

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招 募说明书（更新）摘要

基金管理人：华润元大基金管理有限公司

基金托管人：招商证券股份有限公司

二〇一七年二月

【重要提示】

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（以下简称“本基金”）经 2015 年 7 月 7 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可第【2015】1579 号文准予募集注册。本基金基金合同于 2015 年 12 月 23 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、市场前景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。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

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等信息披露文件，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，自主判断基金的投资价值，谨慎、自主做出投资决策，并自行承担投资风险。本基金面临的主要风险是市场风险、信用风险、流动性风险、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。本基金属于 ETF 联接基金，通过投资于目标 ETF 跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的证券市场相似的风险收益特征。同时，本基金为被动式投资的股票型指数基金，跟踪中创 100 指数，其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，其风险收益特征与标的指数所表现的市场组合的风险收益特征相似。基金所投资的中小企业私募债券之债务人出现违约，或在交易过程中发生交收违约，或由于中小企业私募债券信用质量降低导致价格下降，可能造成基金财产损失。此外，受市场规模及交易活跃程度的影响，中小企业私募债券可能无法在同一价格水平上进行较大数量的买入或卖出，存在一定的流动性风险，从而对基金收益造成影响。

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，本基金管理人不能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，由投资者自行承担。

除特别说明外，本招募说明书所载内容截止日为 2016 年 12 月 23 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2016 年 9 月 30 日（财务数据未经审计）

。

一、基金合同生效日期

2015 年 12 月 23 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 1 号 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：刘小腊

成立时间：2013 年 1 月 17 日

注册资本：3 亿元人民币

存续期限：永续经营

联系人：林婷婷

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%

元大证券投资信托股份有限公司 49%

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 2016 年 12 月 23 日，公司有员工 65 人，其中 57%的员工具有硕士及以上学历， 94%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

刘小腊先生，董事长，博士学历。历任招商银行股份有限公司计划资金部经理、资金交易部总经理助理、资金交易部副总经理、金融市场部总经理、资产管理部总经理、同业金融总部常务副总经理、佛山分行党委书记；珠海华润银行股份有限公司常务副行长。现任华润深国投信托有限公司党委副书记、董事、总经理，深圳红树林创业投资有限公司董事，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。

张天鹄先生，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，蓝筹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，瀚宇彩晶股份有限公司独立董事，微端科技股份有限公司监察人法人代表。现任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。

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总监。

黄古彬先生，监事，硕士学历。历任日盛证券股份有限公司总经理执董，日盛期货股份有限公司总经理，宝来证券股份有限公司副总经理，宝来证券股份有限公司副总裁，宝来证券股份有限公司副董事长，宝来证券股份有限公司总经理，宝来证券股份有限公司董事长，元大证券股份有限公司副董事长。现任元大证券投资信托股份有限公司董事长。

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。

李孟霞女士，监事，硕士学历。历任台湾经济研究院研究助理、台湾中日证券衍生性金融商品部研究员、台湾宝来期货交易部交易员、台湾宝来证券新金融商品部副经理、台湾中华开发工业银行金融交易部经理、台湾富邦投信 ETF 基金管理部基金经理、台湾元大投信指数暨量化投资事业群资深基金经理。现任华润元大基金管理有限公司投资管理部投资总监。

3、基金管理人高级管理人员

刘小腊先生，董事长。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

李武群先生，中国科学院研究生院工学博士，7 年金融行业从业经验。历任中信银行福州分行计划财务部统计岗，华西证券研究所量化组高级研究员、股票投资部投资经理助理。2015 年加入华润元大基金管理有限公司，现任华润元大中创 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。

李孟霞女士，台湾成功大学法学硕士，19 年金融行业从业经验。历任台湾经济研究院研究助理、台湾中日证券衍生性金融商品部研究员、台湾宝来期货交易部交易员、台湾宝来证券新金融商品部副经理、台湾中华开发工业银行金融交易部经理、台湾富邦投信 ETF 基金管理部基金经理、台湾元大投信指数暨量化投资事业群资深基金经理。2015 年 7 月正式加

