

# 中海医疗保健主题股票型证券投资基金 2016 年半年度报告

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：中海基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 24 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司(以下简称“工商银行”)根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 其他指标.....	错误！未定义书签。
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	错误！未定义书签。
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>13</b>
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>32</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	32
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	32
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	33
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	34
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	39
7.6 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.....	39
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	39
7.8 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贵金属投资明细.....	39
7.9 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.....	39
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	40
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	40

7.12 投资组合报告附注.....	40
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>41</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	41
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	错误！未定义书签。
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	41
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	41
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>42</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>42</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	42
10.2 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.....	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	42
10.4 基金投资策略的改变.....	42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	42
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	43
10.8 其他重大事件.....	45
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>错误！未定义书签。</b>
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>50</b>
12.1 备查文件目录.....	50
12.2 存放地点.....	50
12.3 查阅方式.....	50

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中海医疗保健主题股票型证券投资基金
基金简称	中海医疗保健主题股票
基金主代码	399011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 6 月 9 日
基金管理人	中海基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	51,071,724.96 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于医疗保健行业上市公司，在控制风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	<p>1、一级资产配置</p> <p>一级资产配置主要采取自上而下的方式。</p> <p>本基金基于对国内外宏观经济走势、财政货币政策分析、医疗保健行业发展趋势等分析判断，采取自上而下的分析方法，比较不同证券子市场和金融产品的收益及风险特征，动态确定基金资产在固定收益类和权益类资产的配置比例。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>(1) 医疗保健主题行业的界定</p> <p>本基金将沪深两市中从事医疗保健行业的上市公司定义为医疗保健主题类公司，具体包括以下几类公司：</p> <p>1) 主营业务从事医疗行业（包括但不限于化学制药、中药、生物制品、医药商业、医疗器械和医疗服务等行业）的公司；</p> <p>2) 主营业务有利于公众健康（包括但不限于保健食品、养老等行业）的公司；</p> <p>3) 当前非主营业务提供的产品或服务隶属于医疗保健行业，且未来这些产品或服务有望成为主要利润来源的公司。当未来由于经济增长方式的转变、产业结构的升级，从事或受益于上述投资主题的外延也将逐渐扩大，本基金将视实际情况调整上述医疗保健主题的识别及认定。</p> <p>(2) 医疗保健主题类股票的投资策略</p> <p>本基金投资于医疗保健主题类证券的资产不低于非现金基金资产的 80%。本基金对医疗保健主题类的个股</p>

	<p>将采用定量分析与定性分析相结合的方法，选择其中具有优势的上市公司进行投资。</p> <p>1) 定量方式 本基金将对反映上市公司质量和增长潜力的成长性指标、财务指标和估值指标等进行定量分析，以挑选具有成长优势、财务优势和估值优势的个股。</p> <p>2) 定性方式 本基金主要通过实地调研等方法，综合考察评估公司的核心竞争优势，重点投资具有较高进入壁垒、在行业中具备比较优势的公司，并坚决规避那些公司治理混乱、管理效率低下的公司，以确保最大程度地规避投资风险。本基金管理人重点考察上市公司的竞争优势包括：公司管理竞争优势、技术或产品竞争优势、品牌竞争优势、规模优势等方面。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>(1) 久期配置：基于宏观经济趋势性变化，自上而下的资产配置。利用宏观经济分析模型，确定宏观经济的周期变化，主要是中长期的变化趋势，由此确定利率变动的方向和趋势。根据不同大类资产在宏观经济周期的属性，即货币市场顺周期、债券市场逆周期的特点，确定债券资产配置的基本方向和特征。结合货币政策、财政政策以及债券市场资金供求分析，根据收益率模型为各种固定收益类金融工具进行风险评估，最终确定投资组合的久期配置。</p> <p>(2) 期限结构配置：基于数量化模型，自上而下的资产配置。</p> <p>(3) 债券类别配置/个券选择：主要依据信用利差分析，自上而下的资产配置。本基金根据利率债券和信用债券之间的相对价值，以其历史价格关系的数量分析为依据，同时兼顾特定类别收益品种的基本面分析，综合分析各个品种的信用利差变化。在信用利差水平较高时持有金融债、企业债、短期融资券、可分离可转债、资产支持证券等信用债券，在信用利差水平较低时持有国债等利率债券，从而确定整个债券组合中各类别债券投资比例。</p>
<p>业绩比较基准</p>	<p>中证医药卫生指数收益率*80%+中证全债指数收益率*20%</p>
<p>风险收益特征</p>	<p>本基金为股票型基金，属于证券投资基金中的高风险品种，其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。</p>

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中海基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王莉	洪渊
	联系电话	021-38429808	010-66105799
	电子邮箱	wangl@zhfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-9788、 021-38789788	95588
传真		021-68419525	010-66105798
注册地址		上海市浦东新区银城中路 68号2905-2908室及30层	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		上海市浦东新区银城中路 68号2905-2908室及30层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		黄鹏	易会满

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.zhfund.com
基金半年度报告备置地点	上海市浦东新区银城中路68号2905-2908室及30层。

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中海基金管理有限公司	上海市浦东新区银城中路68号 2905-2908室及30层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016年1月1日 - 2016年6月30日)
本期已实现收益	-9,915,522.18
本期利润	-9,893,324.52
加权平均基金份额本期利润	-0.1905
本期加权平均净值利润率	-15.37%
本期基金份额净值增长率	-13.80%

3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)
期末可供分配利润	15,267,112.69
期末可供分配基金份额利润	0.2989
期末基金资产净值	66,338,837.65
期末基金份额净值	1.299
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-32.83%

注1:本报告期指自2016年1月1日至2016年6月30日。

注2:以上所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的申购、赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

注3: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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	4.84%	1.26%	3.30%	1.06%	1.54%	0.20%
过去三个月	2.28%	1.37%	1.76%	1.12%	0.52%	0.25%
过去六个月	-13.80%	2.15%	-12.01%	1.78%	-1.79%	0.37%
过去一年	-24.39%	2.53%	-15.89%	2.08%	-8.50%	0.45%
自基金合同生效起至今	-32.83%	2.52%	-26.35%	2.16%	-6.48%	0.36%

