

## 关于华润元大中创 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型为华润元大中创 100 指数型证券投资基金并修改基金合同部分条款的公告

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证监许可[2015]1579 号文准予募集注册,基金成立于 2015 年 12 月 23 日,基金代码为 001713,目标基金为华润元大中创 100 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“中创 100ETF 基金”）。

中创 100ETF 基金于 2018 年 9 月 6 日触发基金合同终止条款,根据本基金基金合同约定,在中创 100ETF 基金终止上市或基金合同终止后,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。

华润元大基金管理有限公司（以下简称“本公司”）根据本基金合同约定修改基金合同,经与基金托管人招商证券股份有限公司协商一致,并报中国证券监督管理委员会备案,将本基金变更为华润元大中创 100 指数型证券投资基金。转型后的“华润元大中创 100 指数型证券投资基金”基金托管人及基金登记机构不变,基金代码亦保持不变,为“001713”,对于基金的投资目标、投资范围、投资策略以及基金费率等相关内容做出了相应修改。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的基金份额结转华润元大中创 100 指数型证券投资基金的基金份额。基金合同具体修改内容请见附件。

此外,本公司根据上述修订及实际情况对本基金《托管协议》、《招募说明书》涉及前述内容的章节也将同时修改。

为方便投资者,本公司将修订后的《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托管协议》、《华润元大中创 100 指数型证券投资基金招募说明书》在官网上披露,修订后的基金合同自 2019 年 1 月 3 日起生效。投资者欲了解详情,请登录本公司网站

（[www.cryuantafund.com](http://www.cryuantafund.com)）查阅相关公告或拨打本公司客户服务电话（4000-1000-89）咨询相关事宜。

### 风险提示:

本公司承诺以诚实信用、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,也不保证最低收益。投资者投资于基金前应认真阅读基金的基金合同、招募说明书等法律文件。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

附件:《华润元大中创 100 指数型证券投资基金基金合同》修改对照表

华润元大基金管理有限公司

二〇一九年一月三日

### 《华润元大中创 100 指数型证券投资基金基金合同》修改对照表

页码 章节 旧版条款 新版条款 修改理由

全文 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 华润元大中创 100 指数型证券投资基金  
修改基金名称

3-4 第一部分前言 三、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由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定募集,并经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)注册。

中国证监会对本基金募集的注册,并不表明其对本基金的投资价值、市场前景和收益做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。 三、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由基金管理人依照《基金

法》、基金合同及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)注册。中国证监会对华润元大中创 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值、市场前景和收益做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。表明本基金由原基金转型而来

第二部分释义 7、基金份额发售公告：指《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份额发售公告》 删除 根据实际情况删除

第二部分释义 20、ETF 联接基金：指将其绝大部分基金财产投资于跟踪同一标的指数的 ETF，紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，采用开放式运作方式的基金，简称“联接基金”

21、目标 ETF：指由华润元大基金管理有限公司管理的华润元大中创 100 交易型开放式指数证券投资基金 删除 根据实际情况删除

6 第二部分释义 24、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回等业务 21、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，销售基金份额，办理基金份额的申购、赎回等业务 不再进行基金发售

7 第二部分释义 33、基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期 30、基金合同生效日：指《华润元大中创 100 指数型证券投资基金基金合同》生效日 根据实际情况调整基金合同生效日

第二部分释义 35、基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过 3 个月 删除 根据实际情况删除

第二部分释义 43、认购：指在基金募集期内，投资者根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为 删除 根据实际情况删除

9 第三部分基金的基本情况 二、基金的类别

ETF 联接基金 二、基金的类别

股票型证券投资基金 调整转型后基金类别

9 第三部分基金的基本情况 四、基金的投资目标

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 四、基金的投资目标

本基金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。 调整转型后的投资目标

第三部分基金的基本情况 五、基金的最低募集份额总额

本基金的最低募集份额总额为 2 亿份

六、基金份额发售面值和认购费用

本基金基金份额发售面值为人民币 1.00 元

本基金的认购费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示 删除 根据实际情况删除

第三部分基金的基本情况 九、本基金与目标 ETF 的差异

本基金的目标 ETF 为中创 100 交易型开放式指数证券投资基金，本基金为目标 ETF 的联接基金。本基金与目标 ETF 均采用指数化投资方式，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，力争实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。

本基金与目标 ETF 的差异主要在于：

(1) 投资方法不同。目标 ETF 属交易型开放式指数证券投资基金，以股票为主要投资标的，通过投资标的指数成份股及其备选成份股达成投资目标；本金属契约型开放式指数证券投资基金，以目标 ETF 为主要投资标的，通过投资目标 ETF 达成投资目标；

