华润元大富时中国A50指数型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

2018年6月30日

基金管理人：华润元大基金管理有限公司
基金托管人：中国农业银行股份有限公司
送出日期：2018年8月25日

§ 1 重要提示

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2018年8月23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2018年1月1日起至6月30日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华润元大富时中国A50指数
基金主代码	000835
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年11月20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	309,314,231.20份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用被动式投资策略，通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准表现相当，以便为投资者带来长期收益。
投资策略	本基金采用完全复制法来跟踪富时中国A50指数，按照个股在标的指数中的基准权重构建股票组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。 当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，基金管理人会对投资组合进行适当调整，降低跟踪误差。 如有因受股票停牌、股票流动性或其他一些影响指数复制的市场因素的限制，使基金管理人无法依指数权重购买成份股，基金管理人可以根据市场情况，结合经验判断，对投资组合进行适当调整，以获得更接近标的指数的收益率。 定期调整：本基金股票组合根据所跟踪的富时中国A50指数对其成份股的调整而进行相应的定期跟踪调整。 不定期调整：根据指数编制规则，富时中国A50指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重新调整时，本基金将根据富时中国A50指数在股权变动公告日次日发布的临时调整决定及其需调整的权重比例，进行相应调整。 本基金将采用货币市场工具对基金资产进行流动性管理。在满足安全性和保证流动性的基础上，本基金将结合宏观分析和微观分析制定投资策略，有效利用基金资产，更好地实现跟踪标的指数的投资目标。同时，根据本基金的申购和赎回情况，对股票投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数。 本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品，以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。此外，本基金还将运用股指期货来对冲特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理，如预期大额申购赎回、大量分红等，以及对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险。 在正常市场情况下，本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.3%，年跟踪误差不超过4%。
业绩比较基准	富时中国A50指数收益率× 95%+ 银行活期存款收益率(税后)× 5%。
风险收益特征	本基金属于股票型基金，属于证券投资基金中中等预期风险、中等预期收益的投资品种。一般情况下，其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金。

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	刘豫皓	贺倩
	联系电话	0755-88399015	010-66060069
	电子邮箱	lyh@cryuantafund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4000-1000-89	95599
传真		0755-88399045	010-68121816

2.4 信息披露方式

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

§ 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(2018年1月1日 - 2018年6月30日)
本期已实现收益	11,304,143.02
本期利润	-68,263,954.37
加权平均基金份额本期利润	-0.2501
本期基金份额净值增长率	-9.95%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.5832
期末基金资产净值	489,717,294.34
期末基金份额净值	1.583

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。

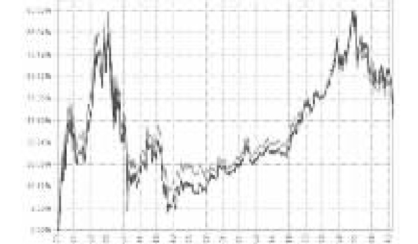
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等)，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-4.92%	1.23%	-5.84%	1.23%	0.92%	0.00%
过去三个月	-6.83%	1.19%	-7.91%	1.19%	1.08%	0.00%
过去六个月	-9.95%	1.19%	-11.58%	1.23%	1.63%	-0.04%
过去一年	6.74%	1.01%	1.12%	1.03%	5.62%	-0.02%
过去三年	-0.88%	1.38%	-8.21%	1.34%	7.33%	0.04%
自基金合同生效起至今	58.30%	1.60%	52.90%	1.57%	5.40%	0.03%

