

# 信达澳银健康中国灵活配置混合型证券投资基金

2021年第1季度报告

2021年03月31日

基金管理人:信达澳银基金管理有限公司

基金托管人:中国建设银行股份有限公司

报告送出日期:2021年04月21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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年4月20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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2021年01月01日起至2021年03月31日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	信达澳银健康中国混合
基金主代码	003291
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年08月18日
报告期末基金份额总额	122,463,272.68份
投资目标	在有效控制组合风险并保持良好流动性的前提下，本基金通过股票与债券等资产的合理配置，并优选健康中国主题相关的优秀上市公司进行投资，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金的投资策略主要包括资产配置策略和个股选择策略两部分。其中，资产配置策略主要是通过研究宏观经济周期运行规律，动态调整大类资产配置比例，以争取规避系统性风险。个股选择策略采用定性与定量相结合的方式，对健康中国主题上市公司的投资价值进行综合评估，精选具有较强竞争优势的上市公司作为投资标的。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%
风险收益特征	本基金是混合型基金产品，其预期收益及预期

	风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种。
基金管理人	信达澳银基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2021年01月01日 - 2021年03月31日）
1. 本期已实现收益	7,305,329.69
2. 本期利润	9,070,747.92
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0753
4. 期末基金资产净值	305,094,901.34
5. 期末基金份额净值	2.491

注：1、上述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的认购、申购及赎回费等），计入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。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其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
过去三个月	5.69%	2.10%	-1.40%	0.96%	7.09%	1.14%
过去六个月	14.27%	1.78%	6.69%	0.80%	7.58%	0.98%
过去一年	87.72%	1.79%	22.43%	0.79%	65.29%	1.00%
过去三年	145.66%	1.50%	25.02%	0.82%	120.64%	0.68%
自基金合同生效起至今	149.10%	1.41%	29.52%	0.78%	119.58%	0.63%

注：本基金基金合同生效日 2017 年 08 月 18 日至报告期末未满五年。

### 3.2.2 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变动的比较



注:1、本基金基金合同于2017年8月18日生效,2017年9月21日开始办理申购、赎回业务。  
2、本基金的投资组合比例为:股票等权益类资产占基金资产的比例为0%-95%,其中投资于本基金定义的健康中国主题相关的证券资产不低于基金非现金资产的80%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%;股指期货、权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。本基金按规定在合同生效后六个月内达到上述规定的投资比例。

## § 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	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		
曾国富	本基金的基金经理、信达澳银产业升级混合基金、信达澳银消费优选混合基金、信达澳银中小盘混	2017-08-18	-	21年	上海财经大学管理学硕士。1994年至2005年历任深圳大华会计师事务所审计部经理,大鹏证券有限责任公司投资银行部业务董事、内部审计委员

	合基金、信达澳银周期动力混合基金和信达澳银医药健康基金的基金经理，权益投资总部副总监				会委员，平安证券有限责任公司资本市场事业部业务总监、内部审核委员会委员，国海富兰克林基金管理有限公司研究分析部分析员。2006年9月加入信达澳银基金，历任高级分析师、投资副总监、投资研究部下股票投资部总经理、研究副总监、研究总监、公募投资总部副总监、权益投资总部副总监，信达澳银精华配置混合基金基金经理（2008年7月30日至2011年12月16日）、信达澳银红利回报混合基金基金经理（2010年7月28日至2011年12月16日）、信达澳银中小盘混合基金基金经理（2009年12月1日起至2014年2月22日）、信达澳银产业升级混合基金基金经理（2015年2月14日起至今）、信达澳银健康中国灵活配置混合型基金基金经理（2017年8月18日起至今）、信达澳银消费优选混合型基金基金经理（2018年3月8日起至今）、信达澳银中小盘混合基金基金经理（2019年4月26日至今）、信达澳银周期动力混合基金基金经理（2020年12月30日至今）和信达澳银医药健康基金基金经理（2021年4月9日起至今）。
杨珂	本基金的基金经理	2020-05-13	-	6年	2014年3月-2015年11月在广发证券（香港）担任必选消费品研究员。2015年11月加入信达澳银基金管理有限公司任医药研究员、基金经理助理，

					现任信达澳银健康中国混合基金基金经理（2020年5月13日至今）和信达澳银医药健康混合基金基金经理（2021年4月9日起至今）。
--	--	--	--	--	--

注：1、基金经理的任职日期、离任日期为根据公司决定确定的任职或离任日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会从业人员资格管理办法的相关规定等。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益，没有发生损害基金持有人利益的行为。

