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)

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

二〇一五年五月

【重要提示】

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2013年12月17日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号文准予募集注册。本基金基金合同于2014年3月31日正式生效。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册,但中国证监会对本基金募集的注册,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险,投资人认购(或申购)本基金时应认真阅读本招募说明书和基金合同,全面认识本基金的风险收益特征和产品特性,并充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,谨慎做出投资决策。本基金面临的主要风险是市场风险、流动性风险、信用风险、政策风险、管理风险、操作风险、技术风险、合规性风险及本基金的特有风险等。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。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,本基金管理人不保证投资于本基金一定盈利,也不保证最低收益。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。

基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则,在投资者作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险,由投资者自行负担。

除特别说明外,本招募说明书所载内容截止日为2015年3月31日,有关财务数据和净值表现截止日为2015年3月31日(财务数据未经审计)。

一、基金合同生效日期

2014年3月31日

二、基金管理人

(一)基金管理人概况

名称:华润元大基金管理有限公司

住所: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)

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

邮政编码:518048

法定代表人:路强

成立时间:2013年1月17日

注册资本:2亿元人民币

存续期限:永续经营

联系人:陈少媛

电话:(0755)88399008

传真:(0755)88399045

华润元大基金管理有限公司(以下简称“公司”)经中国证监会证监许可[2012]1746号文批准设立。公司股权结构如下:

股东名称	股权比例
华润深国投信托有限公司	51%
元大宝来证券投资信托股份有限公司	49%

本基金管理人公司治理结构完善,经营运作规范,能够切实维护基金投资人的合法权益。公司董事会下设薪酬与提名委员会、合规审核委员会、风险控制委员会三个专业委员会,有针对性地研究公司在经营管理和基金运作中的相关情况,制定相应的政策,并充分发挥独立董事的职能,切实加强对公司运作的监督。

公司监事会由四位监事组成,主要负责检查公司的财务以及对公司董事、高级管理人员的行为进行监督。

公司实行董事会领导下的总经理负责制,总经理根据公司章程及董事会授权,全面主持公司日常经营管理。督察长负责公司及基金运作的监察稽核工作,由公司董事会聘任,对董事会负责。公司经营层设投资决策委员会,特定客户资产管理投资决策委员会、产品审议委员会、风险管理委员会,固有资金投资运用管理委员会,IT治理委员会作为总经理行使职权的议事决策机构。

公司按照不同业务职能,分为十个部门。其中投资部门包括投资管理部、固定收益部、特定客户资产管理部三个部门;市场部门包括营销部和市场策划部两个部门;后台运营部门包括信息技术部、运营管理部、综合管理部和财务部四个部门;同时公司还设立了独立于各业务部门的监察合规部,对公司及基金投资运作、内部管理等事项进行事前、事中、事后独立监察。

截至到2015年3月31日,公司有员工61人,其中56%的员工具有硕士及以上学历,92%的员工具有基金从业资格。

公司已经建立健全投资管理制度、风险控制制度、监察稽核制度、基金会计制度、财务管理制度、信息技术管理制度、信息披露制度等公司管理制度。

(二)主要成员情况

1、基金管理人董事会成员

路强先生,董事长,本科学历。历任中国华润总公司进出口贸易经理,大连保税区宝利行华润国贸有限公司副总经理,华润投资开发有限公司助理总经理、董事、副总经理,华润深国投信托有限公司副总经理。现任华润深国投信托有限公司董事、总经理,深圳红树林创业投资有限公司总经理,深圳华润元大资产管理有限公司执行董事。

厉放女士,副董事长,博士学历。历任中国人民银行金融研究所高级研究助理,香港岭南大学社会科学院讲师,美国安泰国际保险公司亚太总部研究员,荷兰集团亚太区研究中心主管,荷兰国际集团全球养老金服务企业资深顾问,现任元大宝来证券(香港)有限公司董事总经理,招商局中国基金有限公司独立董事。

