华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金

2018 第二季度 报告

2018年6月30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
报告送出日期:2018年7月18日

§1 重要提示

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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年7月16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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年3月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华润元大安鑫灵活配置混合
交易代码	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
报告期末基金份额总额	18,047,845.77份
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、银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 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。 2.股票投资策略 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。 3.债券投资策略 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。 4.权证投资策略 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。 5.股指期货投资策略 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。属于中等预期收益和预期风险水平的投资品种。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年4月1日 - 2018年6月30日)
1.本期已实现收益	-4,206,995.42
2.本期利润	-4,824,452.24
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2548
4.期末基金资产净值	20,998,511.44
5.期末基金份额净值	1.163

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 本报告期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	净值增长率①	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	-17.52%	1.17%	-2.88%	0.39%	-14.64%	0.78%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘宏毅	研究部副总经理、华润元大安鑫灵活配置混合型投资基金基金经理、华润元大润泰双鑫债券型证券投资基金基金经理	2018年1月18日	-	9年	曾任湘财证券有限责任公司研究员、信诚基金管理有限公司宏观分析师。2018年1月18日担任华润元大安鑫灵活配置混合型投资基金基金经理,2018年6月14日担任华润元大润泰双鑫债券型证券投资基金基金经理。中国,复旦大学发展经济学硕士,具有基金从业资格。
黄华涛	权益投资部副总经理、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、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	2015年9月16日	-	8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。2016年8月5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,2017年8月2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,西南财经大学金融学博士,具有基金从业资格。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内,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 公平交易专项说明

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。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年2季度,中国经济在外部贸易摩擦不断升级背景下,风险偏好下降,各主要指数均有下跌。具体看,2018年2季度,创业板指数下跌15.46%,中证1000指数下跌17.51%,上证50指数下跌8.90%,沪深300下跌9.94%,上证综指下跌10.14%,万得全A下跌11.79%。中信一级29个行业中食品饮料(9.03%)、餐饮旅游(3.18%)、石油石化(-1.99%)板块表现较好,涨幅居于前3;而电力设备(-21.18%)、通信(-22.28%)、综合(-23.60%)板块走势明显较弱,跌幅居前。在申万风格指数中,2季度均有下跌,高价股指数下跌3.63%,绩优股指数下跌5.88%,涨跌幅居前;而微利股指数和亏损股指数领跌。在2季度,本基金根据市场环境和行业基本面精选优质公司,相比1季度持仓有一定的调整。未来市场展望方面,短期市场受中美贸易摩擦有些调整,但优质公司的中长期配置价值愈发突显;看好医药、新能源、大消费等。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2018年6月30日,本基金份额净值为1.163元,累计净值1.885,报告期内的份额净值增长率为-17.52%,同期业绩比较基准收益率为-2.88%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形,本基金管理人已向中国证监会报告本基金的解决方案。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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	8,205,489.50	38.06
	其中:股票	8,205,489.50	38.06
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	6,070,013.18	28.15
8	其他资产	7,284,052.79	33.79
9	合计	21,559,555.47	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	7,256,152.00	34.56
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	949,337.50	4.52
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	8,205,489.50	39.08

5.3 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明细

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	002773	康弘药业	16,000	832,160.00	3.96
2	603658	安图生物	10,000	824,600.00	3.93
3	002821	凯莱英	8,000	697,840.00	3.32
4	300595	欧普康视	15,000	672,300.00	3.20
5	300003	乐普医疗	17,800	652,904.00	3.11
6	300357	我武生物	15,800	629,946.00	3.00
7	000963	华东医药	12,950	624,837.50	2.98
8	600887	伊利股份	20,000	558,000.00	2.66
9	600521	华海药业	20,000	533,800.00	2.54
10	002384	东山精密	20,000	480,000.00	2.29

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 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明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末持仓国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末持仓国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

本报告期内本基金投资的前十名证券中没有出现发行主体被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2

本报告期内本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	64,967.51
2	应收证券清算款	7,206,434.47
3	应收股利	-
4	应收利息	469.00
5	应收申购款	12,181.81
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,284,052.79

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	21,378,352.69
报告期期间基金总申购份额	3,015,052.98
减:报告期期间基金总赎回份额	6,345,559.90
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	18,047,845.77

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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期期初基金管理人未持有本基金份额,且报告期内基金管理人持有基金份额未发生变动。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

自2018年6月20日起审计基金财产的会计师事务所由德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)改聘为安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)。详见2018年6月21日本公司发布的《华润元大基金管理有限公司改聘会计师事务所公告》。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1.中国证监会关于核准本基金募集的批复;

2.本基金基金合同;

3.本基金托管协议;

