

(上接 B105 版)

传真:010-85097308
客服热线:400-021-8850
网址:https://www.hatwcm.com/
基金管理人可以根据实际情况,增加或者减少销售机构和/或根据法律法规规定,增加或者减少其销售城市、网点,并另行公告,各销售机构提供的基金销售服务可能有所差异,具体请咨询各销售机构。

二、注册登记机构
名称:中欧基金管理有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路333号东方汇经大厦5层
办公地址:上海市虹口区东大名路18号8楼-嘉晟大厦7层
法定代表人:王奕明
总经理:刘建康
成立日期:2006年7月19日
电话:021-68609600
传真:021-68609011
联系人:杨敏

三、出具法律意见书的律师事务所
名称:上海市通力律师事务所
住所:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
负责人:俞卫锋
经办律师:黎明、陆奇
电话:021-31358664
传真:021-31358600
联系人:陆奇

四、审计基金财产的会计师事务所
名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1318号展银楼16层4楼
办公地址:上海市黄浦区南江路202号金天地2号楼普华永道中心11楼
执行事务合伙人:李丹
电话:021-23238189
联系人:薛薇
经办注册会计师:许康华、任佳敏

中欧医疗健康混合型证券投资基金

基金简称:中欧医疗混合
基金代码:002554

基金类型:混合型 开放式

第六部分 基金的投资目标

本基金主要投资于医疗健康相关行业股票,在有效控制投资组合风险的前提下,通过积极的投资配置,力争获得超越业绩比较基准的收益。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、固定收益类资产(国债、地方政府债、金融债、企业债、可转债、中小企业私募债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)、资产支持证券、质押及买断式回购、银行存款及现金等)、衍生品(权证、股指期货、股票期权等)以及经中国证监会允许的资产支持证券(含资产证券化)等固定收益类资产。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:
本基金股票投资占基金资产的比例为60%-95%,其中投资于医疗健康相关行业股票的比例不低于非现金基金资产的80%;权益投资占基金资产净值的比例不低于3%;每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约后,现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期在一年以内的政府债券投资占资产净值比例不低于基金资产净值的5%。

如法律法规或监管机构以后调整基金品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整基金品种的投资比例。

第八部分 基金的投资策略

一、大类资产配置
本基金主要采用自上而下分析的方法进行大类资产配置,确定股票、债券、现金的比例,重点通过宏观经济数据(包括GDP增长率、工业增加值、PPI、CPI、市场利率变化、进出口贸易数据等)和宏观经济的变化趋势,来做前瞻性的战略判断。

二、股票投资策略
(1)医疗健康相关行业界定
本基金所定义的医疗健康相关行业以改善和提高人们身心健康水平为目的,主要包括: a) 医疗卫生服务和 b) 人们身心健康和生活质量相关的行业。本基金投资的医疗健康相关行业股票包括目前主营业务与上述行业相关的行业上市公司,以及主营业务属于上述行业健康领域业务且业务未来有望成为主营业务的公司。

三、个股投资策略
本基金将采用定量、半定量、定性相结合的方法进行个股选择,主要考虑因素包括:行业景气度、公司成长性、估值水平、财务指标、公司治理、股权结构、管理层背景、行业地位、竞争优势、商业模式、产品竞争力、品牌影响力、研发能力、人才储备、股权激励、分红政策、关联交易、诉讼风险、舆情风险、ESG因素等。

四、风险控制
本基金将采用自上而下分析的方法进行风险控制,重点通过宏观经济数据、行业景气度、公司成长性、估值水平、财务指标、公司治理、股权结构、管理层背景、行业地位、竞争优势、商业模式、产品竞争力、品牌影响力、研发能力、人才储备、股权激励、分红政策、关联交易、诉讼风险、舆情风险、ESG因素等进行风险控制。

五、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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

六、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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

七、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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

八、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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

九、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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

十、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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

十一、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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

十二、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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

十三、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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

十四、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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

十五、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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

十六、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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

十七、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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

十八、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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

十九、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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

二十、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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

二十一、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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

二十二、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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

二十三、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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

二十四、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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

二十五、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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

二十六、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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

二十七、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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

二十八、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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

二十九、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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

三十、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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

三十一、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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

三十二、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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

三十三、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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

三十四、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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

