

安信医药健康主题股票型发起式证券投资基金

2021 年第 4 季度投资组合报告

§ 1 投资组合报告

1.1 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	1,024,738,484.61	90.85
	其中：股票	1,024,738,484.61	90.85
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	72,461,057.64	6.42
8	其他资产	30,789,433.90	2.73
9	合计	1,127,988,976.15	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股市值为 13,972,759.47 元，占净值比例

1.25%。

1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

1.2.1 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	800,488,754.35	71.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	6,806.19	0.00
F	批发和零售业	130,637,923.66	11.71
G	交通运输、仓储和邮政业	25,722.00	0.00
H	住宿和餐饮业	—	—

I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,464,217.61	0.49
J	金融业	69,749.68	0.01
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	73,719,463.19	6.61
N	水利、环境和公共设施管理业	288,517.09	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	18,161.78	0.00
R	文化、体育和娱乐业	46,409.59	0.00
S	综合	—	—
	合计	1,010,765,725.14	90.61

1.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
医疗保健	13,972,759.47	1.25
合计	13,972,759.47	1.25

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

1.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

1.3.1 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	002727	一心堂	1,676,030	64,543,915.30	5.79
2	002275	桂林三金	3,812,742	64,473,467.22	5.78
3	300705	九典制药	1,640,000	57,629,600.00	5.17
4	000739	普洛药业	1,582,613	55,533,890.17	4.98
5	603259	药明康德	457,613	54,263,749.54	4.86
5	02359	药明康德	10,000	1,103,760.00	0.10
6	002390	信邦制药	5,332,400	39,566,408.00	3.55
7	603301	振德医疗	764,648	39,279,967.76	3.52
8	600521	华海药业	1,775,753	38,462,809.98	3.45
9	000999	华润三九	1,089,916	37,318,723.84	3.35
10	603520	司太立	573,298	37,264,370.00	3.34

1.4 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。

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五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

1.6 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。

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五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

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五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1.9.1 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合约。

1.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理原则，以套期保值、对冲投资组合的系统性风险为目的，优先选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。基于本基金的个股精选配置，在系统性风险积累较大时，通过适当的股指期货头寸对冲系统性风险，力争获取个股的超额收益和对冲组合的绝对收益。

1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

1.10.1 本期国债期货投资政策

本基金的国债期货投资根据风险管理原则，以套期保值为目的，以对冲风险为主。国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现资产的长期稳定增值。

1.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

1.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

1.11 投资组合报告附注

1.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现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

报告期内本基金投资的前十名证券除司太立（股票代码：603520 SH）外其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2021 年 9 月 6 日，浙江司太立制药股份有限公司因违规经营，违反安全生产行为被仙居县应急管理局通知整改，罚款 2.5 万元【仙应急罚字[2021]第 2000029 号】。

1.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

1.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	—
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	15,772.04
5	应收申购款	30,773,661.86
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	30,789,433.90

1.11.4 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债券。

1.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

1.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。