# 华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金

## 2015 年度报告摘要

2015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：2016年3月29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2016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2015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 | 华润元大安鑫灵活配置混合 |
| 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 | 2014年9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 | 275,752,760.76份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 本基金根据对宏观经济形势的研究，判断经济所处的经济周期阶段、景气循环状况和未来运行趋势，积极把握股票、债券等市场发展趋势，注重大类资产配置轮换特征、重点挖掘价值低洼，在适度控制风险的前提下，追求基金资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | 1、资产配置策略<br>本基金在资产配置中贯彻"自上而下"的策略，根据宏观经济环境、财政及货币政策趋势以及基金管理人对大类资产走势的判断，并通过战略资产配置策略和战术资产配置策略的有机结合，持续、动态、优化确定投资组合的资产配置比例。<br>2、股票投资策略<br>本基金将运用"价值和成长并重"的投资策略来确定具体选股标准。该策略通过建立统一的价值评估框架，综合考虑上市公司的增长潜力和市场估值水平，以寻找具有增长潜力且价格合理或被低估的股票。同时，本基金将综合考虑投资回报的稳定性、持续性与成长性，通过精细化风险管理和组合优化技术，实现行业与风格类资产的均衡配置，从而实现风险调整后收益的最大化。<br>3、债券投资策略<br>本基金将采用"自上而下"的投资策略，对债券类资产进行合理有效的配置，并在配置框架下进行具有针对性的券种选择。<br>4、权证投资策略<br>本基金以被动投资权证为主要策略，包括投资因持有股票而派发的权证和参与分离转债申购而获得的权证，以获取这部分权证带来的增量收益。同时，本基金将在严格控制风险的前提下，以价值分析为基础，主动进行部分权证投资。<br>5、股指期货投资策略<br>本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，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。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率×35%+中债综合指数收益率×65% |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种。 |

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 | 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 | 2015年 | 2014年9月18日(基金合同生效日)-2014年12月31日 |
|---|---|---|
| 本期已实现收益 | 12,781,281.64 | 4,754,438.27 |
| 本期利润 | 11,143,904.28 | 6,473,681.05 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0910 | 0.1650 |
| 本期基金份额净值增长率 | 51.75% | 17.19% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2015年末 | 2014年末 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.8207 | 0.1714 |
| 期末基金资产净值 | 502,050,314.82 | 59,989,036.61 |
| 期末基金份额净值 | 1.821 | 1.200 |

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。

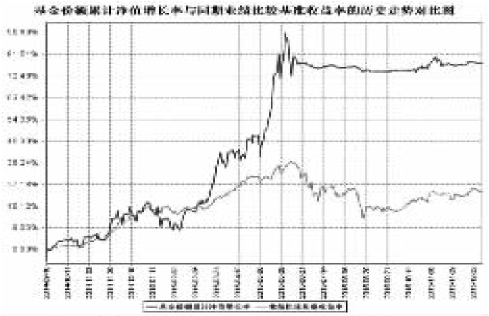
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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 | 1.73% | 0.31% | 6.93% | 0.58% | -5.20% | -0.27% |
| 过去六个月 | 0.39% | 0.24% | -3.36% | 0.94% | 3.75% | -0.70% |
| 过去一年 | 51.75% | 1.29% | 6.51% | 0.87% | 45.24% | 0.42% |
| 自基金合同生效起至今 | 77.83% | 1.24% | 23.25% | 0.82% | 54.58% | 0.42% |

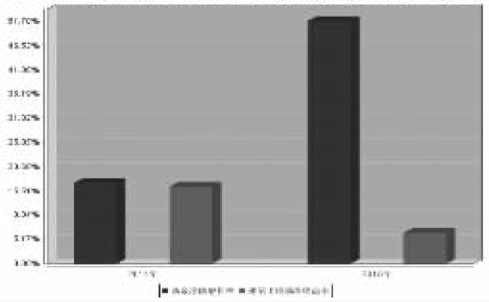
3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1.自2014年9月18日起，华润元大保本混合型证券投资基金转型为华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金。

