

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	
§ 1 重要提示	
基金管理人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规定,于2014年1月17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。投资者有风险,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。 本报告自2014年10月1日起至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	2965.630.38
后端交易代码	2639.976.16
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日	2013年9月11日
报告期末基金份额总额	607,110,327.06份
投资目标	本基金通过运用投资组合保险技术,严格控制本基金损失的风险,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”(CPPI, Constant Proportion Portfolio Insurance)和“时间不相关性投资组合保险策略”(TIPP, Time Invariant Portfolio Protection)进行资产配置,以实现保本和增值的目标。其中,CPPI为主动策略,旨在动态调整投资组合,保本增值;TIPP为辅助策略,旨在保护阶段性收益。
投资策略	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税后收益率 风险收益特征 本基金为保本混合型基金,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 中海信托股份有限公司
§ 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	
1.本期已实现收益	2965.630.38
2.本期利润	2639.976.16
3.加权平均基金份额本期利润	0.0042
4.期末基金份额净值	611.304.659.61
5.期末基金资产净值	1.007
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、所述基金业绩指标包括持有期间本基金的各项费用(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率水平要低于所列数字。 3.2 基金净值表现 3.2.1 本报告期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	
阶段	净值增长率① 净值增长率② 过去三个月 0.40% 0.07% 0.76% 0.01% -0.36% 0.06%
业绩比较基准 业绩比较基准 业绩比较基准 业绩比较基准 业绩比较基准 业绩比较基准	业绩比较基准 业绩比较基准 业绩比较基准 业绩比较基准 业绩比较基准 业绩比较基准
3.2.2 自基金合同生效以来基金业绩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	

5.1 报告期末基金资产组合情况		金额(元)	占基金总资产的比例(%)
序号	项目		
1	权益投资	2,789,778.44	0.46
	其中:股票	2,789,778.44	0.46
2	固定收益投资	113,830,689.80	18.58
	其中:债券	113,830,689.80	18.58
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	123,579,489.37	20.17
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	365,156,327.42	59.59
6	其他资产	7,450,233.45	1.22
7	合计	612,806,518.48	100.00
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合			
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	623,975.44	0.10
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,533,743.00	0.25
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	632,060.00	0.10
J	金融业	-	-
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	-	-
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	-	-