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



§ 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2018年6月30日，本基金管理人共管理十二只开放式基金：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，华润元大稳健收益债券型证券投资基金，华润元大中创100交易型开放式指数证券投资基金联接基金，华润元大现金通货币市场基金，华润元大润鑫债券型证券投资基金，华润元大润泰双鑫债券型证券投资基金，华润元大润泽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		
李武群	指数投资部副总经理、华润元大中创100交易型开放式指数证券投资基金基金经理、华润元大中创100交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、华润元大富时中国A50指数型证券投资基金基金经理	2017年8月2日	-	9年	曾任中信银行福州分行统计分析岗、华西证券股份有限公司研究所高级研究员和股票投资部投资经理助理，2016年4月20日起担任华润元大中创100交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2016年7月20日起担任华润元大中创100交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2017年8月2日起担任华润元大富时中国A50指数型证券投资基金基金经理。中国，中国科学院研究生院微电子学与固体电子学博士，具有基金从业资格。
石武斌	华润元大富时中国A50指数型证券投资基金基金经理、华润元大医疗保健量化混合型证券投资基金基金经理、华润元大信息传媒科技混合型证券投资基金基金经理	2016年4月22日	-	6年	曾任国海证券股份有限公司证券资产管理分公司量化投资研究员，2016年4月22日起担任华润元大富时中国A50指数型证券投资基金基金经理，2016年8月5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，2017年8月1日起担任华润元大信息传媒科技混合型证券投资基金基金经理。中国，中国人民大学概率论与数理统计硕士，具有基金从业资格。

注：① 上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

② 证券从业的含义遵从行业协会《证券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遵规守信情况的说明

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

2018年上半年A股市场各主要指数均呈现震荡下行走势，以富时中国A50指数为代表的大盘蓝筹板块一月份连续上涨后见顶，随后经历了几次较快较深的估值回调，以中小板和创业板为代表的小盘成长股板块盘二月份有一波较快的反弹行情，但随后经历了较大幅度的回调，指数屡创新低，市场情绪极为低迷。上半年，创业板指数下跌8.33%，中小板指数下跌14.26%，上证综指下跌13.90%，沪深300指数下跌12.90%，上证50指数下跌13.30%，中创100指数下跌12.55%。中信一级29个行业餐饮旅游(10.15%)、医药(4.46%)、食品饮料(1.82%)板块走势较强，涨幅较大；而电力设备(-27.00%)、通信(-26.66%)、综合(-32.12%)板块走势明显较弱，跌幅居前。

本基金作为被动指数型基金，报告期内，本基金采用完全复制法紧密跟踪富时中国A50指数，少数关联方股票用同行业的大盘绩优价值股做替代，同时进行新股申购。

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1.583元，本报告期份额净值增长率为-9.95%，同期业绩比较基准收益率为-11.58%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金跟踪的标的指数——富时中国A50指数，是由沪深两市中市场资本总值最大的50只股票组成，它综合反映A股市场中大型龙头企业的运行状况。A50指数成分股以价值型的大市值股票为主，所属行业主要集中在大金融板块，其估值水平普遍较低，在中国经济长期向好的大背景下，大型龙头企业依然有不错的增长空间，极具长期投资价值。

本基金作为一只被动投资管理产品，我们将继续秉承指数化被动投资策略，努力将跟踪误差控制在基金合同规定的范围内，力争为投资者带来较好的投资回报。

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2018年1月1日至2018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：华润元大富时中国A50指数型证券投资基金
报告截止日：2018年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资产：			
银行存款		28,193,142.30	10,803,699.56
结算备付金		19,758,918.05	923,320.87
存出保证金		226,685.45	77,510.82
交易性金融资产		443,137,060.85	254,921,487.13
其中：股票投资		443,137,060.85	248,219,264.53
基金投资		-	-
债券投资		-	6,702,222.60
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		-	1,867,836.29
应收利息		6,097.48	166,516.21
应收股利		-	-
应收申购款		190,401.21	710,546.14
递延所得税资产		-	-
其他资产		129,140.58	-
资产总计		491,641,445.92	269,470,917.02
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		2,948.78	-
应付赎回款		1,194,867.89	6,046,161.02
应付管理人报酬		259,421.00	133,333.41
应付托管费		64,855.28	33,333.35
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		76,573.90	167,786.30
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		325,484.73	625,696.88
负债合计		1,924,151.58	7,006,310.96
所有者权益：			
实收基金		309,314,231.20	149,300,324.17
未分配利润		180,403,063.14	113,164,281.89
所有者权益合计		489,717,294.34	262,464,606.06
负债和所有者权益总计		491,641,445.92	269,470,917.02

