华润元大富时中国 A50 指数型证券投资基金
2026 年第 3 季度报告

2026 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：2026 年 10 月 27 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约定，于 2026 年 10 月 26 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 2026 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华润元大富时中国 A50 指数
基金主代码	000835
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 11 月 20 日
报告期末基金份额总额	34,109,163.17 份
投资目标	本基金采用被动式投资策略，通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准表现相当，以便为投资者带来长期收益。
投资策略	本基金采用完全复制法来跟踪富时中国 A50 指数，按照个股在标的指数中的基准权重构建股票组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，基金管理人会对投资组合进行适当调整，降低跟踪误差。如有因受股票停牌、股票流动性或其他一些影响指数复制的市场因素的限制，使基金管理人无法依指数权重购买成份股，基金管理人可以根据市场情况，结合经验判断，对投资组合进行适当调整，以获得更接近标的指数的收益率。在正常市场情况下，本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.3%，年跟踪误差不超过 4%。
业绩比较基准	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，属于证券投资基金中的较高预期风险、较高预期收益的投资品种。一般情况下，其预期风险和预期收益高于混合型基金、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	
下属分级基金的基金简称	华润元大富时中国 A50 指数 A	华润元大富时中国 A50 指数 C
下属分级基金的交易代码	000835	010573
报告期末下属分级基金的份额总额	33,671,067.96 份	438,095.21 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（2026 年 7 月 1 日-2026 年 9 月 30 日）	
	华润元大富时中国 A50 指数 A	华润元大富时中国 A50 指数 C
1.本期已实现收益	1,090,000.06	12,218.53
2.本期利润	-10,673,504.40	-134,948.57
3.加权平均基金份额本期利润	-0.3107	-0.3165
4.期末基金资产净值	101,017,742.29	1,290,858.18
5.期末基金份额净值	3.0001	2.9465

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

华润元大富时中国 A50 指数 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	-9.41%	1.15%	-10.01%	1.16%	0.60%	-0.01%
过去六个月	-2.33%	1.12%	-3.39%	1.14%	1.06%	-0.02%
过去一年	-5.52%	0.98%	-6.81%	0.99%	1.29%	-0.01%

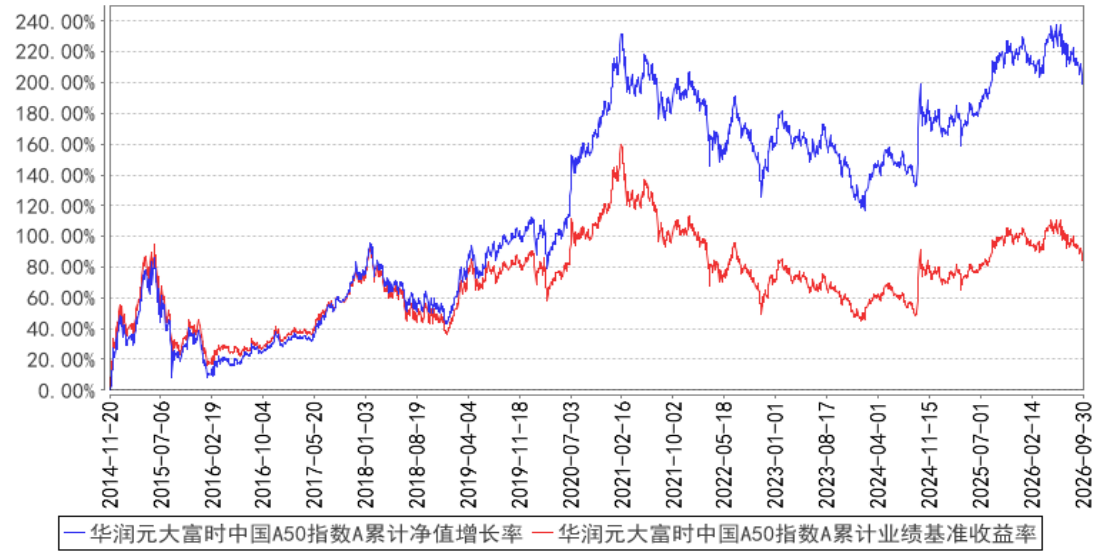
过去三年	17.94%	1.03%	12.88%	1.01%	5.06%	0.02%
过去五年	3.73%	1.06%	-8.45%	1.05%	12.18%	0.01%
过去七年	53.93%	1.12%	4.09%	1.12%	49.84%	0.00%
过去十年	140.20%	1.12%	45.00%	1.12%	95.20%	0.00%
自基金合同生效起至今	200.01%	1.31%	85.21%	1.30%	114.80%	0.01%

