

华润元大信息传媒科技股票型 证券投资基金 2014 年第 2 季度报告

2014 年 6 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2014 年 7 月 18 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2014 年 7 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 2014 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	华润元大信息传媒科技股票
交易代码	000522
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 3 月 31 日
报告期末基金份额总额	158,120,916.93 份
投资目标	本基金主要投资于信息传媒科技产业中的优质上市公司，在控制风险、确保基金资产流动性的前提下，力争实现基金净值增长持续地超越业绩比较基准。
投资策略	<p>1、大类资产配置策略 宏观经济、政策法规以及证券市场表现为资产配置策略的主要考量因素。</p> <p>2、股票投资策略 股票投资策略是本基金的核心部分，本基金将结合定量与定性分析，充分发挥基金管理人研究团队和投资团队的选股能力，选择具有长期持续增长能力的公司。</p> <p>3、债券投资策略 本基金的债券投资采取稳健的投资管理方式，获得与风险相匹配的投资收益，以实现在一定程度上规避股票市场的系统性风险和保证基金资产的流动性。</p> <p>4、股指期货投资策略 本基金将以股指期货为主要的金融衍生工具，与资产配置策略进行搭配。</p> <p>5、权证投资策略 本基金管理人将以价值分析为基础，在采用权证定价模型分析其合</p>

	<p>理定价的基础上，充分考量可投权证品种的收益率、流动性及风险收益特征，通过资产配置、品种与类属选择，力求规避投资风险、追求稳定的风险调整后收益。</p> <p>6、资产支持证券投资策略 本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。</p> <p>7、现金管理 在现金管理上，本基金通过对未来现金流的预测进行现金预算管理，及时满足本基金运作中的流动性需求。</p>
业绩比较基准	中证 TMT 产业主题指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于证券投资基金中的高风险品种，预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。
基金管理人	华润元大基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§ 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（2014年4月1日—2014年6月30日）
1. 本期已实现收益	-4,860,758.34
2. 本期利润	4,555,122.23
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0208
4. 期末基金资产净值	162,613,439.12
5. 期末基金份额净值	1.028

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。

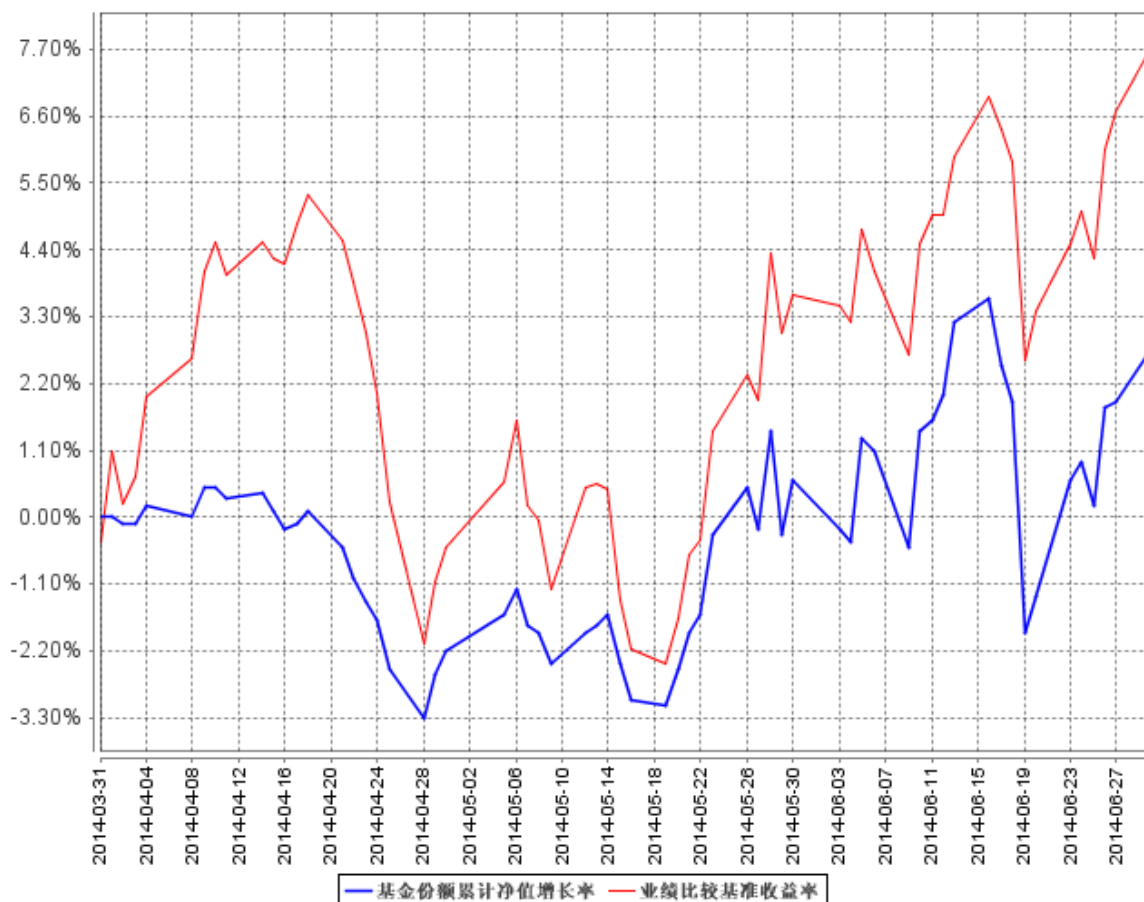
3.2 基金净值表现

3.2.1 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 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	2.80%	0.92%	8.20%	1.10%	-5.40%	-0.18%