三十五、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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

三十六、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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

2.报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1 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	840,053,579.92	61.35
D	电力、热力、燃气及水利生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	174,251,409.02	12.61
G	交通运输、仓储和邮政业	36,699.62	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	34,203.96	0.00
J	金融业	-	-
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	2,803,792.00	0.20
N	卫生、社会保障和社会福利业	-	-
O	医药、生物及健康产业	-	-
P	教育	-	-
Q	综合和社会工作	220,116,562.59	15.92
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计		1,245,296,203.11	90.09

2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

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10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	600276	恒瑞医药	1,581,179	137,578,384.79	9.16
2	600521	国药药业	5,297,147	85,160,450.13	6.35
3	600196	华鲁恒升	1,070,061	84,225,307.89	6.28
4	300125	博瑞医药	2,445,042	83,082,227.48	6.01
5	300147	雅葆时代	1,570,245	82,272,495.59	5.92
6	300155	爱尔眼科	1,985,175	81,749,506.50	5.91
7	000963	华东医药	1,196,185	78,350,172.50	5.67
8	600566	洪兴药业	1,662,744	76,642,922.12	5.53
9	600877	涌和药业	2,811,849	75,188,842.26	5.44
10	600836	兴发集团	829,009	68,791,668.82	4.98

4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有股指期货。

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金股指期货投资将根据风险管理的原则,主要选择流动性好、交易活跃的品种进行投资,以降低套期保值成本,达到套期保值的目的。

10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1 本期国债期货投资政策
国债期货不属于本基金的投资范围,故不适用。

10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
国债期货不属于本基金的投资范围,故不适用。

10.3 本期国债期货投资评价

国债期货不属于本基金的投资范围,故不适用。

11. 基金投资组合报告期末基金资产净值中公允价值计量被划分为第三层次公允价值计量的项目

11.1 本基金投资组合期末公允价值计量被划分为第三层次公允价值计量的项目
11.2 本基金投资组合期末公允价值计量的项目

12. 基金资产构成

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	480,835.32	0.04
2	固定收益投资	-	-
3	公允价值变动	-	-
4	应收利息	35,056.16	0.00
5	应收申购款	24,905,941.40	1.83
6	其他资产	-	-
7	合计	35,271,681.08	2.67

13. 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

14. 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

14.1 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
14.2 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

15. 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

15.1 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
15.2 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

16. 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

16.1 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
16.2 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

17. 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

17.1 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
17.2 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

18. 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

18.1 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
18.2 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

19. 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

19.1 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
19.2 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

20. 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

20.1 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
20.2 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

21. 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

21.1 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
21.2 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

22. 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

22.1 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
22.2 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

23. 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

23.1 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
23.2 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

24. 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

24.1 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
24.2 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

25. 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

25.1 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
25.2 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

26. 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

26.1 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
26.2 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

27. 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

27.1 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
27.2 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

28. 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

28.1 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
28.2 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

29. 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

29.1 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
29.2 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

30. 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

30.1 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
30.2 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

31. 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

31.1 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
31.2 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

32. 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

32.1 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
32.2 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

33. 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

33.1 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
33.2 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

34. 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

34.1 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
34.2 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

35. 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

35.1 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
35.2 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

36. 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

36.1 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
36.2 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

37. 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

37.1 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
37.2 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

38. 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

38.1 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
38.2 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

39. 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

39.1 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
39.2 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

40. 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

40.1 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
40.2 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

41. 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

41.1 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
41.2 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

42. 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

42.1 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
42.2 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

43. 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

43.1 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
43.2 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

44. 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

44.1 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
44.2 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

45. 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

45.1 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
45.2 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

46. 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

46.1 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
46.2 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

47. 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

47.1 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
47.2 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

中欧医疗健康混合 A

净值增长率	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	β-β0	β-β0	
2016.9.29-2016.12.31	-1.39%	0.82%	-1.60%	0.43%	-5.39%	0.09%
2017.1.1-2017.12.31	13.76%	1.02%	9.02%	0.59%	24.24%	0.52%
2018.1.1-2018.3.31	10.08%	1.17%	5.99%	0.95%	4.16%	0.81%
2016.9.29-2018.3.31	36.56%	1.29%	13.69%	0.59%	22.81%	0.53%