注1:“自基金合同生效起至今”指2015年6月9日(基金转型生效日)至2016年6月30日。

注2:本基金的业绩比较基准为中证医药卫生指数收益率\*80%+中证全债指数收益率\*20%,本基金主要投资于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、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、权证、债券、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金投资于股票的比例不低于基金资产的80%,投资于医疗保健主题类证券的资产不低于非现金基金资产的80%。因此,我们选取市场认同度很高的中证医药卫生指数和中证全债指数作为计算业绩基准指数的基础指数。在一般市场状况下,本基金投资于医疗保健主题类证券的比例控制在80%左右,其他资产投资比例控制在20%左右。我们根据本基金在一般市场状况下的资产配置比例来确定本基金业绩基准指数加权的权重,以使业绩比较更加合理。本基金业绩基准指数每日按照80%、20%的比例对基础指数进行再



平衡，然后得到加权后的业绩基准指数的时间序列。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人自 2004 年 3 月 18 日成立以来，始终坚持“诚实信用、勤勉尽责”的原则，严格履行基金管理人的责任和义务，依靠强大的投研团队、规范的业务管理模式、严密科学的风险管理和内部控制体系，为广大基金份额持有人提供规范、专业的资产管理服务。截至 2016 年 6 月 30 日，共管理证券投资基金 32 只。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限	证券从	说明
----	----	-----------------	-----	----

		任职日期	离任日期	业年限	
郑磊	本基金基金经理、中海医药健康产业精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2015年6月9日	-	6年	郑磊先生，复旦大学社会学与卫生事业管理专业硕士。曾任国泰君安证券股份有限公司助理研究员。2013年1月进入我公司工作，历任分析师、高级分析师兼中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理，2014年12月至今任中海医药健康产业精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015年6月至今任中海医疗保健主题股票型证券投资基金基金经理。

注 1：上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外批露的任免日期填写。

注 2：证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

基金管理人在报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、《基金合同》的规定，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，不存在损害基金份额持有人利益的行为，不存在违法违规或未履行基金合同承诺。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度，公司从研究、投资、交易、风险管理事后分析等环节，对股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动的全程公平交易进行了明确约定。公司通过制定研究、交易等相关制度，要求公司各组合研究成果共享，投资交易指令统一下达至交易室，由交易室通过启用公平交易模块并具体执行相关交易，使公平交易制度中要求的时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡得以落实；同时，根据公司制度，通过系统禁止公司组合之间（除指数组合外）的同日反向交易。对于发生在银行间市场的债券买卖交易及交易所市场的大宗交易，由公司风控稽核部对相关交易价格进行事前审核，风控的事前介入有效防范了可能出现的非公平交易行为。

本报告期，公司对不同组合不同时间段的同向交易价差进行了溢价率样本的采集，进行了相关的假设检验，对于相关溢价金额对组合收益率的贡献进行了重要性分析，并针对交易占优次数

进行了时间序列分析。多维度的公平交易监控指标使公平交易事后分析更全面、有效。

本报告期，公司根据制度要求，对不同组合不同时间段的反向交易进行了统计分析，对于出现的公司制度中规定的异常交易，均要求相关当事人和审批人按照公司制度要求予以留痕。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，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不存在超过该证券当日成交量的 5% 的情况，对于一级市场证券申购、二级市场证券交易中出现的可能导致不公平交易和利益输送的重大异常交易情况，风控稽核部均根据制度规定要求组合经理提供相关情况说明予以留痕。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年以来，市场经历了剧烈的波动，尤其是以创业板为代表的泛成长股表现出了显著的估值压力。报告期内本基金坚持了以成长股为主导的投资思路，遵循自下而上的原则进行选股，立足于医药产业，集中配置了制剂出口、血制品、创新药等行业内具备较好成长性的个股。

尽管我们预期到了随着泛成长股估值水平的显著泡沫化及由此引发的市场风险愈加突出，但上半年年初的熔断市场仍然超出了我们的预期，尽管我们始终保持谨慎的态度，并把风险控制作为组合管理的首要任务，但是仍然没能足够地控制基金净值回撤，最后见识了市场的力量并承担了相应的业绩波动。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 6 月 30 日，本基金份额净值 1.299 元（累计净值 1.709 元）。报告期内本基金净值增长率为-13.80%，低于业绩比较基准 1.79 个百分点。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 年以来，为了对冲宏观经济的下行风险，宏观管理机构仍然继续维持以量化宽松为核心的政策组合，经济可能进入预期平稳阶段。展望下半年，央行还在不断宽松屏蔽风险，债券收益率不断压低，一些低估值高股息的蓝筹价值股有可能获得一定的配置价值，从而有可能引导市场风格的转变。

根据盈利、流动性与估值的综合分析，我们预期下半年市场以震荡为主。对于成长股为代表的医药行业而言，我们认为新技术、新模式仍然将成为行业的核心驱动因素。以制剂出口、创新药为主的新产业方向，将为企业打开新的成长空间，将带来更多的投资机会。此外，传统领域的企业也将通过稳定的业绩增长，提供稳健的投资回报率。

