

**国联安中证医药 100 指数证券投资基金**  
**2016 年半年度报告**  
**2016 年 6 月 30 日**

基金管理人：国联安基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一六年八月二十六日

## 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>1 重要提示及目录</b> .....	2
1.1 重要提示.....	2
<b>2 基金简介</b> .....	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.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>4 管理人报告</b> .....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
<b>5 托管人报告</b> .....	11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	11
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.....	11
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.....	11
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	11
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	13
6.4 报表附注.....	15
<b>7 投资组合报告</b> .....	30
7.1 期末基金资产组合情况.....	31
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	31
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	32
7.3.1 期末指数投资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.....	32
7.3.2 期末积极投资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.....	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	35
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	36
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.....	36
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	36
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.....	37
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.....	37
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	37
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	37
7.12 投资组合报告附注.....	37
<b>8 基金份额持有人信息</b> .....	38

8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	38
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	38
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 .....	38
<b>9</b>	<b>开放式基金份额变动</b> .....	<b>39</b>
<b>10</b>	<b>重大事件揭示</b> .....	<b>39</b>
10.1	基金份额持有人大会决议 .....	39
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 .....	39
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	39
10.4	基金投资策略的改变 .....	39
10.5	报告期内改聘会计师事务所情况 .....	39
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 .....	39
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	39
10.8	其他重大事件 .....	41
<b>11</b>	<b>备查文件目录</b> .....	<b>44</b>
11.1	备查文件目录 .....	44
11.2	存放地点 .....	44
11.3	查阅方式 .....	44

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国联安中证医药 100 指数证券投资基金
基金简称	国联安医药 100 指数
基金主代码	000059
交易代码	000059
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 8 月 21 日
基金管理人	国联安基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	187,449,544.85 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，通过严谨的数量化管理和投资纪律约束，力争保持基金净值收益率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%，为投资者提供一个投资中证医药 100 指数的有效工具，从而分享中国经济中长期增长的稳定收益。
投资策略	<p>本基金采用完全复制标的指数的方法，进行被动式指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合复制标的指数，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以复制和跟踪标的指数。本基金力争保持基金净值收益率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%，以实现中证医药 100 指数的有效跟踪。</p> <p>当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或因其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，并结合合理的投资管理策略等，最终使跟踪误差控制在限定的范围之内。</p>
业绩比较基准	95%×中证医药 100 指数收益率+5%×活期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为被动投资型指数基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益均高于货币市场基金和债券型基金。

### 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		国联安基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	陆康芸	汤嵩彦
	联系电话	021-38992806	95559
	电子邮箱	customer.service@gtja-allianz.co	tangsy@bankcomm.com

		m	
客户服务电话		021-38784766/4007000365	95559
传真		021-50151582	021-62701216
注册地址		上海市浦东新区陆家嘴环路 1318号星展银行大厦9楼	上海市浦东新区银城中路188 号
办公地址		上海市浦东新区陆家嘴环路 1318号星展银行大厦9楼	上海市浦东新区银城中路188 号
邮政编码		200121	200120
法定代表人		庹启斌	牛锡明

## 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
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.gtja-allianz.com">http://www.gtja-allianz.com</a> 或 <a href="http://www.vip-funds.com">www.vip-funds.com</a>
基金半年度报告备置地点	上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 9 楼

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	国联安基金管理有限公司	上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 9 楼

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2016年1月1日至2016年6月30日）
本期已实现收益	-4,815,781.17
本期利润	-48,890,805.18
加权平均基金份额本期利润	-0.2613
本期加权平均净值利润率	-18.12%
本期基金份额净值增长率	-15.04%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)
期末可供分配利润	94,207,563.15
期末可供分配基金份额利润	0.5026
期末基金资产净值	281,657,108.00
期末基金份额净值	1.503
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016年6月30日)
基金份额累计净值增长率	50.30%

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，例如，开放式基金的申购赎回费等，计入费用后实际收益要低于所列数字；

2、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，包含停牌股票按公允价值调整的影响；

3、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

### 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	3.58%	1.39%	3.88%	1.43%	-0.30%	-0.04%
过去三个月	1.83%	1.47%	1.88%	1.51%	-0.05%	-0.04%
过去六个月	-15.04%	2.23%	-15.79%	2.26%	0.75%	-0.03%
过去一年	-22.04%	2.66%	-21.94%	2.60%	-0.10%	0.06%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	50.30%	2.00%	63.80%	1.96%	-13.50%	0.04%

