中融医疗健康精选混合型证券投资基金2019年第2季度报告

2019-06-30

基金管理人：中融基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2019-07-19

§1 重要提示
§2 基金简介
§3 主要财务指标、基金净值表现
§4 管理人报告
§5 托管人报告
§6 报告期内基金投资组合情况
§7 报告期内股票投资组合的重大变动
§8 报告期内债券回购业务情况
§9 报告期内权证投资情况
§10 报告期内基金投资策略的重大变动
§11 报告期内为基金进行审计的会计师事务所情况
§12 报告期内管理人的重大事件
§13 备查文件目录

§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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年7月19日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。

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。

基金的过往业绩并不代表未来表现。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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2019年01月01日起至2019年06月30日止。

§2 基金简介

基金基本情况

项目	内容
基金名称	中融医疗健康混合
基金简称	
交易代码	000230
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015-09-18
报告期末基金份额总额	1,399,106.74 份
投资目标	本基金通过精选医疗健康相关产业证券，在严格控制投资风险的基础上，为投资风险偏好型客户的长期稳健增值。
投资策略	1、资产配置策略 2、股票投资策略 3、债券投资策略 4、中小企业私募债投资策略 5、股指期货投资策略 6、资产证券化投资策略 7、融资融券投资策略
业绩比较基准	沪深300指数收益率×50%+恒生医疗保健指数收益率×20%+上证国债指数收益率×30%
风险收益特征	本基金为混合型基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。
基金管理人	中融基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
下属两类基金的基金简称	中融医疗健康混合A
下属两类基金的交易代码	000230
报告期末下属两类基金的份额总额	1,399,106.74
下属两类基金的风险收益特征	

主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	注释(金额)	中融医疗健康混合A(元) 2019-04-01 - 2019-06-30	中融医疗健康混合A(元) 2019-01-01 - 2019-06-30
本期已实现利润		101,797.74	18,456.41
期末可供分配利润		101,395.39	12,450.32
期末可供分配基金份额利润		0.0692	0.0071
期末基金资产净值		1,399,106.74	1,396,103.39
期末基金份额净值		1.000	1.000

注：1、本期已实现利润指本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动损益）扣除本期费用后的余额。本期利润加本期公允价值变动损益。

2、上述日期是指期末可供分配的可实现基金份额利润、期末基金份额、期末资产净值、期末份额净值的日期。

§3 主要财务指标

本期及最近三年的基金净值表现及与同期业绩比较基准收益率的比较

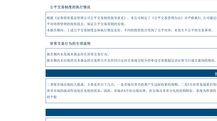
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-1.40 %	1.47 %	-0.39 %	1.22 %	-1.01 %	0.25 %

本期及最近三年的基金净值表现及与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	-1.71 %	1.47 %	-0.39 %	1.22 %	-1.32 %	0.25 %

自基金合同生效日起至基金资产净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

自基金合同生效日起至2019年06月30日止，本基金净值增长率为-1.71%，业绩比较基准收益率为-0.39%，超额收益率-1.32%，本期基金净值增长率低于同期业绩比较基准收益率。



自基金合同生效日起至基金资产净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

§4 管理人报告

管理人对报告期内本基金运作遵守情况的说明

本报告期，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、其他有关法律法规、中国证监会颁布的有关规定及本基金合同的有关规定，在内部管理方面，本基金管理人通过内部风控、稽核监察和投资监察等程序，对本报告期内的投资运作、基金管理人的管理业务活动进行监督、检查和控制，确保基金管理人的管理业务活动合法合规。

