

华润元大润泰双鑫债券型证券投资基金

2018年半年度报告摘要

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

1.1 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。

基金管理人华润元大基金管理有限公司根据基金合同规定,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。

本报告中期财务资料未经审计。
本报告自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 基金基本情况

Table with 2 columns: Item and Value. Includes fund name, code, type, and dates.

2.2 基金产品说明

1. 基金名称
2. 基金管理人
3. 基金托管人
4. 基金投资目标

5. 基金投资策略
6. 基金业绩比较基准
7. 基金风险等级

8. 基金费用
9. 基金收益分配原则
10. 基金销售机构

11. 基金管理人承诺
12. 基金托管人承诺

13. 基金合同生效
14. 基金合同变更

15. 基金合同终止
16. 基金合同其他事项

17. 基金管理人承诺
18. 基金托管人承诺

19. 基金合同生效
20. 基金合同变更

21. 基金合同终止
22. 基金合同其他事项

23. 基金管理人及基金托管人
24. 基金管理人

25. 基金托管人
26. 基金管理人

27. 基金管理人
28. 基金管理人

29. 基金管理人
30. 基金管理人

31. 基金管理人
32. 基金管理人

33. 基金管理人
34. 基金管理人

35. 基金管理人
36. 基金管理人

37. 基金管理人
38. 基金管理人

39. 基金管理人
40. 基金管理人

41. 基金管理人
42. 基金管理人

43. 基金管理人
44. 基金管理人

45. 基金管理人
46. 基金管理人

47. 基金管理人
48. 基金管理人

49. 基金管理人
50. 基金管理人

51. 基金管理人
52. 基金管理人

Table with 4 columns: Item, Unit, 2018年1月1日至2018年6月30日, 2017年1月1日至2017年6月30日. Includes asset and liability items.

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 管理人报告期内本基金运作遵守信用的说明
4.3 管理人报告期内本基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4 报告期内本基金投资策略和运作分析
2018年上半年国内经济企稳, GDP同比增长6.8%,较去年同期下降0.1个百分点。

2018年上半年国内经济企稳, GDP同比增长6.8%,较去年同期下降0.1个百分点。固定资产投资增速连续下降,从年初的7.9%下降至6月的6.0%。

虽然房地产开发投资保持平稳,制造业投资反弹,但是基建投资增速的快速回落仍然拉低了固定资产投资,1-6月工业增加值累计同比增速6.7%,较去年同期下降0.2个百分点。

消费萎靡不振,全社会消费品零售总额累计同比增速较去年同期下降了1.1个百分点。社融增速不断下滑,6月份社融增速已连续跌破10%关口。

货币政策方面,上半年央行还将进一步在中性偏紧转向中性偏松。央行进行了三次降准,共释放约1.65万亿的资金。

在货币宽松、紧信用背景下,长端利率率先表现抢眼。半年末10年期国债到期收益率分别比年初低40BP和57BP。

3年期AA级中期票据和AA级中期票据分别比年初上升65BP和25BP。上半年本基金在纯债资产上主要配置短久期的政策性银行债。

同时配置了较大比例的可转债,可转债以券商、银行股板块为主。下半年我们将密切跟踪经济运行情况,在大类资产配置上,尽可能增厚产品的收益。

4.2 报告期内基金的业绩表现
报告期内,A类基金的净值收益率为-8.51%,同期业绩比较基准收益率为3.87%。

4.3 管理人对外宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
展望2018年下半年,经济基本面仍处于内部动能不足、外部贸易支持持续的状态之下。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析
根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华润元大润泰双鑫债券型证券投资基金合同》的规定。

4.5 报告期内基金的投资策略和运作分析
根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华润元大润泰双鑫债券型证券投资基金合同》的规定。

4.6 报告期内基金的投资策略和运作分析
根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华润元大润泰双鑫债券型证券投资基金合同》的规定。

4.7 报告期内基金的投资策略和运作分析
根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华润元大润泰双鑫债券型证券投资基金合同》的规定。

4.8 报告期内基金的投资策略和运作分析
根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华润元大润泰双鑫债券型证券投资基金合同》的规定。