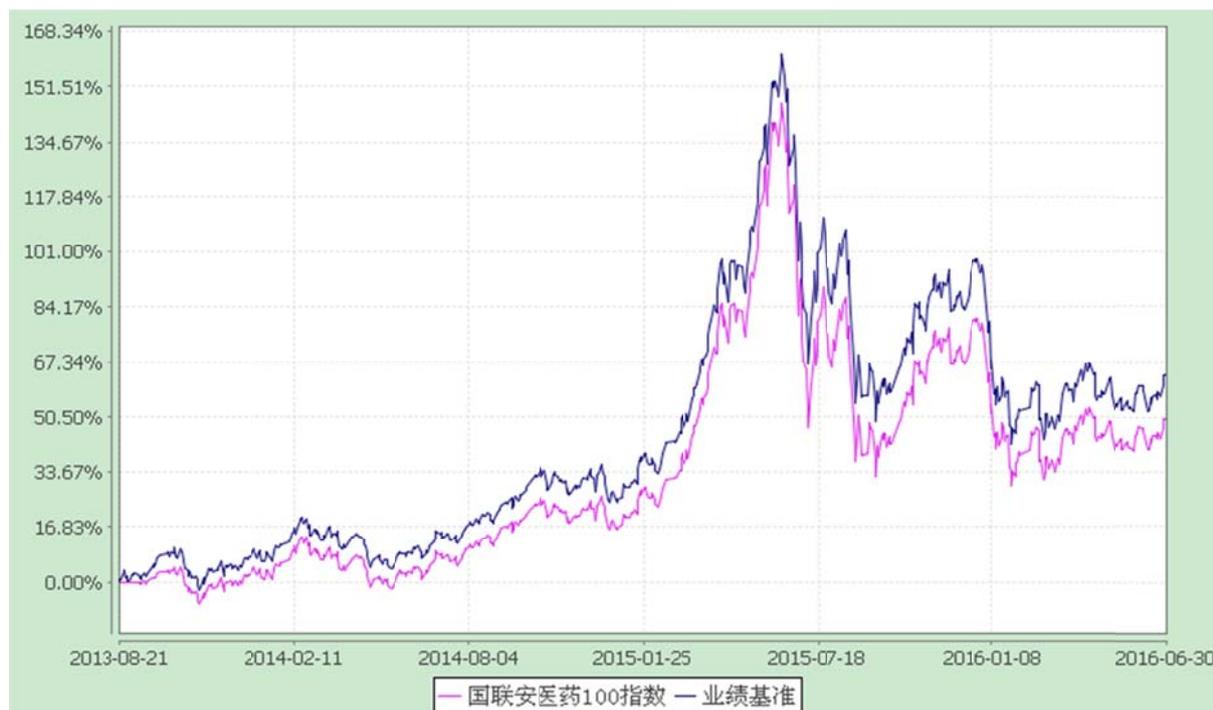
注：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 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

国联安中证医药 100 指数证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2013 年 8 月 21 日至 2016 年 6 月 30 日）



- 注：1、本基金业绩比较基准为： $95\% \times \text{中证医药 100 指数收益率} + 5\% \times \text{活期存款利率（税后）}$ ；
- 2、本基金基金合同于 2013 年 8 月 21 日生效。本基金建仓期为自基金合同生效之日起的 6 个月，建仓期结束时各项资产配置符合合同约定；
- 3、上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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

## 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

国联安基金管理有限公司是中国第一家获准筹建的中外合资基金管理公司，其中方股东为国泰君安证券股份有限公司，是目前中国规模最大、经营范围最宽、机构分布最广的综合类证券公司之一；外方股东为德国安联集团，是全球顶级综合性金融集团之一。截至本报告期末，公司共管理三十一只开放式基金。国联安基金管理公司拥有国际化的基金管理团队，借鉴外方先进的公司治理和风险管理经验，结合本地投资研究与客户服务的成功实践，秉持“稳健、专业、卓越、信赖”的经营理念，力争成为中国基金业最佳基金管理公司之一。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理	证券从业	说明
----	----	-----------	------	----

		(助理) 期限		年限	
		任职日期	离任日期		
冒浩	本基金基金经理、兼任国联安双力中小板综指证券投资基金 (LOF) 基金经理	2015-05-29	-	6 年 (自 2010 年起)	冒浩, 英国帝国理工大学硕士研究生毕业, 2009 年加入国联安基金管理有限公司, 从事量化投资相关工作。先后担任基金经理助理、基金经理。2015 年 5 月起担任国联安中证医药 100 指数证券投资基金基金经理。2015 年 5 月起兼任国联安双力中小板综指证券投资基金 (LOF) 基金经理。

注: 1、基金经理的任职日期和离职日期为公司对外公告之日;

2、证券从业年限的统计标准为证券行业的工作经历年限。

#### 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守《中华人民共和国证券投资基金法》、《国联安中证医药 100 指数证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规、法律文件的规定, 本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产, 在严格控制风险的前提下, 为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定, 无损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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

本基金管理人遵照相应法律法规和内部规章, 制定并完善了《国联安基金管理有限公司公平交易制度》(以下简称“公平交易制度”), 用以规范包括投资授权、研究分析、投资决策、交易执行以及投资管理过程中涉及的实施效果与业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

本报告期内, 本基金管理人严格执行公平交易制度的规定, 公平对待不同投资组合, 确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和投资决策等方面均享有平等机会; 在交易环节严格按照时间优先, 价格优先的原则执行指令; 如遇指令价位相同或指令价位不同但市场条件都满足时, 及时执行交易系统内的公平交易模块; 采用公平交易分析系统对不同投资组合的交易价差进行定期分析; 对投资流程独立稽核等。

本报告期内, 公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未发现有超过该证券当日成交量 5% 的情况。公平交易制度总体执行情况良好。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的无法解释的异常交易行为。

#### 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

在报告期内，本基金采用完全复制中证医药 100 指数的方法，在处理基金的日常申购赎回、成份股长期停牌等事件的过程中，基金管理人综合考虑交易成本、个股权重偏离等因素进行组合调整，将本基金的跟踪误差控制在合理水平。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末，本基金份额净值为 1.503 元，本报告期份额净值增长率为-15.04%，同期业绩比较基准收益率为-15.79%。本报告期内，日均跟踪偏离度为 0.06%，年化跟踪误差为 1.53%，分别符合基金合同约定的日均跟踪偏离度绝对值不超过 0.35%，以及年化跟踪误差不超过 4.0%的限制。

#### 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 年二季度，从宏观面来看，经济出现回调迹象，房地产销售触顶，带动地产投资增速从 7.2% 略降到 7%。全年来看，考虑到政府稳增长、房地产投资惯性以及工业品低库存的支撑，总需求回落并不会明显下降，预计房地产投资增长率稳定在 5% 左右，工业品价格跌幅继续收敛，PPI 预计在年底收敛到 0 附近。从市场来看，目前上证估值合理，考虑到今年经济整体平稳，供给侧改革持续推进，美联储加息进程缓慢，以及市场已消化了大部分风险，预计指数在 2700 点左右有很强的支撑，对应 PE 估值在 11-12 倍之间（相当于 2012-2013 年估值，即上一库存周期上升段的估值）。

