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:2014年8月25日

华润元大保本混合型证券投资基金

2014 半年度 报告摘要

2014年6月30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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定, 于2014年8月20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2014年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华润元大保本混合
基金主代码	000273
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年9月11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	565,473,375.07份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过运用投资组合保险技术,严格有效控制本金损失的风险,追求基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金遵循保本增值的投资理念,兼用“恒定比例投资组合保险策略”(CPPI,Constant Proportion Portfolio Insurance)和“时间不变性投资组合保险策略”(TIPP,Time Invariant Portfolio Protection)进行资产配置,以实现保本和增值的目标。其中CPPI为主要策略,旨在动态调整投资组合、保本增值;TIPP为辅助策略,旨在保护阶段性收益。具体而言,本基金的投资策略包括资产配置策略、稳健资产投资策略和风险资产投资策略。
业绩比较基准	一年期银行定期存款税后收益率。
风险收益特征	本基金为保本混合型基金,属于证券投资基金中的低风险品种。

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	李芳非
	联系电话	0755-88399015	010-66060069
	电子邮箱	hete@cryuantafund.com	lifangfei@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

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.cryuantafund.com
基金半年度报告备置地点	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(2014年1月1日 - 2014年6月30日)
本期已实现收益	5,360,989.42
本期利润	6,854,428.07
加权平均基金份额本期利润	0.0117
本期基金份额净值增长率	1.19%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0159
期末基金资产净值	575,957,444.94
期末基金份额净值	1.019

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。

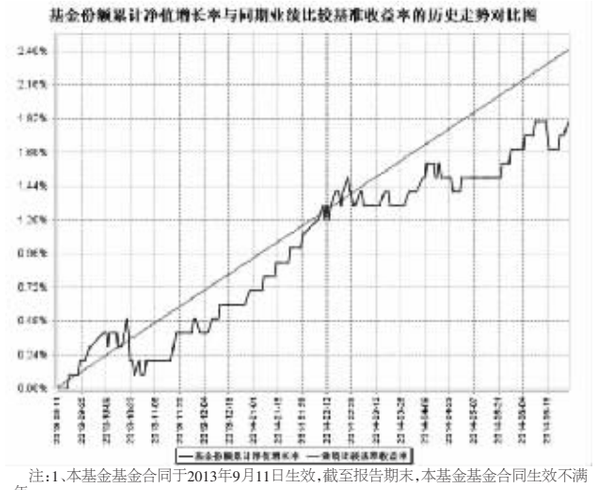
3.2 基金净值表现

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
过去一个月	0.20%	0.05%	0.25%	0.01%	-0.05%	0.04%
过去三个月	0.49%	0.05%	0.75%	0.01%	-0.26%	0.04%
过去六个月	1.19%	0.05%	1.49%	0.01%	-0.30%	0.04%
自基金合同生效起至今	1.90%	0.06%	2.41%	0.01%	-0.51%	0.05%

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



注:1、本基金基金合同于2013年9月11日生效,截至报告期末,本基金基金合同生效不满一年。

2、按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起3个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同中的相关约定。

§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2亿元人民币。公司由华润深国投信托有限公司和台湾元大宝来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2014年6月30日,本基金管理人共管理三只开放式基金:华润元大保本混合型证券投资基金(基金合同生效日为2013年9月11日),华润元大现金收益货币市场基金(基金合同生效日为2013年10月29日),华润元大信息传媒科技股票型证券投资基金(基金合同生效日为2014年3月31日)。

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		
李湘杰	本基金基金经理,投资管理部总经理	2013年9月11日	-	16年	历任台湾安泰商业银行外汇交易员,台湾安泰人寿研究员,台湾安泰证券投资信托股份有限公司基金经理,台湾元大宝来投资信托股份有限公司基金经理职务,现任华润元大基金管理有限公司投资管理部总经理。2013年9月11日起至今担任华润元大保本混合型证券投资基金基金经理,中国台湾,国立台湾大学管理学硕士,具有基金从业资格。

注:1、此处的“任职日期”为基金合同生效之日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业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

