

华润元大医疗保健量化混合型 证券投资基金 2016 年年度报告

2016 年 12 月 31 日

基金管理人：华润元大基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 29 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 28 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。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

| | |
|--|-----------|
| §1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示..... | 2 |
| 1.2 目录..... | 3 |
| §2 基金简介 | 5 |
| 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..... | 6 |
| 2.4 信息披露方式..... | 6 |
| 2.5 其他相关资料..... | 6 |
| §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 | 7 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 7 |
| 3.2 基金净值表现..... | 7 |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况..... | 9 |
| §4 管理人报告 | 10 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 10 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明..... | 11 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 11 |
| 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..... | 12 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 12 |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况..... | 13 |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 13 |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 13 |
| 4.9 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..... | 14 |
| §5 托管人报告 | 14 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 14 |
| 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..... | 14 |
| 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见..... | 14 |
| §6 审计报告 | 15 |
| 6.1 审计报告基本信息..... | 15 |
| 6.2 审计报告的基本内容..... | 15 |
| §7 年度财务报表 | 16 |
| 7.1 资产负债表..... | 16 |
| 7.2 利润表..... | 17 |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 18 |
| 7.4 报表附注..... | 19 |
| §8 投资组合报告 | 40 |
| 8.1 期末基金资产组合情况..... | 40 |
| 8.2 期末按行业分类的股票投资组合..... | 40 |
| 8.3 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..... | 41 |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 42 |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 48 |
| 8.6 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..... | 48 |
| 8.7 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..... | 48 |

| | | |
|------------|---|-----------|
| 8.8 | 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 | 48 |
| 8.9 | 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 | 48 |
| 8.10 | 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 | 48 |
| 8.11 | 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 48 |
| 8.12 | 投资组合报告附注 | 49 |
| §9 | 基金份额持有人信息 | 50 |
| 9.1 | 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 50 |
| 9.2 | 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 50 |
| 9.3 | 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 | 50 |
| §10 | 开放式基金份额变动 | 50 |
| §11 | 重大事件揭示 | 51 |
| 11.1 | 基金份额持有人大会决议 | 51 |
| 11.2 | 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 | 51 |
| 11.3 | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 51 |
| 11.4 | 基金投资策略的改变 | 51 |
| 11.5 | 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 51 |
| 11.6 | 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 | 51 |
| 11.7 | 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 51 |
| 11.8 | 其他重大事件 | 53 |
| §12 | 影响投资者决策的其他重要信息 | 56 |
| §13 | 备查文件目录 | 57 |
| 13.1 | 备查文件目录 | 57 |
| 13.2 | 存放地点 | 57 |
| 13.3 | 查阅方式 | 57 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|---------------------|
| 基金名称 | 华润元大医疗保健量化混合型证券投资基金 |
| 基金简称 | 华润元大医疗保健量化混合 |
| 基金主代码 | 000646 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2014 年 8 月 18 日 |
| 基金管理人 | 华润元大基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国农业银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 42,640,351.97 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股票，通过量化与基本面相结合的方法，精选优质上市公司，在控制风险、确保基金资产流动性的前提下，获取基金资产的长期增值，力争实现超越业绩比较基准的长期收益。 |
| 投资策略 | <p>1、大类资产配置策略 宏观经济、政策法规以及证券市场表现为资产配置策略的主要考量因素。</p> <p>2、股票投资策略 股票投资策略是本基金的核心部分，本基金将结合定量与定性分析，充分发挥基金管理人研究团队和投资团队的选股能力，选择具有长期持续增长能力的公司。</p> <p>3、债券投资策略 本基金的债券投资采取稳健的投资管理方式，获得与风险相匹配的投资收益，以实现在一定程度上规避股票市场的系统性风险和保证基金资产的流动性。</p> <p>4、股指期货投资策略 本基金将以股指期货为主要的金融衍生工具，与资产配置策略进行搭配。</p> <p>5、权证投资策略 本基金管理人将以价值分析为基础，在采用权证定价模型分析其合理定价的基础上，充分考量可投权证品种的收益率、流动性及风险收益特征，通过资产配置、品种与类属选择，力求规避投资风险、追求稳定的风险调整后收益。</p> <p>6、资产支持证券投资策略 本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。</p> <p>7、现金管理 在现金管理上，本基金通过对未来现金流的预测进行现金预算管理，及时满足本基金运作中的流动性需求。</p> |
| 业绩比较基准 | 中证医药卫生指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20% |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，属于证券投资基金中的高风险品种，预期风险和预期收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。 |

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 | | 华润元大基金管理有限公司 | 中国农业银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 何特 | 林葛 |
| | 联系电话 | 0755-88399015 | 010-66060069 |
| | 电子邮箱 | hete@cryuantafund.com | tgxxpl@abchina.com |
| 客户服务电话 | | 4000-1000-89 | 95599 |
| 传真 | | 0755-88399045 | 010-68121816 |
| 注册地址 | | 深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司） | 北京市东城区建国门内大街69号 |
| 办公地址 | | 深圳市福田区中心四路1-1号嘉里建设广场第三座7层 | 北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座9层 |
| 邮政编码 | | 518048 | 100031 |
| 法定代表人 | | 刘小腊 | 周慕冰 |

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》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》 |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.cryuantafund.com |
| 基金年度报告备置地点 | 基金管理人和基金托管人的办公场所 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|--------------------|-------------------------------|
| 会计师事务所 | 安永华明会计师事务所（特殊普通合伙） | 北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室 |
| 注册登记机构 | 华润元大基金管理有限公司 | 深圳市福田区中心四路1-1号嘉里建设广场第三座7层 |

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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 | 2016 年 | 2015 年 | 2014 年 8 月 18 日(基金合同生效日)-2014 年 12 月 31 日 |
|---------------|---------------|---------------|---|
| 本期已实现收益 | 5,828,797.06 | -1,715,739.44 | 5,213,423.89 |
| 本期利润 | -5,131,320.55 | 3,875,092.63 | 8,636,485.27 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.1220 | 0.0859 | 0.0430 |
| 本期加权平均净值利润率 | -9.49% | 6.21% | 4.21% |
| 本期基金份额净值增长率 | -10.68% | 53.14% | 0.30% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2016 年末 | 2015 年末 | 2014 年末 |
| 期末可供分配利润 | 7,713,117.65 | 1,199,847.02 | 229,561.05 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.1809 | 0.0309 | 0.0029 |
| 期末基金资产净值 | 58,508,167.00 | 59,653,587.25 | 80,204,642.79 |
| 期末基金份额净值 | 1.372 | 1.536 | 1.003 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2016 年末 | 2015 年末 | 2014 年末 |
| 基金份额累计净值增长率 | 37.20% | 53.60% | 0.30% |

注：1、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。

2、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、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

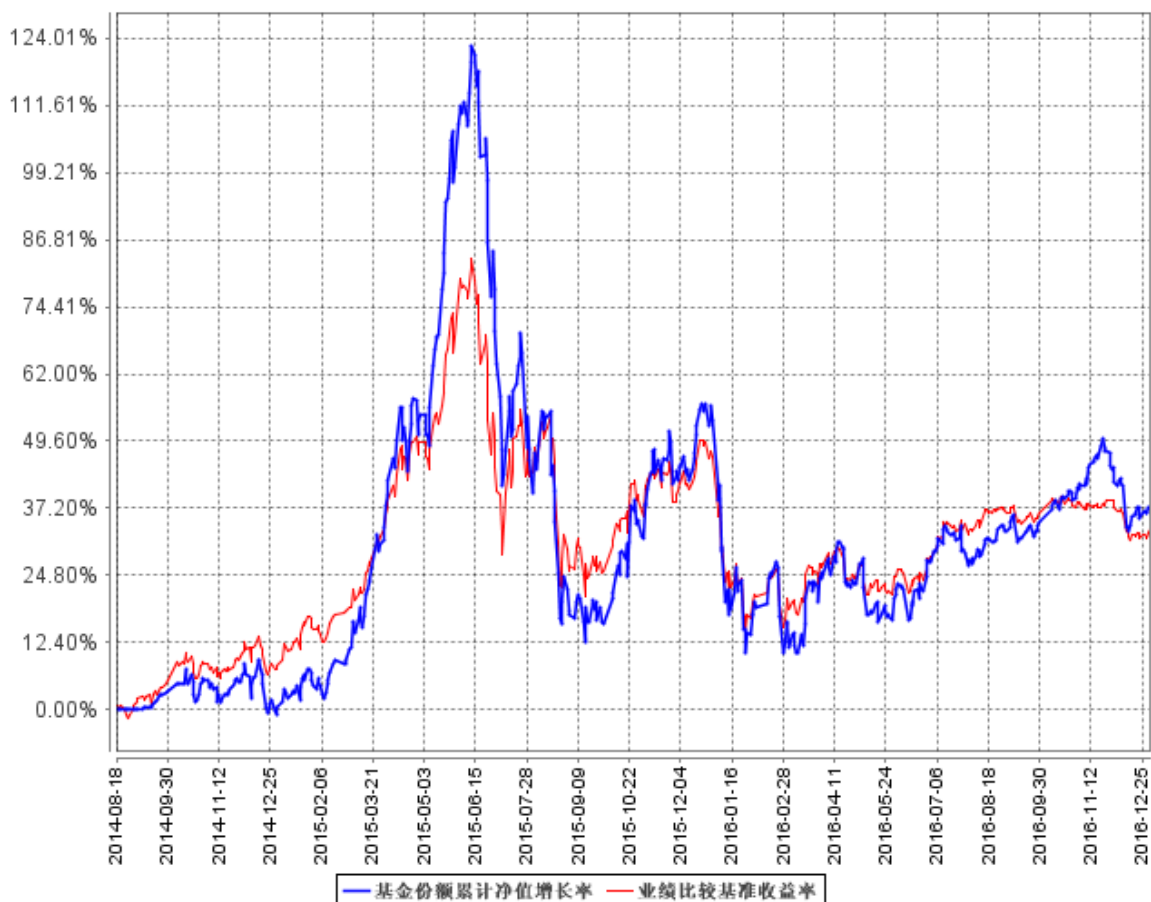
3.2 基金净值表现

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 |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 2.01% | 1.05% | -2.53% | 0.55% | 4.54% | 0.50% |
| 过去六个月 | 7.61% | 1.00% | 3.56% | 0.62% | 4.05% | 0.38% |
| 过去一年 | -10.68% | 1.90% | -9.62% | 1.32% | -1.06% | 0.58% |
| 自基金合同生效起至今 | 37.20% | 2.11% | 32.74% | 1.64% | 4.46% | 0.47% |