## 4.3 公平交易专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人已经建立了投资决策及交易内控制度，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，维护投资者的利益。本基金管理人建立了严谨的公平交易机制，确保不同基金在买卖同一证券时，按照比例分配的原则在各基金间公平分配交易量。公司对报告期内公司所管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行了分析；利用数据统计和重点审查价差原因相结合的方法，对连续四个季度内、不同时间窗口（日内、3日内、5日内）公司管理的不同投资组合同向交易价差进行了分析；对部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易进行了审核和监控，未发现公司所管理的投资组合存在违反公平交易原则的情形。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内，本公司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未出现超过该证券当日成交量的5%的情况。投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易，未导致不公平交易和利益输送。

## 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

春节过后市场波动较大，一线白马龙头公司的股价回调明显，基于长期的研究以及草根调研反馈，很多优质公司的基本面仍然呈现稳健的增长态势，尤其是去年因疫情导致门诊下滑，但随着疫情的逐步缓解，医疗的刚需属性进一步凸显，部分企业业绩将面对较低的基数呈现快速增长。短期的股价大幅波动不改变优质公司的长期业绩增长。希望大家不要过度悲观，保持理智客观，股价大幅回调反而会出现较好的投资机会。我们

依然遵循自下而上的投资逻辑，寻找高增长可持续且估值合理的优秀公司，长期投资。希望从中长期角度为投资人获得稳健的投资收益。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为2.491元，份额累计净值为2.491元，本报告期内，本基金份额净值增长率为5.69%，同期业绩比较基准收益率为-1.40%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

### § 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)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	280,496,515.91	89.89
	其中：股票	280,496,515.91	89.89
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	27,779,752.24	8.90
8	其他资产	3,751,797.77	1.20
9	合计	312,028,065.92	100.00

#### 5.2 报告期末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

代码	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	182,865,657.04	59.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	24,036.12	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	32,414,676.02	10.62
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	56,511.69	0.02
J	金融业	-	-
K	房地产业	10,200.30	0.00
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	36,008,343.72	11.80
N	水利、环境和公共设施管理业	307,444.10	0.10
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	5,726,284.92	1.88
Q	卫生和社会工作	23,083,362.00	7.57
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	280,496,515.91	91.94

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 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	000661	长春高新	62,793	28,428,274.89	9.32
2	688202	美迪西	63,094	19,456,927.72	6.38
3	603939	益丰药房	216,359	19,191,043.30	6.29
4	300347	泰格医药	127,200	19,093,992.00	6.26
5	688016	心脉医疗	64,194	18,640,011.78	6.11
6	688139	海尔生物	215,446	18,612,379.94	6.10



7	300832	新产业	135,651	16,245,563.76	5.32
8	300725	药石科技	85,713	13,237,515.72	4.34
9	603233	大参林	157,384	13,210,812.96	4.33
10	603658	安图生物	114,458	12,569,777.56	4.12

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 5.6 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

##### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未参与股指期货。

#### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 5.10.1 本期国债期货投资政策

注：本基金未参与投资国债期货。

##### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

##### 5.10.3 本期国债期货投资评价

注：本基金未参与投资国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

大参林（603233）：

大参林医药集团股份有限公司于 2020 年 7 月 28 日，因对自外部供应商采购的进口药品存在没有尽进行查验义务的情形（销售期间为 2015 年 9 月至 2016 年 2 月），受到广州市市场监督管理局行政处罚，公司被没收违法所得 465,469.96 元和罚款 1,489,503.87 元。考虑到销售期间为 2015 年 9 月至 2016 年 2 月，距离现在已经 5 年时间，且涉及金额占公司年收入比重仅为 0.004%（公司 2019 年收入为 111.4 亿），公司已经对相关事宜做出了内部整顿，杜绝类似事情再次发生。经判断，该事件对公司日常经营不构成重大影响。

除以上证券外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体报告期内没有被监管部门立案调查，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 5.11.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库的情形。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	120,637.67
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,273.61
5	应收申购款	3,627,886.49
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	3,751,797.77

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	117,979,370.21
报告期期间基金总申购份额	76,081,390.84
减：报告期期间基金总赎回份额	71,597,488.37
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	122,463,272.68

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：基金管理人本报告期内未运用固有资金投资本基金。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：基金管理人本报告期内未运用固有资金投资本基金。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

注：本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《信达澳银健康中国灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《信达澳银健康中国灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、本报告期内公开披露的基金资产净值、基金份额净值及其他临时公告。

### 9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

### 9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公场所、营业场所及网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

信达澳银基金管理有限公司

2021年04月21日