孟扬女士,董事,硕士学历。历任北京大学助教,深圳国际信托投资公司租赁部业务员、副科长、科长、副经理,资产管理部经理、总经理助理,深圳国际信托投资有限责任公司副总经理,华润深国投信托有限公司董事、总经理。现任华润深国投信托有限公司董事长,华润金融控股有限公司副总经理,深圳红树林创业投资有限公司董事长,国信证券股份有限公司董事。

刘宗圣先生,董事,博士学历。历任泰国WALL RESEARCH投资策略分析师,宝来证券研发部总经研究组组长,宝来证券集团总裁特别助理,总经理室主任,国际金融部副总经理,宝来证券(香港)有限公司总经理、宝来证券投资信托股份有限公司总经理。现任元大宝来证券投资信托股份有限公司总经理,PT AMCI Manajemen Investasi Indonesia公司(简称AMII资产管理公司)董事(Commissioner)。

刘胤宏先生,独立董事,硕士学历。历任北京金杜律师事务所公司证券部律师,现任北京金诚同达律师事务所高级合伙人、深圳分所主任,深圳市格林赛特环保能源科技有限公司监事,深圳市南天信息技术有限公司监事。

孙茂竹先生,独立董事,硕士学历。历任北京市第二建筑工程公司工人,现任中国人民大学商学院财务系教授,博士生导师;北京城建设计发展集团股份有限公司独立董事,洛阳轴研科技股份有限公司独立董事,北京首都开发股份有限公司独立董事。

张天鹅先生,独立董事,硕士学历。历任化学银行(Chemical Bank)经理,菲利普·莫里斯公司(Philip Morris Inc)经理,中华开发公司经理,蓝等管理顾问有限公司负责人,所罗门兄弟(Salomon Brothers)副总裁,华盛顿资本集团(Washington Capital Group)执行董事,瑞士联合银行集团(UBS)执行董事,阿凡提公司(Avant! Corporation)首席财务官,Union Nature Inc.负责人,瑞士信贷第一波士顿银行(CSFB)董事总经理。现任翰宇彩晶股份有限公司独立董事,利统股份有限公司董事,富晶通股份有限公司独立董事,富堡工业股份有限公司董事,微端科技股份有限公司监察人法人代表。

林瑞源先生,董事,总经理,本科学历。历任元大宝来证券股份有限公司服务代理部科长,元大宝来证券投资信托股份有限公司客户服务部经理、行销部副总经理、投资理财部副总经理、通路事业部资深副总经理;现任深圳华润元大资产管理有限公司总经理。

何特先生,董事,督察长,硕士学历。历任深圳三九医药贸易有限公司财务部经理,华润深国投信托有限公司投资部经理、证券投资部信托经理,摩根士丹利华鑫基金管理有限公司监察稽核部监察稽核主管,华润深国投信托有限公司证券投资部高级信托经理、总经理助理、执行总监。现任深圳证券期货业纠纷调解中心调解员,深圳华润元大资产管理有限公司执行监事。

2、基金管理人监事会成员

卢伦女士,监事,硕士学历。历任华为技术有限公司人力资源部经理,晨星(深圳)资讯有限公司股票研究部研究员,华润(集团)有限公司财务部资本副总监,现任华润深国投信托有限公司财务管理部总经理。

林武田先生,监事,博士学历。历任兔千股份有限公司董事长兼总经理,元大建设开发股份有限公司总经理,元大京华证券股份有限公司执行副总,元大创业投资股份有限公司董事长,元大国际财务顾问股份有限公司董事长,财团法人元大文教基金会执行长,元大金融控股股份有限公司执行副总,现任元大宝来证券投资信托股份有限公司董事长;财团法人元大文教基金会董事。

张扬帆先生,监事,硕士学历。历任德勤华永会计师事务所高级审计师,华润深国投信托有限公司财务管理部经理,现任华润元大基金管理有限公司财务部总经理助理。

崔佩伦女士,职工监事,硕士学历。历任美商花旗银行空中理财银行专员、训练讲师,JF摩根富林明投信基金事务部襄理,台湾群益投信营销通路部经理、客服部经理,元大证券投信托股份有限公司稽核部资深经理,行政管理部经理,客服部经理,现任华润元大基金管理有限公司运营管理部总经理。