(2) 交易方式不同。目标 ETF 的投资人可通过申购赎回代理券商申购赎回基金份额，在基金符合上市条件申请上市成功后，投资人也可在二级市场买卖目标 ETF 的基金份额；本基金的投资人只能通过本基金的销售机构申购赎回本基金的基金份额；

(3) 申购赎回方式不同。目标 ETF 的投资人依据申购赎回清单，按以组合证券为主的申购对价、赎回对

价进行申购赎回，申购赎回均以份额申报；本基金的投资者依据基金份额净值，以现金方式进行申购赎回，金额申购、份额赎回；

(4) 价格揭示机制不同。目标 ETF 有实时市场交易价格和每日净值；本基金只揭示每日基金净值。

此外，尽管均采用指数化投资方式，且投资目标相同，但投资对象和投资范围的不同，可能会导致本基金与目标 ETF 的业绩表现出现差异。引致差异的因素主要包括：

(1) 目标 ETF 对现金或者到期日在一年以内的政府债券的最低比例没有要求；本基金对现金或者到期日在一年以内的政府债券的最低比例要求为 5%；

(2) 目标 ETF 申购赎回采用组合证券方式，交易成本和冲击成本较小；本基金申购赎回采用现金方式，交易成本和冲击成本较大；

(3) 投资管理方式的不同，如在指数化投资过程中，不同的管理方式会导致跟踪指数的水平、技术手段、买入卖出的时机选择等的不同。删除 根据实际情况删除

#### 第四部分基金份额的发售 一、基金份额的发售时间、发售方式、发售对象

##### 1、发售时间

自基金份额发售之日起最长不得超过 3 个月，具体发售时间见基金份额发售公告。

##### 2、发售方式

通过各销售机构的基金销售网点公开发售，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。

##### 3、发售对象

符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者。

#### 二、基金份额的认购

##### 1、认购费用

本基金的认购费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。基金认购费用不列入基金财产，认购费主要用于基金的市场推广、销售、登记等基金募集期间发生的各项费用。

##### 2、募集期资金与利息的处理方式

基金募集期间募集的资金应当存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。有效认购款项在基金募集期间形成的利息折算成基金份额计入基金投资者的账户，具体份额以登记机构的记录为准。

##### 3、基金认购份额的计算

基金认购份额具体的计算方法在招募说明书中列示。

##### 4、认购申请的确认

销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以登记机构的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利，否则，由此产生的投资者任何损失由投资者自行承担。

##### 5、认购份额余额的确认

认购份额的计算保留到小数点后 2 位，小数点 2 位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

#### 三、基金份额认购金额的限制

1、投资人认购时，需按销售机构规定的方式全额缴款。投资人在募集期内可多次认购，认购一经受理不得撤销。

2、基金管理人可以对每个基金交易账户的单笔最低认购金额进行限制，具体限制请参看招募说明书。

3、基金管理人可以对募集期间的单个投资人的累计认购金额进行限制，具体限制和处理方法请参看招募说明书。删除 转型后基金不再进行基金份额的发售

#### 10 第四部分基金的历史沿革 新增内容:

根据《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》，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 332,800,388.73 元，折合基金份额 332,800,388.73 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。

2018 年 9 月 7 日，华润元大中创 100 交易型开放式指数证券投资基金触发合同终止条款，根据《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》的约定，如目标 ETF 终止上市或目标 ETF 基金合同终止，则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。基金的投资目标、投资范围、投资策略以及基金费率等相关内容也将作相应修改。

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华润元大中创 100 交易型开放式指数证券投资基金终止上市后，变更为华润元大中创 100 指数型证券投资基金。自 2018 年 X 月 X 日，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变更为华润元大中创 100 指数型证券投资基金，《华润元大中创 100 指数型证券投资基金基金合同》自该日起生效。 新增本基金的历史沿革

#### 11 第五部分基金的存续 一、基金备案的条件

本基金自基金份额发售之日起 3 个月内，在基金募集份额总额不少于 2 亿份，基金募集金额不少于 2 亿元人民币且基金认购人数不少于 200 人的条件下，基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售，并在 10 日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起 10 日内，向中国证监会办理基金备案手续。

基金募集达到基金备案条件的，自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起，基金合同生效；否则基金合同不生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对基金合同生效事宜予以公告。基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

#### 二、基金合同不能生效时募集资金的处理方式

如果募集期限届满，未满足基金备案条件，基金管理人应当承担下列责任：

- 1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；
- 2、在基金募集期限届满后 30 日内退还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息；
- 3、如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

#### 三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

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。

法律法规另有规定时，从其规定。 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。

法律法规另有规定时，从其规定。删除不适用的内容

#### 14 第六部分基金份额的申购与赎回 六、申购和赎回的价格、费用及其用途

1、本基金份额净值的计算，保留到小数点后3位，小数点后第4位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。六、申购和赎回的价格、费用及其用途

