

华润元大量化优选混合型证券投资基金 2019 年第 3 季度报告

2019 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：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2019 年 10 月 22 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 10 月 21 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

转型后：

基金简称	华润元大量化优选混合
交易代码	000646
基金运作方式	契约型开始式
基金合同生效日	2019 年 9 月 4 日
报告期末基金份额总额	103,532,814.90 份
投资目标	本基金在有效控制风险的前提下，充分运用量化投资策略，力求基金资产长期增值。
投资策略	<p>本基金在投资中将以基金的权益类资产和固定收益类资产配置作为基础，采用量化选股模型，并将对基金整体的波动和风险进行控制，力求基金资产长期、稳定的增值。</p> <p>1、大类资产配置策略</p> <p>本基金通过定量分析和定性分析相结合的方法，综合分析宏观经济面、政策面、市场面等多种因素以及证券市场的演化趋势，评估股票、债券等各类资产的预期收益和风险，在投资比例限制范围内，确定或调整投资组合中股票、债券等各类资产的比例。</p> <p>（1）宏观经济因素方面，考量因素包括但不限于居民消费价格指数（CPI）、工业品出厂价格指数（PPI）、狭义货币供应量（M1）、广义货币供应量（M2）、固定资产投资增长率、工业企业增加值、采购经理人指数（PMI）、消费品零售增长率、汇率、贸易盈余、大宗商品库存及价格变化等定量因素，评估宏观经济变量</p>

	<p>变化趋势。</p> <p>(2) 政策法规因素方面，主要关注政府货币政策和财政政策，考量因素包括但不限于社会总需求、社会总供给、物价和利率水平，影响因素有：税制变化、政府支出及转移支付、国债发行、利率水平、信贷规模以及存款准备金率等。</p> <p>(3) 证券市场表现因素方面主要关注市场估值和技术指标分析，考量因素包括但不限于市场整体估值水平、各行业及板块相对估值水平、一致预期估值水平、大势型技术指标、超买超卖型技术指标、趋势型技术指标、成交量型技术指标、均线型技术指标等。</p> <p>而在实际执行上，本基金将依据上述宏观经济因子在基金投资模型中所产生的投资信号，实施即时性的动态资产配置调整，通过持仓比例的实时调整，有效增强基金收益并降低投资风险。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金将运用量化选股模型，运用量化多因子选股、事件驱动选股策略，力求寻找基本面良好，并能带来长期稳定超额收益的股票投资组合。同时，本基金也将对基金整体的波动和风险进行控制，力求基金资产长期、稳定的增值。主要包括但不限于以下投资策略：</p> <p>(1) 多因子选股策略</p> <p>根据对国内证券市场运行特征的长期研究、投资研究团队的长期投资实践和大量历史数据的实证检验，基金管理人量化投资团队开发了多因子选股模型。多因子选股模型的基本原理是采用一系列的优选因子作为选股标准，从多个因子维度对个股进行打分，据此筛选出满足条件的投资组合。</p> <p>一般情况下，多因子模型的构建需进行因子筛选，考虑成长、估值、盈利能力等多个维度大类因子及其项下的各细分小类因子，然后确定各因子的权重并根据市场环境变动进行动态调整。具体来说主要可以归结为以下几个步骤：</p> <p>a. 因子的筛选</p> <p>基金管理人量化投资团队在多年研究积累的基础上，对市场上存在的有效因子进行深入研究，通过全面的数据分析及多维度的测算，优选出符合逻辑、超额收益相较明显以及相对稳定的因子作为构建多因子组合的备选因子。本基金多因子选股模型因子池的构建主要考虑成长、估值、盈利能力等多个维度大类因子及其项下的各细分小类因子，同时也包括股票价格波动相关的各类因子，例如价格波动率、成交量、动量趋势、超买超卖等。本基金通过对量化模型中各类因子的持续跟踪来监控因子的有效性，根据市场状况结合因子变化趋势，动态选取最优因子构建股票多头组</p>
--	--

