

## 华润元大信息传媒科技股票型证券投资基金

## [2015] 第一季度报告

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4月21日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会对本基金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、完整性、及时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4月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现、资产配置组合和报告内容，保证本报告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1月1日起至3月31日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称 华润元大信息传媒科技股票

交易代码 000522

基金运作方式 约定期开放式

基金合同生效日 2014年3月31日

报告期末基金份额总额 18,974,960.67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情况下，力争实现净值增长率超越业绩比较基准。

投资策略 1. 大数据、云计算、移动互联网及证券投资相关的产业链配置策略为主要配置策略。

2. 股票投资策略

基金管理人将结合对宏观经济的分析，充分考虑长期持续增长能力的公司。

3. 债券投资策略

本基金将通过久期调整策略、信用利差策略、息差策略等操作。

4. 股权投资策略

本基金将通过行业研究和个股精选，选择具有核心竞争力、估值合理的股票进行配置。

5. 权证投资策略

本基金将通过价值分析策略，在用期权定价模型分析组合持有的股票的基础上，充分考虑期权品种的收益率、波动性和风险收益特征，通过资产配置、品种与类属配置、择时配置等操作策略，力求在风险调整后获得较高的收益。

本基金将投资于货币市场基金、短期融资券、回购协议、债券回购、在严格控制风险的前提下，选择流动性较高、收益率较高的品种进行投资，以获取稳定的投资收益。

7. 现金管理

本基金将通过现金流管理，通过未实现现金的变现实现现金管理，并制定现金运作中的具体安排。

业绩比较基准 中证TMT行业主题指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%

风险收益特征 本基金为股票型基金，属于证券投资基金中的高风险品种，预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

基金经理管理人 华润元大基金管理有限公司

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

单位：人民币元

主要财务指标 报告期(2015年1月1日至2015年3月31日)

1.本期已实现收益 11,512,998.04

2.本期利润 17,259,791.56

3.加权平均基金份额本期利润 0.5386

4.期末基金份额净值 30,497,905.44

5.期末基金资产净值 1,607

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，本期利润为本基金已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.所述基金绩效指标不包括持有人认购或申购基金的费用(例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等)，用户实际收益水平将低于所列示。

3.基金净值表现

3.1 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

新段 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

过去二个月 56.63% 2.31% 48.13% 1.46% 8.50% 0.85%

3.2 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

单位：人民币元

3.3 本报告期基金份额净值增长率与同期行业业绩比较基准收益率的比较

新段 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

过去二个月 49.03% 2.08% 47.50% 1.35% 1.53% 0.73%

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六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关规定。建仓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 任本基金的基金期限 证券从业年限 说明

华润元大信息传媒科技股票型证券投资基金 刘鹏翀 2014年3月31日 - 5年

注：刘鹏翀，硕士，现担任公司高级管理人员，负责信息传媒科技产业投资研究工作。

注：刘鹏翀先生的任期从2014年3月31日起至2015年3月31日止。

注：刘鹏翀先生的任期从2014年3月31日起至201