中邮沪港深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：中邮信息基金管理股份有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2019-07-19

目录

章节	内容
一	重要提示
二	基金产品概况
三	主要财务指标和基金净值表现
四	管理人报告
五	托管人报告
六	财务报告（未经审计）
七	投资组合报告
八	基金份额持有人户数及持有人结构
九	开放式基金的申购、赎回及转换情况
十	重大事件揭示
十一	影响投资者决策的其他重要信息
十二	备查文件目录

一 重要提示

基金管理人的董事会及董事会成员保证报告内容的真实性、准确性和完整性，并对报告内容的虚假记载、误导性陈述或重大遗漏承担个别和连带责任。

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，也不保证最低投资收益。

基金管理人过往业绩及其所做的任何预测不构成对基金产品的保证。

投资者应认真阅读本报告全文，并在做出投资决策前，应认真考虑拟投资的风险收益特征，结合个人投资目的、财务状况、风险承受能力等方面因素，谨慎做出投资决策。

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。

基金过往业绩并不代表未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告财务指标取数来源为中证指数公司。

本报告数据截止日期为2019年06月30日，财务指标数据未经审计。

二 基金产品概况

项目	简介
基金简称	中邮沪港深精选混合
场内简称	-
基金主代码	000477
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010-03-28
基金管理人名称	中邮信息基金管理股份有限公司
基金托管人名称	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	22,120,148.44 份
投资目标	本基金主要从A股市场投资，根据沪港深标的股票的范围，在上市规则允许的范围内，对不限量的沪港深标的股票进行选股，力争在风险适当的前提下，通过投资于价值股、成长股等子价值股，获取稳健的投资收益。
投资策略	本基金通过以量化方式，根据个股的财务指标、市盈率、市净率、股息率、盈利增长率、市场流动性、市场情绪、宏观经济、政策导向、国家发展规划等方面因素，对沪港深标的股票进行分析，选择具有成长潜力、估值合理、股息率较高、盈利增长率较高、市场流动性较好、市场情绪较为乐观、宏观经济、政策导向、国家发展规划有利于公司发展的沪港深标的股票作为本基金的投资对象。
业绩比较基准	沪深300指数×80%+恒生指数×20%（以人民币计价）
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险与预期收益高于债券型基金和混合型基金，属于证券投资基金中较为风险较高品种。
基金管理人	中邮信息基金管理股份有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

三 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2019-04-01 至 2019-06-30）
本期已实现利息	992,441.05
本期利润	1,164,480.42
加权平均基金份额本期利润	0.0400
期末基金资产净值	22,656,676.20
期末基金份额净值	1.0242

注：1. 本期已实现利息收益金额为零或负数，则该指标，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利息收入加上期末公允价值变动收益，上述指标基金份额指每日份额持有人权益的变动量扣除当日份额申购、赎回数量的影响后，计算公式为：期末份额=期初份额+申购份额-赎回份额。

四 管理人报告

基金净值表现

本报告期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	3.98 %	0.17 %	-1.69 %	0.95 %	5.67 %	-0.78 %

自基金合同生效日以来基金累计净值增长率变动及与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注：自基金合同生效日起，本基金的当日份额申购/赎回的，当日份额申购/赎回的份额，本期利润为本期已实现利润加上本期公允价值变动收益。上述指标基金份额指每日份额持有人权益的变动量扣除当日份额申购/赎回数量的影响后的数，计算公式为：期末份额=期初份额+申购份额-赎回份额。

五 其他指标

单位：人民币元

其他指标	报告期（2019-04-01至2019-06-30）
其他指标	报告期（2019-04-30）

六 管理人对报告期内基金运作遵规守信的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金管理暂行办法》等相关法律法规及本基金基金合同的规定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，严格控制风险因素的出现，为基金份额持有人谋求最大利益。

基金管理人承诺，投资过程中，没有违规等方面的投资决策程序的记录；没有为自己谋取利益，未从事内幕交易，操纵市场行为等；保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人未建立或设置一定期限内投资收益率目标，不作出保证一定期限内投资收益的承诺。

基金管理人过往业绩并不代表未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告数据截止日期为2019年06月30日，财务指标数据未经审计。

七 投资组合报告

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	9,355,666.00	39.27
	其中：股票	9,355,666.00	39.27
2	固定收益投资	9,992,900.00	41.95
	其中：债券	9,992,900.00	41.95
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	4,419,594.81	18.55
7	其他资产	153,324.20	0.64
8	合计	23,821,485.01	100.00

注：由于四舍五入的原因数字相对基金资产组合各类别占基金总资产的比例与分项之和可能有差异。

期末按行业分类的股票投资组合

报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	1,166,000.00	5.15
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	-	-
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	7,189,666.00	31.73
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	8,355,666.00	36.88

