

华润元大安鑫灵活配置混合型 证券投资基金 2015 年半年度报告

2015 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：2015 年 8 月 28 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 2015 年 8 月 27 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 2015 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	6
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	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
§5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	12
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	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	15
§7 投资组合报告	29
7.1 期末基金资产组合情况	29
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	29
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	30
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	31
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	39
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	39
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	39
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	39
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	39
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	39
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	39
7.12 投资组合报告附注	40

§8 基金份额持有人信息	40
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	40
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	41
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	41
§9 开放式基金份额变动	41
§10 重大事件揭示	41
10.1 基金份额持有人大会决议	41
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	41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	42
10.4 基金投资策略的改变	42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	42
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	42
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	42
10.8 其他重大事件	43
§11 备查文件目录	45
11.1 备查文件目录	45
11.2 存放地点	45
11.3 查阅方式	45

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	华润元大安鑫灵活配置
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	238,374,099.58 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 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技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。

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
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 9 层
邮政编码		518048	100031
法定代表人		路强	刘士余

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

§ 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(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	15,473,791.24
本期利润	13,511,943.34
加权平均基金份额本期利润	0.3730
本期加权平均净值利润率	24.89%
本期基金份额净值增长率	51.17%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	194,121,067.44
期末可供分配基金份额利润	0.8144
期末基金资产净值	432,495,167.02

期末基金份额净值	1.814
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	77.15%

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。

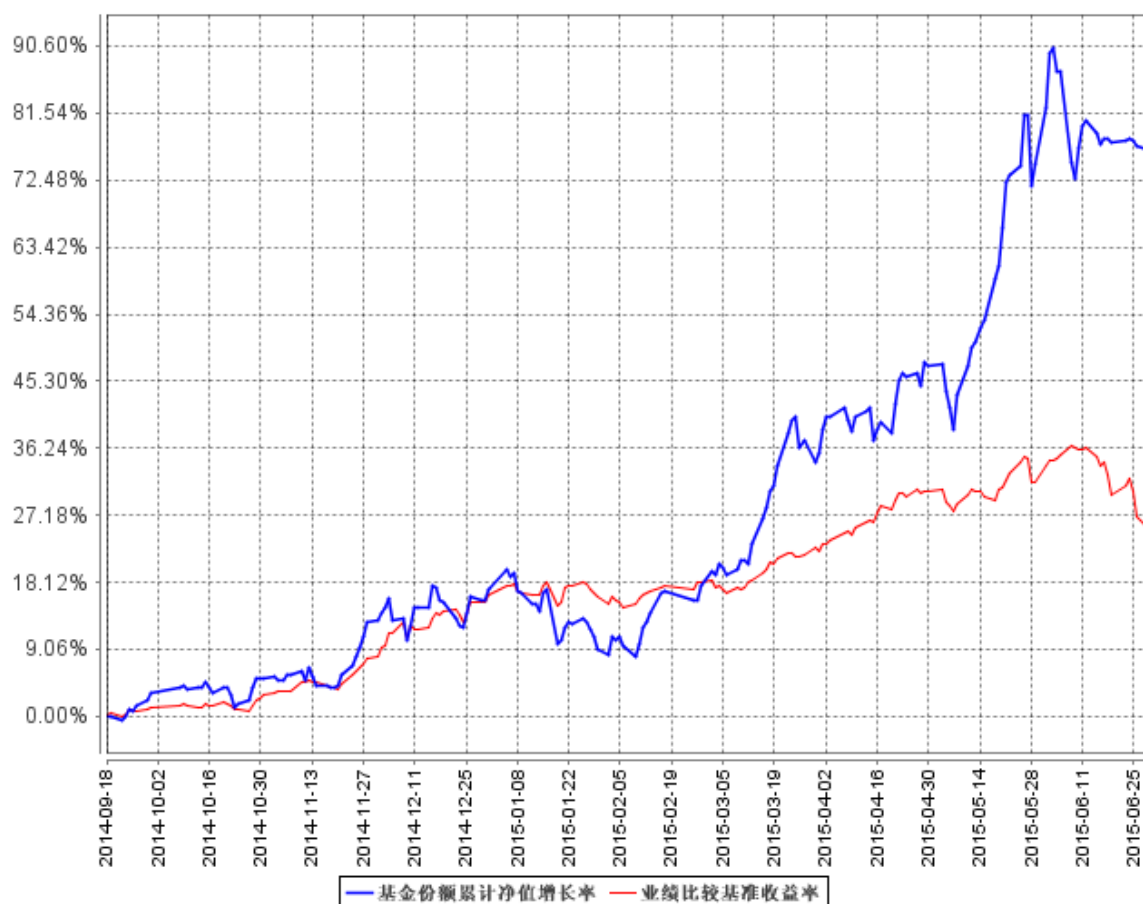
3.2 基金净值表现

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	1.40%	2.16%	-2.50%	1.22%	3.90%	0.94%
过去三个月	30.69%	2.01%	4.94%	0.92%	25.75%	1.09%
过去六个月	51.17%	1.82%	10.26%	0.79%	40.91%	1.03%
自基金合同生效起至今	77.15%	1.58%	28.37%	0.72%	48.78%	0.86%

