

华润元大信息传媒科技混合型 证券投资基金 2015 年第 3 季度报告

2015 年 9 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：2015 年 10 月 27 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 2015 年 10 月 26 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 2015 年 7 月 1 日起至 9 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混合
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	34,357,516.59 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</p>

	<p>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</p> <p>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</p> <p>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	本基金为混合型基金，属于证券投资基金中的中高风险品种，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。
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（2015年7月1日—2015年9月30日）
1. 本期已实现收益	-22,002,785.21
2. 本期利润	-23,008,000.41
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.6426
4. 期末基金资产净值	53,668,020.66
5. 期末基金份额净值	1.562

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。

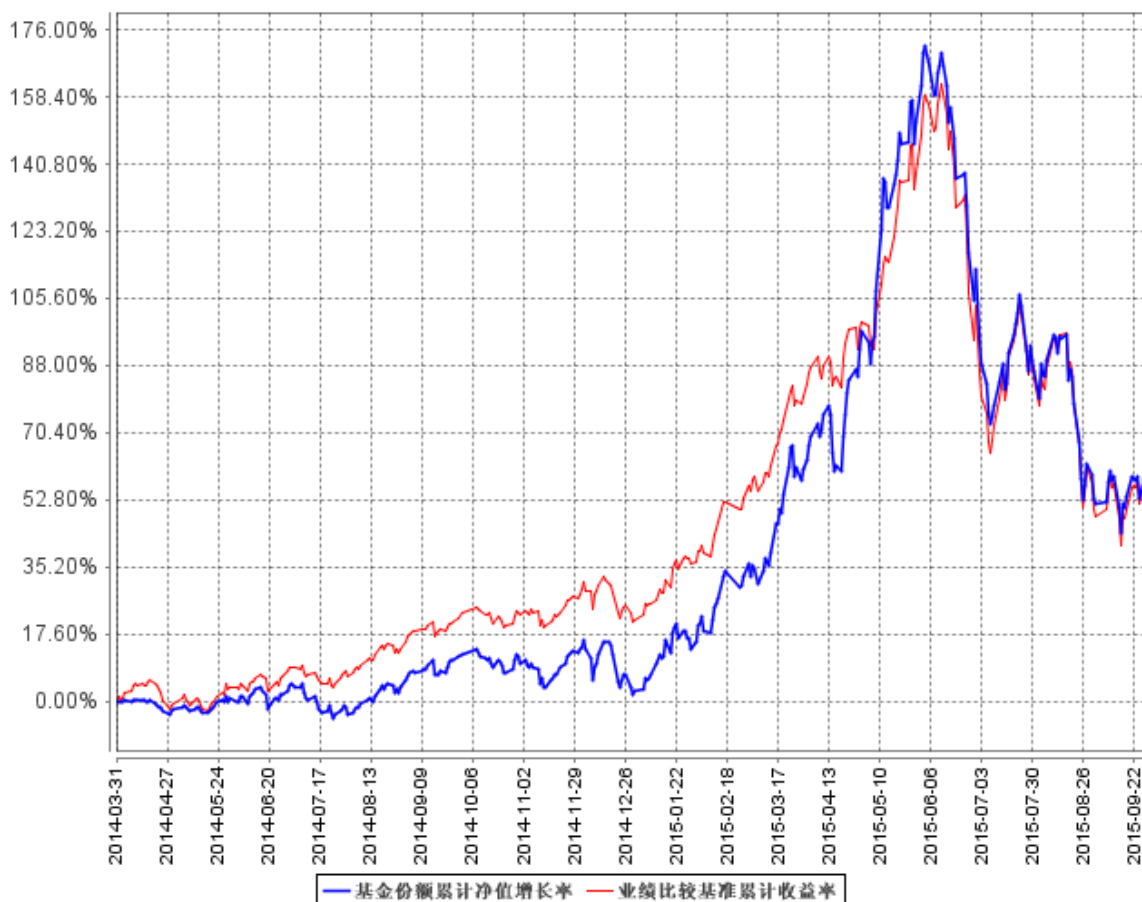
3.2 基金净值表现

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	-26.74%	3.03%	-24.12%	3.22%	-2.62%	-0.19%

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：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。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 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		
杨伟	华润元大信息传媒科技混合型证券投资基金基金经理、华润元大富时中国 A50 指数型证券投资基金基金经理、华润元大中创 100 交易型开放式指数	2015 年 5 月 8 日	-	6 年	曾任兴业证券股份有限公司风险管理专员，平安信托有限责任公司金融工程及量化投资研究员，2014 年 11 月 20 日起担任华润元大富时中国 A50 指数型证券投资基金基金经理，2015 年 5 月 8 日起担任华润元大信息传媒科

	证券投资基金基金经理			技混合型证券投资基金基金经理, 2015 年 5 月 25 日起担任华润元大中创 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。中国, 厦门大学经济学博士, 具有基金从业资格。
--	------------	--	--	--

注: 1. 基金经理任职日期和离任日期为公司正式对外公告中确定的日期; 担任新成立基金的基金经理, 即基金的首任基金经理, 其任职日期为基金合同生效日。

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遵规守信情况的说明

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

2015 年第三季度股票市场震荡下行, 以创业板为代表的成长股跌幅较深, TMT 行业经历了大幅调整。创业板指数下跌 27.14%, 中小板指数下跌 26.57%, 上证综指下跌 28.63%, 沪深 300 指数下跌 28.39%, 上证 50 指数下跌 25.22%, 富时中国 A50 指数下跌 26.73%。中信一级 29 个行业中银行(-16.26%)、餐饮旅游(-23.46%)、医药(-26.97%)板块较强, 涨幅前三; 而煤炭(-40.36%)、有色金属(-40.7%)、钢铁(-45.66%)板块走势明显较弱, 涨幅居后。TMT 行业中, 计算机、传媒、通信和电子分别下跌 36.43%、34.85%、29.43%和 33%。