基于较为谨慎的预期，本基金下半年将采取更加均衡的投资策略，在以确定性增长作为组合管理首要原则的同时，将更加注重产业升级转型的着力点。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，公司分管运营副总担任估值委员会主任委员，其他委员有风险控制总监、监察稽核负责人、基金会计负责人、相关基金经理等。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理作为公司估值委员会的成员，不介入基金日常估值业务，但应参加估值委员会会议，提出基金估值流程及估值技术中存在的潜在问题，参与估值程序和估值技术的决策。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中证指数有限公司以及中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供证券交易所及银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据法律法规以及本基金合同的相关规定，本基金本报告期内未发生利润分配。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对中海医疗保健主题证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，中海医疗保健主题证券投资基金的管理人——中海基金管理有限公司在中海医疗保健主题证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，中海医疗保健主题证券投资基金未进行利润分配。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对中海基金管理有限公司编制和披露的中海医疗保健主题证券投资基金 2016 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：中海医疗保健主题股票型证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	8,626,871.19	4,668,700.67
结算备付金		413,771.71	727,150.12
存出保证金		72,782.73	108,791.93
交易性金融资产	6.4.7.2	57,231,871.48	65,139,435.61
其中：股票投资		57,231,871.48	65,139,435.61
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		1,248,866.84	1,942,441.02
应收利息	6.4.7.5	1,615.21	1,555.00
应收股利		-	-
应收申购款		127,022.89	2,579,871.10
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		67,722,802.05	75,167,945.45
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2015 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		610,575.76	2,733,623.19

应付赎回款		277,099.96	443,804.82
应付管理人报酬		81,758.51	87,996.83
应付托管费		13,626.41	14,666.10
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	350,468.30	405,054.67
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	50,435.46	75,756.44
负债合计		1,383,964.40	3,760,902.05
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	51,071,724.96	47,376,235.33
未分配利润	6.4.7.10	15,267,112.69	24,030,808.07
所有者权益合计		66,338,837.65	71,407,043.40
负债和所有者权益总计		67,722,802.05	75,167,945.45

注：报告截至日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.299 元，基金份额总额 51,071,724.96 份。

## 6.2 利润表

会计主体：中海医疗保健主题股票型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 6 月 9 日(基 金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-8,293,986.55	-6,135,901.07
1.利息收入		36,467.80	10,274.13
其中：存款利息收入	6.4.7.11	36,467.80	10,274.13
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-8,464,267.06	12,333,105.26
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-8,738,990.60	12,333,105.26
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	274,723.54	3,624.98
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	22,197.66	-18,699,231.80

4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	111,615.05	219,951.34
<b>减：二、费用</b>		1,599,337.97	173,615.88
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	479,788.77	37,907.91
2. 托管费	6.4.10.2.2	79,964.77	6,346.24
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	988,367.63	117,807.98
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	51,216.80	11,553.75
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-9,893,324.52	-6,309,516.95
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-9,893,324.52	-6,309,516.95

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中海医疗保健主题股票型证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	47,376,235.33	24,030,808.07	71,407,043.40
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-9,893,324.52	-9,893,324.52
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	3,695,489.63	1,129,629.14	4,825,118.77
其中：1.基金申购款	22,090,152.32	5,756,868.63	27,847,020.95
2.基金赎回款	-18,394,662.69	-4,627,239.49	-23,021,902.18
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	51,071,724.96	15,267,112.69	66,338,837.65

项目	上年度可比期间 2015 年 6 月 9 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	16,088,014.18	6,677,552.48	22,765,566.66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	20,494,345.86	20,494,345.86
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	17,804,967.64	1,642,560,979.08	1,660,365,946.72
其中：1.基金申购款	4,080,395,859.58	2,517,025,944.68	6,597,421,804.26
2.基金赎回款	-4,062,590,891.94	-874,464,965.60	-4,937,055,857.54
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-1,645,383,776.88	-1,645,383,776.88
五、期末所有者权益(基金净值)	33,892,981.82	24,349,100.54	58,242,082.36

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

\_\_\_\_\_  
黄鹏

基金管理人负责人

\_\_\_\_\_  
宋宇

主管会计工作负责人

\_\_\_\_\_  
周琳

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

中海医疗保健主题股票型证券投资基金是根据原中海上证 380 指数证券投资基金(以下简称“中海上证 380 指数基金”)基金份额持有人大会 2015 年 6 月 9 日决议通过的《关于中海上证 380 指数证券投资基金转型相关事项的议案》，经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可字[2014]1292 号《关于准予中海上证 380 指数证券投资基金变更注册的批复》核准，由原中海上证 380 指数基金转型而来。原中海上证 380 指数基金存续期限至 2015 年 6 月 8 日止。自 2015 年 6 月 9 日起，原中海上证 380 指数基金更名为中海医疗保健主题股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)，《中海上证 380 指数证券投资基金基金合同》失效的同时《中海医疗保健主题股票型证券投资基金基金合同》生效。本基金存续期限不定，原中海上证 380 指数基金于基金



合同失效前经审计的基金资产净值为 41,225,823.70 元，已于本基金的基金合同生效日全部转为本基金的基金资产净值。本基金的基金管理人为中海基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中海医疗保健主题股票型证券投资基金基金合同》的规定，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、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、权证、债券、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金投资组合的配置比例为：本基金投资于股票的比例不低于基金资产的 80%，本基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金投资于医疗保健主题类证券的资产不低于非现金基金资产的 80%。本业绩比较基准为：中证医药卫生指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中海医疗保健主题股票型证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金在本报告期内的会计报表遵循了企业会计准则及其他有关规定。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

## 6.4.6.1

以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

## 6.4.6.2

对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

## 6.4.6.3

对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

## 6.4.6.4

基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
活期存款	8,626,871.19
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	8,626,871.19

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	53,018,077.37	57,231,871.48	4,213,794.11

贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	53,018,077.37	57,231,871.48	4,213,794.11

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金在本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金在本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金在本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	1,418.20
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	167.58
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	29.43
合计	1,615.21

### 6.4.7.6 其他资产

注：本基金在本报告期末未持有其他资产。

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	350,468.30
银行间市场应付交易费用	-
合计	350,468.30

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	682.37
预提费用	44,753.80
其他	4,999.29
合计	50,435.46

**6.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	47,376,235.33	47,376,235.33
本期申购	22,090,152.32	22,090,152.32
本期赎回(以“-”号填列)	-18,394,662.69	-18,394,662.69
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	51,071,724.96	51,071,724.96

注：其中本期申购包含红利再投、转换入份额，本期赎回包含转换出份额。

**6.4.7.10 未分配利润**

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	27,833,913.18	-3,803,105.11	24,030,808.07
本期利润	-9,915,522.18	22,197.66	-9,893,324.52
本期基金份额交易	2,059,229.67	-929,600.53	1,129,629.14