医药行业收入利润增速依旧保持在较高水平，而受老龄化、城镇化的影响，未来行业增速仍将确定上行。同时，医药板块上半年表现虽然相对落后，却给投资者提供了更高的安全边际，同时目前医药板块估值溢价率处于较低水平，因此当下医药板块具有非常好的投资价值。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司内部建立估值工作小组对证券估值负责。估值工作小组由公司基金事务部、投资组合管理部、交易部、监察稽核部、风险管理部、数量策略部、研究部部门经理组成，并根据业务分工履行相应的职责，所有成员都具备丰富的专业能力和估值经验，参与估值流程各方不存在重大利益冲突。基金经理不直接参与估值决策，估值决策由估值工作小组成员 1/2 以上多数票通过，数量策略部、研究部、投资组合管理部对估值决策必须达成一致，估值决策由公司总经理签署后生效。对于估值政策，公司和基金托管银行有充分沟通，积极商讨达成一致意见；对于估值结果，公司和基金托管银行有详细的核对流程，达成一致意见后才能对外披露。会计师事务所认可公司基金估值的政策和流程的适当性与合理性。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据法律法规的规定和本基金基金合同的约定，以及本基金实际运作情况，本基金本报告期末进行利润分配，符合本基金基金合同的相关规定。

### 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

报告期内，基金托管人在国联安中证医药 100 指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

#### 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

报告期内，国联安基金管理有限公司在国联安中证医药 100 指数证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

#### 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

报告期内，由国联安基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关国联安中证医药 100 指数证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

### 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：国联安中证医药 100 指数证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	26,825,590.32	33,003,540.32

结算备付金		65,255.07	98,076.31
存出保证金		39,362.87	155,935.65
交易性金融资产	6.4.7.2	256,550,311.45	292,137,217.72
其中：股票投资		256,550,311.45	292,137,217.72
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	6,496.87	7,455.04
应收股利		-	-
应收申购款		629,968.69	448,575.49
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>284,116,985.27</b>	<b>325,850,800.53</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2015 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		1,843,467.29	1,411,403.54
应付管理人报酬		179,410.33	218,347.41
应付托管费		44,852.59	54,586.83
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	108,991.56	150,228.69
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	283,155.50	229,954.86
<b>负债合计</b>		<b>2,459,877.27</b>	<b>2,064,521.33</b>
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	6.4.7.9	187,449,544.85	183,064,635.89
未分配利润	6.4.7.10	94,207,563.15	140,721,643.31
<b>所有者权益合计</b>		<b>281,657,108.00</b>	<b>323,786,279.20</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>284,116,985.27</b>	<b>325,850,800.53</b>

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.503 元，基金份额总额 187,449,544.85 份。

## 6.2 利润表

会计主体：国联安中证医药 100 指数证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>-46,984,463.52</b>	<b>332,240,523.24</b>
1.利息收入		95,311.72	193,727.51
其中：存款利息收入	6.4.7.11	95,311.72	193,727.51
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-3,058,766.06	193,689,349.26
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-4,384,675.94	191,992,529.98
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	1,325,909.88	1,696,819.28
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-44,075,024.01	136,671,189.51
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	54,014.83	1,686,256.96
<b>减：二、费用</b>		<b>1,906,341.66</b>	<b>4,900,607.82</b>
1. 管理人报酬		1,074,417.38	2,537,781.69
2. 托管费		268,604.37	634,445.46
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	301,627.55	1,542,301.84
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.19	261,692.36	186,078.83
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-48,890,805.18</b>	<b>327,339,915.42</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-48,890,805.18</b>	<b>327,339,915.42</b>

## 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国联安中证医药 100 指数证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	183,064,635.89	140,721,643.31	323,786,279.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-48,890,805.18	-48,890,805.18
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）	4,384,908.96	2,376,725.02	6,761,633.98
其中：1.基金申购款	39,307,919.49	17,222,593.89	56,530,513.38
2.基金赎回款	-34,923,010.53	-14,845,868.87	-49,768,879.40
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）	187,449,544.85	94,207,563.15	281,657,108.00
项目	上年度可比期间 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）	511,414,105.80	85,524,731.11	596,938,836.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	327,339,915.42	327,339,915.42
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）	-266,962,953.45	-186,134,886.36	-453,097,839.81
其中：1.基金申购款	532,504,395.20	369,758,205.00	902,262,600.20
2.基金赎回款	-799,467,348.65	-555,893,091.36	-1,355,360,440.01
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）	244,451,152.35	226,729,760.17	471,180,912.52

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：

基金管理人负责人：谭晓雨，主管会计工作负责人：李柯，会计机构负责人：仲晓峰

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

国联安中证医药 100 指数证券投资基金(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”)《关于核准国联安中证医药 100 指数证券投资基金募集的批复》(证监许可[2012]1237 文)批准，由国联安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《国联安中证医药 100 指数证券投资基金基金合同》发售，基金合同于 2013 年 8 月 21 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为 414,529,636.08 份基金份额。本基金的基金管理人为国联安基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《国联安中证医药 100 指数证券投资基金基金合同》和《国联安中证医药 100 指数证券投资基金招募说明书》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，包括标的指数成份股及其备选成份股、新股、到期日在一年以内的政府债券、债券回购、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具。本基金的投资组合比例为：股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例为 85%—100%，其中投资于股票的资产市值不低于基金资产的 85%，投资于标的指数成份股和备选成份股的资产市值不低于股票资产的 90%；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，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{中证医药 100 指数收益率} + 5\% \times \text{活期存款利率（税后）}$ 。

根据《证券投资基金信息披露管理办法》，本基金定期报告在公开披露的第二个工作日，报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会公告[2010]5 号《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>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2016 年 6 月 30 日的财务状况、2016 上半年度的经营成果和基金净值变动情况。

#### 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

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

本基金在本报告期内无会计政策和会计估计变更，未发生过会计差错。

#### 6.4.6 税项

根据财税字[1998]55 号文《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》、财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

