

华润元大安鑫灵活配置混合型 证券投资基金 2016 年半年度报告

2016 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：2016 年 8 月 27 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 2016 年 8 月 26 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 2016 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	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
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	10
§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	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	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	32
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	32
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	32
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	33
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	33
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	33
7.12 投资组合报告附注	33

§8 基金份额持有人信息	34
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	34
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	34
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	34
§9 开放式基金份额变动	35
§10 重大事件揭示	35
10.1 基金份额持有人大会决议	35
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	35
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	35
10.4 基金投资策略的改变	35
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	35
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	36
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	36
10.8 其他重大事件	37
§11 影响投资者决策的其他重要信息	38
§12 备查文件目录	38
12.1 备查文件目录	38
12.2 存放地点	39
12.3 查阅方式	39

§ 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	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	267,814,576.35 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。

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 1 号 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	周慕冰

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(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-13,182,730.08
本期利润	-12,185,566.44
加权平均基金份额本期利润	-0.0453
本期加权平均净值利润率	-2.55%
本期基金份额净值增长率	-2.47%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	207,690,331.15
期末可供分配基金份额利润	0.7755
期末基金资产净值	475,504,907.50
期末基金份额净值	1.776
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	73.44%

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。

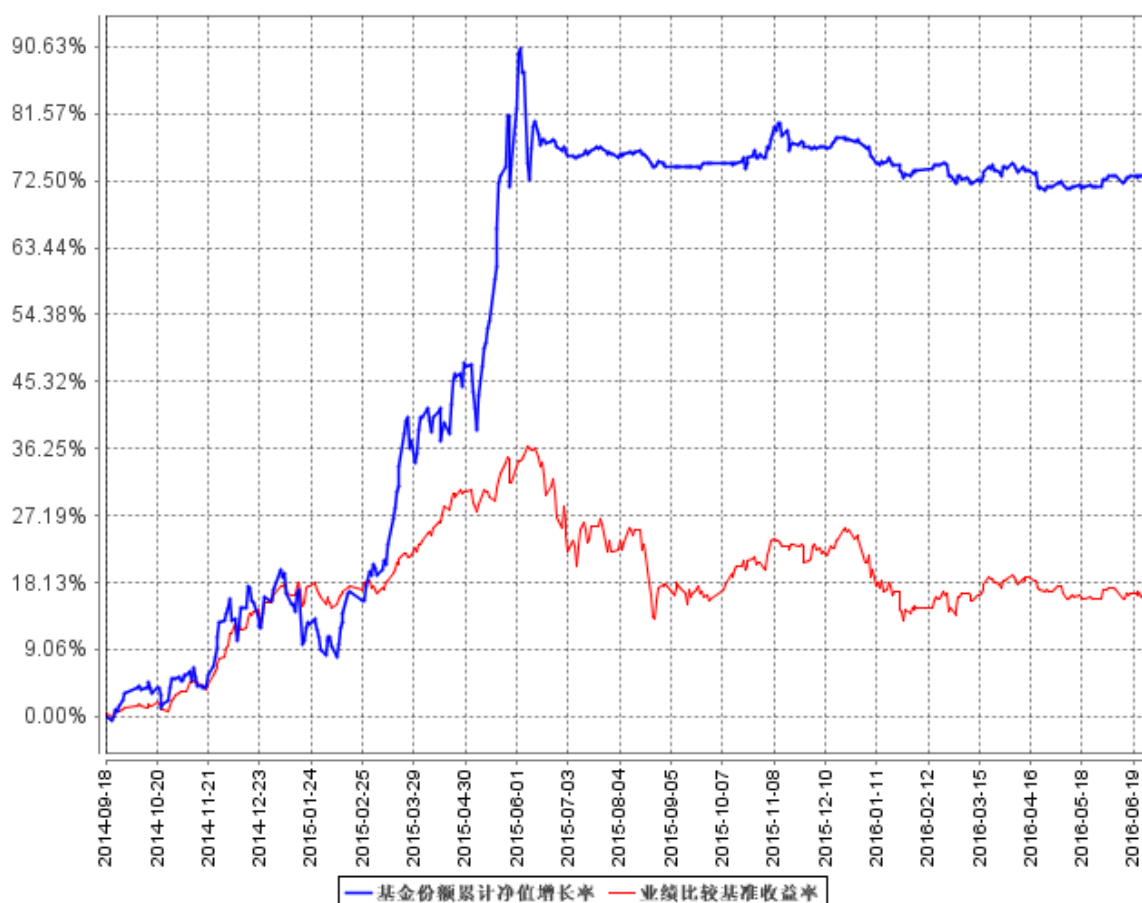
3.2 基金净值表现

