# 华润元大信息传媒科技混合型证券投资基金

## 2015 第三季度 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 | 1.大类资产配置策略<br>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。<br>2.股票投资策略<br>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。<br>3.债券投资策略<br>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。<br>4.股指期货投资策略<br>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。<br>5.权证投资策略<br>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。<br>6.资产支持证券投资策略<br>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。<br>7.现金管理<br>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。 |
| 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。

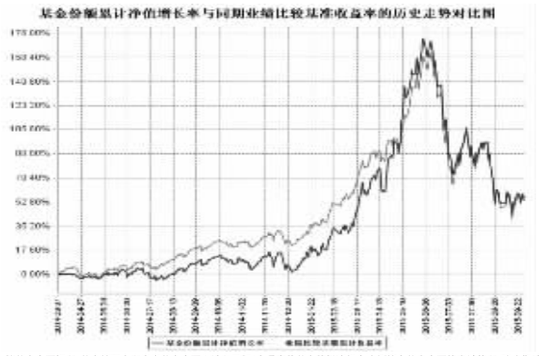
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的申购赎回费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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




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交易型开放式指数证券投资基金基金经理 | 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《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。

本基金作为被动指数型基金,报告期内,本基金采用完全复制法紧密跟踪富时中国A50指数,取得与业绩比较基准基本一致的业绩表现。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.195元,本报告期份额净值增长率为-25.17%,同期业绩比较基准收益率为-25.46%;报告期内,本基金的日均跟踪偏离度为0.183%,在合同规定的目标控制范围之内。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在全球经济复苏乏力,国内去产能、去杠杆和金融风险凸现等多因素叠加的情况下,中国经济在2015年第三季度仍面临较大的下行压力。但从2015年前三季度来看,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"规划产业推度的三大主线。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

本基金本报告期未持仓国债期货。

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持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期未持仓国债期货。

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

# 华润元大现金收益货币市场基金

## 2015 第三季度 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:中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商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 | 华润元大现金收益货币 |
| 交易代码 | 000324 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2013年10月29日 |
| 报告期末基金份额总额 | 2,194,708,380.63份 |
| 投资目标 | 在保持较低风险性和高流动性的前提下,力争获得较高于业绩比较基准的投资收益。 |
| 投资策略 | 1.整体资产配置策略<br>整体资产配置策略主要包括两个方面:一是根据宏观经济形势、央行货币政策、货币市场的资金供求状况等因素,对短期利率走势进行综合判断;二是根据前述判断形成的利率预期动态调整基金投资组合的平均剩余期限。<br>①利率分析策略<br>对利率走势的科学预期是进行久期管理的基本前提,也是正确进行债券投资的首要条件。通过对通货膨胀率、经济增长率、货币供应量、国际利率水平、汇率、政策取向等跟踪分析,形成对基本面的宏观研判。同时,结合对市场环境的研究,主要考察指标包括:央行公开市场操作、主流机构投资者的短期投资倾向、债券供给、货币市场与资本市场资金互动等,合理预期货币市场利率水平的变化。<br>②久期管理策略<br>久期是衡量债券利率风险的主要指标,反映了债券价格对于收益率变动的敏感程度。当预期市场利率上升时,基金管理人将通过增加持有剩余期限较短债券并减持剩余期限较长债券等方式降低组合久期,以降低组合价格风险;在预期市场收益率下降时,通过增持剩余期限较长债券等方式提高组合久期,以分享债券价格上升的收益。<br>2.类别资产配置策略<br>根据整体策略要求,决定组合中类别资产的配置内容和各类别投资的比例。<br>根据不同类别资产的流动性指标,决定类别资产的当期配置比率。<br>根据不同类别资产的收益率水平、市场偏好、法律法规对基金投资的规定、基金合同、基金收益目标、业绩比较基准等决定不同类别资产的目标配置比率。<br>3.个券选择策略<br>在个券选择层面,首先将考虑安全性,优先选择高信用等级的债券品种以规避违约风险。除考虑安全性因素外,在具体的券种选择上,基金管理人将在正确拟合收益率曲线的基础上,找出收益率明显偏高的券种,并客观分析收益率出现偏高的原因。若出现因市场原因所导致的收益率高于公允水平,则该券种价格出现低估,本基金将对此类低估品种进行重点关注。此外,鉴于收益率曲线可以判断出定价偏高或偏低的期限段,从而指导相对价值投资,这也可以帮助基金管理人选择投资于定价低估的短期债券品种。<br>4.流动性管理策略<br>本基金作为现金管理工具,必须具备较高的流动性。基金管理人将在流动性优先的前提下,综合平衡基金资产在流动性资产和收益性资产之间的配置比例,通过现金留存、持有高流动性债券种、正回购、降低组合久期等方式提高基金资产整体的流动性。同时,基金管理人将密切关注投资者大额申购和赎回的需求变化规律,提前做好资金准备。 |
| 业绩比较基准 | 七天通知存款利率(税后) |
| 风险收益特征 | 本基金为货币市场基金,是证券投资基金中的低风险品种。本基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。 |
| 基金管理人 | 华润元大基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 下属分级基金的基金简称 | 华润元大现金收益货币A / 华润元大现金收益货币B |
| 下属分级基金的交易代码 | 000324 / 000325 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 132,113,823.98份 / 2,062,594,556.65份 |

