

华润元大欣享混合型发起式证券投资基金 2023 年第 3 季度报告

2023 年 8 月 10 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：2023 年 10 月 25 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 2023 年 10 月 24 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 2023 年 7 月 1 日起至 8 月 10 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	10,514,174.40 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	362,649.07 份	10,151,525.33 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（2023 年 7 月 1 日-2023 年 8 月 10 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	-514.12	-17,817.23
2. 本期利润	1,028.59	21,942.88
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0024	0.0022
4. 期末基金资产净值	353,544.01	9,865,358.63
5. 期末基金份额净值	0.9749	0.9718

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	0.55%	0.07%	3.27%	0.16%	-2.72%	-0.09%
过去六个月	-0.10%	0.07%	3.02%	0.18%	-3.12%	-0.11%
过去一年	0.13%	0.06%	3.58%	0.23%	-3.45%	-0.17%
过去三年	-2.51%	0.27%	2.99%	0.24%	-5.50%	0.03%

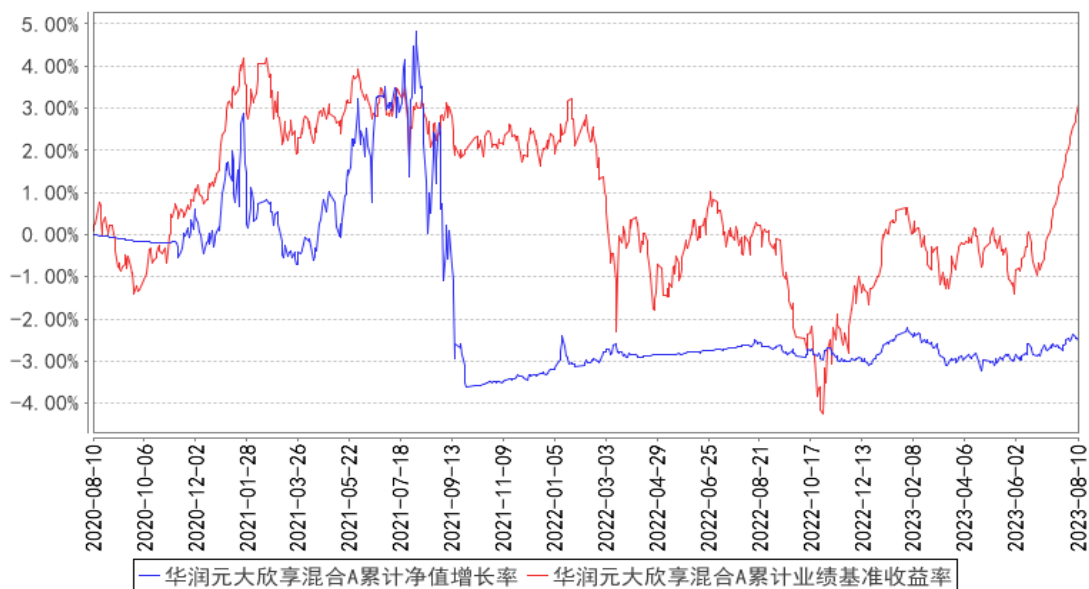
自基金合同 生效起至今	-2.51%	0.27%	3.08%	0.24%	-5.59%	0.03%
----------------	--------	-------	-------	-------	--------	-------

华润元大欣享混合 C

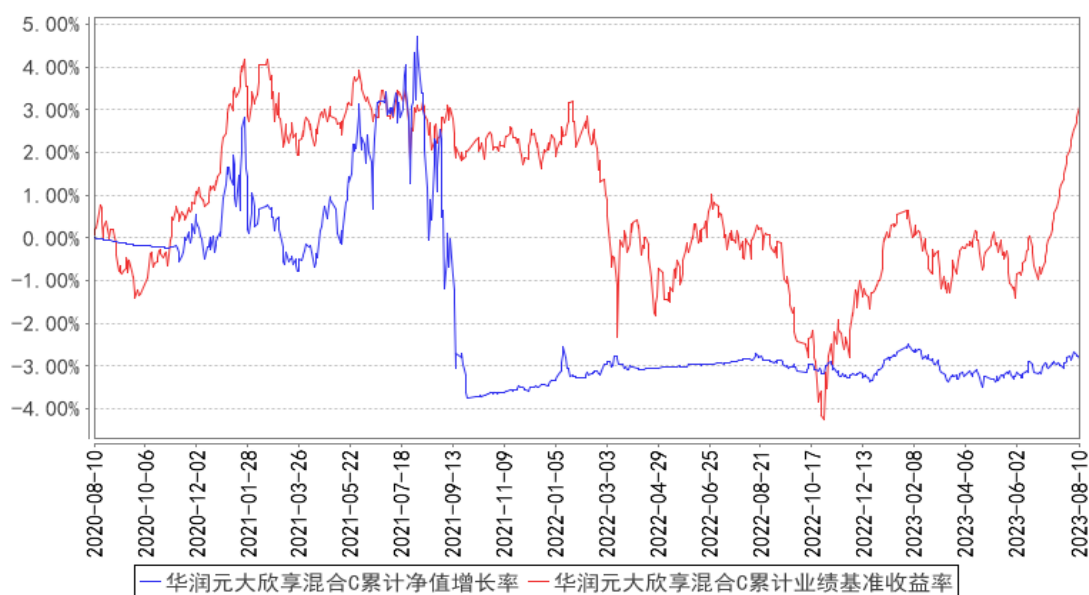
阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.52%	0.07%	3.27%	0.16%	-2.75%	-0.09%
过去六个月	-0.15%	0.07%	3.02%	0.18%	-3.17%	-0.11%
过去一年	0.03%	0.06%	3.58%	0.23%	-3.55%	-0.17%
过去三年	-2.82%	0.27%	2.99%	0.24%	-5.81%	0.03%
自基金合同 生效起至今	-2.82%	0.27%	3.08%	0.24%	-5.90%	0.03%