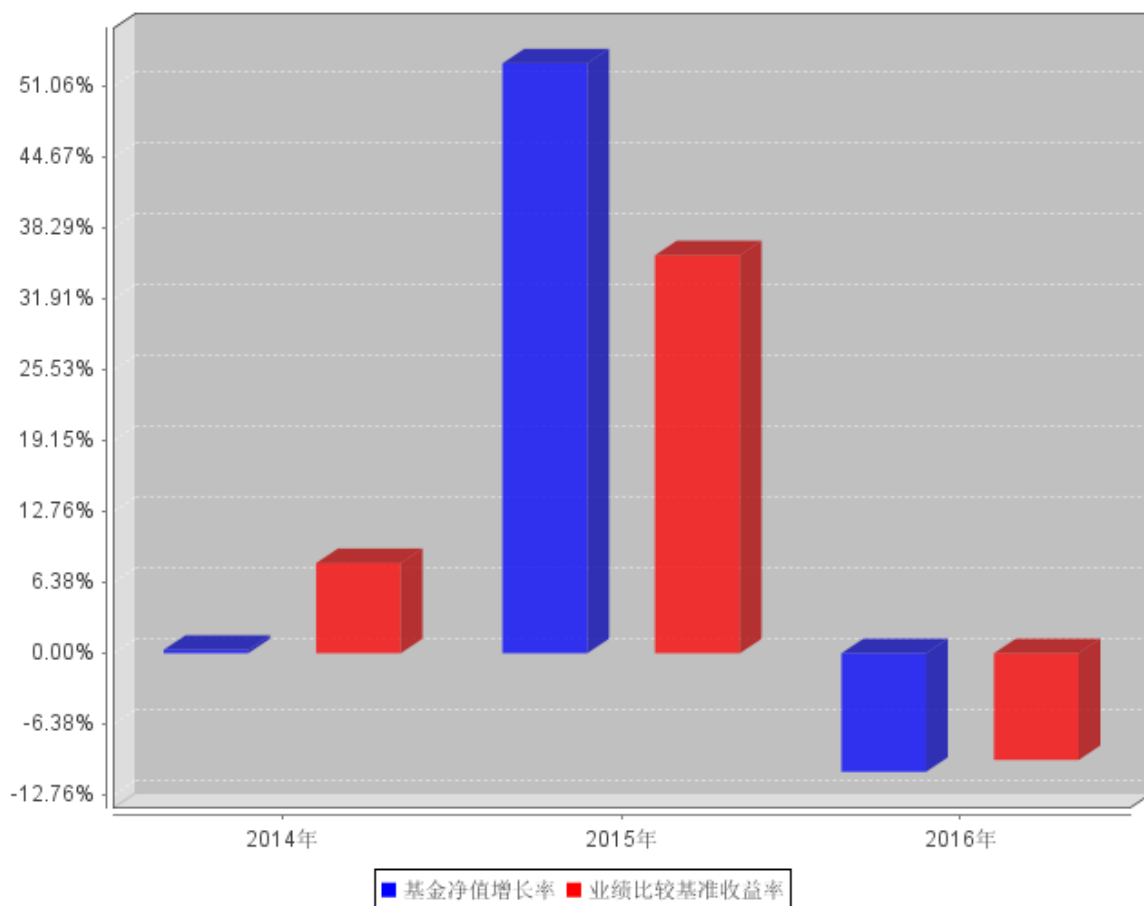
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金基金合同生效日为 2014 年 8 月 18 日，基金合同生效日至 2014 年 12 月 31 日，本基金运作时间未满一年。图示中 2014 年本基金的净值增长率及业绩基准的收益率根据当年实际存续期（2014 年 8 月 18 日至 2014 年 12 月 31 日）计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：截止本报告期末，本基金未进行利润分配。

§ 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

华润元大基金管理有限公司经中国证监会证监许可【2012】1746 号文批准，于 2013 年 1 月 17 日完成工商登记注册，总部位于深圳，注册资本 3 亿元人民币。公司由华润深国投信托有限公司和台湾元大证券投资信托股份有限公司共同发起设立，占股比例分别为 51% 和 49%。截至 2016 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理十只开放式基金：华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金，华润元大现金收益货币市场基金，华润元大信息传媒科技混合型证券投资基金，华润元大医疗保健量化混合型证券投资基金，华润元大富时中国 A50 指数型证券投资基金，华润元大中创 100 交易型开放式指数证券投资基金，华润元大稳健收益债券型证券投资基金，华润元大中创 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金，华润元大现金货币市场基金，华润元大润鑫债券型证券投资基金。

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 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|---|-----------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 袁华涛 | 华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理、华润元大医疗保健量化混合型证券投资基金基金经理、华润元大信息传媒科技混合型证券投资基金基金经理 | 2015 年 9 月 15 日 | - | 7 年 | 曾任华泰证券股份有限公司研究员，华泰证券（上海）资产管理有限公司量化投资经理。2015 年 9 月 15 日起担任华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 9 月 15 日起担任华润元大医疗保健量化混合型证券投资基金基金经理，2016 年 8 月 5 日起担任华润元大信息传媒科技混合型证券投资基金基金经理。中国，西南财经大学金融学博士，具有基金从业资格。 |
| 石武斌 | 华润元大富时中国 A50 指数型证券投资基金基金经理、华润元大医疗保健量化混合型证券投资基金基金经理 | 2016 年 8 月 5 日 | - | 5 年 | 曾任国海证券股份有限公司证券资产管理分公司量化投资研究员，2016 年 4 月 22 日起担任华润元大富时中国 A50 指数型证券投资基金基金经理，2016 年 8 月 5 日起担任华润元大医疗保健量化混合型证券投资基金基金经理。中国，中国人民大学概率论与数理统计硕士，具有基金从业资格。 |

注：1. 基金经理任职日期和离任日期为公司作出决定后正式对外公告之日；担任新成立基金的基

金经理，即基金的首任基金经理，其任职日期为基金合同生效日。

2. 证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中的相关规定。

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循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，没有损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规，公司制订了《华润元大基金管理有限公司公平交易管理办法》，对投资决策的内部控制、研究的内部控制、交易执行的内部控制、公平交易的实施效果评估与监察稽核、信息披露和报告等进行了规定，以确保公司旗下管理的不同投资组合得到公平对待，保护投资者合法权益。公司对所有投资品种实行集中交易制度，严格遵循时间优先、价格优先的公平交易原则，同时对可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，对不同投资组合间同向交易的交易价差进行分析，防止利益输送的发生。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，基金管理人严格遵守法律法规及公司内部制度关于公平交易的相关规定，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，公平交易制度执行情况良好，未发生违反公平交易制度的行为。

本报告期内，基金管理人对旗下管理的不同投资组合间在连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3日内、5日内）的同向交易交易价差进行分析，分析结果表明旗下组合的同向交易情况正常，价差均在可合理解释范围之内。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。基金管理人管理的所有投资组合未存在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超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

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 年中国宏观经济继续疲软，央行货币政策亦不如过往两年宽松，一月份由于熔断机制等多重原因的叠加导致股市暴跌，2 月份开始呈现结构性的行情。全年看，超 70% 的股票下跌，上证指数下跌 12.31%，创业板指数下跌 27.71%，中证医药行业指数下跌 12.12%。从已公布的数据来看，医药行业的营收和增速均稳中有升，相比其它行业仍处于中上游的水平。医药行业政策方面，国家先后出台“健康中国 2030”规划纲要、医保目录调整方案、以及《医药工业发展规划指南》。上述政策旨在加快医药工业由快到强的转变，其中提及，到 2020 年医药行业收入保持中高速增长年均增速高于 10% 等具体指标，以及提到 2020 年健康服务产业总规模超过 8 万亿元人民币，到 2030 年达到 16 万亿元等。诸如此类的政策都将对医药行业发展带来长期重大利好。

报告期内，基金净值增长率为-10.68%，取得与业绩比较基准基本一致的业绩表现。本基金自 8 月下旬起，更多的使用量化投资策略，通过多因子模型来做选股决策，以期达到跑赢基准的目的。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，基金净值增长率为-10.68%，取得与业绩比较基准基本一致的业绩表现。

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 年中国经济实际增速为 6.7%，全年经济整体维持 L 型走势，依然保持中高速增长。中央经济工作会议指出，经济形势总的特点是缓中趋稳、稳中向好，经济运行保持在合理区间，质量和效益提高。我们预测 2017 年 GDP 全年增速降到 6.6%。经济增长有政府托底，经济下滑不会失速。尽管制造业和基建投资将对地产投资下滑的部分影响，但预计 2017 年固定资产投资增速仍将在 2016 年基础上小幅下行；消费增速稳健，出口面临改善机遇但难言大幅改善，三大需求对经济增速的边际贡献率增长空间均不大。我国经济结构在逐步发生转变，未来消费对 GDP 的贡献率或将稳定超过固定资本形成。预计 2017 全年温和通胀，PPI 显著回升。中央经济工作会议定调 2017 年是供给侧结构性改革深化之年，财政政策更加积极有效，货币政策保持稳健中性，汇率增强弹性并在合理均衡水平基本稳定。要把防控金融风险放到更重要位置，防控资产泡沫，确保不发生系统性金融风险。