2.按基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。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。

3.2.3 自基金转型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



注：本基金基金合同生效日为2014年9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9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：本基金基金合同于2014年9月18日生效。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2015年12月31日，本基金管理人共管理八只开放式基金：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。

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 | 2015年9月16日 | - | 6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16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16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，西南财经大学金融学博士，具有基金从业资格。 |
| 杨凯玮 | 原华润元大现金收益货币市场基金基金经理、原华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理、原固定收益部总经理 | 2014年9月18日 | 2015年9月24日 | 11年 | 历任台湾国泰人寿保险股份有限公司研究员，台湾新光人寿保险股份有限公司投资组合高级专员，台湾中华开发工业银行股份有限公司自营交易员，台湾元大宝来证券投资信托股份有限公司基金经理，台湾宏泰人寿保险股份有限公司科长，最后职务为华润元大基金管理有限公司固定收益部总经理。2013年10月29日起至2015年8月11日担任华润元大现金收益货币市场基金基金经理，2014年9月18日起至2015年9月24日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。中国台湾，国立台湾大学土木工程学、国立交通大学管理学双硕士，具有基金从业资格。 |
| 张仲维 | 原华润元大信息传媒科技股票型证券投资基金基金经理、原华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理 | 2014年9月18日 | 2015年5月8日 | 6年 | 曾任台湾元大宝来证券投资信托股份有限公司基金经理。2014年3月31日起至2015年5月8日担任华润元大信息传媒科技股票型证券投资基金基金经理，2014年9月18日起至2015年5月8日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。中国台湾，台湾政治大学国际财务管理硕士，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，基金管理人对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

2015年上半年中国股票市场继续上涨，各指数延续2014年的上升趋势，但三季度股指下跌，2015年第四季度股票市场震荡上行。2015年全年来看，以创业板为代表的成长股涨幅较好，创业板指数全年上升84.41%，中小板指数上升53.70%，上证综指上涨9.41%，沪深300指数上涨5.58%，上证50指数下跌6.23%，富时中国A50指数下跌7.00%。2015年，中信一级29个行业中计算机（125.97%）、餐饮旅游（122.86%）、通信（115.46%）板块较强，涨幅前三；而钢铁（-6.4%）、煤炭（-7.71%）、非银行金融（-18.66%）板块走势明显较弱，涨幅居后。

2015年六月以前我们看好股市的上涨，本基金维持较高的持股比例，三季度本基金进行了减仓，在四季度对持仓股票进行了增持；固定收益类方面，做了存款、短融、回购等。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2015年12月31日，本基金份额净值为1.821元，报告期内的份额净值增长率为51.75%，同期业绩比较基准收益率为6.51%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中央经济工作会议已经确定2016年"去产能、去库存、去杠杆、降成本"五大任务。当前中国经济继续寻底，实体经济增长动能疲弱，物价水平较低，通缩风险抬头。2015年中国经济增速为6.9%，2016年1月中国制造业采购经理人指数为49.4%，连续6个月低于50%，1月财新PMI录得48.4%，连续11个月低于荣枯线，表明经济颓势未改。但经济依然存在结构性亮点，计算机及电子通讯设备制造、医药等行业继续保持扩张态势，中国非制造业商务活动指数继续上升，扩张动力强劲。展望2016年，从我国经济发展的外部环境并不乐观，发达国家缓慢复苏，新兴经济体面临美国加息的挑战，我国经济受结构性和周期性因素的双重影响，预计下行压力持续加大。预计2016年中国经济增速降至6.6%，2016年CPI预计为1.3%，PPI继续负增长。为稳增长，货币政策有望继续保持宽松，无风险利率继续下行，财政政策有望更加积极，赤字率有望突破3%。低利率时代大类资产配置转向股权的大趋势没有变，股票市场开年虽经波折，但全年有望保持震荡向上的慢牛走势。下一步值得警惕美联储继续加息、去产能、去杠杆、注册制等不利事件的集中出现。

