华润元大医疗保健量化股票型证券投资基金

[2015] 半年度报告摘要

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：2015年8月28日

§1 重要提示

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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年8月27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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华润元大医疗保健量化股票
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	49,524,310.20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	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。 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。 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。 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。 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。 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。 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。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为：中证医药卫生指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于证券投资基金中的高风险品种，预期风险和预期收益高于混合型基金、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

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.cryuantafund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公场所

§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(2015年1月1日 - 2015年6月30日)
本期已实现收益	26,630,860.03
本期利润	23,951,482.98
加权平均基金份额本期利润	0.4938
本期基金份额净值增长率	84.15%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.7240
期末基金资产净值	91,459,738.93
期末基金份额净值	1.847

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。

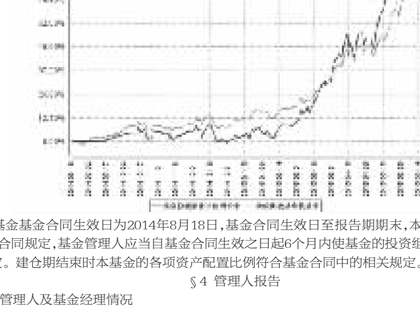
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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
过去一个月	-7.65%	2.96%	-8.30%	2.93%	0.65%	0.03%
过去三个月	38.35%	2.70%	16.10%	2.26%	22.25%	0.44%
过去六个月	84.15%	2.18%	43.23%	1.76%	40.92%	0.42%
自基金合同生效起至今	84.70%	1.81%	54.85%	1.46%	29.85%	0.35%

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



注：1.本基金基金合同生效日为2014年8月18日，基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间未满一年。2.按基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同中的有关规定。建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同中的相关规定。

§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2亿元人民币。公司由华润深国投信托有限公司和台湾元大宝来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2015年6月30日，本基金管理人共管理六只开放式基金：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股票型证券投资基金，华润元大医疗保健量化股票型证券投资基金，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。

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		
李湘杰	华润元大医疗保健量化股票型证券投资基金基金经理	2014年8月18日	-	16年	历任台湾安泰商业银行外汇交易员，台湾安泰人寿研究员，台湾安泰证券投资信托股份有限公司基金经理，台湾元大宝来投资信托股份有限公司基金经理职务，现任华润元大基金管理有限公司投资管理部研究总监。2013年9月11日起至2014年9月18日担任华润元大保本混合型证券投资基金基金经理，2014年8月18日起担任华润元大医疗保健量化股票型证券投资基金基金经理。中国台湾，国立台湾大学管理学硕士，具有基金从业资格。
朱艳	华润元大医疗保健量化股票型证券投资基金基金经理	2014年11月4日	-	7年	曾任汇丰银行大连分行私人银行理财经理，景顺长城基金管理有限公司交易员，2014年11月4日起担任华润元大医疗保健量化股票型证券投资基金基金经理。中国，金融学硕士，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遵规守信情况的说明

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。

4.3.2 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

2015第一季度，指数走势分化明显。创业版、中小板指数表现卓越，大幅上涨，大盘主板指数滞涨休整。一季度沪深300指数上涨17.16%，创业版指上涨59.93%，中证医药指数上涨31.11%，医药板块逆转2014年四季度走势，跑赢大盘指数。

2015年第二季度，股市经历了大幅波动，各指数出现了泡沫化上涨和断崖式下跌。创业板指数上涨22.42%，中小板指数上涨15.32%，上证综指上涨14.12%，沪深300指数上涨10.41%，上证50指数上涨4.19%，富时中国A50指数上涨6.28%。中信一级29个行业中国防军工（41.61%）、轻工制造（39.65%）、交通运输（36.97%）板块较强，涨幅前三；而非银行金融（-6.36%）、建筑（9.64%）、银行（12.55%）板块走势明显较弱，涨幅居后。医疗行业则上涨19.18%。