展望未来，2017 年大类资产配置或转向股票市场。当前货币政策边际收紧，对债市和房市的影响相对更为直接，而股市历经 2015 年以来的多次股灾后，估值相对合理，部分资金可能从债市和房市流向股市。当前依然处于“资产荒”的时代，以险资为代表的机构资金将依然会积极配置

股市。医药行业，受宏观经济影响相对较小，营收和增速稳中有升，在各行业始终处于中上游水平，且政策方面的催化剂也相对较多，2017 年将继续迎来较快较好的发展。医药行业的股票，是个防御兼具进攻的板块，在当前整体风险偏好不高的环境下，很可能在 2017 年获得资金的持续青睐。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发，依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。

公司按照规定的权限和程序，通过实时监控、现场检查、重点抽查和人员询问等方法，独立地开展基金运作和公司管理的合规性稽核，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事会和公司管理层出具监察稽核报告。

公司采取事前防范、事中控制和事后监督等三阶段工作，加强了对日常投资运作的管理和监控，保证投资遵循既定的投资决策程序与业务流程，基金各项投资符合比例控制的要求，严格执行分级授权制度，保证基金投资独立、公平。

本基金管理人承诺将坚持以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，为基金持有人谋求最大利益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、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。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的专门机构，组成人员包括督察长、投资风险负责人、证券研究工作负责人、法律监察负责人及基金会计负责人等。该机构成员均具备专业胜任能力和相关从业资格，精通各自领域的理论知识，熟悉相关政策法规，并具有丰富的实践经验。同时，根据基金管理公司制定的相关制度，估值工作决策机构的成员中不包括基金经理。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.9 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

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—华润元大基金管理有限公司 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，华润元大基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，华润元大基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

| | |
|------------|------------------------------|
| 财务报表是否经过审计 | 是 |
| 审计意见类型 | 标准无保留意见 |
| 审计报告编号 | 安永华明(2017)审字第 61032987_H04 号 |

6.2 审计报告的基本内容

| 审计报告标题 | 审计报告 | |
|--------------|--|----|
| 审计报告收件人 | 华润元大医疗保健量化混合型证券投资基金全体基金份额持有人 | |
| 引言段 | 我们审计了后附的华润元大医疗保健量化混合型证券投资基金财务报表,包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表,2016 年度的利润表及所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。 | |
| 管理层对财务报表的责任段 | <p>编制和公允列报财务报表是基金管理人华润元大基金管理有限公司的责任。这种责任包括:</p> <p>(1)按照企业会计准则的规定编制财务报表,并使其实现公允反映;</p> <p>(2)设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> | |
| 注册会计师的责任段 | <p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> | |
| 审计意见段 | 我们认为,上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了华润元大医疗保健量化混合型证券投资基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和净值变动情况。 | |
| 注册会计师的姓名 | 吴翠蓉 | 高鹤 |
| 会计师事务所的名称 | 安永华明会计师事务所(特殊普通合伙) | |
| 会计师事务所的地址 | 北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室 | |
| 审计报告日期 | 2017 年 3 月 27 日 | |

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华润元大医疗保健量化混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2016 年 12 月 31 日 | 上年度末 2015 年 12 月 31 日 |
|-----------------|------------|---------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 7.4.7.1 | 2,818,160.10 | 6,110,098.16 |
| 结算备付金 | | 464,188.19 | 77,535.08 |
| 存出保证金 | | 49,222.01 | 122,897.62 |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 54,548,489.10 | 53,740,406.74 |
| 其中：股票投资 | | 54,548,489.10 | 53,740,406.74 |
| 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 | 7.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 7.4.7.4 | - | 1,000,000.00 |
| 应收证券清算款 | | 1,300,946.11 | - |
| 应收利息 | 7.4.7.5 | 1,066.53 | 1,209.50 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 169,923.12 | 329,177.60 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 7.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 59,351,995.16 | 61,381,324.70 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2016 年 12 月 31 日 | 上年度末 2015 年 12 月 31 日 |
| 负债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 7.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | - | 1,000,000.00 |
| 应付赎回款 | | 110,541.77 | 504,854.83 |
| 应付管理人报酬 | | 75,769.63 | 72,757.46 |
| 应付托管费 | | 12,628.26 | 12,126.25 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 7.4.7.7 | 194,755.94 | 87,331.94 |
| 应交税费 | | - | - |

| | | | |
|---------------|----------|---------------|---------------|
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 7.4.7.8 | 450,132.56 | 50,666.97 |
| 负债合计 | | 843,828.16 | 1,727,737.45 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 7.4.7.9 | 42,640,351.97 | 38,838,395.60 |
| 未分配利润 | 7.4.7.10 | 15,867,815.03 | 20,815,191.65 |
| 所有者权益合计 | | 58,508,167.00 | 59,653,587.25 |
| 负债和所有者权益总计 | | 59,351,995.16 | 61,381,324.70 |

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.372 元，基金份额总额 42,640,351.97 份。

7.2 利润表

会计主体：华润元大医疗保健量化混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日 |
|------------------------|------------|---|--|
| 一、收入 | | -2,688,761.62 | 6,643,949.81 |
| 1. 利息收入 | | 51,644.14 | 89,471.34 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.11 | 46,293.52 | 85,304.67 |
| 债券利息收入 | | 315.07 | - |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 5,035.55 | 4,166.67 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | 7,568,402.15 | -113,137.72 |
| 其中：股票投资收益 | 7.4.7.12 | 7,363,235.49 | -279,162.59 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 7.4.7.13 | - | - |
| 资产支持证券投资收益 | 7.4.7.13.5 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 7.4.7.14 | - | - |
| 衍生工具收益 | 7.4.7.15 | - | - |
| 股利收益 | 7.4.7.16 | 205,166.66 | 166,024.87 |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.17 | -10,960,117.61 | 5,590,832.07 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 7.4.7.18 | 651,309.70 | 1,076,784.12 |
| 减：二、费用 | | 2,442,558.93 | 2,768,857.18 |
| 1. 管理人报酬 | 7.4.10.2.1 | 808,222.32 | 936,431.57 |
| 2. 托管费 | 7.4.10.2.2 | 134,703.73 | 156,071.98 |
| 3. 销售服务费 | 7.4.10.2.3 | - | - |

| | | | |
|----------------------------|----------|---------------|--------------|
| 4. 交易费用 | 7.4.7.19 | 1,023,985.12 | 1,205,447.98 |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 其他费用 | 7.4.7.20 | 475,647.76 | 470,905.65 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -5,131,320.55 | 3,875,092.63 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -5,131,320.55 | 3,875,092.63 |

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华润元大医疗保健量化混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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） | 38,838,395.60 | 20,815,191.65 | 59,653,587.25 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | -5,131,320.55 | -5,131,320.55 |
| 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） | 3,801,956.37 | 183,943.93 | 3,985,900.30 |
| 其中：1. 基金申购款 | 68,335,648.58 | 14,788,685.18 | 83,124,333.76 |
| 2. 基金赎回款 | -64,533,692.21 | -14,604,741.25 | -79,138,433.46 |
| 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） | 42,640,351.97 | 15,867,815.03 | 58,508,167.00 |
| 项目 | 上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 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） | 79,975,081.74 | 229,561.05 | 80,204,642.79 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 3,875,092.63 | 3,875,092.63 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 | -41,136,686.14 | 16,710,537.97 | -24,426,148.17 |

| | | | |
|--|-----------------|----------------|-----------------|
| (净值减少以“-”号填列) | | | |
| 其中：1. 基金申购款 | 119,779,332.45 | 84,121,252.47 | 203,900,584.92 |
| 2. 基金赎回款 | -160,916,018.59 | -67,410,714.50 | -228,326,733.09 |
| 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） | 38,838,395.60 | 20,815,191.65 | 59,653,587.25 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

 孙晔伟 崔佩伦 崔佩伦
 基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华润元大医疗保健量化混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)原名华润元大医疗保健量化股票型证券投资基金,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[2014]472号《关于核准华润元大医疗保健量化股票型证券投资基金募集的批复》核准,由华润元大基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华润元大医疗保健量化股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次募集期间为2014年7月9日至2014年8月12日,首次设立募集不包括认购资金利息共募集406,738,268.41元,经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明(2014)验字第61032987_H03号验资报告。经向中国证监会备案,《华润元大医疗保健量化股票型证券投资基金基金合同》于2014年8月18日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为406,876,288.32份基金份额,其中认购资金利息折合138,019.91份基金份额。本基金的基金管理人为华润元大基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司(以下简称“中国农业银行”)。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《关于实施〈公开募集证券投资基金运作管理办法〉有关问题的规定》及基金合同的有关规定,经与基金托管人协商一致,并报中国证监会备案,本基金自2015年8月3日起由股票型证券投资基金更名为混合型证券投资基金

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华润元大医疗保健量化混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行的股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、股指期货、银行存款、资产支持证券等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）。本基金的投资组合比例为：本基金股票投资比例范围为基金资产的 60%-95%，本基金投资医疗行业上市公司股票的比例不少于非现金基金资产的 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，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：中证医药卫生指数收益率*80%+中债综合指数收益率*20%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息系根据下列企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计而编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及贷款和应收款项；

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票、债券和衍生工具等投资。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、结算备付金、买入返售金融资产和各类应收款项等。

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。

本基金持有的金融负债均划分为其他金融负债，主要包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

初始确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产取得时发生的相关交易费用计入当期损益；应收款项及其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

