

华润元大中创 100 指数型证券投资基金清算报告

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

清算报告出具日：二〇一九年七月十七日

清算报告公告日：二〇一九年八月十九日

目录

重要提示 3

一、基金概况 4

二、基金运作情况 5

三、财务会计报告 6

四、清算情况 7

五、备查文件 9

重要提示

华润元大中创 100 指数型证券投资基金(以下简称"本基金")由华润元大中创 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金于 2019 年 1 月 3 日转型而来, 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系经中国证券监督管理委员会证监许可[2015]1579 号文《关于准予华润元大中创 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金注册的批复》的注册, 由华润元大基金管理有限公司(以下简称"本公司"或"基金管理人")作为基金管理人向社会公开发行人募集, 基金合同于 2015 年 12 月 23 日正式生效。本基金基金管理人为华润元大基金管理有限公司, 基金托管人为招商证券股份有限公司。

2019 年 3 月 14 日, 本基金基金资产净值已连续 36 个工作日低于五千万人民币, 本公司经与基金托管人招商证券股份有限公司协商一致, 向中国证监会申请召开基金份额持有人大会提议终止基金合同并获得了中国证监会同意。根据《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》、《华润元大中创 100 指数型证券投资基金基金合同》(以下简称"《基金合同》")的有关规定, 《基金合同》生效后, 连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的, 基金管理人应当在定期报告中予以披露; 连续 60 个工作日出现前述情形的, 基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案, 如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等, 并召开基金份额持有人大会进行表决。本基金基金份额持有人大会已于 2019 年 5 月 31 日至 2019 年 6 月 28 日以通讯方式召开, 审议了《关于终止华润元大中创 100 指数型证券投资基金基金合同有关事项的议案》, 并于 2019 年 7 月 1 日表决通过该议案。根据本基金基金份额持有人大会通过的议案及议案说明, 本基金最后运作日为 2019 年 7 月 2 日, 于 2019 年 7 月 3 日起进入清算期。

本基金清算期自 2019 年 7 月 3 日至 2019 年 7 月 17 日止。本基金的基金管理人、基金托管人、安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)和上海市通力律师事务所成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序, 并由安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)对本基金进行清算审计, 上海市通力律师事务所对清算事宜出具法律意见。

一、基金概况

基金名称 华润元大中创 100 指数型证券投资基金

基金简称 华润元大中创 100 指数

基金主代码 001713

基金运作方式 契约型开放式

基金合同生效日 2019 年 1 月 3 日

基金管理人名称 华润元大基金管理有限公司

基金托管人名称 招商证券股份有限公司

公告依据 《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》等相关法律法规以及《华润元大中创 100 指数型证券投资基金基金合同》、《华润元大中创 100 指数型证券投资基金招募说明书》

注册登记机构 华润元大基金管理有限公司

基金合同存续期 不定期

投资目标 通过指数化投资策略, 紧密跟踪标的指数, 追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

投资策略 本基金主要采取完全复制法, 即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建投资组合, 并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期指数成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时, 或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时, 或因某些特殊情况导致流动性不足时, 或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时, 基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整, 从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。

当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时, 以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪

标的指数的效果可能带来影响时，基金管理人会对投资组合进行适当调整，降低跟踪误差。

如有因受股票停牌、股票流动性或其他一些影响指数复制的市场因素的限制，使基金管理人无法依指数权重购买成份股，基金管理人可以根据市场情况，结合经验判断，对投资组合进行适当调整，以获得更接近标的指数的收益率。

定期调整：本基金股票组合根据所跟踪的中创 100 指数对其成份股的调整而进行相应的定期跟踪调整。

不定期调整：根据指数编制规则，中创 100 指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重新调整时，本基金将根据中创 100 指数在股权变动公告日次日发布的临时调整决定及其需调整的权重比例，进行相应调整。

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。同时，根据本基金的申购和赎回情况，对股票投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数。

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分股相关的衍生工具。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。

本基金还将基金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。

基金投资于各种衍生工具的比例合计不超过基金资产总值的 5%。基金拟投资于新推出的金融衍生产品的，需将有关投资方案通知基金托管人，并报告中国证监会备案后公告。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 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。

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%

风险收益特征 本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，为证券投资基金中中等预期风险、中等预期收益的品种。同时本基金为指数基金，采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。

二、基金运作情况

华润元大中创 100 指数型证券投资基金由华润元大中创 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型而来。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经 2015 年 7 月 7 日中国证券监督管理委员会证监许可第【2015】1579 号文准予募集注册，自 2015 年 11 月 9 日至 2015 年 12 月 18 日期间向全社会公开募集。募集有效认购总户数为 1441 户，募集资金及其产生的利息共计 332,856,785.18 元，折合基金份额 332,856,785.18 份。华润元大基金管理有限公司向中国证监会办理完毕基金备案手续后，于 2015 年 12 月 23 日获书面确认，《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合同》自该日起正式生效。

2019 年 3 月 14 日，本基金基金资产净值已连续 36 个工作日低于五千万人民币，本公司经与基金托管人招商证券股份有限公司协商一致，向中国证监会申请召开基金份额持有人大会提议终止基金合同并获得了中国证监会同意。根据《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》、《华润元大中创 100 指数型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，《基金合同》生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。本基金基金份额持有人大会已于 2019 年 5 月 31 日至 2019 年 6 月 28 日以通讯方式召开，审议了《关于终止华润元大中创 100 指数型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，并于 2019 年 7 月 1 日表决通过该议案。根据本基金基金份额持有人大会通过的议案及议案说明，本基金最后

