

华润元大量化优选混合型证券投资基金 2020 年第 3 季度报告

2020 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：2020 年 10 月 28 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 2020 年 10 月 27 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 2020 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

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	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 9 月 4 日	
报告期末基金份额总额	185,491,602.88 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	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。	
业绩比较基准	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%	
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。 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。	
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	
下属分级基金的基金简称	华润元大量化优选混合 A	华润元大量化优选混合 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	181,171,186.12 份	4,320,416.76 份
-----------------	------------------	----------------

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2020年7月1日—2020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	18,561,180.30	534,736.93
2. 本期利润	8,585,383.65	-169,408.88
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0578	-0.0434
4. 期末基金资产净值	255,907,012.24	6,054,096.32
5. 期末基金份额净值	1.4125	1.4013

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

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

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	10.12%	1.39%	3.99%	0.96%	6.13%	0.43%
过去六个月	18.31%	1.11%	11.05%	0.85%	7.26%	0.26%
过去一年	18.52%	1.11%	9.03%	0.92%	9.49%	0.19%
过去三年	10.87%	1.30%	10.53%	1.15%	0.34%	0.15%
过去五年	21.77%	1.44%	21.87%	1.14%	-0.10%	0.30%
自基金合同生效起至今	41.25%	1.62%	53.09%	1.31%	-11.84%	0.31%

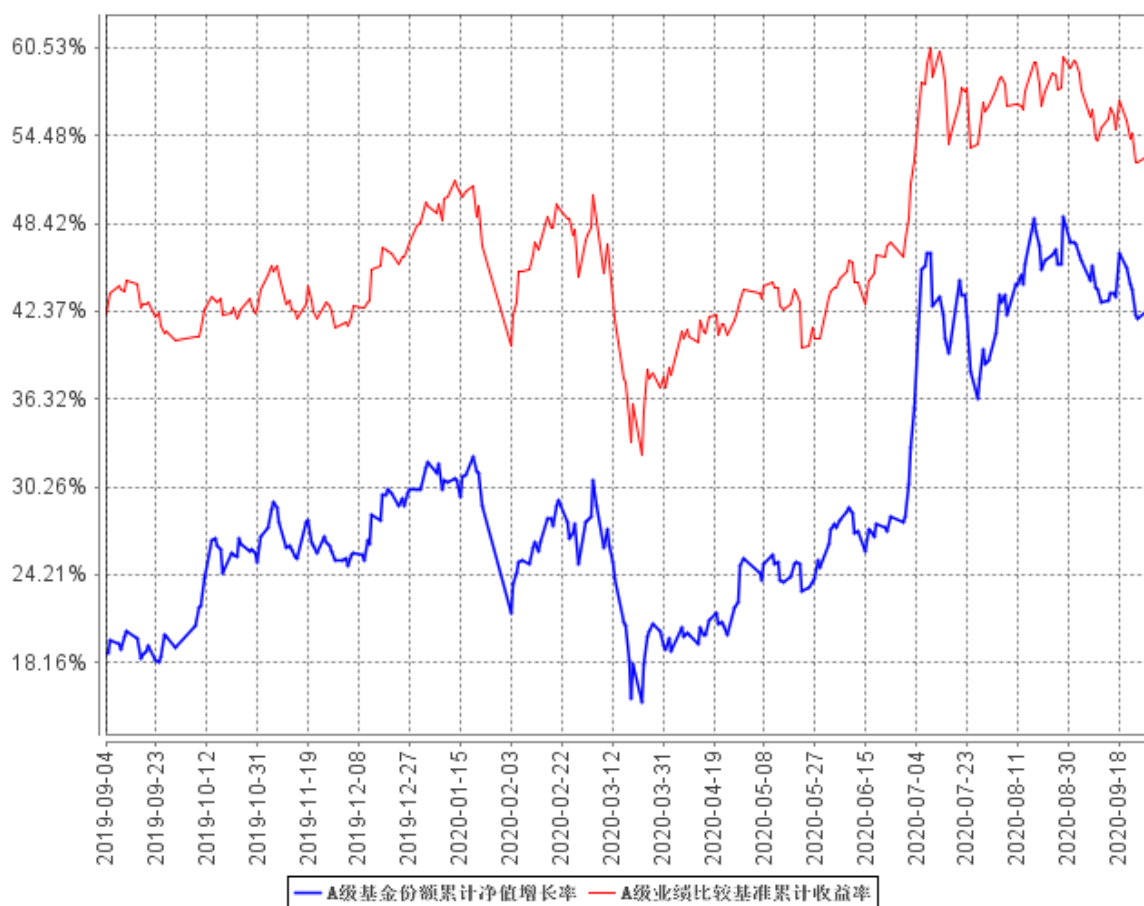
华润元大量化优选混合 C

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	9.91%	1.39%	3.99%	0.96%	5.92%	0.43%
过去六个月	17.85%	1.11%	11.05%	0.85%	6.80%	0.26%

