

华润元大信息传媒科技股票型 证券投资基金 2014 年半年度报告

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

送出日期：2014 年 8 月 25 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 8 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2014 年 3 月 31 日(基金合同生效日)起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
§5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	11
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	11
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	11
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	14
§7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	34
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	39
7.6 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.....	39
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	39
7.8 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贵金属投资明细.....	39
7.9 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.....	40
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	40
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	40
7.12 投资组合报告附注.....	40
§8 基金份额持有人信息	41

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	41
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	41
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	41
§9 开放式基金份额变动.....	42
§10 重大事件揭示.....	42
10.1 基金份额持有人大会决议.....	42
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	42
10.4 基金投资策略的改变.....	42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	42
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	42
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	43
10.8 其他重大事件.....	44
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	45
§12 备查文件目录.....	45
12.1 备查文件目录.....	45
12.2 存放地点.....	45
12.3 查阅方式.....	45

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华润元大信息传媒科技股票型证券投资基金
基金简称	华润元大信息传媒科技股票
基金主代码	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
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
报告期末基金份额总额	158,120,916.93 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华润元大基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	何特	田青
	联系电话	0755-88399015	010-67595096
	电子邮箱	hete@cryuantafund.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		4000-1000-89	010-67595096
传真		0755-88399045	010-66275853
注册地址		深圳市前海深港合作区前湾一路鲤鱼门街一号前海深港合作区管理局综合办公楼 A 栋 201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		深圳市福田区中心四路 1-1 号嘉里建设广场第三座 7 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		518048	100033
法定代表人		路强	王洪章

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.cryuantafund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华润元大基金管理有限公司	深圳市福田区中心四路 1-1 号嘉里建设广场第三座 7 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2014 年 3 月 31 日 - 2014 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-4,856,777.83
本期利润	4,559,102.74
加权平均基金份额本期利润	0.0207
本期加权平均净值利润率	2.08%
本期基金份额净值增长率	2.80%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-3,415,456.64
期末可供分配基金份额利润	-0.0216
期末基金资产净值	162,613,439.12
期末基金份额净值	1.028

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2014年6月30日)
基金份额累计净值增长率	2.80%

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、本基金合同于2014年3月31日生效，实际报告期间为2014年3月31日（基金合同生效日）至2014年6月30日。