	<p>合，并根据市场变化趋势，对模型进行因子调整，以改进模型的有效性。</p> <p>b. 因子权重确定 本基金结合各因子历史具体表现对其权重在不同市场环境下进行动态调整，力求准确把握市场环境。</p> <p>c. 因子的定期调整 在覆盖主流有效选股因子的前提下，本基金将优选历史环境相似的行情因子配置，动态优选表现优异因子，剔除表现不佳的因子，自动适应市场环境变化带来因子失效问题。</p> <p>(2) 事件驱动策略 事件驱动策略是指在提前挖掘和深入分析可能造成股价异常波动的事件基础上，分析出重大事件与股价波动间的历史规律，通过充分把握事件机会获取超额投资回报的交易策略。事件驱动策略中的事件是指具有较为明确的时间和内容，能够对部分投资者的投资行为产生一定的影响，从而决定股价短期波动的因素的事件，如高送转事件、资产重组事件、定向增发事件、业绩预增、股东增持以及股票回购事件等。本基金将尽力发掘和深入分析可能为个股带来超额收益的事件，对本基金事件驱动模型中所采用的事件进行优选，充分把握事件驱动策略为股票投资带来的超额投资回报。</p> <p>(3) 股票投资组合的风险控制 在风险控制方面，本基金将通过组合优化模型实现对相对风险和相对回撤的有效控制。相关性较低的多策略相结合也可有效降低组合风险，动态优化组合收益，有利于基金资产的长期稳定增值。</p> <p>(4) 港股通标的股票投资策略 对于港股投资，本基金将通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，不使用合格境内机构投资者(QDII)境外投资额度进行境外投资。股票筛选方法上，将运用多因子选股模型，主要的因子包括盈利、估值、成长、动量、现金流、股息率、流动性等，并特别关注与 A 股相关性较弱效果又好的因子模型。另外，本基金所投资香港市场股票标的除适用上述股票市场投资策略外，还需关注： 1) 香港股票市场与大陆股票市场存在的差异对股票投资价值的影响，比如行业分布、交易制度、市场流动性、投资者结构、市场波动性、涨跌停限制、估值与盈利回报等方面。 2) 港股通每日额度应用情况。 3) 人民币与港币间的汇兑比率变化。</p> <p>3、债券投资策略 本基金的债券投资采取稳健的投资管理方式，获得与</p>
--	---

	<p>风险相匹配的投资收益,以实现在一定程度上规避股票市场的系统性风险和保证基金资产的流动性。本基金通过分析未来市场利率趋势及市场信用环境变化方向,综合考虑不同券种收益率水平、信用风险、流动性等因素,构造债券投资组合。在实际的投资运作中,本基金将运用久期控制策略、收益率曲线策略、类别选择策略、个券选择策略等多种策略,获取债券市场的长期稳定收益。</p> <p>4、股指期货投资策略</p> <p>本基金将以股指期货为主要的金融衍生工具,与资产配置策略进行搭配。因为在基金实际操作上,当量化模型出现买卖讯号时,基金经理在进行一篮子股票的买卖可能会发生时效性的情况,此时可利用股指期货灵活快速进出的优势,除了达到量化模型的有效性,并可降低交易成本,为实际的投资操作提供多一项选择。</p> <p>5、权证投资策略</p> <p>本基金管理人将以价值分析为基础,在采用权证定价模型分析其合理定价的基础上,充分考量可投权证品种的收益率、流动性及风险收益特征,通过资产配置、品种与类属选择,力求规避投资风险、追求稳定的风险调整后收益。</p> <p>6、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略,在严格控制风险的情况下,通过信用研究和流动性管理,选择风险调整后收益较高的品种进行投资,以期获得长期稳定收益。</p> <p>7、现金管理</p> <p>在现金管理上,本基金通过对未来现金流的预测进行现金预算管理,及时满足本基金运作中的流动性需求。</p>
业绩比较基准	<p>沪深 300 指数收益率*50%+恒生指数收益率*20%+中证国债指数收益率*30%</p>
风险收益特征	<p>本基金为混合型基金,属于证券投资基金中的中等风险品种,预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金。</p> <p>本基金将通过港股通渠道投资于香港证券市场,除了需要承担与内地证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外,本基金还将面临汇率风险、香港市场风险等特殊投资风险。</p>
基金管理人	<p>华润元大基金管理有限公司</p>
基金托管人	<p>中国农业银行股份有限公司</p>
下属分级基金的基金简称	<p>华润元大量化优选混合 A 华润元大量化优选混合</p>

