

华润元大信息传媒科技混合型 证券投资基金 2015 年年度报告

2015 年 12 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

送出日期：2016 年 3 月 29 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 2016 年 3 月 28 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。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	14
§6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息.....	15
6.2 审计报告的基本内容.....	15
§7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表.....	16
7.2 利润表.....	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
7.4 报表附注.....	19
§8 投资组合报告	39
8.1 期末基金资产组合情况.....	39
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	39
8.3 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.....	40
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	41
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	55
8.6 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.....	55
8.7 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.....	55

8.8	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	56
8.9	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	56
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	56
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	56
8.12	投资组合报告附注	56
§9	基金份额持有人信息	58
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	58
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58
9.3	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	58
§10	开放式基金份额变动	58
§11	重大事件揭示	59
11.1	基金份额持有人大会决议	59
11.2	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	59
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	59
11.4	基金投资策略的改变	59
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	59
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	59
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	59
11.8	其他重大事件	60
§12	影响投资者决策的其他重要信息	63
§13	备查文件目录	64
13.1	备查文件目录	64
13.2	存放地点	64
13.3	查阅方式	64

§ 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混合型证券投资基金
基金简称	华润元大信息传媒科技混合
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	36,317,689.84 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	本基金为混合型基金，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债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。

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	tianqingl.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 1 号 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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.cryuantafund.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2015 年	2014 年 3 月 31 日(基金合同生效日) -2014 年 12 月 31 日
本期已实现收益	10,331,432.09	6,395,871.03
本期利润	11,268,049.48	7,662,939.87
加权平均基金份额本期利润	0.3307	0.0628
本期加权平均净值利润率	18.46%	6.19%
本期基金份额净值增长率	76.02%	2.60%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2014 年末
期末可供分配利润	23,132,066.45	780,021.14
期末可供分配基金份额利润	0.6369	0.0260
期末基金资产净值	65,598,920.04	30,746,974.98
期末基金份额净值	1.806	1.026
3.1.3 累计期末指标	2015 年末	2014 年末
基金份额累计净值增长率	80.60%	2.60%

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。

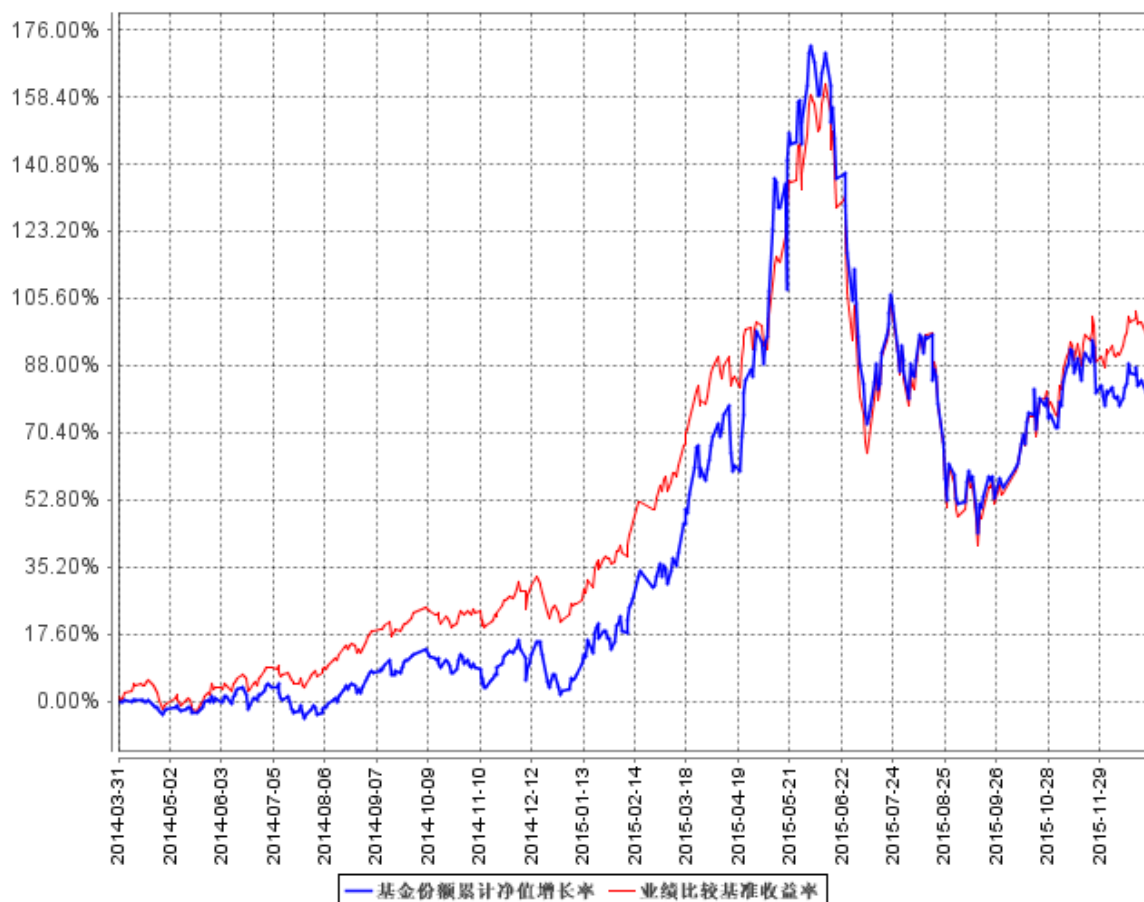
3.2 基金净值表现

3.2.1 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
过去三个月	15.62%	2.11%	26.57%	1.90%	-10.95%	0.21%
过去六个月	-15.29%	2.63%	-3.96%	2.68%	-11.33%	-0.05%
过去一年	76.02%	2.68%	61.16%	2.44%	14.86%	0.24%
自基金合同生效起至今	80.60%	2.20%	95.56%	1.97%	-14.96%	0.23%

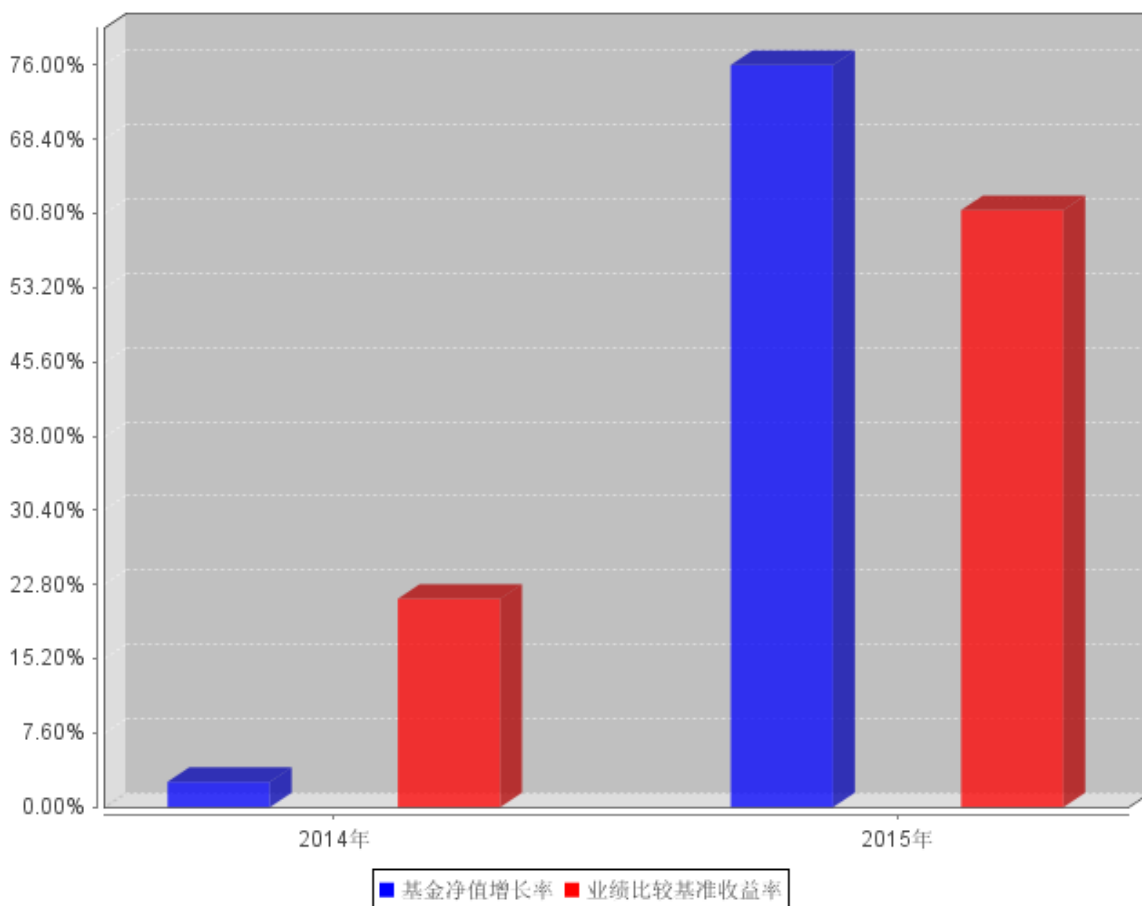
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金基金合同生效日为 2014 年 3 月 31 日，基金合同生效日至 2014 年 12 月 31 日，本基金运作时间未满一年。图示中 2014 年本基金的净值增长率及业绩比较基准的收益率根据当年实际存续期（2014 年 3 月 31 日至 2014 年 12 月 31 日）计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：截止本报告期末，本基金未进行利润分配。

