

2018年半年度报告摘要

华润元大信息传媒科技混合型证券投资基金

2018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,2018年8月5日

1 重要提示

1.1 重要提示  
基金管理人、基金托管人、基金销售机构不存在虚假记载、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,并由董事长签署。  
基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2018年8月23日复核了本报告期内基金资产净值、净值变动、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证基金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。  
本报告自2018年1月1日起至6月30日止。  
本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

2 基金基本情况

基金名称	华润元大信息传媒科技混合
基金代码	000522
基金运作方式	契约型开放式
基金存续期限	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	53,282,103.98
基金合同生效日期	不定期

2.2 基金产品说明

2.1 基金投资目标  
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,力争实现基金资产长期持续增值的投资目标。  
2.2 基金投资策略  
本基金的投资策略包括资产配置策略、行业配置策略、个股选择策略等。  
2.3 基金业绩比较基准  
中证TMT产业主题指数收益率\*80%+中国国债收益率\*20%

2.3 基金管理人

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
法定代表人	刘健	田国立
信息披露负责人	陈永成 电话: 0755-88399015	刘莹 电话: 010-67586066
客户服务电话	4000-1000-99	010-67586066
网址	0755-88399045	010-66275883

2.4 信息披露方式

本基金半年度报告正文的管理人互联网网址: <http://www.cryuanfund.com>

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

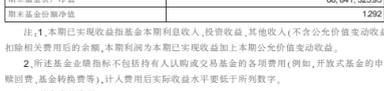
项目	本报告期(2018年1月1日至2018年6月30日)	本报告期末	上年度末
本期已实现收益	-10,571,333.78	-	-
本期利润	-17,086,694.05	-	-
加权平均基金份额本期利润	-0.3206	-	-
本期基金份额净值增长率	-20.44%	-	-
3.1.2 期末数据和指标	本报告期末(2018年6月30日)	本报告期末	上年度末
期末可供分配基金份额利润	0.0841	-	-
期末基金份额净值	68.841,325.95	68,841,325.95	68,841,325.95
期末基金资产净值	1,292	-	-

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金净值增值率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

期间	基金份额净值增长率①	业绩比较基准收益率②	①-②	①-③	①-④
过去一个月	-1.15%	2.82%	-9.17%	1.87%	0.02%
过去三个月	-19.10%	2.24%	-16.10%	1.43%	-3.00%
过去六个月	-20.44%	2.11%	-12.83%	1.46%	0.61%
过去一年	-16.54%	1.84%	-14.62%	1.23%	-1.72%
过去三年	-39.40%	1.98%	-38.17%	1.63%	-1.23%
自基金合同生效起至今	29.20%	1.99%	25.91%	1.63%	3.29%

3.2.2 自基金合同生效以来基金业绩比较基准变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金投资情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的情况

华润元大基金管理有限公司经中国证监会证监许可[2012]1746号批准,于2013年1月17日完成工商登记注册,注册资本为3亿元人民币,公司由华润集团控股投资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,占股比例为51%和49%。截至2018年6月30日,本基金管理人共管理十二只开放式基金,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,华润元大医疗健康主题混合型证券投资基金,华润元大富时中国A50指数证券投资基金,华润元大中创100交易型开放式指数证券投资基金,华润元大稳健收益增强型证券投资基金,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,华润元大现金收益货币市场基金,华润元大稳健债券型证券投资基金,华润元大沪深300指数型证券投资基金,华润元大消费主题型证券投资基金。

4.1.2 基金基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金基金经理的期限	从业年限	说明
张庭洪	基金经理	2018年6月5日	8年	曾任华泰证券(上海)资产管理有限公司中国区固定收益部副经理,2015年9月16日起担任华润元大富时中国A50指数证券投资基金基金经理,2015年9月16日起担任华润元大医疗健康主题混合型证券投资基金基金经理,2016年8月5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,2017年8月2日起担任华润元大现金收益货币市场基金基金经理,2018年1月1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,具有基金从业资格。
曹华	基金经理	2018年6月5日	8年	曾任国海证券(上海)分公司资产管理部副经理,2017年8月2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,具有基金从业资格。