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

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。截至报告期末本基金转型未满一年。
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。

§ 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

2015 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理六只开放式基金：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股票型证券投资基金，华润元大医疗保健量化股票型证券投资基金，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。

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	-	10 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	2015 年 5 月 8 日	5 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

2015 年上半年股票市场继续上扬，各指数延续去年的上涨趋势。上证 50 超大盘半年涨幅 11.17%，富时中国 A50 上涨 10.55%，沪深 300 上涨 26.58%，上证综指上涨 32.23%。中小、创业板指数表现相对大盘股较好。创业板上涨 94.23%，中小板指上涨仅为 69.06%。

具体分行业来看，中信一级行业中计算机(129.35%)、轻工制造(106.02%)、纺织服装(96.98%)，涨幅前三。煤炭(37.78%)、银行(10.9%)、非银行金融(-0.76%)，涨幅居后。由于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，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，因此业绩表现高于同期业绩比较基准。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2015 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.814 元，报告期内的份额净值增长率为 51.17%，同期业绩比较基准收益率为 10.26%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2015 年 7 月全国制造业 PMI 回落至 50.0，低于市场预期的 50.1，相比 6 月下降 0.2 个点，创 5 个月新低，在历年同期中也属于偏低水平，指向制造业景气依然偏弱。

展望 2015 下半年，货币政策仍有望保持放松，财政政策有望更加积极，综合考虑政策的累积效应和一系列稳增长政策的逐步发力，经济很可能呈现出缓中趋稳态势，但同时杠杆率较高、PPI

持续为负等将给经济增长带来不确定性。

我们认为下半年股市将保持震荡上行的走势。短期内可关注基本面较确定的行业、稳增长受益的行业和政策面确定的板块。中长期来看，包含 TMT、医药、军工等成长股是中国经济结构转型下的长期投资趋势。本基金将保持灵活的股票仓位，并将根据量化模型选取表现强势的行业和个股进行投资。

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，2015 年 4 月 27 日至 6 月 17 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 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：华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.6.1	112,651,875.45	3,738,360.28
结算备付金		725,463.11	898,176.06
存出保证金		57,754.62	68,754.10
交易性金融资产	6.4.6.2	20,236,886.26	48,178,126.08
其中：股票投资		20,236,886.26	41,579,188.50
基金投资		-	-
债券投资		-	6,598,937.58
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-

衍生金融资产	6.4.6.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.6.4	280,000,000.00	8,000,000.00
应收证券清算款		-	4,000.00
应收利息	6.4.6.5	16,202.21	137,045.49
应收股利		-	-
应收申购款		100,016,711.14	21,046.17
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.6.6	-	-
资产总计		513,704,892.79	61,045,508.18
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 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	6.4.6.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		79,990,555.59	-
应付赎回款		427,456.87	456,084.91
应付管理人报酬		172,388.79	62,171.60
应付托管费		24,626.98	8,881.66
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.6.7	420,657.26	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	6.4.6.8	174,040.28	160,123.43
负债合计		81,209,725.77	1,056,471.57
所有者权益:			
实收基金	6.4.6.9	238,374,099.58	49,992,712.66
未分配利润	6.4.6.10	194,121,067.44	9,996,323.95
所有者权益合计		432,495,167.02	59,989,036.61
负债和所有者权益总计		513,704,892.79	61,045,508.18

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.814 元，基金份额总额 238,374,099.58 份。

6.2 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 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		15,409,934.08
1.利息收入		391,621.53

其中：存款利息收入	6.4.6.11	60,218.85
债券利息收入		112,800.55
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		218,602.13
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		16,452,740.56
其中：股票投资收益	6.4.6.12	16,333,573.13
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.6.13	69,418.86
资产支持证券投资收益	6.4.6.13.3	-
贵金属投资收益	6.4.6.14	-
衍生工具收益	6.4.6.15	-
股利收益	6.4.6.16	49,748.57
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.6.17	-1,961,847.90
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.6.18	527,419.89
减：二、费用		1,897,990.74
1. 管理人报酬	6.4.9.2.1	395,412.46
2. 托管费	6.4.9.2.2	56,487.51
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.6.19	1,255,050.37
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	6.4.6.20	191,040.40
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		13,511,943.34
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		13,511,943.34

注：本基金基金合同于 2014 年 9 月 18 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 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2015 年 1 月 1 日至 2015 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）	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）	-	13,511,943.34	13,511,943.34
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）	188,381,386.92	170,612,800.15	358,994,187.07
其中：1.基金申购款	267,563,391.40	204,438,555.26	472,001,946.66
2. 基金赎回款	-79,182,004.48	-33,825,755.11	-113,007,759.59

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）	238,374,099.58	194,121,067.44	432,495,167.02

注：本基金基金合同于 2014 年 9 月 18 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>林瑞源</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