§ 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 3 亿元人民币。公司由华润深国投信托有限公司和台湾元大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 2015 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理八只开放式基金：华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金，华润元大现金收益货币市场基金，华润元大信息传媒科技混合型证券投资基金，华润元大医疗保健量化混合型证券投资基金，华润元大富时中国 A50 指数型证券投资基金，华润元大中创 100 交易型开放式指数证券投资基金，华润元大稳健收益债券型证券投资基金，华润元大中创 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金。

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		
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 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理	2015 年 5 月 8 日	-	7 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，2015 年 12 月 23 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联接基金基金经理。中国，厦门大学经济学博士，具有基金从业资格。
张仲维	原华润元大信息传媒科技股票型证券投资基金基金经理、原华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2014 年 3 月 31 日	2015 年 5 月 8 日	6 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 2015 年 5 月 8 日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，2014 年 9 月 18 日起至 2015 年 5 月 8 日担任华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基

					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. 基金经理任职日期和离任日期为公司作出决定后正式对外公告之日；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 公平交易制度和控制方法

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规，公司制订了《华润元大基金管理有限公司公平交易管理办法》，对投资决策的内部控制、研究的内部控制、交易执行的内部控制、公平交易的实施效果评估与监察稽核、信息披露和报告等进行了规定，以确保公司旗下管理的不同投资组合得到公平对待，保护投资者合法权益。公司对所有投资品种实行集中交易制度，严格遵循时间优先、价格优先的公平交易原则，同时对可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，对不同投资组合间同向交易的交易价差进行分析，防止利益输送的发生。

4.3.2 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。

本报告期内，基金管理人对旗下管理的不同投资组合间在连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3日内、5日内）的同向交易交易价差进行分析，分析结果表明旗下组合的同向交易情况正常，价差均在可合理解释范围之内。

4.3.3 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

2015 年股票市场充满变化与挑战，上半年迎来近几年以来最大上涨幅度的一波牛市，然而下半年开始市场风云突变，出现剧烈的震荡调整。全年来看，以创业板为代表的成长股和以富时中国 A50 指数为代表的大盘蓝筹股出现较大分化，创业板指数上涨 84.41%，中小板指数上涨 53.70%，上证综指上涨 9.41%，沪深 300 指数上涨 5.58%，上证 50 指数下跌 6.23%，富时中国 A50 指数下跌 7.00%。中信一级 29 个行业中计算机（125.97%）、餐饮旅游（122.86%）、通信（115.46%）板块较强，涨幅前三；而非银行金融（-18.66%）、煤炭（-7.71%）、钢铁（-6.40%）板块走势明显较弱，涨幅居后。TMT 行业中，计算机、传媒、通信和电子分别上涨 125.97%、71.70%、115.46% 和 80.94%。

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 2015 年 6 月份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。之后主要配置于基本面良好、市值较大的股票，因此在四季度小盘成长股反弹幅度较大的情况下本基金业绩表现一般。

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 76.02%，业绩比较基准收益率为 61.16%，基金份额净值增长率领先业绩比较基准 14.86%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 年宏观经济依然面临较大的下行压力，为实现全年经济增长目标政策有望更加积极。一方面，货币政策将继续保持宽松，除常规降准降息之外，将继续通过地方政府债务置换、专项金融债以及城投债加速发行等推动社会融资总量扩张；另一方面，财政政策将有效发力，财政赤字率将突破 3%。中央经济工作会已经确定“去产能、去库存、去杠杆、降成本、补短板”五大任务，供给侧改革将会逐步落地。下一步值得警惕的时间窗口期是 3-4 月，美联储加息、去产能去杠杆、

注册制等各类不利影响集中出现。

2016 年，机遇与风险并存的股票市场有望在曲折中震荡前行。资金面总体较为宽松有望推动无风险利率继续下行，这将有助于推动大类资产配置转向权益类市场，创新驱动有望推动中国经济加速转型，这些有利因素有望将对市场形成支撑；同时，实体经济仍面临较大的下行压力，在刚性兑付逐步打破的情况下信用风险存在蔓延可能，注册制推出可能加大市场供给压力，这些不利因素可能对市场形成压力。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发，依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。

公司按照规定的权限和程序，通过实时监控、现场检查、重点抽查和人员询问等方法，独立地开展基金运作和公司管理的合规性稽核，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事会和公司管理层出具监察稽核报告。

公司采取事前防范、事中控制和事后监督等三阶段工作，加强了对日常投资运作的管理和监控，保证投资遵循既定的投资决策程序与业务流程，基金各项投资符合比例控制的要求，严格执行分级授权制度，保证基金投资独立、公平。

本基金管理人承诺将坚持以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，为基金持有人谋求最大利益。

4.7 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。

4.8 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。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金存在连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，出现该情况的时间范围为 2015 年 3 月 2 日至 4 月 28 日。经过基金管理人积极地持续营销，截至本报告期末，本基金资产净值已超过五千万元。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的情形。

§ 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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2016）审字第 61032987_H03 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告	
审计报告收件人	华润元大信息传媒科技混合型证券投资基金全体基金份额持有人：	
引言段	我们审计了后附的华润元大信息传媒科技混合型证券投资基金财务报表，包括 2015 年 12 月 31 日的资产负债表，2015 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。	
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是基金管理人华润元大基金管理有限公司的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。	
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>	
审计意见段	我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了华润元大信息传媒科技混合型证券投资基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和净值变动情况。	
注册会计师的姓名	吴翠蓉	高鹤
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室	
审计报告日期	2016 年 3 月 28 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华润元大信息传媒科技混合型证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	4,610,334.50	2,737,332.86
结算备付金		607,633.38	711,179.83
存出保证金		81,355.73	87,578.54
交易性金融资产	7.4.7.2	60,593,350.22	25,161,016.22
其中：股票投资		60,593,350.22	25,161,016.22
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	8,000,000.00
应收证券清算款		1,979,181.06	2,697,748.28
应收利息	7.4.7.5	1,998.85	1,250.06
应收股利		-	-
应收申购款		23,367.39	208,866.99
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		67,897,221.13	39,604,972.78
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,708,679.50	2,136,578.05
应付赎回款		46,927.59	6,298,405.47
应付管理人报酬		85,335.25	55,973.93
应付托管费		14,222.53	9,328.99
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	393,068.68	209,157.69
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	50,067.54	148,553.67
负债合计		2,298,301.09	8,857,997.80
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	36,317,689.84	29,966,953.84
未分配利润	7.4.7.10	29,281,230.20	780,021.14
所有者权益合计		65,598,920.04	30,746,974.98
负债和所有者权益总计		67,897,221.13	39,604,972.78

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.806 元，基金份额总额 36,317,689.84 份。

7.2 利润表

会计主体：华润元大信息传媒科技混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 3 月 31 日(基 金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日
一、收入		14,367,787.18	11,786,045.31
1. 利息收入		125,495.71	1,070,270.82
其中：存款利息收入	7.4.7.11	116,291.78	282,854.78
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		9,203.93	787,416.04
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		11,374,305.44	8,736,844.86
其中：股票投资收益	7.4.7.12	11,178,315.11	8,463,897.79
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.2	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	69,420.00	-
股利收益	7.4.7.16	126,570.33	272,947.07
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	936,617.39	1,267,068.84
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	1,931,368.64	711,860.79
减：二、费用		3,099,737.70	4,123,105.44

1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	911,703.68	1,390,007.64
2. 托管费	7.4.10.2.2	151,950.65	231,667.99
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	1,668,662.91	2,209,976.47
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.20	367,420.46	291,453.34
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		11,268,049.48	7,662,939.87
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		11,268,049.48	7,662,939.87

7.3 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混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 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）	29,966,953.84	780,021.14	30,746,974.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	11,268,049.48	11,268,049.48
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）	6,350,736.00	17,233,159.58	23,583,895.58
其中：1. 基金申购款	194,489,041.94	153,590,232.59	348,079,274.53
2. 基金赎回款	-188,138,305.94	-136,357,073.01	-324,495,378.95
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）	36,317,689.84	29,281,230.20	65,598,920.04
项目	上年度可比期间 2014 年 3 月 31 日（基金合同生效日）至 2014 年 12 月 31 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）	-	7,662,939.87	7,662,939.87
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）	-218,877,716.49	-6,882,918.73	-225,760,635.22

其中：1. 基金申购款	16,821,363.65	1,050,912.04	17,872,275.69
2. 基金赎回款	-235,699,080.14	-7,933,830.77	-243,632,910.91
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）	29,966,953.84	780,021.14	30,746,974.98

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>林瑞源</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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华润元大信息传媒科技混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），原名华润元大信息传媒科技股票型证券投资基金，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《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《关于实施〈公开募集证券投资基金运作管理办法〉有关问题的规定》及基金合同的有关规定，经与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，本基金自2015年8月3日起由股票型证券投资基金更名为混合型证券投资基金。