入华润元大基金管理有限公司，现任华润元大中创 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。

5、投资决策委员会成员

林瑞源（总经理）

李孟霞（投资管理部投资总监）

张俊杰（固定收益部负责人）

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

1、基本情况

名称：招商证券股份有限公司

住所：广东省深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

办公地址：广东省深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

法定代表人：宫少林

成立时间：1993 年 8 月

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 58.08 亿元

存续期间：持续经营

基金托管业务批准文号：证监许可[2014]78 号

联系人：秦湘

联系电话：0755-26951111

招商证券是百年招商局旗下金融企业，经过二十多年创业发展，已成为拥有证券市场业务全牌照的一流券商，并经中国证券监督管理委员会评定为 A 类 AA 级券商。招商证券具有稳定的持续盈利能力、科学合理的风险管理架构、专业的服务能力。公司拥有多层次客户服务渠道，在北京、上海、广州、深圳等城市拥有 200 家批准设立的证券营业部和 11 家证券经纪业务管理分公司，同时在香港设有分支机构，全资拥有招商证券国际有限公司、招商期货有限公司、招商致远资本投资有限公司、招商证

券投资有限公司、招商证券资产管理有限公司，参股博时基金管理公司、招商基金管理公司，构建起国内国际业务一体化的综合证券服务平台。招商证券致力于“全面提升核心竞争力，打造中国最佳投资银行”。公司将以卓越的金融服务实现客户价值增长，推动证券行业进步，立志打造产品丰富、服务一流、能力突出、品牌卓越的国际化金融机构，成为客户信赖、社会尊重、股东满意、员工自豪的优秀金融企业。

2、主要人员情况

招商证券托管部员工多人具备丰富的证券投资基金业务运作经验、会计师事务所审计经验，以及大型 IT 公司的软件设计与开发经验，人员专业背景覆盖了金融、会计、经济、计算机等各领域，其中本科以上人员占比 100%，高级管理人员均拥有硕士研究生或以上学历。

3、基金托管业务经营情况

招商证券托管部是国内首批获得证券投资基金托管业务的证券公司，可为各类公开募集资金设立的证券投资基金提供托管服务。托管部拥有独立的安全监控设施，稳定、高效的托管业务系统，完善的业务管理制度。招商证券托管部本着“诚实信用、谨慎勤勉”的原则，为基金份额持有人利益履行基金托管职责。除此之外，招商证券于 2012 年 10 月获得了证监会准许开展私募基金综合托管服务试点的正式批复，成为业内首家可从事私募托管业务的券商，经验丰富，服务优质，业绩突出。截至 2016 年三季度，招商证券共托管 18 只公募基金。

招商证券托管部于 2015 年 4 月通过了普华永道会计师事务所提供的 ISAE3402 鉴证服务，成为业内第一家通过 ISAE3402 认证的券商托管人和基金外包服务机构。

（二）基金托管人的内部控制制度

1、内部控制目标

招商证券作为基金托管人：

（1）托管业务的经营运作遵守国家有关法律法规和行业监管规则，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念。

（2）建立科学合理、控制严密、运行高效的内部控制体系，保持托管业

务内部控制制度健全、执行有效。

（3）防范和化解经营风险，提高经营管理效益，使托管业务稳健运行和受托资产安全完整，实现托管业务的持续、稳定、健康发展。

（4）不断改进和完善内控机制、体制和各项业务制度、流程，提高业务运作效率和效果。

2、内部控制组织结构

招商证券股份有限公司经营管理层面设立了风险管理委员会。作为公司内部最高风险决策机构，风险管理委员会负责审议公司风险管理政策、风险偏好、容忍度和经济资本等风险限额配置方案，拥有公司重大风险业务和创新业务项目的最终裁量权。风险管理部、法律合规部及稽核监察部为公司的风险管理职能部门。

资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内控稽核岗，配备专职监察稽核人员，在托管部总经理的直接领导下，依照有关法律规章，对业务的运行独立行使监督稽核职权。

3、内部控制制度及措施

招商证券托管部制定了各项管理制度和操作规程，建立了科学合理、控制严密、运行高效的内部控制体系，保持托管业务健全、有效执行；安全保管基金财产，保持基金财产的独立性；实行经营场所封闭式管理，并配备录音和录像监控系统；有独立的综合托管服务系统；业务管理实行复核和检查机制，建立了严格有效的操作制约体系；托管部树立内控优先和风险管理的理念，培养部门全体员工的风险防范和保密意识。