4.2 基金投资组合报告

4.2.1 基金资产配置情况

截至2018年6月30日,本基金资产配置情况如下:股票资产占基金资产净值的比例为68.84%,债券资产占基金资产净值的比例为27.68%,货币资产占基金资产净值的比例为3.48%。

4.2.2 基金行业配置情况

截至2018年6月30日,本基金行业配置情况如下:计算机、通信和其他电子设备制造业占基金资产净值的比例为15.12%,医药生物占基金资产净值的比例为14.46%,食品饮料占基金资产净值的比例为12.82%。

4.2.3 基金重仓股情况

截至2018年6月30日,本基金重仓股情况如下:贵州茅台占基金资产净值的比例为1.87%,五粮液占基金资产净值的比例为1.87%,格力电器占基金资产净值的比例为1.87%。

4.2.4 基金衍生品投资情况

截至2018年6月30日,本基金衍生品投资情况如下:本基金未持有衍生品。

4.2.5 基金流动性风险分析

截至2018年6月30日,本基金流动性风险分析如下:本基金资产流动性良好,能够满足赎回需求。

4.2.6 基金投资策略执行情况

截至2018年6月30日,本基金投资策略执行情况如下:本基金严格执行了基金合同约定的投资策略。

4.2.7 基金业绩表现

截至2018年6月30日,本基金业绩表现如下:本基金净值增长率为-20.44%。

4.2.8 基金风险控制

截至2018年6月30日,本基金风险控制情况如下:本基金严格执行了基金合同约定的风险控制措施。

4.2.9 基金其他事项

截至2018年6月30日,本基金其他事项如下:本基金无其他重大事项。

4.2.10 基金管理人承诺

截至2018年6月30日,基金管理人承诺如下: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。

4.2.11 基金管理人声明

截至2018年6月30日,基金管理人声明如下:基金管理人声明本报告中不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

4.2.12 基金托管人声明

截至2018年6月30日,基金托管人声明如下:基金托管人声明本报告中不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

4.2.13 会计师事务所声明

截至2018年6月30日,会计师事务所声明如下:会计师事务所声明本报告中不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

4.2.14 基金销售机构声明

截至2018年6月30日,基金销售机构声明如下:基金销售机构声明本报告中不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

4.2.15 基金其他事项

截至2018年6月30日,基金其他事项如下:本基金无其他重大事项。

4.2.16 基金风险提示

截至2018年6月30日,基金风险提示如下:基金投资风险较大,投资者应谨慎投资。

4.2.17 基金其他事项

截至2018年6月30日,基金其他事项如下:本基金无其他重大事项。

4.2.18 基金其他事项

截至2018年6月30日,基金其他事项如下:本基金无其他重大事项。

4.2.19 基金其他事项

截至2018年6月30日,基金其他事项如下:本基金无其他重大事项。

4.4 管理人对于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

2018年上半年,中国股票市场从3月下旬开始,在外围贸易摩擦不断升级等内外因素影响下出现普跌。具体看,2018年前半,上证50指数下跌13.30%,上证综指下跌13.90%,沪深300下跌12.90%,创业板指数下跌8.33%,中证TMT指数下跌16.56%,中证1000指数下跌20.08%,中信一级29个行业中食品饮料(10.15%),医药(14.46%),食品饮料(1.82%)表现较好,涨幅居前3,而通信(-26.68%),电力设备(-27.00%),综合(-32.13%)板块表现较差,跌幅居前。在中信一级行业的4个TMT行业中,2018年上半年计算机下跌5.42%,电子下跌18.96%,传媒下跌21.06%,通信下跌26.66%。申万风格指数方面,2018年6月月底高市净率指数为4.11%,相比年初下跌6.75%,而低市净率指数下跌23.89%,市净率指数下跌25.89%。2018上半年,在指数普跌行情中,本基金减持了股票仓位,根据市场环境精选了估值水平合理、业绩稳健的优质上市公司。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2018年6月30日,本基金份额净值为1.292元,报告期内的份额净值增长率为-20.44%,同期业绩比较基准收益率为-12.83%。