4.本报告期内在指定报刊上披露的各项公告。

9.2 存放地点

以上备查文件存放于基金管理人和基金托管人的办公场所。

9.3 查阅方式

基金持有人可在办公时间到基金管理人和基金托管人的办公场所或网站免费查阅。

华润元大基金管理有限公司
2018年7月18日

华润元大中创100交易型开放式指数证券投资基金

2018 第二季度 报告

2018年6月30日

基金管理人:华润元大基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司
报告送出日期:2018年7月18日

§1 重要提示

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。

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年7月16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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华润元大中创100ETF
场内简称	中创100
交易代码	159942
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015年5月25日
报告期末基金份额总额	27,993,705.00份
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	本基金主要采取完全复制法,即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建投组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期指数成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或因某些特殊情况导致流动性不足时,或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整,从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。 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或卖出股,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中证100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,中证100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,本基金将根据中证100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。 为有效管理投资组合,基金可投资于经中国证监会允许的各种金融衍生产品,如股指期货、权证以及其他与标的指数或标的指数成份股相关的衍生工具,基金投资于衍生工具的目标,是使得基金的投资组合更紧密地跟踪标的指数,以便更好地实现基金的投资目标,基金投资于各种衍生工具的比例合计不超过基金资产总值的10%,基金拟投资于新推出的金融衍生产品的,需将有关投资方案通知基金托管人,并报告中国证监会备案总公告。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0.2%,年跟踪误差不超过2%。
业绩比较基准	中证100指数
风险收益特征	本基金属于股票型基金,其预期的风险与收益高于债券型基金与货币市场基金,为证券投资基金中中等预期风险、中等预期收益的品种。同时本基金为交易型开放式指数基金,采用完全复制法跟踪标的指数表现,具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。
基金管理人	华润元大基金管理有限公司
基金托管人	招商证券股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年4月1日 - 2018年6月30日)
1.本期已实现收益	-1,920,068.27
2.本期利润	-7,086,625.78
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2501
4.期末基金资产净值	47,551,576.23
5.期末基金份额净值	1.699

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。

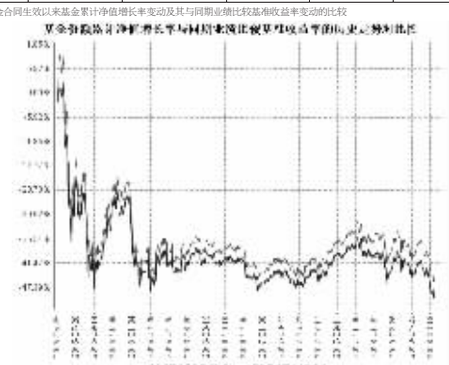
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	-12.83%	1.40%	-13.14%	1.42%	0.31%	-0.02%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李武群	指数投资部副总经理、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	2016年4月20日	-	9年	曾任中信银行福州分行统计分析员、华西证券股份有限公司研究所高级研究员和股票投资部投资经理助理。2016年4月20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,2016年9月20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,中国科学院研究生院微电子学与固体电子学博士,具有基金从业资格。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内,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 公平交易专项说明

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。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年第二季度A股市场各主要指数均呈现震荡下行走势,以富时中国A50指数为代表的大盘蓝筹板块持续低迷走势,以中小板和创业板为代表的小盘成长股板块盘经历了较大幅度的回调,市场情绪很为低迷。创业板指数下跌15.46%,中小板指数下跌12.98%,上证综指下跌10.14%,沪深300指数下跌9.94%,上证50指数下跌8.90%,中创100指数下跌13.14%。中信一级29个行业石油石化(-1.99%)、餐饮旅游(3.15%)、食品饮料(9.03%)板块走势较强,涨幅较大;而电力设备(-21.18%)、通信(-22.28%)、综合(-23.60%)板块走势明显较弱,跌幅居前。

本基金为目标ETF的联接基金,报告期内,本基金主要投资于目标ETF,获得与目标ETF所跟踪的标的指数相近的平均收益率。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为0.886元,本报告期份额净值增长率为-12.36%,同期业绩比较基准收益率为-12.49%;报告期内,本基金的日均跟踪偏离度为0.046%,在合同规定的目标控制范围之内。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形,本基金管理人已向中国证监会报告本基金的解决方案。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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	47,262,138.65	98.68
	其中:股票	47,262,138.65	98.68
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	545,339.27	1.14
8	其他资产	88,440.44	0.18
9	合计	47,895,918.36	100.00

注:上表中的股票投资项含可退替代款估值增值,而5.2的合计项不含可退替代款估值增值。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	2,224,197.30	4.68
B	采矿业	-	-
C	制造业	28,525,655.44	59.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	986,314.52	2.07
F	批发和零售业	1,115,136.00	2.35
G	交通运输、仓储和邮政业	252,000.00	0.53
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,236,287.13	13.11
J	金融业	2,188,117.54	4.60
K	房地产业	350,946.00	0.74
L	租赁和商务服务业	1,320,658.95	2.78
M	科学研究和技术服务业	96,810.00	0.20
N	水利、环境和公共设施管理业	839,528.35	1.77
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,325,215.00	2.79
R	文化、体育和娱乐业	1,801,272.42	3.79
S	综合	-	-
	合计	47,262,138.65	99.39

