## 华润元大医疗保健量化混合型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

基金管理人:华润元大基金管理有限公司 #全杆管人.中国农业银行股份有限公司

送出日期:2018年8月25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 误导性陈述或重大请漏 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章 并由董事长签会 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2018年8月23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

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。

本招生由財务资料丰经审计

本报告期自 2018年1月1日起至6月30日止

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。

2.1 基金基本情况 2014年8月18

31, 720, 689.62

2.2 基金产品说

§ 2 基金简介

投资目标	本基金主要投资于医疗保健行业投票,通过量化与基本目相结合的方法,精造优质上市公司,在控制风险,确保基金资产的长期增值,力争实现超越的崩烂,该联急金资产的长期增值,力争实现超越业绩比较基准的长期收益。
投資策略	1.大型单产配置和的 至级经济,或有法规以及证券市场表现为资产配置有 等处生物。以为。 第分生物。以为。 数据设置的 数据设置的。 数据设置的 数据设置的。 数据设置的 数据设置的。 数据设置的。 数据设置的。 数据设置的。 数据设置的。 3.债券投资管理,对实团组、积投资团制、的改资团制。 3.债券投资管理,以等设置从转发团组、积投资团制。 4.数据则股份股份股份股份股份股份股份。以发现在一处程度上规量股票, 场的成性性风险保证基金资产的放政性。 4.数据则股份股份股份股份股份。 5.权证投资策略 本基金管理人等以价值分析为基础。在采用权证定价模型的资金。 6.的产业投资资金。 6.的产业发验资金。 6.的产业发验资金。 6.的产业发验资金。 6.的产业发验资金。 6.的产业发验资金。 6.的产业发验资金。 6.的产业发验资金。 6.的产业发验资金。 6.的产业发验资金。 6.的产业发验或分别。 6.可产业发验或分别。 6.可产业发验的可能分别。 6.可产业发验的可能分别。6.可产业发验的可能分别。6.可产业发验的可能分别。6.可产业发验的可能分别。6.可产业发验的可能分别。6.可产业发验的可能分别。6.可产业发验的可能分别。6.可产业发验的可能分别。6.可产业发验的可能分别。6.可产业发验的可能分别。6.可产业发验的可能分别。6.可产业发验的可能分别。6.可产业发验的可能分别。6.可产品发验的可能分别。6.可产品发验的可能分别。6.可产品发验的可能分别。6.可产品发验的可能分别。6.可产品发验的可能分别。6.可产品发验的可能分别。6.可产品发验的可能分别。6.可产品发验的可能分别。6.可产品发验的可
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中等风险品种,预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金

000- 1000- 89 010- 68121816 2.4 信息披露方式

tp://www.cryuantafund.com 基金半年度报告备置地户

3.1 主要会计数据和财务指标

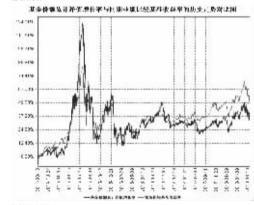
3.1.1 期间数据和指标 889. 484.85 报告期末(2018年6月30日 44, 381, 387.32

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

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	业绩比较基准收益率(3)	业绩比较基准收益率标	①-③	
	15年(1)	(2)	他以至平(3)	准要④		

阶段	份额净值增 长率①	份額净值增 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	0-3	2-4
过去一个月	- 4.57%	2.36%	- 625%	1.50%	1.68%	0.86%
过去三个月	- 0.57%	1.81%	- 0.25%	1.29%	- 0.32%	0.52%
过去六个月	5.51%	1.57%	6.39%	1.23%	- 0.88%	0.34%
过去一年	4.25%	127%	10.86%	0.99%	- 6.61%	0.28%
过去三年	- 24.26%	1.79%	0.51%	1.37%	- 24.77%	0.42%
自基金合同 生效起至今	39.90%	1.80%	55.65%	1.39%	- 15.75%	0.41%
3.2.2 自言	5.金合同生交	以来基金份	物果 计净值	增长率变动及	2其与同期业绩	比较基准收益



§ 4 管理人报告

41 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 2018年6月30日,本基金管理人共管理十二只开放式基金:华润元大安鑫灵活配置混合型证 券投资基金,华洞元大现金收益货币市场基金,华洞元大信息传媒科技混合型证券投资基金,华 洞元大医疗保健量化混合型证券投资基金,华洞元大窗时中国 **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,华润元大现金通货币市场基金,华润 元大洞鑫债券型证券投资基金,华润元大润泰双鑫债券型证券投资基金,华润元大润泽债券型