4.5 管理人对于宏观及行业的基本面分析和判断,以及报告期内基金投资组合配置相关的宏观经济、行业情况、证券市场运行趋势的判断和基金投资策略的具体说明

2018年,全球经济继续企稳向上,中国宏观经济稳中向好,稳中有进。这意味着中国的权益类资产价值有较强的基本面支撑,市场整体方面,从长期来看,受贸易摩擦影响短期波动,但长远来看,养老金入市、中国居民资产配置中股票占比增加,人民币成功纳入MSCI指数,大市资产配置中长期结构持续调整,上市公司业绩继续改善,改革和转型升级加速高风险溢价,市场有望走出困境,行情致远。九大宏观经济指标主要围绕稳增长、数字经济、智慧社会的目标,推动互联网、大数据、人工智能和实体经济深度融合,发展数字经济,共享经济,培育新动能,大市有望走出困境,行情致远。九大宏观经济指标主要围绕稳增长、数字经济、智慧社会的目标,推动互联网、大数据、人工智能和实体经济深度融合,发展数字经济,共享经济,培育新动能,大市有望走出困境,行情致远。

4.6 管理人对于报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

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基金合同、中国证监会相关规定和基金合同于估值日的约定,对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任,会计师事务所应在估值调整导致基金资产净值的变化在0.25%以上时所采用的相关估值技术、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告,定价服务机构按照基金合同约定提供定价服务,其中,本基金管理人为了保障估值工作的顺利开展,建立了负责估值工作决策和执行的专门机构,或组成人员包括基金经理、投资风控负责人、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经验,精通各自领域的理论知识,熟悉相关法律法规,并具有丰富的实践经验。同时,根据基金管理人制定的相关制度,估值工作决策机构的成员中不包括基金管理人。报告期内,参与估值流程各方之间无重大分歧。

4.7 管理人对于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,符合相关法律法规及基金合同约定。

4.8 报告期内管理人对于本基金资产净值计价错误的说明

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

5 投资组合报告

5.1 报告期内本基金投资遵规守信情况说明

本报告期内,中国建设银行股份有限公司在本基金的投资过程中,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,完全尽职尽责履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 投资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

本报告期内,本基金管理人严格遵守了《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,完全尽职尽责履行了基金管理人应尽的义务。

5.3 投资人对报告期内基金资产净值计价错误的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守了《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,完全尽职尽责履行了基金管理人应尽的义务。

5.4 报告期内管理人对于本基金资产净值计价错误的说明

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

5.5 基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为:中证TMT产业主题指数收益率\*80%+中国国债收益率\*20%。

5.6 基金管理人承诺

截至2018年6月30日,基金管理人承诺如下: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。

5.7 基金托管人承诺

截至2018年6月30日,基金托管人承诺如下:基金托管人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

5.8 会计师事务所承诺

截至2018年6月30日,会计师事务所承诺如下:会计师事务所声明本报告中不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

5.9 基金销售机构承诺

截至2018年6月30日,基金销售机构承诺如下:基金销售机构声明本报告中不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