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混合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（含中小板，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%。本基金的业绩比较基准为：中证 TMT 产业主题指数收益率*80%+中债综合指数收益率*20%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、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>》及其他中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 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 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 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。

7.4.4.1 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。

7.4.4.2 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。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产(或负债)，并形成其他单位的金融负债(或资产)或权

益工具的合同。

(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及贷款和应收款项；

本基金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、债券和衍生工具等投资。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、结算备付金、买入返售金融资产和各类应收款项等。

(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。

本基金持有的金融负债均划分为其他金融负债，主要包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

初始确认

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，按照取得时的公允价值作为初始确认金额。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取得时发生的相关交易费用计入当期损益；应收款项及其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

后续计量

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产采用公允价值进行后续计量。在持有该类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；应收款项及其他金融负债采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量，其摊销或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

终止确认

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；

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。

金融资产转移

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。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票、债券、基金和衍生工具等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无交易，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。有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值的，应对最近交易的市价进行调整，确定公允价值。

(2) 不存在活跃市场的金融工具，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定公允价值。本基金采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。

(3) 如有确凿证据表明按上述估值原则仍不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体

情况与基金托管人商定后，按最能适当反映公允价值的价格估值。

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；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。

7.4.4.7 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。

7.4.4.8 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)”。

7.4.4.9 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。

(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。

7.4.4.10 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 1.5%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。

7.4.4.11 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。

7.4.4.12 分部报告

-

7.4.4.13 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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24号《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》的规定,自2015年3月25日起,本基金对持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)的估值方法进行调整,采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的重大会计差错更正。

7.4.6 税项

7.4.6.1 印花税

证券(股票)交易印花税税率为1%,由出让方缴纳。

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。

7.4.6.2 营业税、企业所得税

以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,免征营业税。

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。

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。

7.4.6.3 个人所得税

个人所得税税率为20%。

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、债券的利息及储蓄利息时代扣代缴个人所得税。

基金从上市公司分配取得的股息红利所得,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,减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,减按25%计入应纳税所得额。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于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 2015 年 9 月 8 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，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

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。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
活期存款	4,610,334.50	2,737,332.86
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	4,610,334.50	2,737,332.86

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	58,389,663.99	60,593,350.22	2,203,686.23
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	58,389,663.99	60,593,350.22	2,203,686.23
项目	上年度末 2014 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	23,893,947.38	25,161,016.22	1,267,068.84
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	23,893,947.38	25,161,016.22	1,267,068.84

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产或衍生金融负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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 2015年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
合计	-	-
项目	上年度末 2014年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券	8,000,000.00	-
合计	8,000,000.00	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
应收活期存款利息	1,658.22	854.63
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	300.37	352.09
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	40.26	43.34
合计	1,998.85	1,250.06

注：其他为应收结算保证金利息。

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	393,068.68	209,157.69
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	393,068.68	209,157.69

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	67.54	23,553.67
预提审计费	50,000.00	50,000.00
预提信息披露费	-	75,000.00
合计	50,067.54	148,553.67

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	29,966,953.84	29,966,953.84
本期申购	194,489,041.94	194,489,041.94
本期赎回（以“-”号填列）	-188,138,305.94	-188,138,305.94
- 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	36,317,689.84	36,317,689.84

注：申购份额含红利再投、转换入份额，赎回份额含转换出份额。

7.4.7.10 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
上年度末	2,722,430.75	-1,942,409.61	780,021.14
本期利润	10,331,432.09	936,617.39	11,268,049.48
本期基金份额交易产生的变动数	10,078,203.61	7,154,955.97	17,233,159.58
其中：基金申购款	121,068,935.66	32,521,296.93	153,590,232.59
基金赎回款	-110,990,732.05	-25,366,340.96	-136,357,073.01

本期已分配利润	-	-	-
本期末	23,132,066.45	6,149,163.75	29,281,230.20

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年3月31日(基金合同生效日)至2014年12月31日
活期存款利息收入	101,902.28	39,841.10
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	13,223.05	37,807.17
其他	1,166.45	2,150.95
合计	116,291.78	282,854.78

注：其他包括结算保证金利息收入人民币 1,166.45 元（2014 年度：其他包括结算保证金利息收入人民币 1,004.13 元和申购款利息收入 1,146.82 元）。

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年3月31日(基金合同生效日)至2014年12月31日
卖出股票成交总额	540,537,582.41	719,839,653.85
减：卖出股票成本总额	529,359,267.30	711,375,756.06
买卖股票差价收入	11,178,315.11	8,463,897.79

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益。

7.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具投资收益——买卖权证差价收入。

7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额	上年度可比期间收益金额
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年3月31日(基金合同生效日)至2014年12月31日
股指期货投资收益	69,420.00	-

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年3月31日(基金合同生效日)至2014年12月31日
股票投资产生的股利收益	126,570.33	272,947.07
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	126,570.33	272,947.07

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年3月31日(基金合同生效日)至2014年12月31日
1. 交易性金融资产	936,617.39	1,267,068.84
——股票投资	936,617.39	1,267,068.84
——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	936,617.39	1,267,068.84

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年3月31日(基金合同生效日)至2014年12月31日
基金赎回费收入	1,931,368.64	711,860.79
合计	1,931,368.64	711,860.79

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年3月31日(基金合同生效

		日)至 2014 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	1,668,032.61	2,209,976.47
银行间市场交易费用	-	-
期货交易费用	630.30	-
合计	1,668,662.91	2,209,976.47

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 3 月 31 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	300,000.00	225,000.00
银行汇划费	7,860.46	9,193.34
账户维护费	9,000.00	6,000.00
其他费用_其他	560.00	1,260.00
合计	367,420.46	291,453.34

7.4.7.21 分部报告

-

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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
华润深国投信托有限公司	基金管理人的股东
元大证券投资信托股份有限公司	基金管理人的股东
深圳华润元大资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：（1）元大证券投资信托股份有限公司，系由原“元大宝来证券投资信托股份有限公司”更名而来；

（2）以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 3 月 31 日(基金合同生效 日)至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金 应支付的管理费	911,703.68	1,390,007.64
其中：支付销售机 构的客户维护费	412,342.67	454,899.02

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 3 月 31 日(基金合同生效 日)至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金 应支付的托管费	151,950.65	231,667.99

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。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 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：本基金本报告期及上年度可比期间除基金管理人之外的其他关联方均未持有本基金。

7.4.10.5 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 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年3月31日(基金合同生效日) 至2014年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	4,610,334.50	101,902.28	2,737,332.86	39,841.10

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 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。

7.4.12 期末（2015年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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。

7.4.12.2 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
300336	新文化	2015年12月24日	重大资产重组	42.00	-	-	32,700	1,325,835.00	1,373,400.00	-
300324	旋极信息	2015年12月1日	重大资产重组	49.25	2016年3月10日	44.33	18,500	884,867.00	911,125.00	-
600271	航天信息	2015年10月12日	重大资产重组	71.47	-	-	10,700	512,692.00	764,729.00	-
300104	乐视网	2015年12月7日	重大资产重组	58.80	-	-	12,500	530,308.53	735,000.00	-
000829	天音控股	2015年11月9日	重大资产重组	12.22	-	-	59,700	613,636.00	729,534.00	-
600584	长电科技	2015年11月30日	重大资产重组	22.02	-	-	31,500	600,280.00	693,630.00	-
002143	印纪传媒	2015年12月9日	重大事项停牌	40.55	2016年1月5日	36.50	15,400	669,628.00	624,470.00	-

300366	创意信息	2015 年 12 月 29 日	重大资产重组	77.70	-	-	8,000	658,439.00	621,600.00	-
000066	长城电脑	2015 年 6 月 18 日	重大资产重组	15.19	2016 年 3 月 10 日	19.39	36,300	614,548.45	551,397.00	-
002544	杰赛科技	2015 年 8 月 31 日	重大资产重组	41.42	-	-	13,000	444,490.91	538,460.00	-
000748	长城信息	2015 年 6 月 18 日	重大资产重组	24.68	2016 年 3 月 10 日	31.39	16,000	515,079.63	394,880.00	-
300028	金亚科技	2015 年 6 月 10 日	重大事项停牌	24.48	-	-	15,600	507,182.12	381,888.00	-
300036	超图软件	2015 年 10 月 30 日	重大资产重组	39.01	2016 年 1 月 15 日	35.11	8,300	292,826.34	323,783.00	-
300365	恒华科技	2015 年 11 月 16 日	重大资产重组	42.87	2016 年 1 月 27 日	38.58	7,300	321,637.00	312,951.00	-
600990	四创电子	2015 年 9 月 1 日	重大资产重组	62.75	2016 年 3 月 25 日	69.03	4,400	269,700.00	276,100.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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中国建设银行股份有限公司，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 2015 年 12 月 31 日，本基金未持有债券资产。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风险。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 7.4.12 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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、存出保证金、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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