华润元大富时中国 A50 指数 C

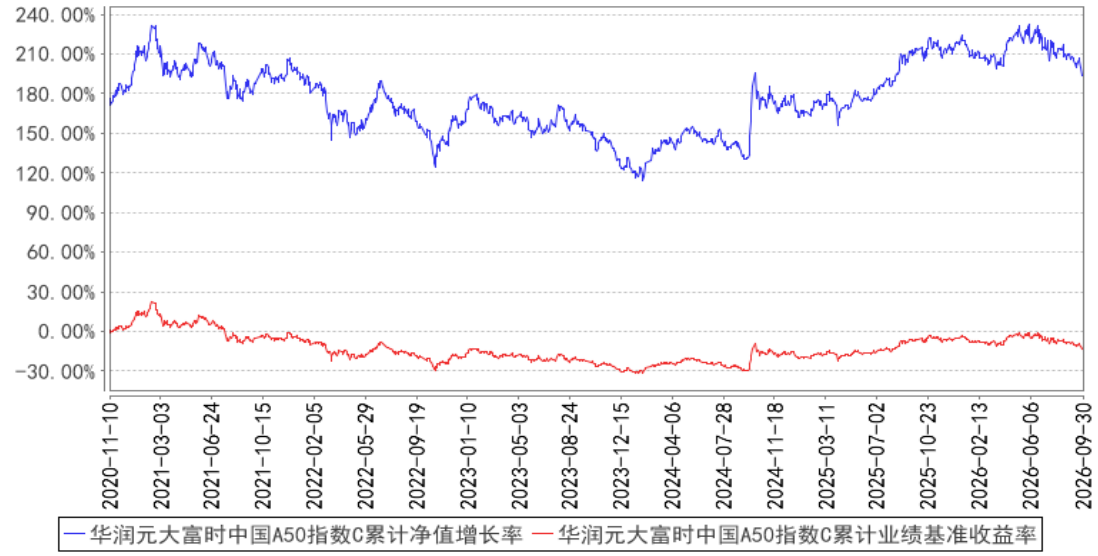
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-9.48%	1.15%	-10.01%	1.16%	0.53%	-0.01%
过去六个月	-2.48%	1.12%	-3.39%	1.14%	0.91%	-0.02%
过去一年	-5.81%	0.98%	-6.81%	0.99%	1.00%	-0.01%
过去三年	16.87%	1.03%	12.88%	1.01%	3.99%	0.02%
过去五年	2.14%	1.06%	-8.45%	1.05%	10.59%	0.01%
自基金合同生效起至今	194.65%	4.79%	-12.69%	1.10%	207.34%	3.69%

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

华润元大富时中国**A50**指数**A**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



华润元大富时中国**A50**指数**C**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



3.3 其他指标

无。

§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	2017 年 8 月 2 日	-	17 年	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

					月加入华润元大基金管理有限公司，现任公司权益量化部基金经理。目前担任华润元大富时中国 A50 指数型证券投资基金、华润元大量化优选混合型证券投资基金、华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金、华润元大信息传媒科技混合型证券投资基金、华润元大核心动力混合型证券投资基金基金经理。

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

本报告期内无上述兼任情况。

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

本基金作为被动指数型基金，报告期内，本基金采用完全复制法紧密跟踪富时中国 A50 指数，少数关联方股票用同行业的大盘绩优价值股做替代。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末华润元大富时中国 A50 指数 A 的基金份额净值为 3.0001 元，本报告期基金份额净值增长率为-9.41%;截至本报告期末华润元大富时中国 A50 指数 C 的基金份额净值为 2.9465 元，本报告期基金份额净值增长率为-9.48%。同期业绩比较基准收益率为-10.01%。

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	95,411,208.28	92.62
	其中：股票	95,411,208.28	92.62
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	6,367,487.67	6.18
	其中：债券	6,367,487.67	6.18
	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	1,215,505.54	1.18
8	其他资产	24,526.55	0.02
9	合计	103,018,728.04	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	9,059,718.00	8.86
C	制造业	48,804,792.15	47.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,324,995.62	3.25
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	2,019,462.00	1.97
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,153,156.25	3.08
J	金融业	27,074,472.26	26.46
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	1,974,612.00	1.93
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	95,411,208.28	93.26

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 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	600519	贵州茅台	6,000	7,551,720.00	7.38
2	300750	宁德时代	21,040	6,124,954.40	5.99
3	601398	工商银行	719,901	5,960,780.28	5.83
4	300308	中际旭创	5,300	4,284,732.00	4.19
5	600036	招商银行	98,212	4,052,227.12	3.96
6	600900	长江电力	116,503	3,324,995.62	3.25
7	601138	工业富联	54,700	3,183,540.00	3.11
8	688256	寒武纪	3,125	3,153,156.25	3.08
9	601899	紫金矿业	98,100	2,922,399.00	2.86
10	601318	中国平安	50,805	2,707,398.45	2.65

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	6,367,487.67	6.22
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	6,367,487.67	6.22

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	019771	25 国债 06	63,000	6,367,487.67	6.22

注：本基金本报告期期末仅持有 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

无。

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

无。

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

无。

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）					-84,217.57
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

本基金以套期保值为目的进行股指期货交易，利用股指期货提高交易效率，降低申购赎回和仓位频繁调整对投资组合的影响。

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

本基金本报告期未持仓国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期未持仓国债期货。

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是否出现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

因工商银行重要信息系统投产变更风险管控不到位、未按规定报告重要信息系统突发事件等，国家金融监督管理总局对其做出罚款的处罚决定。

因招商银行部分机构未纳入并表管理范围、未从银行集团层面对同一客户统一授信等，国家金融监督管理总局对其做出罚款的处罚决定。

报告期内，本基金管理人严格遵循基金投资管理相关制度要求，上述证券发行主体的违法违规行为暂不会造成重大负面影响，投资决策程序符合法律法规和公司制度的规定。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本报告期内本基金投资的前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	6,128.45
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	18,398.10
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	24,526.55

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

单位：份

项目	华润元大富时中国 A50 指	华润元大富时中国 A50

	数 A	指数 C
报告期期初基金份额总额	34,976,454.86	449,719.79
报告期期间基金总申购份额	766,467.52	40,352.64
减:报告期期间基金总赎回份额	2,071,854.42	51,977.22
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	33,671,067.96	438,095.21

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

单位：份

项目	华润元大富时中国 A50 指数 A	华润元大富时中国 A50 指数 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	310,308.25	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	310,308.25	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	0.92	-

注：1、申购/买入总份额含红利再投资、转换入份额。

2、对于分类基金，比例的分母采用各自类别的总份额。

3、申购相关费率符合基金合同和招募说明书等法律文件的约定。

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

无。

§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

2026 年 10 月 27 日