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额净值1.583元，基金份额总额309,314,231.20份。

6.2 利润表

会计主体：华润元大富时中国A50指数型证券投资基金
本报告期：2018年1月1日至2018年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入		-65,246,982.06	14,018,499.54
1.利息收入		174,378.88	61,412.83
其中：存款利息收入	6.4.7.11	106,445.17	8,051.41
债券利息收入		67,933.71	51,864.77
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	1,496.65
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		13,532,813.48	144,215.69
其中：股票投资收益	6.4.7.12	9,390,675.54	-794,080.92
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	10,015.10	142.30
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-1,275,660.00	-
股利收益	6.4.7.16	5,407,782.84	938,154.31
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	6.4.7.17	-79,568,097.39	13,796,620.01
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	613,922.97	16,251.01
减：二、费用		3,016,972.31	663,678.74
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,411,128.14	288,957.88
2. 托管费	6.4.10.2.2	352,782.02	72,239.52
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	934,754.06	54,740.70
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	318,308.09	247,740.64
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-68,263,954.37	13,354,820.80
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-68,263,954.37	13,354,820.80

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：华润元大富时中国A50指数型证券投资基金
本报告期：2018年1月1日至2018年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018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)	149,300,324.17	113,164,281.89	262,464,606.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-68,263,954.37	-68,263,954.37
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)	160,013,907.03	135,502,735.62	295,516,642.65
其中：1.基金申购款	437,505,518.97	363,651,449.31	801,156,968.28
2.基金赎回款	-277,491,611.94	-228,148,713.69	-505,640,325.63
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)	309,314,231.20	180,403,063.14	489,717,294.34
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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)	75,783,816.23	22,206,315.25	97,990,131.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	13,354,820.80	13,354,820.80
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)	-9,011,291.35	-3,310,457.52	-12,321,748.87
其中：1.基金申购款	6,324,110.24	2,452,757.11	8,776,867.35
2.基金赎回款	-15,335,401.59	-5,763,214.63	-21,098,616.22
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)	66,772,524.88	32,250,678.53	99,023,203.41

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：

______ 孙晔伟 ______ ______ 黄晓芳 ______ ______ 黄晓芳 ____

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

华润元大富时中国A50指数型证券投资基金(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[2014]989号《关于核准华润元大富时中国A50指数型证券投资基金注册的批复》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《华润元大富时中国A50指数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2014年10月27日至2014年11月14日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集714,505,762.47元，经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明(2014)验字第61032987_H08号验资报告。经向中国证监会备案，《华润元大富时中国A50指数型证券投资基金基金合同》于2014年11月20日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为714,621,124.13份基金份额，其中认购资金利息折合115,361.66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《华润元大富时中国A50指数型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、债券、资产支持证券、货币市场工具、银行存款、权证、股指期货等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的相关规定)。其中，本基金投资于标的指数的成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产的90%，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，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金业绩比较基准为：富时中国A50指数收益率X95%+银行活期存款收益率(税后)X5%。

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2018年6月30日的财务状况以及自2018年1月1日至2018年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

-

6.4.5.2 会计估计变更的说明

-

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的重大会计差错更正。

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。

(2)增值税及附加、企业所得税

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以及金融同业往来利息收入免征增值税。金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务、买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为(以下称资管产品运营业务)，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。管理人应分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额。未分别核算的，资管产品运营业务不得适用于简易计税方法。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让2017年12月31日前取得的股票(不包括限售股)、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的股票收盘价(2017年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价)、债券估值(中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值)、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按7%、3%和2%的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

