

基金管理人:恒生前海基金管理有限公司  
基金托管人:中国农业银行股份有限公司  
报告送出日期:2017年10月25日

## 1 重要提示

基金管理人的董事会及监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责任个别及连带责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据基金合同规定,于2017年10月23日复核了本报表中的财务指标、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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。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。

本报告书内容未经审计。

本报告期自2017年7月1日起至9月30日止。

## 5 基金产品概况

基金简称:恒生前海沪港深新兴产业精选混合型证券投资基金

交易代码:000332

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2017年4月1日

报告期末基金份额总额:277,303,762.99份

投资目标:力争在报告期内的财务指标、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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。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。

本报告书内容未经审计。

本报告期自2017年7月1日起至9月30日止。

## 5.1 基金产品概况

基金简称:恒生前海沪港深新兴产业精选混合型证券投资基金

交易代码:000332

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2017年4月1日

报告期末基金份额总额:277,303,762.99份

投资目标:力争在报告期内的财务指标、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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。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。

本报告书内容未经审计。

本报告期自2017年7月1日起至9月30日止。

## 5.2 基金产品概况

基金简称:恒生前海沪港深新兴产业精选混合型证券投资基金

交易代码:000332

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2017年4月1日

报告期末基金份额总额:277,303,762.99份

投资目标:力争在报告期内的财务指标、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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。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。

本报告书内容未经审计。

本报告期自2017年7月1日起至9月30日止。

## 5.3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2017年7月1日 - 2017年9月30日)

1.本期已实现收益 3,360,176.78

2.本期利润 -1,902,563.17

3.期末可供分配利润 201,366,410.29

4.期末基金净值 1.0146

注:1)上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

2)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

恒生前海沪港深新兴产业精选混合型基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益变化的比较

3.2 基金净值表现

3.2.1 本基金份额净值增长率与其同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%)

过去三个月 -0.06% 0.08% 4.73% 0.05% -0.60% 0.04%

注:本基金的业绩比较基准为:中证新兴产业指数收益率×50%+恒生指数收益率×50%×(1+汇率×0.0001)

4.基金的过往业绩

4.1 基金经理(基金经理小组)简介

姓名 职务 在本基金的任职日期 离任日期 证券从业年限 说明

林晓峰 基金经理 2017年4月1日 - 14 14 14

注:①本基金的基金经理的任职日期为基金合同生效之日;

②本基金的基金经理的从业年限是指基金经理从事证券行业的工作年限。

4.2 公平交易专题说明

4.2.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格执行证监会《证券投资基金监督管理办法》公平交易制度指

导意见和公司内部公平交易制度,各投资组合按照投资管理制度和流程独立决策,并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。同时通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平性,确保公平交易原则的实现。基金管理人公平对待旗下所有投资组合的所投资组合,报告期内内公平交易制度得到良好的贯彻执行,未发现存在不公平交易行为。

4.2.2 非公平交易行为的专项说明

报告期内,本基金未发现有影响公平交易的异常交易行为,不存在所有投资组合参与的交

易所公开竞价同日反向交易或较少的单边成交量超过该证券当日成交量的5%的情况。

4.3 报告期内按行业分类的股票投资组合

序号 项目 金额(元) 占基金资产的比例(%)

1 固定收益投资 220,481,087.61 76.40

2 其他资产 220,740,097.61 76.40

3 货币市场基金 3,200,000.00 1.14

4 投资组合报告 34,430,630.00 12.04

5 合计 101,210,090.00 35.98

注:①本基金的基金合同于2017年4月1日生效,截至2017年9月30日止,本基金成立未满1年。

②根据本基金的规定,本基金自基金合同生效之日起六个月内为建仓期,建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同中的相关约定。

③基金管理人报告。

④基金托管人报告。

⑤本基金的基金合同于2017年4月1日生效,截至2017年9月30日止,本基金成立未满1年。

⑥本基金的基金合同于2017年4月1日生效,截至2017年9月30日止,本基金成立未满1年。

⑦本基金的基金合同于2017年4月1日生效,截至2017年9月30日止,本基金成立未满1年。

⑧本基金的基金合同于2017年4月1日生效,截至2017年9月30日止,本基金成立未满1年。

⑨本基金的基金合同于2017年4月1日生效,截至2017年9月30日止,本基金成立未满1年。

⑩本基金的基金合同于2017年4月1日生效,截至2017年9月30日止,本基金成立未满1年。

⑪本基金的基金合同于2017年4月1日生效,截至2017年9月30日止,本基金成立未满1年。

⑫本基金的基金合同于2017年4月1日生效,截至2017年9月30日止,本基金成立未满1年。

⑬本基金的基金合同于2017年4月1日生效,截至2017年9月30日止,本基金成立未满1年。

⑭本基金的基金合同于2017年4月1日生效,截至2017年9月30日止,本基金成立未满1年。

⑮本基金的基金合同于2017年4月1日生效,截至2017年9月30日止,本基金成立未满1年。

⑯本基金的基金合同于2017年4月1日生效,截至2017年9月30日止,本基金成立未满1年。

⑰本基金的基金合同于2017年4月1日生效,截至2017年9月30日止,本基金成立未满1年。

⑱本基金的基金合同于2017年4月1日生效,截至2017年9月30日止,本基金成立未满1年。

⑲本基金的基金合同于2017年4月1日生效,截至2017年9月30日止,本基金成立未满1年。

⑳本基金的基金合同于2017年4月1日生效,截至2017年9月30日止,本基金成立未满1年。

㉑本基金的基金合同于2017年4月1日生效,截至2017年9月30日止,本基金成立未满1年。

㉒本基金的基金合同于2017年4月1日生效,截至2017年9月30日止,本基金成立未满1年。

㉓本基金的基金合同于2017年4月1日生效,截至2017年9月30日止,本基金成立未满1年。

㉔本基金的基金合同于2017年4月1日生效,截至2017年9月30日止,本基金成立未满1年。

㉕本基金的基金合同于2017年4月1日生效,截至2017年9月30日止,本基金成立未满1年。

㉖本基金的基金合同于2017年4月1日生效,截至2017年9月30日止,本基金成立未满1年。

㉗本基金的基金合同于2017年4月1日生效,截至2017年9月30日止,本基金成立未满1年。

㉘本基金的基金合同于2017年4月1日生效,截至2017年9月30日止,本基金成立未满1年。

㉙本基金的基金合同于2017年4月1日生效,截至2017年9月30日止,本基金成立未满1年。

㉚本基金的基金合同于2017年4月1日生效,截至2017年9月30日止,本基金成立未满1年。

㉛本基金的基金合同于2017年4月1日生效,截至2017年9月30日止,本基金成立未满1年。

㉜本基金的基金合同于2017年4月1日生效,截至2017年9月30日止,本基金成立未满1年。

㉝本基金的基金合同于2017年4月1日生效,截至2017年9月30日止,本基金成立未满1年。

㉞本基金的基金合同于2017年4月1日生效,截至2017年9月30日止,本基金成立未满1年。

㉟本基金的基金合同于2017年4月1日生效,截至2017年9月30日止,本基金成立未满1年。

㉟本基金的基金合同于2017年4月1日生效,截至2017年9月30日止,本基金成立未满1年。