

华润元大安鑫灵活配置混合型 证券投资基金 2014 年第 3 季度报告

2014 年 9 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：2014 年 10 月 24 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 2014 年 10 月 22 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。

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。华润元大保本混合型证券投资基金以每一年为一个保本周期（第一个保本周期自基金合同生效日起至一个公历年后对应日止。如该对应日为非工作日或不存在该对应日期，保本周期到期日顺延至下一个工作日），即 2014 年 9 月 11 日（周四）为华润元大保本混合型证券投资基金第一个保本周期到期日。

根据《华润元大保本混合型证券投资基金基金合同》的约定，华润元大保本混合型证券投资基金的到期操作期间是指保本周期到期日及之后 4 个工作日（含第 4 个工作日），即 2014 年 9 月 11 日至 2014 年 9 月 17 日。

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 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”，基金托管人及基金登记机构不变，基金代码亦保持不变，为“000273”。转型后基金的投资目标、投资范围、投资策略以及基金费率等按照《华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》相关规定进行运作。就前述修改变更事项，本基金管理人已按照相关法律法规及基金合同的约定履行了相关手续。

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。

自 2014 年 9 月 18 日原华润元大保本混合型证券投资基金名称变更为华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金。原华润元大保本混合型证券投资基金本报告期自 2014 年 7 月 1 日至 2014 年 9 月 17 日止，华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金本报告期自 2014 年 9 月 18 日至 2014 年 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

转型后：

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	42,704,082.39 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、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 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于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。 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，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。
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

转型前：

基金简称	华润元大保本混合
交易代码	000273
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 9 月 11 日
报告期末基金份额总额	81,051,619.67 份
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。
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（转型后）

单位：人民币元

主要财务指标	转型后
	报告期（2014 年 9 月 18 日 — 2014 年 9 月 30 日）
1. 本期已实现收益	226,759.83
2. 本期利润	1,399,389.60
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0239
4. 期末基金资产净值	45,080,730.60
5. 期末基金份额净值	1.056

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、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。

3.1 主要财务指标（转型前）

主要财务指标	转型前
	报告期（ 2014 年 7 月 1 日 — 2014 年 9 月 17 日 ）
1. 本期已实现收益	4,885,863.15
2. 本期利润	3,356,781.61
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0063
4. 期末基金资产净值	83,025,246.57
5. 期末基金份额净值	1.024

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、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。