3、基金管理人高级管理人员

路强先生,董事长暨法定代表人。简历见董事会成员介绍。

林瑞源先生,总经理。简历见董事会成员介绍。

何特先生,督察长。简历见董事会成员介绍。

4、本基金基金经理

张仲维先生,基金经理,台湾政治大学经济学硕士,3年投资管理经验,历任台湾元大宝来证券投资信托股份有限公司国际部基金经理人、研究员,曾任元大新兴消费商机基金基金经理。2013年加入华润元大基金管理有限公司投资管理部,现任华润元大信息传媒科技股票型证券投资基金基金经理及华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

5、投资决策委员会成员

林瑞源(总经理)

杨凯玮(固定收益部总经理兼投资管理部总经理)

陈品桥(投资管理部投资总监)

上述人员之间无近亲属关系。

三、基金托管人

一、基金托管人情况

(一)基本情况

名称:中国建设银行股份有限公司(简称:中国建设银行)

住所:北京市西城区金融大街25号

办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人:王洪章

成立时间:2004年09月17日

组织形式:股份有限公司

注册资本:贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间:持续经营

基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]12号

联系人:田 青

联系电话:(010)6759 5096

中国建设银行拥有悠久的经营历史,其前身“中国人民建设银行”于1954年成立,1996年易名为“中国建设银行”。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于2004年9月分立而成立,承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行(股票代码:939)于2005年10月27日在香港联合交易所主板上市,是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006年9月11日,中国建设银行又作为第一家H股公司晋身恒生指数。2007年9月25日中国建设银行A股在上海证券交易所上市并开始交易。A股发行后中国建设银行的已发行股份总数为:250,010,977,486股(包括240,417,319,880股H股及9,593,657,606股A股)。

2014年上半年,本集团实现利润总额1,695.16亿元,较上年同期增长9.23%;净利润1,309.70亿元,较上年同期增长9.17%。营业收入2,870.97亿元,较上年同期增长14.20%;其中,利息净收入增长12.59%,净利息收益率(NIM)2.80%;手续费及佣金净收入增长8.39%,在营业收入中的占比达20.96%。成本收入比24.17%,同比下降0.45个百分点。资本充足率与核心一级资本充足率分别为13.89%和11.21%,同业领先。

截至2014年6月末,本集团资产总额163,997.90亿元,较上年末增长6.75%,其中,客户贷款和垫款总额91,906.01亿元,增长6.99%;负债总额152,527.78亿元,较上年末增长6.75%,其中,客户存款总额129,569.56亿元,增长6.00%。

截至2014年6月末,中国建设银行公司机构客户326.89万户,较上年末增加20.35万户,增长6.64%;个人客户近3亿户,较上年末增加921万户,增长3.17%;网上银行客户1.67亿户,较上年末增长9.23%,手机银行客户数1.31亿户,增长12.56%。

截至2014年6月末,中国建设银行境内营业机构总量14,707个,服务覆盖面进一步扩大;自助设备72,128台,较上年末增加3,115台。电子银行和自助渠道账务性交易量占比达86.55%,较上年末提高1.15个百分点。

2014年上半年,本集团各方面良好表现,得到市场与业界广泛认可,先后荣获国内外知名机构授予的40余个重要奖项。在英国《银行家》杂志2014年“世界银行1000强排名”中,以一级资本总额位列全球第2,较上年上升3位;在美国《福布斯》杂志2014年全球上市公司2000强排名中位列第2;在美国《财富》杂志世界500强排名第38位,较上年上升12位。

中国建设银行总行设投资托管业务部,下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII托管处、养老金托管处、清算处、核算处、监督稽核处等9个职能处室,在上海设有投资托管服务上海备份中心,共有员工240余人。自2007年起,托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计,并已经成为常规化的内控工作手段。

