华润元大富时中国A50指数型证券投资基金

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	84,490,794.36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%。本基金以富时中国A50指数为标的指数,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高预期风险、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11月20日(基金合同生效日)-2014年12月31日
本期已实现收益	40,973,378.10	29,534,931.63
本期利润	-12,112,466.47	71,588,223.99
加权平均基金份额本期利润	-0.1012	0.3091
本期基金份额净值增长率	-7.00%	44.30%
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	0.3416	0.2017
期末基金资产净值	113,350,672.49	145,271,631.11
期末基金份额净值	1.342	1.443

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。

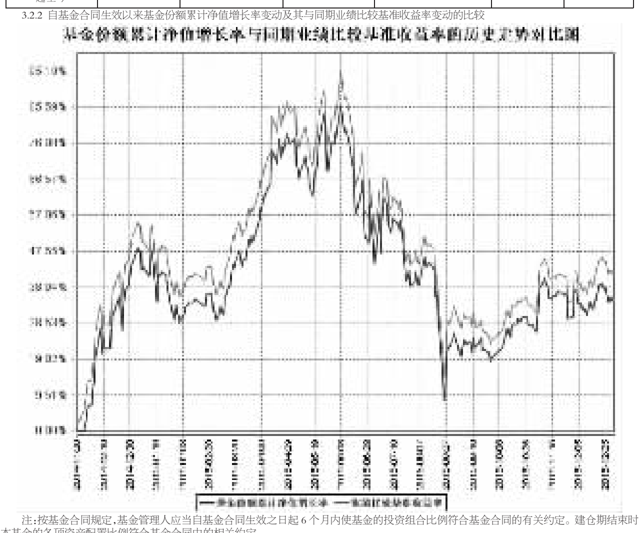
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的申购赎回费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

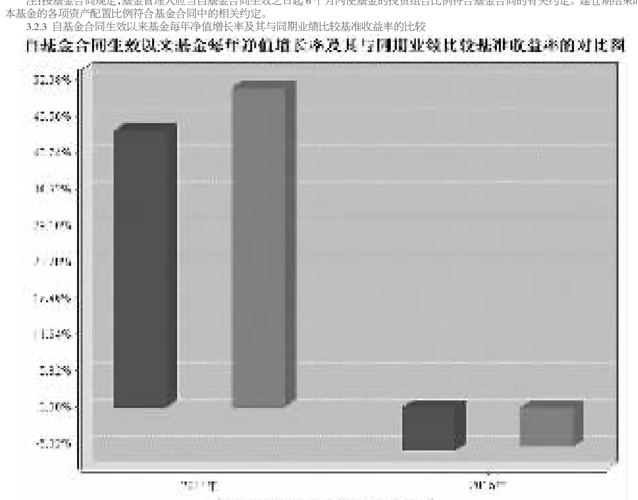
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	12.30%	1.56%	14.08%	1.52%	-1.78%	0.04%
过去六个月	-15.97%	2.49%	-14.97%	2.40%	-1.00%	0.09%
过去一年	-7.00%	2.40%	-6.31%	2.35%	-0.69%	0.05%
自基金合同生效起至今	34.20%	2.45%	41.64%	2.41%	-7.44%	0.04%

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



注: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



注:本基金基金合同生效日为2014年11月20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比较基准的收益率根据当年实际存续期(2014年11月20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11月20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		
杨伟	华润元大信息传媒科技混合型证券投资基金基金经理、华润元大富时中国A50指数型证券投资基金基金经理、华润元大中创100交易型开放式指数证券投资基金基金经理、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基金经理	2014年11月20日	-	7年	曾任兴业证券股份有限公司风险管理专员,平安信托有限责任公司金融工程及量化投资研究员,2014年11月20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,2015年5月8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,2015年5月25日起担任华润元大中创100交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2015年12月23日起担任华润元大中创100交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。中国,厦门大学经济学博士,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年股票市场充满变化与挑战,上半年迎来近几年以来最大上涨幅度的一波牛市,然而下半年开始市场风云突变,出现剧烈的震荡调整。全年来看,以创业板为代表的成长股和以富时中国A50指数为代表的大盘蓝筹股出现较大分化,创业板指数上涨84.41%,中小板指数上涨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%。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;而非银行金融(-18.66%)、煤炭(-7.71%)、钢铁(-6.40%)板块走势明显较弱,涨幅居后。