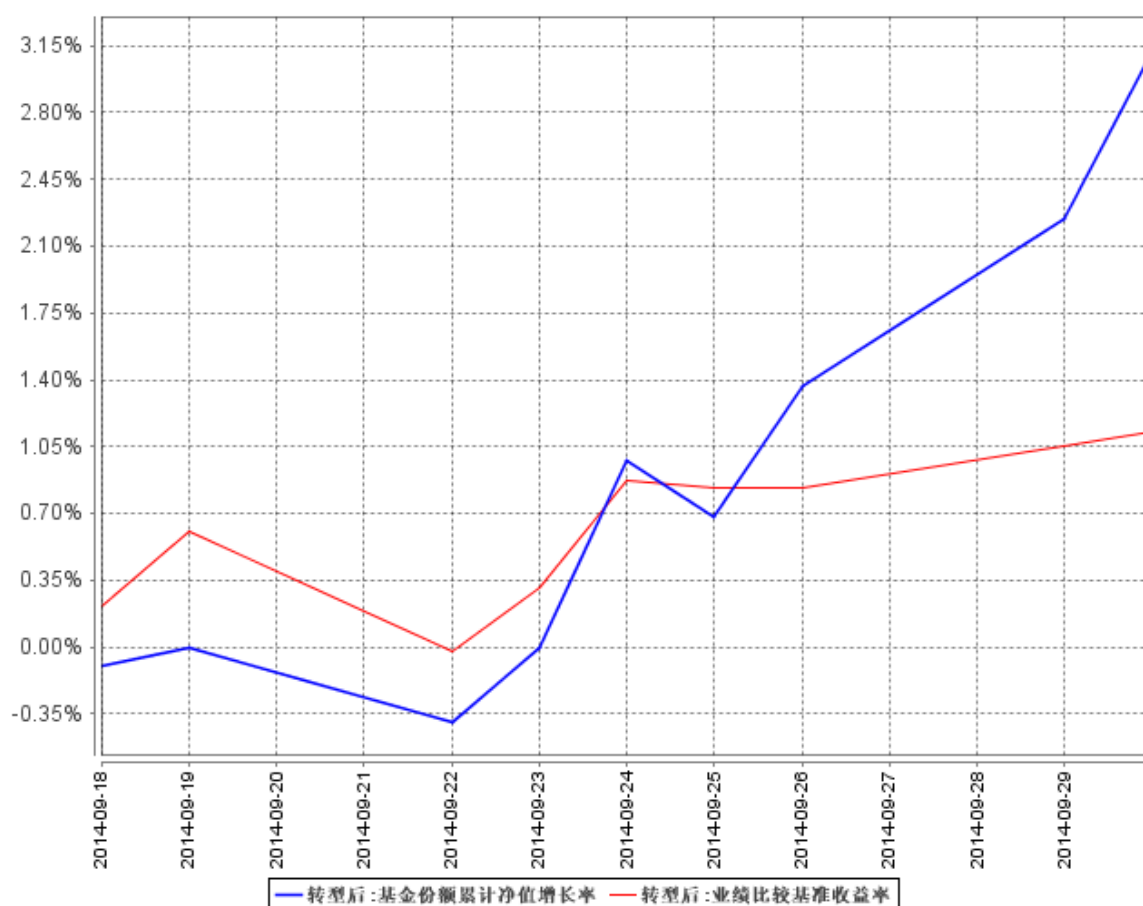
3.2 基金净值表现（转型后）

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
2014 年 9 月 18 日 — 2014 年 9 月 30 日	3.13%	0.53%	1.13%	0.34%	2.00%	0.19%

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

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. 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. 本基金基金合同于 2014 年 9 月 18 日生效，截至报告期末，本基金基金合同生效不满一年。