后续计量

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产采用公允价值进行后续计量。在持有该类金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；应收款项及其他金融负债采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量，其摊销或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

终止确认

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

金融资产转移

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票、债券、基金和衍生工具等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值的，应对最近交易的市价进行调整，确定公允价值。

(2) 不存在活跃市场的金融工具，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定公允价值。本基金采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得或取得不

切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。

(3) 如有确凿证据表明按上述估值原则仍不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能适当反映公允价值的价格估值。

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认,并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账;

(8) 股利收益于除息日确认,并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账;

(9) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失;

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方,经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5%的年费率逐日计提;

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率逐日计提;

(3) 卖出回购金融资产支出,按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率)在回购期内逐日计提;

(4) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定,按实际支出金额,列入当期基金费用。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为 4 次,每份基金份额每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 20%,若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配;

(2) 本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;

(4) 每一基金份额享有同等分配权;

(5) 法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

7.4.4.12 分部报告

-

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要会计政策和会计估计需要披露。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的重大会计差错更正。

7.4.6 税项

7.4.6.1 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

7.4.6.2 营业税、增值税、企业所得税

证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，免征营业税。

自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税。金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务、买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；根据财政部、国家税务总局财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》的规定，2017 年 7 月 1 日（含）以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资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。

7.4.6.3 个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利、债券的利息及储蓄利息时代扣代缴个人所得税。

基金从上市公司分配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，减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2016 年 12 月 31 日 | 上年度末 2015 年 12 月 31 日 |
|----------------|-------------------------|--------------------------|
| 活期存款 | 2,818,160.10 | 6,110,098.16 |
| 定期存款 | - | - |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | - | - |
| 其他存款 | - | - |
| 合计： | 2,818,160.10 | 6,110,098.16 |

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2016 年 12 月 31 日 | | |
|---------------|--------------------------|---------------|---------------|
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 56,494,713.26 | 54,548,489.10 | -1,946,224.16 |
| 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 | 56,494,713.26 | 54,548,489.10 | -1,946,224.16 |
| 项目 | 上年度末 2015 年 12 月 31 日 | | |
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 44,726,513.29 | 53,740,406.74 | 9,013,893.45 |
| 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 | 44,726,513.29 | 53,740,406.74 | 9,013,893.45 |

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金于本期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2016年12月31日 | |
|--------|---------------------|-----------|
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 合计 | - | - |
| 项目 | 上年度末 2015年12月31日 | |
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 买入返售证券 | 1,000,000.00 | - |
| 合计 | 1,000,000.00 | - |

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金于本期末及上年度末均无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2016年12月31日 | 上年度末 2015年12月31日 |
|------------|--------------------|---------------------|
| 应收活期存款利息 | 812.43 | 1,110.39 |
| 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 | 229.79 | 38.28 |
| 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 | 24.31 | 60.83 |
| 合计 | 1,066.53 | 1,209.50 |

注：其他为应收结算保证金利息。

7.4.7.6 其他资产

注：本基金于本期末及上年度末均未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2016年12月31日 | 上年度末 2015年12月31日 |
|-------------|--------------------|---------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 194,755.94 | 87,331.94 |
| 银行间市场应付交易费用 | - | - |
| 合计 | 194,755.94 | 87,331.94 |

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2016年12月31日 | 上年度末 2015年12月31日 |
|-------------|--------------------|---------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - | - |
| 应付赎回费 | 132.56 | 666.97 |
| 预提审计费 | 50,000.00 | 50,000.00 |
| 预提信息披露费 | 400,000.00 | - |
| 合计 | 450,132.56 | 50,666.97 |

7.4.7.9 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12月31日 | |
|---------------|-----------------------------|----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 38,838,395.60 | 38,838,395.60 |
| 本期申购 | 68,335,648.58 | 68,335,648.58 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -64,533,692.21 | -64,533,692.21 |
| - 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 | 42,640,351.97 | 42,640,351.97 |

注：申购份额含红利再投、转换入份额，赎回份额含转换出份额。

7.4.7.10 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 | 1,199,847.02 | 19,615,344.63 | 20,815,191.65 |

| | | | |
|----------------|--------------|----------------|----------------|
| 本期利润 | 5,828,797.06 | -10,960,117.61 | -5,131,320.55 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 684,473.57 | -500,529.64 | 183,943.93 |
| 其中：基金申购款 | -231,342.39 | 15,020,027.57 | 14,788,685.18 |
| 基金赎回款 | 915,815.96 | -15,520,557.21 | -14,604,741.25 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 7,713,117.65 | 8,154,697.38 | 15,867,815.03 |

7.4.7.11 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12月31日 | 上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年12月31日 |
|-----------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 活期存款利息收入 | 41,043.55 | 77,704.82 |
| 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 | 4,304.40 | 6,187.95 |
| 其他 | 945.57 | 1,411.90 |
| 合计 | 46,293.52 | 85,304.67 |

注：其他为结算保证金利息收入。

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 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12月31日 | 上年度可比期间 2015年1月1日至2015 年12月31日 |
|------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 335,366,400.29 | 403,610,733.14 |
| 减：卖出股票成本总额 | 328,003,164.80 | 403,889,895.73 |
| 买卖股票差价收入 | 7,363,235.49 | -279,162.59 |

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

注：本基金于本期及上年度可比期间均无债券投资收益。

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016年1月1日至 2016年12月31日 | 上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年12月31日 |
|-----------------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额 | 1,013,250.69 | - |

| | | |
|-------------------------|--------------|---|
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 1,000,900.00 | - |
| 减：应收利息总额 | 12,350.69 | - |
| 买卖债券差价收入 | 0.00 | - |

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

-

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

-

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金于本期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金于本期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金于本期及上年度可比期间均无衍生工具投资收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016年1月1日至 2016年12月31日 | 上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年12月31日 |
|-------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 205,166.66 | 166,024.87 |
| 基金投资产生的股利收益 | - | - |
| 合计 | 205,166.66 | 166,024.87 |

7.4.7.17 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12月31日 | 上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年12月31日 |
|------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | -10,960,117.61 | 5,590,832.07 |
| ——股票投资 | -10,960,117.61 | 5,590,832.07 |
| ——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 | -10,960,117.61 | 5,590,832.07 |

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016年1月1日至 2016年12月31日 | 上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年12月31日 |
|---------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 648,263.59 | 1,016,375.12 |
| 基金转换费收入 | 3,046.11 | 60,409.00 |
| 合计 | 651,309.70 | 1,076,784.12 |

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016年1月1日至 2016年12月31日 | 上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年12月31日 |
|-----------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 1,023,985.12 | 1,205,447.98 |
| 银行间市场交易费用 | - | - |
| 合计 | 1,023,985.12 | 1,205,447.98 |

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016年1月1日至 2016年12月31日 | 上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年12月31日 |
|---------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 审计费用 | 50,000.00 | 50,000.00 |
| 信息披露费 | 400,000.00 | 400,000.00 |
| 银行汇划费 | 4,647.76 | 6,505.65 |
| 账户维护费 | 21,000.00 | 13,500.00 |
| 其他费用_其他 | - | 900.00 |
| 合计 | 475,647.76 | 470,905.65 |

7.4.7.21 分部报告

-

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需作说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，除在 7.4.6.2 营业税、增值税、企业所得税中披露的事项外，

本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|------------------------|--------------|
| 华润元大基金管理有限公司 | 基金管理人、基金销售机构 |
| 中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”） | 基金托管人、基金销售机构 |
| 华润深国投信托有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 元大证券投资信托股份有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 深圳华润元大资产管理有限公司 | 基金管理人的子公司 |

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金于本期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016年1月1日至 2016年12月31日 | 上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年12月31日 |
|-----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 808,222.32 | 936,431.57 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 456,478.35 | 468,905.53 |

注：(1) 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，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×1.50%÷当年天数。

(2) 根据《开放式证券投资基金销售费用管理规定》，基金管理人依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，客户维护费从基金管理费中列支。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016年1月1日至2016年12 月31日 | 上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31 日 |
|----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 134,703.73 | 156,071.98 |

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，按月支付。日托管费=前一日基

金资产净值×0.25%÷当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

-

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期内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。

7.4.10.4.2 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：本基金的其他关联方于本期末及上年度末均未持有本基金份额。

7.4.10.5 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12月31日 | | 上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日 | |
|--------|-----------------------------|-----------|----------------------------------|-----------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国农业银行 | 2,818,160.10 | 41,043.55 | 6,110,098.16 | 77,704.82 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金于本期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

注：本基金于本期未进行利润分配。

7.4.12 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金于本期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

| 股票代码 | 股票名称 | 停牌日期 | 停牌原因 | 期末估值单价 | 复牌日期 | 复牌开盘单价 | 数量(股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|--------|------|-------------|--------|--------|------------|--------|--------|--------------|--------------|----|
| 000411 | 英特集团 | 2016年12月27日 | 重大事项停牌 | 22.10 | 2017年1月11日 | 24.31 | 66,959 | 1,437,605.35 | 1,479,793.90 | - |
| 300243 | 瑞丰高材 | 2016年9月20日 | 重大事项停牌 | 15.18 | 2017年1月4日 | 16.70 | 19,700 | 295,341.00 | 299,046.00 | - |

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有从事银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有从事交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及由金融工具产生的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政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了由董事会、监事会、董事会下设风险控制委员会，督察长、管理层下设风险管理委员会，监察合规部和各业务部门构成的四级风险管理架构体系。

7.4.13.2 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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国农业银行股份有限公司，与该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 12 月 31 日，本基金未持有债券资产（2015 年 12 月 31 日：无）。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

-

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

-

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风险。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。本基金所投资证券均在证券交易所或银行间市场交易，能及时变现。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可回购交易的债券资产的公允价值。本基金所持有的金融负债以及可赎回基金份额净值(所有者权益)的合同约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

