

华润元大保本混合型证券投资基金 2014 年半年度报告

2014 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

送出日期：2014 年 8 月 25 日

§ 1 重要提示及目录

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。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	10
§5 托管人报告	10
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	10
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	11
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	11
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	11
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	12
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	13
6.4 报表附注	14
§7 投资组合报告	28
7.1 期末基金资产组合情况	28
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	28
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	29
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	29
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	31
7.6 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	31
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	31
7.8 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	32
7.9 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	32
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	32
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	32
7.12 投资组合报告附注	32
§8 基金份额持有人信息	33
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	33

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	33
8.3 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	33
§9 开放式基金份额变动.....	34
§10 重大事件揭示.....	34
10.1 基金份额持有人大会决议	34
10.2 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	34
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	34
10.4 基金投资策略的改变	34
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	34
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	34
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	34
10.8 其他重大事件	36
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	36
§12 备查文件目录.....	36
12.1 备查文件目录	36
12.2 存放地点	37
12.3 查阅方式	37

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华润元大保本混合型证券投资基金
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	李芳菲
	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
注册地址		深圳市前海深港合作区前湾一路鲤鱼门街一号前海深港合作区管理局综合办公楼 A 栋 201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）	北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址	深圳市福田区中心四路 1-1 号 嘉里建设广场第三座 7 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	518048	100031
法定代表人	路强	蒋超良

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华润元大基金管理有限公司	深圳市福田区中心四路 1-1 号嘉里 建设广场第三座 7 层
基金保证人	中海信达担保有限公司	北京市东城区建国门内大街 18 号恒 基中心一座 1607 室

§ 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
本期加权平均净值利润率	1.16%
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)
期末可供分配利润	8,993,738.17
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
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2014 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	1.90%