- (a) 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。
- (b) 证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。
- (c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。
- (d) 对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入，由上市公司、发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股权登记日为自 2013 年 1 月 1 日起至 2015 年 9 月 7 日期间的，暂减按 25% 计入应纳税所得额，股权登记日在 2015 年 9 月 8 日及以后的，暂免征收个人所得税。
- (e) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。
- (f) 对投资者（包括个人和机构投资者）从基金分配中取得的收入，暂不征收个人所得税和企业所得税。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
活期存款	26,825,590.32
定期存款	-
其他存款	-
合计	26,825,590.32

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	256,302,690.91	256,550,311.45	247,620.54
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	256,302,690.91	256,550,311.45	247,620.54

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末（2016 年 6 月 30 日）本基金未持有衍生金融资产/负债。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本报告期末（2016 年 6 月 30 日）本基金未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末（2016 年 6 月 30 日）本基金未持有买断式回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	6,449.73
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	29.40
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.04
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	17.70
合计	6,496.87

注：此处其他列示的是应收结算保证金利息。

#### 6.4.7.6 其他资产

本报告期末（2016 年 6 月 30 日）本基金未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	108,991.56
银行间市场应付交易费用	-
合计	108,991.56

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	6,543.14
应付指数使用费	50,000.00
预提审计费	97,323.20
预提信息披露费	129,289.16
合计	283,155.50

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	183,064,635.89	183,064,635.89
本期申购	39,307,919.49	39,307,919.49
本期赎回 (以“-”号填列)	-34,923,010.53	-34,923,010.53
本期末	187,449,544.85	187,449,544.85

注：此处申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	166,676,647.27	-25,955,003.96	140,721,643.31
本期利润	-4,815,781.17	-44,075,024.01	-48,890,805.18
本期基金份额交易产生的变动数	4,010,095.19	-1,633,370.17	2,376,725.02
其中：基金申购款	35,484,231.14	-18,261,637.25	17,222,593.89
基金赎回款	-31,474,135.95	16,628,267.08	-14,845,868.87
本期已分配利润	-	-	-
本期末	165,870,961.29	-71,663,398.14	94,207,563.15

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	活期存款利息收入	93,411.53
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	1,403.01	
其他	497.18	
合计	95,311.72	

注：此处其他列示的是上交所和深交所结算保证金利息收入和基金申购款滞留利息。

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	卖出股票成交总额	95,905,728.05
减：卖出股票成本总额	100,290,403.99	
买卖股票差价收入	-4,384,675.94	

**6.4.7.13 债券投资收益****6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

本基金本报告期内无债券投资收益。

**6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

本基金本报告期内无债券投资收益买卖债券差价收入。

**6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期内无债券投资收益赎回差价收入。

**6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期内无债券投资收益申购差价收入。

**6.4.7.14 衍生工具收益**

本基金本报告期内无衍生工具投资收益。

**6.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,325,909.88
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,325,909.88

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1.交易性金融资产	-44,075,024.01
——股票投资	-44,075,024.01
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	-44,075,024.01

**6.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	53,323.45
转换费收入	691.38
合计	54,014.83

注：本基金赎回费和转换费的 25% 归入基金资产。

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	301,627.55
银行间市场交易费用	-
合计	301,627.55

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	32,323.20
信息披露费	129,289.16
银行划款费用	80.00
指数使用费	100,000.00
合计	261,692.36

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期内，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

#### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国联安基金管理有限公司	基金管理人
交通银行股份有限公司（交通银行）	基金托管人
国泰君安证券股份有限公司（“国泰君安”）	基金管理人的股东
安联集团	基金管理人的股东
中德安联人寿保险有限公司（“中德安联”）	基金管理人的股东控制的公司

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的 比例	成交金额	占当期股票成交总额的 比例
国泰君安	204,386,964.34	100.00%	879,842,275.74	100.00%

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金与关联方无权证交易。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金与关联方无债券交易。

###### 6.4.10.1.4 债券回购交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金与关联方无债券回购交易。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的 比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的 比例

国泰君安	187,590.69	100.00%	108,991.56	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
国泰君安	787,632.56	100.00%	423,528.12	100.00%

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

根据《证券交易单元租用协议》，本基金管理人在租用国泰君安证券股份有限公司证券交易专用交易单元进行股票、债券、权证及回购交易的同时，还从国泰君安证券股份有限公司获得证券研究综合服务。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月 30日	上年度可比期间 2015年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	1,074,417.38	2,537,781.69
其中：支付销售机构的客户维护费	535,261.67	1,265,775.98

注：本基金支付基金管理人国联安基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值的 0.80% 年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。计算公式为：每日应计提的基金管理费=前一日基金资产净值×0.80%/当年天数。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月 30日	上年度可比期间 2015年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	268,604.37	634,445.46

注：本基金支付基金托管人交通银行的基金托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。计算公式为：每日应计提的基金托管费=前一日的基金资产净值×0.20%/当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金均未与关联方通过银行间同业市场进行债券(含回购)交易。

**6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**

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

本报告期内及上年度可比期间，基金管理人未投资本基金。

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

本期末及上年度末，其他关联方均未投资本基金。

**6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年6月30日		2015年1月1日至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	26,825,590.3 2	93,411.53	65,260,883.6 3	165,363.76

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计算。

**6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本报告期内及上年度可比期间，本基金均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

**6.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

本报告期内及上年度可比期间，本基金无其他关联交易事项。

**6.4.11 利润分配情况**

本报告期内本基金无利润分配情况。

**6.4.12 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券**

**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金本报告期末（2016年6月30日）未持有因认购新发和增发而流通受限的证券。

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

金额单位：人民币元

股票代码	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 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
30014	沃森生	2016-03	重大事	11.16	-	-	211,972.00	2,489,249.55	2,365,607.52	-

