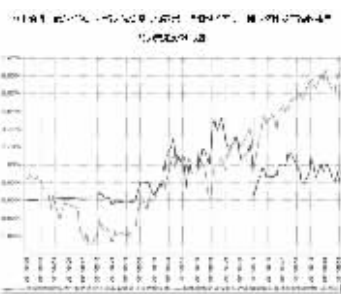


# B188信息披露

## 恒生前海沪港深新兴产业精选混合型证券投资基金

### 2017年第三季度报告



注：1.本基金基金合同于2017年4月1日生效，截至2017年9月30日止，本基金成立未超过1年。

2.截至本报告期末，本基金自基金合同生效起共6个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产与负债比例符合基金合同中的相关规定。

#### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理时间	证券从业年限	说明
林朝晖	基金经理	2017年4月1日	-	14
张勇	基金经理	2017年4月1日	-	9

注：1.上述基金经理的任职日期为基金合同生效之日；2.截至本报告期末，本基金自基金合同生效起共6个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产与负债比例符合基金合同中的相关规定。

3.管理人在报告期内本基金运作遵守信情况的说明：在本报告期内，本基金管理人严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《恒生前海沪港深新兴产业精选混合型证券投资基金合同》和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人的利益。

4.2 公平交易专项说明  
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《证券投资基金管理公司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、投资建议和决策程序等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执行，确保公平交易原则的实现。基金管理人公平对待所管理的所有投资组合，报告期内公平交易制度得到良好的贯彻执行，未发现存在违反公平交易原则的情况。

4.2.2 异常交易行为的专项说明  
本公司原则上禁止同一投资组合在同一交易日内进行反向交易（完全按照有关的投资组合比例进行投资的投资组合除外），不同投资组合之间的同日反向交易。如不同的投资组合构成实质性需求或投资策略的原因需要进行当日反向交易，则须经公司领导严格审批并留痕备查。

本报告期内，本基金未发生除正常的资产交易情况，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成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况。

#### 5.1 投资组合报告

5.1.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	固定收益投资	226,740,387.61	76.40
2	权益投资	226,740,387.61	76.40
3	其中：股票	226,740,387.61	76.40
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	其他金融资产	10,000,000.00	3.40
7	其中：买入返售金融资产	-	-
8	其他金融资产	10,000,000.00	3.40
9	资产支持证券	-	-
10	其他资产	44,506,764.39	15.39
11	负债	7,949,700.00	2.76
12	合计	209,206,344.00	100.00

注：权益投资中通过港股通机制投资的港股公允价值为101,219,069.00元，占基金总资产比例5.03%。

5.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	81,031,312.31	32.36
D	电力、热力、燃气及生产供应	-	-
E	建筑业	-	-
F	金融业	10,240,260.39	4.16
G	房地产业	-	-
H	信息技术业	-	-
I	批发和零售业	-	-
J	交通运输、仓储和邮政业	-	-
K	住宿和餐饮业	-	-
L	健康和社会服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,266,210.00	0.90
O	建筑业	-	-
P	教育、文化和体育业	-	-
Q	其他	-	-
合计		128,529,788.61	54.02

5.1.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	固定收益投资	17,419,167,276.99	64.79
2	权益投资	17,419,167,276.99	64.79
3	其中：股票	17,419,167,276.99	64.79
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	其他金融资产	10,000,000.00	3.40
7	其中：买入返售金融资产	-	-
8	其他金融资产	10,000,000.00	3.40
9	资产支持证券	-	-
10	其他资产	44,506,764.39	15.39
11	负债	7,949,700.00	2.76
12	合计	209,206,344.00	100.00

5.1.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	固定收益投资	17,419,167,276.99	64.79
2	权益投资	17,419,167,276.99	64.79
3	其中：股票	17,419,167,276.99	64.79
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	其他金融资产	10,000,000.00	3.40
7	其中：买入返售金融资产	-	-
8	其他金融资产	10,000,000.00	3.40
9	资产支持证券	-	-
10	其他资产	44,506,764.39	15.39
11	负债	7,949,700.00	2.76
12	合计	209,206,344.00	100.00

5.1.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111721104	17国债附息02104	10,000,000	986,777,688.00	4.10
2	111770115	17国债附息02115	7,000,000	684,864,740.00	2.84
3	111770217	17国债附息02117	6,000,000	587,081,210.00	2.44
4	111770621	17国债附息02121	5,000,000	496,438,263.00	2.06
5	111770473	17国债附息02112	5,000,000	486,630,572.00	2.06
6	111770104	17国债附息02104	5,000,000	483,092,084.01	2.05
7	111771221	17国债附息02121	5,000,000	480,266,720.00	2.05
8	111770306	17国债附息02106	5,000,000	480,317,436.46	2.05
9	111770478	17国债附息02112	5,000,000	480,901,463.76	2.03
10	111770116	17国债附息02116	5,000,000	480,364,028.26	2.03

5.1.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值偏离度

项目	偏离度
报告期内偏离度绝对值前20名证券	0.0000%
报告期内偏离度绝对值前10名证券	-0.0100%
报告期内偏离度绝对值前5名证券	0.0200%
报告期内每个工作日偏离度绝对值的最高值	0.0200%
报告期内每个工作日偏离度绝对值的最低值	-0.0200%
报告期内每个工作日偏离度绝对值的平均值	0.0000%

5.1.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

序号	资产支持证券代码	资产支持证券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111770214	17资产支持证券02104	7,500,000	3.42
2	111770316	17资产支持证券02116	2,000,000	0.92
3	111770621	17资产支持证券02121	2,000,000	0.92
4	160301	招商证券16级资产支持证券01	2,000,000	0.92
5	111770605	17资产支持证券02115	2,000,000	0.92
6	1770118	17资产支持证券02118	2,000,000	0.92
7	1770119	17资产支持证券02119	2,000,000	0.92
8	1770120	17资产支持证券02120	2,000,000	0.92
9	1770121	17资产支持证券02121	2,000,000	0.92
10	1770122	17资产支持证券02122	2,000,000	0.92