5.10 基金其他事项

截至2018年6月30日,基金其他事项如下:本基金无其他重大事项。

5.11 基金风险提示

截至2018年6月30日,基金风险提示如下:基金投资风险较大,投资者应谨慎投资。

5.12 基金其他事项

截至2018年6月30日,基金其他事项如下:本基金无其他重大事项。

5.13 基金其他事项

截至2018年6月30日,基金其他事项如下:本基金无其他重大事项。

5.14 基金其他事项

截至2018年6月30日,基金其他事项如下:本基金无其他重大事项。

5.15 基金其他事项

截至2018年6月30日,基金其他事项如下:本基金无其他重大事项。

5.16 基金其他事项

截至2018年6月30日,基金其他事项如下:本基金无其他重大事项。

5.17 基金其他事项

截至2018年6月30日,基金其他事项如下:本基金无其他重大事项。

5.18 基金其他事项

截至2018年6月30日,基金其他事项如下:本基金无其他重大事项。

5.19 基金其他事项

截至2018年6月30日,基金其他事项如下:本基金无其他重大事项。

5.20 基金其他事项

截至2018年6月30日,基金其他事项如下:本基金无其他重大事项。

5.21 基金其他事项

截至2018年6月30日,基金其他事项如下:本基金无其他重大事项。

5.22 基金其他事项

截至2018年6月30日,基金其他事项如下:本基金无其他重大事项。

5.23 基金其他事项

截至2018年6月30日,基金其他事项如下:本基金无其他重大事项。

5.24 基金其他事项

截至2018年6月30日,基金其他事项如下:本基金无其他重大事项。

5.25 基金其他事项

截至2018年6月30日,基金其他事项如下:本基金无其他重大事项。

5.26 基金其他事项

截至2018年6月30日,基金其他事项如下:本基金无其他重大事项。

5.27 基金其他事项

截至2018年6月30日,基金其他事项如下:本基金无其他重大事项。

5.28 基金其他事项

截至2018年6月30日,基金其他事项如下:本基金无其他重大事项。

5.29 基金其他事项

截至2018年6月30日,基金其他事项如下:本基金无其他重大事项。

5.30 基金其他事项

截至2018年6月30日,基金其他事项如下:本基金无其他重大事项。

5.31 基金其他事项

截至2018年6月30日,基金其他事项如下:本基金无其他重大事项。

5.32 基金其他事项

截至2018年6月30日,基金其他事项如下:本基金无其他重大事项。

5.33 基金其他事项

截至2018年6月30日,基金其他事项如下:本基金无其他重大事项。

5.34 基金其他事项

截至2018年6月30日,基金其他事项如下:本基金无其他重大事项。

5.35 基金其他事项

截至2018年6月30日,基金其他事项如下:本基金无其他重大事项。

5.36 基金其他事项

截至2018年6月30日,基金其他事项如下:本基金无其他重大事项。

5.37 基金其他事项

截至2018年6月30日,基金其他事项如下:本基金无其他重大事项。

5.38 基金其他事项

截至2018年6月30日,基金其他事项如下:本基金无其他重大事项。

5.39 基金其他事项

截至2018年6月30日,基金其他事项如下:本基金无其他重大事项。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

孙博博 黄晓芳 黄晓芳  
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 财务报表

6.4.1 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混合型证券投资基金,经中国证监会证券投资基金业协会(以下简称“中国证监会”)证监许[2013]1598号(关于核准华润元大信息传媒科技混合型证券投资基金募集)核准,由华润元大基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)和(华润元大信息传媒科技混合型证券投资基金)共同发起设立,基金合同于2014年2月27日生效,基金管理人于2014年3月27日,首次公开发行股票,存期期限不定,首次募集期间为2014年2月27日至2014年3月27日,首次公开发行股票数量为100,000,000股,募集资金总额为1,000,000,000.00元,扣除发行费用后,募集资金净额为999,999,999.99元,募集资金已于2014年3月31日正式到位,基金合同生效日的基金资产总额为248,844,670.33份基金份额,其中认购资金扣除认购费用116,949.15份基金份额,基金资产总额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”)。

6.4.2 基金投资组合报告

6.4.2.1 报告期末基金资产组合情况

截至2018年6月30日,本基金资产组合情况如下:股票资产占基金资产净值的比例为68.84%,债券资产占基金资产净值的比例为27.68%,货币资产占基金资产净值的比例为3.48%。

6.4.2.2 报告期末按行业分类的境内投资组合

截至2018年6月30日,本基金境内投资组合情况如下:计算机、通信和其他电子设备制造业占基金资产净值的比例为15.12%,医药生物占基金资产净值的比例为14.46