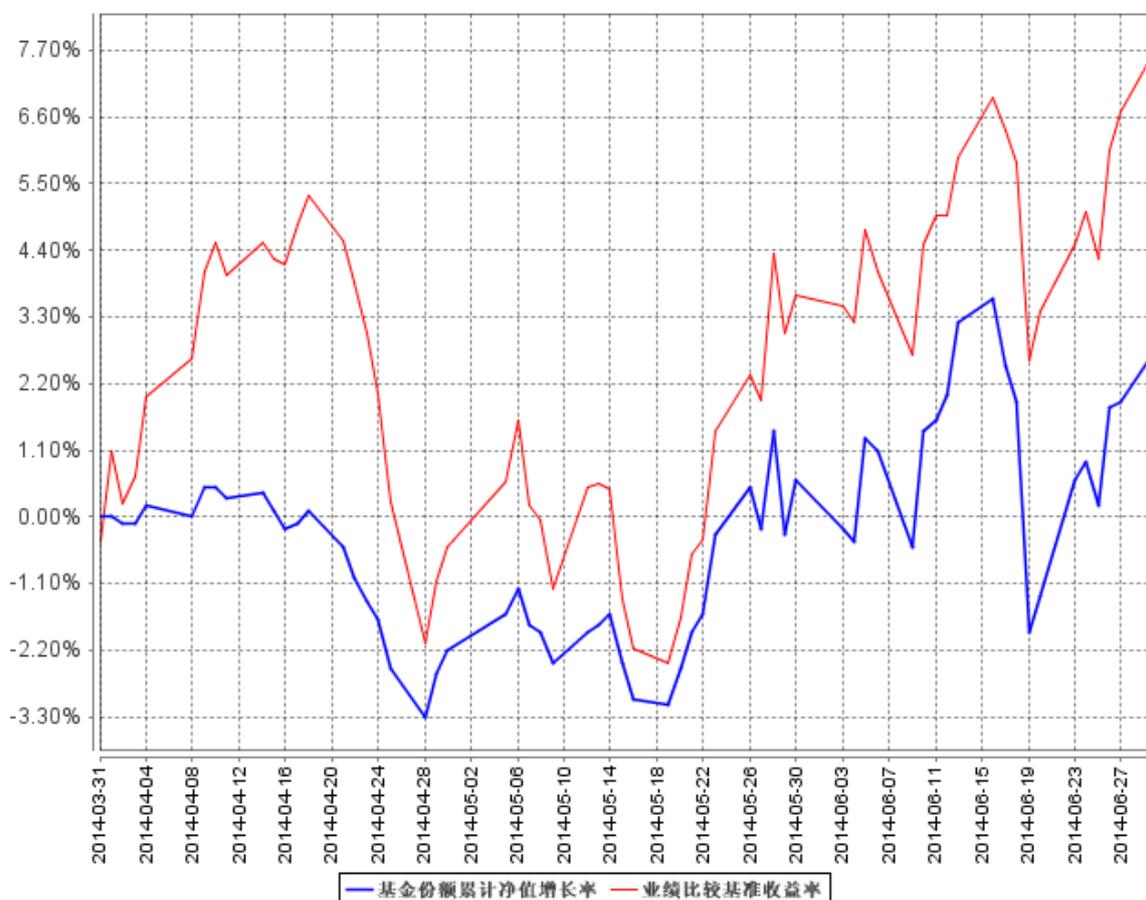
3.2 基金净值表现

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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	2.19%	1.35%	3.94%	1.16%	-1.75%	0.19%
过去三个月	2.80%	0.92%	8.20%	1.10%	-5.40%	-0.18%
自基金合同生效起至今	2.80%	0.91%	7.74%	1.09%	-4.94%	-0.18%

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

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 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华润元大基金管理有限公司经中国证监会证监许可【2012】1746 号文批准，于 2013 年 1 月 17 日完成工商登记注册，总部位于深圳，注册资本 2 亿元人民币。公司由华润深国投信托有限公司和台湾元大宝来证券投资信托股份有限公司共同发起设立，占股比例分别为 51% 和 49%。截至 2014 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理三只开放式基金：华润元大保本混合型证券投资基金（基金合同生效日为 2013 年 9 月 11 日），华润元大现金收益货币市场基金（基金合同生效日为 2013

年 10 月 29 日)，华润元大信息传媒科技股票型证券投资基金（基金合同生效日为 2014 年 3 月 31 日）。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）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”为基金合同生效之日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》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

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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。基金管理人管理的所有投资组合未存在参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2014 年上半年上证综指下跌 2.35%，创业板指数上涨 7.39%，整体行情与 2013 年相同，新兴行业表现亮眼。TMT 四大行业中，计算机、通信、传媒和电子行业分别上涨 21.98%、12.63%、

7.39%和 6.85%。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，2014 年上半年 NASDAQ 指数上涨 6.11%，重回上升趋势。中国科技指数 ETF 上涨 4.50%，腾讯上涨 19.46%。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。

本基金于 2014 年 3 月 31 日成立，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。基金在报告期内持仓较低，因此涨幅落后业绩比较基准。

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 4.94%。

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。展望下半年，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。

展望下半年，我们依然看好整体 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部件的相关公司。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。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律

法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的专门机构，组成人员包括督察长、投资风险负责人、证券研究工作负责人、法律监察负责人及基金会计负责人等。该机构成员均具备专业胜任能力和相关从业资格，精通各自领域的理论知识，熟悉相关政策法规，并具有丰富的实践经验。同时，根据基金管理公司制定的相关制度，估值工作决策机构的成员中不包括基金经理。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华润元大信息传媒科技股票型证券投资基金

报告截止日： 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014 年 6 月 30 日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	3,949,120.71
结算备付金		11,011,085.33
存出保证金		55,800.71
交易性金融资产	6.4.7.2	139,228,953.89
其中：股票投资		139,228,953.89
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	8,500,000.00
应收证券清算款		1,981,073.59
应收利息	6.4.7.5	6,076.47
应收股利		-
应收申购款		1,894,772.85
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		166,626,883.55
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014 年 6 月 30 日
负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		2,479,748.25
应付赎回款		519,584.01
应付管理人报酬		223,160.56
应付托管费		37,193.44
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	660,937.94
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	92,820.23
负债合计		4,013,444.43
所有者权益：		