5.3 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明细

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	002415	海康威视	78,930	2,930,670.90	6.16
2	300498	温氏股份	85,865	1,890,747.30	3.98
3	002304	洋河股份	12,647	1,664,345.20	3.50
4	300059	东方财富	88,158	1,161,922.44	2.44
5	002027	分众传媒	119,460	1,143,232.20	2.40
6	002230	科大讯飞	35,322	1,132,776.54	2.38
7	002024	苏宁易购	79,200	1,115,136.00	2.35
8	002008	大族激光	20,001	1,063,853.19	2.24
9	002739	万达电影	18,590	967,423.60	2.03
10	002450	康得新	55,681	951,031.48	2.00

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 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明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末持仓国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末持仓国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

本报告期内本基金投资的前十名证券中没有出现发行主体被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2

本报告期内本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,371.32
2	应收证券清算款	86,801.28
3	应收股利	-
4	应收利息	267.84
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	88,440.44

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002739	万达电影	967,423.60	2.03	重大资产重组停牌
2	002450	康得新	951,031.48	2.00	重大资产重组停牌

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	28,493,705.00
报告期期间基金总申购份额	500,000.00
减:报告期期间基金总赎回份额	1,000,000.00
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	27,993,705.00

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期期初基金管理人未持有本基金份额,且报告期内基金管理人持有基金份额未发生变动。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

自2018年6月20日起审计基金财产的会计师事务所由德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)改聘为安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)。详见2018年6月21日本公司发布的《华润元大基金管理有限公司改聘会计师事务所公告》。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1.中国证监会关于核准本基金募集的批复;

2.本基金基金合同;

3.本基金托管协议;

4.本报告期内在指定报刊上披露的各项公告。

9.2 存放地点

以上备查文件存放于基金管理人和基金托管人的办公场所。

9.3 查阅方式

基金持有人可在办公时间到基金管理人和基金托管人的办公场所或网站免费查阅。

华润元大基金管理有限公司
2018年7月18日

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

2018 第二季度 报告

2018年6月30日

基金管理人:华润元大基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司
报告送出日期:2018年7月18日

§1 重要提示

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。

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年7月16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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金产品情况

基金简称	中创100联接
交易代码	001713
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年12月23日
报告期末基金份额总额	8,539,509.99份
投资目标	通过投资于目标ETF,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金以华润元大中创100ETF基金(目标ETF)作为其主要投资标的。本基金并不参与目标ETF的管理,主要以一级市场申购的方式进行投资,获取基金份额净值上涨带来的收益;在目标ETF基金份额二级市场交易流动性较好的情况下,也可以通过二级市场买卖目标ETF的基金份额。 1.资产配置策略 为使本基金在保障日常申购赎回的前提下,更好的跟踪标的指数,将严格遵照投资范围内的定进行投资。在巨额申购赎回发生,或份额大比例日常等情况下,基金管理人将在综合考虑冲击成本因素和跟踪效果后,及时将投资配置比例调整至合理水平。 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%。 2.目标ETF的投资策略 1)申购和赎回,目标ETF开放申购赎回后,以股票组合进行申购赎回。 2)二级市场方式:目标ETF上市交易后,在二级市场进行目标ETF基金份额的交易。 当目标ETF申购,赎回或二级市场交易模式进行了变更或调整,本基金应相应作相应的变更或调整。在投资操作过程中,本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上,决定采用一级市场申赎的方式或二级市场交易的方式进行目标ETF的买卖。 3.本基金可通过买入标的指数成分股来跟踪标的指数。基金还将投资于股指期货和其他经中国证监会允许的衍生工具,如权证以及其他与标的指数或标的指数成份股相关的衍生工具。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,以提高投资效率,从而更好地跟踪标的指数,实现投资目标。 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,结合宏观分析和微观分析制定投资策略。此外,本基金还将积极参与风险低且可控的债券回购等投资,以及固债期货投资。基金投资固债期货将本着谨慎的原则,充分考虑其流动性和风险收益特征,适度参与国债期货投资。 4.投资组合的调整 根据每个交易日申购赎回情况及本基金实际权益类资产仓位情况,决定对目标ETF的操作方式和数量。在部分情况下,本基金将会根据目标ETF二级市场交易情况,适时选择对目标ETF进行二级市场交易操作。
业绩比较基准	中创100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ETF联接基金,通过投资于目标ETF跟踪标的指数表现,具有与标的指数以及标的指数所代表的证券市场相似的风险收益特征。同时,本基金为被动式投资的股票型指数基金,跟踪中创100指数,其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金,其风险收益特征与标的指数所表现的市场组合的风险收益特征相似。
基金管理人	华润元大基金管理有限公司
基金托管人	招商证券股份有限公司

2.1