本基金在投资策略上采用多因子量化策略结合基本面研究成果，配置上兼具成长和价值个股，并根据市场趋势进行了有效择时。在市场出现泡沫化之时，有效降低仓位。截至报告期末，基金仓位全部为医药类公司股票。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为1.847元，本报告期份额净值上涨84.15%，业绩比较基准增长率为43.23%，超越于业绩比较基准40.92%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2015年下半年，监管层对系统性风险的重视和防范会进一步强化，货币政策有望继续保持宽松，财政政策有望更加积极，综合考虑政策的累积效应和一系列稳增长政策逐步发力，经济很可能呈现出缓中趋稳态势，但同时杠杆率较高、PPI持续为负等将给经济增长带来不确定性。

从医药行业投资角度来看，本基金未来主要投资以下方向：1. 流动性好，估值较低，业绩增长确定的白马类公司。2.市场大幅调整后，综合考虑公司所处行业、未来可考业绩及公司估值，凸显出投资价值的成长类公司。3. 以基因测序、细胞治疗为代表的精准医疗。4.其它子行业，如PBM、医疗信息化、高端仿制药、健康管理、创新药的龙头公司。

4.6 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。

4.7 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。

4.8 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

本报告期内，本基金存在连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，出现该情况的时间范围为2015年3月25日至5月20日。经过基金管理人积极地持续营销，截至本报告期末，本基金资产净值已超过五千万元。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 2015年 1 月 1 日至 2015年 6 月 30 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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华润元大医疗保健量化股票型证券投资基金

报告截止日：2015年6月30日

单位：人民币元

资 产	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
资 产：		
银行存款	40,207,802.13	20,105,836.62
结算备付金	170,358.41	770,077.75
存出保证金	62,971.85	74,561.28
交易性金融资产	64,767,441.05	70,445,916.05
其中：股票投资	64,767,441.05	70,445,916.05
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	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	8,374.02	2,460.09
应收股利	-	-
应收申购款	916,732.07	31,527.09
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	106,133,679.53	91,430,378.88
负债和所有者权益	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
负 债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	2,056,606.72	10,348,888.28
应付赎回款	12,127,700.34	372,397.75
应付管理人报酬	117,149.60	119,906.69
应付托管费	19,524.93	19,984.45
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	122,420.50	283,650.38
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	230,538.51	80,908.54
负债合计	14,673,940.60	11,225,736.09
所有者权益：		
实收基金	49,524,310.20	79,975,081.74
未分配利润	41,935,428.73	229,561.05
所有者权益合计	91,459,738.93	80,204,642.79
负债和所有者权益总计	106,133,679.53	91,430,378.88

注：报告截止日2015年6月30日，基金份额净值1.847元，基金份额总额49,524,310.20份。

6.2 利润表

会计主体：华润元大医疗保健量化股票型证券投资基金

本报告期：2015年1月1日至2015年6月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
一、收入	25,411,831.94
1.利息收入	47,027.52
其中：存款利息收入	42,860.85
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	4,166.67
其他利息收入	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	27,430,768.65
其中：股票投资收益	27,299,950.05
基金投资收益	-
债券投资收益	-
资产支持证券投资收益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	130,818.60
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-2,679,377.05
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	613,412.82
减：二、费用	1,460,348.96
1. 管理人报酬	494,544.69
2. 托管费	82,424.14
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	647,948.57
5. 利息支出	-
其中：卖出回购金融资产支出	-
6. 其他费用	235,431.56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	23,951,482.98
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	23,951,482.98

注：本基金基金合同于2014年8月18日生效，无上年度可比较期间及可比较数据。

6.3 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股票型证券投资基金

本报告期：2015年1月1日至2015年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1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）	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）	-	23,951,482.98	23,951,482.98
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）	-30,450,771.54	17,754,384.70	-12,696,386.84
其中：1.基金申购款	75,585,756.62	60,359,455.46	135,945,212.08
2.基金赎回款	-106,036,528.16	-42,605,070.76	-148,641,598.92
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）	49,524,310.20	41,935,428.73	91,459,738.93

注：本基金基金合同于2014年8月18日生效，无上年度可比较期间及可比较数据。

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：

______林瑞源______ ______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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华润元大医疗保健量化股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)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《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》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交易的股票（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%。

6.4.2 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。

6.4.3 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2015年6月30日的财务状况以及自2015年1月1日至2015年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 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的说明