投资经理变动情况

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘海纳	中融医疗健康混合基金经理;中融医疗健康混合C基金经理;中融医疗健康混合A基金经理;中融医疗健康精选混合型证券投资基金基金经理。	2019-06-19		9	刘海纳先生，中国国籍，毕业于北京大学经济学专业，硕士研究生学历，具有证券从业资格。证券从业年限9年，2010年7月至2015年5月任职于摩根士丹利华鑫证券有限公司证券研究员，金融研究员，金融研究主管，2015年6月加入中融基金管理有限公司，担任医疗行业研究员。
刘宏宇	中融医疗健康混合C基金经理;中融医疗健康混合A基金经理;中融医疗健康精选混合型证券投资基金基金经理。	2018-09-19		13	刘宏宇先生，中国国籍，毕业于中南财经政法大学经济学专业，硕士研究生学历，具有CFA、FRM证书，具有证券从业资格。曾任：海通证券股份有限公司，2009年7月至2009年10月担任国泰君安证券股份有限公司，2009年11月至2011年2月担任中国银河证券股份有限公司，2011年3月至2015年5月担任中国国际金融股份有限公司，2015年6月至2016年5月担任中国国际金融股份有限公司医疗行业研究主管，2016年6月至2018年8月担任中融基金管理有限公司医疗行业研究主管，2018年8月至今担任中融基金管理有限公司医疗行业研究总监。中国证券业协会授予的基金从业资格证书编号：A20100320120004，中国证券业协会授予的证券从业资格证书编号：S0210110120003。刘宏宇先生担任中融基金管理有限公司医疗行业研究总监，具有证券从业资格，具有证券投资咨询业务资格，具有证券投资基金从业资格。

报告期内基金投资策略

报告期内本基金根据市场情况，主要在医疗行业、医药制造业等领域进行投资。

报告期内基金业绩表现

报告期内，本基金净值增长率为-1.40%，业绩比较基准收益率为-0.39%，超额收益率-1.01%。

管理人对报告期内基金业绩表现的说明

本报告期内，本基金净值增长率为-1.71%，业绩比较基准收益率为-0.39%，超额收益率-1.32%。

§5 托管人报告

报告期内本基金托管人运作遵守有关法律法规情况的说明

报告期内，本基金管理人在投资运作、基金资产净值计算、利润分配、信息披露、募集资金使用、基金份额发售、赎回、登记、基金合同、招募说明书等方面的规定，未发现有违反《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金销售机构监督管理办法》、《证券投资基金销售业务信息管理平台管理规定（试行）》、《证券投资基金管理公司内部控制指引》等法律法规及中国证监会其他有关规定的情况，未发现有违反基金合同、招募说明书的情况。

报告期内基金投资和赎回情况的说明

报告期内本基金未发生申购赎回情况。

报告期内基金收益分配情况的说明

报告期内本基金未发生收益分配。

报告期内管理人的重大事件

1、管理人旗下基金投资关联方证券的情况

报告期内，管理人旗下基金投资关联方证券的情况如下：

证券代码	证券名称	投资决策委员会决议时间	投资金额（元）	投资数量（股）	应付佣金（元）
300663	科蓝软件	2019-04-18	2,994,931.70	200,000	2,994.93
300496	中科创达	2019-04-18	2,994,931.70	200,000	2,994.93
603019	中科曙光	2019-04-18	2,994,931.70	200,000	2,994.93
300454	深信服	2019-04-18	2,994,931.70	200,000	2,994.93
300750	宁德时代	2019-04-18	2,994,931.70	200,000	2,994.93
300357	我武生物	2019-04-18	2,994,931.70	200,000	2,994.93
300015	爱尔眼科	2019-04-18	2,994,931.70	200,000	2,994.93
300146	汤臣倍健	2019-04-18	2,994,931.70	200,000	2,994.93
300326	凯利泰	2019-04-18	2,994,931.70	200,000	2,994.93
300223	北京君正	2019-04-18	2,994,931.70	200,000	2,994.93
合计			32,944,248.70	2,200,000	32,944.24

