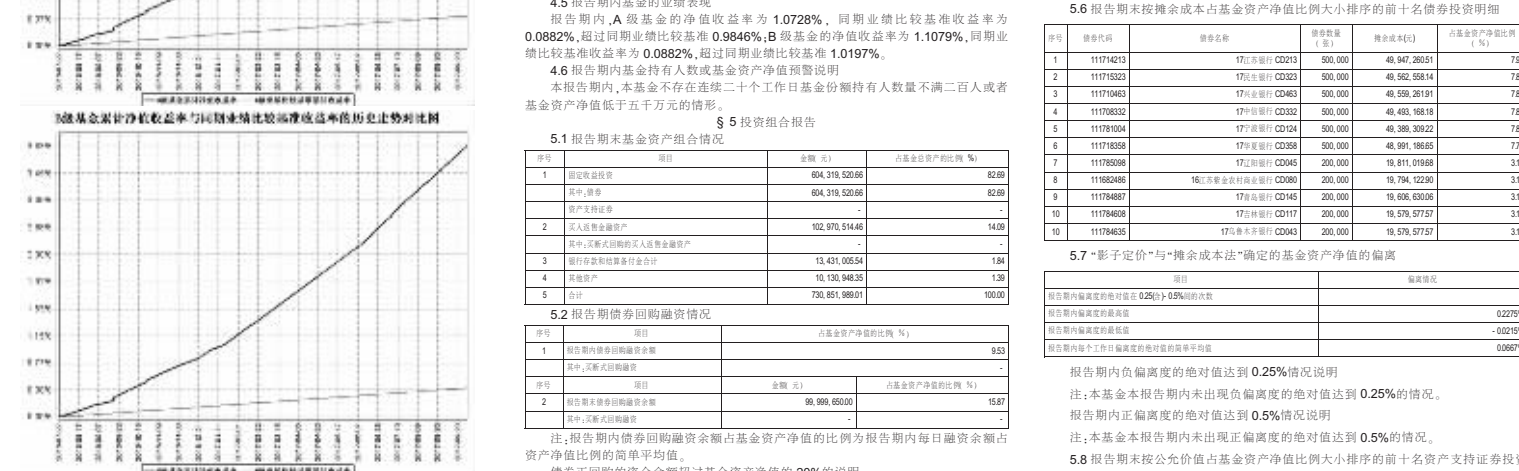
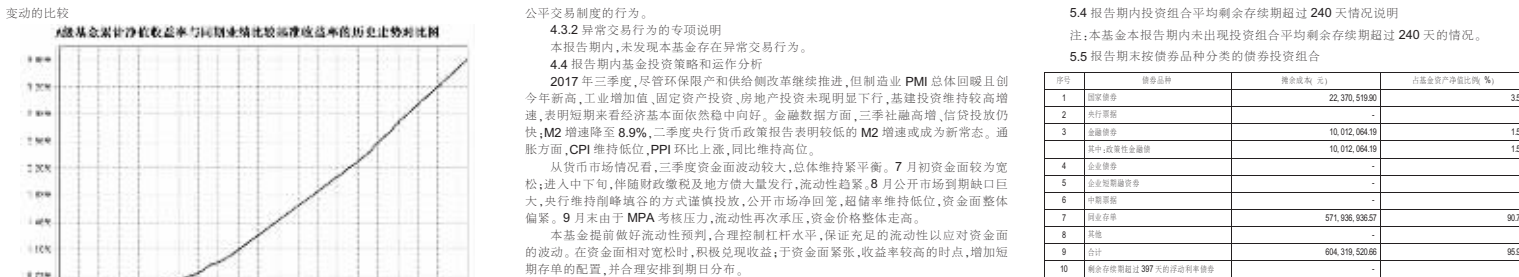


华润元大现金货币基金

2017年第三季度报告



注:按照基金合同规定,本基金的建仓期为基金合同生效之日起6个月。建仓期结束时,本基金各项资产配置比例符合基金合同约定的。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