(二)主要人员情况

赵观甫,投资托管业务部总经理,曾先后在中国建设银行郑州市分行、总行信贷部、总行信贷二部、行长办公室工作,并在中国建设银行河北省分行营业部、总行个人银行业务部、总行审计部担任领导职务,长期从事信贷业务、个人银行业务和内部审计等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟,投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部,长期从事大客户的客户管理及服务工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红,投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行总行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室,长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张力钟,投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行建筑经济部、信贷二部、信贷部、信贷管理部、信贷经营部、公司业务部,并在总行集团客户部和中国建设银行北京市分行担任领导职务,长期从事信贷业务和集团客户业务等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲,投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行会计部,长期从事托管业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

(三)基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行,中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念,不断加强风险管理和内部控制,严格履行托管人的各项职责,切实维护资产持有人的合法权益,为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展,中国建设银行托管资产规模不断扩大,托管业务品种不断增加,已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系,是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2014年9月末,中国建设银行已托管389只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平,赢得了业内的高度认同。中国建设银行自2009年至今连续五年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”;获和讯网的中国“最佳资产托管银行”奖;境内权威资讯媒体《每日经济观察》的“最佳基金托管银行”奖;中央国债登记结算有限责任公司的“优秀托管机构”奖。

二、基金托管人的内部控制制度

(一)内部控制目标

作为基金托管人,中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定,守法经营、规范运作、严格监察,确保业务的稳健运行,保证基金财产的安全完整,确保有关信息的真实、准确、完整、及时,保护基金份额持有人的合法权益。

(二)内部控制组织结构

中国建设银行设有风险与内控管理委员会,负责全行风险管理与内部控制工作,对托管业务风险控制工作进行检查指导。投资托管业务部专门设置了监督稽核处,配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作,具有独立行使监督稽核工作职权和能力。

(三)内部控制制度及措施

投资托管业务部具备系统、完善的制度控制体系,建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程,可以保证托管业务的规范操作和顺利进行;业务人员具备从业资格;业务管理严格实行复核、审核、检查制度,授权工作实行集中控制,业务印章按规程保管,存放、使用,账户资料严格保管,制约机制严格有效;业务操作区专门设置,封闭管理,实施音像监控;业务信息由专职信息披露人负责,防止泄密;业务实现自动化操作,防止人为事故的发生,技术系统完整、独立。

三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

(一)监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定,监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的“托管业务综合系统——基金监督子系统”,严格按照现行法律法规以及基金合同规定,对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督,并定期编写基金投资运作监督报告,报送中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中,对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

(二)监督流程

1.每工作日按时通过基金监督子系统,对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控,发现投资比例超标等异常情况,向基金管理人发出书面通知,与基金管理人进行情况核实,督促其纠正,并及时报告中国证监会。

2.收到基金管理人的划款指令后,对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。

3.根据基金投资运作监督情况,定期编写基金投资运作监督报告,对各基金投资运作的合法合规性、投资独立性和风格显著性等方面进行评价,报送中国证监会。

4.通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易,电话或书面要求基金管理人进行解释或举证,并及时报告中国证监会。

四、相关服务机构

(一)直销机构

本基金直销机构为本基金管理人直销中心和本基金管理人网上直销交易平台。

名称:华润元大基金管理有限公司

住所: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)

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

法定代表人:路强

成立时间:2013年1月17日

电话:(0755)88399008

传真:(0755)88399045

联系人:马天晓

客户服务电话:4000-1000-89

网址:www.cryuantafund.com

个人投资者可以通过本基金管理人网上直销交易平台办理开户、本基金的认购、申购、赎回等业务,具体交易细则请参阅本基金管理人网站公告。网上交易网址:www.cryuantafund.com。