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	0.51%	0.16%	0.08%	0.35%	0.43%	-0.19%
过去三个月	-0.56%	0.23%	-0.97%	0.36%	0.41%	-0.13%
过去六个月	-2.47%	0.26%	-5.39%	0.65%	2.92%	-0.39%
过去一年	-2.09%	0.25%	-8.58%	0.81%	6.49%	-0.56%
自基金合同生效起至今	73.44%	1.07%	17.31%	0.77%	56.13%	0.30%

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：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 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华润元大基金管理有限公司经中国证监会证监许可【2012】1746 号文批准，于 2013 年 1 月 17 日完成工商登记注册，总部位于深圳，注册资本 3 亿元人民币。公司由华润深国投信托有限公司和台湾元大证券投资信托股份有限公司共同发起设立，占股比例分别为 51% 和 49%。截至 2016 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理八只开放式基金：华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金，华润元大现金收益货币市场基金，华润元大信息传媒科技混合型证券投资基金，华润元大医疗保健量化混合型证券投资基金，华润元大富时中国 A50 指数型证券投资基金，华润元大中创 100 交易型开放式指数证券投资基金，华润元大中创 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金，华润元大稳健收益债券型证券投资基金。

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		
袁华涛	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	2015 年 9 月 16 日	-	6 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。中国，西南财经大学金融学博士，具有基金从业资格。

注：1. 基金经理任职日期和离任日期为公司公告的聘任或解聘日期；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

2016 年上半年中国股市整体上是下跌的，第一季度中国股票市场出现了普遍性下跌，但第二季度股票市场出现震荡分化走势。上证指数在上半年下跌 17.22%，创业板指数在上半年下跌 17.92%，中小板指数下跌 17.88%，万得全 A 下跌 17.04%，沪深 300 指数下跌 15.47%，上证 50 指数下跌 12.32%，富时中国 A50 指数下跌 13.03%。2016 年 1-6 月，中信一级 29 个行业中食品饮料（2.38%）、有色金属（-5.15%）、银行（-6.16%）板块表现较好，涨幅居前；而交通运输（-27.00%）、餐饮旅游（-27.26%）、传媒（-29.78%）板块走势明显较弱，跌幅居前。

在市场震荡下跌中，本基金在报告期内对持仓股票进行了减持；固定收益类方面，做了回购等。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.776 元，报告期内的份额净值增长率为-2.47%，同期业绩比较基准收益率为-5.39%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前中国经济继续寻底，实体经济增长动能疲弱，物价水平总体温温和。中央经济工作会议确

定了 2016 年“去产能、去库存、去杠杆、降成本、补短板”的五大任务，供给侧结构性改革将是未来经济工作的主线。未来一段时间，中国经济运行呈现 L 型走势，2015 年中国经济增速为 6.9%，在基建投资和地产政策刺激下，2016 年上半年 GDP 增长录得 6.7%，好于预期，但持续性存疑，制造业投资负增长，房地产投资增速见顶回落，显示底部并未探明。上半年，新经济表现较好，战略新兴产业同比增长 11%，高于工业增长 5 个点；网上商品和服务零售额同比增长 28.2%，新能源汽车同比增长 88.7%，工业机器人同比增长 28.2%；服务业保持较快增长，稳居第一大产业，对经济增长的贡献率高达 59.7%。展望 2016 年下半年，从我国经济发展的外部环境并不乐观，发达国家缓慢复苏，新兴经济体面临美国加息、英国脱欧、恐怖活动等不利挑战，我国经济受结构性和周期性因素的双重影响，预计增长中枢还会下移。去杠杆加大经济与物价下行压力，预计 2016 年中国经济增速降至 6.6%，2016 年 CPI 预计为 2.0%，PPI 预计为-1.8%。为稳增长，货币政策有望继续宽松，无风险利率继续下行，财政政策有望更加积极，赤字率有望突破 3%。下半年股票市场有望保持宽幅震荡的走势，市场会有结构性机会，我们重点关注景气向上、估值合理的优质公司。下一步值得警惕美联储加息、去产能、去杠杆、信用违约等不利事件的冲击。