实收基金	6.4.7.9	158,120,916.93
未分配利润	6.4.7.10	4,492,522.19
所有者权益合计		162,613,439.12
负债和所有者权益总计		166,626,883.55

注：(1) 报告截止日 2014 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.028 元，基金份额总额 158,120,916.93 份；

(2) 本基金合同于 2014 年 3 月 31 日生效，实际报告期间为 2014 年 3 月 31 日（基金合同生效日）至 2014 年 6 月 30 日，无上年度可比期间及可比较数据。

6.2 利润表

会计主体：华润元大信息传媒科技股票型证券投资基金

本报告期：2014 年 3 月 31 日（基金合同生效日）至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2014 年 3 月 31 日(基金合同生效日) 至 2014 年 6 月 30 日
一、收入		6,645,483.93
1.利息收入		913,767.82
其中：存款利息收入	6.4.7.11	248,739.43
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		665,028.39
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-4,037,424.88
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-4,276,030.92
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	238,606.04
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	9,415,880.57
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	353,260.42
减：二、费用		2,086,381.19
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	816,252.52
2. 托管费	6.4.10.2.2	136,042.09
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.18	1,039,097.84
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-

6. 其他费用	6.4.7.19	94,988.74
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,559,102.74
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,559,102.74

注：本基金基金合同于 2014 年 3 月 31 日生效，无上年度可比较期间及可比较数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华润元大信息传媒科技股票型证券投资基金

本报告期：2014 年 3 月 31 日（基金合同生效日）至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 3 月 31 日（基金合同生效日）至 2014 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	248,844,670.33	-	248,844,670.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,559,102.74	4,559,102.74
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-90,723,753.40	-66,580.55	-90,790,333.95
其中：1.基金申购款	3,437,514.11	45,294.38	3,482,808.49
2.基金赎回款	-94,161,267.51	-111,874.93	-94,273,142.44
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	158,120,916.93	4,492,522.19	162,613,439.12

注：本基金基金合同于 2014 年 3 月 31 日生效，无上年度可比较期间及可比较数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>林冠和</u>	<u>崔佩伦</u>	<u>崔佩伦</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华润元大信息传媒科技股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2013]1598号《关于核准华润元大信息传媒科技股票型证券投资基金募集的批复》核准，由华润元大基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投

资基金法》和《华润元大信息传媒科技股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次募集期间为 2014 年 2 月 27 日至 2014 年 3 月 27 日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 248,727,721.18 元，经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明(2014)验字第 61032987_H01 号 验资报告。经向中国证监会备案，《华润元大信息传媒科技股票型证券投资基金基金合同》于 2014 年 3 月 31 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 248,844,670.33 份基金份额，其中认购资金利息折合 116,949.15 份基金份额。本基金的基金管理人为华润元大基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华润元大信息传媒科技股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、股指期货、银行存款、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金股票投资比例范围为基金资产的 60%-95%，本基金投资信息传媒科技产业上市公司股票的比例不少于非现金资产的 80%；本基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金业绩比较基准为：中证 TMT 产业主题指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2014 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2014 年 3 月 31 日（基金合同生效日）至 2014 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系自 2014 年 3 月 31 日（基金合同生效日）起至 2014 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资和债券投资。

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债

的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方（转入方）；本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转。

(2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转。

(3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转。

(4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付

的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算。

(5) 回购协议

基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。本基金的公允价值的计量分为三个层次，第一层次是本基金在计量日能获得相同资产或负债在活跃市场上报价的，以该报价为依据确定公允价值；第二层次是本基金在计量日能获得类似资产或负债在活跃市场上的报价，或相同或类似资产或负债在非活跃市场上的报价的，以该报价为依据做必要调整确定公允价值；第三层次是本基金无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的，以其他反映市场参与者对资产或负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

1) 股票投资

(1) 上市流通的股票的估值

上市流通的股票按估值日该股票在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值。

(2) 未上市的股票的估值

A. 送股、转增股、公开增发新股或配股的股票，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值。

B. 首次公开发行的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按其成本价计算；

首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值。

C. 非公开发行有明确锁定期的股票的估值

本基金投资的非公开发行的股票按以下方法估值：

a. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价低于非公开发行股票初始取得成本时，

采用在证券交易所的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值；

b. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于非公开发行股票的初始取得成本时，按中国证监会相关规定处理。