§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) | |
|---|---|---|
| | 华润元大现金收益货币A | 华润元大现金收益货币B |
| 1. 本期已实现收益 | 1,128,736.21 | 12,163,234.32 |
| 2.本期利润 | 1,128,736.21 | 12,163,234.32 |
| 3.期末基金资产净值 | 132,113,823.98 | 2,062,594,556.65 |

注: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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华润元大现金收益货币A

| 阶段 | 净值收益率① | 净值收益率标准差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 | 0.8079% | 0.0052% | 0.3403% | 0.0000% | 0.4676% | 0.0052% |

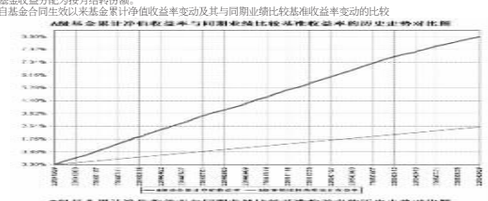
注:本基金收益分配为按月结转份额。

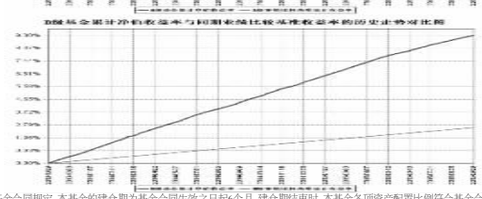
华润元大现金收益货币B

| 阶段 | 净值收益率① | 净值收益率标准差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 | 0.8689% | 0.0052% | 0.3403% | 0.0000% | 0.5286% | 0.0052% |

注:本基金收益分配为按月结转份额。

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




注:按基金合同规定,本基金的建仓期为基金合同生效之日起6个月,建仓期结束时,本基金各项资产配置比例符合基金合同的约定。

§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 | | |
| 杨凯玮 | 华润元大现金收益货币市场基金基金经理、华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理。固定收益部总经理。 | 2013年10月29日 | 2015年8月11日 | 10年 | 历任台湾国泰人寿保险股份有限公司研究员,台湾新光人寿保险股份有限公司投资组合高级专员,台湾中华开发工业银行股份有限公司自营交易员,台湾元大宝来证券投资信托股份有限公司基金经理,台湾宏泰人寿保险股份有限公司科长、最后职务为华润元大基金管理有限公司固定收益部总经理。2013年10月29日起至2015年8月11日担任华润元大现金收益货币市场基金基金经理,2014年9月18日起至2015年9月24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,国立台湾大学土木工程学,国立交通大学管理学双硕士,具有基金从业资格。 |
| 杨荣智 | 华润元大现金收益货币市场基金基金经理 | 2014年11月28日 | - | 7年 | 历任中国农业银行广东分行国际部外汇交易员,永罗银行 中国 有限公司高级交易员,中集集团财务有限公司交易室主管。2014年11月28日起担任华润元大现金收益货币市场基金基金经理。中国,中南财经政法大学经济学硕士,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,宏观经济增长持续疲弱,投资和工业增速均处于下降通道之中。社会整体投资增速继续出现回落,房地产和制造业投资增速维持2季度连续下滑的态势,相比去年同期出现了较明显的增速放缓,仅有基建增速维持在18%以上的较高水平;而工业增加值的增速继续徘徊在6%附近的近年来低位,社会的整体需求仍然疲软。而从制造业的铁气程度来看,三季度的PMI数据表现仍然低迷,财新PMI维持在50以下,而官方的PMI数据也在3季度落入50荣枯线下,整体基本面复苏仍未有起色。货币政策方面,央行在三季度继续下调了基准利率和存款准备金率,持续以宽松的货币政策风格刺激实体经济的融资需求,并同步防范权益市场震荡带来的金融风险。而在公开市场操作方面,央行保持着短期限逆回购的灵活操作,并小幅下调了操作利率,引导市场的回购利率保持在较低水平,配合着降准,银行间市场的流动性继续保持宽松的格局。从资金利率期限结构来看,短期的7天回购利率保持在2%-2.5%的价格区间内进行波动,而长期的3个月SHIBOR利率也保持在3%-3.2%的区间内,显示出市场流动性总体依旧平稳。总体而言,三季度的资金面较为宽松,有利于短期债券的收益兑现,而回购及存款等资产配置则相对配置价值仍然较低。