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。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—华润元大基金管理有限公司 2016 年 1 月 1 日至 2016 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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，华润元大基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本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：华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	19,813,477.85	55,045,835.66
结算备付金		14,281,333.61	10,148,221.10
存出保证金		159,291.83	70,063.34
交易性金融资产	6.4.7.2	3,645,427.74	58,530,605.57
其中：股票投资		3,645,427.74	23,344,605.57

基金投资		-	-
债券投资		-	35,186,000.00
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	438,600,544.40	367,500,000.00
应收证券清算款		14,605.00	10,559,984.48
应收利息	6.4.7.5	193,626.26	1,114,032.16
应收股利		-	-
应收申购款		499.40	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		476,708,806.09	502,968,742.31
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 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		61,923.69	6,898.55
应付管理人报酬		545,121.68	596,672.95
应付托管费		77,874.52	85,238.97
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	337,330.01	164,606.66
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	181,648.69	65,010.36
负债合计		1,203,898.59	918,427.49
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	267,814,576.35	275,752,760.76
未分配利润	6.4.7.10	207,690,331.15	226,297,554.06
所有者权益合计		475,504,907.50	502,050,314.82
负债和所有者权益总计		476,708,806.09	502,968,742.31

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.776 元，基金份额总额 267,814,576.35 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		-6,959,754.41	15,409,934.08
1.利息收入		5,703,914.41	391,621.53
其中：存款利息收入	6.4.7.11	543,998.65	60,218.85
债券利息收入		3,334,962.88	112,800.55
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,824,952.88	218,602.13
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-13,717,623.44	16,452,740.56
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-10,483,770.68	16,333,573.13
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-3,445,313.58	69,418.86
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	211,460.82	49,748.57
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	997,163.64	-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）	6.4.7.18	56,790.98	527,419.89
减：二、费用		5,225,812.03	1,897,990.74
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,324,441.10	395,412.46
2. 托管费	6.4.10.2.2	474,920.20	56,487.51
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	1,214,632.27	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	6.4.7.20	211,818.46	191,040.40
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-12,185,566.44	13,511,943.34
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-12,185,566.44	13,511,943.34

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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	275,752,760.76	226,297,554.06	502,050,314.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-12,185,566.44	-12,185,566.44
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）	-7,938,184.41	-6,421,656.47	-14,359,840.88
其中：1.基金申购款	4,946,394.37	3,847,247.42	8,793,641.79
2.基金赎回款	-12,884,578.78	-10,268,903.89	-23,153,482.67
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）	267,814,576.35	207,690,331.15	475,504,907.50
项目	上年度可比期间 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

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：

_____ 林瑞源	_____ 崔佩伦	_____ 崔佩伦
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

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 2016 年 6 月 30 日的财

务状况以及自 2016 年 1 月 1 日至 2016 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

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

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、增值税、企业所得税

以发行基金方式募集资金不属于营业税或增值税征收范围，不征收营业税或增值税。

2016 年 5 月 1 日前，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，免征营业税。

自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入及金融同业往来利息收入亦免征增值税；存款利息收入不征收增值税。

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、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入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，暂免征收个人所得税。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

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 2016 年 6 月 30 日
活期存款	19,813,477.85
定期存款	—
其中：存款期限 1-3 个月	—
其他存款	—
合计：	19,813,477.85

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,566,398.68	3,645,427.74	1,079,029.06
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	2,566,398.68	3,645,427.74	1,079,029.06

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 2016 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购

买入返售证券	289,000,000.00	—
买入返售证券_银行间	149,600,544.40	—
合计	438,600,544.40	—

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 2016 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	5,473.73
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	5,783.94
应收债券利息	—
应收买入返售证券利息	182,304.06
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	64.53
合计	193,626.26

注：其他为应收结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

注：截止本报告期末，本基金未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	330,195.43
银行间市场应付交易费用	7,134.58
合计	337,330.01

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	147.37
预提审计费	32,323.20
预提信息披露费	149,178.12
合计	181,648.69

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	275,752,760.76	275,752,760.76
本期申购	4,946,394.37	4,946,394.37
本期赎回(以“-”号填列)	-12,884,578.78	-12,884,578.78
- 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	267,814,576.35	267,814,576.35

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	257,838,647.84	-31,541,093.78	226,297,554.06
本期利润	-13,182,730.08	997,163.64	-12,185,566.44
本期基金份额交易产生的变动数	-7,395,774.50	974,118.03	-6,421,656.47
其中：基金申购款	4,443,215.31	-595,967.89	3,847,247.42
基金赎回款	-11,838,989.81	1,570,085.92	-10,268,903.89
本期已分配利润	-	-	-
本期末	237,260,143.26	-29,569,812.11	207,690,331.15