2) 债券投资

(1) 证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日债券收盘净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(3) 未上市债券、交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量；

(4) 在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

3) 权证投资

(1) 上市流通的权证按估值日该权证在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 未上市流通的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量；

(3) 因持有股票而享有的配股权证，采用估值技术确定公允价值进行估值。

4) 分离交易可转债

分离交易可转债，上市日前，采用估值技术分别对债券和权证进行估值；自上市日起，上市

流通的债券和权证分别按上述 2)、3) 中的相关原则进行估值。

5) 其他

(1) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融资产公允价值的, 基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后, 按最能反映公允价值的方法估值;

(2) 如有新增事项, 按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利, 且该种法定权利现在是可执行的, 同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时, 金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外, 金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示, 不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时, 申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失) 占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时, 申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失) 占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算, 并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款, 按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入, 并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失, 列入利息收入减项, 存款利息收入以净额列示;

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认, 在债券实际持有期内逐日计提;

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额, 扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认, 在证券实际持有期内逐日计提;

(4) 买入返售金融资产收入, 按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同

利率差异较小时，也可以用合同利率)，在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50%的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率逐日计提；

(3) 卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(4) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 4 次，每份基金份额每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 20%，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要会计政策和会计估计需要披露。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3% 调整为 1%；

经国务院批准，财政部、国家税务总局决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

2. 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

3. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴 20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》，自 2008 年 10 月 9 日起暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
活期存款	3,949,120.71
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	3,949,120.71

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	129,813,073.32	139,228,953.89	9,415,880.57
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	-	-	-
交易所市场	-	-	-

	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
	资产支持证券	-	-	-
	基金	-	-	-
	其他	-	-	-
	合计	129,813,073.32	139,228,953.89	9,415,880.57

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券	8,500,000.00	-
合计	8,500,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
应收活期存款利息	1,096.23
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	4,955.14
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	25.10
合计	6,076.47

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	660,937.94
银行间市场应付交易费用	-
合计	660,937.94

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,153.27
预提费用	91,666.96
合计	92,820.23

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2014 年 3 月 31 日(基金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	248,844,670.33	248,844,670.33
本期申购	3,437,514.11	3,437,514.11
本期赎回(以“-”号填列)	-94,161,267.51	-94,161,267.51
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	158,120,916.93	158,120,916.93

注：(1) 本基金自 2014 年 2 月 27 日至 2014 年 3 月 27 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金 248,727,721.18 元。根据《华润元大信息传媒科技股票型证券投资基金基金合同》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入 116,949.15 元，在本基金成立后，折算为 116,949.15 份基金份额，划入基金份额持有人账户；

(2) 申购份额含红利再投、转换入份额，赎回份额含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-4,856,777.83	9,415,880.57	4,559,102.74

本期基金份额交易产生的变动数	1,441,321.19	-1,507,901.74	-66,580.55
其中：基金申购款	-66,881.30	112,175.68	45,294.38
基金赎回款	1,508,202.49	-1,620,077.42	-111,874.93
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,415,456.64	7,907,978.83	4,492,522.19

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2014年3月31日(基金合同生效日)至2014年6月30日	
活期存款利息收入	19,614.69	
定期存款利息收入	203,055.56	
其他存款利息收入	-	
结算备付金利息收入	24,818.82	
其他	1,250.36	
合计	248,739.43	

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2014年3月31日(基金合同生效日)至2014年6月30日	
卖出股票成交总额	295,947,879.66	
减：卖出股票成本总额	300,223,910.58	
买卖股票差价收入	-4,276,030.92	

6.4.7.13 债券投资收益

注：本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2014年3月31日(基金合同生效日)至2014年6月30日
股票投资产生的股利收益	238,606.04
基金投资产生的股利收益	-
合计	238,606.04

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2014年3月31日(基金合同生效日)至2014年6月30日
1. 交易性金融资产	9,415,880.57
——股票投资	9,415,880.57
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	9,415,880.57