产生的变动数			
其中：基金申购款	10,079,524.14	-4,322,655.51	5,756,868.63
基金赎回款	-8,020,294.47	3,393,054.98	-4,627,239.49
本期已分配利润	-	-	-
本期末	19,977,620.67	-4,710,507.98	15,267,112.69

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	31,083.61
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	4,656.71
其他	727.48
合计	36,467.80

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	336,192,425.26
减：卖出股票成本总额	344,931,415.86
买卖股票差价收入	-8,738,990.60

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

注：本基金在本报告期无债券投资收益。

##### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金在本报告期无债券投资收益—买卖债券差价收入。

##### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金在本报告期无债券投资收益—赎回差价收入。

**6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入**

注：本基金在本报告期无债券投资收益—申购差价收入。

**6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益**

注：本基金在本报告期无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.14 贵金属投资收益****6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金在本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

注：本基金在本报告期无贵金属投资收益—买卖贵金属差价收入。

**6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

注：本基金在本报告期无贵金属投资收益—赎回差价收入。

**6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

注：本基金在本报告期无贵金属投资收益—申购差价收入。

**6.4.7.15 衍生工具收益****6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金在本报告期无衍生工具收益—买卖权证差价收入。

**6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：本基金在本报告期无衍生工具收益—其他投资收益。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	274,723.54
基金投资产生的股利收益	-
合计	274,723.54

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日

1. 交易性金融资产	22,197.66
——股票投资	22,197.66
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	22,197.66

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	96,333.62
转出基金补偿收入	15,281.43
合计	111,615.05

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	988,367.63
银行间市场交易费用	-
合计	988,367.63

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	19,890.78
信息披露费	24,863.02
银行费用	463.00
帐户服务费	6,000.00
合计	51,216.80

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中海基金管理有限公司（“中海基金”）	基金管理人、直销机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
国联证券股份有限公司（“国联证券”）	基金管理人的股东、代销机构

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年6月9日(基金合同生效日)至2015 年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
国联证券	32,436,295.28	4.82%	12,842,235.90	15.06%

#### 6.4.10.1.2 债券交易

注：本报告期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本报告期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

注：本报告期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。



**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国联证券	30,207.50	5.10%	21,982.91	6.27%
关联方名称	上年度可比期间 2015年6月9日(基金合同生效日)至2015年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国联证券	11,691.64	15.88%	11,691.64	11.27%

注 1：上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。权证交易不计佣金。

注 2：该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

**6.4.10.2 关联方报酬****6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年6月9日(基金合同生效日)至 2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	479,788.77	37,907.91
其中：支付销售机构的客户维护费	195,488.51	12,705.88

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数} \quad (H \text{ 为每日应计提的基金管理费, } E \text{ 为前一日的基金资产净值})$$

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年6月9日(基金合同生效日) 至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	79,964.77	6,346.24

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$  (H 为每日应计提的基金托管费, E 为前一日的基金资产净值)

基金托管费每日计算, 逐日累计至每月月底, 按月支付。

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注: 本基金在本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注: 本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

#### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注: 本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位: 人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年6月9日(基金合同生效日)至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	8,626,871.19	31,083.61	13,694,415.26	10,133.81

注: 本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管, 并按银行间同业利率计息。

### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注: 本基金在本报告期及上年度可比期间未通过关联方购买其承销的证券。

### 6.4.11 利润分配情况

#### 6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

注: 本基金在本报告期末未发生利润分配。

### 6.4.12 期末(2016年6月30日)本基金持有的流通受限证券

#### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注: 本基金在本报告期末未因认购新发/增发证券而持有流通受限证券。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位: 人民币元

股票	股票	停牌	停牌	期末	复牌	复牌	数量(股)	期末	期末估值总	备注
----	----	----	----	----	----	----	-------	----	-------	----

代码	名称	日期	原因	估值单价	日期	开盘单价		成本总额	额	
000638	万方发展	2016年1月5日	重大事项停牌	23.68	2016年7月25日	24.75	142,100	3,375,288.00	3,364,928.00	-
002432	九安医疗	2016年6月20日	重大事项停牌	18.14	2016年7月13日	17.90	65,800	1,198,007.60	1,193,612.00	-

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额，因此无抵押债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额，因此无抵押债券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了《中海基金投资决策委员会议事规则》、《中海基金投资业务流程》、《中海基金权限管理办法》、《中海基金研究管理办法》、《中海基金股票库管理办法》等一系列相应的制度和流程来控制这些风险，并设定适当的风险阈值及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续实时监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风控稽核部、相关职能部门和业务部门构成的风险管理架构体系。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行工商银行；因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券(2015 年 12 月 31 日：同)。

#### **6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2016 年 6 月 30 日，本基金所承担的其他/全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### **6.4.13.4 市场风险**

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金等。

下表所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	8,626,871.19	-	-	-	-	-	8,626,871.19
结算备付金	413,771.71	-	-	-	-	-	413,771.71
存出保证金	72,782.73	-	-	-	-	-	72,782.73
交易性金融资产	-	-	-	-	-	57,231,871.48	57,231,871.48
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,248,866.84	1,248,866.84
应收利息	-	-	-	-	-	1,615.21	1,615.21
应收申购款	-	-	-	-	-	127,022.89	127,022.89
资产总计	9,113,425.63	-	-	-	-	58,609,376.42	67,722,802.05
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	610,575.76	610,575.76
应付赎回款	-	-	-	-	-	277,099.96	277,099.96
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	81,758.51	81,758.51
应付托管费	-	-	-	-	-	13,626.41	13,626.41
应付交易费用	-	-	-	-	-	350,468.30	350,468.30
其他负债	-	-	-	-	-	50,435.46	50,435.46
负债总计	-	-	-	-	-	1,383,964.40	1,383,964.40
利率敏感度缺口	9,113,425.63	-	-	-	-	57,225,412.02	66,338,837.65
上年度末 2015年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	4,668,700.67	-	-	-	-	-	4,668,700.67