4.9 报告期内基金的投资策略和运作分析
根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华润元大润泰双鑫债券型证券投资基金合同》的规定。

4.10 报告期内基金的投资策略和运作分析
根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华润元大润泰双鑫债券型证券投资基金合同》的规定。

4.11 报告期内基金的投资策略和运作分析
根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华润元大润泰双鑫债券型证券投资基金合同》的规定。

4.12 报告期内基金的投资策略和运作分析
根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华润元大润泰双鑫债券型证券投资基金合同》的规定。

4.13 报告期内基金的投资策略和运作分析
根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华润元大润泰双鑫债券型证券投资基金合同》的规定。

4.14 报告期内基金的投资策略和运作分析
根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华润元大润泰双鑫债券型证券投资基金合同》的规定。

4.15 报告期内基金的投资策略和运作分析
根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华润元大润泰双鑫债券型证券投资基金合同》的规定。

4.16 报告期内基金的投资策略和运作分析
根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华润元大润泰双鑫债券型证券投资基金合同》的规定。

4.17 报告期内基金的投资策略和运作分析
根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华润元大润泰双鑫债券型证券投资基金合同》的规定。

4.18 报告期内基金的投资策略和运作分析
根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华润元大润泰双鑫债券型证券投资基金合同》的规定。

单位:人民币元
项目 期初 2018年1月1日至2018年6月30日 2017年1月1日至2017年6月30日

Table with 4 columns: Item, Unit, 2018年1月1日至2018年6月30日, 2017年1月1日至2017年6月30日. Includes asset and liability items.

6.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:华润元大润泰双鑫债券型证券投资基金
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 2018年1月1日 2018年6月30日 2017年1月1日 2017年6月30日