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2014年3月31日(基金合同生效日)至2014年6月30日
基金赎回费收入	353,260.42
合计	353,260.42

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2014年3月31日(基金合同生效日)至2014年6月30日
交易所市场交易费用	1,039,097.84
银行间市场交易费用	-
合计	1,039,097.84

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2014年3月31日(基金合同生效日)至2014年6月30日
审计费用	16,666.72

信息披露费	75,000.24
银行汇划费	2,961.78
其他费用_其他	360.00
合计	94,988.74

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需作说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

-

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华润元大基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金合同于 2014 年 3 月 31 日生效，无上年度可比较期间。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2014 年 3 月 31 日(基金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	816,252.52
其中：支付销售机构的客户维护费	278,969.94

注：(1) 基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50% 的年费率计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×1.50%÷当年天数。

(2) 根据《开放式证券投资基金销售费用管理规定》，基金管理人依据销售机构销售基金的保有量

提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，客户维护费从基金管理费中列支。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	
	2014年3月31日(基金合同生效日)至2014年6月30日	
当期发生的基金应支付的托管费	136,042.09	

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提，按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：本报告期内基金管理人未运用自有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：报告期末除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2014年3月31日(基金合同生效日)至2014年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	3,949,120.71	19,614.69

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行间同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2014 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300253	卫宁软件	2014 年 5 月 28 日	重大资产重组	40.53	2014 年 8 月 1 日	37.50	98,200	3,963,729.97	3,980,046.00	-
300271	华宇软件	2014 年 6 月 27 日	重大资产重组	40.30	-	-	88,107	2,983,988.64	3,550,712.10	-
300323	华灿光电	2014 年 4 月 28 日	重大资产重组	18.68	2014 年 7 月 28 日	11.21	186,700	3,722,861.02	3,487,556.00	-
300369	绿盟科技	2014 年 6 月 26 日	重大资产重组	61.27	-	-	51,620	2,630,341.95	3,162,757.40	-
300379	东方通	2014 年 6 月 23 日	重大资产重组	62.17	2014 年 8 月 15 日	67.39	42,395	2,822,516.59	2,635,697.15	-
300166	东方国信	2014 年 4 月 9 日	重大资产重组	18.71	2014 年 7 月 9 日	20.58	130,716	2,478,964.00	2,445,696.36	-
600498	烽火通信	2014 年 6 月 30 日	重大事项	11.91	2014 年 7 月 7 日	12.10	26,700	318,288.18	317,997.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2014 年 6 月 30 日止，本基金未持有从事银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2014 年 6 月 30 日止，本基金未持有从事交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了由董事会、监事会、董事会下设风险控制委员会，督察长、管理层下设风险管理委员会，监察合规部和各业务部门构成的四级风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2014 年 6 月 30 日，本基金未持有债券资产。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金期末持有证券除 6.4.12 列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，其余在本年度末均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的可回购交易的债券资产的公允价值。本基金所持有的金融负债以及可赎回基金份额净值(所有者权益)的合同约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动

而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、债券投资及买入返售金融资产等。本基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2014年6月30日	6个月以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,949,120.71	-	-	-	3,949,120.71
结算备付金	11,011,085.33	-	-	-	11,011,085.33
存出保证金	55,800.71	-	-	-	55,800.71
交易性金融资产	-	-	-	139,228,953.89	139,228,953.89
买入返售金融资产	8,500,000.00	-	-	-	8,500,000.00
应收证券清算款	-	-	-	1,981,073.59	1,981,073.59
应收利息	-	-	-	6,076.47	6,076.47
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	1,894,772.85	1,894,772.85
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	23,516,006.75	-	-	143,110,876.80	166,626,883.55
负债					
应付证券清算款	-	-	-	2,479,748.25	2,479,748.25
应付赎回款	-	-	-	519,584.01	519,584.01
应付管理人报酬	-	-	-	223,160.56	223,160.56
应付托管费	-	-	-	37,193.44	37,193.44
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	660,937.94	660,937.94
其他负债	-	-	-	92,820.23	92,820.23
负债总计	-	-	-	4,013,444.43	4,013,444.43
利率敏感度缺口	23,516,006.75	-	-	-	-