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	91,100.05
定期存款利息收入	372,847.37
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	78,845.88
其他	1,205.35
合计	543,998.65

注：其他为结算保证金利息收入。

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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	401,716,341.69
减：卖出股票成本总额	412,200,112.37
买卖股票差价收入	-10,483,770.68

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016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	-3,445,313.58
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	-3,445,313.58

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	414,099,370.81
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	411,846,516.28
减：应收利息总额	5,698,168.11
买卖债券差价收入	-3,445,313.58

6.4.7.13.3 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。

6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 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。

6.4.7.15.2 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。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	211,460.82
基金投资产生的股利收益	-
合计	211,460.82

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	997,163.64
——股票投资	945,065.56
——债券投资	52,098.08
——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	997,163.64

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	52,610.72
基金转换费收入	4,180.26
合计	56,790.98

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	1,209,587.27
银行间市场交易费用	5,045.00
合计	1,214,632.27

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
审计费用	32,323.20
信息披露费	149,178.12
银行汇划费	12,117.14
账户维护费	18,000.00
其他费用_其他	200.00
合计	211,818.46

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，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 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
华润元大基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人、基金销售机构

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

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 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	3,324,441.10	395,412.46

其中：支付销售机构的客户维护费	44,863.00	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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	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	474,920.20	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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未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：本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年6月30日		2015年1月1日至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	19,813,477.85	91,100.05	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。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未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（2016 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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601966	玲珑轮胎	2016 年 6 月 24 日	2016 年 7 月 6 日	新股流通受限	12.98	12.98	3,944	51,193.12	51,193.12	-
603016	新宏泰	2016 年 6 月 23 日	2016 年 7 月 1 日	新股流通受限	8.49	8.49	1,602	13,600.98	13,600.98	-
300520	科大国创	2016 年 6 月 30 日	2016 年 7 月 8 日	新股流通受限	10.05	10.05	926	9,306.30	9,306.30	-
002805	丰元股份	2016 年 6 月 29 日	2016 年 7 月 7 日	新股流通受限	5.80	5.80	971	5,631.80	5,631.80	-

6.4.12.2 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
002452	长高集团	2016 年 6 月 14 日	重大事项停牌	12.02	2016 年 7 月 12 日	10.82	100,300	1,030,114.00	1,205,606.00	-
000728	国元证券	2016 年 6 月 8 日	重大事项停牌	16.72	2016 年 7 月 8 日	17.37	70,600	1,205,658.00	1,180,432.00	-

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中国农业银行股份有限公司，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 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有债券资产。

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 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
A-1	—	—
A-1 以下	—	—
未评级	—	30,184,000.00
合计	—	30,184,000.00

注：1、未评级债券包括没有信用评级的国债、政策性金融债、央票等。

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 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
AAA	—	—
AAA 以下	—	—
未评级	—	5,002,000.00
合计	—	5,002,000.00

注：1、未评级债券包括没有信用评级的国债、政策性金融债、央票等。

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

流动性风险是指在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风险。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、存出保证金、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 2016 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	19,813,477.85	-	-	-	-	19,813,477.85
结算备付金	14,281,333.61	-	-	-	-	14,281,333.61
存出保证金	159,291.83	-	-	-	-	159,291.83
交易性金融资产	-	-	-	-	3,645,427.74	3,645,427.74
买入返售金融资产	438,600,544.40	-	-	-	-	438,600,544.40
应收证券清算款	-	-	-	-	14,605.00	14,605.00
应收利息	-	-	-	-	193,626.26	193,626.26
应收申购款	-	-	-	-	499.40	499.40
资产总计	472,854,647.69	-	-	-	3,854,158.40	476,708,806.09
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	61,923.69	61,923.69
应付管理人报酬	-	-	-	-	545,121.68	545,121.68
应付托管费	-	-	-	-	77,874.52	77,874.52
应付交易费用	-	-	-	-	337,330.01	337,330.01
其他负债	-	-	-	-	181,648.69	181,648.69
负债总计	-	-	-	-	1,203,898.59	1,203,898.59
利率敏感度缺口	472,854,647.69	-	-	-	-	-
上年度末 2015 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	55,045,835.66	-	-	-	-	55,045,835.66
结算备付金	10,148,221.10	-	-	-	-	10,148,221.10
存出保证金	70,063.34	-	-	-	-	70,063.34
交易性金融资产	35,186,000.00	-	-	-	23,344,605.57	58,530,605.57
买入返售金融资产	367,500,000.00	-	-	-	-	367,500,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	10,559,984.48	10,559,984.48
应收利息	-	-	-	-	1,114,032.16	1,114,032.16
资产总计	467,950,120.10	-	-	-	35,018,622.21	502,968,742.31
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	6,898.55	6,898.55
应付管理人报酬	-	-	-	-	596,672.95	596,672.95
应付托管费	-	-	-	-	85,238.97	85,238.97
应付交易费用	-	-	-	-	164,606.66	164,606.66
其他负债	-	-	-	-	65,010.36	65,010.36
负债总计	-	-	-	-	918,427.49	918,427.49