结算备付金	727,150.12	-	-	-	-	727,150.12
存出保证金	108,791.93	-	-	-	-	108,791.93
交易性金融资产	-	-	-	-	-65,139,435.61	65,139,435.61
应收证券清算款	-	-	-	-	-1,942,441.02	1,942,441.02
应收利息	-	-	-	-	-1,555.00	1,555.00
应收申购款	-	-	-	-	-2,579,871.10	2,579,871.10
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	5,504,642.72	-	-	-	-69,663,302.73	75,167,945.45
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	-2,733,623.19	2,733,623.19
应付赎回款	-	-	-	-	-443,804.82	443,804.82
应付管理人报酬	-	-	-	-	-87,996.83	87,996.83
应付托管费	-	-	-	-	-14,666.10	14,666.10
应付交易费用	-	-	-	-	-405,054.67	405,054.67
其他负债	-	-	-	-	-75,756.44	75,756.44
负债总计	-	-	-	-	-3,760,902.05	3,760,902.05
利率敏感度缺口	5,504,642.72	-	-	-	-65,902,400.68	71,407,043.40

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合比例为：本基金投资于股票的比例不低于基金资产的 80%，本基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，本基金投资于医疗保健主题类证券的资产不低于非现金基金资产的 80%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对

风险进行跟踪和控制。

### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	57,231,871.48	86.27	65,139,435.61	91.22
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	57,231,871.48	86.27	65,139,435.61	91.22

### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	测算组合市场价格风险的数据为沪深 300 指数变动时，股票资产相应的理论变动值。		
	假定沪深 300 指数变化 5%，其他市场变量均不发生变化。		
	Beta 系数是根据报表日持仓资产在过去 100 个交易日收益率与其对应指数收益率回归加权得出，对于交易少于 100 个交易日的资产，默认其波动与市场同步。		
	假定市场无风险利率为一年定期存款利率。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016 年 6 月 30 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	+5%	2,838,850.25	2,975,351.60
-5%	-2,838,850.25	-2,975,351.60	

### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

假设	假定基金收益率的分布服从正态分布。
	根据基金单位净值收益率在报表日过去 100 个交易日的分布情况。
	以 95% 的置信区间计算基金日收益率的绝对 VaR 值（不足 100 个交易日不

	予计算)。		
分析	风险价值	本期末 (2016 年 6 月 30 日)	上年度末 (2015 年 12 月 31 日)
	收益率绝对 VaR(%)	2.46	4.31

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	57,231,871.48	84.51
	其中：股票	57,231,871.48	84.51
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	9,040,642.90	13.35
7	其他各项资产	1,450,287.67	2.14
8	合计	67,722,802.05	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	1,599,475.00	2.41
B	采矿业	-	-
C	制造业	50,991,214.48	76.86
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	4,641,182.00	7.00



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	-	-
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	57,231,871.48	86.27

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600521	华海药业	217,100	5,279,872.00	7.96
2	002007	华兰生物	111,073	3,487,692.20	5.26
3	000638	万方发展	142,100	3,364,928.00	5.07
4	600276	恒瑞医药	69,689	2,795,225.79	4.21
5	000650	仁和药业	337,800	2,756,448.00	4.16
6	002332	仙琚制药	236,600	2,649,920.00	3.99
7	300233	金城医药	100,400	2,599,356.00	3.92
8	600771	广誉远	85,400	2,488,556.00	3.75
9	300326	凯利泰	99,348	2,482,706.52	3.74
10	000423	东阿阿胶	44,515	2,351,727.45	3.55
11	600303	曙光股份	151,400	2,248,290.00	3.39
12	002001	新和成	102,490	2,165,613.70	3.26
13	600006	东风汽车	222,092	1,969,956.04	2.97
14	300294	博雅生物	30,700	1,929,802.00	2.91
15	300143	星河生物	68,500	1,599,475.00	2.41
16	300273	和佳股份	77,821	1,490,272.15	2.25

17	000596	古井贡酒	28,800	1,380,960.00	2.08
18	000568	泸州老窖	46,300	1,375,110.00	2.07
19	002108	沧州明珠	52,385	1,356,771.50	2.05
20	300109	新开源	21,300	1,352,550.00	2.04
21	002675	东诚药业	29,053	1,351,836.09	2.04
22	300147	香雪制药	91,100	1,341,903.00	2.02
23	600199	金种子酒	120,100	1,333,110.00	2.01
24	002435	长江润发	73,000	1,313,270.00	1.98
25	603368	柳州医药	14,700	1,276,254.00	1.92
26	002551	尚荣医疗	53,732	1,256,254.16	1.89
27	002432	九安医疗	65,800	1,193,612.00	1.80
28	300100	双林股份	23,748	1,040,399.88	1.57

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002001	新和成	10,606,222.46	14.85
2	300143	星河生物	8,619,556.03	12.07
3	002589	瑞康医药	7,413,936.20	10.38
4	300294	博雅生物	7,188,012.40	10.07
5	300147	香雪制药	6,934,082.12	9.71
6	600276	恒瑞医药	6,202,866.74	8.69
7	000650	仁和药业	6,045,086.50	8.47
8	600436	片仔癀	5,659,631.38	7.93
9	000423	东阿阿胶	5,493,652.00	7.69
10	002626	金达威	5,439,348.74	7.62
11	002370	亚太药业	5,364,838.00	7.51
12	300109	新开源	5,208,023.00	7.29
13	300326	凯利泰	5,169,439.60	7.24
14	002155	湖南黄金	5,164,642.55	7.23
15	300049	福瑞股份	4,815,032.00	6.74
16	000705	浙江震元	4,798,462.60	6.72
17	002007	华兰生物	4,717,824.00	6.61
18	000513	丽珠集团	4,537,790.64	6.35