2	物	-22	项							
600511	国药股份	2016-02-18	重大事项	27.43	2016-08-04	30.16	90,530.00	3,027,873.00	2,483,237.90	-

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 0 元，因此没有作为抵押的债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 0 元，因此没有作为抵押的债券。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金金融工具的风险主要包括：

- 信用风险
- 流动性风险
- 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。

本基金基金管理人的风险控制组织体系分为三个层次：第一层次为董事会及督察长；第二层次为总经理、风险控制委员会、风险管理部及监察稽核部；第三层次为公司各业务相关部门对各自部门的风险控制。

风险管理的工作目标是通过建立并运用有效的策略、流程、方法和工具，识别和度量公司经营中所承受的投资风险、运作风险、信用风险等各类风险，向公司决策和管理层提供及时充分的风险报告，确保公司能对相关风险采取有效的防范控制和妥善的管理。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出

现违约、拒绝支付到期本息，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等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

#### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

本报告期末及上年度末，本基金均未持有短期信用债券投资。

#### **6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资**

本报告期末及上年度末，本基金均未持有长期信用债券投资。

#### **6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度与可能遭受的损失。本基金的流动性风险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，另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。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。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债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

#### **6.4.13.4 市场风险**

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

##### **6.4.13.4.1 利率风险**

利率风险是指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。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

## 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年6月30 日	1个月以 内	1-3 个月	6个月以 内	3个月 -1年	6个月 -1年	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产										
银行存款	26,825,590.32	-	-	-	-	-	-	-	-	26,825,590.32
结算备付金	65,255.07	-	-	-	-	-	-	-	-	65,255.07
存出保证金	39,362.87	-	-	-	-	-	-	-	-	39,362.87
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	256,550,311.45	256,550,311.45
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	-	-	-	-	-	-	-	-	6,496.87	6,496.87
应收股利	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-	-	629,968.69	629,968.69
其他资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	26,930,208.26	-	-	-	-	-	-	-	257,186,777.01	284,116,985.27
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	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	-	1,843,467.29	1,843,467.29
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	-	179,410.33	179,410.33
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	-	44,852.59	44,852.59
应付销售服务	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

费											
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	-	-	108,991.56	108,991.56
应付税费	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	-	-	283,155.50	283,155.50
负债总计	-	-	-	-	-	-	-	-	-	2,459,877.27	2,459,877.27
利率敏感度缺口	26,930,208.26	-	-	-	-	-	-	-	-	254,726,899.74	281,657,108.00
上年度末 2015 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	6 个月以内	3 个月-1 年	6 个月-1 年	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计	
资产											
银行存款	33,003,540.32	-	-	-	-	-	-	-	-	-	33,003,540.32
结算备付金	98,076.31	-	-	-	-	-	-	-	-	-	98,076.31
存出保证金	155,935.65	-	-	-	-	-	-	-	-	-	155,935.65
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	292,137,217.72	292,137,217.72
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	-	-	-	-	-	-	-	-	-	7,455.04	7,455.04
应收股利	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	448,575.49	448,575.49
其他资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	33,257,552.28	-	-	-	-	-	-	-	-	292,593,248.25	325,850,800.53
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	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	1,411,403.54	1,411,403.54	
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	218,347.41	218,347.41	
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	54,586.83	54,586.83	
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	150,228.69	150,228.69	
应付税费	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
应付利息	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
应付利润	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	229,954.86	229,954.86	
负债总计	-	-	-	-	-	-	-	2,064,521.33	2,064,521.33	
利率敏感度缺口	33,257,552.28	-	-	-	-	-	-	290,528.726.92	323,786,279.20	

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本报告期末及上年度末，本基金均未持有债券，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响，所以未进行敏感性分析。银行存款及结算备付金之浮动利率根据中国人民银行的基准利率和相关机构的相关政策浮动。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外

的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券以及银行间同业市场交易的债券，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。

本基金投资组合中股票投资比例为基金资产净值的 91.09%，无债券投资和衍生金融资产。于 2016 年 6 月 30 日，本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	256,550,311.45	91.09	292,137,217.72	90.23
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	256,550,311.45	91.09	292,137,217.72	90.23

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加 13,873,856.28	增加 17,000,829.51
	业绩比较基准下降 5%	减少 13,873,856.28	减少 17,000,829.51

### 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	256,550,311.45	90.30
	其中：股票	256,550,311.45	90.30
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	26,890,845.39	9.46
7	其他各项资产	675,828.43	0.24
8	合计	284,116,985.27	100.00

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

## 7.2.1 指数投资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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	208,218,057.52	73.93
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	29,772,736.44	10.57
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	2,721,940.00	0.97
J	金融业	-	-
K	房地产业	2,862,324.00	1.02
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	2,319,767.10	0.82
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	10,655,486.39	3.78
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	256,550,311.45	91.09

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

### 7.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

### 7.2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通股票投资。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

### 7.3.1 期末指数投资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	000078	海王生物	518,775	3,854,498.25	1.37
2	300439	美康生物	86,100	3,097,878.00	1.10
3	300363	博腾股份	124,291	3,084,902.62	1.10
4	300026	红日药业	175,800	3,057,162.00	1.09
5	300009	安科生物	99,800	2,982,024.00	1.06