利率敏感度缺口	467,950,120.10	-	-	-	-
---------	----------------	---	---	---	---

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（2016 年 6 月 30 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	市场利率增加 25 个基点	-	-3,929.37
	市场利率减少 25 个基点	-	3,939.34

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。

6.4.13.4.2 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。

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 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 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	3,645,427.74	0.77	23,344,605.57	4.65
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	35,186,000.00	7.01
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	3,645,427.74	0.77	58,530,605.57	11.66

6.4.13.4.3.2 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（2016 年 6 月 30 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	160,302.43	845,051.94
	沪深 300 指数下降 5%	-160,302.43	-845,051.94

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	3,645,427.74	0.76
	其中：股票	3,645,427.74	0.76
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	438,600,544.40	92.01
	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	34,094,811.46	7.15
7	其他各项资产	368,022.49	0.08
8	合计	476,708,806.09	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	2,100,136.96	0.44

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	274,240.28	0.06
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	70,492.40	0.01
J	金融业	1,180,432.00	0.25
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	20,126.10	0.00
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	3,645,427.74	0.77

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	002452	长高集团	100,300	1,205,606.00	0.25
2	000728	国元证券	70,600	1,180,432.00	0.25
3	601611	中国核建	13,109	274,240.28	0.06
4	300516	久之洋	1,473	258,025.41	0.05
5	601127	小康股份	6,947	165,824.89	0.03
6	603737	三棵树	1,327	154,038.16	0.03
7	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.02
8	300515	三德科技	1,354	63,461.98	0.01
9	300518	盛讯达	1,306	61,186.10	0.01
10	601966	玲珑轮胎	3,944	51,193.12	0.01
11	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.01
12	603958	哈森股份	2,372	34,394.00	0.01
13	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.01
14	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.00
15	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.00

16	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00
17	002805	丰元股份	971	5,631.80	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	002466	天齐锂业	8,492,610.29	1.69
2	002739	万达院线	7,929,824.41	1.58
3	300367	东方网力	7,898,601.33	1.57
4	300059	东方财富	7,758,661.00	1.55
5	300113	顺网科技	6,707,996.30	1.34
6	600030	中信证券	6,533,064.00	1.30
7	300078	思创医惠	6,440,620.00	1.28
8	300271	华宇软件	6,423,088.00	1.28
9	000728	国元证券	6,289,292.61	1.25
10	600519	贵州茅台	5,669,358.85	1.13
11	600000	浦发银行	5,250,398.75	1.05
12	300166	东方国信	5,235,840.44	1.04
13	300047	天源迪科	5,104,400.40	1.02
14	600016	民生银行	4,897,474.46	0.98
15	002308	威创股份	4,310,600.38	0.86
16	002530	丰东股份	4,245,267.60	0.85
17	601555	东吴证券	4,189,437.00	0.83
18	300188	美亚柏科	4,081,062.84	0.81
19	601799	星宇股份	4,063,980.00	0.81
20	600756	浪潮软件	4,059,113.00	0.81

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	002466	天齐锂业	9,062,669.26	1.81
2	300059	东方财富	7,875,709.41	1.57
3	300078	思创医惠	7,522,923.39	1.50
4	300367	东方网力	7,522,867.86	1.50

5	300113	顺网科技	7,509,291.34	1.50
6	002739	万达院线	6,618,549.12	1.32
7	600030	中信证券	6,482,699.94	1.29
8	600136	当代明诚	6,419,899.50	1.28
9	300271	华宇软件	6,146,870.94	1.22
10	600519	贵州茅台	5,888,886.50	1.17
11	000728	国元证券	5,301,390.36	1.06
12	300166	东方国信	5,256,021.08	1.05
13	600000	浦发银行	5,212,513.49	1.04
14	600016	民生银行	4,988,675.01	0.99
15	300047	天源迪科	4,627,609.20	0.92
16	002530	丰东股份	4,450,321.56	0.89
17	601799	星宇股份	4,392,423.42	0.87
18	601555	东吴证券	4,231,969.88	0.84
19	300339	润和软件	4,133,567.36	0.82
20	300389	艾比森	4,122,923.70	0.82