资产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%。

6.4.2 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。

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 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日止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

6.4.4.1 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。

6.4.4.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期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，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。

此外，本报告期所采用的其他会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.4.3 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。

6.4.5 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。

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。

6.4.6 重要财务报表项目的说明

6.4.6.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
活期存款	112,651,875.45
定期存款	—
其中：存款期限 1-3 个月	—
其他存款	—
合计：	112,651,875.45

6.4.6.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2015 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		20,479,491.38	20,236,886.26	-242,605.12
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		20,479,491.38	20,236,886.26	-242,605.12

6.4.6.3 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。

6.4.6.4 买入返售金融资产

6.4.6.4.1 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 2015 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券	280,000,000.00	-
合计	280,000,000.00	-

6.4.6.4.2 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。

6.4.6.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	15,885.05
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	293.76
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-

其他	23.40
合计	16,202.21

注：其他为应收结算保证金利息。

6.4.6.6 其他资产

注：截止本报告期末，本基金未持有其他资产。

6.4.6.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	419,004.76
银行间市场应付交易费用	1,652.50
合计	420,657.26

6.4.6.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	479.38
审计费	24,795.19
信息披露费	148,765.71
合计	174,040.28

6.4.6.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	49,992,712.66	49,992,712.66
本期申购	267,563,391.40	267,563,391.40
本期赎回(以“-”号填列)	-79,182,004.48	-79,182,004.48
— 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	238,374,099.58	238,374,099.58

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。

6.4.6.10 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	8,567,812.48	1,428,511.47	9,996,323.95
本期利润	15,473,791.24	-1,961,847.90	13,511,943.34
本期基金份额交易产生的变动数	194,780,781.34	-24,167,981.19	170,612,800.15
其中：基金申购款	227,677,059.83	-23,238,504.57	204,438,555.26
基金赎回款	-32,896,278.49	-929,476.62	-33,825,755.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	218,822,385.06	-24,701,317.62	194,121,067.44

6.4.6.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	46,030.88
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	7,655.59
其他	6,532.38
合计	60,218.85

注：其他包括结算保证金利息收入人民币 489.44 元和申购款利息收入人民币 6,042.94 元。

6.4.6.12 股票投资收益

6.4.6.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	423,405,186.28
减：卖出股票成本总额	407,071,613.15
买卖股票差价收入	16,333,573.13

6.4.6.13 债券投资收益

6.4.6.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	69,418.86
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-

合计	69,418.86
----	-----------

6.4.6.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	7,819,567.21
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	7,500,397.39
减：应收利息总额	249,750.96
买卖债券差价收入	69,418.86

6.4.6.13.3 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。

6.4.6.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.6.15 衍生工具收益

6.4.6.15.1 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。

6.4.6.15.2 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。

6.4.6.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
股票投资产生的股利收益	49,748.57
基金投资产生的股利收益	-
合计	49,748.57

6.4.6.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
1. 交易性金融资产	-1,961,847.90
——股票投资	-2,017,949.71
——债券投资	56,101.81
——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	-1,961,847.90

6.4.6.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	419,043.57
基金转换费收入	108,376.32
合计	527,419.89

6.4.6.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	1,254,835.37
银行间市场交易费用	215.00
合计	1,255,050.37

6.4.6.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	148,765.71
银行汇划费	3,979.50
账户维护费	13,500.00
合计	191,040.40

6.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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。

6.4.8 关联方关系

6.4.8.1 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，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.8.2 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。

6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行交易。本基金合同于 2014 年 9 月 18 日生效，无上年度可比较期间。

6.4.9.2 关联方报酬

6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	395,412.46
其中：支付销售机构的客户维护费	232,279.51

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。

6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	56,487.51

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。

6.4.9.3 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。

6.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.9.4.1 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。本基金基金合同于 2014 年 9 月 18 日生效，无上年度可比期间可比数据。

6.4.9.4.2 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。

6.4.9.5 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 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	112,651,875.45	46,030.88

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。

6.4.9.6 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。

6.4.9.7 其他关联交易事项的说明

注：无。

6.4.10 利润分配情况

6.4.10.1 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。

6.4.11 期末（2015 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.11.1 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。

6.4.11.2 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
002354	天神娱乐	2015 年 5 月 28 日	重大事项	96.97	2015 年 7 月 23 日	87.27	8,800	916,902.00	853,336.00	-
300047	天源迪科	2015 年 6 月 3 日	重大事项	24.00	2015 年 7 月 30 日	32.29	28,000	685,336.00	672,000.00	-

300346	南大光电	2015 年 6 月 25 日	重大事项	35.49	-	-	13,166	500,346.64	467,261.34	-
002308	威创股份	2015 年 6 月 12 日	重大事项	31.00	-	-	14,800	374,070.00	458,800.00	-
300360	炬华科技	2015 年 6 月 15 日	重大资产重组	44.08	-	-	9,900	371,450.00	436,392.00	-
002527	新时达	2015 年 6 月 15 日	重大资产重组	30.92	-	-	13,050	372,382.00	403,506.00	-