412基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

l .		LL 40 ( tot 591			
寰华涛	权部理元灵混券金理元保混券金理元传混券金理元包指投联基础,大活合投基、大陆合投基、大陆合投基、大陆合投基、大工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工	2015年9月16日	-	<b>8</b> 年	曾任年奉证李股份有限公 研究员、华帝证券、上海 严管拥有限公司量化股份 用。2015年9月16日3 任年间元大安康政活配号合型证券投资基金基金 用。2015年9月16日3 任年间元大医厅保健斯 理。2015年9月16日3 世年的元大医厅保健斯 平间元大医厅保健斯 型证券投资基金基金 用。2016年8月5日3时 市间元大医厅保健斯 时间,2017年8月7日3日17日 市间元大医厅保健斯 时间,2017年8月7日3日17日 市间元大医企业
石武斌	华富45 全国资金华医量型资金华信科型资金年信科型资金华医量型资金华医量型货化证基经间货证基经间货证基经间货证基经间货 化诺奈金理元传混奈金理元传混奈金理元传混奈金理元传混杂金理元明数投基	2016年8月5日	-	<b>6</b> 年	曾任国海证券股份有限公 证券资产管理分公司银代 资研究员。2016年4月 启起租任华男元大都时村 A50 指数等证券投资基 金金经理。2017年8月1日志 经理。2017年8月1日志 位于明元大信息传做新社 合型证券投资基金基 论与数理统计硕士,具系 全从业资格。

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

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。

4.3.1 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

与的交易所公开竞价同口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 金管理有限公司依熙(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

4.4 答理人对招生期由北全的招咨等政和业绩事和的说明 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内 本基金运用量化洗股策略 投资医药行业中业绩较好 估值合理的优质价值成长 股为主。当前医药行业增速较为稳健,处于长周期向上的拐点附近,继续看好医药行业的未来表

报告期内,本基金份额净值增长率为5.51%,业绩比较基准收益率为6.39% 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018年上半年, GDP 增速连续 2 个季度下滑, 宏观经济不确定性依然较大, 股市整体的调 整幅度也较大,医药、食品饮料等少数业绩确定性较强的行业成了宏观不确定性中的避风港,继 **使要好医若行业的成长性和防御层性** 

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,本基金存在连续六十个工作日以上基金资产净值低于五千万元的情形,本基 金管理人已向中国证监会报告本基金的解决方案。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,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一华洞元大基 金管理有限公司 2018年1月1日至2018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 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、基金份额中购赎回价格的计算、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半年度报告中的 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混合型证券投资基金

报告截止日: 2018年6月30日

赞产	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年 12 月 31 日
资产:			
银行存款		649, 792.39	2, 308, 272.28
结算备付金		796, 545.62	269, 263.81
存出保证金		39, 867.55	74, 148.18
交易性金融资产		41, 862, 136.82	34, 950, 278.54
其中;股票投资		40, 155, 676.82	34, 950, 278.54
基金投资			
债券投资		1, 706, 460.00	
资产支持证券投资			
贵金属投资			
衍生金融资产			
买人返售金融资产			700, 000.00
应收证券清算款		1, 714, 831.03	1, 204.38
应收利息		15, 544.88	381.39
应收股利			
应收申购款		18, 828.96	14, 595.13
递延所得税资产		-	
其他资产			
资产总计		45, 097, 547.25	38, 318, 143.71
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017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		132, 627.76	
应付赎回款		103, 621.79	213, 001.73
应付管理人报酬		54, 734.56	48, 129.17
应付托管费		9, 122.45	8, 021.49
应付销售服务费			
应付交易费用		192, 003.60	142, 335.94
应交税费			
应付利息			
应付利润			
递延所得税负债			
其他负债		224, 049.77	350, 394.51
负债合计		716, 159.93	761, 882.84
所有者权益:			
实收基金		31, 720, 689.62	28, 318, 302.37
未分配利润		12, 660, 697.70	9, 237, 958.50
所有者权益合计		44, 381, 387.32	37, 556, 260.87
负债和所有者权益总计		45, 097, 547.25	38, 318, 143.71