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

基金份额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



注：1、本基金基金合同于 2014 年 3 月 31 日生效，截至报告期末，本基金基金合同生效不满一年。
 2、按基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截至报告期末，本基金仍处于建仓期。

§ 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		
张仲维	本基金基金经理	2014 年 3 月 31 日	-	4 年	曾任台湾元大宝来证券投资信托股份有限公司基金经理。2014 年 3 月 31 日起至今担任华润元大信息传媒科技股票型证券投资基金基金经理。中国台湾，台湾政治大学国际财务管理硕士，具有基金从业资格。

注：1. 此处的任职日期为本基金合同生效日。

2. 证券从业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业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度上证综指上涨 0.74%，创业板指数上涨 5.79%，创业板综指上涨 10.83%，显示小市值公司表现比大市值公司来的亮眼。TMT 四大行业中，计算机、通信、电子和传媒行业分别上涨 13.64%、9.08%、8.92%和 8.02%。计算机行业涨幅最高主要是受到政府一系列利好政策出台，刺激计算机中软件和硬件类股都表现亮眼。海外科技相关情况，二季度 NASDAQ 指数上涨 6.07%，重回上升趋势。中国科技指数 ETF 上涨 4.82%，腾讯财报优于预期上涨 10.71%。新在美国上市的中国网路类股如京东、途牛和聚美也都表现亮眼。

本基金在封闭期内维持较低持股，封闭期打开后持仓维持正常水平，主要布局计算机国产化、苹果概念和移动互联网相关主题。行业配置上主要超配计算机行业，主因政府连续出台利好计算机版快的政策，例如：中国政府采购网发布《关于进行信息类协议供货强制节能产品补充招标的通知》，要求所有政府采购的计算机设备不允许安装 Win8 系统。我国即将推出网络安全审查制度，对于进入我国市场的重要信息技术产品和服务都将进行安全审查。中国政府推动金融行业硬件国产化等。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金份额净值增长率为 2.80%，低于业绩比较基准收益率 5.4%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2014 年 6 月中采 PMI 51（前值 50.8），符合预期，汇丰 PMI 小幅下修终值为 50.7，工业仍如之前预期延续改善。从采购相关项上来看，采购量微降而原材料/产成品库存均处于低位，显示企业补库存心态仍然偏谨慎。展望第三季度，工业趋势有需求扩张和政策加码的利好，但同时也存在去年同期基数较高和地产低迷加剧的不利影响，综合来看可能改善幅度有限。在宏观环境没有太大改变之下，我们持续看好符合改革方向的成长股，主要看好 TMT 和医疗行业。

目前看好整体 TMT 行业表现，未来主要在于选股，市场目前分化严重，小市值公司股价表现亮眼，大市值公司表现疲弱。基金将适当增加小市值公司股票仓位，以期增加基金收益。产业均衡布局 TMT 四个类股，主要看好计算机国产化、苹果概念和移动互联网相关主题。在中国经济转型的过程中，看好各行业信息化将利好计算机相关公司的软硬件服务，例如金融行业信息化、军工行业信息化、教育和医疗行业信息化。在苹果概念股中，主要看好有供应新零售组件的相关公司。最后在互联网行业中主要看好互联网医疗和互联网教育相关公司。对于上述相关公司，一旦随着市场大幅调整，基金将择机加仓。

§ 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	139,228,953.89	83.56
	其中：股票	139,228,953.89	83.56
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	8,500,000.00	5.10
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	14,960,206.04	8.98
7	其他资产	3,937,723.62	2.36
8	合计	166,626,883.55	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	62,835,767.43	38.64

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	1,439,597.55	0.89
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	57,452,305.93	35.33
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	3,169,159.98	1.95
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	14,332,123.00	8.81
S	综合	-	-
	合计	139,228,953.89	85.62

5.3 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	300059	东方财富	487,780	5,867,993.40	3.61
2	601231	环旭电子	163,908	5,054,922.72	3.11
3	300291	华录百纳	137,000	4,807,330.00	2.96
4	300010	立思辰	187,123	4,663,105.16	2.87
5	002475	立讯精密	141,245	4,630,011.10	2.85
6	300133	华策影视	134,460	4,295,997.00	2.64
7	002439	启明星辰	197,904	4,233,166.56	2.60
8	002292	奥飞动漫	113,738	4,174,184.60	2.57
9	300104	乐视网	91,545	4,018,825.50	2.47
10	002008	大族激光	230,454	3,996,072.36	2.46

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：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

注：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

注：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

注：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有股指期货。

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有国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：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有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 东方财富 2014 年 1 月 9 日公告称，日前全资子公司上海天天基金销售有限公司，收到上海证监局沪证监决[2014]1 号行政监管措施决定书。根据《证券投资基金销售管理办法》的规定，责令天天基金限期整改。本公司对以上证券的投资决策程序符合法律法规及公司制度的相关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为。除此之外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期未被监管部门立案调查，且在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

5.11.2 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	55,800.71

2	应收证券清算款	1,981,073.59
3	应收股利	-
4	应收利息	6,076.47
5	应收申购款	1,894,772.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,937,723.62

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：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

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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

报告期期初基金份额总额	248,844,670.33
报告期期间基金总申购份额	3,437,514.11
减：报告期期间基金总赎回份额	94,161,267.51
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	158,120,916.93

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

注：本报告期期初管理人未持有本基金份额，且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

注：本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

§ 9 备查文件目录

9.1 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、本报告期内在指定报刊上披露的各项公告。

9.2 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。

9.3 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
2014 年 7 月 18 日