

华润元大医疗保健量化混合型 证券投资基金 2016 年年度报告摘要

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

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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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

2.4 信息披露方式

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

§ 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

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。

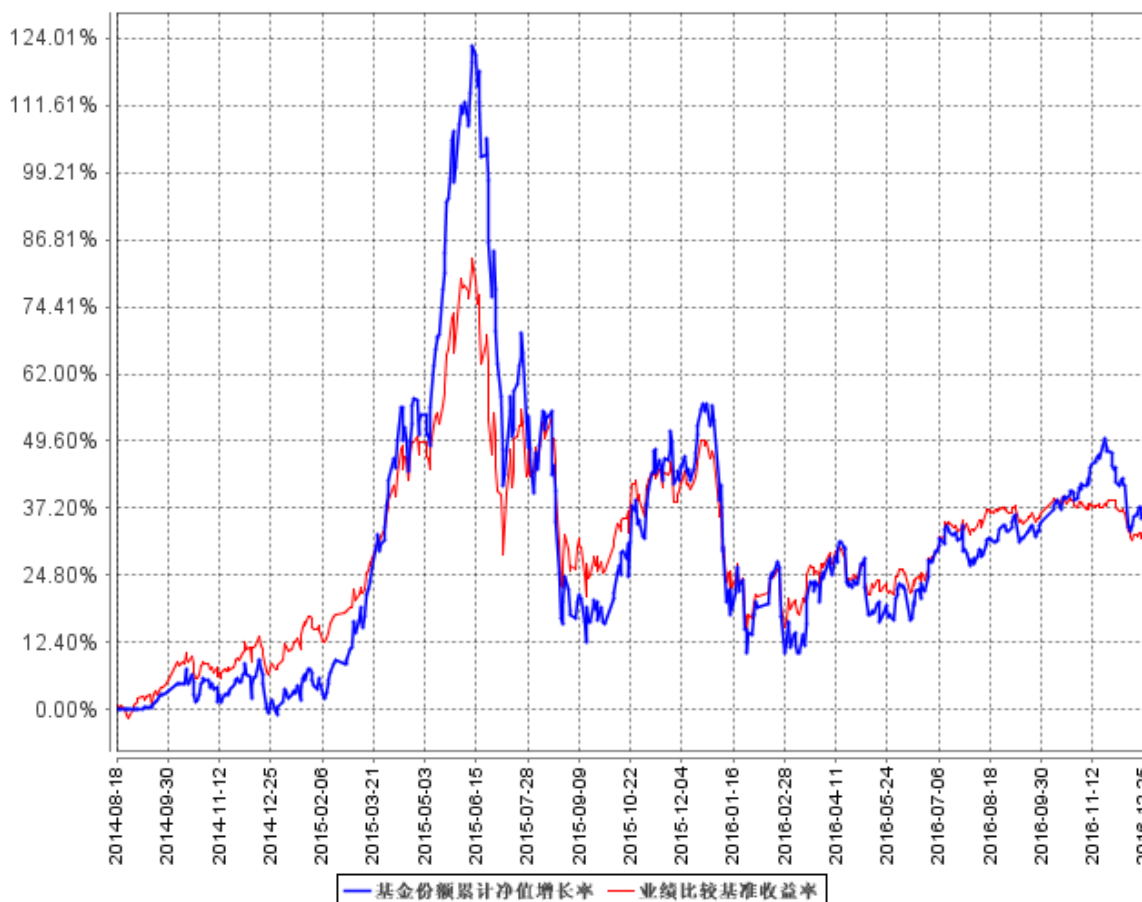
3.2 基金净值表现

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%

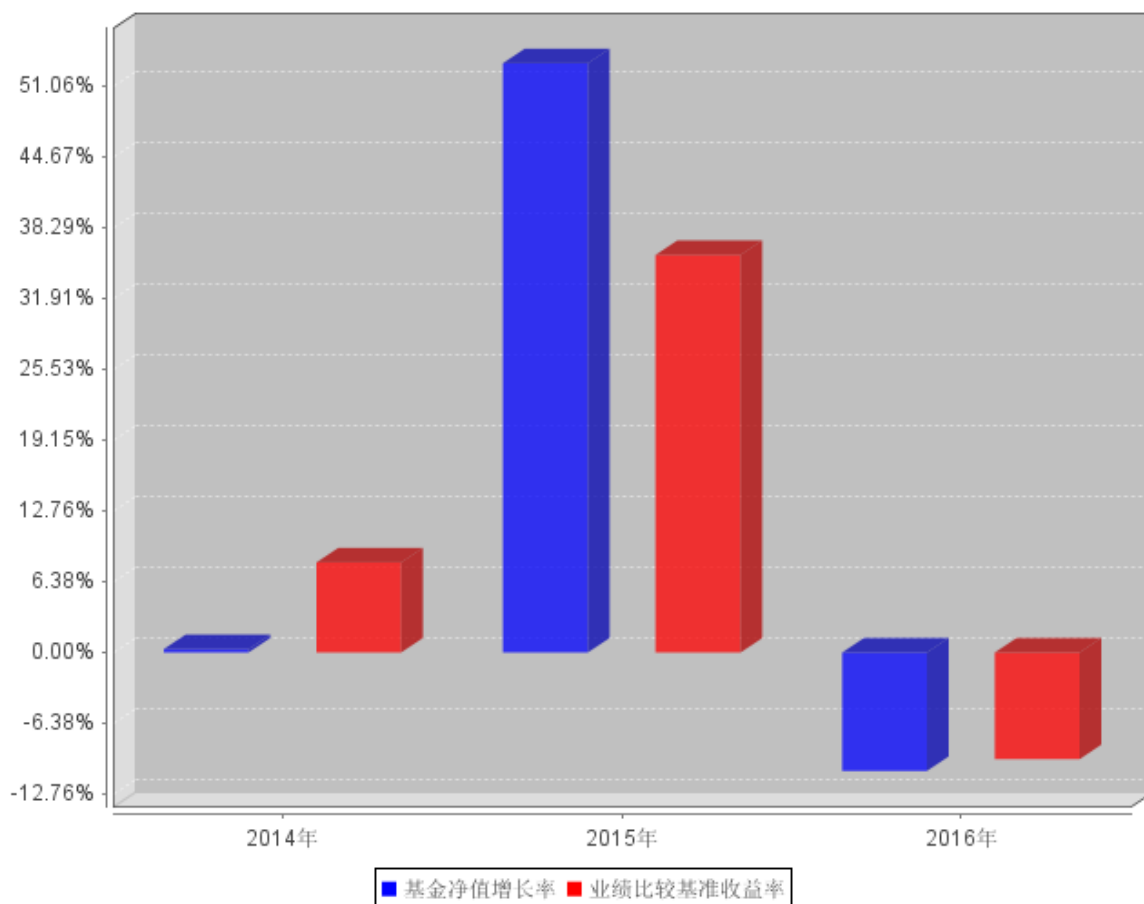
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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，经济形势总的特征是缓中趋稳、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

本基金本报告期财务会计报告经安永华明会计师事务所审计，注册会计师签字出具了无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§ 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	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	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	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	-	-
买入返售金融资产	-	1,000,000.00

应收证券清算款	1,300,946.11	-
应收利息	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	-	-
资产总计	59,351,995.16	61,381,324.70
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2016年12月31日	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	-	-
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	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	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	42,640,351.97	38,838,395.60
未分配利润	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	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	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	7,363,235.49	-279,162.59
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	205,166.66	166,024.87
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-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）	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	808,222.32	936,431.57
2. 托管费	134,703.73	156,071.98
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	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	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	3,801,956.37	183,943.93	3,985,900.30

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 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

本基金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。

7.4.5 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 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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 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。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期		上年度可比期间	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		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。

7.4.8.2.3 销售服务费

-

7.4.8.3 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。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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。

7.4.8.4.2 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

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。

7.4.8.5 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

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		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。

7.4.8.6 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。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.9 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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。

7.4.9.2 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	-

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 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。

7.4.9.3.2 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。

7.4.10 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层次公允价值转入（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	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

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年度报告正文。

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。

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：本基金本报告期末未投资股指期货。

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	-	-	-	-	-	-

§ 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》。

华润元大基金管理有限公司
2017 年 3 月 29 日