6.2 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: 2018年1月1日至2018年6月30日

4001700000			
項目	附注号	本期 2018年1月1日至2018 年6月30日	上年度可比期间 2017年 1 月 1 日至 2017年 6 月 30 日
一、收人		2, 809, 702.28	30, 708.45
1.利息收入		31, 725.34	41, 073.97
其中:存款利息收入	6.4.7.11	10, 260.80	19, 244.46
债券利息收人		18, 228.21	0.56
资产支持证券利息收入		-	
买人返售金融资产收入		3, 236.33	21, 828.95
其他利息收人		-	
2.投资收益( 损失以" - "填列)		1, 702, 125.27	- 4, 477, 328.28
其中:股票投资收益	6.4.7.12	1, 363, 712.04	- 4, 867, 228.95
基金投资收益		-	
债券投资收益	6.4.7.13	959.04	
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	18, 233.01	
股利收益	6.4.7.16	319, 221.18	389, 900.67
3.公允价值变动收益( 损失以" - " 号填列)	6.4.7.17	1, 036, 730.81	4, 441, 323.16
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	39, 120.86	25, 639.60
减:二、费用		883, 486.62	1, 531, 582.42
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	294, 250.15	384, 125.63
2. 托管费	6.4.10.22	49, 041.68	64, 020.93
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	
4. 交易费用	6.4.7.19	405, 395.38	867, 728.83
5. 利息支出		-	
其中:卖出回购金融资产支出		-	
6. 税金及附加		65.64	
7. 其他费用	6.4.7.20	134, 733.77	215, 707.03
三、利润总额(亏损总额以"。"号填列)		1, 926, 215.66	- 1, 500, 873.97
减:所得税费用		-	
四、净利润(净亏损以"。"号填列)		1, 926, 215.66	- 1, 500, 873.97

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混合型证券投资基金 本报告期,2018年1月1日至2018年6月30日

本期							
项目	2018年	2018年 1 月 1 日至 2018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)	28, 318, 302.37	9, 237, 958.50	37, 556, 260.87				
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本期净 利润)	-	1, 926, 215.66	1, 926, 215.66				
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, 402, 387.25	1, 496, 523.54	4, 898, 910.79				
其中:1.基金申购款	11, 418, 952.38	4, 757, 474.92	16, 176, 427.30				
2.基金赎回款	- 8, 016, 565.13	- 3, 260, 951.38	- 11, 277, 516.51				
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)	31, 720, 689.62	12, 660, 697.70	44, 381, 387.32				
项目	上年度可比期间 2017年 1 月 1 日至 2017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)	42, 640, 351.97	15, 867, 815.03	58, 508, 167.00				
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本期净 利润)	-	- 1, 500, 873.97	- 1,500,873.97				
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)	- 6, 348, 753.82	- 1, 964, 642.46	- 8, 313, 396.28				
其中:1.基金申购款	2, 956, 079.66	916, 914.62	3, 872, 994.28				
2.基金赎回款	- 9, 304, 833.48	- 2, 881, 557.08	- 12, 186, 390.56				
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)	36, 291, 598.15	12, 402, 298.60	48, 693, 896.75				
报表附注为财务报表	<b>長的组成部分</b> 。						
本报告 6.1 至 6.4 财	务报表由下列负责人签	署:					

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

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 份基金份額。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 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干非理金基金资产的 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 2018 年 6 月 30 日的 财务状况以及自 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。 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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

6.4.5.2 会计估计变更的说明

6.4.5.3 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。

证券(股票)交易印花税税率为1%,由出让方缴纳。 (2)增值税及附加、企业所得税

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,金融业纳人试点范 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。金融机构开展的质押式买人返售金融商品业务 买断式买人 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

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]56号文《关于资管产品增值税有关问题 的通知)的规定,自2018年1月1日起,资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应 税行为(以下称资管产品运营业务), 暂适用简易计税方法,按照 3%的征收率缴纳增值税。管理 人应分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额。未分别核算的,资管 产品运营业务不得适用于简易计税方法。对资管产品在 2018年1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。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租人固定资产进项税额抵扣等增值税 政策的通知》的规定、自 2018 年 1 月 1 日起、资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发 生的部分金融商品转让业务,按照以下规定确定销售额:提供贷款服务,以 2018年1月1日起 产生的利息及利息性质的收入为销售额;转让2017年12月31日前取得的股票(不包括限售 股)、债券、基金、非货物期货,可以选择按照实际买入价计算销售额,或者以 2017 年最后一个交 易日的股票收盘价(2017年最后一个交易日处于停牌期间的股票,为停牌前最后一个交易日收 盘价)、债券估值(中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值)、基金份额 净值,非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

