



# Disclosure 信息披露

2017年9月16日 星期六  
zqsb@stcn.com (0755)83501750

# B80

**(上接B79版)**  
办公地址：上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19楼  
负责人：俞卫锋  
联系电话：021-31358666  
传真：021-31358600  
经办律师：黎明、丁媛  
联系人：丁媛  
四、审计基金财产的会计师事务所  
名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）  
住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1318号展银大厦507单元

办公地址：上海市湖洲路202号普华永道中心1楼  
执行事务合伙人：李丹  
联系电话：021-23238888  
传真：021-23238800  
联系人：李一  
经办注册会计师：许理雄、李一

**第四部分 基金的基本情况**  
**第五部分 基金类型和存续期限**  
1. 基金类型：股票型证券投资基金  
2. 基金运作方式：契约型开放式  
3. 基金的存续期间：不定期

**第六部分 投资目标**  
本基金主要投资于大健康主题股票，在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。

**第七部分 投资范围**  
本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他依法发行、上市的股票）、股指期货、权证等权益类金融工具、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、地方政府债、政府支持机构债、政府支持债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、短期融资券、超短期融资券、央行票据）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具等固定收益类金融工具，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：本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的80%，投资于基金合同界定的大健康主题证券资产占非现金基金资产的比例不低于780%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金以后，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。

如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种或变更投资比例限制，基金管理人可在履行适当程序后，可以相应调整本基金的投资范围和比例限制。

**第八部分 投资策略**  
中国人口基数大，本身蕴含巨大的健康需求。一方面，随着经济发展、中产及富裕阶层的崛起，以财富换取健康的观念不断深化，人们日益注重健康及生活品质。另一方面，人口日益老龄化，多数慢性发病率随着年龄上升而迅速提高，国家推行“预防-治疗-康复”三位一体健康服务体系。在此特定背景下，涵盖预防、医疗、康复、养老的大健康产业及相关上市公司市值巨大，发展潜力大。

本基金在投资运作中，依托大类资产配置，侧重在大健康主题各子行业间灵活配置，并在行业内精选个股，以期实现基金资产的价值增值。  
**1. 股票投资策略**  
(1) 大健康主题界定  
本基金通过大健康主题相关子行业的精选以及对行业内相关资产的深入分析，挖掘该类型资产的投资价值。  
大健康主题是指经济系统中提供预防、诊断、治疗和康复等与健康相

关商品和服务领域的总称，通常包括医药生产制造、医药销售流通、医疗服务、健康体检服务、健康保险、健康食品、健康家居、休闲健身、环保防疫及养老服务等领域。

未来随着经济增长及产业结构的进一步发展，大健康主题的外延可能将不断扩大，本基金将根据实际情况对大健康主题的定义方法进行调整。  
(2) 大健康主题各子行业配置策略  
大健康主题涉及的子行业广泛，本基金将从子行业的成长性和空间、景气度、估值水平等多个维度来对大健康主题各子行业进行研究分析，实现投资组合在大健康主题各子行业之间的灵活、高效配置。  
(3) 个股投资策略  
本基金密切关注国内外宏观经济走势与我国财政、货币政策动向，预测未来利率变动走势，自上而下地确定投资组合久期，并结合信用分析等自下而上的个券选择方法构建债券投资组合，配置能够提供稳定收益的债券和货币市场工具组合，保证基金资产流动性。  
2. 固定收益类投资工具投资策略  
本基金密切跟踪国内外宏观经济走势与我国财政、货币政策动向，预测未来利率变动走势，自上而下地确定投资组合久期，并结合信用分析等自下而上的个券选择方法构建债券投资组合，配置能够提供稳定收益的债券和货币市场工具组合，保证基金资产流动性。  
3. 股指期货投资策略  
本基金投资股指期货将主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本，并利用股指期货的对冲作用，降低股票组合的系统性风险。  
4. 中小企业私募债券投资策略  
本基金在严格控制风险的前提下，综合考虑中小企业私募债券的安全性、收益性和流动性等特点，选择具有相对优势的品种，在严格遵守法律法规和基金合同基础上，谨慎进行中小企业私募债券的投资。  
5. 资产支持证券投资策略  
本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析和判断，同时采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。  
6. 权证投资策略  
权证为基本金融辅助性投资工具，其投资原则为有利于基金资产增值，基金权证投资方向将以价值分析为基础，在采用数量化模型分析其合理溢价的基础上，立足于以低风险套利，尽力减少组合净值波动率，力求稳健的超额收益。

**第九部分 业绩比较基准**  
中证健康产业指数收益率×80%+中证综合指数收益率×20%  
如果今后法律法规发生变化，或证券市场中有其他代表性更强或者更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整，调整业绩比较基准应经基金托管人同意，并报中国证监会备案。基金管理人应在调整前2个工作日在指定媒介上公告，无需召开基金份额持有人大会审议。

