。

36)本基金的基金经理在任职期间内未发生过变更基金经理的情况。

37)本基金的基金经理在任职期间内未发生过变更基金经理的情况。

38)本基金的基金经理在任职期间内未发生过变更基金经理的情况。

39)本基金的基金经理在任职期间内未发生过变更基金经理的情况。

40)本基金的基金经理在任职期间内未发生过变更基金经理的情况。

41)本基金的基金经理在任职期间内未发生过变更基金经理的情况。

42)本基金的基金经理在任职期间内未发生过变更基金经理的情况。

43)本基金的基金经理在任职期间内未发生过变更基金经理的情况。

44)本基金的基金经理在任职期间内未发生过变更基金经理的情况。

45)本基金的基金经理在任职期间内未发生过变更基金经理的情况。

46)本基金的基金经理在任职期间内未发生过变更基金经理的情况。

47)本基金的基金经理在任职期间内未发生过变更基金经理的情况。

48)本基金的基金经理在任职期间内未发生过变更基金经理的情况。

49)本基金的基金经理在任职期间内未发生过变更基金经理的情况。

50)本基金的基金经理在任职期间内未发生过变更基金经理的情况。

51)本基金的基金经理在任职期间内未发生过变更基金经理的情况。

52)本基金的基金经理在任职期间内未发生过变更基金经理的情况。

53)本基金的基金经理在任职期间内未发生过变更基金经理的情况。

54)本基金的基金经理在任职期间内未发生过变更基金经理的情况。

55)本基金的基金经理在任职期间内未发生过变更基金经理的情况。

56)本基金的基金经理在任职期间内未发生过变更基金经理的情况。

57)本基金的基金经理在任职期间内未发生过变更基金经理的情况。

58)本基金的基金经理在任职期间内未发生过变更基金经理的情况。

59)本基金的基金经理在任职期间内未发生过变更基金经理的情况。

60)本基金的基金经理在任职期间内未发生过变更基金经理的情况。

61)本基金的基金经理在任职期间内未发生过变更基金经理的情况。

62)本基金的基金经理在任职期间内未发生过变更基金经理的情况。

63)本基金的基金经理在任职期间内未发生过变更基金经理的情况。

64)本基金的基金经理在任职期间内未发生过变更基金经理的情况。

65)本基金的基金经理在任职期间内未发生过变更基金经理的情况。

66)本基金的基金经理在任职