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:2015年8月28日

华润元大富时中国A50指数型证券投资基金

2015 半年度 报告摘要

2015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2015年8月27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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015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	华润元大富时中国A50指数
基金主代码	000835
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年11月20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	133,831,727.67份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用被动式投资策略,通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段,力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准表现相当,以便为投资者带来长期收益。
投资策略	本基金采用完全复制法来跟踪富时中国A50指数,按照个股在标的指数中的基准权重构建股票组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。 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,以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,基金管理人会对投资组合进行适当调整,降低跟踪误差。 如有因受股票停牌、股票流动性或其他一些影响指数复制的市场因素的限制,使基金管理人无法依指数权重购买成份股,基金管理人可以根据市场情况,结合经验判断,对投资组合进行适当调整,以获得更接近标的指数的收益率。 定期调整:本基金股票组合根据所跟踪的富时中国A50指数对其成份股的调整而进行相应的定期跟踪调整。 不定期调整:根据指数编制规则,富时中国A50指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重新调整时,本基金将根据富时中国A50指数在股权变动公告日次日发布的临时调整决定及其需调整的权重比例,进行相应调整。 本基金将采用货币市场工具对基金资产进行流动性管理。在满足安全性和保证流动性的基础上,本基金将结合宏观分析和微观分析制定投资策略,有效利用基金资产,更好地实现跟踪标的指数的投资目标。同时,根据本基金的申购和赎回情况,对股票投资组合进行调整,从而有效跟踪标的指数。 本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品,以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与股指期货的投资,以管理投资组合的系统性风险,改善组合的风险收益特性。此外,本基金还将运用股指期货来对冲特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理,如预期大额申购赎回、大量分红等,以及对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险。 在正常市场情况下,本基金力争净值增长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0.3%,年跟踪误差不超过4%。
业绩比较基准	富时中国A50指数收益率×95%+银行活期存款收益率(税后)×5%。
风险收益特征	本基金属于股票型基金,属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的投资品种。一般情况下,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。

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	何婷	林蔑
	联系电话	0755-88399015	010-66060069
	电子邮箱	hete@cryuantafund.com	tgcxpl@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(2015年1月1日 - 2015年6月30日)
本期已实现收益	49,664,032.61
本期利润	18,992,144.98
加权平均基金份额本期利润	0.1344
本期基金份额净值增长率	10.67%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.5885
期末基金资产净值	213,751,258.19
期末基金份额净值	1.597

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。

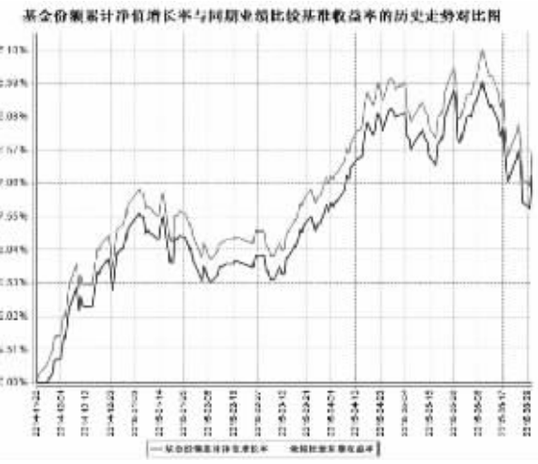
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的申购赎回费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-5.33%	3.15%	-4.98%	3.22%	-0.35%	-0.07%
过去三个月	7.11%	2.50%	6.07%	2.48%	1.04%	0.02%
过去六个月	10.67%	2.31%	10.19%	2.30%	0.48%	0.01%
自基金合同生效起至今	59.70%	2.40%	66.58%	2.40%	-6.88%	0.00%

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
-15.02%
-4.51%
0.00%
-2014-11-20
-2014-12-31
-2015-01-31
-2015-02-28
-2015-03-31
-2015-04-30
-2015-05-31
-2015-06-30
-2015-07-31
-2015-08-20
-2015-08-27
-2015-08-28
-2015-08-31
-2015-09-30
-2015-10-31
-2015-11-30
-2015-12-31
-2016-01-31
-2016-02-29
-2016-03-31
-2016-04-30
-2016-05-31
-2016-06-30
-2016-07-31
-2016-08-31
-2016-09-30
-2016-10-31
-2016-11-30
-2016-12-31
-2017-01-31
-2017-02-28
-2017-03-31
-2017-04-30
-2017-05-31
-2017-06-30
-2017-07-31
-2017-08-31
-2017-09-30
-2017-10-31
-2017-11-30
-2017-12-31
-2018-01-31
-2018-02-28
-2018-03-31
-2018-04-30
-2018-05-31
-2018-06-30
-2018-07-31
-2018-08-31
-2018-09-30
-2018-10-31
-2018-11-30
-2018-12-31
-2019-01-31
-2019-02-28
-2019-03-31
-2019-04-30
-2019-05-31
-2019-06-30
-2019-07-31
-2019-08-31
-2019-09-30
-2019-10-31
-2019-11-30
-2019-12-31
-2020-01-31
-2020-02-29
-2020-03-31
-2020-04-30
-2020-05-31
-2020-06-30
-2020-07-31
-2020-08-31
-2020-09-30
-2020-10-31
-2020-11-30
-2020-12-31
-2021-01-31
-2021-02-28
-2021-03-31
-2021-04-30
-2021-05-31
-2021-06-30
-2021-07-31
-2021-08-31
-2021-09-30
-2021-10-31
-2021-11-30
-2021-12-31
-2022-01-31
-2022-02-28