19	002133	广宇集团	4,150,153.00	5.81
20	600521	华海药业	3,979,927.64	5.57
21	601607	上海医药	3,636,936.79	5.09
22	600056	中国医药	3,600,683.53	5.04
23	300363	博腾股份	3,576,510.00	5.01
24	600006	东风汽车	3,550,781.00	4.97
25	600489	中金黄金	3,520,519.00	4.93
26	600771	广誉远	3,472,630.95	4.86
27	300100	双林股份	3,282,708.00	4.60
28	000963	华东医药	3,239,393.74	4.54
29	002435	长江润发	3,161,102.14	4.43
30	600216	浙江医药	3,062,259.85	4.29
31	300255	常山药业	3,045,998.80	4.27
32	002044	美年健康	2,949,239.59	4.13
33	002462	嘉事堂	2,796,836.02	3.92
34	000028	国药一致	2,792,767.30	3.91
35	600547	山东黄金	2,743,263.00	3.84
36	002714	牧原股份	2,740,059.45	3.84
37	002551	尚荣医疗	2,715,982.36	3.80
38	002311	海大集团	2,666,474.10	3.73
39	002332	仙琚制药	2,624,564.00	3.68
40	002182	云海金属	2,572,641.50	3.60
41	300233	金城医药	2,542,742.00	3.56
42	002663	普邦园林	2,519,918.00	3.53
43	002411	必康股份	2,487,118.00	3.48
44	000411	英特集团	2,473,317.20	3.46
45	600645	中源协和	2,466,641.00	3.45
46	300336	新文化	2,440,887.00	3.42
47	300003	乐普医疗	2,436,788.00	3.41
48	300078	思创医惠	2,435,017.00	3.41
49	601567	三星医疗	2,424,993.00	3.40
50	002675	东诚药业	2,399,777.88	3.36
51	002245	澳洋顺昌	2,377,275.27	3.33
52	600713	南京医药	2,296,448.00	3.22
53	603108	润达医疗	2,252,868.00	3.15
54	002108	沧州明珠	2,246,904.00	3.15

55	300122	智飞生物	2,219,596.00	3.11
56	000078	海王生物	2,203,080.00	3.09
57	600303	曙光股份	2,195,387.00	3.07
58	600566	济川药业	2,193,247.00	3.07
59	002262	恩华药业	2,155,568.00	3.02
60	600988	赤峰黄金	2,143,080.00	3.00
61	300401	花园生物	1,996,477.24	2.80
62	600285	羚锐制药	1,986,301.00	2.78
63	600763	通策医疗	1,976,318.00	2.77
64	002434	万里扬	1,950,116.00	2.73
65	300273	和佳股份	1,942,152.00	2.72
66	002693	双成药业	1,911,244.54	2.68
67	600529	山东药玻	1,903,909.90	2.67
68	603456	九洲药业	1,883,117.00	2.64
69	300015	爱尔眼科	1,882,176.95	2.64
70	600161	天坛生物	1,864,816.00	2.61
71	000858	五粮液	1,846,864.00	2.59
72	600721	*ST 百花	1,846,340.98	2.59
73	600211	西藏药业	1,838,529.20	2.57
74	300289	利德曼	1,822,617.00	2.55
75	600518	康美药业	1,784,370.71	2.50
76	600519	贵州茅台	1,745,033.00	2.44
77	601886	江河集团	1,733,748.00	2.43
78	002428	云南锗业	1,704,022.00	2.39
79	600682	南京新百	1,697,974.00	2.38
80	601069	西部黄金	1,632,521.00	2.29
81	600998	九州通	1,555,705.00	2.18
82	002664	信质电机	1,514,071.00	2.12
83	300181	佐力药业	1,453,701.00	2.04

注：本报告期内，累计买入股票金额是以股票成交金额（成交单价乘以成交数量）列示的，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
----	------	------	----------	----------------

1	002001	新和成	8,316,835.03	11.65
2	300147	香雪制药	7,839,475.76	10.98
3	002589	瑞康医药	7,375,504.35	10.33
4	300143	星河生物	6,765,562.12	9.47
5	300294	博雅生物	6,475,120.39	9.07
6	300109	新开源	6,330,050.28	8.86
7	002626	金达威	6,011,225.22	8.42
8	600436	片仔癀	5,923,331.92	8.30
9	002462	嘉事堂	5,774,178.02	8.09
10	000705	浙江震元	5,605,927.88	7.85
11	002155	湖南黄金	5,404,375.29	7.57
12	002370	亚太药业	4,858,611.84	6.80
13	300049	福瑞股份	4,807,352.96	6.73
14	000513	丽珠集团	4,767,345.24	6.68
15	300078	思创医惠	4,730,088.78	6.62
16	002172	澳洋科技	4,617,227.73	6.47
17	002020	京新药业	4,542,594.34	6.36
18	600763	通策医疗	4,488,815.35	6.29
19	600645	中源协和	4,173,751.40	5.85
20	600867	通化东宝	4,050,981.34	5.67
21	002007	华兰生物	4,050,444.55	5.67
22	300363	博腾股份	3,748,718.99	5.25
23	002133	广宇集团	3,723,810.51	5.21
24	601607	上海医药	3,713,224.89	5.20
25	600056	中国医药	3,587,242.50	5.02
26	600276	恒瑞医药	3,547,905.99	4.97
27	300401	花园生物	3,465,091.67	4.85
28	600489	中金黄金	3,347,436.82	4.69
29	000423	东阿阿胶	3,319,292.76	4.65
30	000963	华东医药	3,264,769.10	4.57
31	300255	常山药业	3,214,503.00	4.50
32	000650	仁和药业	3,154,327.54	4.42
33	002675	东诚药业	3,009,408.79	4.21
34	002182	云海金属	3,005,947.67	4.21
35	600216	浙江医药	2,892,300.97	4.05
36	000028	国药一致	2,837,501.33	3.97
37	600576	万家文化	2,836,144.00	3.97
38	300326	凯利泰	2,814,938.39	3.94

