

## 华润元大保本混合型证券投资基金

## [2013]第四季度报告

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:2014年1月22日

基金管理人的董事会及董事保证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2014年1月17日复核了本报告中的财务数据、净值表现、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。

本报告期间自2013年10月1日起至2013年12月31日止。

## §2 基金产品概况

基金简称:华润元大保本混合

交易代码:000273

前端交易代码:

后端交易代码:

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2013年5月11日

报告期末基金份额总额:607,110,327.06份

本基金通过运用投资组合保险技术，严格有效控制本金损失的风险，追求基金资产的稳定增值。

本基金遵循保本增值的投资理念，兼用“恒定比例投资组合保险策略”(CPTP, Constant Proportion Portfolio Insurance)和“时间不变的投资组合保险策略”(TIPPI, Time Invariant Portfolio Protection)进行资产配置，以实现资本的增值的目标。其中CPTP为主要策略，雷动主动调整投资组合，保本增益；TIPPI为辅助策略，旨在保险阶段收

益。具体而言，本基金的投资策略包括资产配置策略、稳健资产投资策略和风险资产投资策略。

业绩比较基准:一年期银行定期存款利率后收益率。

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低风险品种。

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

基金保证人:中海信达担保有限公司

## §3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2013年10月1日 - 2013年12月31日)

1.本期已实现收益 2,965,650.38

2.本期利润 2,639,976.16

3.加权平均基金份额本期利润率 0.0042

4.期末基金资产净值 611,304,659.61

5.期末基金份额 1,007.00

注:1.本期已实现收益指基金本期利润减去必要的费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上公允价值变动收益减去相关费用后的余额，本期利润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)，计算费用后实际收益水平将低于前列数字。

2.所列财务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)，计算费用后实际收益水平将低于前列数字。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

注:1.本基金合同于2013年5月11日生效，截至报告期末，本基金合同生效不满一年。

2.按基金合同规定，本基金合同生效之日起3个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同中的相关约定。

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 任职日期 离任日期 说明

李湘杰 本基金基金经理、投资管理部总经理 2013年9月11日 - 15年

注:1.此处的任职日期为本基金合同生效日。

2.证券从业从年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

在本报告期内，基金管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规、基金合同的约定，及时披露相关信息，遵守基金合同和其他法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则，谨慎和勤勉地履行职责，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

本报告期内，基金管理人严格执行公平交易制度及公司内部制度关于公平交易的相关规定，在投资管理活动中对所有研究部门、投资部门、交易部门、风险管理等部门执行情况良好，未发生违反公平交易制度的行为。

4.4 制度执行情况

本报告期内，基金管理人严格执行公平交易制度及公司内部制度关于公平交易的相关情况，未发生违反公平交易制度的行为。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

2014年预计GDP增长率为7.5%，增速较微幅放缓。货币政策继续中性偏紧，全年利率中枢将维持高位运行，宏观环境不利股市流动性与基本面股类企业盈利方面，预计全年A股盈利增速从2013年的15.2%回落至12%。

四季度全会定调全面深化改革，改革将进入全面推进的阶段，但凡市场化的改革，包括财税、金融、国资、资源配置等方面，对于国有垄断行业、银行业等行业来说无疑是负面的；而对于新兴产业、民营成长型企业而言将在市场化改革的进程中受益。

我们看好消费升级概念、TMT和医药类投资机会，未来改革的投资机会。

4.6 投资组合报告

基金管理人:国泰基金管理有限公司

基金托管人:中国建设银行股份有限公司

报告送出日期:二〇一四年一月二十二日

重要提示

基金管理人的董事会及董事保证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；

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2014年1月20日复核了本报告中的财务数据、净值表现、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。

本报告期间自2013年10月1日起至2013年12月31日止。

## §2 基金产品概况

基金简称:国泰6个月短期理财债券型证券投资基金

交易代码:03029

场内简称:国泰6月

基金合同生效日:2012年9月25日

报告期末基金份额总额:55,980,180,945.00份

基金份额

本基金合同生效以来的期间回报率:0.00%

报告期期间回报率:0.00%

</