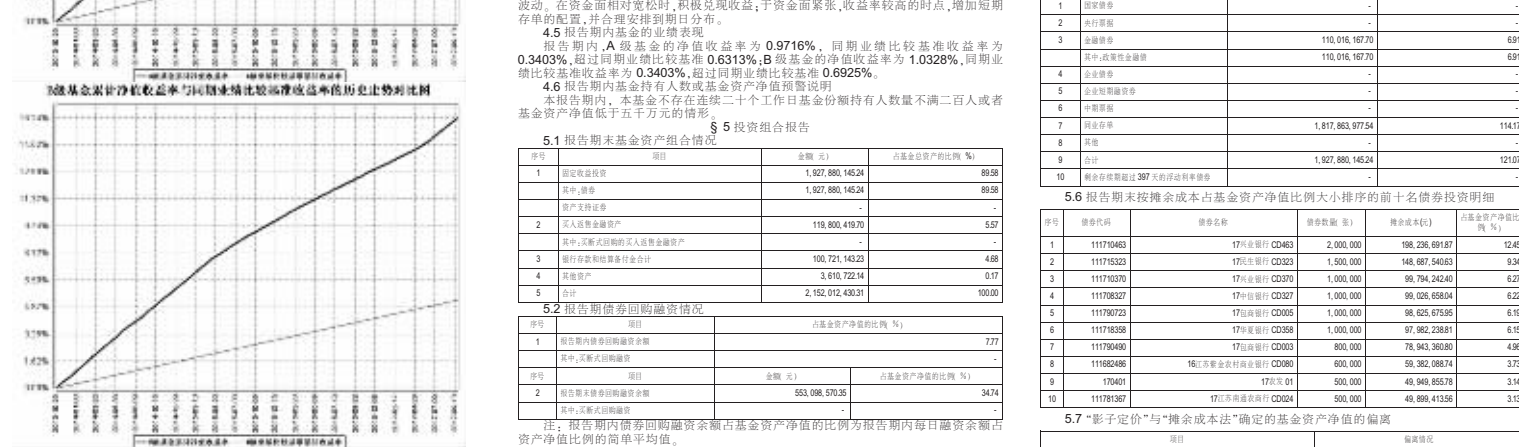
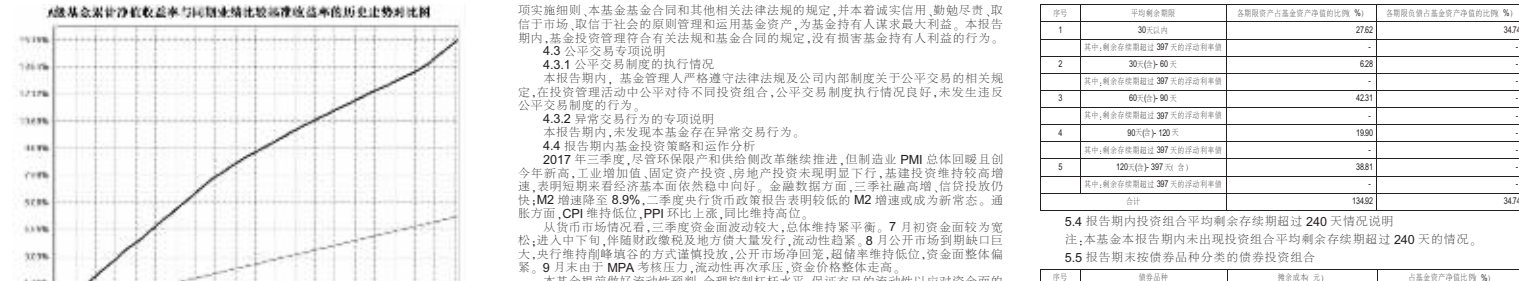
注:1.基金经理任职日期和离任日期为公司作出决定后正式对外公告之日;担任新成立的基金经理,即基金的首任基金经理,其任职日期为基金合同生效日。
2.证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券基金从业人员资格管理办法》中的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
在本报告期内,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》及其各项实施细刚、本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,为基金份额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,没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明
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

华润元大现金收益货币市场基金

2017年第三季度报告



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《证券基金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遵规守信情况的说明
在本报告期内,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

4.3 公平交易专项说明
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

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。
4.4 报告期内基金投资策略和运作分析
2017年3季度,中国股市结束近1年来的震荡分化走势,出现普涨格局。具体看,2017年3季度,上证50指数上涨4.80%,上证综指上涨4.90%,沪深300上涨4.63%,中证500上涨7.58%,创业板指数上涨2.69%,中证TMT指数上涨4.58%,国证2000指数上涨4.10%,中证一级29个行业中有色金属(25.62%)、钢铁(17.40%)、煤炭(15.71%)板块表现较好,涨幅居于前3;而电力及公用事业(-0.28%)、纺织服装(-1.04%)、传媒(-3.08%)板块走势明显较弱,跌幅居前。在中信一级行业的4个TMT行业中,3季度,通信上涨11.14%,电子上涨10.23%,计算机上涨4.15%,而传媒下跌3.08%。在3季度,本基金保持较高股票仓位,根据市场环境精选优质标的进行配置。未来市场展望方面,继续保持乐观,看好消费电子、5G、人工智能等。

截至报告期内基金的业绩表现
截至2017年9月30日,本基金份额净值1.597元,报告期内的基金份额净值增长率3.17%,同期业绩比较基准收益率为3.69%。
4.6 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明
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。