（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

1、监督方法

基金托管人根据《基金法》、《运作办法》等法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定，对基金合同生效之后所托管基金的投资范围、投资比例、投资限制等进行监督，并及时提示基金管理人违规风险。

2、监督程序

基金托管人发现基金管理人投资指令或实际投资运作违反法律法规、基金合同和托管协议的规定，应及时以电话提醒或书面提示等方式通知基

金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到书面通知后应在限期内及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

四、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

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。

1、直销机构

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1号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：刘小腊

成立时间：2013年1月17日

电话：（0755）88399008

传真：（0755）88399045

联系人：杜敏琳

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。

2、其他销售机构

（1）中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街69号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座

法定代表人：周慕冰

客户服务电话：95599

传真：010-68121816

网址：www.95599.cn

（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：刘晓勇

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：中国（上海）自由贸易试验区商城路 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：杨德红

电话：021-38676666

传真：021-38670666

客服电话：400-8888-666/95521

网址：www.gtja.com

（4）招商证券股份有限公司

办公地址：广东省深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

法定代表人：宫少林

电话：0755-82943666

传真：0755-83734343

客服电话：95565、4008888111

网址：www.newone.com.cn

（5）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：010-60836029

客服电话：95548

网址：www.cs.ecitic.com

(6) 上海华信证券有限责任公司

住所：上海浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 9 楼

办公地址：上海浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 9 楼

法定代表人：郭林

电话：021-38784818

传真：021-68774818

客服电话：4008205999

网址：www.shhxzq.com

(7) 民生证券股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-20 层

办公地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-20 层

法定代表人：余政

电话：010-85127629

传真：010-85127641

客服电话：4006198888

网址：www.msyzq.com

(8) 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.citicssd.com

（9）兴业证券股份有限公司

住所：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

电话：0591-38162212

传真：0591-38507538

客服电话：95562

网址：www.xyzq.com.cn

（10）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：400-860-1555

网址：www.dwzq.com.cn

（11）光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：薛峰

电话：021-22169999

传真：021-22169134

网址：www.ebscn.com

（12）中泰证券股份有限公司

注册地址：山东济南市中区经七路 86 号

办公地址：山东济南市中区经七路 86 号证券大厦 2001 室

法定代表人：李玮

联系人：马晓男

客户服务电话：95538

电话：021-20315255

传真：02120315137

网址：www.zts.com.cn

（13）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

（14）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：010-85156398

传真：010-65182261

客服电话：400-888-8108

网址：www.csc108.com

（15）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

传真：010-66568990

客服电话：4008-888-888

网址：www.chinastock.com.cn

(16) 和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号 1002 室

办公地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人：王莉

联系人：刘洋

电话：010-85650628

传真：010-65884788

客服电话：010-85650688

网址：www.hexun.com

(17) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

住所：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#

办公地址：北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 A 座 7 层

法定代表人：张彦

电话：010-83363101

传真：010-83363072

客服电话：400-116-1188

网址：8.jrj.com.cn

(18) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

住所：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

办公地址：上海市杨浦区昆明路 508 号北美广场 B 座 12 楼

法定代表人：汪静波

电话：021-38509735

传真：021-38509777

网址：www.noah-fund.com

(19) 深圳众禄金融控股股份有限公司

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

(20) 上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

办公地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 9 楼

法定代表人：其实

联系人：潘世友

电话：021-54509998

传真：021-64385308

客户服务电话：400-1818-188

网址：www.1234567.com.cn

(21) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦
903~906 室

法定代表人：杨文斌

电话：021-20613999

传真：021-68596916

客服电话：400-700-9665

网址：www.ehowbuy.com

(22) 蚂蚁（杭州）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：400-076-6123

网址: www.fund123.cn

(23) 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

(24) 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: www.5ifund.com 及同花顺金融服务网 www.10jqka.com.cn