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。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有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。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资及买入返售金融资产等。本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。

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2016 年 12 月 31 日 | 6 个月以内 | 6 个月-1 年 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|--------------------------|--------------|-------------|-------|-------|---------------|---------------|
| 资产 | | | | | | |
| 银行存款 | 2,818,160.10 | - | - | - | - | 2,818,160.10 |
| 结算备付金 | 464,188.19 | - | - | - | - | 464,188.19 |
| 存出保证金 | 49,222.01 | - | - | - | - | 49,222.01 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | - | 54,548,489.10 | 54,548,489.10 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | 1,300,946.11 | 1,300,946.11 |
| 应收利息 | - | - | - | - | 1,066.53 | 1,066.53 |
| 应收申购款 | 99.85 | - | - | - | 169,823.27 | 169,923.12 |
| 资产总计 | 3,331,670.15 | - | - | - | 56,020,325.01 | 59,351,995.16 |
| 负债 | | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | 110,541.77 | 110,541.77 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | 75,769.63 | 75,769.63 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | 12,628.26 | 12,628.26 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | 194,755.94 | 194,755.94 |
| 其他负债 | - | - | - | - | 450,132.56 | 450,132.56 |
| 负债总计 | - | - | - | - | 843,828.16 | 843,828.16 |
| 利率敏感度缺口 | 3,331,670.15 | - | - | - | - | - |
| 上年度末 2015 年 12 月 31 日 | 6 个月以内 | 6 个月-1 年 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | | |
| 银行存款 | 6,110,098.16 | - | - | - | - | 6,110,098.16 |
| 结算备付金 | 77,535.08 | - | - | - | - | 77,535.08 |
| 存出保证金 | 122,897.62 | - | - | - | - | 122,897.62 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | - | 53,740,406.74 | 53,740,406.74 |
| 买入返售金融资产 | 1,000,000.00 | - | - | - | - | 1,000,000.00 |
| 应收利息 | - | - | - | - | 1,209.50 | 1,209.50 |
| 应收申购款 | 497.02 | - | - | - | 328,680.58 | 329,177.60 |
| 资产总计 | 7,311,027.88 | - | - | - | 54,070,296.82 | 61,381,324.70 |
| 负债 | | | | | | |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | 1,000,000.00 | 1,000,000.00 |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | 504,854.83 | 504,854.83 |

| | | | | | | |
|---------|--------------|---|---|---|--------------|--------------|
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | 72,757.46 | 72,757.46 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | 12,126.25 | 12,126.25 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | 87,331.94 | 87,331.94 |
| 其他负债 | - | - | - | - | 50,666.97 | 50,666.97 |
| 负债总计 | - | - | - | - | 1,727,737.45 | 1,727,737.45 |
| 利率敏感度缺口 | 7,311,027.88 | - | - | - | - | - |

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本期末本基金未持有交易性债券资产，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 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，所面临的最大其他价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行交易的股票、债券、货币市场工具、权证、股指期货、银行存款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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2016年12月31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 | 54,548,489.10 | 93.23 | 53,740,406.74 | 90.09 |
| 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 | 54,548,489.10 | 93.23 | 53,740,406.74 | 90.09 |

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| | | |
|----|------------------------|----------------|
| 假设 | 除中证医药卫生指数以外的其他市场变量保持不变 | |
| 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 12 月 31 日） | 上年度末（2015 年 12 月 31 日） |
| | 中证医药卫生指数上升 5% | 3,549,321.25 | 2,919,143.68 |
| | 中证医药卫生指数下降 5% | -3,549,321.25 | -2,919,143.68 |

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

-

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1. 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

2. 其他事项

(1) 公允价值

基金管理人已经评估了银行存款、结算备付金、买入返售金融资产、其他应收款项类投资以及其他金融负债因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

各层次金融工具公允价值

于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中划分为第一层次的余额为人民币 52,769,649.20 元，划分为第二层次的余额为人民币 1,778,839.90 元，无划分为第三层次的余额（于 2015 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中划分为第一层次的余额为人民币 51,221,510.67 元，划分为第二层次的余额为人民币 2,518,896.07 元，无划分为第三层次的余额）。

公允价值所属层次间重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间或限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中所采用输入值的可观察性和重要性，确定相关股票公允价值应属第二层次或第三层次。

对于证券交易所上市的可转换、可交换债券，若出现交易不活跃的情况，本基金不会于交易不活跃期间将债券的公允价值列入第一层次；根据估值调整中所采用输入值的可观察性和重要性，确定相关债券公允价值应属第二层次或第三层次。

第三层次公允价值期初金额和本期变动金额

本基金于本报告期初未持有公允价值划分为第三层次的金融工具；本基金本期未发生第三次公允价值转入（转出）的情况。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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 | 54,548,489.10 | 91.91 |
| | 其中：股票 | 54,548,489.10 | 91.91 |
| 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 | 3,282,348.29 | 5.53 |
| 7 | 其他各项资产 | 1,521,157.77 | 2.56 |
| 8 | 合计 | 59,351,995.16 | 100.00 |

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|---------------|---------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 40,679,585.20 | 69.53 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 667,743.00 | 1.14 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 9,475,006.89 | 16.19 |
| 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 | 340,582.00 | 0.58 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | 327,369.00 | 0.56 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |

| | | | |
|---|---------------|---------------|-------|
| M | 科学研究和技术服务业 | 1,740,099.88 | 2.97 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 996,420.69 | 1.70 |
| 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 | 321,682.44 | 0.55 |
| | 合计 | 54,548,489.10 | 93.23 |

8.3 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 | 300452 | 山河药辅 | 35,754 | 1,563,879.96 | 2.67 |
| 2 | 600513 | 联环药业 | 87,632 | 1,530,054.72 | 2.62 |
| 3 | 300358 | 楚天科技 | 87,735 | 1,512,551.40 | 2.59 |
| 4 | 600055 | 万东医疗 | 83,379 | 1,510,827.48 | 2.58 |
| 5 | 600272 | 开开实业 | 78,152 | 1,505,207.52 | 2.57 |
| 6 | 600479 | 千金药业 | 95,444 | 1,505,151.88 | 2.57 |
| 7 | 600781 | 辅仁药业 | 79,473 | 1,498,066.05 | 2.56 |
| 8 | 002750 | 龙津药业 | 90,015 | 1,496,949.45 | 2.56 |
| 9 | 300412 | 迦南科技 | 42,534 | 1,492,943.40 | 2.55 |
| 10 | 300233 | 金城医药 | 61,186 | 1,491,102.82 | 2.55 |
| 11 | 600080 | 金花股份 | 118,621 | 1,489,879.76 | 2.55 |
| 12 | 300239 | 东宝生物 | 184,058 | 1,487,188.64 | 2.54 |
| 13 | 300453 | 三鑫医疗 | 62,389 | 1,482,986.53 | 2.53 |
| 14 | 300206 | 理邦仪器 | 156,000 | 1,482,000.00 | 2.53 |
| 15 | 002758 | 华通医药 | 49,945 | 1,480,369.80 | 2.53 |
| 16 | 000411 | 英特集团 | 66,959 | 1,479,793.90 | 2.53 |
| 17 | 300289 | 利德曼 | 118,542 | 1,475,847.90 | 2.52 |
| 18 | 002566 | 益盛药业 | 115,151 | 1,473,932.80 | 2.52 |
| 19 | 600488 | 天药股份 | 236,844 | 1,470,801.24 | 2.51 |
| 20 | 000705 | 浙江震元 | 112,281 | 1,467,512.67 | 2.51 |
| 21 | 600713 | 南京医药 | 184,500 | 1,466,775.00 | 2.51 |
| 22 | 000919 | 金陵药业 | 107,748 | 1,457,830.44 | 2.49 |
| 23 | 300254 | 仟源医药 | 75,496 | 1,456,317.84 | 2.49 |
| 24 | 300246 | 宝莱特 | 43,551 | 1,451,990.34 | 2.48 |
| 25 | 000590 | 启迪古汉 | 73,590 | 1,446,043.50 | 2.47 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 26 | 002693 | 双成药业 | 133,999 | 1,444,509.22 | 2.47 |
| 27 | 002728 | 特一药业 | 53,577 | 1,437,470.91 | 2.46 |
| 28 | 300404 | 博济医药 | 43,668 | 1,415,279.88 | 2.42 |
| 29 | 300357 | 我武生物 | 40,400 | 1,414,808.00 | 2.42 |
| 30 | 600976 | 健民集团 | 44,300 | 1,414,499.00 | 2.42 |
| 31 | 000538 | 云南白药 | 7,676 | 584,527.40 | 1.00 |
| 32 | 300417 | 南华仪器 | 7,500 | 411,450.00 | 0.70 |
| 33 | 300321 | 同大股份 | 8,900 | 343,540.00 | 0.59 |
| 34 | 600593 | 大连圣亚 | 8,600 | 341,248.00 | 0.58 |
| 35 | 300277 | 海联讯 | 27,400 | 340,582.00 | 0.58 |
| 36 | 000692 | 惠天热电 | 52,300 | 336,289.00 | 0.57 |
| 37 | 603002 | 宏昌电子 | 50,600 | 335,984.00 | 0.57 |
| 38 | 300283 | 温州宏丰 | 34,200 | 335,844.00 | 0.57 |
| 39 | 300112 | 万讯自控 | 23,500 | 335,815.00 | 0.57 |
| 40 | 600793 | 宜宾纸业 | 10,700 | 334,268.00 | 0.57 |
| 41 | 600356 | 恒丰纸业 | 27,300 | 333,333.00 | 0.57 |
| 42 | 600605 | 汇通能源 | 14,100 | 333,183.00 | 0.57 |
| 43 | 300305 | 裕兴股份 | 25,800 | 332,820.00 | 0.57 |
| 44 | 300154 | 瑞凌股份 | 32,304 | 332,085.12 | 0.57 |
| 45 | 300354 | 东华测试 | 13,600 | 331,840.00 | 0.57 |
| 46 | 000695 | 滨海能源 | 20,600 | 331,454.00 | 0.57 |
| 47 | 000430 | 张家界 | 27,100 | 330,891.00 | 0.57 |
| 48 | 002553 | 南方轴承 | 26,800 | 329,640.00 | 0.56 |
| 49 | 002015 | 霞客环保 | 37,400 | 329,494.00 | 0.56 |
| 50 | 600854 | 春兰股份 | 44,486 | 329,196.40 | 0.56 |
| 51 | 002420 | 毅昌股份 | 32,600 | 328,934.00 | 0.56 |
| 52 | 600444 | 国机通用 | 14,600 | 328,354.00 | 0.56 |
| 53 | 300270 | 中威电子 | 21,600 | 328,104.00 | 0.56 |
| 54 | 600778 | 友好集团 | 29,100 | 327,666.00 | 0.56 |
| 55 | 000668 | 荣丰控股 | 13,100 | 327,369.00 | 0.56 |
| 56 | 300125 | 易世达 | 10,900 | 324,820.00 | 0.56 |
| 57 | 603199 | 九华旅游 | 8,191 | 324,281.69 | 0.55 |
| 58 | 300260 | 新莱应材 | 9,600 | 322,176.00 | 0.55 |
| 59 | 600455 | 博通股份 | 5,468 | 321,682.44 | 0.55 |
| 60 | 300243 | 瑞丰高材 | 19,700 | 299,046.00 | 0.51 |

