

华润元大欣享混合型发起式证券投资基金 2022 年第 3 季度报告

2022 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：兴业银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 10 月 26 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 10 月 25 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 2022 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	华润元大欣享混合
基金主代码	004928
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 8 月 10 日
报告期末基金份额总额	10,769,562.19 份
投资目标	本基金将以严格的风险控制为前提，结合科学严谨、具有前瞻性的宏观策略分析以及深入的个股/个券挖掘，力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金在资产配置中贯彻“自上而下”的策略，根据宏观经济环境、财政及货币政策趋势以及基金管理人对大类资产走势的判断，并通过战略资产配置策略和战术资产配置策略的有机结合，持续、动态、优化确定投资组合的资产配置比例。股票投资方面，本基金通过定量分析和定性分析相结合的方法挖掘优质上市公司，筛选其中安全边际较高的个股构建投资组合。本基金投资策略还包括存托凭证投资策略、债券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、资产支持证券投资策略等。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*10%+恒生指数收益率*10%+中债总指数（全价）收益率*80%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，属于中等预期收益和预期风险水平的投资品种。

	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	兴业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华润元大欣享混合 A	华润元大欣享混合 C
下属分级基金的交易代码	004928	004929
报告期末下属分级基金的份额总额	531,257.97 份	10,238,304.22 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（2022 年 7 月 1 日-2022 年 9 月 30 日）	
	华润元大欣享混合 A	华润元大欣享混合 C
1. 本期已实现收益	2,628.35	45,525.76
2. 本期利润	-685.26	-16,550.25
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0012	-0.0016
4. 期末基金资产净值	515,959.26	9,920,604.91
5. 期末基金份额净值	0.9712	0.9690

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

华润元大欣享混合 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	-0.14%	0.03%	-3.22%	0.21%	3.08%	-0.18%
过去六个月	-0.02%	0.02%	-2.56%	0.25%	2.54%	-0.23%
过去一年	0.76%	0.05%	-4.41%	0.27%	5.17%	-0.22%
自基金合同	-2.88%	0.31%	-2.42%	0.25%	-0.46%	0.06%

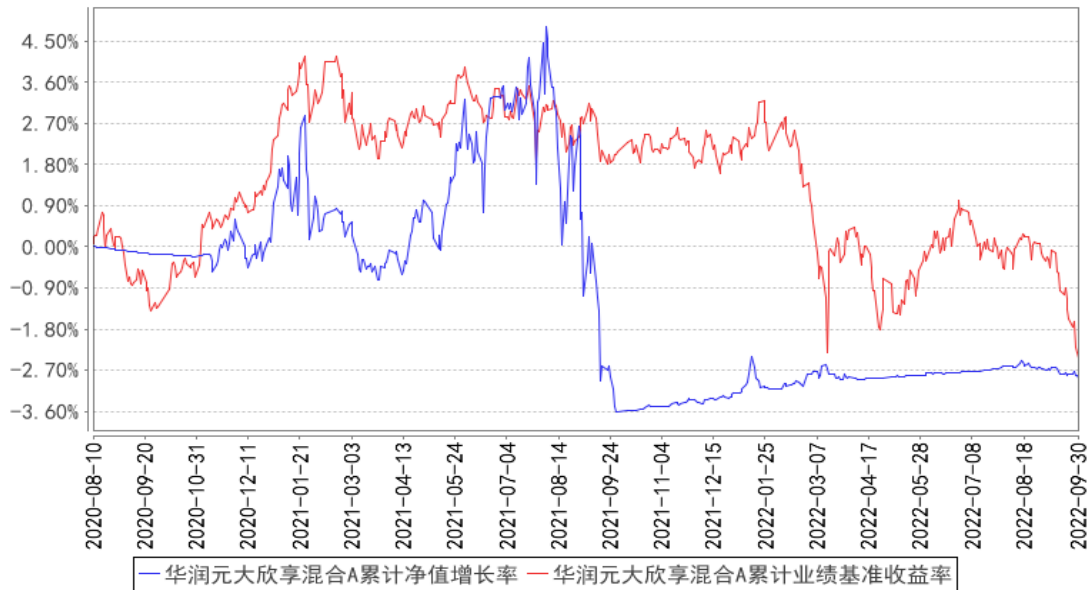
生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