增值税附加税包括城市维护建设税 教育费附加和地方教育费附加 以实际缴纳的增值税 税额为计税依据。分别按7%。3%和2%的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费 附加。 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。

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、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴 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 红利所得全额计人应纳税所得额,持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计人 应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂免征收个人所得税。

6.4.7.1 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 6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

OHNE THE MITTER SERVICES	7 1 7 1 7 1 7 1
关联方名称	与本基金的关系
	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。 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。 6.4.8.1 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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费 单位:人民币元

项目	本期 2018年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
期发生的基金应支付的 理费	294, 250.15	384, 125.63
中:支付销售机构的客户 护费	162, 600.60	214, 260.24
注:(1)基金管理费按		6的年费率计提,按月支付。日管理费

(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。

6.4.8.2.2 基金托管费 单位:人民币元

项目	2018年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的 托管费	49, 041.68	64, 020.93
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	<b>%+</b> 当年天数。	

6.4.8.2.3 销售服务费 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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债券(含回购)交易。 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况 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。 6.4.8.4.2 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

报告期末除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金 6.4.8.5 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

2018年1月1日至2018年6月30日 2017年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 649, 792.39 上,本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管,按银行同业利率计自

6486本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况 本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券 6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

6.4.9 期末(2018年6月30日)本基金持有的流通受限证券 6.4.9.1 因认购新发 / 增发证券而于期末持有的流通受限证券 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 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

会额单位, 人民币元 股 停 期末 .... 复牌

票码	票名称	停 円 期	原因	估值单 价	复牌日期	开盘单 价	数量(股)	期末 成本总额	期末估值	各言
39 9	益丰药房	2018 年 4 月 17 日	重大资产重组停牌	53.07	2018 年 7 月 16 日	65.69	17, 000	896, 887.34	902, 190.00	
6	6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券									

截至本报告期末,本基金未持有从事银行间市场债券下回购交易中作为抵押的债券,

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, 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

§ 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	金額	(%)
1	权益投资	40, 155, 676.82	89.04
	其中:股票	40, 155, 676.82	89.04
2	固定收益投资	1, 706, 460.00	3.78
	其中:债券	1, 706, 460.00	3.78
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买人返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买人返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	1, 446, 338.01	321
7	其他各项资产	1, 789, 072.42	3.97
8	合计	45, 097, 547.25	100.00
7	9 加土地仁小八米价机而社次和人	•	•

公允价值

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

行业类别

Α	农、林、牧、渔业		-
В	采矿业		-
С	制造业	26, 131, 137.59	58.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应 业	-	-
Е	建筑业		-
F	批发和零售业	8, 888, 782.50	20.03
G	交通运输、仓储和邮政业		-
Н	住宿和餐饮业		-
1	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		-
М	科学研究和技术服务业		-
Ν	水利、环境和公共设施管理业		-
0	居民服务、修理和其他服务业		-
Р	教育		-
Q	卫生和社会工作	5, 135, 756.73	11.57
R	文化、体育和娱乐业		-
S	综合		
	合计	40, 155, 676.82	90.48

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

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

1			数量(股)	公允价值	占基金资产净值 比例(%)
	000661	长春高新	18, 712	4, 260, 722.40	9.60
2	600276	恒瑞医药	55, 170	4, 179, 67920	9.42
3	300347	泰格医药	64, 779	4, 007, 876.73	9.03
4	000963	华东医药	82, 950	4, 002, 337.50	9.02
5	002727	一心堂	121, 500	3, 942, 675.00	8.88
6	300003	乐普医疗	100,600	3, 690, 008.00	8.31
7	600566	济川药业	67, 215	3, 239, 090.85	7.30
8	600867	通化东宝	91, 962	2, 204, 329.14	4.97
9	600518	康美药业	92, 100	2, 107, 248.00	4.75
10	600196	复星医药	38, 500	1, 593, 515.00	3.59