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。

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，本基金存在连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，出现该情况的时间范围为2015年1月8日至4月8日、4月27日至6月16日。经过基金管理人积极地持续营销，截至本报告期末，本基金资产净值已超过五千万元。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 2015 年1月1日至 2015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：华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金
报告截止日：2015年12月31日

单位：人民币元

| 资产 | 本期末<br>2015年12月31日 | 上年度末<br>2014年12月31日 |
|---|---|---|
| 资产： | | |
| 银行存款 | 55,045,835.66 | 3,738,360.28 |
| 结算备付金 | 10,148,221.10 | 898,176.06 |
| 存出保证金 | 70,063.34 | 68,754.10 |
| 交易性金融资产 | 58,530,605.57 | 48,178,126.08 |
| 其中：股票投资 | 23,344,605.57 | 41,579,188.50 |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | 35,186,000.00 | 6,598,937.58 |
| 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 | 367,500,000.00 | 8,000,000.00 |
| 应收证券清算款 | 10,559,984.48 | 4,000.00 |
| 应收利息 | 1,114,032.16 | 137,045.49 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | - | 21,046.17 |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 502,968,742.31 | 61,045,508.18 |
| 负债和所有者权益 | 本期末<br>2015年12月31日 | 上年度末<br>2014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 | 6,898.55 | 456,084.91 |
| 应付管理人报酬 | 596,672.95 | 62,171.60 |
| 应付托管费 | 85,238.97 | 8,881.66 |
| 应付销售服务费 | - | - |
| 应付交易费用 | 164,606.66 | 369,209.97 |
| 应交税费 | - | - |
| 应付利息 | - | - |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 65,010.36 | 160,123.43 |
| 负债合计 | 918,427.49 | 1,056,471.57 |
| 所有者权益： | | |
| 实收基金 | 275,752,760.76 | 49,992,712.66 |
| 未分配利润 | 226,297,554.06 | 9,996,323.95 |
| 所有者权益合计 | 502,050,314.82 | 59,989,036.61 |
| 负债和所有者权益总计 | 502,968,742.31 | 61,045,508.18 |

注：报告截止日2015年12月31日，基金份额净值1.821元，基金份额总额275,752,760.76份。

7.2 利润表

会计主体：华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金
本报告期：2015年1月1日至2015年12月31日

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2015年1月1日至2015年12月31日 | 上年度可比期间<br>2014年9月18日(基金合同生效日)至2014年12月31日 |
|---|---|---|
| 一、收入 | 16,450,938.32 | 7,445,792.58 |
| 1.利息收入 | 3,228,820.96 | 160,232.40 |
| 其中：存款利息收入 | 650,438.19 | 18,918.40 |
| 债券利息收入 | 567,776.18 | 50,253.22 |
| 资产支持证券利息收入 | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | 2,010,606.59 | 91,060.78 |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2.投资收益（损失以"-"填列） | 13,422,603.56 | 5,461,892.52 |
| 其中：股票投资收益 | 13,078,769.01 | 5,461,892.52 |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | 121,141.54 | - |
| 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 | 222,693.01 | - |
| 3.公允价值变动收益（损失以"-"号填列） | -1,637,377.36 | 1,719,242.78 |
| 4.汇兑收益（损失以"-"号填列） | - | - |
| 5.其他收入（损失以"-"号填列） | 1,436,891.16 | 104,424.88 |
| 减：二、费用 | 5,307,034.04 | 972,111.53 |
| 1. 管理人报酬 | 2,941,413.88 | 171,553.84 |
| 2. 托管费 | 420,201.92 | 24,507.72 |
| 3. 销售服务费 | - | - |
| 4. 交易费用 | 1,535,343.08 | 681,258.03 |
| 5. 利息支出 | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | - | - |
| 6. 其他费用 | 410,075.16 | 94,791.94 |
| 三、利润总额（亏损总额以"-"号填列） | 11,143,904.28 | 6,473,681.05 |
| 减：所得税费用 | - | - |
| 四、净利润（净亏损以"-"号填列） | 11,143,904.28 | 6,473,681.05 |