6.4.4.1 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。

6.4.4.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24号关于发布《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》的通知的规定，交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值。

此外，本报告期所采用的其他会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.4.3 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。

6.4.5 税项

1.印花税

证券（股票）交易印花税税率为1‰，由出让方缴纳。

股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

2.营业税、企业所得税

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。

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。

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。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

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，减按25%计入应纳税所得额。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

6.4.6 关联方关系

6.4.6.1 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

本基金本报告期内，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.6.2 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
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

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。

6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行交易。本基金合同于2014年8月18日生效，无上年度可比较期间。

6.4.7.2 关联方报酬

6.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	494,544.69
其中：支付销售机构的客户维护费	233,154.51

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。

6.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	82,424.14

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。

6.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。本基金基金合同于2014年8月18日生效，无上年度可比期间可比数据。

6.4.7.4.2 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：报告期末除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金。

6.4.7.5 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 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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
中国农业银行	40,207,802.13	38,848.12	-	-

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。

6.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.7.7 其他关联交易事项的说明

注：无。

6.4.8 期末（ 2015年6月30日 ）本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.8.2 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
002223	鱼跃医疗	2015年6月25日	重大事项	57.75	2015年7月13日	60.48	40,184	1,711,952.44	2,320,626.00	-
300294	博雅生物	2015年4月23日	重大事项	78.82	-	-	21,684	1,081,535.82	1,709,132.88	-
600587	新华医疗	2015年5月22日	重大事项	58.63	2015年7月3日	52.77	20,199	958,980.95	1,184,267.37	-
603998	方盛制药	2015年5月28日	重大事项	54.27	2015年7月1日	58.60	20,150	789,879.10	1,093,540.50	-
002688	金河生物	2015年6月2日	重大事项	29.70	2015年7月14日	26.73	34,800	685,536.00	1,033,560.00	-
002166	莱茵生物	2015年5月25日	重大事项	40.49	2015年7月2日	36.44	23,084	835,762.58	934,671.16	-

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 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。

6.4.8.3.2 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。

6.4.9 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

管理层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2015年6月30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 56,491,643.14元，划分为第二层次的余额为人民币 8,275,797.91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

本基金本报告期未发生金融工具公允价值层次之间的转移。

第三层次公允价值期初金额和本期变动金额

本基金报告期初未持有公允价值划分为第三层次的金融工具；本基金本期无净转入（转出）第三层次。

(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。

§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	64,767,441.05	61.02
	其中：股票	64,767,441.05	61.02
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	40,378,160.54	38.04
7	其他各项资产	988,077.94	0.93
8	合计	106,133,679.53	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	52,716,154.12	57.64
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	9,392,605.93	10.27
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	778,425.00	0.85
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	1,880,256.00	2.06
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	64,767,441.05	70.82

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	300110	华仁药业	244,800	4,802,976.00	5.25
2	600993	马应龙	84,799	2,721,199.91	2.98
3	300238	冠昊生物	60,842	2,480,528.34	2.71
4	000078	海王生物	108,325	2,383,150.00	2.61
5	600976	健民集团	68,648	2,336,777.92	2.55
6	002223	鱼跃医疗	40,184	2,320,626.00	2.54
7	600530	交大昂立	70,900	2,299,287.00	2.51
8	300318	博晖创新	44,500	2,122,650.00	2.32
9	002462	嘉事堂	36,751	1,951,478.10	2.13
10	300009	安科生物	71,435	1,920,887.15	2.10