(25) 上海利得基金销售有限公司

住所: 上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

办公地址: 上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼

法定代表人: 沈继伟

电话: 86-021-50583533

传真: 86-021-50583633

客服电话: 400-033-7933

网址: www.leadbank.com.cn

(26) 北京增财基金销售有限公司

住所: 北京市西城区南礼士路 66 号 1 号楼 12 层 1208 号

办公地址: 北京市西城区南礼士路 66 号 1 号楼 12 层 1208 号

法定代表人: 罗细安

电话：010-67000988、010-68086927

传真：010-67000988-6000

网址：www.zcvc.com.cn

（27）北京钱景财富投资管理有限公司

住所：北京市海淀区丹棱街丹棱 SOHO 1008-1012

办公地址：北京市海淀区丹棱街丹棱 SOHO 1008-1012

法定代表人：赵荣春

电话：010-59158281

传真：010-57569671

网址：www.niuji.net

（28）上海汇付金融服务有限公司

住所：上海市中山南路 100 号 19 楼

办公地址：上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

法定代表人：冯修敏

电话：021-33323999

传真：021-33323830

网址：www.chinapnr.com

（29）北京微动利投资管理有限公司

住所：北京市石景山区古城西路 113 号景山财富中心 341

办公地址：北京市石景山区古城西路 113 号景山财富中心 341

法定代表人：梁洪军

电话：010-68854005

传真：010-68854009

客服电话：4008-196-665

网址：www.buyforyou.com.cn

（30）上海陆金所资产管理有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 15 楼

法定代表人：鲍东华

电话：021-20665952

传真：021-22066653

客服电话：4008219031

网址：www.lufunds.com

(31) 深圳富济财富管理有限公司

住所：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）

办公地址：深圳市南山区科苑南路高新南七道惠恒集团二期418室

法定代表人：齐小贺

电话：0755-83999907

传真：0755-83999926

网址：www.jinqianwo.cn

(32) 北京肯特瑞财富投资管理有限公司

注册地址：北京市海淀区海淀东三街2号4层401-15

法定代表人：陈超

电话：4000988511/4000888816

传真：010-89188000

客服电话：95118

网址：fund.jd.com

(33) 深圳市金斧子投资咨询有限公司

住所：深圳市南山区粤海街道科苑路16号东方科技大厦18楼

办公地址：深圳市南山区科苑路科兴科学园B3单元7楼

法定代表人：赖任军

电话：0755-66892301

传真：0755-84034477

客服电话：400-9500-888

网址：www.jfzinv.com

(34) 北京汇成基金销售有限公司

住所：北京市海淀区中关村大街11号11层1108

办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108

法定代表人：王伟刚

电话：010-56282140

传真：010-62680827

客服电话：400-619-9059

网址：www.fundzone.cn

（35）奕丰金融服务（深圳）有限公司

住所：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入住深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市南山区海德三路海岸大厦东座 1115-1116 室及 1307 室

法定代表人：TAN YIK KUAN

电话：0755-89460500

传真：0755-21674453

客服电话：400-684-0500

网址：www.ifastps.com.cn

（36）珠海盈米财富管理有限公司

住所：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼

法定代表人：肖雯

电话：020-89629099

传真：020-89629011

客服电话：020-89629066

网址：www.yingmi.cn

（37）北京恒天明泽基金销售有限公司

住所：北京市经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室

办公地址：北京市朝阳区东三环北路甲 19 号 SOHO 嘉盛中心 30 层 3001 室

法定代表人：李悦

电话：010-59313555

传真：010-57756199

客服电话：4008980618

网址：www.chtfund.com

各销售机构的具体名单见基金份额发售公告以及基金管理人届时发布的调整销售机构的相关公告。

（二）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1号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：刘小腊

电话：（0755）88399008

传真：（0755）88399045

联系人：崔佩伦

（三）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：安冬、陆奇

（四）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：吴翠蓉、高鹤

五、基金名称和基金类型

（一）本基金名称：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

（二）本基金类型：ETF 联接基金

（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

通过投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

（二）投资范围

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，以目标 ETF、标的指数的成份股和备选成份股票、国内依法发行上市的非成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（含中小企业私募债）、货币市场工具、权证、股指期货、国债期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会批准的允许基金投资的其它金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人可在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金投资于目标 ETF 的比例不少于基金资产净值的 90%，每个交易日日终在扣除股指期货和国债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比例合计不低于基金资产净值的 5%。

七、基金的投资策略

（一）投资策略

本基金以华润元大中创 100 交易型开放式指数证券投资基金作为其主要投资标的，方便特定的客户群通过本基金投资目标 ETF。本基金并不参与目标 ETF 的管理，主要以一级市场申购的方式投资于目标 ETF，获取