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金
本报告期：2015年1月1日至2015年12月31日

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2015年1月1日至2015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） | 49,992,712.66 | 9,996,323.95 | 59,989,036.61 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 11,143,904.28 | 11,143,904.28 |
| 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） | 225,760,048.10 | 205,157,325.83 | 430,917,373.93 |
| 其中：1.基金申购款 | 494,708,185.84 | 388,485,935.96 | 883,194,121.80 |
| 2.基金赎回款 | -268,948,137.74 | -183,328,610.13 | -452,276,747.87 |
| 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） | 275,752,760.76 | 226,297,554.06 | 502,050,314.82 |
| 项目 | 上年度可比期间<br>2014年9月18日(基金合同生效日)至2014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） | 81,051,619.67 | 1,973,626.90 | 83,025,246.57 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 6,473,681.05 | 6,473,681.05 |
| 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） | -31,058,907.01 | 1,549,016.00 | -29,509,891.01 |
| 其中：1.基金申购款 | 45,478,755.06 | 6,607,634.71 | 52,086,389.77 |
| 2.基金赎回款 | -76,537,662.07 | -5,058,618.71 | -81,596,280.78 |
| 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） | 49,992,712.66 | 9,996,323.95 | 59,989,036.61 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

______林瑞源______　　______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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"本基金")系由华润元大保本混合型证券投资基金第一个保本周期到期后转型而来。华润元大保本混合型证券投资基金经中国证监会证监许可[2013]872号文予以募集注册，自2013年8月19日至2013年9月6日期间向全社会公开募集。募集有效认购总户数为6,465户，募集资金及其产生的利息共计630,303,516.04元，折合基金份额630,303,516.04份，于2013年9月11日基金合同正式生效。根据《华润元大保本混合型证券投资基金基金合同》的约定，2014年9月11日，华润元大保本混合型证券投资基金第一个保本周期到期后，未能符合保本基金存续条件，自2014年9月18日起变更为本基金。同时，基金的投资目标、投资范围、投资策略以及基金费率等相关内容根据《华润元大保本混合型证券投资基金基金合同》的相关约定作相应修改为《华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。上述变更无须经基金份额持有人大会决议，在报中国证监会备案后，提前在临时公告或《华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》中予以说明。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《华润元大安鑫灵活配置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上市交易的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、一级市场新股或增发的股票、衍生工具（权证、股指期货等）、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金及到期日在一年以内的政府债券，以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为0%－95%，权证投资占基金资产净值的比例为0%－3%，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，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×35%+中债综合指数收益率×65%。

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2015年12月31日的财务状况以及2015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

除下述事项外，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。

根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24号《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》的规定，自2015年3月25日起，本基金对持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外）的估值方法进行调整，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

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

（1）印花税

证券（股票）交易印花税税率为1‰，由出让方缴纳。

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

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。

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。

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。

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

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，减按25%计入应纳税所得额。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《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》的规定，自2015年9月8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，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

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。

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：（1）元大证券投资信托股份有限公司，系由原"元大宝来证券投资信托股份有限公司"更名而来；

（2）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

本基金本报告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<br>2015年1月1日至2015年12月31日 | 上年度可比期间<br>2014年9月18日(基金合同生效日)至2014年12月31日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 2,941,413.88 | 171,553.84 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 143,277.80 | 83,050.23 |

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。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2015年1月1日至2015年12月31日 | 上年度可比期间<br>2014年9月18日(基金合同生效日)至2014年12月31日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 420,201.92 | 24,507.72 |

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.20%的年费率计提，按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.20%÷当年天数。

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：本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金。

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<br>2015年1月1日至2015年12月31日 | | 上年度可比期间<br>2014年9月18日(基金合同生效日)至2014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 | 20,045,835.66 | 316,473.83 | 3,738,360.28 | 13,289.75 |

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：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.9 期末（ 2015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。