		C
下属分级基金的交易代码	000646	007827
报告期末下属分级基金的份额总额	103, 511, 867. 06 份	20, 947. 84 份

转型前:

基金简称	华润元大医疗保健量化混合
交易代码	000646
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 8 月 18 日
报告期末基金份额总额	105, 560, 779. 53 份
投资目标	本基金主要投资于医疗保健行业股票,通过量化与基本面相结合的方法,精选优质上市公司,在控制风险、确保基金资产流动性的前提下,获取基金资产的长期增值,力争实现超越业绩比较基准的长期收益。
投资策略	<p>1、大类资产配置策略 宏观经济、政策法规以及证券市场表现为资产配置策略的主要考量因素。</p> <p>2、股票投资策略 股票投资策略是本基金的核心部分,本基金将结合定量与定性分析,充分发挥基金管理人研究团队和投资团队的选股能力,选择具有长期持续增长能力的公司。</p> <p>3、债券投资策略 本基金的债券投资采取稳健的投资管理方式,获得与风险相匹配的投资收益,以实现在一定程度上规避股票市场的系统性风险和保证基金资产的流动性。</p> <p>4、股指期货投资策略 本基金将以股指期货为主要的金融衍生工具,与资产配置策略进行搭配。</p> <p>5、权证投资策略 本基金管理人将以价值分析为基础,在采用权证定价模型分析其合理定价的基础上,充分考量可投资品种收益率、流动性及风险收益特征,通过资产配置、品种与类属选择,力求规避投资风险、追求稳定的风险调整后收益。</p> <p>6、资产支持证券投资策略 本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略,在严格控制风险的情况下,通过信用研究和流动性管理,选择风险调整后收益较高的品种进行投资,以期获得长期稳定收益。</p> <p>7、现金管理 在现金管理上,本基金通过对未来现金流的预测进</p>

	行现金预算管理,及时满足本基金运作中的流动性需求。	
业绩比较基准	中证医药卫生指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%	
风险收益特征	本基金为混合型基金,属于证券投资基金中的中等风险品种,预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金。	
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	
报告期末下属分级基金的份额总额	105,560,779.53 份	0.00 份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标（转型后）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2019年9月4日—2019年9月30日）	
	华润元大量化优选混合 A	华润元大量化优选混合 C
1. 本期已实现收益	11,017,975.07	62.68
2. 本期利润	676,678.61	-40.53
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0065	-0.0038
4. 期末基金资产净值	123,363,538.00	24,969.97
5. 期末基金份额净值	1.1918	1.1920

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。

3.1 主要财务指标（转型前）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2019年7月1日—2019年9月3日）	
	1. 本期已实现收益	1,156,052.70
2. 本期利润	10,316,807.10	
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1526	
4. 期末基金资产净值	125,122,886.02	
5. 期末基金份额净值	1.1850	