2015 年 12 月 31 日						
资产						
银行存款	4,610,334.50	-	-	-	-	4,610,334.50
结算备付金	607,633.38	-	-	-	-	607,633.38
存出保证金	81,355.73	-	-	-	-	81,355.73
交易性金融资产	-	-	-	-	-60,593,350.22	60,593,350.22
应收证券清算款	-	-	-	-	1,979,181.06	1,979,181.06
应收利息	-	-	-	-	1,998.85	1,998.85
应收申购款	497.02	-	-	-	22,870.37	23,367.39
资产总计	5,299,820.63	-	-	-	-62,597,400.50	67,897,221.13
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	1,708,679.50	1,708,679.50
应付赎回款	-	-	-	-	46,927.59	46,927.59
应付管理人报酬	-	-	-	-	85,335.25	85,335.25
应付托管费	-	-	-	-	14,222.53	14,222.53
应付交易费用	-	-	-	-	393,068.68	393,068.68
其他负债	-	-	-	-	50,067.54	50,067.54
负债总计	-	-	-	-	2,298,301.09	2,298,301.09
利率敏感度缺口	5,299,820.63	-	-	-	-	-
上年度末 2014 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	2,737,332.86	-	-	-	-	2,737,332.86
结算备付金	711,179.83	-	-	-	-	711,179.83
存出保证金	87,578.54	-	-	-	-	87,578.54
交易性金融资产	-	-	-	-	-25,161,016.22	25,161,016.22
买入返售金融资产	8,000,000.00	-	-	-	-	8,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	2,697,748.28	2,697,748.28
应收利息	-	-	-	-	1,250.06	1,250.06
应收申购款	-	-	-	-	208,866.99	208,866.99
资产总计	11,536,091.23	-	-	-	-28,068,881.55	39,604,972.78
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	2,136,578.05	2,136,578.05
应付赎回款	-	-	-	-	6,298,405.47	6,298,405.47
应付管理人报酬	-	-	-	-	55,973.93	55,973.93
应付托管费	-	-	-	-	9,328.99	9,328.99
应付交易费用	-	-	-	-	209,157.69	209,157.69
其他负债	-	-	-	-	148,553.67	148,553.67
负债总计	-	-	-	-	8,857,997.80	8,857,997.80
利率敏感度缺口	11,536,091.23	-	-	-	-	-

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：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。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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、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相关规定。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日		上年度末 2014年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产-股票投资	60,593,350.22	92.37	25,161,016.22	81.83
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
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	60,593,350.22	92.37	25,161,016.22	81.83

7.4.13.4.3.2 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（2015年12月31日）	上年度末（2014年12月31日）
	中证 TMT 产业主题指数上升 5%		3,536,908.94
中证 TMT 产业主题指数下降 5%		-3,536,908.94	-1,362,371.54

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1. 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

2. 其他事项

(1) 公允价值

管理层已经评估了银行存款、结算备付金、买入返售金融资产、其他应收款项类投资以及其他金融负债因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

各层次金融工具公允价值

于 2015 年 12 月 31 日，本基金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中划分为第一层次的余额为人民币 51,360,403.22 元，划分为第二层次的余额为人民币 9,232,947.00 元，无划分为第三层次的余额（于 2014 年 12 月 31 日，本基金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中划分为第一层次的余额为人民币 21,952,005.24 元，划分为第二层次的余额为人民币 3,209,010.98 元，无划分为第三层次的余额）。

公允价值所属层次间重大变动

本基金本报告期未发生金融工具公允价值层次之间的转移。

第三层次公允价值期初金额和本期变动金额

本基金报告期初未持有公允价值划分为第三层次的金融工具；本基金本期无净转入（转出）第三层次。

(2) 除上述事项以外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	60,593,350.22	89.24
	其中：股票	60,593,350.22	89.24
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	-	-
	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	5,217,967.88	7.69
7	其他各项资产	2,085,903.03	3.07
8	合计	67,897,221.13	100.00

8.2 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	29,919,559.46	45.61
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	2,046,681.12	3.12
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	21,369,577.64	32.58
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,815,062.00	2.77
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-

0	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	5,442,470.00	8.30
S	综合	-	-
	合计	60,593,350.22	92.37

8.3 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	600718	东软集团	56,800	1,763,640.00	2.69
2	300113	顺网科技	16,200	1,642,194.00	2.50
3	600775	南京熊猫	82,000	1,570,300.00	2.39
4	600536	中国软件	42,800	1,544,224.00	2.35
5	000681	视觉中国	39,000	1,482,390.00	2.26
6	002583	海能达	117,600	1,468,824.00	2.24
7	300330	华虹计通	64,882	1,396,260.64	2.13
8	002281	光迅科技	21,500	1,393,845.00	2.12
9	002724	海洋王	49,800	1,392,408.00	2.12
10	300336	新文化	32,700	1,373,400.00	2.09
11	300356	光一科技	24,400	1,368,840.00	2.09
12	600757	长江传媒	122,600	1,346,148.00	2.05
13	300389	艾比森	27,446	1,345,128.46	2.05
14	002194	武汉凡谷	78,904	1,341,368.00	2.04
15	002232	启明信息	63,000	1,340,640.00	2.04
16	300170	汉得信息	67,500	1,339,875.00	2.04
17	600601	方正科技	216,200	1,336,116.00	2.04
18	600776	东方通信	116,500	1,332,760.00	2.03
19	002261	拓维信息	34,100	1,326,490.00	2.02
20	600203	福日电子	96,072	1,317,147.12	2.01
21	000536	华映科技	89,100	1,313,334.00	2.00
22	603688	石英股份	54,300	1,298,856.00	1.98
23	300360	炬华科技	36,800	1,291,680.00	1.97
24	002396	星网锐捷	53,200	1,284,780.00	1.96
25	300301	长方照明	119,300	1,281,282.00	1.95
26	300051	三五互联	47,500	1,258,750.00	1.92

27	600088	中视传媒	41,200	1,240,532.00	1.89
28	300369	绿盟科技	25,300	1,230,592.00	1.88
29	300455	康拓红外	25,900	1,222,480.00	1.86
30	300359	全通教育	14,100	1,214,292.00	1.85
31	300211	亿通科技	41,100	1,196,421.00	1.82
32	603729	龙韵股份	10,600	1,190,592.00	1.81
33	300002	神州泰岳	88,700	1,161,970.00	1.77
34	300046	台基股份	41,300	1,144,010.00	1.74
35	002446	盛路通信	28,400	1,053,640.00	1.61
36	600410	华胜天成	38,000	1,007,380.00	1.54
37	300264	佳创视讯	36,000	995,760.00	1.52
38	002733	雄韬股份	30,300	927,483.00	1.41
39	300324	旋极信息	18,500	911,125.00	1.39
40	300462	华铭智能	20,800	841,360.00	1.28
41	002017	东信和平	42,300	820,620.00	1.25
42	600271	航天信息	10,700	764,729.00	1.17
43	300104	乐视网	12,500	735,000.00	1.12
44	000829	天音控股	59,700	729,534.00	1.11
45	600756	浪潮软件	13,700	704,591.00	1.07
46	600584	长电科技	31,500	693,630.00	1.06
47	002138	顺络电子	44,000	631,400.00	0.96
48	002143	印纪传媒	15,400	624,470.00	0.95
49	300366	创意信息	8,000	621,600.00	0.95
50	000066	长城电脑	36,300	551,397.00	0.84
51	002544	杰赛科技	13,000	538,460.00	0.82
52	000748	长城信息	16,000	394,880.00	0.60
53	300028	金亚科技	15,600	381,888.00	0.58
54	300036	超图软件	8,300	323,783.00	0.49
55	300365	恒华科技	7,300	312,951.00	0.48
56	600990	四创电子	4,400	276,100.00	0.42

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例（%）
1	600536	中国软件	6,759,536.00	21.98
2	002657	中科金财	6,077,695.50	19.77

3	600718	东软集团	5, 115, 933. 98	16. 64
4	300295	三六五网	4, 892, 666. 84	15. 91
5	600588	用友网络	4, 872, 802. 31	15. 85
6	000555	神州信息	4, 860, 280. 00	15. 81
7	300002	神州泰岳	4, 720, 607. 67	15. 35
8	600570	恒生电子	4, 562, 084. 00	14. 84
9	600050	中国联通	4, 440, 800. 00	14. 44
10	300378	鼎捷软件	4, 381, 578. 27	14. 25
11	000100	TCL 集团	4, 309, 850. 00	14. 02
12	601231	环旭电子	4, 307, 484. 68	14. 01
13	300367	东方网力	4, 207, 003. 40	13. 68
14	002439	启明星辰	4, 110, 338. 00	13. 37
15	300392	腾信股份	4, 101, 455. 14	13. 34
16	600571	信雅达	4, 086, 974. 80	13. 29
17	600410	华胜天成	4, 072, 500. 00	13. 25
18	000063	中兴通讯	4, 047, 270. 80	13. 16
19	002230	科大讯飞	4, 014, 289. 00	13. 06
20	002410	广联达	4, 002, 177. 51	13. 02
21	300104	乐视网	3, 887, 086. 20	12. 64
22	300226	上海钢联	3, 877, 405. 10	12. 61
23	300170	汉得信息	3, 852, 914. 88	12. 53
24	600446	金证股份	3, 804, 017. 60	12. 37
25	600060	海信电器	3, 663, 124. 00	11. 91
26	300033	同花顺	3, 631, 545. 91	11. 81
27	300017	网宿科技	3, 581, 435. 42	11. 65
28	300369	绿盟科技	3, 572, 493. 00	11. 62
29	300136	信维通信	3, 554, 364. 00	11. 56
30	600100	同方股份	3, 533, 955. 00	11. 49
31	000681	视觉中国	3, 485, 444. 00	11. 34
32	300178	腾邦国际	3, 408, 561. 80	11. 09
33	300399	京天利	3, 401, 889. 32	11. 06
34	002261	拓维信息	3, 344, 211. 00	10. 88
35	002065	东华软件	3, 343, 609. 00	10. 87
36	002376	新北洋	3, 293, 489. 92	10. 71
37	002178	延华智能	3, 283, 669. 98	10. 68
38	300359	全通教育	3, 276, 465. 16	10. 66