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本期末本基金未持有交易性债券资产，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大其他价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行交易的股票、债券、货币市场工具、权证、股指期货、银行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	139,228,953.89	85.62
交易性金融资产-基金投资	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-
其他	-	-
合计	139,228,953.89	85.62

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证 TMT 产业主题指数以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)
		本期末（2014年6月30日）
	中证 TMT 产业主题指数上升 5%	4,674,468.21
中证 TMT 产业主题指数下降 5%	-4,674,468.21	

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	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	其他各项资产	3,937,723.62	2.36
8	合计	166,626,883.55	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

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

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	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
11	300253	卫宁软件	98,200	3,980,046.00	2.45
12	600446	金证股份	128,373	3,946,186.02	2.43
13	300271	华宇软件	88,107	3,550,712.10	2.18
14	300323	华灿光电	186,700	3,487,556.00	2.14
15	300144	宋城演艺	119,231	3,169,159.98	1.95
16	300369	绿盟科技	51,620	3,162,757.40	1.94
17	300115	长盈精密	143,400	3,157,668.00	1.94
18	300251	光线传媒	142,200	3,153,996.00	1.94
19	002138	顺络电子	149,314	3,114,690.04	1.92
20	300043	互动娱乐	165,363	3,065,830.02	1.89
21	300207	欣旺达	104,370	3,047,604.00	1.87
22	300150	世纪瑞尔	184,302	2,919,343.68	1.80
23	000977	浪潮信息	82,520	2,903,053.60	1.79
24	300017	网宿科技	45,299	2,890,076.20	1.78
25	300065	海兰信	167,921	2,844,581.74	1.75
26	603005	晶方科技	67,053	2,796,780.63	1.72
27	600570	恒生电子	92,100	2,707,740.00	1.67
28	300379	东方通	42,395	2,635,697.15	1.62
29	002396	星网锐捷	93,600	2,619,864.00	1.61
30	002402	和而泰	139,200	2,591,904.00	1.59
31	300287	飞利信	91,700	2,547,426.00	1.57
32	300166	东方国信	130,716	2,445,696.36	1.50
33	300205	天喻信息	147,463	2,270,930.20	1.40
34	300296	利亚德	136,638	2,265,458.04	1.39
35	300202	聚龙股份	79,268	2,216,333.28	1.36

36	600587	新华医疗	28,400	2,117,220.00	1.30
37	002465	海格通信	132,600	2,112,318.00	1.30
38	600373	中文传媒	148,200	2,074,800.00	1.28
39	002030	达安基因	90,700	1,764,115.00	1.08
40	002065	东华软件	80,000	1,609,600.00	0.99
41	002230	科大讯飞	56,250	1,496,250.00	0.92
42	300184	力源信息	102,755	1,439,597.55	0.89
43	600776	东方通信	100,000	1,335,000.00	0.82
44	300170	汉得信息	98,836	1,274,984.40	0.78
45	600410	华胜天成	106,600	1,267,474.00	0.78
46	600050	中国联通	389,600	1,258,408.00	0.77
47	600699	均胜电子	37,870	951,673.10	0.59
48	300299	富春通信	39,100	501,262.00	0.31
49	600571	信雅达	24,400	475,556.00	0.29
50	600498	烽火通信	26,700	317,997.00	0.20

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	300059	东方财富	8,541,001.88	5.25
2	300115	长盈精密	8,449,050.28	5.20
3	002475	立讯精密	8,412,330.79	5.17
4	300058	蓝色光标	7,944,445.29	4.89
5	002065	东华软件	7,943,083.80	4.88
6	002396	星网锐捷	7,676,538.82	4.72
7	002292	奥飞动漫	7,670,986.44	4.72
8	300010	立思辰	7,030,048.03	4.32
9	300017	网宿科技	6,975,875.64	4.29
10	600776	东方通信	6,762,710.62	4.16
11	002008	大族激光	6,667,492.78	4.10
12	300287	飞利信	6,637,098.34	4.08
13	300315	掌趣科技	6,521,225.65	4.01
14	002410	广联达	6,302,874.13	3.88
15	300369	绿盟科技	6,239,517.68	3.84
16	300296	利亚德	6,164,284.38	3.79
17	601231	环旭电子	6,100,611.91	3.75