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（转型后）

3.2.1 本报告期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

华润元大量化优选混合 A

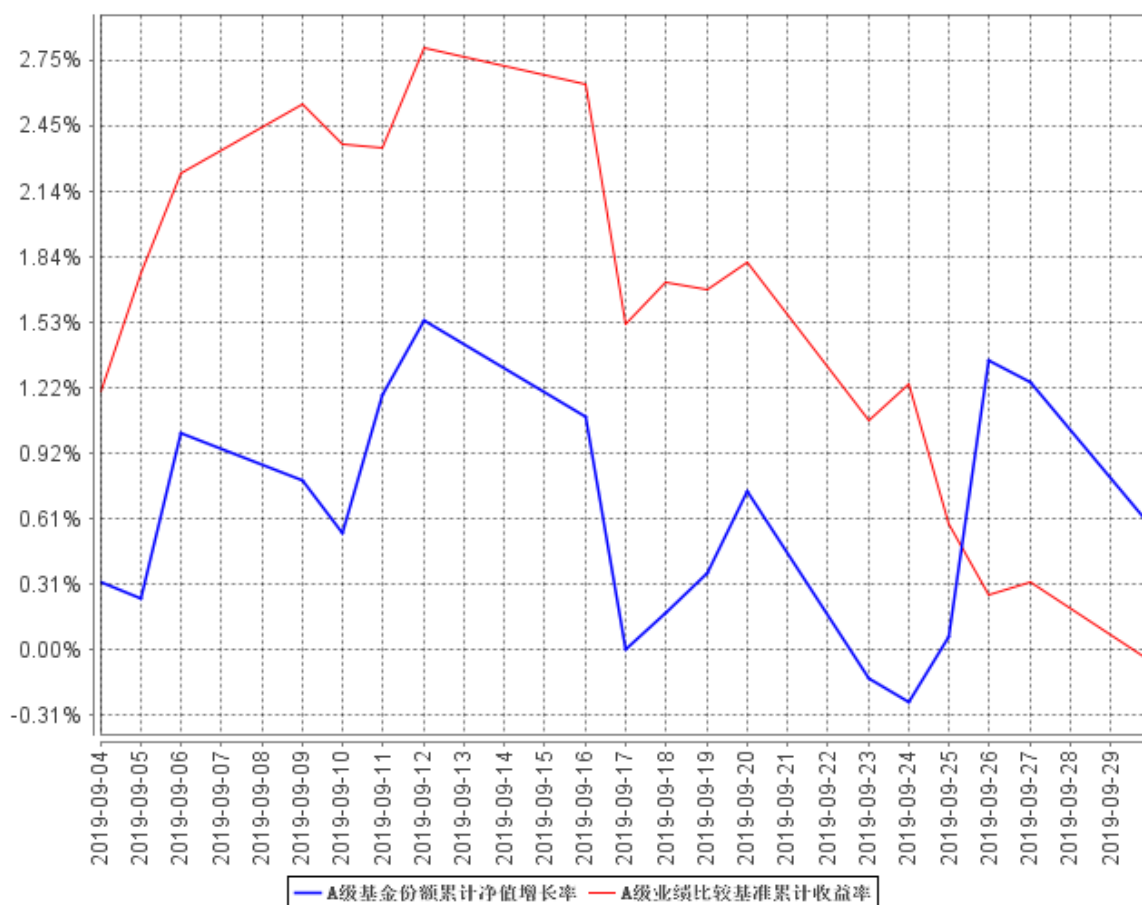
阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准收 益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.57%	0.59%	-0.05%	0.53%	0.62%	0.06%