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。

4.3.2 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

本报告期内上证综指下跌2.35%,创业板指数上涨7.39%。股市行情分化。风格上,小盘股好于大盘股。主题上,在线教育、网络安全、航母指数、4G指数表现抢眼。由于本基金为一年期保本基金,在整体资产配置上而言股票仓位较低,在报告期内基金在计算机、电子元器件、医药等热点行业进行了布局及区间的操作。

本报告期内,基金固定收益部分的操作较为稳健,债市延续一季度的债券“小阳春”,由于经济数据继续并不乐观,以及央行连续出台“定向降准”的措施,使得市场对于未来货币政策宽松预期升温,推动了中长期债券收益率创出年内新低。政策性银行债由于前期相对国债的利差优势明显,同时需求释放,推动了收益率明显下行。由于市场需求转好,收益率下行较为迅速,本基金持续卖出部分债券兑现收益,同时也继续运用回购交易,做好流动性管理工作,并继续精选收益性价比较高的品种滚动投资。

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1.019元,本报告期份额净值增长率为1.19%,同期业绩比较基准收益率为1.49%,落后业绩比较基准0.3%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中国经济低迷态势难有改观,预计全年增速将回落至7.5%。真实出口小幅回升;受到产能过剩和地方政府高债务的抑制,投资增长将有所放缓;消费乏力贯穿全年。总需求疲软抑制下半年经济复苏,二季度以后经济继续走弱,预计增速将由上半年的7.6%回落至下半年的7.4%左右。经济低迷拖累工业盈利,预计全年增速将为个位数。

经济在经历了第一季度下滑以后,随着国家“稳增长、调结构、促改革”系列政策的持续出台和以及经济内生增长的韧性,在第二季度有所回暖。在第二季度,国务院召开了9 次常务会议,其中多项措施涉及“稳增长、调结构”,分别包括:税收、就业、三农、投融资、产业发展、经济规划以及环境保护等方面,从多个角度积极引导。五月,中采制造业PMI 指数为50.8%,较二月低点50.2%上升了0.6 个百分点,也是连续的第三个月上升;汇丰PMI 指数,从三月开始也呈现连续上升的态势,五月汇丰PMI 为49.3%,同样实现了连续三个月的反弹。但房地产调整的深度和广度都在逐渐加大;钢铁、水泥等过剩产能产业寒冬仍未过去。经济形势呈现动力和压力并存局面。下半年经济回调压力显著加大,出口的弱势复苏难以弥补地产销售低迷对消费和投资的拖累作用,地产产业链、过剩行业利润面临进一步下行压力。

主板市场区间震荡,基本上个股题材表现,选股不选市。风格上,小盘股好于大盘股。主题上,在线教育、网络安全、航母指数、4G指数表现抢眼。展望下半年我们仍看好主题投资,在当前宽幅震荡行情中,信息安全、互联网、智慧城市、去IOE、环保、新能源、医疗等概念将提供更多掘金机会。

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。

§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 2014 年 1 月 1 日至 2014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:华润元大保本混合型证券投资基金

报告截止日:2014年6月30日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
资 产:			
银行存款		261,933,139.22	361,971,345.78
结算备付金		878,675.70	3,184,981.64
存出保证金		59,775.16	42,093.45
交易性金融资产		271,718,641.00	116,620,468.24
其中:股票投资		10,522,641.00	2,789,778.44
基金投资		-	-
债券投资		261,196,000.00	113,830,689.80
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		35,000,292.50	123,579,489.37
应收证券清算款		-	1,039,122.23
应收利息		8,527,615.24	6,328,029.63
应收股利		-	-
应收申购款		-	988.14
递延所得税资产		-	-
其他资产		45,000.00	40,000.00
资产总计		578,163,138.82	612,806,518.48
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013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		-	-
应付赎回款		1,004,139.18	401,319.81
应付管理人报酬		665,318.61	731,389.91
应付托管费		95,045.53	104,484.26
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		212,361.13	155,355.94
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		228,829.43	109,308.95
负债合计		2,205,693.88	1,501,858.87
所有者权益:			
实收基金		565,473,375.07	607,110,327.06
未分配利润		10,484,069.87	4,194,332.55
所有者权益合计		575,957,444.94	611,304,659.61
负债和所有者权益总计		578,163,138.82	612,806,518.48