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	-	14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，现任公司权益量化部总经理、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、华润元大欣享混合型发起式证券投资基金、华润元大臻选回报混合型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	-	11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，现担任权益量化部基金经理。目前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。

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

2023 年第三季度股票市场震荡下行。7 月下旬政治局会议对经济、地产、资本市场的表述均有积极变化，8 月下旬资本市场亦有降低印花税、限制减持等重磅政策措施出台，但皆在短暂提振市场情绪后再次下行，主要原因在于政策是渐进式的，显现效果需要时间，而现实层面的经济数据较弱，难以扭转投资者的悲观预期；此外，海外对中国经济预期转悲观，人民币持续贬值，导致外资持续流出，也给存量博弈的市场造成较大压力。我们在市场的普遍悲观中应该看到积极的因素，政策底部日益清晰，经济在政策推动和补库行为下可能迎来反弹，市场经过长期下行估值亦在底部，拉长周期，我们认为当前位置大概率是市场的底部区间。

2023 年第三季度债券市场先扬后抑，8 月中下旬达到高点，随后持续调整，一方面与流动性收紧相关，另一方面在持续的政策推动下对经济的预期亦有所变化。

欣享 8 月 10 日为最后运作日，8 月 11 日起进入基金财产清算程序，清算期将择机退出投资收回现金。

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 0.9749 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.55%；截至本报告期末华润元大欣享混合 C 的基金份额净值为 0.9718 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.52%。同期业绩比较基准收益率为 3.27%。

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，本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。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。本基金已于 2023 年 8 月 11 日进入基金财产清算程序。

§ 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	2,677,504.00	26.14
	其中：股票	2,677,504.00	26.14
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	7,112,134.80	69.45
	其中：债券	7,112,134.80	69.45
	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	449,027.61	4.38
8	其他资产	2,432.02	0.02
9	合计	10,241,098.43	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	43,310.00	0.42
B	采矿业	175,862.00	1.72
C	制造业	1,375,601.00	13.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	88,360.00	0.86
E	建筑业	43,800.00	0.43
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	71,101.00	0.70
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	770,849.00	7.54
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	36,786.00	0.36
M	科学研究和技术服务业	39,450.00	0.39
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	32,385.00	0.32
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,677,504.00	26.20

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	200	375,000.00	3.67
2	300750	宁德时代	800	197,200.00	1.93
3	000858	五粮液	700	123,417.00	1.21
4	600036	招商银行	3,600	122,904.00	1.20
5	000568	泸州老窖	500	118,500.00	1.16
6	601318	中国平安	1,900	97,584.00	0.95
7	600900	长江电力	4,000	88,360.00	0.86
8	002594	比亚迪	300	78,810.00	0.77
9	601398	工商银行	13,500	63,315.00	0.62
10	601166	兴业银行	3,600	59,184.00	0.58

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	7,112,134.80	69.60
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	7,112,134.80	69.60
----	----	--------------	-------

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	019696	23 国债 03	30,000	3,052,587.95	29.87
2	019698	23 国债 05	30,000	3,041,979.45	29.77
3	019693	22 国债 28	10,000	1,017,567.40	9.96

注：本基金本报告期末仅持有 3 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

因兴业银行股份有限公司违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定，中国人民银行于对其作出处以罚款的监管措施。

因招商银行股份有限公司为同业投资提供第三方信用担保等二十七项违规行为，中国银行保险监督管理委员会对其作出处以罚款的监管措施。

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	2,432.02
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	2,432.02

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	443,623.38	10,167,052.12
报告期期间基金总申购份额	738.94	-

减:报告期期间基金总赎回份额	81,713.25	15,526.79
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	362,649.07	10,151,525.33

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	-
-管理人持有的本基金份额	10,000,000.00
-买入/申购总份额	-
-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(%)	95.11

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	95.11	10,000,000.00	95.11	3年
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	95.11	10,000,000.00	95.11	3年

§ 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	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
---	----------------	------------

投资者类别	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	2023 年 7 月 1 日至 2023 年 9 月 30 日	10,000,000.00	0.00	0.00	10,000,000.00	95.1097
产品特有风险							
<p>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。</p>							

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

2023 年 10 月 25 日