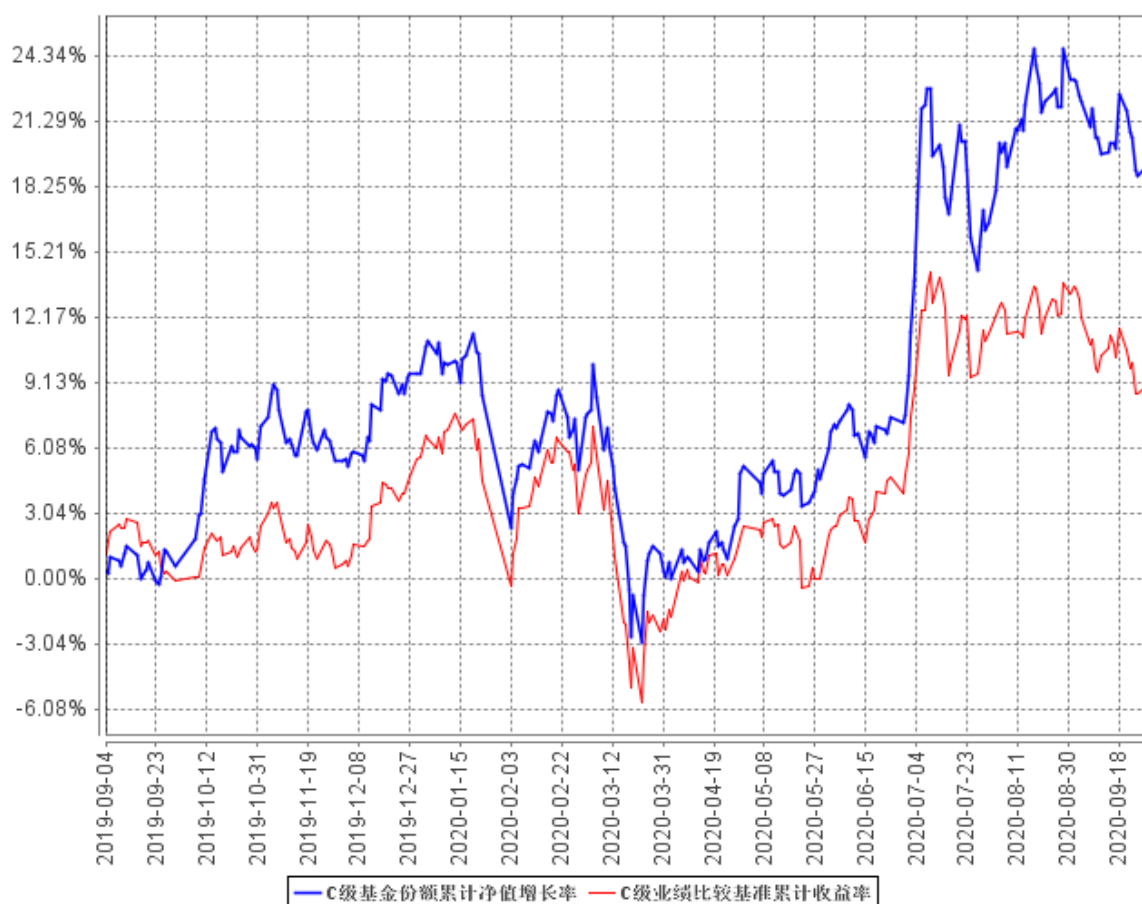
过去一年	17.56%	1.11%	9.03%	0.92%	8.53%	0.19%
自基金合同生效起至今	18.25%	1.08%	8.97%	0.90%	9.28%	0.18%

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



C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

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		
李武群	本基金基金经理、量化指数部总经理	2019年10月18日	-	11年	中国，中国科学院研究生院微电子学与固体电子学博士，具有基金从业资格。曾任中信银行福州分行统计分析岗、华西证券股份有限公司研究所高级研究员和股票投资部投资经理助理；2015年8月13日加入华润元大基金管理有限公司，现任公司量化指数部总经理；2017年8月2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

					<p>年 10 月 18 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；2020 年 4 月 8 日起担任华润元大成长精选股票型发起式证券投资基金基金经理；2020 年 8 月 13 日起担任华润元大景泰混合型证券投资基金基金经理。</p>
--	--	--	--	--	---