6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.11.3.1 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。

6.4.11.3.2 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。

6.4.12 金融工具风险及管理

6.4.12.1 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。

6.4.12.2 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 2015 年 6 月 30 日，本基金未持有债券资产。

6.4.12.3 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。

6.4.12.4 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。

6.4.12.4.1 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。

6.4.12.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015 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	112,651,875.45	-	-	-	-	112,651,875.45

结算备付金	725,463.11	-	-	-	-	725,463.11
存出保证金	57,754.62	-	-	-	-	57,754.62
交易性金融资产	-	-	-	-	20,236,886.26	20,236,886.26
买入返售金融资产	280,000,000.00	-	-	-	-	280,000,000.00
应收利息	-	-	-	-	16,202.21	16,202.21
应收申购款	-	-	-	-	100,016,711.14	100,016,711.14
资产总计	393,435,093.18	-	-	-	120,269,799.61	513,704,892.79
负债	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	79,990,555.59	79,990,555.59
应付赎回款	-	-	-	-	427,456.87	427,456.87
应付管理人报酬	-	-	-	-	172,388.79	172,388.79
应付托管费	-	-	-	-	24,626.98	24,626.98
应付交易费用	-	-	-	-	420,657.26	420,657.26
其他负债	-	-	-	-	174,040.28	174,040.28
负债总计	-	-	-	-	81,209,725.77	81,209,725.77
利率敏感度缺口	393,435,093.18	-	-	-	-	-
上年度末 2014 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	3,738,360.28	-	-	-	-	3,738,360.28
结算备付金	898,176.06	-	-	-	-	898,176.06
存出保证金	68,754.10	-	-	-	-	68,754.10
交易性金融资产	2,014,000.00	1,227,765.00	3,357,172.58	-	41,579,188.50	48,178,126.08
买入返售金融资产	8,000,000.00	-	-	-	-	8,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	4,000.00	4,000.00
应收利息	-	-	-	-	137,045.49	137,045.49
应收申购款	-	-	-	-	21,046.17	21,046.17
资产总计	14,719,290.44	1,227,765.00	3,357,172.58	-	41,741,280.16	61,045,508.18
负债	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	456,084.91	456,084.91
应付管理人报酬	-	-	-	-	62,171.60	62,171.60
应付托管费	-	-	-	-	8,881.66	8,881.66
应付交易费用	-	-	-	-	369,209.97	369,209.97
其他负债	-	-	-	-	160,123.43	160,123.43
负债总计	-	-	-	-	1,056,471.57	1,056,471.57
利率敏感度缺口	14,719,290.44	1,227,765.00	3,357,172.58	-	-	-

6.4.12.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本期末本基金未持有交易性债券资产，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.12.4.2 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。

6.4.12.4.3 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。

6.4.12.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		上年度末 2014 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	20,236,886.26	4.68	41,579,188.50	69.31
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	20,236,886.26	4.68	41,579,188.50	69.31

6.4.12.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数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（2015 年 6 月 30 日）	上年度末（2014 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	759,138.75	662,547.39
	沪深 300 指数下降 5%	-759,138.75	-662,547.39

6.4.13 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 6 月 30 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 16,945,590.92 元，划分为第二层次的余额为人民币 3,291,295.34 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

本基金本报告期末未发生金融工具公允价值层次之间的转移。

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。

§ 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	20,236,886.26	3.94
	其中：股票	20,236,886.26	3.94
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	280,000,000.00	54.51
	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	113,377,338.56	22.07
7	其他各项资产	100,090,667.97	19.48
8	合计	513,704,892.79	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	12,707,465.34	2.94

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	2,960,095.92	0.68
J	金融业	4,569,325.00	1.06
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	20,236,886.26	4.68

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	002390	信邦制药	225,000	4,023,000.00	0.93
2	300039	上海凯宝	200,000	3,110,000.00	0.72
3	601939	建设银行	369,200	2,632,396.00	0.61
4	000725	京东方 A	500,000	2,595,000.00	0.60
5	601988	中国银行	396,100	1,936,929.00	0.45
6	300085	银之杰	20,000	1,434,600.00	0.33
7	002354	天神娱乐	8,800	853,336.00	0.20
8	300047	天源迪科	28,000	672,000.00	0.16
9	600562	国睿科技	10,900	631,764.00	0.15
10	600085	同仁堂	16,200	581,742.00	0.13
11	300346	南大光电	13,166	467,261.34	0.11
12	002308	威创股份	14,800	458,800.00	0.11
13	300360	炬华科技	9,900	436,392.00	0.10
14	002527	新时达	13,050	403,506.00	0.09
15	300290	荣科科技	4	159.92	0.00