华润元大量化优选混合 C

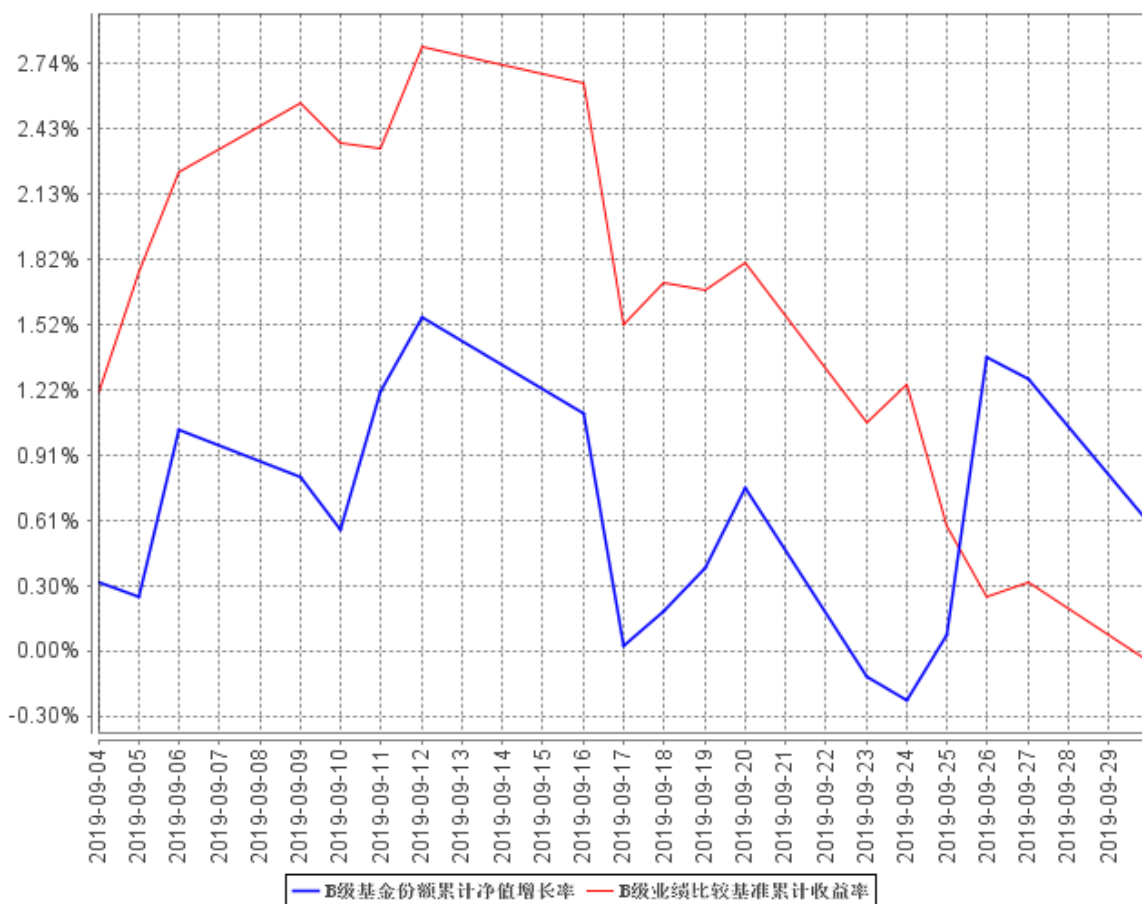
阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准收 益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.59%	0.59%	-0.05%	0.53%	0.64%	0.06%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



B级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



3.2 基金净值表现 (转型前)