基金份额净值上涨带来的收益；在目标 ETF 基金份额二级市场交易流动性较好的情况下，也可以通过二级市场买卖目标 ETF 的基金份额。

1、资产配置策略

本基金主要通过投资于目标 ETF 以实现对业绩比较基准的良好跟踪。本基金投资于目标 ETF 的资产比例将不低于基金资产净值的 90%，其余资产可投资于标的指数的成份股和备选成份股票、国内依法发行上市的非成份股（包括中小板、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、国债期货、资产支持证券或中国证监会批准的允许基金投资的其它金融工具（但须符合中国证监会相关规定），其目的是为了使本基金在保障日常申购赎回的前提下，更好的跟踪标的指数。在巨额申购赎回发生、成份股大比例分红等情况下，基金管理人将在综合考虑冲击成本因素和跟踪效果后，及时将股票配置比例调整至合理水平。

在正常市场情况下，本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.3%，年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

2、目标 ETF 的投资策略

本基金投资目标 ETF 有如下两种方式：

- 1) 申购和赎回：目标 ETF 开放申购赎回后，以股票组合进行申购赎回。
- 2) 二级市场方式：目标 ETF 上市交易后，在二级市场进行目标 ETF 基金份额的交易。

当目标 ETF 申购、赎回或二级市场交易模式进行了变更或调整，本基金也将作相应的变更或调整，无须召开基金份额持有人大会。

在投资运作过程中，本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用一级市场申赎的方式或二级市场交易的方式进行目标 ETF 的买卖。

3、本基金可通过买入标的指数成分股来跟踪标的指数。为了更好地实现投资目标，基金还将投资于股指期货和其他经中国证监会允许的衍生工

具，如权证以及其他与标的指数或标的指数成份股相关的衍生工具。基金投资股指期货将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数，实现投资目标。

本基金将采用货币市场工具对基金资产进行流动性管理。在满足安全性和保证流动性的基础上，本基金将结合宏观分析和微观分析制定投资策略，有效利用基金资产，更好地实现跟踪标的指数的投资目标。此外，本基金还将积极参与风险低且可控的债券回购等投资，以及国债期货投资。基金投资国债期货将本着谨慎的原则，充分考虑其流动性和风险收益特征，适度参与国债期货投资。

未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，本基金可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新中公告。

4、投资组合的调整

本基金将根据每个交易日申购赎回情况及本基金实际权益类资产仓位情况，来决定对目标 ETF 的操作方式和数量。

- 1) 当收到净申购时，本基金将根据净申购规模及实际权益类资产仓位情况，确定是否需要买入成份股，并申购目标 ETF 的操作；
- 2) 当收到净赎回时，本基金将根据净赎回规模及实际权益类资产仓位情况，确定是否需要目标 ETF 进行赎回，并卖出赎回所得成份股；
- 3) 在部分情况下，本基金将会根据目标 ETF 二级市场交易情况，适时选择对目标 ETF 进行二级市场交易操作。

（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）本基金采用被动式指数化投资，在追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化的前提下，根据标的指数成份股的构成及其权重，形成基金投资建议；
- （4）以维护基金份额持有人利益为基金投资决策的准则。

2、投资决策机制

本基金实行投资决策委员会下的基金经理负责制。基金经理负责基金的日常投资运作，基金投资的重大事项需向投资决策委员会报告。

3、投资决策流程

研究、决策、组合构建、交易、评估、组合维护的有机配合共同构成了本基金的投资管理程序。严格的投资管理程序可以保证投资理念的正确执行，避免重大风险的发生。

（1）研究：指数投资研究人员依托公司整体研究平台，整合外部信息以及券商等外部研究力量的研究成果开展指数跟踪、成份股等相关信息的搜集与分析、流动性分析等工作，作为基金投资决策的重要依据。

（2）投资决策：投资决策委员会依据指数投资研究小组提供的研究报告，定期召开或遇重大事项时召开投资决策会议，决策相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议，每日进行基金投资管理的日常决策。

（3）组合构建：基金经理根据标的指数相关信息，结合内部指数投资研究，以指数复制法构建组合。在追求跟踪误差最小化的前提下，基金经理将采取适当的投资方法，以降低投资成本、控制投资风险。

（4）交易执行：运营管理部交易组负责具体的交易执行，同时履行一线监控的职责。

（5）投资绩效评估：投资管理部定期和不定期对基金进行投资绩效评估，并提供相关报告。绩效评估能够确认组合是否实现了投资预期、组合误差的来源及投资策略成功与否，基金经理可以据此检讨投资策略，进而调整投资组合。