(二)代销机构

(1)中国建设银行股份有限公司

注册地址:北京市西城区金融大街25号

办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人:王洪章

邮政编码:100032

联系人:张静

传真:010-66275654

客服电话:95533

网址:www.ccb.com

(2)珠海华润银行股份有限公司

注册地址:广东省珠海市吉大九洲大道东1346号

办公地址:广东省珠海市吉大九洲大道东1346号

法定代表人:蒋伟

传真:4008396588-018012

客服电话:400-880-0338

网址:www.crbank.com.cn

(3)国泰君安证券股份有限公司

注册地址:上海市浦东新区商城路618号

办公地址:上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼

法定代表人:万建华

电话:021-38676666

传真:021-38670666

客服电话:4008888666

网址:www.gtja.com

(4)东吴证券股份有限公司

注册地址:苏州市工业园区星阳街5号东吴证券大厦

办公地址:苏州市工业园区星阳街5号东吴证券大厦

法定代表人:范力

联系人:方晓丹

电话:0512-65581136

传真:0512-65588021

客服电话:4008601555

网址:www.dwzq.com.cn

(5)国信证券股份有限公司

注册地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人:何如

联系人:齐晓燕

电话:0755-82130833

传真:0755-82133952

客服电话:95536

网址:www.guosen.com.cn

(6)中国国际金融有限公司

注册地址:北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

办公地址:北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

法定代表人:金立群

电话:010-65051166

传真:010-65051156

网址:www.cicc.com

(7)中信建投证券股份有限公司

注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址:北京市朝内大街188号

法定代表人:王常青

电话:010-85130588

传真:010-65182261

客服电话:400-888-8108

网址:www.csc108.com

(8)中信证券股份有限公司

注册地址:广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座

办公地址:北京朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦9层

法定代表人:王东明

电话:010-60838888

传真:010-60836221

客服电话:95548

网址:www.cs.ecitic.com

(9)中信证券(浙江)有限责任公司

注册地址:浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层

办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层

法定代表人:沈强

联系人:王需需

电话:0571-87112507

传真:0571-85783771

客服电话:95548

网址:www.bigsun.com.cn

(10)兴业证券股份有限公司

注册地址:福州市湖东路268号

办公地址:上海市民生路1199弄证大五道口广场1号楼22楼

法定代表人:兰荣

联系人:黄英

电话:0591-38162212

传真:0591-38507538

客服电话:95562

网址:www.xyzq.com

(11)光大证券股份有限公司

注册地址:上海市静安区新闸路1508号

办公地址:上海市静安区新闸路1508号

法定代表人:袁长清(代行)

邮政编码:200040

联系人:刘晨

传真:021-22169134

客服电话:95525

网址:www.ebscn.com

(12)中国银河证券股份有限公司

注册地址:北京西城区金融大街35号国际企业大厦C座

办公地址:北京西城区金融大街35号国际企业大厦C座

法定代表人:陈有安

邮政编码:100033

联系人:宋明

传真:010-66568990

客服电话:4008-888-888

网址:www.chinastock.com.cn

(13)齐鲁证券有限公司

注册地址:济南市经七路86号

办公地址:济南市经七路86号

法定代表人:李玮

联系人:吴阳

电话:0531-68889155

传真:0531-68889752

客户服务电话:95538

网址:www.qlzq.com.cn

(14)杭州数米基金销售有限公司

注册地址:杭州市余杭区仓前街文一西路1218号1栋202室

办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼

法定代表人:陈柏青

电话:021-60897840

传真:0571-26698533

客服电话:4000-766-123

网址:www.fund123.cn

(15)上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址:上海市浦东新区高翔路526号2幢220室

办公地址:上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层

法定代表人:张跃伟

电话:021-20691869

传真:021-20691861

客服电话:400-820-2899

网址:www.erichfund.com

(16)浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址:浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室