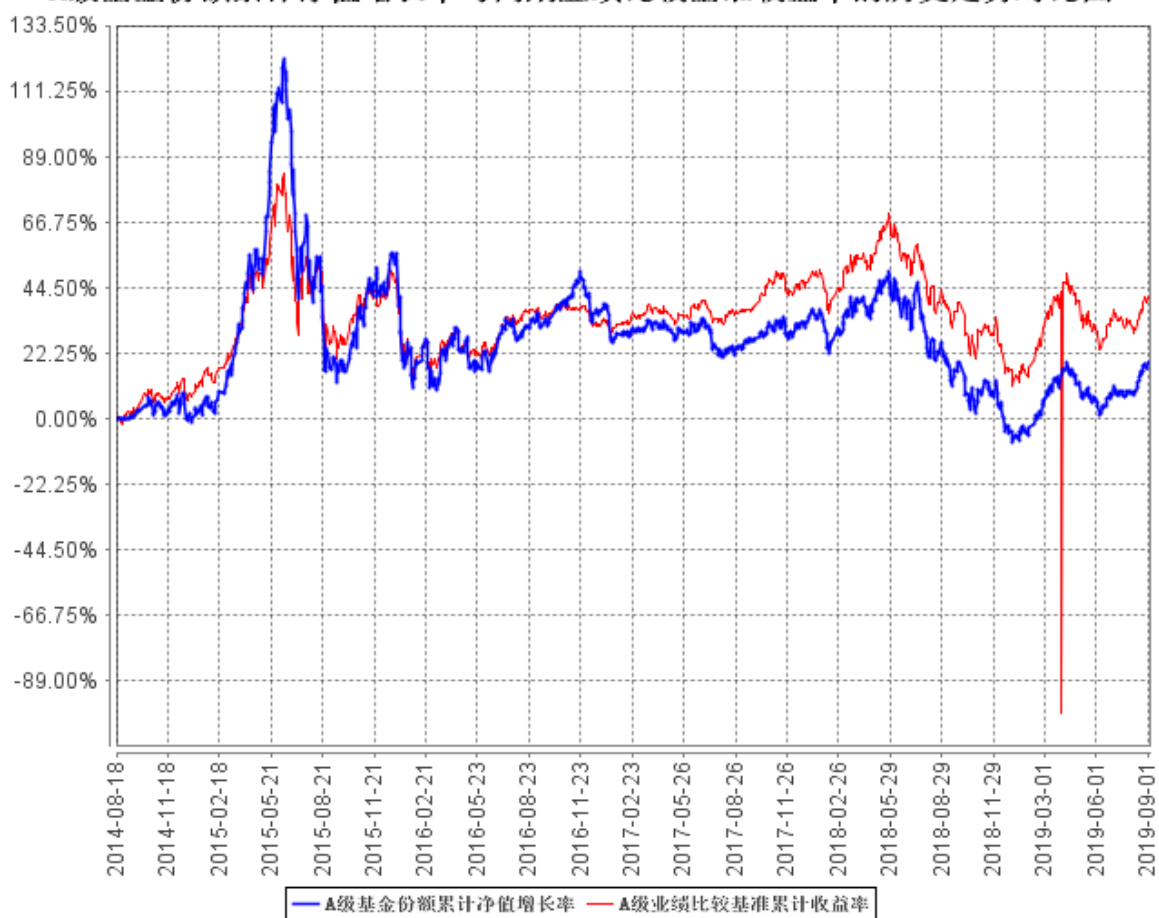
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华润元大医疗保健量化混合

阶段	净值增长率①	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
过去三个月	9.72%	0.79%	5.39%	0.88%	4.33%	-0.09%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



B级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型前）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈剑波	本基金基金经理	2018年11月8日	-	9年	中国，天津大学热能工程学士，具有基金从业资格。曾任招商基金管理有限公司信息技术部高级经理、广州安正软件科技有限公司副总经理、招商基金管理有限公司量化投资部先后担任数据分析师、投资经理、基金经理；2017年9月18日加入公司；2018年11月8日至2019年9月3

					日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；2019 年 2 月 14 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。
袁华涛	本基金基金经理	2016 年 8 月 5 日	-	9 年	中国，西南财经大学金融学博士，具有基金从业资格。曾任华泰证券股份有限公司研究员，华泰证券（上海）资产管理有限公司量化投资经理。2015 年 7 月 20 日加入公司；2015 年 9 月 16 日至 2019 年 9 月 16 日担任华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金；2016 年 8 月 5 日至 2019 年 9 月 16 日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；2015 年 9 月 16 日至 2019 年 9 月 3 日担任华润元大医疗保健混合型证券投资基金基金经理。

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型后）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
袁华涛	本基金基金经理	2016 年 8 月 5 日	-	9 年	中国，西南财经大学金融学博士，具有基金从业资格。曾任华泰证券股份有限公司研究员，华泰证券（上海）资产管理有限公司量化投资经理。2015 年 7 月 20 日加入公司；2015 年 9 月 16 日至 2019 年 9 月 16 日担任华润元大安鑫灵活配置混合型