本基金作为被动指数型基金,报告期内,本基金采用完全复制法紧密跟踪富时中国A50指数,取得与业绩比较基准基本一致的业绩表现。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金份额净值增长率为-7.00%,业绩比较基准收益率为-6.31%,基金份额净值增长率落后业绩比较基准0.69%。报告期内,本基金的日均跟踪偏离度为0.12%,年化跟踪误差为3.35%,在合同规定的目标控制范围之内。

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年宏观经济依然面临较大的下行压力,为实现全年经济增长目标政策有望更加积极。一方面,货币政策将继续保持宽松,除常规降准降息之外,将继续通过地方政府债务置换、专项金融债以及城投债加速发行等推动社会融资总量扩张;另一方面,财政政策将有效发力,财政赤字率将突破3%。中央经济工作会已经确定"去产能、去库存、去杠杆、降成本、补短板"五大任务,供给侧改革将会逐步落地。下一步值得警惕的时间窗口期是3-4月,美联储加息、去产能去杠杆、注册制等各类不利影响集中出现。

2016年,机遇与风险并存的股票市场有望在曲折中震荡前行。资金面总体较为宽松有望推动无风险利率继续下行,这将有助于推动大类资产配置转向权益类资产,创新驱动有望推动中国经济加速转型,这些有利因素有望对市场形成支撑;同时,实体经济仍面临较大的下行压力,在刚性兑付逐步打破的情况下信用风险存在蔓延可能,注册制推出可能加大市场供给压力,这些不利因素可能对市场形成压力。

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,对基金所有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:华润元大富时中国A50指数型证券投资基金

报告截止日:2015年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
资 产:		
银行存款	6,453,609.21	4,280,757.63
结算备付金	21,431.63	9,878,285.79
存出保证金	79,343.62	77,841.49
交易性金融资产	107,003,963.96	136,267,465.88
其中:股票投资	107,003,963.96	136,267,465.88
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	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	1,484.46	6,268.05
应收股利	-	-
应收申购款	7,419.91	4,253,081.30
递延所得税资产	-	-
其他资产	35,877.72	-
资产总计	113,603,130.51	154,763,700.14
负债和所有者权益	本期末 2015年12月31日	上年度末 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	93,105.78	8,917,568.63
应付管理人报酬	59,177.04	86,449.43
应付托管费	14,794.26	21,612.34
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	35,181.31	429,641.54
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	50,199.63	36,797.09
负债合计	252,458.02	9,492,069.03
所有者权益:		
实收基金	84,490,794.36	100,678,166.64
未分配利润	28,859,878.13	44,593,464.47
所有者权益合计	113,350,672.49	145,271,631.11
负债和所有者权益总计	113,603,130.51	154,763,700.14

注:报告截止日2015年12月31日,基金份额净值1.342元,基金份额总额84,490,794.36份。

7.2 利润表

会计主体:华润元大富时中国A50指数型证券投资基金

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 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年11月20日(基金合同生效日)至2014年12月31日
一、收入	-9,102,746.28	72,495,573.80
1.利息收入	101,688.70	844,734.89
其中:存款利息收入	101,688.70	123,968.55
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	720,766.34
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	42,946,187.78	28,665,302.17
其中:股票投资收益	39,120,998.35	28,665,302.17
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	3,825,189.43	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-53,085,844.57	42,053,292.36
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	935,221.81	932,244.38
减:二、费用	3,009,720.19	907,349.81
1.管理人报酬	1,043,903.37	168,872.66
2.托管费	260,975.77	42,218.15
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	1,199,300.47	690,539.93
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	505,540.58	5,719.07
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-12,112,466.47	71,588,223.99
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-12,112,466.47	71,588,223.99

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华润元大富时中国A50指数型证券投资基金

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 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)	100,678,166.64	44,593,464.47	145,271,631.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-12,112,466.47	-12,112,466.47
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)	-16,187,372.28	-3,621,119.87	-19,808,492.15
其中:1.基金申购款	477,025,291.86	251,554,538.94	728,579,830.80
2.基金赎回款	-493,212,664.14	-255,175,658.81	-748,388,322.95
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)	84,490,794.36	28,859,878.13	113,350,672.49
项目	上年度可比期间 2014年11月20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)	714,621,124.13	-	714,621,124.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	71,588,223.99	71,588,223.99
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)	-613,942,957.49	-26,994,759.52	-640,937,717.01
其中:1.基金申购款	84,706,485.97	20,145,732.05	104,852,218.02
2.基金赎回款	-698,649,443.46	-47,140,491.57	-745,789,935.03
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)	100,678,166.64	44,593,464.47	145,271,631.11