**第十部分 风险收益特征**  
本基金为股票型基金，属于证券投资基金中预期风险和预期收益较高的品种，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

**第十一部分 投资组合报告**  
基金管理人的董事会及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责任。  
基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年7月14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，保证报告内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。  
本投资组合报告所载数据截止2017年6月30日，本报告所列财务数据未经审计。

**1. 报告期末基金资产组合情况**

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益投资	224,602,162.33	86.54
2	固定收益投资	224,602,162.33	86.54
3	其中：债券	-	-
4	资产支持证券	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	其中：买入返售金融资产-其他	-	-
8	银行存款和结算备付金合计	31,279,290.98	12.06
9	其他金融资产	3,683,796.67	1.41
10	合计	293,534,293.38	100.00

**2. 报告期末按行业分类的股票投资组合**

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林牧渔	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	141,296,863.75	58.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	64,845,972.92	25.56
F	批发和零售业	15,719,683.36	6.26
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	7,639.62	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,944,132	0.28
N	水利、环境和公共设施管理业	20,879,977.68	8.24
O	医药、健康和互联网服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计		224,602,162.33	86.60

**3. 报告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组合**

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600566	中国医药	936,053	24,260,575.35	9.58
2	002217	合力泰	2,368,574	23,597,138.12	9.31
3	300197	东方园林	1,762,714	23,486,841.92	9.23
4	002310	东方园林	1,383,800	23,131,160.00	9.13
5	300296	广信诺	1,219,136	22,979,756.80	9.04
6	300185	福耀玻璃	1,944,132	22,979,756.80	9.04
7	300445	中孚实业	942,200	15,218,244.44	6.29
8	002236	天润股份	611,800	13,935,150.00	5.51
9	600703	三七药业	647,700	12,739,600.00	5.03
10	000963	华东医药	236,706	11,732,977.20	4.63

**4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合**  
本基金本报告期末持有债券。

**5. 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债券投资组合**  
本基金本报告期末持有债券。

**6. 报告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**  
本基金本报告期末持有资产支持证券。

**7. 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**  
本基金本报告期末持有贵金属。

**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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**1. 报告期末基金资产组合情况**

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益投资	224,602,162.33	86.54
2	固定收益投资	224,602,162.33	86.54
3	其中：债券	-	-
4	资产支持证券	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	其中：买入返售金融资产-其他	-	-
8	银行存款和结算备付金合计	31,279,290.98	12.06
9	其他金融资产	3,683,796.67	1.41
10	合计	293,534,293.38	100.00

**2. 报告期末按行业分类的股票投资组合**

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林牧渔	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	141,296,863.75	58.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	64,845,972.92	25.56
F	批发和零售业	15,719,683.36	6.26
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	7,639.62	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,944,132	0.28
N	水利、环境和公共设施管理业	20,879,977.68	8.24
O	医药、健康和互联网服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计		224,602,162.33	86.60

**3. 报告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组合**

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600566	中国医药	936,053	24,260,575.35	9.58
2	002217	合力泰	2,368,574	23,597,138.12	9.31
3	300197	东方园林	1,762,714	23,486,841.92	9.23
4	002310	东方园林	1,383,800	23,131,160.00	9.13
5	300296	广信诺	1,219,136	22,979,756.80	9.04
6	300185	福耀玻璃	1,944,132	22,979,756.80	9.04
7	300445	中孚实业	942,200	15,218,244.44	6.29
8	002236	天润股份	611,800	13,935,150.00	5.51
9	600703	三七药业	647,700	12,739,600.00	5.03
10	000963	华东医药	236,706	11,732,977.20	4.63

**4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合**  
本基金本报告期末持有债券。

**5. 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债券投资组合**  
本基金本报告期末持有债券。

**6. 报告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**  
本基金本报告期末持有资产支持证券。

**7. 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**  
本基金本报告期末持有贵金属。

**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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**9. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**10. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**11. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**12. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**13. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**14. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**15. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**16. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**17. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**18. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**19. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**20. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**21. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**22. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**23. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**24. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**25. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**26. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**27. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**28. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**29. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**30. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**31. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**32. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**33. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**34. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**35. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**36. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**37. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**38. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**39. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**40. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**41. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**42. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**43. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**44. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**45. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**46. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**47. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**48. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**49. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**50. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**51. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**52. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**53. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**54. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**55. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**56. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**57. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**58. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**59. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**60. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**61. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**62. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**63. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**64. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**65. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**66. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**67. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**68. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**69. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**70. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**71. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**72. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**73. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**74. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**75. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**76. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**77. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**78. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**79. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**80. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**81. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**82. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**83. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**84. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**85. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**86. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**87. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**88. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**89. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**90. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**91. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**92. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**93. 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权证**  
本基金本报告期末持有权证。

**94. 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权证**  
本基金本报告