一、期初所有者权益(基金净值) 28,008,599.21 -519,150.15 28,007,449.06

二、本期综合收益总额 1,968,945.31 40,943.82 -5,807,401.49

三、本期基金份额持有人申购、赎回及转换等产生的基金份额变动 -1,968,945.31 40,943.82 -5,807,401.49

四、本期基金份额持有人申购、赎回及转换等产生的基金份额变动 125,019.24 -3,638.81 121,380.43

五、本期基金份额持有人申购、赎回及转换等产生的基金份额变动 -10,991,863.55 433,676.03 -9,988,187.52

六、本期基金份额持有人申购、赎回及转换等产生的基金份额变动 18,639,753.90 -1,086,921.35 18,746,635.25

七、本期基金份额持有人申购、赎回及转换等产生的基金份额变动 275,288,714.53 - 275,288,714.53

八、本期基金份额持有人申购、赎回及转换等产生的基金份额变动 -226,142,269.27 -610,945.19 -226,753,214.46

九、本期基金份额持有人申购、赎回及转换等产生的基金份额变动 -241,433,065.62 54,689.25 20,783,739.90

十、本期基金份额持有人申购、赎回及转换等产生的基金份额变动 -206,433,902.62 -855,544.44 -207,289,447.06

十一、本期基金份额持有人申购、赎回及转换等产生的基金份额变动 58,128,482.26 630,627.73 58,759,109.99

十二、本期基金份额持有人申购、赎回及转换等产生的基金份额变动 275,288,714.53 - 275,288,714.53

十三、本期基金份额持有人申购、赎回及转换等产生的基金份额变动 -226,142,269.27 -610,945.19 -226,753,214.46

十四、本期基金份额持有人申购、赎回及转换等产生的基金份额变动 -241,433,065.62 54,689.25 20,783,739.90

十五、本期基金份额持有人申购、赎回及转换等产生的基金份额变动 -206,433,902.62 -855,544.44 -207,289,447.06

十六、本期基金份额持有人申购、赎回及转换等产生的基金份额变动 58,128,482.26 630,627.73 58,759,109.99

十七、本期基金份额持有人申购、赎回及转换等产生的基金份额变动 275,288,714.53 - 275,288,714.53

十八、本期基金份额持有人申购、赎回及转换等产生的基金份额变动 -226,142,269.27 -610,945.19 -226,753,214.46

十九、本期基金份额持有人申购、赎回及转换等产生的基金份额变动 -241,433,065.62 54,689.25 20,783,739.90

二十、本期基金份额持有人申购、赎回及转换等产生的基金份额变动 -206,433,902.62 -855,544.44 -207,289,447.06

二十一、本期基金份额持有人申购、赎回及转换等产生的基金份额变动 58,128,482.26 630,627.73 58,759,109.99

二十二、本期基金份额持有人申购、赎回及转换等产生的基金份额变动 275,288,714.53 - 275,288,714.53

二十三、本期基金份额持有人申购、赎回及转换等产生的基金份额变动 -226,142,269.27 -610,945.19 -226,753,214.46

发生变化。
6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各方关联方

Table with 2 columns: 关联方名称, 与本基金的关联关系. Lists related parties and their relationships.

注:以下关联交易均在正常业务范围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。
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 2018年1月1日至2018年6月30日 2017年1月1日至2017年6月30日

基金管理费 76,511.59 287,452.97

注:(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的0.7%的年费率计提,按月支付。
(2) 托管费(支付)按前一日基金资产净值×0.2%÷当年天数。

6.4.8.2.2 销售服务费
单位:人民币元
项目 2018年1月1日至2018年6月30日 2017年1月1日至2017年6月30日

销售服务费 44,349.82 153,153.81

注:本基金管理费按前一日基金资产净值的0.7%的年费率计提,按月支付。
托管费(支付)按前一日基金资产净值×0.2%÷当年天数。

6.4.8.2.3 销售服务费
单位:人民币元
项目 2018年1月1日至2018年6月30日 2017年1月1日至2017年6月30日

销售服务费 44,349.82 153,153.81

注:支付基金销售机构的销售服务费按前一日对应级别基金资产净值的约定费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给华润元大基金管理有限公司。

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
6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人以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以外的其他关联方持有本基金的情况
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
项目 2018年1月1日至2018年6月30日 2017年1月1日至2017年6月30日

银行存款 834,987.81 2,703.04 7,347,827.22 45,094.61

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
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
6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票
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
7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况
单位:人民币元
项目 金额 占基金资产净值比例(%)

1 权益投资 280,675.00 1.68

2 固定收益 280,675.00 1.68

3 金融衍生品 15,399,342.20 91.68

4 买入返售金融资产 - -

5 其他资产 - -

6 负债 - -

7 未分配利润 1,102,444.88 6.54

8 其他 - -

9 其他 - -

10 其他 - -

11 其他 - -

12 其他 - -

13 其他 - -

14 其他 - -

15 其他 - -

16 其他 - -

17 其他 - -

18 其他 - -

19 其他 - -

20 其他 - -

21 其他 - -

22 其他 - -

23 其他 - -

24 其他 - -

25 其他 - -

26 其他 - -

27 其他 - -

28 其他 - -

29 其他 - -

30 其他 - -

31 其他 - -

32 其他 - -

33 其他 - -

34 其他 - -

35 其他 - -

36 其他 - -

37 其他 - -

38 其他 - -

39 其他 - -

40 其他 - -

41 其他 - -

42 其他 - -

43 其他 - -

44 其他 - -

45 其他 - -

46 其他 - -

47 其他 - -

48 其他 - -

49 其他 - -

50 其他 - -

51 其他 - -

52 其他 - -

53 其他 - -

54 其他 - -

55 其他 - -

56 其他 - -

57 其他 - -

58 其他 - -

59 其他 - -

60 其他 - -

61 其他 - -

62 其他 - -

63 其他 - -

64 其他 - -

65 其他 - -

66 其他 - -

67 其他 - -

68 其他 - -

69 其他 - -

70 其他 - -

71 其他 - -

72 其他 - -

73 其他 - -

74 其他 - -

75 其他 - -

76 其他 - -

77 其他 - -

78 其他 - -

79 其他 - -

80 其他 - -

81 其他 - -

82 其他 - -

83 其他 - -

84 其他 - -

85 其他 - -

86 其他 - -

87 其他 - -

88 其他 - -

89 其他 - -

90 其他 - -

91 其他 - -

92 其他 - -

93 其他 - -

94 其他 - -

95 其他 - -

96 其他 - -

97 其他 - -

98 其他 - -

99 其他 - -

100 其他 - -

101 其他 - -

102