					证券投资基金；2016年8月5日至2019年9月16日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；2015年9月16日至2019年9月3日担任华润元大医疗保健混合型证券投资基金基金经理；2019年9月4日起担任华润元大量化优选混合型证券投资基金基金经理。
陈剑波	本基金基金经理	2018年11月8日	-	9年	中国，天津大学热能工程学士，具有基金从业资格。曾任招商基金管理有限公司信息技术部高级经理、广州安正软件科技有限公司副总经理、招商基金管理有限公司量化投资部先后担任数据分析师、投资经理、基金经理；2017年9月18日加入公司；2018年11月8日至2019年9月3日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；2019年2月14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；2019年9月4日起担任华润元大量化优选混合型证券投资基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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 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。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2019 年第三季度行情继续小幅回落，市场在 3000 点附近多空博弈激烈。从板块行业上看，中小创板块在科创板的带动下表现强于大蓝筹板块，与科创板相关的计算机、电子、医药行业逆势上涨，涨幅明显。从板块指数上看，创业板指数上涨 7.68%，中小板指数上涨 5.62%，上证综指下跌 2.47%，沪深 300 指数下跌 0.29%，上证 50 指数下跌 1.12%，富时 A50 指数下跌 0.19%。从行业指数上看，中信一级 29 个行业中有色金属（-7.04%）、钢铁（-10.51%）、商贸零售（-6.78%）板块走势明显较弱，跌幅较大；而医药（6.86%）、电子元器件（18.63%）、计算机（5.03%）板块走势较强，涨幅相对较大。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，A 级基金的净值收益率为 10.35%，同期业绩比较基准收益率为 5.34%，C 级基金的净值收益率为 0.59%，同期业绩比较基准收益率为-0.05%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金存在连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，出现该情况的时间范围为 2019 年 7 月 1 日至 7 月 29 日。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的情形。

§ 5 投资组合报告

转型后：

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	114,307,719.30	92.19

	其中：股票	114,307,719.30	92.19
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	8,835,512.00	7.13
8	其他资产	843,901.82	0.68
9	合计	123,987,133.12	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,183,573.92	1.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	228,680.00	0.19
G	交通运输、仓储和邮政业	346,896.00	0.28
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	223,129.40	0.18
J	金融业	110,823,114.98	89.82
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	210,180.00	0.17
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	292,145.00	0.24
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	114,307,719.30	92.64

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	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600000	浦发银行	871,400	10,317,376.00	8.36

2	601398	工商银行	1,835,200	10,148,656.00	8.22
3	601818	光大银行	2,569,400	10,123,436.00	8.20
4	600016	民生银行	1,666,500	10,032,330.00	8.13
5	601988	中国银行	2,786,700	9,976,386.00	8.09
6	601939	建设银行	1,426,595	9,971,899.05	8.08
7	601166	兴业银行	568,400	9,964,052.00	8.08
8	600015	华夏银行	1,349,500	9,959,310.00	8.07
9	601328	交通银行	1,821,300	9,926,085.00	8.04
10	600036	招商银行	285,400	9,917,650.00	8.04

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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。

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五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末持仓股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末持仓国债期货。

5.10.2 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投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末持仓国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本报告期内本基金投资的前十名证券中没有出现发行主体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。

5.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本报告期内本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	32,566.52
2	应收证券清算款	706,872.49
3	应收股利	-
4	应收利息	1,934.60
5	应收申购款	83,361.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	19,166.76
8	其他	-
9	合计	843,901.82

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告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。

5.11.6 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。

转型前：

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	118,506,929.98	94.17
	其中：股票	118,506,929.98	94.17
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-

	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	7,228,825.42	5.74
8	其他资产	106,202.47	0.08
9	合计	125,841,957.87	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	69,558,791.04	55.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	14,250,673.30	11.39
G	交通运输、仓储和邮政业	351,560.00	0.28
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	142,396.88	0.11
J	金融业	19,537,531.36	15.61
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	5,559,189.40	4.44
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	9,106,788.00	7.28
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	118,506,929.98	94.71

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	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	603259	药明康德	62,980	5,285,911.40	4.22
2	600867	通化东宝	299,790	5,216,346.00	4.17
3	600521	华海药业	293,460	5,079,792.60	4.06
4	600276	恒瑞医药	62,680	4,920,380.00	3.93

5	600079	人福医药	435,600	4,913,568.00	3.93
6	600380	健康元	513,152	4,890,338.56	3.91
7	600535	天士力	273,700	4,704,903.00	3.76
8	600196	复星医药	167,953	4,690,927.29	3.75
9	600572	康恩贝	717,200	4,661,800.00	3.73
10	600763	通策医疗	46,700	4,615,828.00	3.69