1、本基金份额净值的计算，保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。根据实际运作需求调整小数点位数

#### 16 第六部分基金份额的申购与赎回 七、拒绝或暂停申购的情形

6、目标ETF暂停基金资产估值；

7、目标ETF暂停申购、暂停赎回、暂停上市或二级市场交易停牌；七、拒绝或暂停申购的情形

6、接受某一投资者申购申请后导致其份额超过基金总份额50%以上的。调整拒绝或暂停申购的情形

16 第六部分基金份额的申购与赎回 发生上述第1、2、3、5、6、7、9、10项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。发生上述第1、2、3、5、8、9项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。相应调整序号

#### 第六部分基金份额的申购与赎回 八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

5、目标ETF暂停基金资产估值；

6、目标ETF暂停申购、暂停赎回、暂停上市或二级市场交易停牌；八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

删除 根据实际情况删除

#### 22 第七部分基金合同当事人及权利义务 一、基金管理人

(二) 基金管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

(15) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换和非交易过户等业务规则；一、基金管理人

(二) 基金管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

(15) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金申购、赎回、转换和非交易过户等业务规则；不再进行认购

#### 22 第七部分基金合同当事人及权利义务 一、基金管理人

(二) 基金管理人的权利与义务

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

(1) 依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；一、基金管理人

(二) 基金管理人的权利与义务

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

(1) 依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的销售、申购、赎回和登记事宜；转型后基金不再进行发售

23 第七部分基金合同当事人及权利义务 (8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，确定基金份额申

购、赎回的价格； (8) 采取适当合理的措施使计算基金份额申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回的价格； 不再进行认购

第七部分基金合同当事人及权利义务 (24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，基金合同不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人； 删除 根据实际情况删除

27 第七部分基金合同当事人及权利义务 三、基金份额持有人

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

(4) 缴纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用； 三、基金份额持有人

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

(4) 缴纳基金申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用； 不再进行基金认购

第八部分基金份额持有人大会 目标 ETF 召开基金份额持有人大会的，本基金应当提前召开本基金的基金份额持有人大会基金份额持有人大会的表决意见征求本基金基金份额持有人的意见。本基金的基金管理人应当分别按照权益登记日本基金基金份额持有人大会各类表决意见的具体比例参加目标 ETF 基金份额持有人大会投票表决。

本基金的基金管理人不应以本基金的名义代表本基金的全体基金份额持有人以目标 ETF 的基金份额持有人的身份行使目标 ETF 的基金份额持有人大会的表决权，但可接受本基金的特定基金份额持有人的委托以本基金的基金份额持有人代理人的身份出席目标 ETF 的基金份额持有人大会并参与表决。 删除 根据实际情况删除

28 第八部分基金份额持有人大会 一、召开事由

(5) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外； 一、召开事由

(5) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求调整该等报酬标准的除外； 根据现行制度修改

28 第八部分基金份额持有人大会 (6) 变更基金类别，但根据基金合同约定变更为跟踪同一标的的指数的指数基金的除外；

(7) 本基金与其他基金的合并；

(8) 变更基金投资目标、范围或策略，但根据基金合同约定变更为跟踪同一标的的指数的指数基金的除外；

(6) 变更基金类别；

(7) 本基金与其他基金的合并；

(8) 变更基金投资目标、范围或策略； 根据实际情况调整

28 第八部分基金份额持有人大会 (12) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项； (12) 对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项； 更精确的表述

28 第八部分基金份额持有人大会 2、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

(1) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由本基金或基金份额持有人承担的费用； 2、在法律法规和基金合同规定的范围内，并对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

(1) 调低除基金管理费、基金托管费外其他应由本基金或基金份额持有人承担的费用； 根据实际情况调整

42 第十二部分基金的投资 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。 一、投资目标

本基金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。 调整投资目标

42 第十二部分基金的投资 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%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，以中创 100 指数的成份股和备选成份股票为主要投资对象。为更好的实现投资目标，本基金也可投资于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：本基金投资于标的指数成份股及备选成分股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%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

#### 调整投资范围

#### 42 第十二部分基金的投资 三、标的指数

##### 中创 100 指数。

如果华润元大中创 100 交易型开放式指数证券投资基金变更其标的指数，或者深圳证券交易所变更或停止中创指数的编制及发布，或者中创 100 指数被其他指数所替代，或者由于指数编制方法等重大变更导致中创 100 指数不宜继续作为目标基金的标的指数，或者证券市场有其他代表性更强、更适合于本基金投资的指数推出，本基金管理人可以依据审慎性原则和维护基金份额持有人合法权益的原则，在取得基金托管人的同意并履行适当程序后，更换本基金的标的指数和投资对象，并依据目标 ETF 的标的指数、市场代表性、流动性、与原指数的相关性等诸多因素选择确定新的标的指数。