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

华润元大富时中国A50指数型证券投资基金(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[2014]989号《关于准予华润元大富时中国A50指数型证券投资基金注册的批复》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《华润元大富时中国A50指数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2014年10月27日至2014年11月14日,首次设立募集不包括认购资金利息共募集714,505,762.47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_H08号验资报告。经向中国证监会备案,《华润元大富时中国A50指数型证券投资基金基金合同》于2014年11月20日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为714,621,124.13份基金份额,其中认购资金利息折合115,361.66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《华润元大富时中国A50指数型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股。此外,为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于部分非成份股(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、债券、资产支持证券、货币市场工具、银行存款、权证、股指期货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的相关规定)。本基金的投资组合比例为:投资于标的指数的成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产90%,每个交易日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为:富时中国A50指数收益率×95%+银行活期存款收益率(税后)×5%。

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2015年12月31日的财务状况以及2015年1月1日至2015年12月31日止期间的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度,即每年1月1日起至12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外,均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产(或负债),并形成其他单位的金融负债(或资产)或权益工具的合同。

(1)金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及贷款和应收款项;

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主要包括股票、债券和衍生工具等投资。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、结算备付金、买入返售金融资产和各类应收款项等。

(2)金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。

本基金持有的金融负债均划分为其他金融负债,主要包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

初始确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债,按照取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产取得时发生的相关交易费用计入当期损益;应收款项及其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

后续计量

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产采用公允价值进行后续计量。在持有该类金融资产期间取得的利息或现金股利,应当确认为当期收益。每日,本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益;应收款项及其他金融负债采用实际利率法,按照摊余成本进行后续计量,其摊销或减值产生的利得或损失,均计入当期损益。

终止确认

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止,或该金融资产已转移,且符合金融资产转移的终止确认条件的,金融资产将终止确认;

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的,该金融负债或其一部分将终止确认;

处置该金融资产或金融负债时,其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益,同时调整公允价值变动收益。

金融资产转移

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的,终止确认该金融资产;保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的,不终止确认该金融资产;本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的,分别下列情况处理:放弃了对该金融资产控制的,终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债;未放弃对该金融资产控制的,按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产,并相应确认有关负债。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值,是指市场参与者在计量日发生的有序交易中,出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债,假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行;不存在主要市场的,本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债,根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值,确定所属的公允价值层次:第一层次输入值,在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价;第二层次输入值,除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值;第三层次输入值,相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日,本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估,以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票、债券、基金和衍生工具等投资按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1)存在活跃市场的金融工具按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值;估值日无交易,但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日的收盘价估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价值。有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值的,应对最近交易的市价进行调整,确定公允价值。

(2)不存在活跃市场的金融工具,采用市场参与者普遍认同,且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术,确定公允价值。本基金采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术,优先使用相关可观察输入值,只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下,才使用不可观察输入值。

(3)如有确凿证据表明按上述估值原则仍不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能适当反映公允价值的价格估值。

(4)如有新增事项,按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金同时满足下列条件时,金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示:具有抵销已确认金额的法定权利,且该种法定权利是当前可执行的;计划以净额结算,或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在"损益平准金"科目中核算,并于期末全额转入"未分配利润/(累计亏损)"。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1)存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。

(2)债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认,在债券实际持有期内逐日计提;

(3)资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额,扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认,在证券实际持有期内逐日计提;

(4)买入返售金融资产收入,按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率),在回购期内逐日计提;

(5)股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认,并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账;

(6)债券投资收益/(损失)于成交日确认,并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账;

(7)衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认,并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账;

(8)股利收益于除息日确认,并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账;

(9)公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失;

(10)其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方,经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

(1)基金管理费按前一日基金资产净值的0.60%的年费率逐日计提;

(2)基金托管费按前一日基金资产净值的0.15%的年费率逐日计提;

(3)基金标的指数使用费按前一日基金资产净值的0.02%的年费率逐日计提;

(4)卖出回购金融资产支出,按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率)在回购期内逐日计提;

(5)其他费用系根据有关法规及相应协议规定,按实际支出金额,列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的,则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1)在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为4次,每份基金份额每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的20%,若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配;

(2)本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;

(3)基金收益分配后基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;

(4)每一基金份额享有同等分配权;

(5)法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

7.4.4.12 分部报告

-

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计需要披露。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