39	600637	东方明珠	3, 221, 080. 69	10. 48
40	300059	东方财富	3, 162, 281. 00	10. 28
41	002405	四维图新	3, 160, 656. 00	10. 28
42	600037	歌华有线	3, 156, 971. 00	10. 27
43	300288	朗玛信息	3, 150, 500. 28	10. 25
44	601318	中国平安	3, 112, 616. 00	10. 12
45	002063	远光软件	3, 105, 310. 00	10. 10
46	002281	光迅科技	3, 094, 105. 88	10. 06
47	600601	方正科技	3, 037, 819. 00	9. 88
48	300380	安硕信息	3, 016, 669. 00	9. 81
49	600850	华东电脑	2, 965, 620. 12	9. 65
50	300291	华录百纳	2, 954, 115. 20	9. 61
51	002415	海康威视	2, 943, 850. 00	9. 57
52	300292	吴通控股	2, 942, 234. 00	9. 57
53	600804	鹏博士	2, 915, 508. 61	9. 48
54	000793	华闻传媒	2, 915, 019. 00	9. 48
55	002236	大华股份	2, 912, 128. 71	9. 47
56	300133	华策影视	2, 876, 789. 97	9. 36
57	600498	烽火通信	2, 866, 404. 00	9. 32
58	300166	东方国信	2, 850, 950. 95	9. 27
59	300036	超图软件	2, 844, 796. 34	9. 25
60	002373	千方科技	2, 828, 896. 06	9. 20
61	002104	恒宝股份	2, 803, 390. 00	9. 12
62	600485	信威集团	2, 701, 859. 30	8. 79
63	600839	四川长虹	2, 700, 629. 00	8. 78
64	000503	海虹控股	2, 683, 801. 00	8. 73
65	601519	大智慧	2, 646, 912. 03	8. 61
66	300085	银之杰	2, 610, 611. 00	8. 49
67	600198	大唐电信	2, 606, 275. 00	8. 48
68	300253	卫宁软件	2, 550, 573. 48	8. 30
69	002396	星网锐捷	2, 529, 498. 00	8. 23
70	600728	佳都科技	2, 491, 900. 62	8. 10
71	600775	南京熊猫	2, 482, 450. 00	8. 07
72	002232	启明信息	2, 451, 502. 00	7. 97
73	300339	润和软件	2, 443, 243. 00	7. 95
74	600757	长江传媒	2, 440, 522. 00	7. 94

75	000839	中信国安	2,418,536.56	7.87
76	000977	浪潮信息	2,394,044.00	7.79
77	300389	艾比森	2,365,479.18	7.69
78	002308	威创股份	2,307,737.00	7.51
79	002241	歌尔声学	2,295,163.80	7.46
80	002475	立讯精密	2,294,759.60	7.46
81	002153	石基信息	2,265,894.84	7.37
82	000156	华数传媒	2,243,362.00	7.30
83	600776	东方通信	2,234,645.00	7.27
84	300027	华谊兄弟	2,221,386.30	7.22
85	002268	卫士通	2,216,406.00	7.21
86	300168	万达信息	2,195,106.00	7.14
87	002583	海能达	2,190,180.80	7.12
88	603000	人民网	2,170,970.00	7.06
89	002095	生意宝	2,144,913.68	6.98
90	002446	盛路通信	2,138,089.10	6.95
91	300251	光线传媒	2,123,594.00	6.91
92	300377	赢时胜	2,121,953.00	6.90
93	300271	华宇软件	2,090,061.80	6.80
94	000536	华映科技	2,056,842.00	6.69
95	000049	德赛电池	2,020,602.32	6.57
96	000050	深天马A	2,012,522.00	6.55
97	000768	中航飞机	2,008,885.00	6.53
98	002194	武汉凡谷	1,992,156.08	6.48
99	002467	二六三	1,988,997.17	6.47
100	300336	新文化	1,988,234.00	6.47
101	300113	顺网科技	1,986,666.40	6.46
102	600522	中天科技	1,985,621.00	6.46
103	002183	怡亚通	1,964,885.00	6.39
104	300330	华虹计通	1,917,004.00	6.23
105	002138	顺络电子	1,913,583.24	6.22
106	600764	中电广通	1,889,780.29	6.15
107	300356	光一科技	1,886,466.00	6.14
108	300079	数码视讯	1,886,160.00	6.13
109	000748	长城信息	1,880,820.31	6.12
110	300366	创意信息	1,813,443.00	5.90

111	000829	天音控股	1,810,688.00	5.89
112	300315	掌趣科技	1,810,619.00	5.89
113	300324	旋极信息	1,801,382.00	5.86
114	000917	电广传媒	1,797,011.00	5.84
115	000547	航天发展	1,794,821.00	5.84
116	600584	长电科技	1,774,292.00	5.77
117	600203	福日电子	1,774,087.80	5.77
118	300455	康拓红外	1,766,174.00	5.74
119	000725	京东方A	1,749,040.00	5.69
120	000997	新大陆	1,733,420.00	5.64
121	300051	三五互联	1,697,896.00	5.52
122	300077	国民技术	1,690,506.00	5.50
123	002195	二三四五	1,681,143.50	5.47
124	603729	龙韵股份	1,676,206.00	5.45
125	002465	海格通信	1,674,096.55	5.44
126	300028	金亚科技	1,636,295.00	5.32
127	300231	银信科技	1,597,411.56	5.20
128	002055	得润电子	1,590,670.00	5.17
129	300115	长盈精密	1,585,917.29	5.16
130	300046	台基股份	1,560,695.00	5.08
131	600088	中视传媒	1,556,306.00	5.06
132	000021	深科技	1,541,242.00	5.01
133	002084	海鸥卫浴	1,535,018.15	4.99
134	002456	欧菲光	1,534,786.00	4.99
135	601929	吉视传媒	1,517,918.00	4.94
136	600703	三安光电	1,480,298.00	4.81
137	600959	江苏有线	1,456,453.86	4.74
138	600563	法拉电子	1,448,431.29	4.71
139	002335	科华恒盛	1,444,141.00	4.70
140	601098	中南传媒	1,440,540.37	4.69
141	300020	银江股份	1,414,551.09	4.60
142	300078	思创医惠	1,390,907.91	4.52
143	002385	大北农	1,385,030.00	4.50
144	002635	安洁科技	1,369,327.00	4.45
145	300379	东方通	1,360,258.00	4.42
146	002148	北纬通信	1,354,089.00	4.40

147	600837	海通证券	1,352,347.00	4.40
148	300303	聚飞光电	1,346,693.00	4.38
149	603688	石英股份	1,346,127.16	4.38
150	002609	捷顺科技	1,337,245.00	4.35
151	002739	万达院线	1,335,837.00	4.34
152	300211	亿通科技	1,327,154.00	4.32
153	300360	炬华科技	1,323,337.00	4.30
154	000413	东旭光电	1,317,362.00	4.28
155	002724	海洋王	1,308,668.80	4.26
156	300205	天喻信息	1,293,587.50	4.21
157	002161	远望谷	1,273,039.00	4.14
158	000607	华媒控股	1,249,558.00	4.06
159	002380	科远股份	1,193,568.76	3.88
160	002488	金固股份	1,189,298.00	3.87
161	300101	振芯科技	1,173,210.00	3.82
162	603118	共进股份	1,171,468.00	3.81
163	600405	动力源	1,161,960.00	3.78
164	300207	欣旺达	1,159,111.00	3.77
165	300301	长方照明	1,146,003.00	3.73
166	300275	梅安森	1,134,853.00	3.69
167	300012	华测检测	1,132,566.00	3.68
168	300468	四方精创	1,118,208.00	3.64
169	300081	恒信移动	1,107,702.00	3.60
170	300264	佳创视讯	1,100,766.00	3.58
171	600122	宏图高科	1,099,770.00	3.58
172	002312	三泰控股	1,089,142.00	3.54
173	600271	航天信息	1,063,522.00	3.46
174	300088	长信科技	1,059,615.00	3.45
175	600884	杉杉股份	1,059,372.75	3.45
176	600661	新南洋	1,052,751.15	3.42
177	600105	永鼎股份	1,028,792.88	3.35
178	000938	紫光股份	1,027,882.00	3.34
179	002280	联络互动	1,026,679.00	3.34
180	002017	东信和平	1,008,962.00	3.28
181	600845	宝信软件	1,005,897.97	3.27
182	002618	丹邦科技	1,005,893.00	3.27