6	300273	和佳股份	154,800	2,964,420.00	1.05
7	600436	片仔癀	65,724	2,958,237.24	1.05
8	000661	长春高新	27,300	2,912,364.00	1.03
9	000150	宜华健康	91,800	2,862,324.00	1.02
10	000423	东阿阿胶	54,176	2,862,118.08	1.02
11	600763	通策医疗	91,100	2,840,498.00	1.01
12	300238	冠昊生物	64,500	2,830,260.00	1.00
13	002223	鱼跃医疗	88,797	2,816,640.84	1.00
14	600557	康缘药业	172,033	2,809,298.89	1.00
15	002727	一心堂	111,854	2,796,350.00	0.99
16	002317	众生药业	227,262	2,724,871.38	0.97
17	600085	同仁堂	91,469	2,724,861.51	0.97
18	300015	爱尔眼科	74,565	2,723,859.45	0.97
19	300199	翰宇药业	133,778	2,722,382.30	0.97
20	002022	科华生物	127,735	2,722,032.85	0.97
21	300253	卫宁健康	110,200	2,721,940.00	0.97
22	000650	仁和药业	332,299	2,711,559.84	0.96
23	300204	舒泰神	146,800	2,706,992.00	0.96
24	002581	未名医药	99,200	2,703,200.00	0.96
25	002589	瑞康医药	88,000	2,702,480.00	0.96
26	002737	葵花药业	72,039	2,699,301.33	0.96
27	300016	北陆药业	117,700	2,689,445.00	0.95
28	000989	九芝堂	117,900	2,684,583.00	0.95
29	002099	海翔药业	281,900	2,683,688.00	0.95
30	000513	丽珠集团	58,154	2,681,480.94	0.95
31	002001	新和成	125,931	2,660,922.03	0.94
32	002433	太安堂	265,087	2,656,171.74	0.94
33	000999	华润三九	109,376	2,649,086.72	0.94
34	600750	江中药业	83,235	2,646,873.00	0.94
35	002030	达安基因	95,167	2,645,642.60	0.94
36	600276	恒瑞医药	65,842	2,640,922.62	0.94
37	300244	迪安诊断	79,308	2,615,577.84	0.93
38	000963	华东医药	38,772	2,613,232.80	0.93
39	603939	益丰药房	80,000	2,609,600.00	0.93
40	002422	科伦药业	169,270	2,608,450.70	0.93
41	002462	嘉事堂	69,964	2,606,159.00	0.93
42	600267	海正药业	214,459	2,605,676.85	0.93
43	300039	上海凯宝	256,073	2,604,262.41	0.92
44	002424	贵州百灵	151,278	2,601,981.60	0.92
45	600422	昆药集团	190,756	2,601,911.84	0.92
46	002294	信立泰	95,416	2,595,315.20	0.92
47	000028	国药一致	39,837	2,593,388.70	0.92
48	600329	中新药业	150,125	2,592,658.75	0.92
49	002551	尚荣医疗	110,855	2,591,789.90	0.92

50	000566	海南海药	237,456	2,590,644.96	0.92
51	300147	香雪制药	175,755	2,588,871.15	0.92
52	002038	双鹭药业	85,776	2,588,719.68	0.92
53	600594	益佰制药	160,994	2,572,684.12	0.91
54	000538	云南白药	39,996	2,571,742.80	0.91
55	002390	信邦制药	277,815	2,567,010.60	0.91
56	002603	以岭药业	161,220	2,565,010.20	0.91
57	600572	康恩贝	394,213	2,554,500.24	0.91
58	600079	人福医药	152,162	2,551,756.74	0.91
59	300436	广生堂	41,491	2,548,377.22	0.90
60	603883	老百姓	51,100	2,541,714.00	0.90
61	603718	海利生物	154,400	2,535,248.00	0.90
62	600056	中国医药	159,537	2,530,256.82	0.90
63	300003	乐普医疗	138,630	2,528,611.20	0.90
64	600420	现代制药	84,377	2,522,872.30	0.90
65	002252	上海莱士	66,912	2,521,244.16	0.90
66	600867	通化东宝	121,481	2,513,441.89	0.89
67	600664	哈药股份	301,634	2,500,545.86	0.89
68	600380	健康元	272,062	2,497,529.16	0.89
69	600201	生物股份	91,230	2,493,315.90	0.89
70	000739	普洛药业	401,083	2,490,725.43	0.88
71	601607	上海医药	137,919	2,489,437.95	0.88
72	600511	国药股份	90,530	2,483,237.90	0.88
73	600196	复星医药	130,554	2,483,137.08	0.88
74	600998	九州通	141,784	2,482,637.84	0.88
75	000623	吉林敖东	99,494	2,482,375.30	0.88
76	600535	天士力	69,340	2,479,598.40	0.88
77	600518	康美药业	163,232	2,479,494.08	0.88
78	600332	白云山	100,592	2,478,586.88	0.88
79	300347	泰格医药	85,305	2,475,551.10	0.88
80	600252	中恒集团	566,623	2,459,143.82	0.87
81	300267	尔康制药	171,500	2,455,880.00	0.87
82	600062	华润双鹤	134,727	2,454,725.94	0.87
83	600195	中牧股份	134,093	2,453,901.90	0.87
84	600161	天坛生物	88,293	2,453,662.47	0.87
85	600216	浙江医药	184,524	2,433,871.56	0.86
86	600812	华北制药	391,309	2,430,028.89	0.86
87	002411	必康股份	135,600	2,420,460.00	0.86
88	600587	新华医疗	104,703	2,417,592.27	0.86
89	300142	沃森生物	211,972	2,365,607.52	0.84
90	300485	赛升药业	50,800	2,360,168.00	0.84
91	600645	中源协和	66,015	2,319,767.10	0.82
92	002019	亿帆鑫富	150,675	2,317,381.50	0.82
93	002550	千红制药	277,246	2,312,231.64	0.82

94	002437	誉衡药业	259,795	2,260,216.50	0.80
95	603567	珍宝岛	101,000	2,206,850.00	0.78
96	600521	华海药业	77,646	1,888,350.72	0.67
97	002219	恒康医疗	167,772	1,853,880.60	0.66
98	002007	华兰生物	50,120	1,573,768.00	0.56
99	002399	海普瑞	88,794	1,550,343.24	0.55
100	300463	迈克生物	28,900	782,323.00	0.28

### 7.3.2 期末积极投资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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