5.1.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资明细

序号	贵金属代码	贵金属名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	99999	黄金	2,000,000	0.92
2	99999	白银	2,000,000	0.92
3	99999	铂金	2,000,000	0.92
4	99999	钯金	2,000,000	0.92
5	99999	铑金	2,000,000	0.92
6	99999	钌金	2,000,000	0.92
7	99999	铱金	2,000,000	0.92
8	99999	锇金	2,000,000	0.92
9	99999	钴金	2,000,000	0.92
10	99999	镍金	2,000,000	0.92

5.1.9 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权证投资明细

序号	权证代码	权证名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	99999	权证	2,000,000	0.92
2	99999	权证	2,000,000	0.92
3	99999	权证	2,000,000	0.92
4	99999	权证	2,000,000	0.92
5	99999	权证	2,000,000	0.92
6	99999	权证	2,000,000	0.92
7	99999	权证	2,000,000	0.92
8	99999	权证	2,000,000	0.92
9	99999	权证	2,000,000	0.92
10	99999	权证	2,000,000	0.92

5.1.10 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指期货投资明细

序号	股指期货代码	股指期货名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	99999	股指期货	2,000,000	0.92
2	99999	股指期货	2,000,000	0.92
3	99999	股指期货	2,000,000	0.92
4	99999	股指期货	2,000,000	0.92
5	99999	股指期货	2,000,000	0.92
6	99999	股指期货	2,000,000	0.92
7	99999	股指期货	2,000,000	0.92
8	99999	股指期货	2,000,000	0.92
9	99999	股指期货	2,000,000	0.92
10	99999	股指期货	2,000,000	0.92

5.1.11 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国债期货投资明细

序号	国债期货代码	国债期货名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	99999	国债期货	2,000,000	0.92
2	99999	国债期货	2,000,000	0.92
3	99999	国债期货	2,000,000	0.92
4	99999	国债期货	2,000,000	0.92
5	99999	国债期货	2,000,000	0.92
6	99999	国债期货	2,000,000	0.92
7	99999	国债期货	2,000,000	0.92
8	99999	国债期货	2,000,000	0.92
9	99999	国债期货	2,000,000	0.92
10	99999	国债期货	2,000,000	0.92

5.1.12 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商品期货投资明细

序号	商品期货代码	商品期货名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	99999	商品期货	2,000,000	0.92
2	99999	商品期货	2,000,000	0.92
3	99999	商品期货	2,000,000	0.92
4	99999	商品期货	2,000,000	0.92
5	99999	商品期货	2,000,000	0.92
6	99999	商品期货	2,000,000	0.92
7	99999	商品期货	2,000,000	0.92
8	99999	商品期货	2,000,000	0.92
9	99999	商品期货	2,000,000	0.92
10	99999	商品期货	2,000,000	0.92

5.1.13 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期权投资明细

序号	期权代码	期权名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	99999	期权	2,000,000	0.92
2	99999	期权	2,000,000	0.92
3	99999	期权	2,000,000	0.92
4	99999	期权	2,000,000	0.92
5	99999	期权	2,000,000	0.92
6	99999	期权	2,000,000	0.92
7	99999	期权	2,000,000	0.92
8	99999	期权	2,000,000	0.92
9	99999	期权	2,000,000	0.92
10	99999	期权	2,000,000	0.92

5.1.14 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货币期货投资明细

序号	货币期货代码	货币期货名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	99999	货币期货	2,000,000	0.92
2	99999	货币期货	2,000,000	0.92
3	99999	货币期货	2,000,000	0.92
4	99999	货币期货	2,000,000	0.92
5	99999	货币期货	2,000,000	0.92
6	99999	货币期货	2,000,000	0.92
7	99999	货币期货	2,000,000	0.92
8	99999	货币期货	2,000,000	0.92
9	99999	货币期货	2,000,000	0.92
10	99999	货币期货	2,000,000	0.92

5.1.15 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大宗商品投资明细

序号	大宗商品代码	大宗商品名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	99999	大宗商品	2,000,000	0.92
2	99999	大宗商品	2,000,000	0.92
3	99999	大宗商品	2,000,000	0.92
4	99999	大宗商品	2,000,000	0.92
5	99999	大宗商品	2,000,000	0.92
6	99999	大宗商品	2,000,000	0.92
7	99999	大宗商品	2,000,000	0.92
8	99999	大宗商品	2,000,000	0.92
9	99999	大宗商品	2,000,000	0.92
10	99999	大宗商品	2,000,000	0.92

5.1.16 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贵金属投资明细

序号	贵金属代码	贵金属名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	99999	贵金属	2,000,000	0.92
2	99999	贵金属	2,000,000	0.92
3	99999	贵金属	2,000,000	0.92
4	99999	贵金属	2,000,000	0.92
5	99999	贵金属	2,000,000	0.92
6	99999	贵金属	2,000,000	0.92
7	99999	贵金属	2,000,000	0.92
8	99999	贵金属	2,000,000	0.92
9	99999	贵金属	2,000,000	0.92
10	99999	贵金属	2,000,000	0.92

5.1.17 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期权投资明细

序号	期权代码	期权名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	99999	期权	2,000,000	0.92
2	99999	期权	2,000,000	0.92
3	99999	期权	2,000,000	0.92
4	99999	期权	2,000,000	0.92
5	99999	期权	2,000,000	