

2017年9月30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
报告送出日期:2017年10月25日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事局及监事会在报告日前不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性、完整性和及时性承担个别及连带责任。

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10月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告所载内容仅作为投资决策依据,不构成投资建议,投资者据此操作,风险自担。

本报告期自2017年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

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

基金类型 混合型

基金合同生效日 2014年8月18日

报告期基金总资产 31,033,309.44元

投资目标 本基金主要投资于医疗保健行业,通过量化与基本面结合的分析,精选具有良好成长性、估值合理的医疗保健行业股票,力求在一定程度上超越业绩比较基准。

投资策略 本基金主要投资于医疗保健行业,通过量化与基本面结合的分析,精选具有良好成长性、估值合理的医疗保健行业股票,力求在一定程度上超越业绩比较基准。

业绩比较基准 中国医药流通指数*60%+沪深300指数*40%

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,风险风险报酬率高于货币基金和货币市场基金。

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

基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

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.所列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、基金转换费等,费用计算后实际收益水平要低于所列示的数字。

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

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.所列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、基金转换费等,费用计算后实际收益水平要低于所列示的数字。

3.3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期 2017年7月1日-2017年9月30日

1.本期已实现收益 -2,096,983.87

2.本期利润 -2,564,124.26

3.期末可供分配基金份额利润 39,534,803.10

4.期末基金资产净值 1274

5.期末基金份额净值 0.98%

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.所列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、基金转换费等,费用计算后实际收益水平要低于所列示的数字。

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

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.所列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、基金转换费等,费用计算后实际收益水平要低于所列示的数字。

3.3.2 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期 2017年7月1日-2017年9月30日

1.本期已实现收益 -706,904.69

2.本期利润 5,371,826.88

3.期末可供分配基金份额利润 25,200.00/份

4.期末基金资产净值 75,270.00/份

5.期末基金份额净值 1.001

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.所列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、基金转换费等,费用计算后实际收益水平要低于所列示的数字。

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

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.所列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、基金转换费等,费用计算后实际收益水平要低于所列示的数字。

3.3.3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期 2017年7月1日-2017年9月30日

1.本期已实现收益 -706,904.69

2.本期利润 5,371,826.88

3.期末可供分配基金份额利润 25,200.00/份

4.期末基金资产净值 75,270.00/份

5.期末基金份额净值 1.001

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.所列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、基金转换费等,费用计算后实际收益水平要低于所列示的数字。

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

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.所列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、基金转换费等,费用计算后实际收益水平要低于所列示的数字。

3.3.4 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期 2017年7月1日-2017年9月30日

1.本期已实现收益 -706,904.69

2.本期利润 5,371,826.88

3.期末可供分配基金份额利润 25,200.00/份

4.期末基金资产净值 75,270.00/份

5.期末基金份额净值 1.001

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.所列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、基金转换费等,费用计算后实际收益水平要低于所列示的数字。

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

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.所列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、基金转换费等,费用计算后实际收益水平要低于所列示的数字。

3.3.5 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期 2017年7月1日-2017年9月30日

1.本期已实现收益 -706,904.69

2.本期利润 5,371,826.88

3.期末可供分配基金份额利润 25,200.00/份

4.期末基金资产净值 75,270.00/份

5.期末基金份额净值 1.001

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.所列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、基金转换费等,费用计算后实际收益水平要低于所列示的数字。

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

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.所列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、基金转换费等,费用计算后实际收益水平要低于所列示的数字。

3.3.6 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期 2017年7月1日-2017年9月30日

1.本期已实现收益 -706,904.69

2.本期利润 5,371,826.88

3.期末可供分配基金份额利润 25,200.00/份

4.期末基金资产净值 75,270.00/份

5.期末基金份额净值 1.001

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.所列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、基金转换费等,费用计算后实际收益水平要低于所列示的数字。

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

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.所列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、基金转换费等,费用计算后实际收益水平要低于所列示的数字。

3.3.7 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期 2017年7月1日-2017年9月30日

1.本期已实现收益 -706,904.69

2.本期利润 5,371,826.88

3.期末可供分配基金份额利润 25,200.00/份

4.期末基金资产净值 75,270.00/份

5.期末基金份额净值 1.001

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.所列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、基金转换费等,费用计算后实际收益水平要低于所列示的数字。

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

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.所列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、基金转换费等,费用计算后实际收益水平要低于所列示的数字。

3.3.8 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期 2017年7月1日-2017年9月30日

1.本期已实现收益 -706,904.69

2.本期利润 5,371,826.88

3.期末可供分配基金份额利润 25,200.00/份

4.期末基金资产净值 75,270.00/份

5.期末基金份额净值 1.001

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.所列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、基金转换费等,费用计算后实际收益水平要低于所列示的数字。

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

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.所列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、基金转换费等,费用计算后实际收益水平要低于所列示的数字。

3.3.9 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期 2017年7月1日-2017年9月30日

1.本期已实现收益 -706,904.69</p