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。

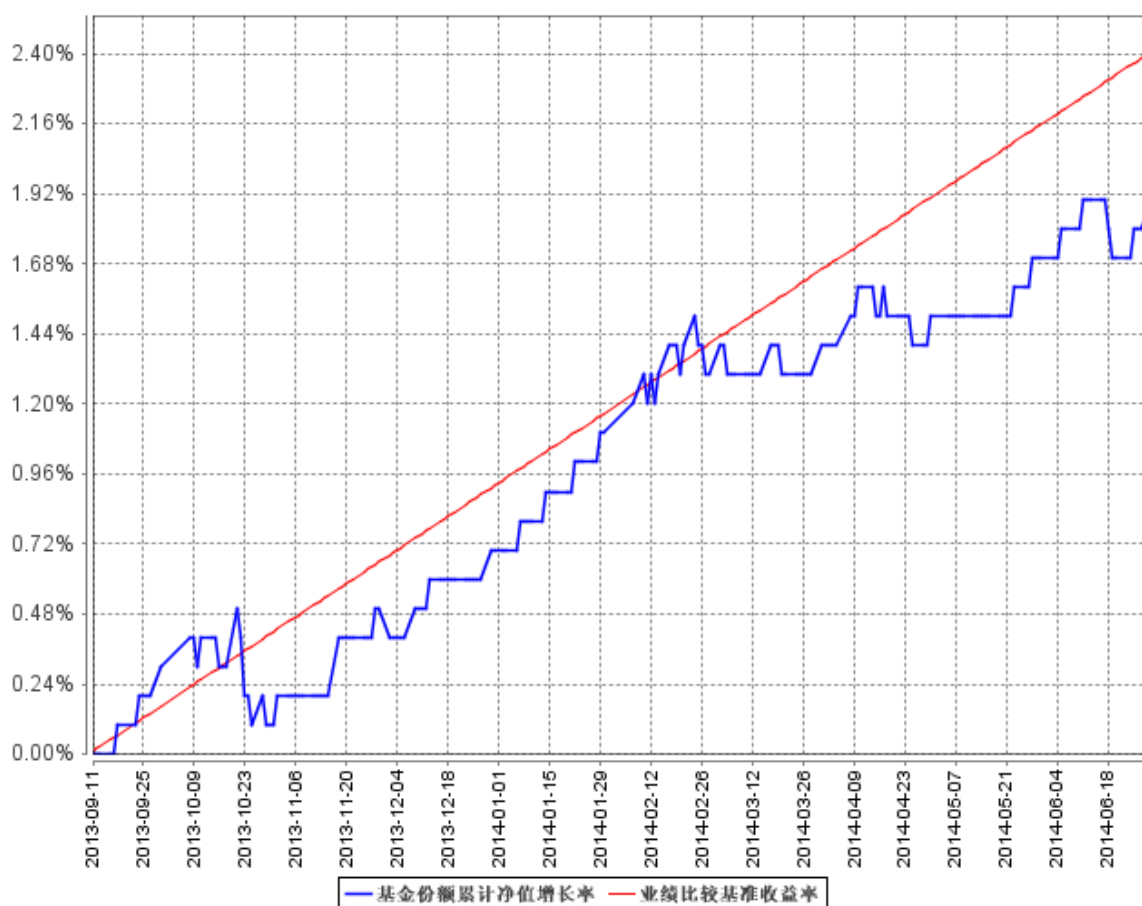
3.2 基金净值表现

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合规守信情况的说明

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合规守信、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，未发现有关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	6.4.7.1	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	6.4.7.2	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	6.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	35,000,292.50	123,579,489.37

应收证券清算款		-	1,039,122.23
应收利息	6.4.7.5	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	6.4.7.6	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	6.4.7.3	-	-
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	6.4.7.7	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	6.4.7.8	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	6.4.7.9	565,473,375.07	607,110,327.06
未分配利润	6.4.7.10	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
一、收入		12,329,470.72
1.利息收入		14,044,818.71
其中：存款利息收入	6.4.7.11	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	6.4.7.12	-4,435,944.07
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	927,458.34
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	47,042.35
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	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）	6.4.7.17	252,656.74
减：二、费用		5,475,042.65
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	4,121,051.84
2. 托管费	6.4.10.2.2	588,721.68
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.18	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	6.4.7.19	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：

<u>林冠和</u>	<u>崔佩伦</u>	<u>崔佩伦</u>
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。

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

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 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
活期存款	28,933,139.22
定期存款	233,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	93,000,000.00
存款期限 3 个月-1 年	140,000,000.00
其他存款	-
合计：	261,933,139.22

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	10,362,041.26	10,522,641.00	160,599.74
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	259,827,518.20	1,368,481.80
	合计	259,827,518.20	1,368,481.80
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	270,189,559.46	271,718,641.00	1,529,081.54

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：截止本报告期末，本基金未持有衍生金融资产和衍生金融负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	35,000,292.50	-
合计	35,000,292.50	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：截至本报告期末，本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2014 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	4,761.75
应收定期存款利息	5,218,230.19
应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	355.86
应收债券利息	3,253,904.76
应收买入返售证券利息	50,338.47
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	24.21
合计	8,527,615.24

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
其他应收款	45,000.00
待摊费用	—
合计	45,000.00

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	202,568.93
银行间市场应付交易费用	9,792.20
合计	212,361.13

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	15,392.14
预提费用	213,437.29
合计	228,829.43

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	607,110,327.06	607,110,327.06

本期申购	494,362.07	494,362.07
本期赎回(以“-”号填列)	-42,131,314.06	-42,131,314.06
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	565,473,375.07	565,473,375.07

注：申购份额含红利再投、转换入份额，赎回份额含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,152,716.24	41,616.31	4,194,332.55
本期利润	5,360,989.42	1,493,438.65	6,854,428.07
本期基金份额交易产生的变动数	-519,967.49	-44,723.26	-564,690.75
其中：基金申购款	5,831.49	497.95	6,329.44
基金赎回款	-525,798.98	-45,221.21	-571,020.19
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,993,738.17	1,490,331.70	10,484,069.87

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	101,939.23
定期存款利息收入	8,031,397.70
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	18,965.27
其他	1,071.13
合计	8,153,373.33

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	168,820,943.89
减：卖出股票成本总额	173,256,887.96
买卖股票差价收入	-4,435,944.07

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2014年1月1日至2014年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	187,256,522.26
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	183,830,934.58
减：应收利息总额	2,498,129.34
债券投资收益	927,458.34

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
股票投资产生的股利收益	47,042.35
基金投资产生的股利收益	-
合计	47,042.35

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
1. 交易性金融资产	1,493,438.65
——股票投资	149,860.57
——债券投资	1,343,578.08
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	1,493,438.65

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	252,656.74
合计	252,656.74

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	527,125.13
银行间市场交易费用	6,050.01
合计	533,175.14

