

华润元大富时中国A50指数型证券投资基金

2019 第一季度 报告

2019年3月31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4月5日
§ 1 重要提示
基金管理人的董事会及董事声明本基金所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其中内容的真实性、准确性和完整性承担责任，但法律、行政法规另有规定的除外。
基金托管人承诺以诚实信用、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，投资人应在作出投资决策前仔细阅读本基金的招募说明书。
本报告期无财务数据。

本报告期无1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称：华润元大富时中国A50指数

交易代码：000808

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

报告期基金净值总额：290,674,575.00

报告目标：无

投资目标：本基金主要通过投资于A股市场，通过严格的风险控制和有效的数量化风险管理手段，力争创造本基金的长期稳定收益。

本基金将主要投资于复权后市值排名在A股市场前50位的股票，同时结合定期调整和动态调整，精选出具有成长性、盈利能力强、估值合理的股票，以实现本基金的长期增值。

本基金的股票投资比例为基金总资产的80%以上，现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不超过基金总资产的20%，现金及到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金总资产的5%。

基金的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，投资人应在作出投资决策前仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期无财务数据。

本报告期无1月1日起至3月31日止。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

报告期(2019年1月1日 - 2019年3月31日)

4,376,807.82

期末可供分配利润：96,634,822.11

期末基金资产净值：4,421,411,633.93

期末基金份额净值：1.0004

注：1.本期利润：指报告期基金利息收入、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，本期利润为期初至报告期末的基金利润总额减去基金的管理费、托管费和赎回费后的余额。

2.本期可供分配利润：本期利润减去本期间的公允价值变动收益。

3.期末基金资产净值：基金资产总值减去负债后的金额。

4.期末基金份额净值：基金资产净值除以报告期末的基金份额总数。

5.报告期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 000318 中国平安 599,679 54,715,357.00 12.11

2 000002 中国银行 4,000,000 4,000,000.00 0.90

3 000001 中国石油 3,000,000 3,000,000.00 0.65

4 000028 中国神华 3,000,000 29,320,000.00 6.45

5 000005 五粮液 2,000,000 20,791,903.12 4.58

6 000360 沪电股份 1,000,700 19,381,300.00 4.29

7 000651 中国国航 2,000,000 32,720.70 0.07

8 000002 万科A 499,500 15,315,500.00 3.38

9 000001 中国建筑 300,000 14,845,098.00 3.28

10 000003 中国重工 2,131,300 13,513,700.00 2.93

合计 20,269,357.00 452.58

5.4 报告期末按公允价值品种分类的证券投资基金组合

序号 债券品种 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 国债 - -

2 中央企业债 - -

3 金融债 38,301,830.00 4.08

4 企业债 - -

5 金融债 - -

6 中期票据 - -

7 可转换债券 - -

8 其他 - -

9 合计 38,301,830.00 4.08

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(手) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000002 中国银行 383,000 18,301,830.00 4.08

注：1.本期末无应收利息、应付债券、其他应收款、买入返售金融资产、卖出回购金融资产、应收款项、存货等。

2.基金投资的前十名证券的市值占基金资产净值的比例为100%。

3.报告期内本基金无卖出回购金融资产情况。

4.3.2 基金投资组合的分析

4.3.2.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的各项资产

序号 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 制造业 24,605,200 5.48%

2 信息传输、软件和信息技术服务业 1,313,000 0.28%

3 其他行业 204,300 0.04%

4.3.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 计算机、通信和其他电子设备制造业 24,605,200 5.48%

2 信息传输、软件和信息技术服务业 1,313,000 0.28%

3 其他行业 204,300 0.04%

4.3.2.3 报告期末按行业分类的债券投资组合

序号 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 制造业 18,301,830.00 4.08%

4.3.3 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证券

序号 证券代码 证券名称 数量(股) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000318 中国平安 599,679 54,715,357.00 12.11

2 000002 中国银行 4,000,000 4,000,000.00 0.90

3 000001 中国石油 3,000,000 3,000,000.00 0.65

4 000028 中国神华 3,000,000 29,320,000.00 6.45

5 000005 五粮液 2,000,000 20,791,903.12 4.58

6 000360 沪电股份 1,000,700 19,381,300.00 4.29

7 000651 中国国航 2,000,000 32,720.70 0.07

8 000002 万科A 499,500 15,315,500.00 3.38

9 000001 中国建筑 300,000 14,845,098.00 3.28

10 000003 中国重工 2,131,300 13,513,700.00 2.93

4.3.4 报告期内基金投资的前十名股票与基金资产净值比例偏离度情况

4.3.4.1 投资组合的平均市值

4.3.4.2 投资组合的偏离度

4.3.4.3 投资组合的偏离度

4.3.4.4 投资组合的偏离度

4.3.4.5 投资组合的偏离度

4.3.4.6 投资组合的偏离度

4.3.4.7 投资组合的偏离度

4.3.4.8 投资组合的偏离度

4.3.4.9 投资组合的偏离度

4.3.4.10 投资组合的偏离度

4.3.4.11 投资组合的偏离度

4.3.4.12 投资组合的偏离度

4.3.4.13 投资组合的偏离度

4.3.4.14 投资组合的偏离度

4.3.4.15 投资组合的偏离度

4.3.4.16 投资组合的偏离度

4.3.4.17 投资组合的偏离度

4.3.4.18 投资组合的偏离度

4.3.4.19 投资组合的偏离度

4.3.4.20 投资组合的偏离度

4.3.4.21 投资组合的偏离度

4.3.4.22 投资组合的偏离度

4.3.4.23 投资组合的偏离度

4.3.4.24 投资组合的偏离度

4.3.4.25 投资组合的偏离度

4.3.4.26 投资组合的偏离度

4.3.4.27 投资组合的偏离度

4.3.4.28 投资组合的偏离度

4.3.4.29 投资组合的偏离度

4.3.4.30 投资组合的偏离度

4.3.4.31 投资组合的偏离度

4.3.4.32 投资组合的偏离度

4.3.4.33 投资组合的偏离度

4.3.4.34 投资组合的偏离度

4.3.4.35 投资组合的偏离度

4.3.4.36 投资组合的偏离度

4.3.4.37 投资组合的偏离度

4.3.4.38 投资组合的偏离度

4.3.4.39 投资组合的偏离度

4.3.4.40 投资组合的偏离度

4.3.4.41 投资组合的偏离度

4.3.4.42 投资组合的偏离度

4.3.4.43 投资组合的偏离度

4.3.4.44 投资组合的偏离度

4.3.4.45 投资组合的偏离度

4.3.4.46 投资组合的偏离度

4.3.4.47 投资组合的偏离度

4.3.4.48 投资组合的偏离度

4.3.4.49 投资组合的偏离度

4.3.4.50 投资组合的偏离度

4.3.4.51 投资组合的偏离度

4.3.4.52 投资组合的偏离度

4.3.4.53 投资组合的偏离度

4.3.4.54 投资组合的偏离度

4.3.4.55 投资组合的偏离度

4.3.4.56 投资组合的偏离度

4.3.4.57 投资组合的偏离度

4.3.4.58 投资组合的偏离度

4.3.4.59 投资组合的偏离度

4.3.4.60 投资组合的偏离度

4.3.4.61 投资组合的偏离度

4.3.4.62 投资组合的偏离度

4.3.4.63 投资组合的偏离度

4.3.4.64 投资组合的偏离度

4.3.4.65 投资组合的偏离度

4.3.4.66 投资组合的偏离度

4.3.4.67 投资组合的偏离度

4.3.4.68 投资组合的偏离度

4.3