注：1. 本报告采用证监会行业分类标准披露。

报告期末按沪股通投资的港股投资组合情况

序号	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	基础材料	166,296.00	0.73
2	消费非必需品	185,725.00	0.82
3	消费必需品	101,149.00	0.45
4	医疗	256,500.00	1.13
5	金融	1,547,559.00	6.83
6	房产管理	181,606.00	0.80
7	工业	1,189,356.00	5.25
8	信息技术	341,187.00	1.51
9	电信服务	-	-
10	公用事业	1,409,878.00	6.22
11	房地产	1,266,360.00	5.59
合计		8,355,666.00	36.88

注：由于四舍五入的原因分类明细占基金资产净值比例与分项之和可能有差异。

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	港股代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	00700	腾讯控股	16,500	761,595.00	3.36
2	00941	中国移动	15,500	678,915.00	2.99
3	00883	中国海洋石油	9,000	547,080.00	2.41
4	00011	恒生银行	2,800	478,602.00	2.11
5	00939	建设银行	72,000	444,888.00	1.96
6	00619	大众联合控股-G3	5,000	422,338.00	1.86
7	00270	粤海投资	10,000	406,480.00	1.79
8	01299	友邦保险	4,800	355,728.00	1.57
9	02269	药明生物技术	6,100	341,600.00	1.50
10	02318	中国平安	13,000	331,838.00	1.46

报告期末按沪股通投资的港股投资组合情况

序号	港股代码	股票名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	[illegible]	[illegible]	9,992,900.00	44.11
2	[illegible]	[illegible]	100,000	0.44
合计			9,992,900.00	44.11

注：本报告未期末投资可以上交易。

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：本报告未期末未投资贵金属。

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

序号	权证代码	权证名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	[illegible]	[illegible]	9,992,900.00	44.11	
2	[illegible]	[illegible]	100,000	0.44	
合计			9,992,900.00	44.11	

注：本报告未期末权证可以上交易。

期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细

注：本报告未期末未投资股指期货。

期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期货投资明细

注：本报告未期末未投资国债期货。

投资组合报告附注

受到谴责以及处罚情况

本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被国家银行业监管机构、证券监督机构行政一书内发现非合规、处罚。

中邮基金投资的前十名股票名称与基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内股票。

其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,418.44
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	15,988.38
4	应收利息	105,415.44
5	应收申购款	5,502.34
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	153,324.20

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本报告期末未基金未持有处于转股期的可转换债券。

报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本报告期末未基金前十名股票中不存在流通受限的情况。

八 基金份额持有人户数及持有人结构

报告期末基金份额持有人户数及持有人结构情况

项目	基金份额
报告期期初管理人持有的本基金份额	2,000,000.00
报告期期间总赎回份额	-
报告期期间总申购/转入份额	2,000,000.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	4,000,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	18.08

报告期末持有的基金份额净值大于等于100万元的前十名持有人情况

持有人名称	持有份额（份）	占基金份额比例（%）
中邮信息基金管理股份有限公司-中邮沪港深精选混合型证券投资基金	4,000,000.00	18.08
合计	4,000,000.00	18.08

报告期末基金管理人所在公司从事本基金投资情况

项目	份额（份）
基金管理人所在公司从事本基金投资情况	0.00
其中：基金管理人固有资金	0.00
基金管理人从业人员投资情况	0.00
其中：基金经理所管理基金	0.00
基金管理人从业人员投资情况	0.00
其中：基金经理所管理基金	0.00

九 开放式基金的申购、赎回及转换情况

报告期内基金份额发生变动的情况

项目	份额
报告期期初基金份额	22,120,148.44
报告期期间基金总申购份额	-
报告期期间基金总赎回份额	-
报告期期末基金份额	22,120,148.44

十 重大事件揭示

十个工作日内公告的重大事件

公告日期	公告内容
2019-04-30	中邮沪港深精选混合2019年第1季度报告

报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，基金管理人未发生重大人事变动。

报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

报告期内基金投资策略的改变

报告期内，基金投资策略未发生改变。

报告期内基金管理人的重大诉讼事项

报告期内，基金管理人未发生重大诉讼事项。

报告期内基金托管人的重大诉讼事项

报告期内，基金托管人未发生重大诉讼事项。

报告期内基金投资的股票投资交易情况说明

报告期内基金投资的股票投资交易情况说明

交易方式	成交金额（元）	占股票成交总额的比例（%）
交易单元数量发生变动的情况	-	-
报告期内基金投资的股票投资交易情况说明	-	-

报告期内基金投资的股票投资交易佣金情况说明

券商名称	交易单元数量	成交金额（元）	佣金（元）	佣金比例（%）	备注
招商证券股份有限公司	1	9,992,900.00	4,000.00	100.00	-
合计	1	9,992,900.00	4,000.00	100.00