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
审计费用	39,671.58
信息披露费	148,765.71
银行汇划费	23,437.19
账户维护费	12,166.21
合计	224,040.69

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需作说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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。

6.4.10 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，无上年度可比期间。

6.4.10.1 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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 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。

6.4.10.2.2 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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 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。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2014 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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。

6.4.12.2 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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 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。

6.4.12.3.2 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通

过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了由董事会、监事会、董事会下设风险控制委员会，督察长、管理层下设风险管理委员会，监察合规部和各业务部门构成的四级风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2014 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 38.40%。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
A-1	201,105,000.00	50,003,000.00
A-1 以下	—	—
未评级	50,121,000.00	51,863,689.80
合计	251,226,000.00	101,866,689.80

注：1、未评级债券为国债、政策性金融债和央行票据等。

2、上述评级均由经中国证监会核准从事证券市场资信评级业务的评级机构做出。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
AAA	—	—
AAA 以下	—	—
未评级	9,970,000.00	11,964,000.00

合计	9,970,000.00	11,964,000.00
----	--------------	---------------

注：1、未评级债券为国债、政策性金融债和央行票据等。

2、上述评级均由经中国证监会核准从事证券市场资信评级业务的评级机构做出。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金期末持有证券除 6.4.12 列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，其余在本年度末均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的可回购交易的债券资产的公允价值。本基金所持有的金融负债以及可赎回基金份额净值(所有者权益)的合同约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、债券投资及买入返售金融资产等。本基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2014 年 6 月 30 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						

银行存款	261,933,139.22	-	-	-	-	261,933,139.22
结算备付金	878,675.70	-	-	-	-	878,675.70
存出保证金	59,775.16	-	-	-	-	59,775.16
交易性金融资产	20,022,000.00	231,204,000.00	9,970,000.00	-	10,522,641.00	271,718,641.00
买入返售金融资产	35,000,292.50	-	-	-	-	35,000,292.50
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	8,527,615.24	8,527,615.24
应收申购款	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	45,000.00	45,000.00
资产总计	317,893,882.58	231,204,000.00	9,970,000.00	-	19,095,256.24	578,163,138.82
负债	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	1,004,139.18	1,004,139.18
应付管理人报酬	-	-	-	-	665,318.61	665,318.61
应付托管费	-	-	-	-	95,045.53	95,045.53
应付交易费用	-	-	-	-	212,361.13	212,361.13
其他负债	-	-	-	-	228,829.43	228,829.43
负债总计	-	-	-	-	2,205,693.88	2,205,693.88
利率敏感度缺口	317,893,882.58	231,204,000.00	-	-	-	-
上年度末 2013 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产	-	-	-	-	-	-
银行存款	261,971,345.78	100,000,000.00	-	-	-	361,971,345.78
结算备付金	3,184,981.64	-	-	-	-	3,184,981.64
存出保证金	42,093.45	-	-	-	-	42,093.45
交易性金融资产	83,893,689.80	29,937,000.00	-	-	2,789,778.44	116,620,468.24
买入返售金融资产	123,579,489.37	-	-	-	-	123,579,489.37
应收证券清算款	-	-	-	-	1,039,122.23	1,039,122.23
应收利息	-	-	-	-	6,328,029.63	6,328,029.63
应收申购款	-	-	-	-	988.14	988.14
其他资产	-	-	-	-	40,000.00	40,000.00
资产总计	472,671,600.04	129,937,000.00	-	-	10,197,918.44	612,806,518.48
负债	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	401,319.81	401,319.81
应付管理人报酬	-	-	-	-	731,389.91	731,389.91
应付托管费	-	-	-	-	104,484.26	104,484.26
应付交易费用	-	-	-	-	155,355.94	155,355.94
其他负债	-	-	-	-	109,308.95	109,308.95
负债总计	-	-	-	-	1,501,858.87	1,501,858.87
利率敏感度缺口	472,671,600.04	129,937,000.00	-	-	-	-

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 （ 2014 年 6 月 30 日 ）	上年度末 （ 2013 年 12 月 31 日 ）
	市场利率增加 25 个基准点	-502, 712. 38	-130, 794. 39
	市场利率减少 25 个基准点	505, 307. 47	131, 305. 36

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大其他价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。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、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。截至 2014 年 6 月 30 日，本基金持有的股票投资金额仅占基金净资产的 1.83%，因此当市场价格发生合理、可能的变动时，对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日		上年度末 2013 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	10, 522, 641. 00	1. 83	2, 789, 778. 44	0. 46
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	10, 522, 641. 00	1. 83	2, 789, 778. 44	0. 46