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人网站的半年度报告正文。

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	300244	迪安诊断	6,023,216.89	7.51
2	600976	健民集团	5,456,171.62	6.80
3	600993	马应龙	5,253,258.32	6.55
4	300318	博晖创新	4,657,096.88	5.81
5	300238	冠昊生物	4,412,483.12	5.50
6	000919	金陵药业	3,969,060.00	4.95
7	600530	交大昂立	3,947,604.05	4.92
8	300294	博雅生物	3,810,426.00	4.75
9	000078	海王生物	3,780,946.00	4.71
10	300357	我武生物	3,511,959.99	4.38
11	300246	宝莱特	3,381,132.55	4.22
12	002433	太安堂	3,318,182.00	4.14
13	300016	北陆药业	3,150,734.30	3.93
14	002688	金河生物	3,130,191.00	3.90
15	600750	江中药业	3,057,095.00	3.81
16	300326	凯利泰	2,952,599.00	3.68
17	300039	上海凯宝	2,902,302.87	3.62
18	600587	新华医疗	2,869,960.87	3.58
19	600479	千金药业	2,854,091.50	3.56
20	300086	康芝药业	2,840,310.00	3.54
21	002198	嘉应制药	2,808,101.51	3.50
22	300109	新开源	2,682,471.16	3.34
23	002462	嘉事堂	2,602,285.00	3.24
24	300006	莱美药业	2,555,920.80	3.19
25	002365	永安药业	2,548,382.24	3.18
26	002223	鱼跃医疗	2,444,811.14	3.05
27	002393	力生制药	2,324,787.23	2.90
28	000516	国际医学	2,244,706.14	2.80
29	600566	济川药业	2,188,577.46	2.73
30	002551	尚荣医疗	2,170,627.00	2.71
31	600829	人民同泰	2,089,387.00	2.61
32	002422	科伦药业	2,084,235.50	2.60
33	000513	丽珠集团	1,999,057.66	2.49
34	300314	戴维医疗	1,978,144.00	2.47
35	002750	龙津药业	1,908,981.00	2.38
36	002390	信邦制药	1,900,656.00	2.37
37	300194	福安药业	1,899,052.18	2.37
38	600881	亚泰集团	1,803,879.00	2.25
39	300110	华仁药业	1,772,075.04	2.21
40	600529	山东药玻	1,770,859.00	2.21
41	002412	汉森制药	1,770,492.52	2.21
42	002332	仙琚制药	1,769,159.31	2.21
43	300289	利德曼	1,768,811.97	2.21
44	300181	佐力药业	1,767,548.07	2.20
45	002626	金达威	1,767,395.00	2.20
46	600211	西藏药业	1,761,666.25	2.20
47	600085	同仁堂	1,756,251.48	2.19
48	300015	爱尔眼科	1,704,080.19	2.12
49	002385	大北农	1,663,386.00	2.07
50	002653	海思科	1,621,577.89	2.02