在2015年三季度中,本基金继续紧跟资金面和市场供给变化,较为主动地调整自身的仓位,并保持充分的流动性应对赎回。同时本基金本着稳健配置的操作思路,合理地控制着报告期内的债券、存款和回购等资产的平衡配比,在保证投资人的收益和流动性的同时,继续选择收益较可观的优质债券进行配置,并以积极主动的思路进行交易操作,依旧为投资者提供了显著超出比较基准的回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内,A级基金的净值收益率为0.8079%,同期业绩比较基准收益率为0.3403%,超过同期业绩比较基准0.4676%;B级基金的净值收益率为0.8689%,同期业绩比较基准收益率为0.3403%,超过同期业绩比较基准0.5286%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2015年四季度,由于三季度经济基本面仍然未能有明显改善,尽管央行已连续加码宽松政策,但政策对实体经济的传导效果仍然有限。展望四季度,货币政策宽松的趋势仍然不会有转向,加上央行仍有意愿通过各种流动性支持工具来维持市场宽松的局面,因此四季度内货币市场仍然将呈现宽松状况,回购利率难以大幅反弹。债券市场方面,由于资金面的整体偏松以及基本面疲弱带来的利多支撑,四季度的债券市场大概率难以明细回调,仍有利于货币基金逐步兑现累计的债券收益;但随着地方政府发债的逐步推进,债券供给压力仍然不可小视,债券收益率可能一定波动冲击。投资策略上,我们将在四季度主要积极参与债券买卖和交易,在货币市场利率仍然较低的背景下,努力兑现债券收益以支持组合整体收益;同时也继续择机在利率阶段性的高点做存款和逆回购的配置,保持好流动性和收益性的兼顾。

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 | 固定收益投资 | 820,285,327.35 | 37.34 |
| | 其中:债券 | 820,285,327.35 | 37.34 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 2 | 买入返售金融资产 | 110,000,805.00 | 5.01 |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 3 | 银行存款和结算备付金合计 | 1,257,071,610.31 | 57.22 |
| 4 | 其他资产 | 9,712,942.31 | 0.44 |
| 5 | 合计 | 2,197,070,684.97 | 100.00 |

5.2 报告期债券回购融资情况

| 序号 | 项目 | 占基金资产净值的比例(%) | |
|---|---|---|---|
| 1 | 报告期内债券回购融资余额 | 2.15 | |
| | 其中:买断式回购融资 | 0.00 | |
| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金资产净值的比例(%) |
| 2 | 报告期末债券回购融资余额 | - | - |
| | 其中:买断式回购融资 | - | - |

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

注:在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

| 项目 | 天数 |
|---|---|
| 报告期末投资组合平均剩余期限 | 114 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 124 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 70 |

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

| 序号 | 发生日期 | 平均剩余期限 | 原因 | 调整期 |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 2015年7月1日 | 124 | 赎回 | 发生后10个工作日内 |
| 2 | 2015年7月2日 | 123 | 赎回 | 发生后10个工作日内 |

注:根据本基金合同规定,本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天。本报告期内本基金发生投资组合平均剩余期限超过120天的情况见上表。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

| 序号 | 平均剩余期限 | 各期限资产占基金资产净值的比例(%) | 各期限负债占基金资产净值的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 30天以内 | 32.95 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | 0.45 | - |
| 2 | 30天(含)-60天 | 16.68 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | 1.36 | - |
| 3 | 60天(含)-90天 | 9.02 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 4 | 90天(含)-180天 | 17.33 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 5 | 180天(含)-397天(含) | 23.69 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| | 合计 | 99.67 | - |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 摊余成本(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 280,178,101.16 | 12.77 |
| | 其中:政策性金融债 | 280,178,101.16 | 12.77 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | 540,107,226.19 | 24.61 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 同业存单 | - | - |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 820,285,327.35 | 37.38 |
| 10 | 剩余存续期超过397天的浮动利率债券 | 39,881,100.63 | 1.82 |

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 债券数量(张) | 摊余成本(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 150411 | 15农发11 | 500,000 | 50,145,991.36 | 2.28 |
| 2 | 110221 | 11国开21 | 500,000 | 50,081,595.01 | 2.28 |
| 3 | 041562033 | 15协鑫发电CP001 | 400,000 | 39,984,737.95 | 1.82 |
| 4 | 041561041 | 15金元CP001 | 400,000 | 39,980,310.25 | 1.82 |
| 5 | 011534004 | 15东制联SCP004 | 400,000 | 39,971,184.99 | 1.82 |
| 6 | 110212 | 11国开12 | 300,000 | 30,058,001.33 | 1.37 |
| 7 | 130215 | 13国开15 | 300,000 | 30,031,049.35 | 1.37 |
| 8 | 011599407 | 15豫能源SCP002 | 300,000 | 29,992,892.53 | 1.37 |
| 9 | 041562026 | 15东方CP001 | 300,000 | 29,985,290.17 | 1.37 |
| 10 | 150311 | 15进出11 | 300,000 | 29,974,187.26 | 1.37 |

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

| 项目 | 偏离情况 |
|---|---|
| 报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数 | - |
| 报告期内偏离度的最高值 | 0.1936% |
| 报告期内偏离度的最低值 | 0.0701% |
| 报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.1541% |

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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 本基金所持有的债券采用摊余成本法进行估值,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价或折价,在其剩余期限内按实际利率法进行摊销,每日计提收益。本基金通过每日分红使基金份额净值维持在1.00元。

5.8.2 本报告期内本基金持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本不存在超过当日基金资产净值的20%的情况。

5.8.3 本报告期内本基金投资的前十名证券中没有出现发行主体被监管部门立案调查,