183	601398	工商银行	998,422.00	3.25
184	300448	浩云科技	994,567.00	3.23
185	002504	弘高创意	985,566.00	3.21
186	002315	焦点科技	980,533.00	3.19
187	300050	世纪鼎利	979,287.16	3.18
188	603989	艾华集团	977,449.50	3.18
189	600048	保利地产	968,725.00	3.15
190	002594	比亚迪	958,086.00	3.12
191	002733	雄韬股份	954,919.50	3.11
192	002273	水晶光电	941,422.00	3.06
193	300202	聚龙股份	941,265.46	3.06
194	000532	力合股份	937,711.00	3.05
195	300390	天华超净	936,373.50	3.05
196	000733	振华科技	935,169.00	3.04
197	300042	朗科科技	930,836.00	3.03
198	002416	爱施德	929,160.00	3.02
199	002289	宇顺电子	921,702.00	3.00
200	300242	明家科技	917,389.00	2.98
201	600551	时代出版	916,456.00	2.98
202	000727	华东科技	915,244.60	2.98
203	600353	旭光股份	913,061.00	2.97
204	002599	盛通股份	911,798.36	2.97
205	002400	省广股份	905,196.00	2.94
206	000673	当代东方	903,125.00	2.94
207	300223	北京君正	887,926.00	2.89
208	002197	证通电子	887,062.44	2.89
209	300312	邦讯技术	883,085.00	2.87
210	300365	恒华科技	862,453.00	2.81
211	300213	佳讯飞鸿	859,369.00	2.79
212	300319	麦捷科技	851,341.00	2.77
213	300252	金信诺	844,261.00	2.75
214	300047	天源迪科	844,066.69	2.75
215	300462	华铭智能	834,438.00	2.71
216	600825	新华传媒	833,387.00	2.71
217	002253	川大智胜	832,085.00	2.71
218	600756	浪潮软件	822,491.00	2.68

219	002093	国脉科技	819,079.00	2.66
220	002292	奥飞动漫	818,016.86	2.66
221	600386	北巴传媒	814,152.00	2.65
222	300248	新开普	805,789.00	2.62
223	000712	锦龙股份	792,493.00	2.58
224	300449	汉邦高科	753,154.00	2.45
225	000823	超声电子	748,304.00	2.43
226	600797	浙大网新	747,101.00	2.43
227	002544	杰赛科技	746,904.00	2.43
228	000970	中科三环	731,997.00	2.38
229	000670	盈方微	727,456.00	2.37
230	300038	梅泰诺	727,228.00	2.37
231	300058	蓝色光标	723,728.00	2.35
232	603005	晶方科技	720,534.00	2.34
233	002231	奥维通信	711,660.00	2.31
234	002052	同洲电子	705,366.40	2.29
235	300297	蓝盾股份	704,426.00	2.29
236	300134	大富科技	702,107.00	2.28
237	000066	长城电脑	699,197.00	2.27
238	002131	利欧股份	696,137.52	2.26
239	002223	鱼跃医疗	690,321.00	2.25
240	600699	均胜电子	685,368.00	2.23
241	300302	同有科技	672,687.00	2.19
242	300414	中光防雷	672,504.00	2.19
243	300155	安居宝	670,176.00	2.18
244	002143	印纪传媒	669,628.00	2.18
245	002045	国光电器	661,181.00	2.15
246	600130	波导股份	660,996.00	2.15
247	002577	雷柏科技	659,373.00	2.14
248	600476	湘邮科技	657,452.00	2.14
249	002222	福晶科技	657,448.00	2.14
250	300188	美亚柏科	656,218.00	2.13
251	600990	四创电子	654,700.00	2.13
252	601801	皖新传媒	653,737.00	2.13
253	000020	深华发 A	647,265.00	2.11
254	300229	拓尔思	645,374.00	2.10

255	002429	兆驰股份	644,528.00	2.10
256	002712	思美传媒	643,481.00	2.09
257	002474	榕基软件	642,909.00	2.09
258	002349	精华制药	636,796.00	2.07
259	300383	光环新网	627,109.00	2.04
260	002152	广电运通	627,102.00	2.04
261	600373	中文传媒	619,270.00	2.01
262	002185	华天科技	615,463.00	2.00

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。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例（%）
1	300059	东方财富	8,519,961.84	27.71
2	002657	中科金财	7,442,626.26	24.21
3	600570	恒生电子	6,286,454.16	20.45
4	600588	用友网络	6,154,750.40	20.02
5	600446	金证股份	5,604,419.60	18.23
6	000555	神州信息	5,496,267.34	17.88
7	300295	三六五网	5,422,783.71	17.64
8	300104	乐视网	5,357,708.51	17.43
9	600050	中国联通	5,310,239.26	17.27
10	300378	鼎捷软件	5,309,593.22	17.27
11	000063	中兴通讯	5,140,075.89	16.72
12	300168	万达信息	5,101,231.59	16.59
13	600536	中国软件	5,038,328.93	16.39
14	600060	海信电器	5,006,635.34	16.28
15	002230	科大讯飞	4,912,204.85	15.98
16	600804	鹏博士	4,755,563.33	15.47
17	000100	TCL 集团	4,728,139.06	15.38
18	002439	启明星辰	4,708,896.80	15.31
19	002065	东华软件	4,441,472.42	14.45
20	300226	上海钢联	4,417,889.45	14.37
21	300178	腾邦国际	4,246,465.42	13.81
22	300136	信维通信	4,170,000.00	13.56
23	600718	东软集团	4,169,979.57	13.56
24	300392	腾信股份	4,159,974.56	13.53

25	600571	信雅达	4,156,238.69	13.52
26	300017	网宿科技	4,146,928.53	13.49
27	600100	同方股份	4,142,498.98	13.47
28	002415	海康威视	4,134,862.35	13.45
29	300033	同花顺	4,015,073.68	13.06
30	300399	京天利	4,005,722.70	13.03
31	601231	环旭电子	3,954,161.06	12.86
32	002410	广联达	3,824,529.77	12.44
33	002178	延华智能	3,798,552.12	12.35
34	300380	安硕信息	3,782,927.60	12.30
35	300367	东方网力	3,772,874.27	12.27
36	600037	歌华有线	3,647,873.73	11.86
37	600637	东方明珠	3,599,090.97	11.71
38	002405	四维图新	3,533,993.09	11.49
39	601318	中国平安	3,525,105.85	11.46
40	300085	银之杰	3,518,991.38	11.45
41	000503	海虹控股	3,439,802.76	11.19
42	300288	朗玛信息	3,424,439.00	11.14
43	600410	华胜天成	3,401,477.31	11.06
44	300292	吴通控股	3,365,554.70	10.95
45	300253	卫宁软件	3,246,292.30	10.56
46	600498	烽火通信	3,150,331.92	10.25
47	300028	金亚科技	3,138,367.52	10.21
48	300002	神州泰岳	3,093,999.04	10.06
49	002475	立讯精密	3,044,957.30	9.90
50	300291	华录百纳	3,041,577.41	9.89
51	002063	远光软件	2,973,410.47	9.67
52	300339	润和软件	2,965,682.51	9.65
53	002153	石基信息	2,926,925.49	9.52
54	002376	新北洋	2,854,480.00	9.28
55	002236	大华股份	2,818,891.51	9.17
56	600850	华东电脑	2,815,730.16	9.16
57	002241	歌尔声学	2,807,938.01	9.13
58	300133	华策影视	2,803,543.34	9.12
59	002373	千方科技	2,724,827.47	8.86
60	002104	恒宝股份	2,717,969.53	8.84
61	002268	卫士通	2,714,080.53	8.83
62	300027	华谊兄弟	2,705,910.58	8.80

63	300271	华宇软件	2,694,809.88	8.76
64	300369	绿盟科技	2,651,348.25	8.62
65	000793	华闻传媒	2,617,098.66	8.51
66	300166	东方国信	2,586,728.34	8.41
67	000839	中信国安	2,581,291.61	8.40
68	000725	京东方A	2,483,534.81	8.08
69	600485	信威集团	2,479,334.72	8.06
70	002183	怡亚通	2,472,493.00	8.04
71	002465	海格通信	2,366,540.24	7.70
72	600728	佳都科技	2,365,229.00	7.69
73	300170	汉得信息	2,337,372.50	7.60
74	600839	四川长虹	2,319,708.09	7.54
75	002308	威创股份	2,304,986.60	7.50
76	300251	光线传媒	2,197,308.01	7.15
77	000977	浪潮信息	2,194,147.00	7.14
78	000997	新大陆	2,184,250.14	7.10
79	300359	全通教育	2,171,266.30	7.06
80	300377	赢时胜	2,167,837.88	7.05
81	601519	大智慧	2,152,792.00	7.00
82	000049	德赛电池	2,101,224.00	6.83
83	600198	大唐电信	2,079,161.00	6.76
84	000156	华数传媒	2,071,300.08	6.74
85	002095	生意宝	2,063,857.64	6.71
86	300036	超图软件	2,026,353.01	6.59
87	000681	视觉中国	1,963,293.70	6.39
88	000768	中航飞机	1,949,555.12	6.34
89	603000	人民网	1,851,103.22	6.02
90	600764	中电广通	1,819,874.00	5.92
91	300079	数码视讯	1,803,226.00	5.86
92	000050	深天马A	1,801,238.82	5.86
93	002467	二六三	1,800,407.00	5.86
94	002385	大北农	1,794,942.16	5.84
95	300077	国民技术	1,761,967.00	5.73
96	002261	拓维信息	1,722,737.00	5.60
97	002084	海鸥卫浴	1,716,692.06	5.58
98	600522	中天科技	1,715,773.00	5.58
99	002281	光迅科技	1,648,233.00	5.36
100	002195	二三四五	1,626,394.55	5.29