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	本期累计买人金额	占期初基金资产净值 比例(%)
1	600276	恒瑞医药	6, 868, 351.00	18.29
2	600566	济川药业	5, 754, 526.75	15.32
3	600867	通化东宝	5, 474, 741.01	14.58
4	000963	华东医药	5, 294, 818.00	14.10
5	300003	乐普医疗	5, 127, 614.00	13.65
6	300347	泰格医药	5, 040, 347.94	13.42
7	000661	长春高新	4, 819, 929.68	12.83
8	002727	一心堂	4, 447, 800.00	11.84
9	600518	康美药业	3, 853, 941.91	10.26
10	002365	永安药业	3, 732, 890.00	9.94
11	300233	金城医药	3, 431, 500.00	9.14
12	000538	云南白药	3, 315, 869.00	8.83
13	603669	灵康药业	3, 287, 158.90	8.75
14	002393	力生制药	3, 247, 476.00	8.65
15	600511	国药股份	3, 175, 464.00	8.46
16	600196	复星医药	3, 129, 196.00	8.33
17	002626	金达威	3, 044, 663.08	8.11
18	002019	亿帆医药	3, 000, 534.00	7.99
19	300485	赛升药业	2, 540, 687.00	6.77
20	600976	健民集团	2, 438, 425.00	6.49
21	300015	爱尔眼科	2, 428, 741.50	6.47
22	603567	珍宝岛	2, 358, 119.84	6.28
23	002001	新和成	2, 314, 504.11	6.16
24	600216	浙江医药	2, 273, 653.00	6.05
25	000651	格力电器	2, 175, 749.00	5.79
26	600557	康缘药业	2, 126, 024.00	5.66
27	002262	思华药业	2, 118, 447.00	5.64
28	600535	天士力	1, 990, 840.00	5.30
29	600332	白云山	1, 967, 600.00	5.24
30	600351	亚宝药业	1, 947, 005.00	5.18
31	600422	昆药集团	1,742,951.00	4.64
32	300009	安科生物	1, 698, 463.00	4.52
33	600436	片仔癀	1, 520, 337.00	4.05
34	600781	辅仁药业	1, 503, 807.00	4.00
35	603939	益丰药房	1, 320, 339.00	3.52
36	000028	国药一致	1, 293, 732.00	3.44
37	600380	健康元	1, 235, 308.00	3.29
38	600211	西藏药业	1, 218, 816.00	3.25
39	600845	宝信软件	1, 169, 304.00	3.11
40	600085	同仁堂	1, 127, 697.00	3.00
41	000015	山土 (松) (松	1 093 440 00	2.01

48 600529 761, 329.00 注:买人金额按买人成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

1, 085, 375.00

1, 029, 345.0

990, 322.00

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

42 000756 43 002223

600090

- 1	600276	但地区约	4, 947, 438.61	13.17
2	300233	金城医药	4, 725, 646.00	12.58
3	002393	力生制药	4, 547, 290.40	12.11
4	600566	济川药业	3, 974, 985.00	10.58
5	603567	珍宝岛	3, 664, 869.01	9.76
6	600535	天士力	3, 574, 830.00	9.52
7	002365	永安药业	3, 567, 885.00	9.50
8	000538	云南白药	3, 511, 912.00	9.35
9	603669	灵康药业	3, 434, 228.94	9.14
10	600867	通化东宝	3, 249, 837.20	8.65
11	600976	健民集团	3, 100, 461.74	826
12	002626	金达威	3, 083, 303.78	821
13	600511	国药股份	3, 083, 083.00	821
14	600518	康美药业	3, 080, 315.39	820
15	000963	华东医药	3, 007, 405.00	8.01
16	002019	亿帆医药	2, 907, 531.00	7.74
17	002422	科伦药业	2, 725, 540.38	726
18	600196	复星医药	2, 683, 034.00	7.14
19	600332	白云山	2, 606, 044.00	6.94
20	002001	新和成	2, 511, 041.74	6.69
21	600380	健康元	2, 486, 038.00	6.62
22	600557	康缘药业	2, 470, 810.31	6.58
23	600664	哈药股份	2, 439, 082.00	6.49
24	600090	同济堂	2, 420, 733.99	6.45
25	002737	葵花药业	2, 368, 928.00	6.31
26	600216	浙江医药	2, 302, 389.00	6.13
27	300485	赛升药业	2, 287, 983.00	6.09
28	000651	格力电器	2, 170, 476.00	5.78
29	600436	片仔癀	2, 131, 668.00	5.68
30	600529	山东药玻	2, 052, 648.00	5.47
31	002727	一心堂	1, 936, 007.00	5.15
32	300015	爱尔眼科	1, 931, 049.56	5.14
33	600351	亚宝药业	1, 783, 896.00	4.75
34	000513	丽珠集团	1, 728, 755.00	4.60
35	600422	昆药集团	1, 635, 616.00	4.36
36	300009	安科生物	1, 618, 626.80	4.31
37	600781	辅仁药业	1, 562, 540.00	4.16
38	300158	振东制药	1, 462, 201.00	3.89
39	603939	益丰药房	1, 397, 149.00	3.72
40	600085	同仁堂	1, 360, 631.23	3.62
41	603368	柳药股份	1, 355, 144.20	3.61
42	000989	九芝堂	1, 340, 151.50	3.57
43	600211	西藏药业	1, 336, 489.00	3.56
44	300347	泰格医药	1, 316, 535.00	3.51
45	000756	新华制药	1, 293, 947.00	3.45
46	000661	长春高新	1, 278, 558.00	3.40
47	000028	国药一致	1, 256, 949.00	3.35
48	300003	乐普医疗	1, 255, 562.00	3.34
49	300396	迪瑞医疗	1, 209, 430.70	322
50	002223	鱼跃医疗	1, 195, 043.00	3.18
51	000915	山大华特	1, 192, 018.00	3.17

