

华润元大富时中国 A50 指数型证券投资基金 2017 年年度报告摘要

2017 年 12 月 31 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 3 月 28 日

1.1 重要提示
本基金的董事会、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 3 月 27 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。
本报告财务资料已经审计，德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告自 2017 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。
本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

2.1 基金基本情况

基金名称	华润元大富时中国 A50 指数
基金代码	000656
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	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	140,303,324.77 份
报告期末基金份额持有人户数	12 户

2.2 基金产品说明

投资目标：本基金紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，力争实现基金份额净值增长率超越标的指数同期增长率。
投资策略：本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股。为更好的实现投资目标，本基金可少量投资于国内依法发行上市的其他股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货、期权以及法律法规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。本基金将根据法律法规进行融资融券交易，以提高投资效率，实现基金的投资目标。本基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，每个交易日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保持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%。本基金的业绩比较基准为：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，预期风险和预期收益高于货币型基金、债券型基金和混合型基金，属于证券投资基金中的较高风险品种。本基金的风险收益特征与标的指数所表征的风险收益特征相似。

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。
本报告财务资料已经审计，德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告自 2017 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。
本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

2.3 基金管理人及基金托管人

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
办公地址	北京市西城区阜成门内大街 2 号	北京市西城区复兴门内大街 28 号
法定代表人	李长生	田国立
总经理	李长生	田国立
分管基金业务负责人	李长生	田国立
基金运营部负责人	李长生	田国立
基金销售部门负责人	李长生	田国立
基金投资部门负责人	李长生	田国立
基金风控部门负责人	李长生	田国立
基金合规部门负责人	李长生	田国立
基金信息技术部门负责人	李长生	田国立
基金法律合规部门负责人	李长生	田国立
基金财务部门负责人	李长生	田国立
基金行政管理部门负责人	李长生	田国立
基金其他部门负责人	李长生	田国立

2.4 信息披露方式

基金年度报告全文披露网站	http://www.rhymf.com.cn
基金年度报告摘要披露网站	基金管理人基金托管人披露网站

3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

项目	2017 年	2016 年	2015 年
1. 基金资产净值	8,790,441.24	-7,018,028.26	46,978,379.92
2. 基金份额净值	37,801,880.68	-3,180,403.18	42,172,440.67
3. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
4. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
5. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
6. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
7. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
8. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
9. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
10. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
11. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
12. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
13. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
14. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
15. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
16. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
17. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
18. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
19. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
20. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
21. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
22. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
23. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
24. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
25. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
26. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
27. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
28. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
29. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
30. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
31. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
32. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
33. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
34. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
35. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
36. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
37. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
38. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
39. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
40. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
41. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
42. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
43. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
44. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
45. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
46. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
47. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
48. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
49. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
50. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
51. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
52. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
53. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
54. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
55. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
56. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
57. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
58. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
59. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
60. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
61. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
62. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
63. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
64. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
65. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
66. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
67. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
68. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
69. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
70. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
71. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
72. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
73. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
74. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
75. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
76. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
77. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
78. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
79. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
80. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
81. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
82. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
83. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
84. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
85. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
86. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
87. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
88. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
89. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
90. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
91. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
92. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
93. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
94. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
95. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
96. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
97. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
98. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
99. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
100. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户

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据。

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
注：本基金业绩比较基准为：富时中国 A50 指数收益率×95%+银行活期存款收益率（税后）×5%。

项目	2017 年	2016 年	2015 年
1. 基金资产净值	8,790,441.24	-7,018,028.26	46,978,379.92
2. 基金份额净值	37,801,880.68	-3,180,403.18	42,172,440.67
3. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
4. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
5. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
6. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
7. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
8. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
9. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
10. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
11. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
12. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
13. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
14. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
15. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
16. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
17. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
18. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
19. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
20. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
21. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
22. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
23. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
24. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
25. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
26. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
27. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
28. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
29. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
30. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
31. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
32. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
33. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
34. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
35. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
36. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
37. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
38. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
39. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
40. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
41. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
42. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
43. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
44. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
45. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
46. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
47. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
48. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
49. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
50. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
51. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
52. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
53. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
54. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
55. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
56. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
57. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
58. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
59. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
60. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
61. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
62. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
63. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
64. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
65. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
66. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
67. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
68. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
69. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
70. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
71. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
72. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
73. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
74. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
75. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
76. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
77. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
78. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
79. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
80. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
81. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
82. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
83. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
84. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
85. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
86. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
87. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
88. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
89. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
90. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
91. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
92. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
93. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
94. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
95. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
96. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
97. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
98. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
99. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户
100. 基金份额持有人户数	12 户	12 户	12 户

3.2.2 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金基金合同生效日为 2014 年 11 月 20 日，基金合同生效日至 2014 年 12 月 31 日，本基金运作时间未满一年，图示为 2014 年本基金的净值增长率及业绩比较基准的收益率根据当年实际存续期（2014 年 11 月 20 日至 2014 年 12 月 31 日）计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

截止本报告期末，本基金未进行利润分配。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其基金经理的经验
华润元大基金管理有限公司经中国证监会证监许可[2014]1746 号文批准，于 2013 年