办公地址:浙江省杭州市翠柏路7号杭州电子商务产业园2楼

法定代表人:凌顺平

电话:0571-88911818

传真:0571-86800423

客服电话:4008-773-772

网址:同花顺金融服务网www.10jqka.com.cn爱基金网www.ijjin.cn

(17)深圳众禄基金销售有限公司

注册地址:深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼

办公地址:深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼

法定代表人:薛峰

联系人:童彩平

电话:0755-33227950

传真:0755-33227951

客服电话:4006-788-887

网址:众禄基金网www.zlfund.cn及基金买卖网www.jjmmw.com

(18)北京展恒基金销售有限公司

办公地址:北京市朝阳区华严北里二号民建大厦六层

法定代表人:闫振杰

联系人:焦琳

电话:010-62020088

传真:010-62020355

客服电话:400-888-6661

网址:www.myfund.com

(19)中期资产管理有限公司

注册地址:北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢11层1103号

办公地址:北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢2层

法定代表人:路瑶

邮政编码:100020

联系人:侯英建

传真:010-65807864

客服电话:010-65807609

网址:www.cifcofund.com

(20)平安银行股份有限公司

注册地址:深圳市深南东路5047号

法定代表人:孙建一

联系人:张莉

联系电话:021-38637673

传真:021-50979507

客服电话:95511转3

网址:www.bank.pingan.com

(21)深圳前海汇联基金销售有限公司

注册地址:深圳南山区粤兴二道6号武汉大学深圳产学研大楼B815号

办公地址:深圳福田区金田路2028号皇岗中心4楼

法定代表人:丁海

邮政编码:518000

联系人:张誉腾

传真:0755-32938888-5

客服电话:0755-36907366

网址:www.flyingfund.com.cn

(22)中信证券(山东)有限责任公司

注册地址:山东省青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001

办公地址:山东省青岛市崂山区深圳路222号1号楼20层

法定代表人:杨宝林

联系人:吴忠超

电话:0532-85022326

传真:0532-85022605

客服电话:95548

网址:www.citicsd.com

基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其它符合要求的机构代理销售本基金或变更上述销售机构,并及时公告。

(三)登记机构

名称:华润元大基金管理有限公司

住所: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)

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

法定代表人:路强

电话:(0755)88399008

传真:(0755)88399045

联系人:崔佩伦

(四)出具法律意见书的律师事务所

名称:上海市通力律师事务所

住所:上海市银城中路68号时代金融中心19楼

办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼

负责人:俞卫锋

电话:(021)31358666

传真:(021)31358600

联系人:安冬

经办律师:黎明、安冬

(五)审计基金财产的会计师事务所

名称:安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)

住所: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

办公地址: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

法定代表人:Ng Albert Kong Ping 吴港平

电话:(010)58153000、(0755)25028288

传真:(010)85188298、(0755)25026188

联系人:李妍明

经办注册会计师:吴翠碧、高鹤

五、基金名称和基金类型

(一)本基金名称:华润元大信息传媒科技股票型证券投资基金

(二)本基金类型:股票型证券投资基金

(三)基金运作方式:契约型开放式

六、基金投资目标和投资方向

(一)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。

(二)投资范围

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%。

在基金实际管理过程中,本基金具体资产配置比例由基金管理人根据中国宏观经济情况和证券市场的阶段性变化做主动调整,以求基金资产在各类资产的投资中达到风险和收益的最佳平衡,但比例不超出上述限定范围。在法律法规有新规定的情况下,基金管理人可对上述比例做适度调整。

七、基金的投资策略

(一)投资策略

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。

(1)宏观经济因素方面,考量因素包括但不限于居民消费价格指数(CPI)、工业品出厂价格指数(PPI)、狭义货币供应量(M1)、广义货币供应量(M2)、固定资产投资增长率、工业企业增加值、采购经理人指数(PMI)、消费品零售增长率、汇率、贸易盈余、大宗商品库存及价格变化等定量因素,评估宏观经济变量变化趋势。

(2)政策法规因素方面,主要关注政府货币政策和财政政策,考量因素包括但不限于社会总需求、社会总供给、物价和利率水平,影响因素有:税制变化、政府支出及转移支付、国债发行、利率水平、信贷规模以及存款准备金率等。