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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 | 300233 | 金城医药 | 6,425,862.40 | 10.77 |
| 2 | 002728 | 特一药业 | 6,416,128.00 | 10.76 |
| 3 | 300357 | 我武生物 | 6,078,636.00 | 10.19 |
| 4 | 300086 | 康芝药业 | 5,753,086.00 | 9.64 |
| 5 | 300396 | 迪瑞医疗 | 5,607,865.20 | 9.40 |
| 6 | 600976 | 健民集团 | 5,541,999.99 | 9.29 |
| 7 | 000919 | 金陵药业 | 5,243,197.28 | 8.79 |
| 8 | 002566 | 益盛药业 | 5,197,984.00 | 8.71 |
| 9 | 600272 | 开开实业 | 4,997,181.72 | 8.38 |
| 10 | 002370 | 亚太药业 | 4,938,333.44 | 8.28 |
| 11 | 300206 | 理邦仪器 | 4,758,953.00 | 7.98 |
| 12 | 300412 | 迦南科技 | 4,736,122.00 | 7.94 |
| 13 | 002412 | 汉森制药 | 4,730,091.00 | 7.93 |
| 14 | 002688 | 金河生物 | 4,659,680.17 | 7.81 |
| 15 | 601988 | 中国银行 | 4,597,894.00 | 7.71 |
| 16 | 002693 | 双成药业 | 4,456,998.00 | 7.47 |
| 17 | 600829 | 人民同泰 | 4,417,824.36 | 7.41 |
| 18 | 300289 | 利德曼 | 4,060,130.00 | 6.81 |
| 19 | 300358 | 楚天科技 | 3,871,488.20 | 6.49 |
| 20 | 600222 | 太龙药业 | 3,852,358.69 | 6.46 |
| 21 | 600529 | 山东药玻 | 3,804,805.40 | 6.38 |
| 22 | 603168 | 莎普爱思 | 3,794,954.23 | 6.36 |
| 23 | 000411 | 英特集团 | 3,743,300.31 | 6.28 |
| 24 | 600488 | 天药股份 | 3,742,805.05 | 6.27 |
| 25 | 300452 | 山河药辅 | 3,635,832.00 | 6.09 |
| 26 | 300404 | 博济医药 | 3,501,257.72 | 5.87 |
| 27 | 603669 | 灵康药业 | 3,493,247.00 | 5.86 |
| 28 | 002750 | 龙津药业 | 3,473,810.30 | 5.82 |
| 29 | 601398 | 工商银行 | 3,449,595.00 | 5.78 |
| 30 | 002393 | 力生制药 | 3,307,755.00 | 5.54 |
| 31 | 300181 | 佐力药业 | 3,267,627.00 | 5.48 |
| 32 | 600351 | 亚宝药业 | 3,177,541.00 | 5.33 |
| 33 | 002758 | 华通医药 | 3,175,303.05 | 5.32 |
| 34 | 300109 | 新开源 | 3,172,299.00 | 5.32 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 35 | 600713 | 南京医药 | 3,117,841.35 | 5.23 |
| 36 | 000705 | 浙江震元 | 3,080,845.00 | 5.16 |
| 37 | 300347 | 泰格医药 | 3,040,412.14 | 5.10 |
| 38 | 600781 | 辅仁药业 | 2,999,850.00 | 5.03 |
| 39 | 300453 | 三鑫医疗 | 2,995,429.95 | 5.02 |
| 40 | 603222 | 济民制药 | 2,912,332.00 | 4.88 |
| 41 | 300016 | 北陆药业 | 2,897,160.00 | 4.86 |
| 42 | 000650 | 仁和药业 | 2,870,539.00 | 4.81 |
| 43 | 300255 | 常山药业 | 2,870,313.80 | 4.81 |
| 44 | 600613 | 神奇制药 | 2,820,047.00 | 4.73 |
| 45 | 600833 | 第一医药 | 2,819,478.00 | 4.73 |
| 46 | 600479 | 千金药业 | 2,802,574.00 | 4.70 |
| 47 | 000004 | 国农科技 | 2,786,638.47 | 4.67 |
| 48 | 600513 | 联环药业 | 2,754,731.80 | 4.62 |
| 49 | 002166 | 莱茵生物 | 2,751,429.00 | 4.61 |
| 50 | 002433 | 太安堂 | 2,735,293.18 | 4.59 |
| 51 | 300239 | 东宝生物 | 2,707,987.32 | 4.54 |
| 52 | 002365 | 永安药业 | 2,658,633.00 | 4.46 |
| 53 | 600671 | 天目药业 | 2,657,627.88 | 4.46 |
| 54 | 000590 | 启迪古汉 | 2,593,282.84 | 4.35 |
| 55 | 300254 | 仟源医药 | 2,426,252.06 | 4.07 |
| 56 | 300246 | 宝莱特 | 2,413,632.02 | 4.05 |
| 57 | 300039 | 上海凯宝 | 2,387,776.16 | 4.00 |
| 58 | 000756 | 新华制药 | 2,222,390.21 | 3.73 |
| 59 | 300194 | 福安药业 | 2,065,338.89 | 3.46 |
| 60 | 002107 | 沃华医药 | 2,037,835.45 | 3.42 |
| 61 | 000597 | 东北制药 | 2,014,918.00 | 3.38 |
| 62 | 300436 | 广生堂 | 2,005,266.00 | 3.36 |
| 63 | 600080 | 金花股份 | 1,949,209.00 | 3.27 |
| 64 | 300482 | 万孚生物 | 1,775,800.00 | 2.98 |
| 65 | 601166 | 兴业银行 | 1,751,217.00 | 2.94 |
| 66 | 600055 | 万东医疗 | 1,729,905.82 | 2.90 |
| 67 | 300158 | 振东制药 | 1,678,163.00 | 2.81 |
| 68 | 000153 | 丰原药业 | 1,675,513.00 | 2.81 |
| 69 | 000788 | 北大医药 | 1,637,322.00 | 2.74 |
| 70 | 002020 | 京新药业 | 1,543,063.00 | 2.59 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 71 | 600211 | 西藏药业 | 1,496,805.23 | 2.51 |
| 72 | 600276 | 恒瑞医药 | 1,457,257.00 | 2.44 |
| 73 | 300326 | 凯利泰 | 1,452,776.00 | 2.44 |
| 74 | 600285 | 羚锐制药 | 1,421,369.00 | 2.38 |
| 75 | 000538 | 云南白药 | 1,411,950.00 | 2.37 |
| 76 | 600436 | 片仔癀 | 1,408,368.00 | 2.36 |
| 77 | 300204 | 舒泰神 | 1,395,430.00 | 2.34 |
| 78 | 600778 | 友好集团 | 1,361,101.00 | 2.28 |
| 79 | 603520 | 司太立 | 1,361,094.00 | 2.28 |
| 80 | 000692 | 惠天热电 | 1,339,980.00 | 2.25 |
| 81 | 002626 | 金达威 | 1,334,690.00 | 2.24 |
| 82 | 600593 | 大连圣亚 | 1,330,645.00 | 2.23 |
| 83 | 000518 | 四环生物 | 1,297,490.00 | 2.18 |
| 84 | 600216 | 浙江医药 | 1,254,304.00 | 2.10 |
| 85 | 300363 | 博腾股份 | 1,197,199.00 | 2.01 |