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。

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	002437	誉衡药业	6,408,144.16	7.99
2	300244	迪安诊断	4,842,301.21	6.04
3	000623	吉林敖东	4,364,991.04	5.44
4	300086	康芝药业	4,307,672.43	5.37
5	300009	安科生物	3,889,645.43	4.85
6	002038	双鹭药业	3,483,464.93	4.34
7	300246	宝莱特	3,463,631.76	4.32
8	300109	新开源	3,294,833.64	4.11
9	600196	复星医药	3,294,341.26	4.11
10	600085	同仁堂	3,283,463.66	4.09
11	300016	北陆药业	3,276,649.25	4.09
12	002462	嘉事堂	3,246,054.70	4.05
13	000538	云南白药	3,195,343.15	3.98
14	600518	康美药业	3,165,261.27	3.95
15	601607	上海医药	3,156,335.04	3.94
16	600998	九州通	3,113,452.26	3.88
17	600976	健民集团	3,059,619.44	3.81
18	002294	信立泰	3,048,620.72	3.80
19	000513	丽珠集团	3,017,102.98	3.76
20	600252	中恒集团	2,938,073.39	3.66
21	600276	恒瑞医药	2,923,332.52	3.64
22	002198	嘉应制药	2,917,128.27	3.64
23	600530	交大昂立	2,913,226.02	3.63
24	000503	海虹控股	2,857,007.00	3.56
25	300318	博晖创新	2,835,182.18	3.53
26	002365	永安药业	2,775,679.97	3.46
27	300357	我武生物	2,743,580.39	3.42
28	600436	片仔癀	2,695,936.94	3.36
29	300294	博雅生物	2,694,835.70	3.36
30	002399	海普瑞	2,680,254.57	3.34
31	002693	双成药业	2,620,301.96	3.27
32	300039	上海凯宝	2,600,060.80	3.24
33	002688	金河生物	2,468,132.00	3.08
34	600993	马应龙	2,457,591.63	3.06
35	600594	益佰制药	2,453,498.32	3.06
36	002007	华兰生物	2,446,896.30	3.05
37	000516	国际医学	2,414,319.46	3.01
38	002332	仙琚制药	2,387,387.36	2.98
39	600511	国药股份	2,380,619.40	2.97
40	000919	金陵药业	2,368,063.53	2.95
41	300326	凯利泰	2,364,325.95	2.95
42	002551	尚荣医疗	2,334,030.00	2.91
43	300314	戴维医疗	2,311,489.77	2.88
44	002001	新 和 成	2,298,834.38	2.87
45	002275	桂林三金	2,293,307.82	2.86
46	002626	金达威	2,269,493.13	2.83
47	002422	科伦药业	2,229,902.00	2.78
48	000963	华东医药	2,206,779.36	2.75
49	600566	济川药业	2,194,011.38	2.74
50	600535	天士力	2,148,477.19	2.68
51	300003	乐普医疗	2,143,778.98	2.67
52	300238	冠昊生物	2,137,518.55	2.67
53	300015	爱尔眼科	2,115,855.00	2.64
54	600881	亚泰集团	2,060,016.73	2.57
55	600587	新华医疗	2,025,772.59	2.53
56	002653	海思科	1,981,396.19	2.47
57	002385	大北农	1,977,568.05	2.47
58	300206	理邦仪器	1,967,170.44	2.45
59	300194	福安药业	1,963,759.66	2.45
60	002550	千红制药	1,914,616.91	2.39
61	300253	卫宁软件	1,854,227.71	2.31
62	000989	九 芝 堂	1,829,209.71	2.28
63	600211	西藏药业	1,794,447.69	2.24
64	600056	中国医药	1,706,809.52	2.13
65	002030	达安基因	1,684,252.90	2.10
66	002390	信邦制药	1,680,989.44	2.10

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。

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	192,714,314.94
卖出股票收入（成交）总额	223,013,362.94

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。

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前十名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投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金报告期末持有股指期货。

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

注：本基金报告期末持有国债期货。

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投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

注：本基金报告期末持有国债期货。

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，在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

7.12.2 本基金所投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

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	62,971.85
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,374.02
5	应收申购款	916,732.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	988,077.94

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	002223	鱼跃医疗	2,320,626.00	2.54	重大事项

7.12.6 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。

§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
3,794	13,053.32	4,100,110.22	8.28%	45,424,199.98	91.72%

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	153,051.79	0.3090%

注：截止本报告期末，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。

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（ 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	79,975,081.74
本报告期基金总申购份额	75,585,756.62
减：本报告期基金总赎回份额	106,036,528.16
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	49,524,310.20

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。

§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

本报告期内基金管理人总经理发生变更，由林冠和先生变更为林瑞源先生，该事项已于2015年4月2日进行公告。

本报告期内基金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

本基金投资策略并无重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金管理人聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计的会计师事务所。本报告期内未改聘为本基金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，托管人及其高级管理人员无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	
中信证券	2	143,926,935.80	34.62%	131,031.50	34.62%	-
中金公司	1	99,950,019.13	24.04%	90,994.68	24.04%	-
海通证券	1	81,764,281.20	19.67%	74,438.34	19.67%	-
安信证券	2	55,713,652.87	13.40%	50,721.86	13.40%	-
国信证券	2	30,819,795.70	7.41%	28,058.12	7.41%	-
国泰君安	1	3,552,993.18	0.85%	3,234.71	0.85%	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	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。我公司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。本基金本报告期内分别向安信证券、招商证券、中信证券、银河证券租用了基金专用交易单元。

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
中信证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	4,000,000.00	100.00%	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

§11 影响投资者决策的其他重要信息

基金管理人于2015年8月3日发布了《关于华润元大医疗保健量化股票型证券投资基金变更基金类型并相应修订基金合同部分条款的公告》。自2015年8月3日起，华润元大医疗保健量化股票型证券投资基金变更为华润元大医疗保健量化混合型证券投资基金。

华润元大基金管理有限公司
2015年8月28日