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	600754	锦江股份	4,632,962.80	7.72
2	600804	XD 鹏博士	4,370,041.00	7.28
3	002390	信邦制药	4,188,472.00	6.98
4	002467	二六三	4,048,220.69	6.75
5	000888	峨眉山 A	3,812,387.62	6.36
6	000610	西安旅游	3,424,654.98	5.71
7	300017	网宿科技	3,370,709.68	5.62
8	300039	上海凯宝	3,216,890.20	5.36
9	002033	丽江旅游	3,149,636.29	5.25
10	600036	招商银行	3,013,132.00	5.02
11	002230	科大讯飞	2,984,954.00	4.98
12	601988	中国银行	2,777,810.00	4.63
13	002338	奥普光电	2,770,021.00	4.62
14	002577	雷柏科技	2,751,118.00	4.59
15	000977	浪潮信息	2,687,492.44	4.48
16	002312	三泰控股	2,681,870.00	4.47
17	000802	北京文化	2,662,337.10	4.44
18	002153	石基信息	2,627,510.24	4.38
19	000725	京东方 A	2,620,506.00	4.37
20	600893	中航动力	2,609,082.20	4.35
21	300288	朗玛信息	2,608,305.60	4.35
22	300359	全通教育	2,591,320.08	4.32
23	601007	金陵饭店	2,552,009.00	4.25
24	002152	广电运通	2,488,882.51	4.15
25	601939	建设银行	2,483,788.00	4.14
26	600570	恒生电子	2,482,867.55	4.14
27	300167	迪威视讯	2,477,794.00	4.13
28	300047	天源迪科	2,423,505.05	4.04
29	600216	浙江医药	2,278,385.15	3.80
30	600664	哈药股份	2,271,254.00	3.79
31	600488	天药股份	2,269,301.42	3.78

32	600718	东软集团	2,264,851.64	3.78
33	002194	武汉凡谷	2,245,889.00	3.74
34	600038	中直股份	2,012,678.46	3.36
35	600276	恒瑞医药	1,999,004.35	3.33
36	000568	泸州老窖	1,930,545.00	3.22
37	000858	五 粮 液	1,926,538.00	3.21
38	600199	金种子酒	1,924,350.00	3.21
39	601888	中国国旅	1,923,051.49	3.21
40	300053	欧比特	1,919,760.98	3.20
41	002465	海格通信	1,888,513.00	3.15
42	002186	全 聚 德	1,854,063.00	3.09
43	300182	捷成股份	1,853,709.30	3.09
44	300303	聚飞光电	1,841,959.00	3.07
45	002373	千方科技	1,837,763.00	3.06
46	000862	银星能源	1,821,395.20	3.04
47	600990	四创电子	1,819,680.00	3.03
48	600562	国睿科技	1,809,531.00	3.02
49	300355	蒙草抗旱	1,784,921.98	2.98
50	300166	东方国信	1,784,321.60	2.97
51	002469	三维工程	1,783,459.99	2.97
52	300197	铁汉生态	1,782,648.00	2.97
53	601668	中国建筑	1,782,259.00	2.97
54	002542	中化岩土	1,781,014.76	2.97
55	000748	长城信息	1,778,873.38	2.97
56	300399	京天利	1,778,307.00	2.96
57	300377	赢时胜	1,769,724.00	2.95
58	600358	国旅联合	1,768,351.00	2.95
59	300046	台基股份	1,730,159.96	2.88
60	600391	成发科技	1,729,194.00	2.88
61	002504	东光微电	1,724,953.00	2.88
62	000780	平庄能源	1,724,951.00	2.88
63	300346	南大光电	1,724,635.56	2.87
64	601666	XD 平煤股	1,721,196.00	2.87
65	600345	长江通信	1,704,068.84	2.84
66	000430	张家界	1,657,280.00	2.76
67	300373	扬杰科技	1,644,823.00	2.74

68	002156	通富微电	1,641,905.00	2.74
69	002059	云南旅游	1,638,953.40	2.73
70	300170	汉得信息	1,633,005.00	2.72
71	601318	中国平安	1,628,418.00	2.71
72	002649	博彦科技	1,618,549.00	2.70
73	300229	拓尔思	1,615,760.80	2.69
74	000997	新大陆	1,598,582.00	2.66
75	002362	汉王科技	1,570,878.00	2.62
76	300277	海联讯	1,561,989.00	2.60
77	300150	世纪瑞尔	1,558,625.62	2.60
78	002268	卫士通	1,555,053.41	2.59
79	601328	交通银行	1,523,191.40	2.54
80	300185	通裕重工	1,494,464.00	2.49
81	002524	光正集团	1,492,329.00	2.49
82	300111	向日葵	1,492,294.00	2.49
83	002628	成都路桥	1,491,289.00	2.49
84	600138	中青旅	1,489,941.60	2.48
85	601616	广电电气	1,489,888.40	2.48
86	002067	景兴纸业	1,489,752.10	2.48
87	300117	嘉寓股份	1,487,687.00	2.48
88	600812	华北制药	1,487,448.00	2.48
89	002693	双成药业	1,487,182.50	2.48
90	600210	紫江企业	1,487,070.00	2.48
91	000682	东方电子	1,486,870.00	2.48
92	000488	晨鸣纸业	1,486,236.00	2.48
93	600308	华泰股份	1,485,751.00	2.48
94	600054	黄山旅游	1,485,736.90	2.48
95	300239	东宝生物	1,485,697.24	2.48
96	600462	石岷纸业	1,481,572.99	2.47
97	601601	中国太保	1,469,248.00	2.45
98	600512	腾达建设	1,468,576.00	2.45
99	002635	安洁科技	1,465,278.32	2.44
100	300085	银之杰	1,458,290.00	2.43
101	000681	视觉中国	1,444,562.00	2.41
102	300397	天和防务	1,418,178.42	2.36
103	600015	华夏银行	1,401,285.93	2.34