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 单位:人民币元

55 601600

133. 382, 525.79 注,买人股票成本,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 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

863. 978.00

1, 706, 460,0 1, 706, 460.00

322 7	顿单位:人民市	兀							
序号	字号 债券代码 债券名称 数量(张) 公允价值 占基金资产净值 比例(%)								
1	018005	国开 1701	17, 000	1, 706, 460.00	3.84				
注:	本基金本报告	期末仅持有1	只债券。						

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 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

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

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约

名称

18, 780.0 注:本基金本报告期末未持仓股指期货 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

报告期末,未持仓股指期货。 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

本报告期末,未持仓国债期货 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细 本基金本报告期末未持仓国债期货

7.11.3 本期国债期货投资评价 本报告期末,未持仓国债期货 7.12 投资组合报告附注

基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前。

年内受到公开谴责、处罚的情形 7.12.2 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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

1, 714, 831.0 18, 828.9 1, 789, 072.42 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明纸 本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分 由于四舍五人的原因,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

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

份额单位:份 3, 269, 619.48 10.31% 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的

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

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

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

§ 9 开放式基金份额变动

§ 10 重大事件揭示

10.4 基金投资策略的改变 报告期未改变投资策略。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

31, 720, 689.62 x报告期期末基金份额总额 注,本基金总申购份额含红利再投、转换人份额,总赎回份额含转换出份额

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

本招告期内,本基金管理人,基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。 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

基金管理人于 2018 年 6 月 21 日发布《华润元大基金管理有限公司改聘会计师事务所公 告》,将会计师事务所由德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)改聘为安永华明会计师事务所

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未受到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

成交金額 佣金 73, 245, 923.56 27.18% 68, 214.84 27.52% 15, 567, 542,

10, 197.70 4.11% 4, 456, 390.7 1.65% 4, 150.20 1.67% 1, 811, 596

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

2. 选择交易单元的程序。

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;

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。本基金本报告期分别新增了一个兴业证券的沪市基金专用交易单元和一个国 融证券的沪市基金专用交易单元

(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

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

	成交金額	成交忌额的比 例	成交金額	成交总额 的比例	灰交金額	成交息額 比例
招商证券	2, 304, 390.00	59.00%	10, 800, 000.00	100.00%		
华泰证券	1,601,520.96	41.00%		-		
安信证券	-	-	-	-		
兴业证券	-	-		-		
中信证券	-	-	-	-		
银河证券	-	-	-	-		
国融证券	-	-		-		
民生证券	-	-	-	-		
中银国际	-	-		-		
中信建投	-	-	-	-		
国泰君安	-	-		-		
中金公司	-	-		-		
国信证券	-	-	-	-	-	
海通证券	-			-		

华润元大基金管理有限公司

2018年8月25日

2.3 基金管理人和基金托管/

§ 3 主要财务指标和基金净值表现 金额单位:人民币元

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

3.2 基金净值表现

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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