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 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 | 300396 | 迪瑞医疗 | 5,962,853.01 | 10.00 |
| 2 | 300086 | 康芝药业 | 5,883,225.68 | 9.86 |
| 3 | 002728 | 特一药业 | 5,519,848.08 | 9.25 |
| 4 | 002370 | 亚太药业 | 5,257,940.49 | 8.81 |
| 5 | 300233 | 金城医药 | 5,185,238.56 | 8.69 |
| 6 | 002688 | 金河生物 | 4,924,158.13 | 8.25 |
| 7 | 300357 | 我武生物 | 4,831,215.26 | 8.10 |
| 8 | 002412 | 汉森制药 | 4,677,747.43 | 7.84 |
| 9 | 601988 | 中国银行 | 4,591,318.00 | 7.70 |
| 10 | 600976 | 健民集团 | 4,555,820.57 | 7.64 |
| 11 | 600829 | 人民同泰 | 4,337,345.44 | 7.27 |
| 12 | 600222 | 太龙药业 | 4,280,040.63 | 7.17 |
| 13 | 600529 | 山东药玻 | 4,246,273.96 | 7.12 |
| 14 | 300181 | 佐力药业 | 4,183,628.92 | 7.01 |
| 15 | 300016 | 北陆药业 | 3,856,388.58 | 6.46 |
| 16 | 002566 | 益盛药业 | 3,853,637.71 | 6.46 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 17 | 600272 | 开开实业 | 3,839,775.05 | 6.44 |
| 18 | 603168 | 莎普爱思 | 3,824,145.50 | 6.41 |
| 19 | 300412 | 迦南科技 | 3,806,181.29 | 6.38 |
| 20 | 300347 | 泰格医药 | 3,741,041.70 | 6.27 |
| 21 | 000919 | 金陵药业 | 3,724,631.24 | 6.24 |
| 22 | 603669 | 灵康药业 | 3,571,089.46 | 5.99 |
| 23 | 002393 | 力生制药 | 3,496,371.24 | 5.86 |
| 24 | 000004 | 国农科技 | 3,479,223.31 | 5.83 |
| 25 | 600833 | 第一医药 | 3,470,915.36 | 5.82 |
| 26 | 601398 | 工商银行 | 3,457,210.00 | 5.80 |
| 27 | 600351 | 亚宝药业 | 3,446,700.70 | 5.78 |
| 28 | 600671 | 天目药业 | 3,402,263.45 | 5.70 |
| 29 | 300206 | 理邦仪器 | 3,137,531.28 | 5.26 |
| 30 | 600613 | 神奇制药 | 3,137,392.96 | 5.26 |
| 31 | 002693 | 双成药业 | 3,103,985.32 | 5.20 |
| 32 | 002365 | 永安药业 | 3,081,907.68 | 5.17 |
| 33 | 300255 | 常山药业 | 3,053,564.66 | 5.12 |
| 34 | 603222 | 济民制药 | 3,027,575.07 | 5.08 |
| 35 | 000650 | 仁和药业 | 3,006,307.04 | 5.04 |
| 36 | 000756 | 新华制药 | 3,005,048.64 | 5.04 |
| 37 | 300109 | 新开源 | 2,949,212.70 | 4.94 |
| 38 | 000411 | 英特集团 | 2,862,407.30 | 4.80 |
| 39 | 002166 | 莱茵生物 | 2,806,289.75 | 4.70 |
| 40 | 600436 | 片仔癀 | 2,749,680.73 | 4.61 |
| 41 | 002626 | 金达威 | 2,669,738.65 | 4.48 |
| 42 | 000597 | 东北制药 | 2,640,881.12 | 4.43 |
| 43 | 002433 | 太安堂 | 2,540,535.50 | 4.26 |
| 44 | 300039 | 上海凯宝 | 2,505,397.70 | 4.20 |
| 45 | 300289 | 利德曼 | 2,396,974.75 | 4.02 |
| 46 | 002019 | 亿帆医药 | 2,391,140.72 | 4.01 |
| 47 | 300358 | 楚天科技 | 2,368,561.80 | 3.97 |
| 48 | 600488 | 天药股份 | 2,308,708.94 | 3.87 |
| 49 | 300318 | 博晖创新 | 2,255,378.06 | 3.78 |
| 50 | 300436 | 广生堂 | 2,212,525.50 | 3.71 |
| 51 | 002750 | 龙津药业 | 2,209,043.17 | 3.70 |
| 52 | 002107 | 沃华医药 | 2,123,254.67 | 3.56 |
| 53 | 000153 | 丰原药业 | 2,068,264.33 | 3.47 |
| 54 | 300194 | 福安药业 | 2,033,382.01 | 3.41 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 55 | 300158 | 振东制药 | 2,012,139.54 | 3.37 |
| 56 | 002317 | 众生药业 | 2,007,742.97 | 3.37 |
| 57 | 600530 | 交大昂立 | 1,990,453.74 | 3.34 |
| 58 | 300452 | 山河药辅 | 1,955,753.08 | 3.28 |
| 59 | 600211 | 西藏药业 | 1,939,809.25 | 3.25 |
| 60 | 300294 | 博雅生物 | 1,892,145.89 | 3.17 |
| 61 | 000705 | 浙江震元 | 1,866,912.04 | 3.13 |
| 62 | 002007 | 华兰生物 | 1,849,717.18 | 3.10 |
| 63 | 300404 | 博济医药 | 1,823,395.47 | 3.06 |
| 64 | 300326 | 凯利泰 | 1,757,922.00 | 2.95 |
| 65 | 601166 | 兴业银行 | 1,746,954.00 | 2.93 |
| 66 | 600513 | 联环药业 | 1,721,734.91 | 2.89 |
| 67 | 000788 | 北大医药 | 1,708,387.40 | 2.86 |
| 68 | 300204 | 舒泰神 | 1,657,751.59 | 2.78 |
| 69 | 600781 | 辅仁药业 | 1,645,285.66 | 2.76 |
| 70 | 300482 | 万孚生物 | 1,642,725.78 | 2.75 |
| 71 | 300239 | 东宝生物 | 1,610,835.65 | 2.70 |
| 72 | 600285 | 羚锐制药 | 1,559,364.39 | 2.61 |
| 73 | 600521 | 华海药业 | 1,521,753.78 | 2.55 |
| 74 | 600713 | 南京医药 | 1,517,204.58 | 2.54 |
| 75 | 002758 | 华通医药 | 1,494,654.00 | 2.51 |
| 76 | 002020 | 京新药业 | 1,478,393.00 | 2.48 |
| 77 | 603520 | 司太立 | 1,449,685.48 | 2.43 |
| 78 | 300453 | 三鑫医疗 | 1,435,121.66 | 2.41 |
| 79 | 600276 | 恒瑞医药 | 1,423,725.55 | 2.39 |
| 80 | 300298 | 三诺生物 | 1,403,771.50 | 2.35 |
| 81 | 000518 | 四环生物 | 1,328,340.00 | 2.23 |
| 82 | 300363 | 博腾股份 | 1,295,640.00 | 2.17 |
| 83 | 600216 | 浙江医药 | 1,289,303.98 | 2.16 |
| 84 | 300246 | 宝莱特 | 1,282,887.00 | 2.15 |
| 85 | 300009 | 安科生物 | 1,248,865.92 | 2.09 |
| 86 | 603799 | 华友钴业 | 1,240,811.37 | 2.08 |
| 87 | 000989 | 九芝堂 | 1,201,546.68 | 2.01 |
| 88 | 600479 | 千金药业 | 1,201,501.24 | 2.01 |

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 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 | 339,771,364.77 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 335,366,400.29 |

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末投资股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

报告期内，本基金未持仓股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末持仓国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末投资国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本报告期暂无进行国债期货投资。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。

8.12.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 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 | 49,222.01 |
| 2 | 应收证券清算款 | 1,300,946.11 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 1,066.53 |
| 5 | 应收申购款 | 169,923.12 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 1,521,157.77 |

8.12.4 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。

8.12.5 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。

8.12.6 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，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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 |
| 3,257 | 13,091.91 | 3,269,626.65 | 7.67% | 39,370,725.32 | 92.33% |

9.2 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 | 67,279.26 | 0.1578% |

注：截至本报告期末，本基金管理人从业人员投资、持有本基金符合相关法律法规、中国证监会规定及相关管理制度的规定。

9.3 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 | 0~10 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0 |

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|------------------------------------|----------------|
| 基金合同生效日 (2014 年 8 月 18 日) 基金份额总额 | 406,876,288.32 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 38,838,395.60 |
| 本报告期基金总申购份额 | 68,335,648.58 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 64,533,692.21 |
| 本报告期基金拆分变动份额 (份额减少以 "-" 填列) | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 42,640,351.97 |

注：本基金总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

根据华润元大基金管理有限公司第二届董事会第六次临时会议审议通过，公司董事长由路强先生变更为刘小腊先生。上述变更已按照规定报相关监管机构备案，并进行公告。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为第 3 年为本基金提供审计服务，本年度应支付给会计师事务所的报酬为人民币 50,000.00 元。

11.6 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、托管人及其高级管理人员无受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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 | |
| 国信证券 | 2 | 210,234,125.74 | 31.14% | 195,810.08 | 31.14% | - |
| 银河证券 | 1 | 123,739,061.48 | 18.33% | 115,237.08 | 18.33% | - |
| 华泰证券 | 1 | 122,325,747.83 | 18.12% | 113,914.87 | 18.12% | - |
| 中信建投 | 1 | 119,977,081.34 | 17.77% | 111,732.33 | 17.77% | - |
| 招商证券 | 1 | 91,199,365.62 | 13.51% | 84,935.30 | 13.51% | - |

| | | | | | | |
|------|---|--------------|-------|----------|-------|---|
| 中银国际 | 2 | 4,179,431.97 | 0.62% | 3,892.34 | 0.62% | - |
| 国泰君安 | 1 | 3,440,591.08 | 0.51% | 3,205.46 | 0.51% | - |
| 中信证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 民生证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | 2 | - | - | - | - | - |

注：基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

1、基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其交易单元作为基金的专用交易单元，选择的标准是：

- (1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 5 亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，最近二年未发生因重大违规行为而受到中国证监会处罚；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；
- (6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务。