注:报告截止日2014年6月30日,基金份额净值1.019元,基金份额总额565,473,375.07份。

6.2 利润表

会计主体:华润元大保本混合型证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、收入		12,329,470.72	-
1.利息收入		14,044,818.71	-
其中:存款利息收入		8,153,373.33	-
债券利息收入		4,799,704.34	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,091,741.04	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		-3,461,443.38	-
其中:股票投资收益		-4,435,944.07	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		927,458.34	-
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		47,042.35	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		1,493,438.65	-
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)		252,656.74	-
减:二、费用		5,475,042.65	-
1.管理人报酬		4,121,051.84	-
2.托管费		588,721.68	-
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		533,175.14	-
5.利息支出		8,053.30	-
其中:卖出回购金融资产支出		8,053.30	-
6.其他费用		224,040.69	-
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		6,854,428.07	-
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		6,854,428.07	-

注:本基金基金合同于2013年9月11日生效,无上年度可比较期间及可比较数据。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华润元大保本混合型证券投资基金

本报告期:2014年1月1日 至 2014年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014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)	607,110,327.06	4,194,332.55	611,304,659.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	6,854,428.07	6,854,428.07
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)	-41,636,951.99	-564,690.75	-42,201,642.74
其中:1.基金申购款	494,362.07	6,329.44	500,691.51
2.基金赎回款	-42,131,314.06	-571,020.19	-42,702,334.25
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)	565,473,375.07	10,484,069.87	575,957,444.94

注:本基金基金合同于2013年9月11日生效,无上年度可比较期间及可比较数据。

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:

林冠和 崔佩伦 崔佩伦

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

华润元大保本混合型证券投资基金 (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”)证监许可[2013]872号《关于核准华润元大保本混合型证券投资基金募集的批复》核准,由华润元大基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华润元大保本混合型证券投资基金基金合同》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2013年8月19日至2013年9月6日,首次设立募集不包括认购资金利息共募集630,030,063.83元, 经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明 (2013) 验字第61032987_H02号 验资报告。 经向中国证监会备案,《华润元大保本混合型证券投资基金基金合同》于2013年9月11日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为630,303,516.04份基金份额,其中认购资金利息折合273,452.21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《中华人民共和国证券投资基金法》和《华润元大保本混合型证券投资基金合同》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(包括中小板、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。本基金的基金资产包括稳健资产和风险资产。稳健资产为国内依法发行交易的债券、货币市场工具和银行存款等,其中债券包括国债、金融债、央行票据、地方政府债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、可转换公司债券(含分离交易的可转换公司债券)、资产支持证券、债券回购等。风险资产为股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证、股指期货等。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为:债券、货币市场工具等稳健资产占基金资产的比例不低于60%;股票、权证、股指期货等风险资产占基金资产的比例不高于40%,其中,基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%;基金应保留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:一年期银行定期存款税后收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部2006年2月颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的应用指南、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2014年6月30日的财务状况以及期间的经营成果和净值变动情况。

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差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1.印花税

经国务院批准,财政部、国家税务总局决定,自2008年4月24日起,调整证券(股票)交易印花税税率,由原先的3‰调整为1‰;

经国务院批准,财政部、国家税务总局决定,自2008年9月19日起,调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税,受让方不再征收,税率不变;

根据财政部、国家税务总局财税字[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》的规定,股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让,暂免征收印花税。

2.营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》,自2004年1月1日起,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、债券的差价收入,继续免征营业税和企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定,对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;

根据财政部、国家税务总局财税字[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》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

3.个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定,对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20%的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《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》的规定,自2013年1月1日起,证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,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,暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

根据财政部、国家税务总局财税字[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》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》,自2008年10月9日起暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

6.4.7 关联方关系

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

本报告期内,本基金管理人华润元大基金管理有限公司公告设立全资子公司深圳华润元大资产管理有限公司。

6.4.7.2 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
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
华润元大基金管理有限公司	基金管理人、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