(3)证券市场表现因素方面主要关注市场估值和技术指标分析,考量因素包括但不限于市场整体估值水平、各行业及板块相对估值水平、一致预期估值水平、大势型技术指标、超买超卖型技术指标、趋势型技术指标、成交量型技术指标、均线型技术指标等。

而在实际执行上,本基金将依据上述宏观经济因子在基金投资模型中所产生的投资信号,实施即时性的动态资产配置调整,通过持仓比例的实时调整,有效增强基金收益并降低投资风险。

2、股票投资策略

(1)信息传媒科技(TMT)产业上市公司股票的界定

TMT(Technology,Media,Telecom)产业,即以IT、互联网,固定互联网、移动互联网为代表的数字新媒体产业。TMT产业利用新技术、空前地活跃了信息沟通和信息融合,代表了未来电信、媒体科技(互联网)、信息技术的融合趋势,是我国信息化升级进程的主要受益产业。本基金将29个中信一级行业中的通信、传媒、电子元器件和计算机这四个一级行业归为TMT产业。

如果未来由于技术进步或经济结构变化导致本基金TMT产业的覆盖范围发生变动,基金管理人有权适时对上述定义进行补充和修订。如果未来中信证券对行业分类标准进行调整,例如对一、二级行业进行增减,则本基金管理人亦将酌情进行相应的调整。如果未来中信证券不再存续或不再发布行业分类标准,本基金管理人将根据上述对TMT产业的界定,自行选择符合TMT产业范畴的上市公司股票进行投资。

本基金为主题型基金,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%。

(2)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。

I.定量分析是建立在已为国际市场上广泛应用的多因子阿尔法模型(Multiple Factors Alpha Model)的基础上,根据中国资本市场的实际情况,由本基金管理人团队开发的更具针对性和实用性的修正的多因子阿尔法选股模型。本基金采用的因子指标主要分为两大类:

1)市场面因子

本基金管理人认为,市场面因子对市场的反应比较直接,比基本分析更能反应实际市场的局部现象;在一个非完全有效的市场中,这些因子对选择股票的表现具有一定的正面贡献。本基金主要采用的市场面因子包括绝对强弱指标和相对强弱指标等。

①绝对强弱指标

通过比较一段时期内股票的绝对涨幅和股价走势的斜率高低来分析市场看好该股票的程度,从而判断未来市场的走势。

②相对强弱指标

通过比较一段时期内的平均收盘涨数和平均收盘跌数来分析市场买卖盘的意向和实力,从而判断未来市场的走势。

2)成长因子

本基金通过量化统计模型,建立企业成长因子库,根据历史表现,将直接能反映超额收益的成长因子作为本基金的成份因子。本基金入库的成长因子主要包含主营业务增长率、净利润增长率等。

①主营业务增长率

主营业务增长率=(本期主营业务收入-上期主营业务收入总额的比率)/上期主营业务收入

该指标通常是公司利润增长的先导指标,是分析公司投资价值的重要指标。主营收入快速增长往往意味着市场占有率的上升,这是公司竞争力提高的重要标志,体现了公司的持续成长能力。

②净利润增长率

净利润增长率=(本期净利润额-上期净利润额)/上期净利润额

该指标反映的是企业实现价值最大化的扩张速度,是反映公司成长状况和发展能力的重要指标。

本基金利用“多因子阿尔法模型”计算每只股票的因子加权得分,并挑选总得分最高的若干只个股构建投资组合。每隔一段时期,将重新计算个股加权因子得分,并以新得分值为依据对股票投资组合进行调整,始终保证组合中个股具有相对较高的分值。在挑选多因子模型的过程中,量化研究团队并不以模型的复杂性为目的,而是以达到模型的有效性为最大考量。