3. 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。截至报告期末，本基金仍处于建仓期。

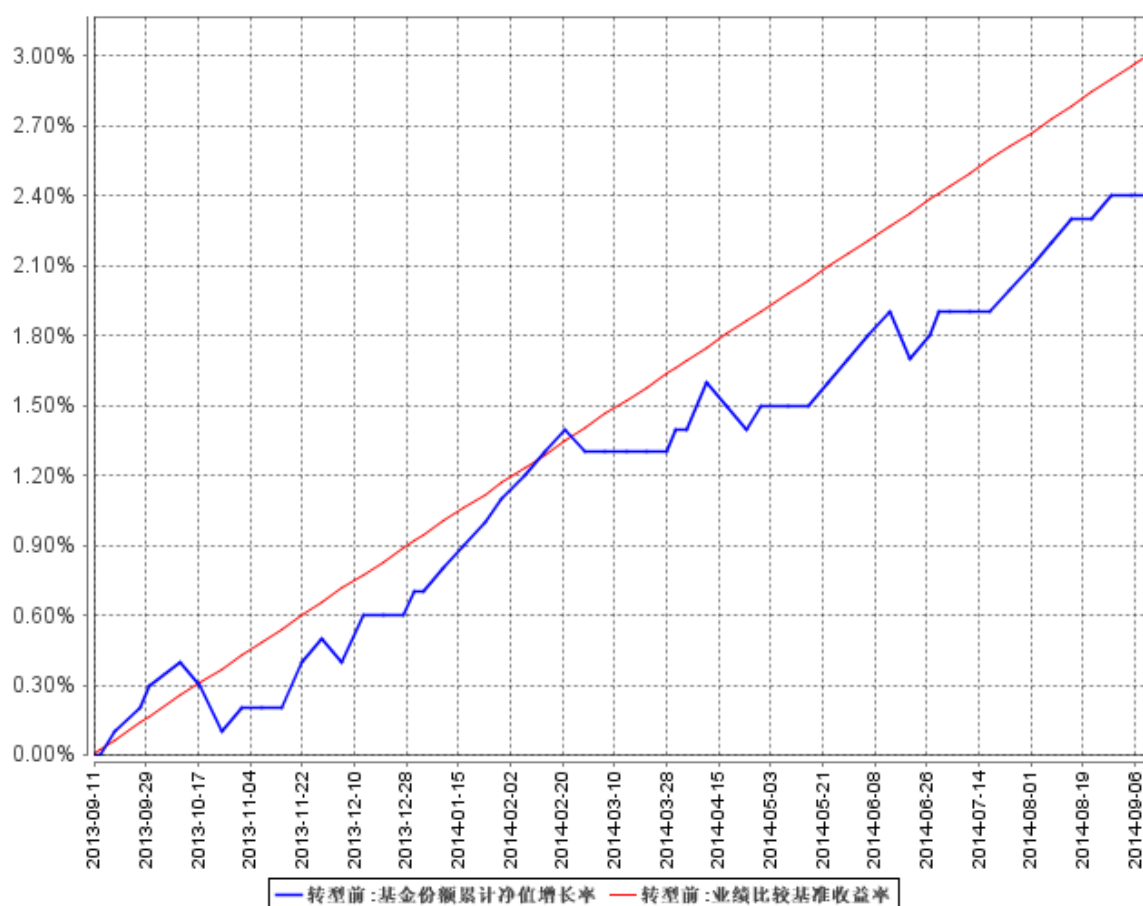
3.2 基金净值表现（转型前）

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
2014 年 7 月 1 日 — 2014 年 9 月 17 日	0.49%	0.05%	0.65%	0.01%	-0.16%	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

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. 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。

2. 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（转型前）

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		
李湘杰	华润元大医疗保健量化股票型证券投资基金基金经理。投资管理部研究总监	2013 年 9 月 11 日	2014 年 9 月 18 日	15 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研究总监。2013 年 9 月 11 日起至 2014 年 9 月 18 日担任华润元大保本混合型证券投资基金基金经理，2014 年 8 月 18 日起担任华润元大医疗保健量化股票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. 此处的任职日期为本基金合同生效日，此处离任日期为公司公告的解聘日期。

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。

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型后）

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		
杨凯玮	华润元大现金收益货币市场基金基金经理，华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理。固定收益部总经理兼任投资管理部总经理	2014 年 9 月 18 日	-	8 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，现任华润元大基金管理有限公司固定收益部总经理兼任投资管理部总经理。2013 年 10 月 29 日起至今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	华润元大信息传媒科技股票型证券投资基金基金经理，华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2014 年 9 月 18 日	-	4 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 日起至今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. 此处的任职日期为本基金合同生效日。

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合规守信情况的说明

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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

整体股票市场从 7 月底起迎来大幅上涨，我们认为主因为政府政策放松预期、海外资金进入预期和货币环境宽松。三季度上证综指涨 15.4%。沪深 300 涨 13.2%。创业板涨 9.69%。行业来看，29 个中信一级行业全部上涨。国防军工（38.25%）、农林牧渔（34.09%）、纺织服装（31.79%）涨幅前三；银行（8.03%）、家电（10.91%）、传媒（13.07%）涨幅靠后。从风格上来看，中小型股票的涨幅优于大型绩优股。基金在转型之前股票仓位低，以应基金到期的赎回。基金转型之后，由于我们看好未来股市的走势，将股票仓位逐步拉高，行业和选股上根据量化模型选取表现强势的行业和个股进行投资。因为基金的股票仓位较高，且我们投资的行业表现优于沪深 300 指数，基金在报告期内表现优于业绩比较基准。

4.4.2 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 1.056 元，基金转型之前份额净值增长率为 0.49%，同期业绩比较基准收益率为 0.65%。基金转型之后份额净值增长率为 3.13%，同期业绩比较基准收益率为 1.13%。