104	600410	华胜天成	1, 383, 953. 00	2. 31
105	002439	启明星辰	1, 353, 454. 00	2. 26
106	300050	世纪鼎利	1, 347, 162. 00	2. 25
107	002533	金杯电工	1, 335, 553. 00	2. 23
108	600487	亨通光电	1, 326, 737. 70	2. 21
109	600105	永鼎股份	1, 326, 111. 00	2. 21
110	300006	莱美药业	1, 324, 769. 84	2. 21
111	600017	日照港	1, 323, 990. 00	2. 21
112	300215	电科院	1, 323, 748. 00	2. 21
113	000963	华东医药	1, 323, 155. 00	2. 21
114	603168	莎普爱思	1, 320, 081. 00	2. 20
115	600221	海南航空	1, 318, 834. 00	2. 20
116	600033	福建高速	1, 317, 689. 00	2. 20
117	600771	广誉远	1, 317, 479. 14	2. 20
118	601518	吉林高速	1, 317, 304. 00	2. 20
119	002487	大金重工	1, 304, 597. 00	2. 17
120	002609	捷顺科技	1, 278, 059. 74	2. 13
121	000728	国元证券	1, 269, 948. 00	2. 12
122	601336	新华保险	1, 263, 261. 00	2. 11
123	300034	钢研高纳	1, 231, 890. 46	2. 05
124	000983	西山煤电	1, 226, 114. 00	2. 04
125	600115	东方航空	1, 225, 965. 00	2. 04
126	600348	阳泉煤业	1, 225, 513. 26	2. 04
127	600019	宝钢股份	1, 222, 823. 00	2. 04
128	600018	上港集团	1, 222, 419. 00	2. 04
129	601898	中煤能源	1, 222, 364. 50	2. 04
130	603128	华贸物流	1, 220, 313. 00	2. 03
131	601699	潞安环能	1, 214, 406. 82	2. 02
132	000089	深圳机场	1, 209, 535. 00	2. 02
133	601866	中海集运	1, 207, 303. 00	2. 01
134	000778	新兴铸管	1, 206, 559. 00	2. 01
135	002297	博云新材	1, 201, 363. 00	2. 00
136	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。

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	600754	锦江股份	4,893,345.26	8.16
2	002467	二六三	4,697,272.26	7.83
3	600804	XD 鹏博士	4,675,485.54	7.79
4	600036	招商银行	4,631,968.07	7.72
5	000888	峨眉山 A	3,987,133.81	6.65
6	300017	网宿科技	3,615,408.32	6.03
7	000610	西安旅游	3,594,006.54	5.99
8	002230	科大讯飞	3,540,906.71	5.90
9	601666	XD 平煤股	3,371,680.32	5.62
10	002033	丽江旅游	3,367,393.08	5.61
11	601007	金陵饭店	3,066,737.92	5.11
12	002577	雷柏科技	2,898,737.77	4.83
13	300359	全通教育	2,841,527.33	4.74
14	002338	奥普光电	2,837,790.51	4.73
15	601166	兴业银行	2,739,603.15	4.57
16	002312	三泰控股	2,719,213.59	4.53
17	000802	北京文化	2,641,709.74	4.40
18	600893	中航动力	2,634,866.41	4.39
19	000977	浪潮信息	2,626,927.58	4.38
20	600488	天药股份	2,472,421.16	4.12
21	300288	朗玛信息	2,460,804.18	4.10
22	600216	浙江医药	2,459,519.67	4.10
23	002152	广电运通	2,445,872.60	4.08
24	000501	鄂武商 A	2,415,888.37	4.03
25	002153	石基信息	2,354,857.08	3.93
26	600664	哈药股份	2,353,777.96	3.92
27	601398	工商银行	2,350,748.92	3.92
28	600000	浦发银行	2,340,448.36	3.90
29	300167	迪威视讯	2,318,502.69	3.86
30	600718	东软集团	2,313,905.90	3.86
31	600570	恒生电子	2,217,797.16	3.70
32	002194	武汉凡谷	2,181,312.85	3.64
33	601668	中国建筑	2,162,081.25	3.60
34	300053	欧比特	2,143,157.49	3.57
35	002373	千方科技	2,100,442.18	3.50