运作日为 2019 年 7 月 2 日，于 2019 年 7 月 3 日起进入清算期。
自本基金基金合同生效日至最后运作日期间，本基金正常运作。

三、财务会计报告

基金最后运作日资产负债表（经审计）

会计主体：华润元大中创 100 指数型证券投资基金

报告截止日：2019 年 7 月 2 日

单位：人民币元

最后运作日

2019 年 7 月 2 日

资产：

银行存款 1,824,794.48

结算备付金 4,210.53

应收证券清算款 800,421.15

应收利息 1,163.34

应收申购款 30,316.44

资产总计 2,660,905.94

负债：

应付赎回款 2,112.28

应付管理人报酬 68.78

应付托管费 13.75

其他负债 113,323.77

负债合计 115,518.58

所有者权益：

实收基金 3,617,942.92

未分配利润 -1,072,555.56

所有者权益合计 2,545,387.36

负债和所有者权益总计 2,660,905.94

四、清算情况

自 2019 年 7 月 3 日至 2019 年 7 月 17 日止的清算期间，本基金基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行清算，全部清算工作按清算原则和清算手续进行。基金资产处置、负债清偿及基金净资产分配情况如下：

1、资产处置情况

(1)本基金最后运作日结算备付金为人民币 4,210.53 元，截至 2019 年 7 月 17 日结算备付金余额为人民币 4,210.53 元。

(2)本基金最后运作日应收证券清算款为人民币 800,421.15 元，已于 2019 年 7 月 3 日划入本基金托管账户。

(3)本基金最后运作日应收利息为人民币 1,163.34 元，包括应收银行存款利息人民币 1,155.67 元和应收结算备付金利息人民币 7.67 元。

截至 2019 年 7 月 17 日应收利息余额为人民币 2,878.67 元，包括应收银行存款利息人民币 2,868.15 元和应收结算备付金利息人民币 10.52 元。

(4)本基金最后运作日应收申购款为人民币 30,316.44 元，已于 2019 年 7 月 3 日划入本基金托管账户。

2、负债清偿情况

(1)本基金最后运作日应付赎回款为人民币 2,112.28 元，该款项已分别于 2019 年 7 月 3 日和 2019 年 7 月 4 日支付。

(2)本基金最后运作日应付基金管理人报酬为人民币 68.78 元，该款项已于 2019 年 7 月 10 日支付。

(3)本基金最后运作日应付基金托管费为人民币 13.75 元，该款项已于 2019 年 7 月 10 日支付。

(4)本基金最后运作日其他负债为人民币 113,323.77 元，其中应付指数使用费人民币 315.81 元已于 2019 年 7 月 11 日支付，应付律师费人民币 30,000.00 元及应付公证费人民币 10,000.00 元已于 2019 年 7 月 9 日支付，应付审计费人民币 73,000.00 元（其中 2018 年度审计费人民币 50,000.00 元，清算审计费人民币 23,000.00 元）已分别于 2019 年 7 月 5 日和 2019 年 7 月 9 日支付，应付赎回费人民币 7.96 元已分别于 2019 年 7 月 3 日和 2019 年 7 月 4 日支付。

3、清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目 自 2019 年 7 月 3 日至
2019 年 7 月 17 日止清算期间

一、清算收益

1、利息收入（注 1） 1,715.33

2、其他收入 5.37

清算收入小计 1,720.70

二、清算费用

清算费用小计（注 2） -

三、清算净收益 1,720.70

注 1：利息收入系计提的清算期间的银行存款利息及结算备付金利息，其中银行存款利息收入为人民币 1,712.48 元，结算备付金利息为人民币 2.85 元。

注 2：根据本基金的基金合同约定，清算费用优先从基金财产中支付。

4、资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

单位：人民币元

项目 金额

一、最后运作日 2019 年 7 月 2 日基金净资产 2,545,387.36

加：清算期间净收益 1,720.70

基金赎回款（注 1） -40,598.73

二、2019 年 7 月 17 日基金净资产 2,506,509.33

注 1：系本基金持有人于最后运作日（2019 年 7 月 2 日）提交的赎回申请，已于 2019 年 7 月 5 日支付。

根据本基金的基金合同约定，依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

2019 年 7 月 17 日本基金剩余财产为人民币 2,506,509.33 元，其中包括未变现资产：结算备付金人民币 4,210.53 元，应收银行存款利息及结算备付金利息人民币 2,878.67 元。上述未变现资产人民币 7,089.20 元，将由基金管理人以自有资金垫付，待销户结息后再一并垫付的资金划至基金管理人账户。

因清算款划出日不能确定，暂不能准确预估清算结束日至清算款划出日前一日银行存款产生的利息，该期间利息亦属全体基金份额持有人所有，将于划出清算款时一并向基金份额持有人分配。

5、基金财产清算报告的告知安排

本清算报告已经基金托管人复核，在经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并向基金份额持有人公告。

五、备查文件

（一）备查文件目录

- 1、《华润元大中创 100 指数型证券投资基金清算审计报告》
- 2、《华润元大中创 100 指数型证券投资基金清算报告的法律意见》

（二）存放地点

备查文件存放于基金管理人、基金托管人处。

（三）查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅备查文件。

华润元大中创 100 指数型证券投资基金

基金财产清算小组

二〇一九年八月十九日