华润元大欣享混合 C

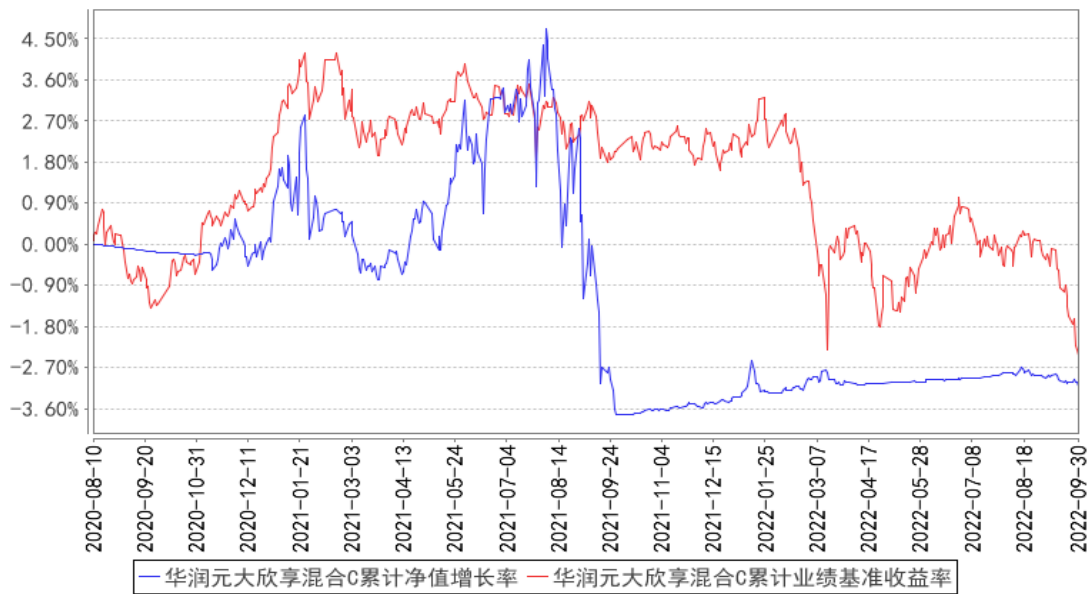
阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.16%	0.03%	-3.22%	0.21%	3.06%	-0.18%
过去六个月	-0.07%	0.02%	-2.56%	0.25%	2.49%	-0.23%
过去一年	0.65%	0.05%	-4.41%	0.27%	5.06%	-0.22%
自基金合同 生效起至今	-3.10%	0.31%	-2.42%	0.25%	-0.68%	0.06%

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

华润元大欣享混合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



华润元大欣享混合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



§ 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	本基金的基金经理	2020年10月23日	-	13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；2020年10月23日起担任华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金、华润元大欣享混合型发起式证券投资基金基金经理；2022年2月18日担任华润元大臻选回报混合型证券投资基金基金经理；2022年6月23日起担任华润元大ESG主题混合型证券投资基金基金经理。
胡永杰	原基金的基金经理	2021年1月25日	2022年8月8日	7年	曾任招商银行总行信息技术部开发工程师、深圳前海金信大数据金融服务有限公司研究员。2017年加入公司，现担任量化指数部基金经理。2021年1月25

					日起担任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、华润元大富时 A50 指数型证券投资基金、华润元大成长精选股票型发起式证券投资基金；2022 年 2 月 18 日起担任华润元大臻选回报混合型证券投资基金基金经理；2022 年 6 月 23 日起担任华润元大 ESG 主题混合型证券投资基金基金经理。2021 年 1 月 25 日至 2022 年 8 月 8 日担任华润元大欣享混合型发起式证券投资基金基金经理。
罗黎军	本基金的基金经理	2022 年 8 月 8 日	-	10 年	曾任安信证券国际业务部、五牛基金证券投资部、香江金融控股集团投资管理部研究员。2017 年 9 月加入华润元大基金管理有限公司，2020 年 7 月 16 日起担任华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金、华润元大润泰双鑫债券型证券投资基金基金经理。2022 年 8 月 8 日起担任华润元大欣享混合型发起式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

无

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

7 月，市场整体震荡下行，7 月份上证指数跌 4.28%，创业板指同步下跌，单月跌幅为 4.99%，市场整体的万得全 A 下跌 2.67%。市场前期已经充分反映了环比因素的利好，包括疫情之后经济的改善、防疫的缓和与政策的支持等，当前基金仓位已经重新回到高点，并且再次出现了显著的集中。但市场近期并没有观察到增量资金的流入，而是以存量资金为主。目前市场已经接近了环比改善的拐点。制造业 PMI 为 49.0，低于前值的 50.2；非制造业 PMI 为 53.8，低于前值的 54.7。从分项来看，代表供给端的生产采购和进口，需求端的新订单和出口以及库存端的产成品和原材料均有不同程度的走低。建筑业 PMI 为 59.2，基建仍为下半年的主基调，预计下半年将仍有小幅提高。