## 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	000078	海王生物	4,485,112.50	1.39
2	000513	丽珠集团	3,824,028.00	1.18
3	600557	康缘药业	2,877,234.77	0.89
4	000566	海南海药	2,702,351.00	0.83
5	002581	未名医药	2,606,748.00	0.81
6	000150	宜华健康	2,547,934.00	0.79
7	300253	卫宁健康	2,544,994.00	0.79
8	002411	必康股份	2,543,608.00	0.79
9	000989	九芝堂	2,522,395.00	0.78
10	600763	通策医疗	2,512,470.00	0.78
11	300009	安科生物	2,510,113.00	0.78
12	300016	北陆药业	2,507,243.00	0.77
13	300204	舒泰神	2,503,037.16	0.77
14	603718	海利生物	2,498,586.20	0.77
15	002223	鱼跃医疗	2,496,323.00	0.77
16	600594	益佰制药	2,380,877.00	0.74
17	300122	智飞生物	1,470,825.00	0.45
18	000661	长春高新	1,348,541.44	0.42
19	300238	冠昊生物	1,329,579.00	0.41
20	600252	中恒集团	1,186,549.25	0.37

### 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
----	------	------	----------	---------

				产净值比例 (%)
1	300122	智飞生物	3,745,233.60	1.16
2	000078	海王生物	3,630,531.01	1.12
3	000513	丽珠集团	3,516,995.88	1.09
4	600566	济川药业	3,179,931.78	0.98
5	002773	康弘药业	3,101,692.12	0.96
6	300406	九强生物	3,007,719.17	0.93
7	600993	马应龙	2,982,278.44	0.92
8	002262	恩华药业	2,973,832.00	0.92
9	600521	华海药业	2,550,963.00	0.79
10	000919	金陵药业	2,506,183.60	0.77
11	002007	华兰生物	2,505,370.00	0.77
12	002118	紫鑫药业	2,385,519.75	0.74
13	002653	海思科	2,334,317.80	0.72
14	600557	康缘药业	2,284,896.39	0.71
15	002432	九安医疗	2,192,334.21	0.68
16	002019	亿帆鑫富	2,142,463.00	0.66
17	600594	益佰制药	2,086,410.00	0.64
18	300238	冠昊生物	2,028,548.37	0.63
19	002223	鱼跃医疗	1,972,919.78	0.61
20	600771	广誉远	1,890,311.50	0.58

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	108,778,521.73
卖出股票的收入（成交）总额	95,905,728.05

注：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

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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

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投资。

**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细**

本基金本报告期末未持有股指期货。

**7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金本报告期末未持有股指期货，没有相关投资政策。

**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**

本基金本报告期末未持有国债期货，没有相关投资政策。

**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有国债期货。

**7.11.3 本期国债期货投资评价**

本基金本报告期末未持有国债期货，没有相关投资评价。

**7.12 投资组合报告附注**

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

7.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

**7.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	39,362.87
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,496.87

5	应收申购款	629,968.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	675,828.43

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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

##### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

##### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

## 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
23,857	7,857.21	4,987,312.50	2.66%	182,462,232.35	97.34%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

截止本报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

### 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

截止本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间均为 0；本基金基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013 年 8 月 21 日）基金份额总额	414,529,636.08
本报告期期初基金份额总额	183,064,635.89
本报告期基金总申购份额	39,307,919.49
减：本报告期基金总赎回份额	34,923,010.53
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	187,449,544.85

注：总申购份额包含本报告期内发生的转换入和红利再投资份额；总赎回份额包含本报告期内发生的转换出份额。

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 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

1、2016 年 6 月 25 日，基金管理人发布关于《国联安基金管理有限公司高级管理人员变更公告》。自该日起刘轶先生担任我司督察长一职。公司总经理谭晓雨女士不再代为履行督察长职责。上述事项已经国联安基金管理有限公司第四届董事会第二十次会议审议通过。

2、本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内未发生基金投资策略的改变。

### 10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期内基金未有改聘为其审计的会计师事务所的情况。

### 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，基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未有受监管部门稽查或处罚的情形发生。

### 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	
国泰君安证券股份有限公司	2	204,386,964.34	100.00%	187,590.69	100.00%	-

注：1、 专用交易单元的选择标准和程序

(1) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准

基金管理人负责选择证券经营机构, 选用其专用交易单元供本基金买卖证券专用, 选用标准为:

- A 实力雄厚, 信誉良好, 注册资本不少于 3 亿元人民币。
- B 财务状况良好, 各项财务指标显示公司经营状况稳定。
- C 经营行为规范, 近一年未发生重大违规行为而受到证监会处罚。
- D 内部管理规范、严格, 具备健全的内部控制制度, 并能满足基金运作高度保密的要求。
- E 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件, 交易设备符合代理本基金进行证券交易的要求, 并能为本基金提供全面的信息服务。

F 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周到的咨询服务。

(2) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的程序

基金管理人根据上述标准考察证券经营机构后, 与被选中的证券经营机构签订交易单元使用协议, 通知基金托管人协同办理相关交易单元租用手续。之后, 基金管理人将根据各证券经营机构的研究报告、信息服务质量等情况, 根据如下选择标准细化的评价体系进行评比排名:

- A 提供的研究报告质量和数量;
- B 研究报告被基金采纳的情况;
- C 因采纳其报告而为基金运作带来的直接效益和间接效益;
- D 因采纳其报告而为基金运作避免或减少的损失;
- E 由基金管理人提出课题, 证券经营机构提供的研究论文质量;
- F 证券经营机构协助我公司研究员调研情况;
- G 与证券经营机构研究员交流和共享研究资料情况;
- H 其他可评价的量化标准。

基金管理人不但对已使用交易单元的证券经营机构进行排名, 同时亦关注并接受其他证券经营机构的研究报告和信息资讯。对于达到有关标准的证券经营机构将继续保留, 并对排名靠前的证券经营机构在交易量的分配上采取适当的倾斜政策。对于不能达到有关标准的证券经营机构则将退出