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

截至 2014 年 6 月 30 日，本基金持有的股票投资金额仅占基金净资产的 1.83%，因此当市场价格发生合理、可能的变动时，对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.14 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（元）	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所有股票投资明细

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	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	40,037,000.00	6.95
	其中：政策性金融债	40,037,000.00	6.95
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	221,159,000.00	38.40
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	261,196,000.00	45.35

7.6 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	041460029	14 亚泰 CP001	200,000	20,166,000.00	3.50
2	041456009	14 桂交投 CP001	200,000	20,162,000.00	3.50
3	041469014	14 昆交产 CP002	200,000	20,126,000.00	3.49
4	041456015	14 冀建投 CP001	200,000	20,102,000.00	3.49
5	041454012	14 红豆 CP001	200,000	20,066,000.00	3.48

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为保本型基金，本基金暂不参与股指期货交易。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金暂不参与国债期货交易。

7.11.2 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。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期间未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

基金投资的前十名证券的发行主体本期无出现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。

7.12.2

基金投资的前十名股票无超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 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	59,775.16
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	-
4	应收利息	8,527,615.24
5	应收申购款	-
6	其他应收款	45,000.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,632,390.40

7.12.4 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。

7.12.5 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。

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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
4,618	122,449.84	27,050,958.07	4.78%	538,422,417.00	95.22%

8.2 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	524,823.36	0.0928%

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。

8.3 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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2013 年 9 月 11 日 ）基金份额总额	630, 303, 516. 04
本报告期期初基金份额总额	607, 110, 327. 06
本报告期基金总申购份额	494, 362. 07
减：本报告期基金总赎回份额	42, 131, 314. 06
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	565, 473, 375. 07

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。

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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

本报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内为基金进行审计的会计师事务所无变更。

10.6 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未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	

中信证券	1	169,737,544.24	48.54%	154,529.15	48.54%	-
国信证券	2	51,692,441.79	14.78%	47,060.88	14.78%	-
海通证券	1	40,851,538.26	11.68%	37,191.39	11.68%	-
国泰君安	1	38,230,312.67	10.93%	34,804.59	10.93%	-
民生证券	1	26,936,115.31	7.70%	24,522.65	7.70%	-
中金公司	1	22,212,881.57	6.35%	20,222.70	6.35%	-

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。本基金本报告期内新增国信证券深圳交易单元一个。

10.7.2 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
中信证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	95,000,000.00	6.69%	-	-
海通证券	-	-	893,000,000.00	62.93%	-	-
国泰君安	-	-	431,000,000.00	30.37%	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-

中金公司	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华润元大基金管理有限公司旗下开放式基金净值公告	上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2014 年 1 月 2 日
2	华润元大保本混合型证券投资基金 2013 年第 4 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2014 年 1 月 22 日
3	华润元大基金管理有限公司关于设立子公司的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2014 年 1 月 28 日
4	关于华润元大基金管理有限公司从业人员在子公司兼任职务情况的公告	基金管理人网站	2014 年 1 月 28 日
5	华润元大基金管理有限公司关于增加前海汇联基金销售有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2014 年 2 月 28 日
6	华润元大保本混合型证券投资基金 2013 年年度报告	基金管理人网站	2014 年 3 月 28 日
7	华润元大保本混合型证券投资基金 2013 年年度报告摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014 年 3 月 28 日
8	华润元大保本混合型证券投资基金 2014 年第 1 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2014 年 4 月 21 日
9	华润元大保本混合型证券投资基金基金招募说明书（更新）（2014 年第 1 号）	基金管理人网站	2014 年 4 月 22 日
10	华润元大保本混合型证券投资基金基金招募说明书（更新）摘要（2014 年第 1 号）	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2014 年 4 月 22 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

2014 年 2 月 28 日，基金管理人股东元大宝来证券投资信托股份有限公司法定代表人、董事长高抗胜于届龄退休，由杜纯琛接任。2014 年 6 月 18 日，基金管理人股东元大宝来证券投资信托股份有限公司法定代表人、董事长杜纯琛先生辞任，由林武田先生接任。

§ 12 备查文件目录

12.1 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。

12.2 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。

12.3 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
2014 年 8 月 25 日