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

-

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

9 月以来市场受流动性、估值以及国际环境等因素影响，前期活跃的股票在回调过程中成为了下跌的主力，四季度行情市场有望由流动性驱动转向盈利驱动模式。从板块指数上看，创业板指数上涨 5.60%，中小板指数上涨 8.19%，上证综指上涨 7.82%，沪深 300 指数上涨 10.17%，上证 50 指数上涨 9.87%，富时 A50 指数上涨 8.93%。从行业指数上看，中信一级 30 个行业中国防军工（32.34%）、消费者服务（27.01%）、电力设备及新能源（24.12%）板块走势较强，涨幅相对较大；而商贸零售（-3.40%）、通讯（-7.97%）、计算机（-1.87%）板块走势较弱，跌幅相对较大。

本基金作为主动量化型基金，报告期内，本基金主要运用量化选股模型，选择业绩较好且估值较低的低估价值股与绩优成长股，同时积极进行新股与新债申购。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末华润元大量化优选混合 A 基金份额净值为 1.4125 元，本报告期基金份额净值增长率为 10.12%；截至本报告期末华润元大量化优选混合 C 基金份额净值为 1.4013 元，本报告期基金份额净值增长率为 9.91%；同期业绩比较基准收益率为 3.99%。

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 投资组合报告

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	230,346,605.07	66.31
	其中：股票	230,346,605.07	66.31
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	104,937,957.00	30.21
	其中：债券	104,937,957.00	30.21
	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	10,255,303.27	2.95
8	其他资产	1,841,424.51	0.53
9	合计	347,381,289.85	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	12,306,200.00	4.70
B	采矿业	-	-
C	制造业	16,786,842.98	6.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	5,015,813.12	1.91
F	批发和零售业	295,434.43	0.11
G	交通运输、仓储和邮政业	11,176.60	0.00

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	123,920.23	0.05
J	金融业	163,706,996.09	62.49
K	房地产业	29,660,847.00	11.32
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	242,173.40	0.09
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	370,852.00	0.14
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	228,520,255.85	87.23

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
A 基础材料	-	-
B 消费者非必需品	-	-
C 消费者常用品	-	-
D 能源	-	-
E 金融	1,826,349.22	0.70
F 医疗保健	-	-
G 工业	-	-
H 信息技术	-	-
I 电信服务	-	-
J 公用事业	-	-
K 房地产	-	-
合计	1,826,349.22	0.70

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	601398	工商银行	4,610,169	22,682,031.48	8.66
2	601988	中国银行	6,863,900	21,964,480.00	8.38
3	601009	南京银行	2,315,400	18,268,506.00	6.97
4	002142	宁波银行	567,433	17,862,790.84	6.82
5	000001	平安银行	1,122,900	17,034,393.00	6.50
6	000002	万科A	563,100	15,778,062.00	6.02
7	002146	荣盛发展	1,819,500	13,882,785.00	5.30
8	002714	牧原股份	166,300	12,306,200.00	4.70
9	000876	新希望	392,220	10,864,494.00	4.15
10	601939	建设银行	1,492,795	9,180,689.25	3.50
10	00939	建设银行	221,000	974,869.54	0.37

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	104,937,957.00	40.06
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	104,937,957.00	40.06

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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019627	20 国债 01	1,050,430	104,937,957.00	40.06

注：本基金本报告期末仅持有 1 只债券。

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

本基金本报告期末未持仓股指期货。

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 市场中性策略执行情况

-

5.12 投资组合报告附注

5.12.1 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。

5.12.2 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。

5.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	62,109.65
2	应收证券清算款	25,456.49
3	应收股利	-
4	应收利息	1,718,116.85
5	应收申购款	35,741.52
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,841,424.51

5.12.4 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。

5.12.5 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。

5.12.6 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

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
报告期期初基金份额总额	84,178,905.11	97,619.64

报告期期间基金总申购份额	109,146,193.80	5,285,870.43
减:报告期期间基金总赎回份额	12,153,912.79	1,063,073.31
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	181,171,186.12	4,320,416.76

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

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

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

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

无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

7月2日发布了《华润元大量化优选混合型证券投资基金恢复大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告》,7月13日发布了《华润元大量化优选混合型证券投资基金C类份额暂停大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告》,7月21日发布了《华润元大量化优选混合型证券投资基金2020年第2季度报告》,7月22日发布了《华润元大基金管理有限公司关于改选李晴为第三届监事会职工监事的公告》,7月25日发布了《华润元大量化优选混合型发起式证券投资基金基金合同生效公告》,8月20日发布了《华润元大量化优选混合型证券投资基金A类份额暂停大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告》,8月31日发布了《华润元大量化优选混合型证券投资基金基金产品资料概要(更新)》,9月18日发布了《华润元大基金管理有限公司基金产品风险等级更新》,9月25日发布了《华润元大量化优选混合型证券投资基金(华润元大量化优选混合A份额)基金产品资料概要(更新)》、《华润元大量化优选混合型证券投资基金(华润元大量化优选混合C份额)基金产品资料概要(更新)》。

§ 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、本报告期内在规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

2020 年 10 月 28 日