5.1 报告期末基金资产组合情况

5.3 基金投资组合报告

5.3.1 投资组合平均持仓期限

5.3.2 投资组合平均持仓期限分布比例

5.3.3 投资组合平均持仓期限分布比例

5.3.4 投资组合平均持仓期限分布比例

5.3.5 投资组合平均持仓期限分布比例

5.3.6 投资组合平均持仓期限分布比例

5.3.7 投资组合平均持仓期限分布比例

5.3.8 投资组合平均持仓期限分布比例

5.3.9 投资组合平均持仓期限分布比例

5.3.10 投资组合平均持仓期限分布比例

5.3.11 投资组合平均持仓期限分布比例

5.3.12 投资组合平均持仓期限分布比例

5.3.13 投资组合平均持仓期限分布比例

2017年9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:平安银行股份有限公司
报告送出日期:2017年10月25日

§1 重要提示
基金管理人的董事会及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责任。
基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年10月24日复核了本报告中的财务指标、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。
本报告中期财务资料未经审计。
本报告期自2017年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金名称 华润元大现金货币基金
代码 000800
基金运作方式 契约型开放式
基金合同生效日期 2016年7月27日
报告期末基金份额总额 628,968,931.00

投资策略
1. 大类资产配置策略
本基金主要投资于货币市场工具,一是根据宏观经济形势、货币市场利率、货币市场资金供求状况、信用状况等因素进行合理的资产配置,一是根据投资组合的流动性需求进行合理的资产配置,二是根据投资组合的收益率需求进行合理的资产配置。

2. 信用债投资策略
本基金主要投资于信用债,一是根据宏观经济形势、信用债市场利率、信用债市场资金供求状况、信用债市场信用状况等因素进行合理的资产配置,一是根据投资组合的流动性需求进行合理的资产配置,二是根据投资组合的收益率需求进行合理的资产配置。

3. 流动性管理策略
本基金主要投资于流动性管理工具,一是根据宏观经济形势、流动性管理工具市场利率、流动性管理工具市场资金供求状况、流动性管理工具市场信用状况等因素进行合理的资产配置,一是根据投资组合的流动性需求进行合理的资产配置,二是根据投资组合的收益率需求进行合理的资产配置。

4. 风险控制策略
本基金主要投资于风险控制工具,一是根据宏观经济形势、风险控制工具市场利率、风险控制工具市场资金供求状况、风险控制工具市场信用状况等因素进行合理的资产配置,一是根据投资组合的流动性需求进行合理的资产配置,二是根据投资组合的收益率需求进行合理的资产配置。

5. 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。
本报告中期财务资料未经审计。
本报告期自2017年7月1日起至9月30日止。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注: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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

2017年10月25日 星期三

基金管理人:华润元大基金管理有限公司
基金托管人:平安银行股份有限公司
报告送出日期:2017年10月25日

§1 重要提示
基金管理人的董事会及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责任。
基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年10月24日复核了本报告中的财务指标、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。
本报告中期财务资料未经审计。
本报告期自2017年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金名称 华润元大现金货币基金
代码 000800
基金运作方式 契约型开放式
基金合同生效日期 2016年7月27日
报告期末基金份额总额 628,968,931.00

投资策略
1. 大类资产配置策略
本基金主要投资于货币市场工具,一是根据宏观经济形势、货币市场利率、货币市场资金供求状况、信用状况等因素进行合理的资产配置,一是根据投资组合的流动性需求进行合理的资产配置,二是根据投资组合的收益率需求进行合理的资产配置。

2. 信用债投资策略
本基金主要投资于信用债,一是根据宏观经济形势、信用债市场利率、信用债市场资金供求状况、信用债市场信用状况等因素进行合理的资产配置,一是根据投资组合的流动性需求进行合理的资产配置,二是根据投资组合的收益率需求进行合理的资产配置。

3. 流动性管理策略
本基金主要投资于流动性管理工具,一是根据宏观经济形势、流动性管理工具市场利率、流动性管理工具市场资金供求状况、流动性管理工具市场信用状况等因素进行合理的资产配置,一是根据投资组合的流动性需求进行合理的资产配置,二是根据投资组合的收益率需求进行合理的资产配置。

4. 风险控制策略
本基金主要投资于风险控制工具,一是根据宏观经济形势、风险控制工具市场利率、风险控制工具市场资金供求状况、风险控制工具市场信用状况等因素进行合理的资产配置,一是根据投资组合的流动性需求进行合理的资产配置,二是根据投资组合的收益率需求进行合理的资产配置。

5. 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。
本报告中期财务资料未经审计。
本报告期自2017年7月1日起至9月30日止。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注: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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额

注:本基金收益分配方式为按日结转份额