36	600990	四创电子	2,048,394.14	3.41
37	002186	全聚德	2,046,355.55	3.41
38	300377	赢时胜	2,012,903.65	3.36
39	300303	聚飞光电	2,006,762.19	3.35
40	000712	锦龙股份	1,987,269.33	3.31
41	300047	天源迪科	1,979,906.02	3.30
42	002465	海格通信	1,973,188.22	3.29
43	002504	东光微电	1,969,240.23	3.28
44	600276	恒瑞医药	1,961,770.42	3.27
45	000862	银星能源	1,948,405.47	3.25
46	600391	成发科技	1,932,097.23	3.22
47	300197	铁汉生态	1,925,976.89	3.21
48	601888	中国国旅	1,903,025.58	3.17
49	002542	中化岩土	1,901,410.31	3.17
50	600199	金种子酒	1,899,736.02	3.17
51	300182	捷成股份	1,895,729.30	3.16
52	000858	五粮液	1,893,520.97	3.16
53	000568	泸州老窖	1,892,267.66	3.15
54	600038	中直股份	1,852,754.72	3.09
55	002362	汉王科技	1,847,157.21	3.08
56	002059	云南旅游	1,796,649.94	2.99
57	300373	扬杰科技	1,792,302.06	2.99
58	601688	华泰证券	1,786,692.65	2.98
59	600508	上海能源	1,776,294.03	2.96
60	002268	卫士通	1,775,258.09	2.96
61	300150	世纪瑞尔	1,772,607.14	2.95
62	600697	欧亚集团	1,770,397.68	2.95
63	000430	张家界	1,769,515.58	2.95
64	600345	长江通信	1,760,441.12	2.93
65	600512	腾达建设	1,751,278.28	2.92
66	000776	广发证券	1,741,885.64	2.90
67	002156	通富微电	1,722,483.83	2.87
68	300355	蒙草抗旱	1,719,129.67	2.87
69	000937	冀中能源	1,717,383.33	2.86
70	000682	东方电子	1,711,111.78	2.85
71	002067	景兴纸业	1,709,567.38	2.85
72	300046	台基股份	1,705,924.62	2.84
73	300166	东方国信	1,704,930.03	2.84

74	600997	开滦股份	1,699,632.43	2.83
75	600123	兰花科创	1,697,727.67	2.83
76	300117	嘉寓股份	1,695,722.61	2.83
77	600694	大商股份	1,691,305.17	2.82
78	600812	华北制药	1,678,617.14	2.80
79	002487	大金重工	1,670,414.09	2.78
80	002635	安洁科技	1,663,391.11	2.77
81	000780	平庄能源	1,657,962.42	2.76
82	600159	大龙地产	1,655,100.40	2.76
83	300277	海联讯	1,654,699.70	2.76
84	002469	三维工程	1,650,747.11	2.75
85	600210	紫江企业	1,647,917.81	2.75
86	300399	京天利	1,640,639.07	2.73
87	600462	石岷纸业	1,636,647.01	2.73
88	000979	中弘股份	1,636,158.17	2.73
89	601616	广电电气	1,634,919.69	2.73
90	600729	重庆百货	1,624,385.92	2.71
91	600016	民生银行	1,623,733.72	2.71
92	000918	嘉凯城	1,623,086.15	2.71
93	000748	长城信息	1,622,176.53	2.70
94	600308	华泰股份	1,605,143.67	2.68
95	002693	双成药业	1,601,522.14	2.67
96	000036	华联控股	1,595,086.50	2.66
97	300111	向日葵	1,580,251.56	2.63
98	300239	东宝生物	1,573,602.26	2.62
99	300229	拓尔思	1,567,611.95	2.61
100	600358	国旅联合	1,565,397.28	2.61
101	600816	安信信托	1,563,458.70	2.61
102	002649	博彦科技	1,543,815.00	2.57
103	600280	中央商场	1,542,968.23	2.57
104	600410	华胜天成	1,540,899.79	2.57
105	600105	永鼎股份	1,537,788.90	2.56
106	002439	启明星辰	1,536,302.36	2.56
107	300185	通裕重工	1,535,327.65	2.56
108	002609	捷顺科技	1,530,831.12	2.55
109	000997	新大陆	1,529,948.00	2.55
110	000488	晨鸣纸业	1,519,169.93	2.53
111	002628	成都路桥	1,515,454.40	2.53