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。

(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，暂减按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。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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

本基金本报告期内，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

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。

6.4.8.1 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。

金额单位：人民币元

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,411,128.14	288,957.88
其中：支付销售机构的客户维护费	839,229.30	169,464.91

注：(1) 基金管理费按前一日的基金资产净值的0.6%的年费率计提，按月支付。日管理费 = 前一日基金资产净值× 0.6%÷ 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。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	352,782.02	72,239.52

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.15%的年费率计提，按月支付。日托管费 = 前一日基金资产净值× 0.15%÷ 当年天数。

6.4.8.2.3 销售服务费

-

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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。

6.4.8.4.2 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

报告期末除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金。

6.4.8.5 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 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	28,193,142.30	96,324.72	1,947,792.15	7,806.37

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。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末(2018年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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

6.4.9.1.1 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
603693	江苏新能	2018年6月25日	2018年7月3日	新股流通受限	9.00	9.00	5,384	48,456.00	48,456.00	-
603706	东方环宇	2018年6月29日	2018年7月9日	新股流通受限	13.09	13.09	1,765	23,103.85	23,103.85	-
603105	芯能科技	2018年6月29日	2018年7月9日	新股流通受限	4.83	4.83	3,481	16,813.23	16,813.23	-

6.4.9.2 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
601390	中国中铁	2018年5月7日	重大资产重组停牌	7.47	2018年8月20日	7.25	498,200	4,207,589.44	3,721,554.00	-

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 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。

6.4.9.3.2 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。

6.4.10 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	443,137,060.85	90.13
	其中：股票	443,137,060.85	90.13
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	47,952,060.35	9.75
7	其他各项资产	552,324.72	0.11
8	合计	491,641,445.92	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	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	13,511,701.00	2.76
C	制造业	154,165,183.27	31.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,872,324.27	1.20
E	建筑业	13,510,759.41	2.76
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,634,571.72	0.33
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,404,148.00	0.70
J	金融业	219,519,716.64	44.83
K	房地产业	25,573,700.00	5.22
L	租赁和商务服务业	5,863,730.40	1.20
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	81,226.14	0.02
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	443,137,060.85	90.49

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

-

7.3 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

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	601318	中国平安	835,470	48,941,832.60	9.99
2	600519	贵州茅台	40,600	29,697,276.00	6.06
3	600036	招商银行	1,066,416	28,196,039.04	5.76
4	601398	工商银行	4,015,201	21,360,869.32	4.36
5	000333	美的集团	356,500	18,616,430.00	3.80
6	000651	格力电器	386,103	18,204,756.45	3.72
7	601166	兴业银行	1,256,300	18,090,720.00	3.69
8	600016	民生银行	2,151,900	15,063,300.00	3.08
9	000002	万 科A	586,900	14,437,740.00	2.95
10	600887	伊利股份	453,000	12,638,700.00	2.58

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的年度报告正文。

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	601318	中国平安	53,109,209.33	20.23
2	600036	招商银行	30,428,348.14	11.59
3	600519	贵州茅台	25,511,222.42	9.72
4	601398	工商银行	24,407,696.36	9.30
5	000651	格力电器	22,822,869.34	8.70
6	601166	兴业银行	20,302,163.00	7.74
7	000333	美的集团	17,511,132.23	6.67
8	000002	万 科A	17,424,354.95	6.64
9	600016	民生银行	16,112,170.82	6.14
10	600000	浦发银行	14,936,384.48	5.69
11	600887	伊利股份	13,156,636.81	5.01
12	600030	中信证券	12,116,934.75	4.62
13	000858	五 粮 液	10,784,550.00	4.11
14	601328	交通银行	10,783,042.00	4.11
15	601668	中国建筑	9,213,049.00	3.51
16	000725	京东方A	9,199,997.00	3.51
17	600276	恒瑞医药	9,149,187.59	3.49
18	002415	海康威视	8,947,933.67	3.41
19	600104	上汽集团	8,787,759.85	3.35
20	600048	保利地产	8,694,840.00	3.31
21	601601	中国太保	7,872,117.15	3.00
22	601169	北京银行	7,712,178.00	2.94
23	002027	分众传媒	7,487,656.82	2.85
24	601988	中国银行	7,411,521.00	2.82
25	000001	平安银行	7,233,038.55	2.76
26	601766	中国中车	6,646,882.00	2.53
27	601939	建设银行	6,349,762.00	2.42
28	600837	海通证券	6,189,133.00	2.36
29	600585	海螺水泥	5,615,484.00	2.14