39	002044	美年健康	2,761,311.01	3.87
40	002714	牧原股份	2,723,294.27	3.81
41	603883	老百姓	2,718,373.25	3.81
42	603108	润达医疗	2,681,641.49	3.76
43	300267	尔康制药	2,646,125.50	3.71
44	002411	必康股份	2,636,955.62	3.69
45	002311	海大集团	2,619,782.00	3.67
46	600547	山东黄金	2,608,975.99	3.65
47	002663	普邦园林	2,564,049.85	3.59
48	300336	新文化	2,482,041.85	3.48
49	601567	三星医疗	2,449,259.15	3.43
50	600713	南京医药	2,409,507.88	3.37
51	000411	英特集团	2,372,803.70	3.32
52	002245	澳洋顺昌	2,362,111.34	3.31
53	600006	东风汽车	2,327,458.88	3.26
54	300122	智飞生物	2,324,610.98	3.26
55	300003	乐普医疗	2,289,822.00	3.21
56	300100	双林股份	2,262,287.00	3.17
57	000078	海王生物	2,244,721.80	3.14
58	600566	济川药业	2,182,322.41	3.06
59	002262	恩华药业	2,143,024.11	3.00
60	000516	国际医学	2,052,128.05	2.87
61	000858	五粮液	2,034,670.47	2.85
62	603456	九洲药业	2,031,448.78	2.84
63	300450	先导智能	2,020,731.00	2.83
64	300015	爱尔眼科	2,011,656.54	2.82
65	600771	广誉远	2,007,564.00	2.81
66	600161	天坛生物	1,991,552.00	2.79
67	600988	赤峰黄金	1,966,422.64	2.75
68	002434	万里扬	1,956,612.80	2.74
69	600518	康美药业	1,914,260.52	2.68
70	002693	双成药业	1,912,345.00	2.68
71	600211	西藏药业	1,898,072.65	2.66
72	600721	*ST 百花	1,884,749.59	2.64
73	600529	山东药玻	1,870,089.00	2.62
74	300289	利德曼	1,846,555.23	2.59
75	601886	江河集团	1,777,020.32	2.49
76	601069	西部黄金	1,758,337.44	2.46

77	600519	贵州茅台	1,756,739.13	2.46
78	002551	尚荣医疗	1,752,149.32	2.45
79	002428	云南锗业	1,648,057.17	2.31
80	002664	信质电机	1,636,368.19	2.29
81	600285	羚锐制药	1,539,591.27	2.16
82	600682	南京新百	1,486,398.38	2.08
83	000681	视觉中国	1,471,263.30	2.06
84	600998	九州通	1,464,999.00	2.05
85	002435	长江润发	1,464,353.35	2.05
86	300081	恒信移动	1,436,676.00	2.01

注：本报告期内，累计卖出股票金额是以股票成交金额（成交单价乘以成交数量）列示的，不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	337,001,654.07
卖出股票收入（成交）总额	336,192,425.26

注：本报告期内，买入股票成本总额和卖出股票收入总额都是以股票成交金额（成交单价乘以成交数量）列示的，不考虑相关交易费用。

### 7.5 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。

### 7.6 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。

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

### 7.8 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贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

### 7.9 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。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 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合约。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

根据基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

### 7.11.2 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合约。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

根据基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 7.12.2

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	72,782.73
2	应收证券清算款	1,248,866.84
3	应收股利	-
4	应收利息	1,615.21
5	应收申购款	127,022.89
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,450,287.67



### 7.12.4 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

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000638	万方发展	3,364,928.00	5.07	重大事项停牌

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
3,737,819	5,143.69	3,737,819.49	7.32%	47,333,905.47	92.68%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	1,506.74	0.0030%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年6月9日）基金份额总额	21,903,185.27
本报告期期初基金份额总额	47,376,235.33
本报告期基金总申购份额	22,090,152.32
减：本报告期基金总赎回份额	18,394,662.69
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	51,071,724.96

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 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

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金自2015年6月9日转型以来，投资策略变更为：主要投资于医疗保健行业上市公司，在控制风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的投资回报。

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金审计的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人、托管机构及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东兴证券	1	100,102,548.77	14.87%	93,225.99	15.74%	-
中信证券	3	95,340,756.60	14.16%	80,362.12	13.56%	-
中信建投	2	69,523,399.94	10.33%	54,127.60	9.14%	-
申万宏源	1	68,349,631.97	10.15%	63,653.60	10.74%	-
招商证券	1	60,532,420.72	8.99%	56,373.80	9.52%	-
方正证券	1	59,294,480.25	8.81%	43,362.30	7.32%	-
国泰君安	2	33,100,833.09	4.92%	30,826.83	5.20%	-
国联证券	1	32,436,295.28	4.82%	30,207.50	5.10%	-
东方证券	1	31,887,114.77	4.74%	29,696.77	5.01%	-
广发证券	1	24,906,427.64	3.70%	23,195.65	3.92%	-
东北证券	2	22,455,443.46	3.34%	20,912.52	3.53%	-
长江证券	1	19,537,272.11	2.90%	18,194.94	3.07%	-
中泰证券	2	19,325,221.42	2.87%	17,997.54	3.04%	-
中银国际	1	14,735,556.47	2.19%	13,723.15	2.32%	-
民生证券	1	11,389,882.89	1.69%	8,329.34	1.41%	-
国金证券	2	10,276,793.95	1.53%	8,267.04	1.40%	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
高华证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
华林证券	1	-	-	-	-	-

海通证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
中建银投证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-

注 1：本基金以券商研究服务质量作为交易单元的选择标准，具体评分指标分为研究支持和服务支持，研究支持包括券商研究报告质量、投资建议、委托课题、业务培训、数据提供等；服务支持包括券商组织上门路演、应我方委托完成的课题研究或专项培训等。根据我公司及基金法律文件中对券商交易单元的选择标准，并参照我公司券商研究服务质量评分标准，确定拟租用交易单元的所属券商名单；由我公司相关部门分别与券商对应部门进行商务谈判，草拟证券交易单元租用协议并汇总修改意见完成协议初稿；报风控稽核部审核后确定租用交易单元。