基金管理人的选择名单，基金管理人将重新选择其它经营稳健、研究能力强、信息服务质量高的证券经营机构，租用其交易单元。若证券经营机构所提供的研究报告及其他信息服务不符合要求，基金管理人有权提前中止租用其交易单元。

## 2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况

报告期内本基金租用证券公司的交易单元无变更。

### 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		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
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	国联安基金管理有限公司关于指数熔断后旗下基金调整开放时间的公告	公司网站	2016-01-04
2	国联安基金管理有限公司关于旗下场内基金在指数熔断期间暂停申购赎回业务的提示性公告	中国证券报、上证报、证券时报、证券日报、公司网站	2016-01-06
3	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持万科 A 股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2016-01-06
4	国联安基金管理有限公司关于指数熔断后旗下基金调整开放时间的公告	公司网站	2016-01-07
5	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持海格通信、深信泰丰股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2016-01-09
6	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持天龙集团股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2016-01-13
7	基金所持冠昊生物（300238）股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2016-01-14
8	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持千方科技（002373）股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2016-01-15
9	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持拓维信息、康得新股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2016-01-16

10	国联安中证医药 100 指数证券投资基金四季报	中国证券报、上证报、证券时报、证券日报、公司网站	2016-01-20
11	国联安基金管理有限公司关于增加珠海盈米财富管理有限公司为旗下开放式基金代销机构并开通定投、转换及参加费率优惠的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2016-01-28
12	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持上海佳豪、暴风科技股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2016-01-28
13	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持宁波港等股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2016-01-29
14	国联安基金管理有限公司关于增加奕丰科技服务(深圳)前海有限公司为旗下开放式基金代销机构并开通定投、转换及参加费率优惠的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2016-01-29
15	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持创意信息股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2016-01-30
16	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持万方发展、华信国际股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2016-01-30
17	国联安基金管理有限公司关于旗下基金参加钱景财富费率优惠活动的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2016-02-18
18	基金所持信威集团股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2016-02-18
19	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2016-03-02
20	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持金亚科技股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2016-03-04
21	国联安基金管理有限公司关于旗下基金参加北京乐融多源投资咨询有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、上证报、证券时报、证券日报、公司网站	2016-03-07
22	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持浦发银行股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2016-03-05
23	国联安基金关于调整旗下开放式基金申购金额下限及最低持有金额下限的公告	中国证券报、上证报、证券时报、证券日报、公司网站	2016-03-15
24	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持长安汽车等股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2016-03-19
25	国联安中证医药 100 指数证券投资基金基金 2015 年度报告摘要	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2016-03-28
26	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持完美环球(002624)估值调整的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2016-03-31
27	国联安中证医药 100 指数证券投资基金招募说明书更新(摘要)	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2016-04-05
28	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持牧原股份股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2016-04-07

29	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中国民生银行股份有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2016-04-08
30	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加上海浦东发展银行股份有限公司申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2016-04-11
31	国联安基金管理有限公司关于旗下国联安中证医药 100 指数证券投资基金参与中国民生银行股份有限公司定期定额投资业务费率优惠活动的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2016-04-12
32	国联安基金关于调整旗下开放式基金申购金额下限及最低持有金额下限的公告（展恒基金）	中国证券报、上证报、证券时报、证券日报、公司网站	2016-04-13
33	国联安基金管理有限公司关于增加深圳市金斧子投资咨询有限公司为旗下开放式基金代销机构并开通定投、转换及参加费率优惠的公告	中国证券报、上证报、证券时报、证券日报、公司网站	2016-04-13
34	国联安中证医药 100 指数证券投资基金基金 2016 年度第一季度报告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2016-04-22
35	国联安基金管理有限公司关于旗下基金参加深圳市新兰德证券投资咨询有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2016-04-25
36	国联安基金关于调整旗下开放式基金申购金额下限及最低持有金额下限的公告	中国证券报、上证报、证券时报、证券日报、公司网站	2016-04-29
37	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持汇冠股份股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2016-05-06
38	国联安基金管理有限公司关于旗下基金参加了联泰资产费率优惠活动的公告	中国证券报、上证报、证券时报、证券日报、公司网站	2016-05-09
39	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持惠博普等股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2016-05-11
40	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持神州信息等股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2016-05-13
41	国联安基金管理有限公司关于旗下基金参加中国民生银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2016-05-17
42	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持康耐特等股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2016-05-20
43	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东亚银行（中国）有限公司为代销机构并参加定期定额投资业务费率优惠活动的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2016-05-23
44	国联安基金管理有限公司关于增加北京微动利投资管理有限公司为旗下开放式基金代销机构并开通定投、转换及参加费率优惠的公告	中国证券报、上证报、证券时报、证券日报、公司网站	2016-06-03

45	国联安基金管理有限公司关于增加深圳富济财富管理有限公司为旗下开放式基金代销机构并开通定投、转换及参加费率优惠的公告	中国证券报、上证报、证券时报、证券日报、公司网站	2016-06-03
46	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持黑牛食品股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2016-06-04
47	基金所持东方国信股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2016-06-15
48	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持格力电器股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2016-06-24
49	国联安基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2016-06-25
50	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行股份有限公司申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上证报、证券时报、证券日报、公司网站	2016-06-30

## 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准国联安中证医药 100 指数证券投资基金发行及募集的文件
- 2、《国联安中证医药 100 指数证券投资基金基金合同》
- 3、《国联安中证医药 100 指数证券投资基金招募说明书》
- 4、《国联安中证医药 100 指数证券投资基金托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 7、中国证监会要求的其他文件

### 11.2 存放地点

上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 9 楼

### 11.3 查阅方式

网址：[www.gtja-allianz.com](http://www.gtja-allianz.com) 或 [www.vip-funds.com](http://www.vip-funds.com)

国联安基金管理有限公司

二〇一六年八月二十六日