2、管理人旗下基金投资关联方证券的情况

报告期内，管理人旗下基金投资关联方证券的情况如下：

证券代码	证券名称	投资决策委员会决议时间	投资金额（元）	投资数量（股）	应付佣金（元）
300663	科蓝软件	2019-04-18	2,994,931.70	200,000	2,994.93
300496	中科创达	2019-04-18	2,994,931.70	200,000	2,994.93
603019	中科曙光	2019-04-18	2,994,931.70	200,000	2,994.93
300454	深信服	2019-04-18	2,994,931.70	200,000	2,994.93
300750	宁德时代	2019-04-18	2,994,931.70	200,000	2,994.93
300357	我武生物	2019-04-18	2,994,931.70	200,000	2,994.93
300015	爱尔眼科	2019-04-18	2,994,931.70	200,000	2,994.93
300146	汤臣倍健	2019-04-18	2,994,931.70	200,000	2,994.93
300326	凯利泰	2019-04-18	2,994,931.70	200,000	2,994.93
300223	北京君正	2019-04-18	2,994,931.70	200,000	2,994.93
合计			32,944,248.70	2,200,000	32,944.24

§6 报告期内基金投资组合情况

报告期末按照证券投资品种分类的资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,304,931.70	85.79
2	其中：股票	1,304,931.70	85.79
3	固定收益投资	5,114.40	0.34
4	其中：债券	5,114.40	0.34
5	资产支持证券		
6	贵金属投资		
7	金融衍生品投资		
8	买入返售金融资产		
9	其中：买断式逆回购		
10	银行存款和结算备付金合计	215,900.14	14.19
11	其他资产	2,000.00	0.13
12	合计	1,522,946.24	100.00

报告期末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（%）
A	农、林、牧、渔业		
B	采矿业		
C	制造业	1,109,904.12	79.43
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	406,171.40	29.06
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	金融业	185,855.92	13.30
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		
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	卫生和社会工作	58,000.26	4.15
R	文化、体育和娱乐业		
S	综合		
合计		1,759,931.70	125.94

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	300663	科蓝软件	6,700	205,326	14.68
2	300496	中科创达	1,500	184,695	13.21
3	603019	中科曙光	5,100	156,468	11.19
4	300454	深信服	1,000	137,000	9.80
5	300750	宁德时代	1,500	101,985	7.29
6	300357	我武生物	6,900	100,155.00	7.16
7	300015	爱尔眼科	3,800	72,200	5.16
8	300146	汤臣倍健	5,600	65,415	4.68
9	300326	凯利泰	5,900	65,490	4.68
10	300223	北京君正	5,907	58,907.34	4.21

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券		
2	央行票据		
3	金融债券		
	其中：政策性金融债		
4	企业债券		
5	企业短期融资券		
6	中期票据		
7	可转债（可交换债）	5,114.40	0.36
8	同业存单		
9	其他		
10	合计	5,114.40	0.36

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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	113022	医药转债	50	5,114	0.36

报告期末投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：1、本报告期末没有投资前十名股票中存在流通受限情况的情况。

报告期末按照证券投资品种分类的资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金资产净值比例（%）
1	权益投资	1,304,931.70	85.79
2	其中：股票	1,304,931.70	85.79
3	固定收益投资	5,114.40	0.34
4	其中：债券	5,114.40	0.34
5	资产支持证券		
6	贵金属投资		
7	金融衍生品投资		
8	买入返售金融资产		
9	其中：买断式逆回购		
10	银行存款和结算备付金合计	215,900.14	14.19
11	其他资产	2,000.00	0.13
12	合计	1,522,946.24	100.00

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	300663	科蓝软件	6,700	205,326	14.68
2	300496	中科创达	1,500	184,695	13.21
3	603019	中科曙光	5,100	156,468	11.19
4	300454	深信服	1,000	137,000	9.80
5	300750	宁德时代	1,500	101,985	7.29
6	300357	我武生物	6,900	100,155.00	7.16
7	300015	爱尔眼科	3,800	72,200	5.16
8	300146	汤臣倍健	5,600	65,415	4.68
9	300326	凯利泰	5,900	65,490	4.68
10	300223	北京君正	5,907	58,907.34	4.21

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券		
2	央行票据		
3	金融债券		
	其中：政策性金融债		
4	企业债券		
5	企业短期融资券		
6	中期票据		
7	可转债（可交换债）	5,114.40	0.36
8	同业存单		
9	其他		
10	合计	5,114.40	0.36