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。

7.4.5.3 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

本基金于本期及上年度可比期间均未通过关联交易单元进行交易。

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 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年11月20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	1,043,903.37	168,872.66
其中:支付销售机构的客户维护费	596,345.49	97,766.11

注:(1)基金管理费按前一日的基金资产净值的0.6%的年费率计提,按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×0.6%÷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 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年11月20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	260,975.77	42,218.15

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的0.15%的年费率计提,按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.15%÷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:本基金于本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:本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方均未持有本基金。

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 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年11月20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	6,453,609.21	91,206.54	4,280,757.63	110,526.52

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

-

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

注:本基金于本期末无因暂时停牌而流通受限证券。

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

本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107,003,963.96元,无划分为第二和第三层次的余额(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136,267,465.88元,无划分为第二和第三层次的余额)。

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。

对于特殊事项停牌的股票,本基金从进行估值调整之日起将相关股票公允价值所属层次从第一层次转入第二层次,于股票复牌并恢复市价估值之日起从第二层次转入第一层次。对于持有的非公开发行股票,本基金于限售期内将相关股票公允价值所属层次列入第二层次,于限售期满并恢复市价估值之日起从第二层次转入第一层次。

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归属于第三层次的金融工具;本基金本报告期末发生净转入(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	107,003,963.96	94.19
	其中:股票	107,003,963.96	94.19
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	6,475,040.84	5.70
7	其他各项资产	124,125.71	0.11
8	合计	113,603,130.51	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	3,256,905.80	2.87
C	制造业	16,565,234.90	14.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,145,742.10	1.89
E	建筑业	6,425,136.70	5.67
F	批发和零售业	1,488,915.00	1.31
G	交通运输、仓储和邮政业	1,922,769.68	1.70
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,539,438.00	1.36
J	金融业	68,406,853.78	60.35
K	房地产业	5,252,968.00	4.63
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	107,003,963.96	94.40

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	601318	中国平安	270,560	9,740,160.00	8.59
2	600016	民生银行	685,800	6,611,112.00	5.83
3	600036	招商银行	347,700	6,255,123.00	5.52
4	601398	工商银行	1,365,200	6,252,616.00	5.52
5	601166	兴业银行	335,800	5,732,106.00	5.06
6	600000	浦发银行	290,500	5,307,435.00	4.68
7	600048	保利地产	493,700	5,252,968.00	4.63
8	600030	中信证券	228,400	4,419,540.00	3.90
9	601328	交通银行	495,800	3,192,952.00	2.82
10	601766	中国中车	229,038	2,943,138.30	2.60

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	601318	中国平安	43,817,555.19	30.16
2	600030	中信证券	19,389,611.00	13.35
3	600036	招商银行	18,749,871.78	12.91
4	601988	中国银行	17,651,296.00	12.15
5	600016	民生银行	17,191,992.52	11.83
6	601166	兴业银行	14,621,310.00	10.06
7	601398	工商银行	14,511,234.71	9.99
8	600048	保利地产	14,131,790.74	9.73
9	600000	浦发银行	13,400,477.00	9.22
10	601766	中国中车	12,246,088.00	8.43
11	600837	海通证券	11,363,805.80	7.82
12	601328	交通银行	9,916,806.00	6.83
13	000651	格力电器	7,641,707.07	5.26
14	601668	中国建筑	7,565,785.00	5.21
15	600519	贵州茅台	7,174,064.45	4.94
16	601601	中国太保	7,012,637.08	4.83
17	601989	中国重工	7,005,383.00	4.82
18	601169	北京银行	6,716,768.74	4.62
19	600028	中国石化	6,699,371.00	4.61
20	000001	平安银行	6,666,812.00	4.59
21	601688	华泰证券	6,292,496.03	4.33
22	000776	广发证券	6,213,781.32	4.28
23	601006	大秦铁路	5,863,177.33	4.04
24	000725	京东方A	5,716,240.00	3.93
25	601390	中国中铁	5,448,909.00	3.75
26	601628	中国人寿	5,071,292.00	3.49
27	601818	光大银行	5,017,740.88	3.45
28	601939	建设银行	4,867,990.30	3.35
29	000333	美的集团	4,801,631.18	3.31
30	600104	上汽集团	4,738,833.80	3.26
31	601299	中国北车	4,688,075.00	3.23
32	600050	中国联通	4,520,613.59	3.11
33	601857	中国石油	4,099,630.00	2.82
34	601186	中国铁建	3,687,524.70	2.54
35	600999	招商证券	3,486,600.04	2.40
36	601088	中国神华	3,440,235.00	2.37
37	002024	苏宁云商	3,391,043.37	2.33
38	600887	伊利股份	3,242,521.00	2.23
39	600015	华夏银行	3,088,237.00	2.13
40	600900	长江电力	3,042,853.61	2.09
41	600585	海螺水泥	2,971,198.00	2.05