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	601318	中国平安	24,357,226.77	9.28
2	600036	招商银行	13,472,645.16	5.13
3	600519	贵州茅台	11,295,449.29	4.30
4	601398	工商银行	9,864,929.00	3.76
5	601166	兴业银行	9,048,091.00	3.45
6	600837	海通证券	8,348,732.73	3.18
7	000333	美的集团	7,600,509.80	2.90
8	000002	万 科A	7,261,817.97	2.77
9	600016	民生银行	6,723,056.00	2.56
10	600000	浦发银行	6,589,882.00	2.51
11	600887	伊利股份	5,995,905.00	2.28
12	600030	中信证券	5,341,392.80	2.04
13	601688	华泰证券	5,249,141.00	2.00
14	600276	恒瑞医药	5,211,448.00	1.99
15	000776	广发证券	4,907,401.60	1.87
16	000858	五 粮 液	4,792,545.70	1.83
17	601328	交通银行	4,718,040.00	1.80
18	601186	中国铁建	4,456,216.41	1.70
19	600104	上汽集团	4,159,487.00	1.58
20	601668	中国建筑	4,055,609.00	1.55

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	490,507,172.75
卖出股票收入(成交)总额	225,407,192.28

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

本基金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

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前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

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

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

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
公允价值变动总额合计(元)					-
股指期货投资本期收益(元)					-1,275,660.00
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-

注：本基金本报告期末未持仓股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

报告期内，本基金未持仓股指期货。

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

本基金本报告期末未持仓国债期货。

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没有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

本报告期内本基金投资的前十名股票未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	226,685.45
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,097.48
5	应收申购款	190,401.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	129,140.58
8	其他	-
9	合计	552,324.72

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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
13,313	23,234.00	16,344,507.78	5.28%	292,969,723.42	94.72%

8.3 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	22,468.53	0.0073%

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。

8.4 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
本基金基金经理持有本开放式基金	0

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11月20日)基金份额总额	714,621,124.13
本报告期期初基金份额总额	149,300,324.17
本报告期基金总申购份额	437,505,518.97
减：本报告期基金总赎回份额	277,491,611.94
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	309,314,231.20

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，本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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

基金管理人于2018年6月21日发布《华润元大基金管理有限公司改聘会计师事务所公告》，将会计师事务所由德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)改聘为安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)。

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到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	
招商证券	1	243,144,086.15	34.04%	226,449.71	35.09%	-
中信证券	2	209,725,664.24	29.36%	195,317.00	30.27%	-
华泰证券	1	155,233,367.83	21.73%	144,569.80	22.40%	-
兴业证券	1	94,385,851.90	13.21%	69,026.91	10.70%	-
海通证券	1	5,143,590.82	0.72%	3,761.49	0.58%	-
银河证券	1	3,471,043.62	0.49%	3,232.31	0.50%	-
国融证券	1	2,343,394.82	0.33%	2,182.43	0.34%	-
安信证券	2	832,642.57	0.12%	775.52	0.12%	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-

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。本基金本报告期分别新增了一个兴业证券的沪市基金专用交易单元和一个国融证券的沪市基金专用交易单元。

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
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国融证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

无。

华润元大基金管理有限公司
2018年8月25日