II.定性分析主要依赖基本面的研究,TMT产业的上市公司包含很多一般意义的行业,其发展阶段也有所不同,在个股的精选上,本基金将着重选择那些产品已经过前期的技术和产业准备、下游需求在政策刺激下将大幅增长、具有良好业绩成长性的上市公司。因此,本基金将从上市公司的成长性、科技研发能力、估值水平等方面对TMT产业的上市公司进行综合评价;

1)成长性:本基金对科技主题上市公司的成长性分析将包括定量及定性两方面。在定量的分析方法上,主要参考主营业务收入增长率、主营业务利润增长率、净资产收益率(ROE)、毛利率等成长性指标。在实际投资操作中,本基金并不拘泥于单一成长性指标,而是将综合考虑上市公司的基本面后,最大程度地筛选出具有持续成长潜力的科技主题上市公司。因此,在对上市公司成长性的定性分析上,本基金强调企业成长能力的可持续性,重点从行业成长前景、行业地位、用户消费习惯、产品前景、盈利能力、财务结构等方面进行研判。

2)科技研发能力:本基金将选择那些产品具有较高科技含量或公司具有较强技术开发能力的上市公司,考虑的因素包括:产品技术含量、技术发展前景、技术成熟程度、研究经费投入规模、配套政策支持、研究成果转化的经济效果等。

3)公司治理结构:公司治理结构的评估是指对上市公司经营管理层面的组织和制度上的灵活性、完整性和规范性的全面考察,包括对所有权和经营权的分离、对股东利益的保护、经营管理的自主性、政府及母公司对公司内部的干预程度,管理决策的执行和传达的有效性、股东会、董事会和监事会的实际执行情况,企业改制彻底性、企业内部控制的制订和执行情况等。因此,公司治理结构是决定公司评估价值的重要因素,也是决定上市公司盈利能力能否持续的重要因素。

4)估值水平分析

基金管理人将对科技主题的上市公司给予估值分析,并结合行业地位分析,优选出具有盈利持续稳定增长、价值低估且在各自行业中具有领先地位的优质上市公司股票进行投资。本基金采用的估值方法包括市盈率法(P/E)、市净率法(P/B)等。

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。本基金通过分析未来市场利率趋势及市场信用环境变化方向,综合考虑不同券种收益率水平、信用风险、流动性等因素,构造债券投资组合。在实际的投资运作中,本基金将运用久期控制策略、收益率曲线策略、类别选择策略、个券选择策略等多种策略,获取债券市场的长期稳定收益。

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。因为在基金实际操作上,当量化模型出现买卖讯号时,基金经理在进行一篮子股票的买卖可能会发生时效性的情况,此时可利用股指期货灵活快速进出的优势,除了达到量化模型的有效性,并可降低交易成本,为实际的投资操作提供多一项选择。

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。

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。

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。

(二)投资决策依据和投资流程

1、投资决策依据

(1)国家有关法律法规和基金合同的有关规定;

(2)公司投资及风险控制政策;

(3)宏观经济发展态势、证券市场运行环境和走势,以及上市公司的基本面;

(4)投资对象的预期收益和预期风险的匹配关系,本基金将在承担适度风险的范围内,选择收益风险配比最佳的品种进行投资。

2、投资决策机制

本基金投资决策基本原则是根据基金的投资目标、投资理念以及范围等要素,制定基金投资策略。本基金采用投资团队分级负责制的投资决策方式。本基金经理是本基金投资团队的重要成员,一方面积极参与投资团队的投资研究工作,另一方面在公司授权下主动行使投资决策和本基金的投资组合管理职责。

本基金力求通过包括本基金经理在内的整个投资团队全体人员的共同努力来争取良好的投资业绩,在投资过程中采取分级授权的投资决策机制,对于不同的投资规模的决策程序有所不同,力争实现基金资产在合理控制投资风险的前提下的稳定增值。

公司设立投资决策委员会,作为公司投资管理的最高决策和监督机构。为提高投资决策效率和专业性水平,公司授权投资管理部总经理带领投资研究团队负责公司日常投资决策和投资管理。投资决策委员会定期或在认为必要时评估基金投资业绩、监控基金