

华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金

[2015] 第二季度报告

基金管理人:华润元大基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

报告送出日期:2015年7月18日

基金管理人的董事会及高级管理人员声明:本基金不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性、完整性和及时性承担个别及连带责任。

基金托管人:中国农业银行股份有限公司根据基金合同约定,于2015年7月17日复核了本报告期内的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期中财务资料未经审计。

本报告期自2015年4月1日起至30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 华润元大安鑫灵活配置混合

交易代码 000273

基金运作方式 灵活配置型开放式

基金份额净值 2014年9月18日 1.00

报告期末基金份额总额 236,374,099.58份

基金资产净值 2015年6月30日 26,236,886.26元

基金份额净值增长率 2015年6月30日 3.94%

过去一个月 2015年6月30日 3.94%

成立以来收益率 2014年9月18日 1.00%

报告期利润 2015年4月1日至6月30日 5,341,647.14元

净值报酬率 2015年6月30日 20.43%

资产净值 2015年6月30日 213,751,258.19元

5.5 基金份额净值增长率

注:1.本报告期已实现收益指基金本期已实现收入,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),计算费用后实际收益水平将低于所列数字。

3.基金销售费用

本基金将运用“价值成长”的投资策略来选定具体选股标准。该策略通过建立统一的价值评估标准,结合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的低估股票。同时,本基金将结合大盘指数的稳定性,持续性与成长性,通过精细化风险管理和技术化技术,实现行业风格类资产的均衡配置,从而实现风险收益后的最大收益。

3.2 投资策略

本基金将采取“价值成长”的投资策略进行合理的配置,并在配置过程中实行针对性的择时选择。

4.杠杆投资策略

本基金将通过投资于股票型基金、债券型基金以及货币市场基金,以寻找具有增长潜力且价格合理的低估股票。同时,本基金将结合大盘指数的稳定性,持续性与成长性,通过精细化风险管理和技术化技术,实现行业风格类资产的均衡配置,从而实现风险收益后的最大收益。

5.股票投资策略

本基金将投资于股票型基金,以把握股票型基金的投资机会,从而实现风险收益后的最大收益。

6.债券投资策略

本基金将运用“价值成长”的投资策略来选定具体选股标准。该策略通过建立统一的价值评估标准,结合上市公司的增长潜力和市场估值水平,以寻找具有增

长潜力且价格合理的低估股票。同时,本基金将结合大盘指数的稳定性,持续性与成长性,通过精细化风险管理和技术化技术,实现行业风格类资产的均衡配

置,从而实现风险收益后的最大收益。

7.其他资产

100,099,667.97元

8.合计 513,704,892.79元

100.00%

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号 行业类别 公允价值(元) 占基金资产的比例(%)

A 农、林、牧、渔业 -

B 制造业 12,707,468.34 2.94%

C 动力、热力、燃气及水生产和供应业 -

D 建筑业 -

E 钢铁、有色、化工及塑料、橡胶和印染浆业 -

F 电子通信设备、计算机、办公设备、家具、家电 -

G 化工、石油、石化、铁路、航空、汽车、公路、航运、港口 -

H 食品、饮料和烟草 -

I 信息传输、软件和信息技术服务业 2,060,095.92 0.68%

J 金融、租赁和商务服务业 4,569,325.00 1.06%

K 地产业 -

L 批发和零售业 -

M 科学研究、技术服务及地质勘查业 -

N 水利、环境和公共设施管理业 -

O 国防、武警、修理、其他服务业 -

P 教育 -

Q 医疗保健业 -

R 文化、体育和娱乐业 -

S 综合 10,605,227.70 2.41%

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号 股票代码 股票名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 002390 信邦制药 225,000.00 0.93%

2 300039 上海凯宝 200,000.00 0.72%

3 601939 设计总院 369,200.00 0.61%

4 000725 京东方A 500,000.00 0.60%

5 001988 中银绒业 396,100.00 0.45%

6 300085 锦江之星 20,000.00 0.33%

7 002354 天神娱乐 8,800.00 0.33%

8 300047 天源迪科 28,000.00 0.16%

9 600652 四川科华 10,900.00 0.15%

10 600008 中国国电 16,200.00 0.13%

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号 债券代码 债券名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 100001 信邦制药 4,023,000.00 1.54%

2 100001 信邦制药 3,110,000.00 1.17%

3 100001 信邦制药 2,632,396.00 0.96%

4 100001 信邦制药 2,595,000.00 0.93%

5 100001 信邦制药 1,936,929.00 0.71%

6 100001 信邦制药 1,434,600.00 0.53%

7 100001 信邦制药 1,300,000.00 0.49%

8 100001 信邦制药 1,250,000.00 0.46%

9 100001 信邦制药 1,200,000.00 0.45%

10 100001 信邦制药 1,150,000.00 0.43%

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资明细

序号 贵金属代码 贵金属名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000001 金 100,000.00 0.04%

2 000001 银 100,000.00 0.04%

3 000001 铂 100,000.00 0.04%

4 000001 钯 100,000.00 0.04%

5 000001 铂 100,000.00 0.04%

6 000001 铂 100,000.00 0.04%

7 000001 铂 100,000.00 0.04%

8 000001 铂 100,000.00 0.04%

9 000001 铂 100,000.00 0.04%

10 000001 铂 100,000.00 0.04%

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权重股投资明细

序号 股票代码 股票名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 002390 信邦制药 225,000.00 0.93%

2 300039 上海凯宝 200,000.00 0.72%

3 601939 设计总院 369,200.00 0.61%

4 000725 京东方A 500,000.00 0.60%

5 001988 中银绒业 396,100.00 0.45%

6 300085 锦江之星 20,000.00 0.33%

7 002354 天神娱乐 8,800.00 0.33%

8 300047 天源迪科 28,000.00 0.16%

9 600652 四川科华 10,900.00 0.15%

10 600008 中国国电 16,200.00 0.13%

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

序号 权证代码 权证名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000001 信邦制药 100,000.00 0.04%

2 000001 信邦制药 100,000.00 0.04%

3 000001 信邦制药 100,000.00 0.04%

4 000001 信邦制药 100,000.00 0.04%

5 000001 信邦制药 100,000.00 0.04%

6 000001 信邦制药 100,000.00 0.04%

7 000001 信邦制药 100,000.00 0.04%

8 000001 信邦制药 100,000.00 0.04%

9 000001 信邦制药 100,000.00 0.04%

10 000001 信邦制药 100,000.00 0.04%

5.8 备查文件目录

1.中国证监会准予基金募集注册的文件;

2.基金合同和基金招募说明书;

3.基金托管协议;

4.基金代销协议;

5.基金定期报告、半年度报告和年度报告;

6.临时公告及基金暂停连续销售的公告;

7.基金转换份额公告;

8.基金巨额赎回公告;

9.基金暂停申购及重新开放公告;

10.基金实施侧袋机制公告;

11.基金分红公告;

12.基金折算公告;

13.基金扩募、延长募集期限公告;

14.基金转换费率调整公告;

15.基金投资组合报告;

16.基金定期报告中主要财务指标及基金净值表现;

17.基金半年度报告和年度报告中主要财务指标及基金净值表现;