18	600446	金证股份	5,976,985.75	3.68
19	300207	欣旺达	5,892,536.66	3.62
20	300104	乐视网	5,727,956.41	3.52
21	000977	浪潮信息	5,601,139.96	3.44
22	300133	华策影视	5,571,261.76	3.43
23	002439	启明星辰	5,530,371.40	3.40
24	600261	阳光照明	5,459,705.04	3.36
25	002236	大华股份	5,209,870.26	3.20
26	300253	卫宁软件	5,207,029.97	3.20
27	300205	天喻信息	4,916,718.26	3.02
28	002446	盛路通信	4,911,542.93	3.02
29	300322	硕贝德	4,875,769.64	3.00
30	300043	互动娱乐	4,866,205.81	2.99
31	300271	华宇软件	4,759,486.97	2.93
32	002368	太极股份	4,695,612.21	2.89
33	000413	东旭光电	4,604,496.08	2.83
34	600536	中国软件	4,545,134.50	2.80
35	300383	光环新网	4,530,282.70	2.79
36	300379	东方通	4,528,343.22	2.78
37	002415	海康威视	4,494,137.23	2.76
38	603000	人民网	4,459,367.98	2.74
39	600340	华夏幸福	4,444,629.80	2.73
40	300002	神州泰岳	4,405,828.14	2.71
41	002049	同方国芯	4,354,370.90	2.68
42	600699	均胜电子	4,341,019.08	2.67
43	300144	宋城演艺	4,332,309.39	2.66
44	002174	游族网络	4,219,632.29	2.59
45	002303	美盈森	4,200,731.38	2.58
46	000049	德赛电池	4,181,847.24	2.57
47	600588	用友软件	4,162,992.68	2.56
48	300065	海兰信	4,142,419.39	2.55
49	300027	华谊兄弟	4,113,611.22	2.53
50	300291	华录百纳	4,091,889.09	2.52
51	002465	海格通信	4,078,896.93	2.51
52	002587	奥拓电子	4,044,378.02	2.49
53	300352	北信源	3,964,239.00	2.44

54	300020	银江股份	3,942,524.89	2.42
55	600570	恒生电子	3,922,752.65	2.41
56	002152	广电运通	3,769,424.49	2.32
57	600703	三安光电	3,727,314.25	2.29
58	300323	华灿光电	3,722,861.02	2.29
59	600637	百视通	3,662,212.21	2.25
60	300202	聚龙股份	3,565,341.20	2.19
61	300150	世纪瑞尔	3,526,884.96	2.17
62	002241	歌尔声学	3,463,730.98	2.13
63	002138	顺络电子	3,425,967.84	2.11

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	300058	蓝色光标	7,975,304.73	4.90
2	300315	掌趣科技	6,537,840.41	4.02
3	002410	广联达	6,034,444.80	3.71
4	002065	东华软件	5,975,573.88	3.67
5	300115	长盈精密	5,809,999.78	3.57
6	002236	大华股份	5,172,561.75	3.18
7	600776	东方通信	5,032,790.46	3.09
8	600261	阳光照明	5,001,211.80	3.08
9	002396	星网锐捷	4,866,674.45	2.99
10	002368	太极股份	4,737,991.67	2.91
11	300017	网宿科技	4,622,227.81	2.84
12	300322	硕贝德	4,598,599.68	2.83
13	000413	东旭光电	4,532,792.18	2.79
14	300383	光环新网	4,483,603.03	2.76
15	603000	人民网	4,478,933.11	2.75
16	000049	德赛电池	4,442,827.13	2.73
17	002475	立讯精密	4,437,437.07	2.73
18	002446	盛路通信	4,408,840.48	2.71
19	300002	神州泰岳	4,277,888.83	2.63
20	002049	同方国芯	4,240,059.50	2.61
21	600340	华夏幸福	4,212,918.46	2.59
22	300027	华谊兄弟	4,205,804.26	2.59