2、选择交易单元的程序：

我公司根据上述标准，选定符合条件的证券公司作为租用交易单元的对象。我公司投研部门定期对所选定证券公司的服务进行综合评比，评比内容包括：提供研究报告质量、数量、及时性及提供研究服务主动性和质量等情况，并依据评比结果确定交易单元交易的具体情况。我在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向券商租用交易单元作为基金专用交易单元。本基金本报告期新增了一个海通证券的深市基金专用交易单元，同时退租一个海通证券的沪市基金专用交易单元。

11.7.2 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 |
| 国信证券 | 2,001,800.00 | 100.00% | 14,100,000.00 | 52.81% | - | - |
| 银河证券 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | |
|------|---|---|---------------|--------|---|
| 华泰证券 | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | - | - | 10,000,000.00 | 37.45% | - |
| 中银国际 | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | - | - | 2,600,000.00 | 9.74% | - |
| 中信证券 | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | - | - | - | - | - |
| 民生证券 | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | - | - | - | - | - |

11.8 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 | 华润元大基金管理有限公司旗下开放式基金净值公告 | 中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站 | 2016年1月4日 |
| 2 | 华润元大基金管理有限公司关于指数熔断机制触发后公司旗下基金申购、赎回、转换及定投业务处理的公告 | 中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站 | 2016年1月4日 |
| 3 | 华润元大基金管理有限公司关于指数熔断机制触发后公司旗下基金申购、赎回、转换及定投业务处理的公告 | 中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站 | 2016年1月7日 |
| 4 | 华润元大基金管理有限公司关于旗下部分基金调整停牌股票估值方法的公告 | 中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站 | 2016年1月12日 |
| 5 | 华润元大医疗保健量化混合型证券投资基金 2015 年第 4 季度报告 | 中国证券报、上海证券报、 证券时报、证券日报、基金 管理人网站 | 2016年1月20日 |
| 6 | 华润元大基金管理有限公司关于变更公司住所的公告 | 中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站 | 2016年2月27日 |
| 7 | 华润元大基金管理有限公司关于同比例增加注册资本的公告 | 中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站 | 2016年2月27日 |
| 8 | 华润元大基金管理有限公司关于旗下部分基金调整停牌股票估值方法的公告 | 中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站 | 2016年3月1日 |
| 9 | 华润元大医疗保健量化混合型证券投资基金 2015 年年度报告 | 基金管理人网站 | 2016年3月29日 |
| 10 | 华润元大医疗保健量化混合型证券投资基金 2015 年年度报告摘要 | 中国证券报、上海证券报、 证券时报、证券日报、基金 管理人网站 | 2016年3月29日 |
| 11 | 华润元大医疗保健量化混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2016年第1号） | 基金管理人网站 | 2016年4月1日 |
| 12 | 华润元大医疗保健量化混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2016年第1号） | 中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站 | 2016年4月1日 |

| | | | |
|----|---|---------------------------------------|-----------------|
| 13 | 华润元大基金管理有限公司关于调整旗下部分开放式基金申购、赎回、转换转出及最低持有份额的数额限制的公告 | 中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站 | 2016 年 4 月 8 日 |
| 14 | 华润元大基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加深圳富济财富管理有限公司为代销机构、开通定期定额投资和转换业务并参加其费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站 | 2016 年 4 月 19 日 |
| 15 | 华润元大医疗保健量化混合型证券投资基金 2016 年第 1 季度报告 | 中国证券报、上海证券报、 证券时报、证券日报、基金 管理人网站 | 2016 年 4 月 20 日 |
| 16 | 华润元大基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金对中信建投证券股份有限公司开通定期定额投资和转换业务并参加其费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站 | 2016 年 5 月 13 日 |
| 17 | 华润元大基金关于实施基金网上直销申购、定投及转换在通联支付渠道费率优惠的公告 | 中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站 | 2016 年 6 月 24 日 |
| 18 | 华润元大基金管理有限公司旗下开放式基金净值公告 | 中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站 | 2016 年 7 月 1 日 |
| 19 | 华润元大基金管理有限公司关于旗下部分基金调整停牌股票估值方法的公告 | 中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站 | 2016 年 7 月 13 日 |
| 20 | 华润元大基金管理有限公司董事长变更公告 | 中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站 | 2016 年 7 月 14 日 |
| 21 | 关于华润元大基金管理有限公司从业人员在子公司兼职情况变更的公告 | 基金管理人网站 | 2016 年 7 月 14 日 |
| 22 | 华润元大基金管理有限公司关于旗下基金参加诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站 | 2016 年 7 月 19 日 |
| 23 | 华润元大基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加上海利得基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站 | 2016 年 7 月 20 日 |
| 24 | 华润元大医疗保健量化混合型证券投资基金 2016 年第 2 季度报告 | 中国证券报、上海证券报、 证券时报、证券日报、基金 管理人网站 | 2016 年 7 月 21 日 |
| 25 | 华润元大基金关于旗下基金参加诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司定期定额投资业务申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站 | 2016 年 7 月 22 日 |
| 26 | 华润元大基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加上海陆金所资产管理有限公司为代销机构、开通定期定额投资业务并参加其费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站 | 2016 年 7 月 27 日 |
| 27 | 华润元大医疗保健量化混合型证券投资基金基金经理变更公告 | 中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站 | 2016 年 8 月 6 日 |
| 28 | 华润元大基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加北京汇成基金销售有限公司为代销机构、开通定期定额投资和转换业务并参加其费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站 | 2016 年 8 月 26 日 |
| 29 | 华润元大基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加深圳市新兰德证券投资咨询有限公司为代销机 | 中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站 | 2016 年 8 月 26 日 |

| | | | |
|----|---|---------------------------------------|------------------|
| | 构、开通定期定额投资和转换业务并参加其费率优惠活动的公告 | | |
| 30 | 华润元大医疗保健量化混合型证券投资基金 2016 年半年度报告 | 基金管理人网站 | 2016 年 8 月 27 日 |
| 31 | 华润元大医疗保健量化混合型证券投资基金 2016 年半年度报告摘要 | 中国证券报、上海证券报、 证券时报、证券日报、基金 管理人网站 | 2016 年 8 月 27 日 |
| 32 | 华润元大基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加和讯信息科技有限公司为代销机构、开通定期定额投资和转换业务并参加其费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站 | 2016 年 9 月 7 日 |
| 33 | 华润元大基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加北京肯特瑞财富投资管理有限公司为代销机构、开通转换业务并参加其费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站 | 2016 年 9 月 14 日 |
| 34 | 华润元大基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加珠海盈米财富管理有限公司为代销机构、开通定期定额投资和转换业务并参加其费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站 | 2016 年 9 月 28 日 |
| 35 | 华润元大基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加奕丰金融服务（深圳）有限公司为代销机构、开通定期定额投资和转换业务并参加其费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站 | 2016 年 9 月 28 日 |
| 36 | 华润元大医疗保健量化混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2016 年第 2 号） | 基金管理人网站 | 2016 年 9 月 30 日 |
| 37 | 华润元大医疗保健量化混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2016 年第 2 号） | 中国证券报、上海证券报、 证券时报、证券日报、基金 管理人网站 | 2016 年 9 月 30 日 |
| 38 | 华润元大医疗保健量化混合型证券投资基金 2016 年第 3 季度报告 | 中国证券报、上海证券报、 证券时报、证券日报、基金 管理人网站 | 2016 年 10 月 25 日 |
| 39 | 华润元大基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加深圳市金斧子投资咨询有限公司为代销机构、开通定期定额投资和转换业务并参加其费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站 | 2016 年 12 月 6 日 |
| 40 | 华润元大基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加民生证券股份有限公司为代销机构、开通定期定额投资和转换业务并参加其费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站 | 2016 年 12 月 6 日 |
| 41 | 华润元大基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加上海华信证券有限责任公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站 | 2016 年 12 月 12 日 |
| 42 | 华润元大基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加北京恒天明泽基金销售有限公司为代销机构、开通定期定额投资和转换业务的公告 | 中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站 | 2016 年 12 月 17 日 |
| 43 | 华润元大基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金对上海华信证券有限责任公司开通定期定额投资业务的公告 | 中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站 | 2016 年 12 月 17 日 |

| | | | |
|----|---|------------------------------|------------------|
| 44 | 华润元大基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加上海基煜基金销售有限公司为代销机构、开通定期定额投资和转换业务的公告 | 中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站 | 2016 年 12 月 24 日 |
| 45 | 华润元大基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加上海万得投资顾问有限公司为代销机构、开通定期定额投资和转换业务并参加其费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站 | 2016 年 12 月 24 日 |
| 46 | 华润元大基金关于基金网上直销申购、定投及转换在通联支付渠道费率优惠活动延期的公告 | 中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站 | 2016 年 12 月 27 日 |
| 47 | 华润元大基金管理有限公司关于开通手机客户端直销业务的公告 | 中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站 | 2016 年 12 月 29 日 |
| 48 | 华润元大基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国农业银行股份有限公司费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站 | 2016 年 12 月 29 日 |

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金管理人股东元大证券投资信托股份有限公司法定代表人、董事长林武田先生于届龄退休，由黄古彬先生接任；本基金管理人股东华润深国投信托有限公司完成增资，实收资本由 26.30 亿元人民币增至 60 亿元人民币；路强先生不再担任本基金管理人股东华润深国投信托有限公司总经理，由刘小腊先生接任。

2017 年 2 月 14 日，本基金管理人发布了《华润元大基金管理有限公司总经理变更公告》。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会关于核准本基金募集的批复；
- 2、本基金基金合同；
- 3、本基金托管协议；
- 4、本报告期内在指定报刊上披露的各项公告。

13.2 存放地点

以上备查文件存放于基金管理人和基金托管人的办公场所。

13.3 查阅方式

基金持有人可在办公时间到基金管理人和基金托管人的办公场所或网站免费查阅。

华润元大基金管理有限公司
2017年3月29日