101	300315	掌趣科技	1,611,719.70	5.24
102	300115	长盈精密	1,583,993.41	5.15
103	000917	电广传媒	1,573,285.11	5.12
104	002739	万达院线	1,569,419.40	5.10
105	300231	银信科技	1,546,798.00	5.03
106	300078	思创医惠	1,506,396.95	4.90
107	000547	航天发展	1,472,362.00	4.79
108	601098	中南传媒	1,447,347.00	4.71
109	002055	得润电子	1,438,558.00	4.68
110	600563	法拉电子	1,438,017.00	4.68
111	600959	江苏有线	1,437,259.90	4.67
112	000021	深科技	1,431,486.00	4.66
113	300366	创意信息	1,417,049.00	4.61
114	600122	宏图高科	1,403,842.00	4.57
115	300020	银江股份	1,366,697.20	4.44
116	300379	东方通	1,362,127.00	4.43
117	002635	安洁科技	1,356,136.39	4.41
118	600837	海通证券	1,350,918.00	4.39
119	000748	长城信息	1,345,653.72	4.38
120	601929	吉视传媒	1,330,336.33	4.33
121	600601	方正科技	1,326,959.00	4.32
122	002416	爱施德	1,316,201.00	4.28
123	300207	欣旺达	1,284,953.21	4.18
124	002380	科远股份	1,263,735.60	4.11
125	002161	远望谷	1,262,622.00	4.11
126	002456	欧菲光	1,253,776.00	4.08
127	300303	聚飞光电	1,245,650.00	4.05
128	002488	金固股份	1,238,409.28	4.03
129	000413	东旭光电	1,231,969.00	4.01
130	600703	三安光电	1,226,814.00	3.99
131	000607	华媒控股	1,224,176.00	3.98
132	002335	科华恒盛	1,180,429.00	3.84
133	300012	华测检测	1,180,361.00	3.84
134	000938	紫光股份	1,160,254.00	3.77
135	300205	天喻信息	1,158,438.00	3.77
136	002138	顺络电子	1,151,044.61	3.74
137	002280	联络互动	1,140,102.86	3.71
138	603118	共进股份	1,123,417.00	3.65

139	002312	三泰控股	1, 117, 608. 00	3. 63
140	300275	梅安森	1, 117, 069. 00	3. 63
141	600661	新南洋	1, 078, 646. 00	3. 51
142	600884	杉杉股份	1, 075, 385. 60	3. 50
143	002618	丹邦科技	1, 070, 500. 00	3. 48
144	300101	振芯科技	1, 070, 446. 00	3. 48
145	002396	星网锐捷	1, 069, 267. 50	3. 48
146	002148	北纬通信	1, 066, 757. 00	3. 47
147	002446	盛路通信	1, 053, 389. 00	3. 43
148	601398	工商银行	1, 051, 640. 00	3. 42
149	300081	恒信移动	1, 038, 218. 00	3. 38
150	300468	四方精创	1, 027, 516. 00	3. 34
151	002504	弘高创意	1, 026, 094. 14	3. 34
152	002609	捷顺科技	1, 012, 172. 00	3. 29
153	300448	浩云科技	1, 002, 262. 00	3. 26
154	002315	焦点科技	1, 000, 160. 00	3. 25
155	300324	旋极信息	992, 834. 00	3. 23
156	600048	保利地产	990, 676. 00	3. 22
157	600105	永鼎股份	989, 726. 90	3. 22
158	300389	艾比森	988, 755. 12	3. 22
159	600405	动力源	982, 813. 00	3. 20
160	002594	比亚迪	968, 380. 00	3. 15
161	603989	艾华集团	959, 357. 00	3. 12
162	300223	北京君正	955, 661. 00	3. 11
163	300202	聚龙股份	949, 661. 50	3. 09
164	300050	世纪鼎利	942, 828. 00	3. 07
165	000733	振华科技	939, 893. 00	3. 06
166	300088	长信科技	921, 467. 00	3. 00
167	002197	证通电子	918, 622. 00	2. 99
168	000829	天音控股	916, 904. 40	2. 98
169	002232	启明信息	915, 617. 90	2. 98
170	600016	民生银行	902, 304. 00	2. 93
171	300252	金信诺	894, 015. 00	2. 91
172	300042	朗科科技	888, 881. 00	2. 89
173	002273	水晶光电	886, 835. 00	2. 88
174	300213	佳讯飞鸿	886, 781. 00	2. 88
175	600584	长电科技	884, 794. 50	2. 88
176	300242	明家科技	884, 242. 48	2. 88

177	002599	盛通股份	875,874.04	2.85
178	002253	川大智胜	868,479.00	2.82
179	002289	宇顺电子	865,215.00	2.81
180	600757	长江传媒	862,159.00	2.80
181	600775	南京熊猫	861,987.00	2.80
182	300319	麦捷科技	856,440.00	2.79
183	600845	宝信软件	855,759.00	2.78
184	000673	当代东方	852,826.00	2.77
185	002292	奥飞动漫	848,969.60	2.76
186	300390	天华超净	837,009.19	2.72
187	300113	顺网科技	836,968.00	2.72
188	600551	时代出版	823,218.31	2.68
189	300449	汉邦高科	809,776.00	2.63
190	002400	省广股份	802,100.86	2.61
191	600353	旭光股份	798,280.00	2.60
192	600776	东方通信	796,049.00	2.59
193	300047	天源迪科	787,899.00	2.56
194	000712	锦龙股份	786,481.00	2.56
195	600130	波导股份	781,459.00	2.54
196	300297	蓝盾股份	779,949.00	2.54
197	300336	新文化	769,352.00	2.50
198	300038	梅泰诺	759,024.00	2.47
199	600386	北巴传媒	742,401.00	2.41
200	300058	蓝色光标	737,072.00	2.40
201	000670	盈方微	735,890.91	2.39
202	002223	鱼跃医疗	735,371.00	2.39
203	002583	海能达	733,043.00	2.38
204	002712	思美传媒	722,830.00	2.35
205	300312	邦讯技术	721,919.00	2.35
206	002231	奥维通信	721,433.00	2.35
207	000532	力合股份	719,264.00	2.34
208	300248	新开普	715,958.00	2.33
209	601801	皖新传媒	707,452.00	2.30
210	603005	晶方科技	700,123.00	2.28
211	300356	光一科技	686,893.00	2.23
212	002045	国光电器	685,870.00	2.23
213	300188	美亚柏科	684,752.00	2.23
214	300383	光环新网	681,074.48	2.22

215	600699	均胜电子	670,850.47	2.18
216	002341	新纶科技	665,266.00	2.16
217	002194	武汉凡谷	659,303.76	2.14
218	002131	利欧股份	657,846.00	2.14
219	002577	雷柏科技	650,524.50	2.12
220	300155	安居宝	634,995.00	2.07
221	000536	华映科技	631,540.00	2.05
222	300256	星星科技	628,400.00	2.04
223	300348	长亮科技	625,642.36	2.03
224	002389	南洋科技	623,988.00	2.03
225	002093	国脉科技	622,397.00	2.02
226	002185	华天科技	620,340.00	2.02
227	600825	新华传媒	618,782.00	2.01
228	600476	湘邮科技	617,116.20	2.01
229	600373	中文传媒	615,324.76	2.00

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。

8.4.3 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	563,854,983.91
卖出股票收入（成交）总额	540,537,582.41

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。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

公允价值变动总额合计（元）	-
股指期货投资本期收益（元）	69,420.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）	-

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末持仓国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末投资国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末持仓国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

本基金投资的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。

8.12.2

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。

8.12.3 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	81,355.73
2	应收证券清算款	1,979,181.06
3	应收股利	-
4	应收利息	1,998.85
5	应收申购款	23,367.39
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,085,903.03

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300336	新文化	1,373,400.00	2.09	重大资产重组

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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
2,314	15,694.77	1,675.00	0.00%	36,316,014.84	100.00%

9.2 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	42,610.04	0.1173%

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。

9.3 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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 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
本报告期期初基金份额总额	29,966,953.84
本报告期基金总申购份额	194,489,041.94
减:本报告期基金总赎回份额	188,138,305.94
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	36,317,689.84

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。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