8 月，指数弱势调整，三大指数月 K 线收跌，个股板块跌多涨少。月初沪指弱势回调后，强势震荡上扬，逼近 3300 点，不过涨势未能延续至月末，沪指震荡下行，最终月 K 线收绿。截止到 8 月 31 日，上证指数月 K 线下跌 1.57%、深成指月 K 线下跌 3.68%、创业板指月 K 线下跌 3.75%。个股板块跌多涨少，煤炭、石油石化、综合、非银金融和传媒等行业走势较强，汽车、电力设备、机械设备、建筑材料和钢铁等板块下跌。资金面方面，8 月 LPR 非对称性调降为市场注入适当流动性，而降息后短中期市场利率仍大幅偏移政策利率，显示出流动性的合理充裕。

9 月，A 股在美联储加息预期强化所致的汇率快速贬值、美股持续羸弱下跌等影响下大幅收跌、市场交投情绪明显萎靡。大盘股指数跌幅较小，上证 50、沪深 300 分别下跌 5.49%、6.72%。小盘及成长类指数跌幅较大，中证 1000 下跌 9.27%，创业板指下跌 10.95%。9 月制造业 PMI 录得 50.1%，较上月上升 0.7 个百分点。分项上仅生产指数高于临界点，表明内需仍较疲弱。受本土疫情散发影响，9 月服务业 PMI 较 8 月回落 3pct 至 48.9%；外需继续收缩，9 月 PMI 新出口订单较 8 月下降 1.1 个百分点。

本基金规模较小，债券资产以利率债为主，权益部分以行业龙头配置为主。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末华润元大欣享混合 A 的基金份额净值为 0.9712 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.14%；截至本报告期末华润元大欣享混合 C 的基金份额净值为 0.9690 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.16%。同期业绩比较基准收益率为-3.22%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金为发起式基金，且截至本报告期末，本基金基金合同生效未满 3 年，暂不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条第一款的规定。

§ 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	318,666.00	3.04
	其中：股票	318,666.00	3.04
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	9,139,289.86	87.32
	其中：债券	9,139,289.86	87.32
	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	1,007,543.77	9.63
8	其他资产	660.07	0.01
9	合计	10,466,159.70	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	279,016.00	2.67
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	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	39,650.00	0.38
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	318,666.00	3.05

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	600893	航发动力	1,000	41,950.00	0.40
2	300750	宁德时代	100	40,089.00	0.38
3	601888	中国中免	200	39,650.00	0.38
4	300122	智飞生物	400	34,572.00	0.33
5	002304	洋河股份	200	31,630.00	0.30
6	601799	星宇股份	200	30,478.00	0.29
7	300760	迈瑞医疗	100	29,900.00	0.29
8	002594	比亚迪	100	25,201.00	0.24
9	301349	信德新材	200	23,622.00	0.23
10	688012	中微公司	200	21,574.00	0.21

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	5,047,419.18	48.36
2	央行票据	-	-
3	金融债券	4,091,870.68	39.21
	其中：政策性金融债	4,091,870.68	39.21
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	9,139,289.86	87.57

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	019638	20 国债 09	50,000	5,047,419.18	48.36
2	018008	国开 1802	40,000	4,091,870.68	39.21

注：本基金本报告期末仅持有 2 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

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

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，前十大证券发行主体未出现违法违规行为，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规定的备选股票库

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	560.15
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	99.92
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	660.07

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股票。

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	华润元大欣享混合 A	华润元大欣享混合 C
报告期期初基金份额总额	660,218.86	10,506,127.89
报告期期间基金总申购份额	2,269.13	17,884.86
减：报告期期间基金总赎回份额	131,230.02	285,708.53
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	531,257.97	10,238,304.22

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	华润元大欣享混合 A	华润元大欣享混合 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	-	10,000,000.00

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	-	10,000,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	-	92.85

注：本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 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	92.85	10,000,000.00	92.85	-
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,000.00	92.85	10,000,000.00	92.85	-

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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	2022 年 7 月 1 日至 2022 年 9 月 30 日	10,000,000.00	0.00	0.00	10,000,000.00	92.8543

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。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 10 备查文件目录

10.1 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。

10.2 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。

10.3 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

2022 年 10 月 26 日