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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 600654 | 中安消 | 2015年12月14日 | 重大事项停牌 | 28.84 | - | - | 66,300 | 2,329,413.00 | 1,912,092.00 | - |

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

管理层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21,432,513.57元，划分为第二层次的余额为人民币37,098,092.00元，无划分为第三层次的余额（于2014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45,588,977.08元，划分为第二层次的余额为人民币2,589,149.00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。根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24号《关于发布<中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准>的通知》的规定，自2015年3月25日起，交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值，相关固定收益品种的公允价值所属层次从第一层次转入第二层次。

第三层次公允价值期初金额和本期变动金额

本基金报告期初未持有公允价值划分为第三层次的金融工具；本基金本期无净转入（转出）第三层次。

(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 | 23,344,605.57 | 4.64 |
| | 其中：股票 | 23,344,605.57 | 4.64 |
| 2 | 固定收益投资 | 35,186,000.00 | 7.00 |
| | 其中：债券 | 35,186,000.00 | 7.00 |
| | 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 | 367,500,000.00 | 73.07 |
| | 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 | 65,194,056.76 | 12.96 |
| 7 | 其他各项资产 | 11,744,079.98 | 2.33 |
| 8 | 合计 | 502,968,742.31 | 100.00 |

8.2 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 | 6,020,645.29 | 1.20 |
| 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 | 3,778,891.28 | 0.75 |
| 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 | 12,366,801.00 | 2.46 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | 1,178,268.00 | 0.23 |
| 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 | 23,344,605.57 | 4.65 |

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 | 600136 | 道博股份 | 60,598 | 3,778,891.28 | 0.75 |
| 2 | 300078 | 思创医惠 | 58,500 | 2,854,800.00 | 0.57 |
| 3 | 300113 | 顺网科技 | 20,100 | 2,037,537.00 | 0.41 |
| 4 | 300468 | 四方精创 | 23,500 | 1,952,380.00 | 0.39 |
| 5 | 603636 | 南威软件 | 19,800 | 1,936,836.00 | 0.39 |
| 6 | 600654 | 中安消 | 66,300 | 1,912,092.00 | 0.38 |
| 7 | 300075 | 数字政通 | 50,000 | 1,567,500.00 | 0.31 |
| 8 | 002395 | 双象股份 | 51,299 | 1,559,489.60 | 0.31 |
| 9 | 600718 | 东软集团 | 45,800 | 1,422,090.00 | 0.28 |
| 10 | 300096 | 易联众 | 49,500 | 1,320,165.00 | 0.26 |

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 | 300468 | 四方精创 | 6,917,284.00 | 11.53 |
| 2 | 603636 | 南威软件 | 6,416,611.63 | 10.70 |
| 3 | 600804 | 鹏博士 | 6,348,195.00 | 10.58 |
| [illegible] | [illegible] | [illegible] | [illegible] | [illegible] |
| 146 | 600771 | 广誉远 | 1,317,479.14 | 2.20 |
| 147 | 601518 | 吉林高速 | 1,317,304.00 | 2.20 |
| 148 | 000558 | 莱茵体育 | 1,308,375.00 | 2.18 |
| 149 | 002487 | 大金重工 | 1,304,597.00 | 2.17 |
| 150 | 600728 | 佳都科技 | 1,301,759.24 | 2.17 |
| 151 | 002008 | 大族激光 | 1,288,834.00 | 2.15 |
| 152 | 002609 | 捷顺科技 | 1,278,059.74 | 2.13 |
| 153 | 000728 | 国元证券 | 1,269,948.00 | 2.12 |
| 154 | 600730 | 中国高科 | 1,252,490.98 | 2.09 |
| 155 | 300034 | 钢研高纳 | 1,231,890.46 | 2.05 |
| 156 | 000983 | 西山煤电 | 1,226,114.00 | 2.04 |
| 157 | 600115 | 东方航空 | 1,225,965.00 | 2.04 |
| 158 | 600348 | 阳泉煤业 | 1,225,513.26 | 2.04 |
| 159 | 600019 | 宝钢股份 | 1,222,823.00 | 2.04 |
| 160 | 600018 | 上港集团 | 1,222,419.00 | 2.04 |
| 161 | 601898 | 中煤能源 | 1,222,364.50 | 2.04 |
| 162 | 603128 | 华贸物流 | 1,220,313.00 | 2.03 |
| 163 | 601699 | 潞安环能 | 1,214,406.82 | 2.02 |
| 164 | 000089 | 深圳机场 | 1,209,535.00 | 2.02 |
| 165 | 601866 | 中海集运 | 1,207,303.00 | 2.01 |
| 166 | 000778 | 新兴铸管 | 1,206,559.00 | 2.01 |
| 167 | 002297 | 博云新材 | 1,201,363.00 | 2.00 |
| 168 | 601088 | 中国神华 | 1,200,195.00 | 2.00 |