112	300397	天和防务	1,493,023.58	2.49
113	300170	汉得信息	1,487,271.76	2.48
114	002524	光正集团	1,485,038.35	2.48
115	600054	黄山旅游	1,480,846.43	2.47
116	601318	中国平安	1,475,387.01	2.46
117	601601	中国太保	1,465,214.41	2.44
118	000681	视觉中国	1,458,762.64	2.43
119	600138	中青旅	1,431,995.91	2.39
120	600487	亨通光电	1,429,119.25	2.38
121	600999	招商证券	1,415,257.00	2.36
122	300346	南大光电	1,414,543.87	2.36
123	000066	长城电脑	1,410,435.00	2.35
124	002707	众信旅游	1,408,471.68	2.35
125	601328	交通银行	1,402,256.51	2.34
126	600015	华夏银行	1,370,573.53	2.28
127	600033	福建高速	1,362,474.85	2.27
128	300178	腾邦国际	1,360,662.40	2.27
129	601518	吉林高速	1,349,253.91	2.25
130	601336	新华保险	1,345,904.00	2.24
131	603168	莎普爱思	1,332,433.82	2.22
132	000963	华东医药	1,314,618.19	2.19
133	300050	世纪鼎利	1,300,435.27	2.17
134	600017	日照港	1,283,993.69	2.14
135	300006	莱美药业	1,279,476.27	2.13
136	600771	广誉远	1,273,755.05	2.12
137	300253	卫宁软件	1,265,044.15	2.11
138	300215	电科院	1,253,661.20	2.09
139	002533	金杯电工	1,242,941.45	2.07
140	002415	海康威视	1,224,522.17	2.04
141	601333	广深铁路	1,218,058.43	2.03
142	600765	中航重机	1,205,856.00	2.01
143	600221	海南航空	1,200,977.90	2.00
144	000728	国元证券	1,200,603.59	2.00
145	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。

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	387,747,260.62
卖出股票收入（成交）总额	423,405,186.28

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

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

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

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

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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。

7.12.2

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。

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	57,754.62
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	16,202.21
5	应收申购款	100,016,711.14
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	100,090,667.97

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

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	002354	天神娱乐	853,336.00	0.20	重大事项
2	300047	天源迪科	672,000.00	0.16	重大事项

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
736	323,877.85	227,955,211.03	95.63%	10,418,888.55	4.37%

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	148,185.03	0.0622%

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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 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
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	267,563,391.40
减：本报告期基金总赎回份额	79,182,004.48
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	238,374,099.58

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总经理发生变更，由林冠和先生变更为林瑞源先生，该事项已于 2015

年 4 月 2 日进行公告。

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。

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。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金管理人聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计的会计师事务所。本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。

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无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	
国信证券	2	302,803,342.18	37.33%	275,665.96	37.33%	-
中信证券	2	232,758,002.70	28.70%	211,906.20	28.70%	-
国泰君安	1	83,198,882.68	10.26%	75,744.49	10.26%	-
银河证券	1	72,670,256.24	8.96%	66,159.20	8.96%	-
安信证券	2	55,223,190.52	6.81%	50,275.06	6.81%	-
招商证券	1	44,378,154.92	5.47%	40,400.31	5.47%	-
民生证券	1	20,120,617.66	2.48%	18,318.12	2.48%	-
海通证券	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、银河证券租用了基金专用交易单元。

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
国信证券	3,735,931.16	58.24%	58,000,000.00	4.92%	-	-
中信证券	1,512,426.46	23.58%	-	-	-	-
国泰君安	-	-	70,000,000.00	5.94%	-	-
银河证券	324,130.63	5.05%	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	842,686.00	13.14%	1,050,000,000.00	89.13%	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

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	中国证券报、上海证券报、	2015 年 1 月 5 日

	公告	证券时报、基金管理人网站	
2	华润元大基金管理有限公司关于实施基金直销柜台认购、申购及转换费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2015 年 1 月 15 日
3	华润元大基金管理有限公司关于旗下部分基金调整停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2015 年 1 月 21 日
4	华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金 2014 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	2015 年 1 月 22 日
5	关于华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金参加部分代销机构申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2015 年 1 月 30 日
6	华润元大基金管理有限公司关于旗下部分基金调整停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、 基金管理人网站	2015 年 2 月 25 日
7	华润元大基金管理有限公司关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2015 年 3 月 26 日
8	华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金 2014 年年度报告	基金管理人网站	2015 年 3 月 30 日
9	华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金 2014 年年度报告摘要	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2015 年 3 月 30 日
10	华润元大基金管理有限公司关于变更公司总经理的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2015 年 4 月 2 日
11	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变更的公告	基金管理人网站	2015 年 4 月 2 日
12	华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金 2015 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	2015 年 4 月 21 日
13	华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2015 年第 1 号）	基金管理人网站	2015 年 4 月 30 日
14	华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2015 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	2015 年 4 月 30 日
15	华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2015 年 5 月 9 日
16	华润元大基金管理有限公司关于旗下部分基金调整停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2015 年 5 月 12 日
17	华润元大基金管理有限公司关于旗下部分基金调整停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2015 年 5 月 15 日
18	华润元大基金管理有限公司关于旗下部分基金调整停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2015 年 5 月 19 日
19	华润元大基金管理有限公司关于旗下部分基金调整停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2015 年 5 月 27 日
20	关于华润元大基金管理有限公司旗下部分基金参加中国农业银行网上银行、手机银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2015 年 5 月 28 日
21	华润元大基金管理有限公司关于旗下部分基金调整停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2015 年 6 月 10 日

§ 11 备查文件目录

11.1 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。

11.2 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。

11.3 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
2015 年 8 月 28 日