本基金采用量化模型精选 TMT 行业中的质优股票, 在报告期内对 TMT 的相关行业进行了适度

均衡配置，同时利用量化模型对市场趋势和个股走势进行分析判断，在市场出现调整风险时及时对基金的持仓进行了调整，较为有效地控制了基金的下行风险。

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-26.74%，业绩比较基准收益率为-24.12%，基金份额净值增长率落后业绩比较基准 2.62%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

进入 2015 年三季度，全球经济复苏乏力，国内去产能、去杠杆和金融风险凸现等多因素叠加，中国经济仍面临较大的下行压力。但从 2015 年前 3 季度来看，中国经济总体运行在合理区间，结构调整积极推进，发展活力有所增强。前 3 季度 GDP 同比增长 6.9%，当季增长 6.9%，好于市场预期。从支出法看，外贸表现不佳，投资增速下滑，但消费继续稳定增长。从生产法来看，第二产业增速降至 5.8%，第三产业增速升至 8.6%，服务业对增长的贡献继续提升。展望 2015 年第四季度，从先行指标来看，9 月全国制造业 PMI 为 49.8，低于荣枯线，指向经济下行压力加大。为实现全年经济增长目标，货币政策有望继续保持宽松，财政政策有望更加积极，综合考虑政策的累积效应和一系列稳增长政策逐步发力，经济很可能呈现出缓中趋稳态势，但同时部分行业产能过剩、外围经济动能较弱等将给经济增长带来不确定性。

当前中国经济转型升级迫在眉睫，即将召开的“十三五”规划如何在稳增长、调结构、促创新中实现有效突破，将成为市场关注焦点。随着“十三五”规划落地在即，制造升级、信息经济、现代服务业有望成为“十三五”规划产业维度的三大主线。本基金将重点关注受益于“十三五”规划、业绩增长确定性比较高的相关板块，如云计算、大数据、互联网金融、体育、文化、传媒等。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 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	35,216,624.00	63.21
	其中：股票	35,216,624.00	63.21

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	19,437,143.68	34.89
8	其他资产	1,060,008.96	1.90
9	合计	55,713,776.64	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	15,378,503.00	28.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	240,600.00	0.45
F	批发和零售业	468,736.00	0.87
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	13,068,793.00	24.35
J	金融业	537,480.00	1.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,706,495.00	3.18
M	科学研究和技术服务业	233,350.00	0.43
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	248,580.00	0.46
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	3,334,087.00	6.21
S	综合	-	-
	合计	35,216,624.00	65.62

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	002183	怡亚通	33,800	1,466,582.00	2.73
2	300027	华谊兄弟	22,900	724,556.00	1.35
3	300113	顺网科技	14,500	637,710.00	1.19
4	300336	新文化	23,300	583,432.00	1.09
5	600271	航天信息	10,700	574,483.00	1.07

6	600804	鹏博士	26,600	572,698.00	1.07
7	300017	网宿科技	10,500	553,455.00	1.03
8	601318	中国平安	18,000	537,480.00	1.00
9	300292	吴通通讯	14,900	477,545.00	0.89
10	002380	科远股份	9,400	455,430.00	0.85

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

股指期货投资本期收益（元）	69,420.00
---------------	-----------

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用和风险管理功能，降低股票仓位频繁调整的交易成本和对冲股票市场系统性风险。

本基金投资于股指期货，对基金总体风险的影响很小，并符合既定的投资政策和投资目标。

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

本基金本报告期末持仓国债期货。

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

本基金本报告期末持仓国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

2014 年 10 月 24 日，鹏博士收到中国证券监督管理委员会四川监管局《关于对鹏博士电信传媒集团股份有限公司采取出具警示函措施的决定》（行政监管措施决定书[2014]15 号）。鹏博士已积极落实监管部门整改要求，根据《企业会计准则》的相关规定，对发现的会计差错事项进行更正，聘请会计师事务所对会计差错更正事项进行审计并发表专项意见；同时，按照证监会和上海证券交易所的相关规定，已将会计差错更正事项提交公司第九届董事会第二十七次会议审议并履行相关信息披露义务。

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

本报告期内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	80,878.21
2	应收证券清算款	968,492.15
3	应收股利	-
4	应收利息	3,978.55
5	应收申购款	6,660.05
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,060,008.96

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002183	怡亚通	1,466,582.00	2.73	重大事项
2	300027	华谊兄弟	724,556.00	1.35	重大事项

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	39,392,811.30
报告期期间基金总申购份额	20,405,487.78
减：报告期期间基金总赎回份额	25,440,782.49
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	34,357,516.59

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：本报告期期初基金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投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

基金管理人于 2015 年 8 月 3 日发布了《关于华润元大信息传媒科技股票型证券投资基金变更基金类型并相应修订基金合同部分条款的公告》。自 2015 年 8 月 3 日起，华润元大信息传媒科技股票型证券投资基金变更为华润元大信息传媒科技混合型证券投资基金。

§ 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
2015 年 10 月 27 日