注 2：本报告期内新增了国金证券的深圳交易单元；因华泰联合证券合并入华泰证券，原华泰联合证券下交易单元全部转入华泰证券；因申银万国证券与宏源证券合并，更名为申万宏源证券，但交易单元暂时不合并，仍分开使用。

注 3：上述佣金按市场佣金率计算，已扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取，并由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

注 4：以上数据由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东兴证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-

国泰君安	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
中建银投证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-

注：本基金未租用证券公司交易单元进行除股票交易之外的其他证券投资。

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中海医疗保健主题证券投资基金 年度最后一日净值公告	中国证券报	2016年1月1日
2	中海基金管理有限公司关于2016	中国证券报	2016年1月4日

	年 1 月 4 日指数熔断期间调整旗下部分基金开放时间的公告		
3	中海基金关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报	2016 年 1 月 5 日
4	中海基金管理有限公司关于旗下基金新增奕丰科技服务（深圳）前海有限公司为销售机构并开通基金转换及定期定额投资业务的公告	中国证券报	2016 年 1 月 6 日
5	中海基金管理有限公司关于旗下场内基金在指数熔断期间暂停申购赎回业务的提示性公告	中国证券报	2016 年 1 月 6 日
6	中海基金管理有限公司关于 2016 年 1 月 7 日指数熔断期间调整旗下部分基金开放时间的公告	中国证券报	2016 年 1 月 7 日
7	中海基金关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报	2016 年 1 月 8 日
8	中海基金关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报	2016 年 1 月 12 日
9	中海基金管理有限公司关于旗下基金新增上海联泰资产管理有限公司为销售机构并开通基金转换及定期定额投资业务的公告	中国证券报	2016 年 1 月 15 日
10	中海医疗保健主题股票型证券投资基金更新招募说明书（2016 年第 1 号）	中海基金网站	2016 年 1 月 22 日

11	中海医疗保健主题股票型证券投资基金更新招募说明书摘要 (2016 年第 1 号)	中国证券报	2016 年 1 月 22 日
12	中海医疗保健主题证券投资基金 2015 年第 4 季度报告	中国证券报	2016 年 1 月 22 日
13	中海基金关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报	2016 年 1 月 27 日
14	中海基金关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报	2016 年 2 月 16 日
15	中海基金管理有限公司关于旗下基金新增北京钱景财富投资管理有限公司为销售机构并开通基金转换及定期定额投资业务的公告	中国证券报	2016 年 2 月 18 日
16	中海基金管理有限公司关于从业人员在子公司兼任职务及领薪情况的公告	中国证券报	2016 年 2 月 19 日
17	关于中海基金网上直销调整“e 通宝”认购、申购、定投优惠费率的公告	中国证券报	2016 年 3 月 22 日
18	中海医疗保健主题股票型证券投资基金 2015 年年度报告	中海基金网站	2016 年 3 月 25 日
19	中海医疗保健主题股票型证券投资基金 2015 年年度报告摘要	中国证券报	2016 年 3 月 25 日
20	中海基金管理有限公司关于旗下基金参加深圳市新兰德证券投资咨询有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报	2016 年 3 月 30 日

21	中海基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报	2016 年 3 月 30 日
22	中海基金管理有限公司关于调整网上直销系统招商银行网银支付费率优惠的公告	中国证券报	2016 年 4 月 8 日
23	中海基金管理有限公司关于旗下基金新增中经北证（北京）资产管理有限公司为销售机构并开通基金转换及定期定额投资业务的公告	中国证券报	2016 年 4 月 13 日
24	中海医疗保健主题股票型证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	中国证券报	2016 年 4 月 21 日
25	中海基金管理有限公司关于支付宝基金支付业务下线的公告	中国证券报	2016 年 4 月 28 日
26	中海基金管理有限公司关于官方淘宝店停止认、申购业务的公告	中国证券报	2016 年 4 月 28 日
27	中海基金管理有限公司关于旗下基金新增北京展恒基金销售股份有限公司为销售机构并开通基金转换及定期定额投资业务的公告	中国证券报	2016 年 5 月 5 日
28	中海基金管理有限公司关于旗下部分基金新增深圳市金斧子投资咨询有限公司为销售机构并开通基金转换及定期定额投资业务的公告	中国证券报	2016 年 5 月 11 日
29	中海基金管理有限公司关于旗下部分基金参加珠海盈米财富管理	中国证券报	2016 年 5 月 30 日



	有限公司转换费率优惠活动的公告		
30	中海基金管理有限公司关于旗下基金新增北京广源达信投资管理有限公司为销售机构并开通基金转换及定期定额投资业务的公告	中国证券报	2016年6月8日
31	中海基金管理有限公司关于旗下部分基金在上海陆金所资产管理有限公司开通基金定期定额投资业务的公告	中国证券报	2016年6月8日
32	中海基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海中正达广投资管理有限公司为销售机构并开通基金转换及定期定额投资业务的公告	中国证券报	2016年6月15日
33	中海基金管理有限公司关于旗下部分基金新增乾道金融信息服务（北京）有限公司为销售机构并开通基金转换及定期定额投资业务的公告	中国证券报	2016年6月15日
34	中海基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行股份有限公司网上银行及手机银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报	2016年6月24日
35	中海基金管理有限公司关于旗下基金参与京东基金费率优惠活动的公告	中国证券报	2016年6月28日

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准募集中海上证 380 指数证券投资基金的文件
- 2、中海上证 380 指数证券投资基金基金合同、中海医疗保健主题证券投资基金合同
- 3、中海上证 380 指数证券投资基金托管协议、中海医疗保健主题证券投资基金协议
- 4、中海上证 380 指数证券投资基金财务报表及报表附注、中海医疗保健主题证券投资基金财务报表及报表附注
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

### 11.2 存放地点

上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层

### 11.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人中海基金管理有限公司。

咨询电话：(021)38789788 或 400-888-9788

公司网址：<http://www.zhfund.com>

中海基金管理有限公司  
2016 年 8 月 24 日