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。

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 | 600804 | 鹏博士 | 6,578,617.54 | 10.97 |
| 2 | 300468 | 四方精创 | 5,647,581.00 | 9.41 |
| 3 | 603636 | 南威软件 | 5,523,429.49 | 9.21 |
| 4 | 002467 | 二六三 | 5,339,682.45 | 8.90 |
| 5 | 002739 | 万达院线 | 5,009,572.96 | 8.35 |
| 6 | 600754 | 锦江股份 | 4,893,345.26 | 8.16 |
| 7 | 600036 | 招商银行 | 4,631,968.07 | 7.72 |
| 8 | 300017 | 网宿科技 | 4,310,854.32 | 7.19 |
| 9 | 000888 | 峨眉山A | 3,987,133.81 | 6.65 |
| 10 | 600570 | 恒生电子 | 3,859,780.16 | 6.43 |
| 11 | 000610 | 西安旅游 | 3,594,006.54 | 5.99 |
| 12 | 300479 | 神思电子 | 3,590,939.12 | 5.99 |
| 13 | 002230 | 科大讯飞 | 3,540,906.71 | 5.90 |
| 14 | 601666 | 平煤股份 | 3,371,680.32 | 5.62 |
| 15 | 002033 | 丽江旅游 | 3,367,393.08 | 5.61 |
| 16 | 600718 | 东软集团 | 3,352,042.90 | 5.59 |
| 17 | 300166 | 东方国信 | 3,250,439.03 | 5.42 |
| 18 | 601555 | 东吴证券 | 3,081,240.00 | 5.14 |
| 19 | 601007 | 金陵饭店 | 3,066,737.92 | 5.11 |
| 20 | 300188 | 美亚柏科 | 3,019,214.18 | 5.03 |
| 21 | 002577 | 雷柏科技 | 2,898,737.77 | 4.83 |
| 22 | 300359 | 全通教育 | 2,841,527.33 | 4.74 |
| 23 | 002338 | 奥普光电 | 2,837,790.51 | 4.73 |
| [illegible] | [illegible] | [illegible] | [illegible] | [illegible] |
| 160 | 300050 | 世纪鼎利 | 1,300,435.27 | 2.17 |
| 161 | 600017 | 日照港 | 1,283,993.69 | 2.14 |
| 162 | 300006 | 莱美药业 | 1,279,476.27 | 2.13 |
| 163 | 600771 | 广誉远 | 1,273,755.05 | 2.12 |
| 164 | 300253 | 卫宁软件 | 1,265,044.15 | 2.11 |
| 165 | 300215 | 电科院 | 1,253,661.20 | 2.09 |
| 166 | 002533 | 金杯电工 | 1,242,941.45 | 2.07 |
| 167 | 600109 | 国金证券 | 1,232,952.22 | 2.06 |
| 168 | 002354 | 天神娱乐 | 1,231,547.00 | 2.05 |
| 169 | 002415 | 海康威视 | 1,224,522.17 | 2.04 |
| 170 | 601333 | 广深铁路 | 1,218,058.43 | 2.03 |
| 171 | 600765 | 中航重机 | 1,205,856.00 | 2.01 |
| 172 | 600221 | 海南航空 | 1,200,977.90 | 2.00 |
| 173 | 000728 | 国元证券 | 1,200,603.59 | 2.00 |
| 174 | 300034 | 钢研高纳 | 1,200,185.95 | 2.00 |