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	391,555,868.98
卖出股票收入（成交）总额	401,716,341.69

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

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

本基金本报告期末未持仓国债期货。

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

本基金本报告期末未持仓国债期货。

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	159,291.83
2	应收证券清算款	14,605.00
3	应收股利	-
4	应收利息	193,626.26
5	应收申购款	499.40
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	368,022.49

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	002452	长高集团	1,205,606.00	0.25	重大事项停牌
2	000728	国元证券	1,180,432.00	0.25	重大事项停牌
3	601966	玲珑轮胎	51,193.12	0.01	新股锁定

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
991	270,246.80	260,331,645.33	97.21%	7,482,931.02	2.79%

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	2,758.63	0.0010%

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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

注：截止本报告期末，本基金管理人从业人员投资、持有本基金符合相关法律法规、中国证监会规定及相关管理制度的规定。

§ 9 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	275,752,760.76
本报告期基金总申购份额	4,946,394.37
减：本报告期基金总赎回份额	12,884,578.78
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	267,814,576.35

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	
华泰证券	1	236,632,909.48	29.88%	220,377.07	29.88%	-
国信证券	2	198,549,604.53	25.07%	184,909.16	25.07%	-
银河证券	1	161,233,836.04	20.36%	150,157.19	20.36%	-
招商证券	1	122,876,081.77	15.52%	114,434.45	15.52%	-
中信证券	2	54,907,046.29	6.93%	51,134.64	6.93%	-
安信证券	2	9,603,436.26	1.21%	8,943.75	1.21%	-
中信建投	1	7,962,335.68	1.01%	7,415.32	1.01%	-
国泰君安	1	193,268.91	0.02%	179.98	0.02%	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
民生证券	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，并能为本基金提供全面的信息服；
- (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。本基金本报告期内向海通证券租用了一个基金专用交易单元，向海通证券退租了一个基金专用交易单元。

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
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	10,818,185.20	16.92%	2,342,500,000.00	26.46%	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	21,201,533.00	33.16%	5,651,000,000.00	63.83%	-	-
中信证券	-	-	631,500,000.00	7.13%	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国泰君安	31,914,772.70	49.92%	228,000,000.00	2.58%	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
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公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 1 月 4 日
2	华润元大基金管理有限公司关于指数熔断机制触发后公司旗下基金申购、赎回、转换及定投业务处理的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 1 月 4 日
3	华润元大基金管理有限公司关于指数熔断机制触发后公司旗下基金申购、赎回、转换及定投业务处理的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 1 月 7 日
4	华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金 2015 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	2016 年 1 月 20 日
5	华润元大基金管理有限公司更正公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 1 月 21 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、证券时报、基金管理人网站	2016 年 1 月 29 日

7	华润元大基金管理有限公司关于变更公司住所的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2016 年 2 月 27 日
8	华润元大基金管理有限公司关于同比例增加注册资本的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2016 年 2 月 27 日
9	华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金 2015 年年度报告	基金管理人网站	2016 年 3 月 29 日
10	华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金 2015 年年度报告摘要	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2016 年 3 月 29 日
11	华润元大基金管理有限公司关于调整旗下部分开放式基金申购、赎回、转换转出及最低持有份额的数额限制的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2016 年 4 月 8 日
12	华润元大基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加深圳富济财富管理有限公司为代销机构、开通定期定额投资和转换业务并参加其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	2016 年 4 月 19 日
13	华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金 2016 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	2016 年 4 月 20 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）（2016 年第 1 号）	基金管理人网站	2016 年 4 月 28 日
15	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（2016 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	2016 年 4 月 28 日
16	华润元大基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金对中信建投证券股份有限公司开通定期定额投资和转换业务并参加其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	2016 年 5 月 13 日
17	华润元大基金关于实施基金网上直销申购、定投及转换在通联支付渠道费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2016 年 6 月 24 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

2016 年 6 月 13 日，基金管理人股东元大证券投资信托股份有限公司法定代表人、董事长林武田于届龄退休，由黄古彬接任。

§ 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
2016 年 8 月 27 日