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 月中采 PMI 指数为 51.1%，与上月持平，显示整体经济运行相对稳定。7 月政治局会议已经明确了稳增长的重要性，政策持续发力，对冲地产投资回落风险，同时定向支持居民合理住房需求。货币政策将向宽松方向调整，提高货币增速，一方面将通过公开市场操作并且辅助结构性宽松手段增加流动性。展望未来，股市上涨的中期逻辑未变，短期正面信息更多，股市向上趋势延续，保持高仓位。投资方向上仍以政策为投资主线。以国改为主线的体制改革持续为 A 股提供自下而上的投资线索。在增量资金入场的环境下，政府主导的各类改革从去年的“预期”阶段转向“落地”阶段，电改、油改、各地方政府的国改为 A 股提供持续的主题线索。10 月份沪港通即将开闸，白酒、医药、乳制品将受益，且具备估值切换逻辑。各项改革继续推进，继续看好国企改革类股、军工、TMT 和医疗等新兴行业。基金将根据量化模型选取表现强势的行业和个股进行投资。

§ 5 投资组合报告

转型后：

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	31,277,709.30	64.95
	其中：股票	31,277,709.30	64.95
2	固定收益投资	2,000,400.00	4.15
	其中：债券	2,000,400.00	4.15
	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	9,000,000.00	18.69
	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	5,755,599.71	11.95
7	其他资产	121,190.51	0.25
8	合计	48,154,899.52	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	5,050,029.75	11.20
C	制造业	11,395,124.30	25.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-

E	建筑业	5,472,350.09	12.14
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	1,180,944.00	2.62
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	2,505,426.00	5.56
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	4,412,710.16	9.79
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	1,261,125.00	2.80
	合计	31,277,709.30	69.38

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	002717	岭南园林	56,700	1,530,333.00	3.39
2	002713	东易日盛	36,175	1,510,306.25	3.35
3	002541	鸿路钢构	91,397	1,453,212.30	3.22
4	000780	平庄能源	252,000	1,330,560.00	2.95
5	002620	瑞和股份	74,856	1,320,459.84	2.93
6	601011	宝泰隆	103,800	1,280,892.00	2.84
7	000863	三湘股份	185,500	1,272,530.00	2.82
8	600121	郑州煤电	239,000	1,271,480.00	2.82
9	600624	复旦复华	85,500	1,261,125.00	2.80
10	000030	富奥股份	156,100	1,240,995.00	2.75

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	2,000,400.00	4.44
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-

9	合计	2,000,400.00	4.44
---	----	--------------	------

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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019407	14 国债 07	20,000	2,000,400.00	4.44

注：本基金本报告期末仅持有 1 只债券。

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

注：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

注：本基金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

注：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

注：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

本基金本报告期末未持有股指期货。

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：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

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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	76,102.93
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	35,206.16
5	应收申购款	9,881.42
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	121,190.51

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告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。

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。

转型前：

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	-	-
	其中：股票	-	-
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	83,494,472.48	99.78
7	其他资产	187,028.33	0.22
8	合计	83,681,500.81	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票。

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

注：本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告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。

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

注：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

注：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

注：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

注：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

注：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

本基金本报告期末未持有股指期货。

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：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

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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	76,102.93
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	65,925.40
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	187,028.33

5.11.4 报告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

注：本基金本报告期末未持有股票。

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

基金合同生效日（2014年9月18日）基金份额总额	65,878,168.77
报告期期初基金份额总额	-
报告期期间基金总申购份额	16,823.13
减：报告期期间基金总赎回份额	23,190,909.51
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	42,704,082.39

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（转型后）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型后）

注：本报告期期初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（转型后）

注：本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型前）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型前）

注：本报告期期初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（转型前）

注：本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

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 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”，详细情况请见本报告的“重要提示”部分。

§ 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华润元大保本混合型证券投资基金募集的批复；
- 2、《华润元大保本混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《华润元大保本混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 5、《华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 6、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
2014 年 10 月 24 日