（6）组合监控与调整：基金经理将跟踪标的指数变动，结合成份股基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果，对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数。

基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据环境变化和实际需要对上述投资程序做出调整，并在基金招募说明书及其更新中公告。

（三）投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

- （1）本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%；
- （2）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；
- （3）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；
- （4）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；
- （5）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；
- （6）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；
- （7）本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；
- （8）本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；
- （9）本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；
- （10）基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；
- （11）本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；
- （12）本基金若投资股指期货、国债期货的，则应当遵守下列限制：
 - 1) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%，在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；

本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

2) 基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的 15%；基金在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%；基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 30%；本基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定；

3) 在任何交易日日终，持有的买入股指期货和国债期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券等；

（13）本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过基金资产净值的 10%；

（14）基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

（15）每个交易日日终在扣除股指期货和国债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比例合计不低于基金资产净值的 5%；

（16）法律法规及中国证监会规定的其他投资限制。

因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制、目标 ETF 申购、赎回、交易被暂停或交收延迟、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规另有规定时，从其规定。

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。期间，基金的投资范围、投资策略应符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或调整上述限制，如适用于本基金，基金管理

人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按照调整后的规定执行。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- （1）承销证券；
- （2）违反规定向他人贷款或者提供担保；
- （3）从事承担无限责任的投资；
- （4）向基金管理人、基金托管人出资；
- （5）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- （6）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。

基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

若将来法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更，致使本款前述约定的投资禁止行为和投资组合比例限制被修改或取消，基金管理人在依法履行相应程序后，本基金可相应调整禁止行为和投资限制规定。

八、基金的业绩比较基准

中创 100 指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款收益率（税后） $\times$ 5%

若本基金标的指数发生变更，基金业绩比较基准随之变更。如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出时，本基金管理人可以在与基金托管人协商同意后变更业绩比较基准的组成和权重。若变更业绩比较基准涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更，则基金管理人应就变更业绩比较基准召开基金份额持

有人大会，报中国证监会备案并在指定媒介公告。若变更业绩比较基准对基金投资范围和投资策略无实质性影响（包括但不限于指数编制单位变更、指数更名等），则无需召开基金份额持有人大会。基金管理人应于变更前在指定媒介上公告。

九、基金的风险收益特征

本基金属于 ETF 联接基金，通过投资于目标 ETF 跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的证券市场相似的风险收益特征。同时，本基金为被动式投资的股票型指数基金，跟踪中创 100 指数，其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，其风险收益特征与标的指数所表现的市场组合的风险收益特征相似。

十、目标 ETF 发生相关变更情形的处理方式

目标 ETF 出现下述情形之一的，本基金可在履行适当程序后由投资于目标 ETF 的联接基金变更为直接投资该标的指数的指数基金，不需召开持有人大会；若届时本基金管理人已有以该指数作为标的指数的指数基金，则本基金将本着维护投资者合法权益的原则，履行适当的程序后可选取其他合适的指数作为标的指数。相应地，基金合同中将删除关于目标 ETF 的表述部分，或将变更标的指数，届时将由基金管理人另行公告。

- 1、目标 ETF 交易方式发生重大变更致使本基金的投资策略难以实现；
- 2、目标 ETF 终止上市；
- 3、目标 ETF 基金合同终止；
- 4、目标 ETF 与其他基金进行合并；
- 5、目标 ETF 的基金管理人发生变更；
- 6、中国证监会规定的其他情形。

十一、基金的投资组合报告

本投资组合报告所载数据截至 2016 年 9 月 30 日（财务数据未经审计）。

1.1 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	248,694.00	0.43
---	------	------------	------

其中：股票 248,694.00 0.43

2 基金投资 54,463,248.42 93.33

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 3,562,135.29 6.10

8 其他资产 80,663.80 0.14

9 合计 58,354,741.51 100.00

1.2 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 150,922.00 0.26

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 --

E 建筑业 6,736.00 0.01

F 批发和零售业 9,756.00 0.02

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 33,334.00 0.06

J 金融业 17,345.00 0.03

K 房地产业 782.00 0.00

L 租赁和商务服务业 7,252.00 0.01

M 科学研究和技术服务业 --

N 水利、环境和公共设施管理业	9,255.00	0.02
O 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	13,312.00	0.02
S 综合	-	-
合计	248,694.00	0.43