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	601318	中国平安	45,012,580.27	30.99
2	600036	招商银行	21,637,516.91	14.89
3	600030	中信证券	20,257,959.01	13.94
4	601988	中国银行	20,050,297.42	13.80
5	600016	民生银行	17,643,375.95	12.15
6	601166	兴业银行	15,055,202.64	10.36
7	600000	浦发银行	14,969,518.74	10.30
8	600048	保利地产	13,014,627.01	8.96
9	600837	海通证券	11,938,136.78	8.22
10	601398	工商银行	11,613,574.00	7.99
11	601328	交通银行	10,820,304.41	7.45
12	000651	格力电器	9,632,954.57	6.63
13	601169	北京银行	8,709,672.33	6.00
14	601668	中国建筑	8,551,481.17	5.89
15	600519	贵州茅台	8,254,772.30	5.68
16	601601	中国太保	7,597,275.77	5.23
17	000001	平安银行	7,197,876.90	4.95
18	601766	中国中车	6,668,892.50	4.59
19	601299	中国北车	6,595,054.76	4.54
20	601006	大秦铁路	6,480,864.64	4.46
21	601989	中国重工	6,459,327.81	4.45
22	600028	中国石化	6,327,443.75	4.36
23	600887	伊利股份	6,265,395.33	4.31
24	601390	中国中铁	6,218,918.87	4.28
25	601628	中国人寿	5,656,205.26	3.89
26	000725	京东方A	5,468,031.01	3.76
27	000333	美的集团	5,340,734.14	3.68
28	601939	建设银行	5,319,314.43	3.66
29	000776	广发证券	5,310,483.28	3.66
30	600050	中国联通	5,264,149.32	3.62
31	600104	上汽集团	5,222,168.61	3.59
32	601818	光大银行	5,114,246.54	3.52
33	600900	长江电力	4,968,248.27	3.42
34	600015	华夏银行	4,793,601.57	3.30
35	600585	海螺水泥	4,561,889.77	3.14
36	600999	招商证券	4,517,034.92	3.11
37	601857	中国石油	4,396,646.59	3.03
38	601688	华泰证券	4,198,304.59	2.89
39	601186	中国铁建	4,056,573.34	2.79
40	601088	中国神华	3,685,600.08	2.54
41	600019	宝钢股份	3,221,037.75	2.22
42	002415	海康威视	3,166,022.46	2.18

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	383,520,025.62
卖出股票收入(成交)总额	398,818,681.32

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

本基金本报告期末持仓股指期货。

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:本基金本报告期末未投资国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末持仓国债期货。

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	79,343.62
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,484.46
5	应收申购款	7,419.91
6	其他应收款	-
7	待摊费用	35,877.72
8	其他	-
9	合计	124,125.71

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
2,834	29,813.27	89,133.21	0.11%	84,401,661.15	99.89%

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	336,534.83	0.3983%

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11月20日)基金份额总额	714,621,124.13
本报告期期初基金份额总额	100,678,166.64
本报告期基金总申购份额	477,025,291.86
减:本报告期基金总赎回份额	493,212,664.14
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	84,490,794.36

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日经中国证券监督管理委员会证监许可[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

本基金本报告期内投资策略没有改变。

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1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	
招商证券	1	251,575,276.32	32.16%	230,250.59	32.26%	-
国信证券	2	187,110,168.79	23.92%	170,340.15	23.87%	-
国泰君安	1	144,790,548.14	18.51%	131,803.82	18.47%	-
中银国际	2	126,775,138.07	16.20%	115,411.18	16.17%	-
民生证券	1	49,601,249.81	6.34%	45,157.31	6.33%	-
中信证券	2	11,101,873.37	1.42%	10,107.20	1.42%	-
安信证券	2	6,560,486.96	0.84%	6,088.54	0.85%	-
银河证券	1	4,823,965.48	0.62%	4,494.51	0.63%	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-

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
招商证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

华润元大基金管理有限公司

2016年3月29日