23	002415	海康威视	4,194,272.70	2.58
24	600536	中国软件	4,177,456.60	2.57
25	002587	奥拓电子	4,149,670.74	2.55
26	002174	游族网络	4,138,696.76	2.55
27	300287	飞利信	4,044,030.82	2.49
28	300352	北信源	4,009,719.00	2.47
29	002303	美盈森	4,009,455.94	2.47
30	300296	利亚德	3,895,136.74	2.40
31	002292	奥飞动漫	3,840,051.53	2.36
32	002152	广电运通	3,775,532.36	2.32
33	300059	东方财富	3,754,894.91	2.31
34	600588	用友软件	3,724,010.82	2.29
35	300020	银江股份	3,723,340.23	2.29
36	300369	绿盟科技	3,631,508.56	2.23
37	002241	歌尔声学	3,439,680.26	2.12
38	600703	三安光电	3,395,891.85	2.09
39	600637	百视通	3,380,237.26	2.08
40	600699	均胜电子	3,327,048.75	2.05

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	430,036,983.90
卖出股票收入（成交）总额	295,947,879.66

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 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。

7.6 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。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 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贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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。

7.12.2

本基金所投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
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

7.12.4 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。

7.12.5 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。

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人 户数(户)	户均持有的 基金份 额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
2,202	71,807.86	28,200,098.96	17.83%	129,920,817.97	82.17%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	205,286.92	0.1298%

注：截至本报告期末，本基金管理人从业人员投资、持有本基金符合相关法律法规、中国证监会规定及相关管理制度的规定。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014年3月31日）基金份额总额	248,844,670.33
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	3,437,514.11
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	94,161,267.51
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本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。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人未发生重大的人事变动。

本基金托管人 2014 年 2 月 7 日发布任免通知，解聘尹东中国建设银行投资托管业务部总经理助理职务。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略没有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金管理人聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计的会计师事务所。本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人，托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信建投	1	240,194,590.06	33.09%	218,673.51	33.09%	-
光大证券	2	228,289,930.49	31.45%	207,835.25	31.45%	-
国信证券	1	168,464,337.30	23.20%	153,370.08	23.20%	-
中信证券	2	89,036,005.71	12.26%	81,059.10	12.26%	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-

注：基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

1、基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其交易单元作为基金的专用交易单元，选择的标准是：

- (1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 5 亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，最近二年未发生因重大违规行为而受到中国证监会处罚；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；
- (6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务。

2、选择交易单元的程序：

我公司根据上述标准，选定符合条件的证券公司作为租用交易单元的对象。我公司投研部门定期对所选定证券公司的服务进行综合评比，评比内容包括：提供研究报告质量、数量、及时性及提供研究服务主动性和质量等情况，并依据评比结果确定交易单元交易的具体情况。我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向券商租用交易单元作为基金专用交易单元。本基金本报告期内先后向中信证券、国信证券、国泰君安、兴业证券、光大证券和中信建投租用了基金专用交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信建投	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	1,845,000,000.00	49.06%	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	1,915,500,000.00	50.94%	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华润元大信息传媒科技股票型证券投资基金基金合同摘要	中国证券报、证券时报	2014年2月21日
2	华润元大信息传媒科技股票型证券投资基金招募说明书	中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2014年2月21日
3	华润元大信息传媒科技股票型证券投资基金基金份额发售公告	中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2014年2月21日
4	华润元大信息传媒科技股票型证券投资基金基金合同	基金管理人网站	2014年2月21日
5	华润元大信息传媒科技股票型证券投资基金托管协议	基金管理人网站	2014年2月21日
6	华润元大基金管理有限公司关于增加前海汇联基金销售有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2014年2月28日
7	华润元大基金管理有限公司关于增加平安银行股份有限公司为华润元大信息传媒科技股票型证券投资基金销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2014年3月5日
8	关于华润元大信息传媒科技股票型证券投资基金延长募集期限的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2014年3月22日
9	关于华润元大信息传媒科技股票型证券投资基金提前结束募集的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2014年3月27日
10	华润元大信息传媒科技股票型证券投资基金基金合同生效公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2014年4月1日
11	华润元大信息传媒科技股票型证券投资基金关于开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2014年5月13日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

2014 年 2 月 28 日，基金管理人股东元大宝来证券投资信托股份有限公司法定代表人、董事长高抗胜于届龄退休，由杜纯琛接任。2014 年 6 月 18 日，基金管理人股东元大宝来证券投资信托股份有限公司法定代表人、董事长杜纯琛先生辞任，由林武田先生接任。

§ 12 备查文件目录

12.1 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。

12.2 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。

12.3 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 8 月 25 日