1.3 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	002129	中环股份	6,300	52,101.00	0.09
2	002266	浙富控股	3,200	18,784.00	0.03
3	300027	华谊兄弟	900	11,142.00	0.02
4	002450	康得新	600	10,848.00	0.02
5	002415	海康威视	400	9,788.00	0.02
6	002024	苏宁云商	900	9,756.00	0.02
7	300059	东方财富	500	9,575.00	0.02
8	300070	碧水源	500	9,255.00	0.02
9	300104	乐视网	200	8,850.00	0.02
10	002142	宁波银行	400	6,260.00	0.01

1.4 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。

1.5 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。

1.6 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。

1.7 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。

1.8 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。

1.9 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基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	------	-----	------------	--------------

1	中创 100 指数基金	指数基金	交易型开放式	华润元大基金管理有限公司	54,463,248.42	94.04
---	-------------	------	--------	--------------	---------------	-------

注：上述基金明细为本基金本报告期末持有的全部基金。

1.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

1.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末持仓股指期货。

1.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

1.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末持仓国债期货。

1.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

1.11.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末持仓国债期货。

1.12 投资组合报告附注

1.12.1 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，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

1.12.2 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。

1.12.3 其他资产构成

序号 名称 金额（元）

1 存出保证金 43,417.98

2 应收证券清算款 -

3 应收股利 -

4 应收利息 3,180.33

5 应收申购款 34,065.49

6 其他应收款 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 80,663.80

1.12.4 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。

1.12.5 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 002129 中环股份 52,101.00 0.09 重大事项停牌

2 300027 华谊兄弟 11,142.00 0.02 重大事项停牌

3 300070 碧水源 9,255.00 0.02 重大事项停牌

1.12.6 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。

十二、基金的业绩

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，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

（一）基金净值表现

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

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

2015.12.23-2015.12.31 0.10% 0.04% -3.44% 1.15% -3.54% -1.11%

2016.1.1-2016.9.30 1.40% 1.71% -18.35% 1.98% 19.75% -0.27%

2015.12.23-2016.9.30 1.50% 1.68% -21.15% 1.96% 22.65% -0.28%

（二）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（2015年12月23日至2016年9月30日）

十三、基金的费用与税收

（一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、账户开户费用、账户维护费用；
- 9、基金收益分配中发生的费用；

10、按照国家有关规定和基金合同约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除基金资产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分的 0.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.50\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值扣除基金资产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分，若为负数，则 E 取 0。

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除基金资产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.10\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值扣除基金资产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分，若为负数，则 E 取 0。

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行支取，基金管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

3、上述“一、基金费用的种类”中除管理费、托管费之外的其他费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入或摊入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、基金合同生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（四）基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情降低基金管理费和基金托管费，此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 日前在指定媒介上刊登公告。

（五）基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十四、对招募说明书更新部分的说明

《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招募说明书（更新）》（2016 年第 2 号）依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动进行了更新，主要内容如下：

（一）在“重要提示”中，更新了“招募说明书所载内容截止日”和“有关财务数据和净值表现截止日”。

（二）在“三、基金管理人”部分，对基金管理人的相关内容进行了更

新。

（三）在“四、基金托管人”部分，对基金托管人的相关内容进行了更新。

（四）在“五、相关服务机构”部分，对代销机构的相关内容进行了更新。

（五）在“九、基金的投资”部分，更新了“基金的投资组合报告”的内容，截止日期更新为 2016 年 9 月 30 日，该部分内容均按有关规定编制，并经本基金托管人复核。

（六）在“十、基金的业绩”部分，更新了“基金净值表现”和“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”，该部分内容均按照有关规定编制，并经本基金托管人复核。

（七）在“二十二、其他应披露事项”部分，更新了自上一次《招募说明书（更新）》截止日 2016 年 6 月 23 日至本次《招募说明书（更新）》截止日 2016 年 12 月 23 日之间的信息披露事项。

上述内容仅为本基金更新招募说明书的摘要，详细资料须以本更新招募说明书正文所载的内容为准。欲查询本更新招募说明书详细内容，可登录华润元大基金管理有限公司网站 www.cryuantafund.com。

华润元大基金管理有限公司

二〇一七年二月六日