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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。

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五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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）					51,669.90
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投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末持仓股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末持仓国债期货。

5.10.2 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投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末持仓国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本报告期内本基金投资的前十名证券中没有出现发行主体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。

5.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本报告期内本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	32,566.52
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	21,566.57
5	应收申购款	52,069.38
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	106,202.47

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告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。

5.11.6 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。

§ 6 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

项目	华润元大量化优选混合 A	华润元大量化优选混
----	--------------	-----------

		合 C
基金合同生效日（2019 年 9 月 4 日） 基金份额总额	105,571,787.03	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总 申购份额	729,785.26	20,947.84
减：基金合同生效日起至报告期期末基金 总赎回份额	2,789,705.23	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆 分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	103,511,867.06	20,947.84

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。

§ 6 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

项目	华润元大医疗保健量化混合
报告期期初基金份额总额	28,838,111.54
报告期期间基金总申购份额	107,376,066.17
减：报告期期间基金总赎回份额	30,653,398.18
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少 以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	105,560,779.53

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。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型后）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型后）

本报告期期初基金管理人未持有本基金份额，且报告期内基金管理人持有基金份额未发生变动。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细（转型后）

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型前）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型前）

本报告期期初基金管理人未持有本基金份额，且报告期内基金管理人持有基金份额未发生变动。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细（转型前）

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2019年7月30日至2019年8月6日	0.00	27,496,791.93	27,496,791.93	0.00	0.00%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本基金于本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情形，本基金管理人已经采取措施，审慎确认大额申购与大额赎回，防控产品流动性风险并公平对待投资者。本基金管理人提请投资者注意因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、大额赎回风险以及净值波动风险等特有风险。							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

2019年7月17日公布了《华润元大医疗保健量化混合型证券投资基金2019年第2季度报告》，2019年7月27日公布了《华润元大基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金开展直销柜台费率优惠活动的公告》，2019年7月30日公布了《华润元大基金管理有限公司关于以通讯方式召开华润元大医疗保健量化混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》，2019年7月31日公布了《华润元大基金管理有限公司关于以通讯方式召开华润元大医疗保健量化混合型证券投资

基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告》，2019 年 8 月 1 日公布了《华润元大基金管理有限公司关于以通讯方式召开华润元大医疗保健量化混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告》，2019 年 8 月 2 日公布了《关于〈华润元大基金管理有限公司关于以通讯方式召开华润元大医疗保健量化混合型证券投资基金基金份额持有人大会的提示性公告〉的更正公告》，2019 年 8 月 3 日公布了《华润元大医疗保健量化混合型基金关于在代销机构、网上直销系统暂停大额申购（含转换转入及定期定额投资）业务的公告》，2019 年 8 月 13 日公布了《华润元大医疗保健量化混合型基金关于在网下直销柜台暂停大额申购（含转换转入及定期定额投资）业务的公告》，2019 年 8 月 29 日公布了《华润元大医疗保健量化混合型证券投资基金 2019 年半年度报告》、《华润元大医疗保健量化混合型证券投资基金 2019 年半年度报告摘要》，2019 年 9 月 4 日公布了《关于华润元大医疗保健量化混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》、《华润元大量化优选混合型证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告》，2019 年 9 月 19 日公布了《华润元大基金管理有限公司关于李仆代为履行董事长职务的公告》，2019 年 9 月 27 日公布了《华润元大基金管理有限公司关于公司股权、注册资本总额变更的公告》。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会关于核准本基金募集的批复；
- 2、本基金基金合同；
- 3、本基金托管协议；
- 4、本报告期内在指定报刊上披露的各项公告。

9.2 存放地点

以上备查文件存放于基金管理人和基金托管人的办公场所。

9.3 查阅方式

基金持有人可在办公时间到基金管理人和基金托管人的办公场所或网站免费查阅。

华润元大基金管理有限公司
2019 年 10 月 22 日