本基金合同于2013年9月11日生效,无上年度可比较期间。

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 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,121,051.84
其中:支付销售机构的客户维护费	1,592,105.59

注:(1) 基金管理费按前一日的基金资产净值的1.40%的年费率计提,按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×1.40%÷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。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	588,721.68

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的0.2%的年费率计提,按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.2%÷当年天数。

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

注:本基金本报告期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

注:本报告期内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

注: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

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	28,933,139.22	101,939.23

注:本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管,按银行间同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金本报告期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

无。

6.4.9 期末(2014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

注: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

注:本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 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。

6.4.9.3.2 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。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§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	10,522,641.00	1.82
	其中:股票	10,522,641.00	1.82
2	固定收益投资	261,196,000.00	45.18
	其中:债券	261,196,000.00	45.18
	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	35,000,292.50	6.05
	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	262,811,814.92	45.46
7	其他各项资产	8,632,390.40	1.49
8	合计	578,163,138.82	100.00

7.2 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	10,522,641.00	1.83
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	-	-
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	-	-
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	-	-
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	10,522,641.00	1.83

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

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	300124	汇川技术	59,900	1,868,880.00	0.32
2	600563	法拉电子	53,400	1,775,550.00	0.31
3	300072	三聚环保	88,400	1,767,116.00	0.31
4	300316	晶盛机电	92,300	1,710,319.00	0.30
5	600535	天士力	44,100	1,709,757.00	0.30
6	000581	威孚高科	62,700	1,691,019.00	0.29

注:本基金本报告期末仅持有6只股票。

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	300124	汇川技术	5,247,367.71	0.86
2	002241	歌尔声学	4,096,205.93	0.67
3	600699	均胜电子	3,563,996.00	0.58
4	000581	威孚高科	3,193,463.37	0.52
5	002456	欧菲光	2,938,894.00	0.48
6	300003	乐普医疗	2,930,311.84	0.48
7	300133	华策影视	2,903,460.50	0.47
8	300037	新宙邦	2,887,944.67	0.47
9	002197	证通电子	2,887,682.51	0.47
10	300015	爱尔眼科	2,887,137.36	0.47
11	600600	青岛啤酒	2,427,072.00	0.40
12	600588	用友软件	2,407,586.20	0.39
13	002437	誉衡药业	2,405,718.64	0.39
14	300127	银河磁体	2,394,819.47	0.39
15	000748	长城信息	2,391,772.00	0.39
16	002626	金达威	2,388,951.51	0.39
17	002551	尚荣医疗	2,384,326.94	0.39
18	601766	中国南车	2,380,584.00	0.39
19	600763	通策医疗	2,371,424.00	0.39
20	601186	中国铁建	2,367,666.00	0.39

注:买入金额按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

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	占期初基金资产净值比例(%)
1	002241	歌尔声学	3,718,049.46	0.61
2	300124	汇川技术	3,510,733.90	0.57
3	600699	均胜电子	3,258,068.37	0.53
4	300003	乐普医疗	2,943,716.18	0.48
5	300133	华策影视	2,854,756.93	0.47
6	300037	新宙邦	2,834,195.75	0.46
7	300015	爱尔眼科	2,810,685.07	0.46
8	002197	证通电子	2,766,200.74	0.45
9	600763	通策医疗	2,660,800.50	0.44
10	002456	欧菲光	2,629,101.71	0.43
11	600196	复星医药	2,555,653.70	0.42
12	601186	中国铁建	2,478,768.00	0.41
13	300244	迪安诊断	2,446,560.37	0.40
14	000748	长城信息	2,413,483.07	0.39
15	601766	中国南车	2,402,816.00	0.39
16	002626	金达威	2,312,690.20	0.38
17	002437	誉衡药业	2,303,481.00	0.38
18	002219	恒康医疗	2,279,430.07	0.37
19	002551	尚荣医疗	2,277,969.56	0.37
20	600016	民生银行	2,250,200.00	0.37

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。

7.4.3 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	180,839,889.95
卖出股票收入(成交)总额	168,820,943.89

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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

| 序号 | 债券品种 |