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 | 483,258,939.92 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 512,930,910.77 |

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 5,002,000.00 | 1.00 |
| | 其中：政策性金融债 | 5,002,000.00 | 1.00 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | 30,184,000.00 | 6.01 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债 | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 35,186,000.00 | 7.01 |

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 011599198 | 15粤物资SCP003 | 100,000 | 10,077,000.00 | 2.01 |
| 2 | 011599208 | 15包钢集SCP004 | 100,000 | 10,068,000.00 | 2.01 |
| 3 | 011599462 | 15江阴公SCP002 | 100,000 | 10,039,000.00 | 2.00 |
| 4 | 130202 | 13国开02 | 50,000 | 5,002,000.00 | 1.00 |

注：本基金本报告期末仅持有4只债券。

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：本基金本报告期末投资股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期未持有股指期货。

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

本基金本报告期未持有国债期货。

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

本基金本报告期未持有国债期货。

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未被监管部门立案调查，且在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

8.12.2

本基金所投资的前十名股票没有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 | 70,063.34 |
| 2 | 应收证券清算款 | 10,559,984.48 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 1,114,032.16 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 11,744,079.98 |

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值 | 占基金资产净值比例（%） | 流通受限情况说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 600654 | 中安消 | 1,912,092.00 | 0.38 | 重大事项停牌 |

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 |
| 513 | 537,529.75 | 268,535,113.43 | 97.38% | 7,217,647.33 | 2.62% |

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 | 104,739.06 | 0.0380% |

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9月18日 ）基金份额总额 | 81,051,619.67 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 49,992,712.66 |
| 本报告期基金总申购份额 | 494,708,185.84 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 268,948,137.74 |
| 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 | 275,752,760.76 |

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

根据公司第一届董事会第十五次临时会议审议通过，并于2015年3月31日经中国证券监督委员会证监许可[2015]494号文核准批复，公司总经理由林冠和先生变更为林瑞源先生。上述变更已按照规定报相关监管机构备案，并进行公告。

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

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，本基金管理人的基金投资策略遵循本基金《基金合同》中规定的投资策略，未发生显著改变。

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65,000.00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稽查或处罚等情况。

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 | 322,528,132.25 | 32.39% | 294,035.51 | 32.29% | - |
| 中信证券 | 2 | 232,758,002.70 | 23.37% | 211,906.20 | 23.27% | - |
| 银河证券 | 1 | 157,253,274.87 | 15.79% | 144,931.57 | 15.92% | - |
| 招商证券 | 1 | 124,833,270.46 | 12.53% | 115,328.02 | 12.67% | - |
| 国泰君安 | 1 | 83,198,882.68 | 8.35% | 75,744.49 | 8.32% | - |
| 安信证券 | 2 | 55,223,190.52 | 5.54% | 50,275.06 | 5.52% | - |
| 民生证券 | 1 | 20,120,617.66 | 2.02% | 18,318.12 | 2.01% | - |
| 华泰证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中银国际 | 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。本基金本报告期内分别向安信证券、招商证券、中信证券、银河证券、中信建投、华泰证券租用了基金专用交易单元，向中信建投退租了一个基金专用交易单元。

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 | 3,735,931.16 | 58.24% | 58,000,000.00 | 0.30% | - | - |
| 中信证券 | 1,512,426.46 | 23.58% | - | - | - | - |
| 银河证券 | 324,130.63 | 5.05% | - | - | - | - |
| 招商证券 | 842,686.00 | 13.14% | 19,023,500,000.00 | 99.33% | - | - |
| 国泰君安 | - | - | 70,000,000.00 | 0.37% | - | - |
| 安信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 民生证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | - | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中银国际 | - | - | - | - | - | - |

华润元大基金管理有限公司
2016年3月29日