根据公司第一届董事会第十五次临时会议审议通过，并于 2015 年 3 月 31 日经中国证券监督管理委员会证监许可[2015]494 号文核准批复，公司总经理由林冠和先生变更为林瑞源先生。上述变更已按照规定报相关监管机构备案，并进行公告。

本报告期内基金托管人 2015 年 1 月 4 日发布任免通知，聘任张力铮为中国建设银行投资托管业务部副总经理。基金托管人 2015 年 9 月 18 日发布任免通知，解聘纪伟中国建设银行投资托管业务部副总经理职务。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为第 2 年为本基金提供审计服务，本年度应支付给会计师事务所的报酬为人民币 50,000.00 元。

11.6 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无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
光大证券	2	764,328,408.67	69.21%	703,705.76	69.13%	-
中信建投	1	126,391,815.63	11.44%	117,626.67	11.56%	-
兴业证券	1	115,583,214.25	10.47%	105,227.16	10.34%	-
国泰君安	1	60,507,705.14	5.48%	56,351.12	5.54%	-
中信证券	2	37,581,422.63	3.40%	34,999.77	3.44%	-
国信证券	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。本基金本报告期内租用的基金专用交易单元未发生变化。

11.7.2 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
光大证券	-	-	64,000,000.00	100.00%	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-

11.8 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	华润元大基金管理有限公司旗下开放式基金净值公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2015 年 1 月 5 日
2	华润元大基金管理有限公司关于旗下部分基金调整停	中国证券报、上海证券报、	2015 年 1 月 13 日

	牌股票估值方法的公告	证券时报、基金管理人网站	
3	华润元大基金管理有限公司关于实施基金直销柜台认购、申购及转换费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2015 年 1 月 15 日
4	华润元大基金管理有限公司关于旗下部分基金调整停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、 基金管理人网站	2015 年 1 月 17 日
5	华润元大信息传媒科技股票型证券投资基金 2014 年 第 4 季度报告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2015 年 1 月 22 日
6	关于华润元大信息传媒科技股票型证券投资基金参加 部分代销机构申购及定期定额投资申购费率优惠活动的 公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2015 年 1 月 30 日
7	华润元大基金管理有限公司关于旗下部分基金调整停牌 牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2015 年 2 月 14 日
8	华润元大基金管理有限公司关于旗下部分基金调整停牌 牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、 基金管理人网站	2015 年 2 月 25 日
9	华润元大基金管理有限公司关于旗下部分基金调整停牌 牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2015 年 3 月 5 日
10	华润元大基金管理有限公司关于旗下部分基金调整停牌 牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2015 年 3 月 11 日
11	华润元大基金管理有限公司关于旗下部分基金调整停牌 牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2015 年 3 月 20 日
12	华润元大基金管理有限公司关于旗下基金调整交易所 固定收益品种估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2015 年 3 月 26 日
13	华润元大信息传媒科技股票型证券投资基金 2014 年 年度报告	基金管理人网站	2015 年 3 月 30 日
14	华润元大信息传媒科技股票型证券投资基金 2014 年 年度报告摘要	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2015 年 3 月 30 日
15	华润元大基金管理有限公司关于变更公司总经理的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2015 年 4 月 2 日
16	关于华润元大基金管理有限公司从业人员在子公司兼任 职务情况变更的公告	基金管理人网站	2015 年 4 月 2 日
17	华润元大信息传媒科技股票型证券投资基金 2015 年 第 1 季度报告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2015 年 4 月 21 日
18	华润元大信息传媒科技股票型证券投资基金基金经理 变更公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2015 年 5 月 9 日
19	华润元大基金管理有限公司关于旗下部分基金调整停牌 牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2015 年 5 月 12 日
20	华润元大基金管理有限公司关于旗下部分基金调整停牌 牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2015 年 5 月 14 日
21	华润元大信息传媒科技股票型证券投资基金招募说明书 (更新)(2015 年第 1 号)	基金管理人网站	2015 年 5 月 15 日
22	华润元大信息传媒科技股票型证券投资基金招募说明书 (更新)摘要(2015 年第 1 号)	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2015 年 5 月 15 日
23	华润元大基金管理有限公司关于旗下部分基金调整停牌 牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2015 年 6 月 3 日
24	华润元大基金管理有限公司关于旗下部分基金调整停牌 牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2015 年 6 月 6 日
25	华润元大基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海 天天基金销售有限公司为销售机构并参与其费率优惠活 动的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2015 年 6 月 6 日
26	华润元大基金管理有限公司关于旗下华润元大信息传 媒科技股票型证券投资基金增加中国农业银行股份有限 公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2015 年 6 月 12 日
27	华润元大基金管理有限公司关于旗下部分基金调整停牌 牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2015 年 6 月 13 日
28	华润元大基金管理有限公司关于旗下部分基金调整停牌 牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2015 年 6 月 30 日

29	华润元大基金管理有限公司旗下开放式基金净值公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2015 年 7 月 1 日
30	华润元大基金管理有限公司关于旗下部分基金调整停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2015 年 7 月 2 日
31	华润元大基金管理有限公司关于旗下部分基金调整停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2015 年 7 月 3 日
32	华润元大基金管理有限公司关于旗下部分基金调整停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2015 年 7 月 4 日
33	华润元大基金管理有限公司关于旗下部分基金调整停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2015 年 7 月 7 日
34	华润元大基金管理有限公司关于公司、高级管理人员及基金经理投资旗下基金相关事宜的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2015 年 7 月 8 日
35	华润元大基金管理有限公司关于旗下部分基金调整停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2015 年 7 月 9 日
36	华润元大信息传媒科技股票型证券投资基金 2015 年第 2 季度报告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2015 年 7 月 18 日
37	华润元大基金管理有限公司关于旗下部分基金调整停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2015 年 7 月 18 日
38	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	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2015 年 8 月 3 日
39	华润元大信息传媒科技混合型证券投资基金基金合同	基金管理人网站	2015 年 8 月 3 日
40	华润元大信息传媒科技混合型证券投资基金托管协议	基金管理人网站	2015 年 8 月 3 日
41	华润元大基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加上海汇付金融服务有限公司为代销机构并开通定期定额投资和转换业务，同时参加申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2015 年 8 月 5 日
42	华润元大基金关于参加数米基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2015 年 8 月 8 日
43	华润元大基金关于参加天天基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2015 年 8 月 8 日
44	华润元大基金管理有限公司关于旗下部分基金调整停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2015 年 8 月 25 日
45	华润元大基金管理有限公司关于旗下部分基金调整停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2015 年 8 月 26 日
46	华润元大基金管理有限公司关于旗下基金停止在中信证券（浙江）所有代销业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2015 年 8 月 27 日
47	华润元大信息传媒科技股票型证券投资基金 2015 年半年度报告	基金管理人网站	2015 年 8 月 28 日
48	华润元大信息传媒科技股票型证券投资基金 2015 年半年度报告摘要	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2015 年 8 月 28 日
49	华润元大基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加北京微动利投资管理有限公司为代销机构并开通定期定额投资和转换业务，同时参加申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2015 年 8 月 29 日
50	华润元大基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司为代销机构并开通定期定额投资业务，同时参加其申购及定期定额费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2015 年 9 月 2 日
51	华润元大基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加中信期货有限公司为代销机构并开通定期定额投资和转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2015 年 9 月 2 日
52	华润元大基金管理有限公司关于旗下部分基金调整停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2015 年 9 月 7 日
53	华润元大基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加北京增财基金销售有限公司为代销机构并开通定期定额投资和转换业务，同时参加申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2015 年 9 月 8 日

54	华润元大基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中国工商银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2015 年 10 月 17 日
55	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	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2015 年 10 月 27 日
56	华润元大基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加上海好买基金销售有限公司为代销机构、开通定期定额投资和转换业务并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2015 年 11 月 4 日
57	华润元大基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加大泰金石投资管理有限公司为代销机构、开通转换业务并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2015 年 11 月 7 日
58	华润元大基金管理有限公司关于旗下部分基金调整停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2015 年 11 月 10 日
59	华润元大基金管理有限公司关于旗下部分基金调整停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2015 年 11 月 11 日
60	华润元大信息传媒科技混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2015 年第 2 号）	基金管理人网站	2015 年 11 月 2 日
61	华润元大信息传媒科技混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2015 年第 2 号）	中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2015 年 11 月 13 日
62	华润元大基金管理有限公司关于旗下部分基金调整停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2015 年 11 月 17 日
63	华润元大基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加北京钱景财富投资管理有限公司为代销机构、开通定期定额投资和转换业务并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2015 年 12 月 5 日
64	华润元大基金管理有限公司关于参加深圳众禄金融控股股份有限公司费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2015 年 12 月 16 日
65	华润元大基金管理有限公司关于参加中国农业银行股份有限公司定投产品费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2015 年 12 月 24 日
66	华润元大基金关于实施基金网上直销申购、定投及转换在通联支付渠道费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2015 年 12 月 29 日
67	华润元大基金管理有限公司关于指数熔断期间旗下基金业务安排的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2015 年 12 月 31 日

§ 12 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。

§ 13 备查文件目录

13.1 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。

13.2 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。

13.3 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
2016年3月29日