##### 中创 100 指数。

如果深圳证券交易所变更或停止中创指数的编制及发布，或者中创 100 指数被其他指数所替代，或者由于指数编制方法等重大变更导致中创 100 指数不宜继续作为标的指数，或者证券市场有其他代表性更强、更适合于本基金投资的指数推出，本基金管理人可以依据审慎性原则和维护基金份额持有人合法权益的原则，在取得基金托管人的同意并履行适当程序后，更换本基金的标的指数和投资对象，并依据市场代表性、流动性、与原指数的相关性等诸多因素选择确定新的标的指数。

#### 43-44 第十二部分基金的投资 四、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)，其目的是为了使得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，确定是否需要为目标 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。

四、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%。 修改投资策略

#### 44 第十二部分基金的投资 五、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%； 五、投资限制

##### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

(1) 本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%； 调整投资比例

#### 44 第十二部分基金的投资 (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： (12)

本基金参与股指期货、国债期货交易，应当遵守下列要求： 修改表述

46 第十二部分基金的投资 除上述第(9)、(15)、(17)、(18)项外，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。 除上述第(9)、(15)、(17)、(18)项外，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。 根据实际情况调整

#### 47 第十二部分基金的投资 六、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。 六、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%

中创 100 指数选取中小板和创业板中代表性较强、流动性较好的 100 家公司组成样本股。中创 100 指数反映中小企业板和创业板重点企业的运行状况，进一步凸显深交所多层次资本市场的特色，满足投资者对中小创业型企业进行指数化投资的需要。若本基金标的指数发生变更，基金业绩比较基准随之变更。 补充对于中创 100 指数的介绍

#### 47 第十二部分基金的投资 七、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。 七、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。根据实际情况调整风险收益特征

#### 第十二部分基金的投资 八、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。删除

#### 第十四部分基金资产估值 二、估值对象

基金所拥有的目标 ETF 份额、股票、权证、股指期货合约、国债期货合约、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。二、估值对象

基金所拥有的股票、权证、股指期货合约、国债期货合约、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。删除目标 ETF 份额

#### 第十四部分基金资产估值 1、目标 ETF 估值方法

本基金投资的目标 ETF 份额按照估值日目标 ETF 的基金份额净值估值。删除 转型后基金不再对目标 ETF 估值

#### 49-50 第十四部分基金资产估值 2、证券交易所上市的有价证券的估值

(1) 交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大的事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大的事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

(2) 交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价或第三方估值机构提供的价格估值，估值日没有交易且本基金采用的是按收盘价或第三方估值机构提供的价格估值的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价或第三方估值机构提供的价格估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值；

(3) 交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价减去债券收盘价或估值全价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价减去债券收盘价或估值全价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整并确定公允价值。1、证券交易所上市的有价证券的估值

(1) 交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后发生了影响公允价值计量的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

(2) 交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价或第三方估值机构提供的价格估值，估值日没有交易且本基金采用的是按收盘价或第三方估值机构提供的价格估值的，且最近交易日后未发生影响公允价值

计量的重大事件，按最近交易日的收盘价或第三方估值机构提供的价格估值。如最近交易日后发生了影响公允价值计量的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

(3) 交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价减去债券收盘价或估值全价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件，按最近交易日债券收盘价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价减去债券收盘价或估值全价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后发生了影响公允价值计量的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整并确定公允价格。根据实际估值情况调整

50 第十四部分基金资产估值 8、本基金投资股指期货、国债期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。 7、本基金投资股指期货、国债期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件，采用最近交易日结算价估值。根据实际估值情况调整

51 第十四部分基金资产估值 四、估值程序

1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到0.001元，小数点后第4位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。 四、估值程序

1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到0.0001元，小数点后第5位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。根据实际情况调整小数点位数

51 第十四部分基金资产估值 五、估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后3位以内(含第3位)发生估值错误时，视为基金份额净值错误。 五、估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后4位以内(含第4位)发生估值错误时，视为基金份额净值错误。根据实际情况调整小数点位数

第十四部分基金资产估值 六、暂停估值的情形

3、基金所投资的目标ETF暂停估值或暂停公告基金份额净值时； 六、暂停估值的情形  
删除 根据实际情况删除

54 第十四部分基金资产估值 八、特殊情况的处理

1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第10项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。 八、特殊情况的处理

1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第8项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。相应调整序号

55 第十五部分基金费用与税收 一、基金费用的种类

一、基金费用的种类

新增：

8、标的指数许可使用费； 转型后的基金新增标的指数许可使用费

55 第十五部分基金费用与税收 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。 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 根据实际情况调整管理费的计提方法

### 55-56 第十五部分基金费用与税收 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。 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 根据实际情况调整托管费的计提方法

### 56 第十五部分基金费用与税收 新增内容：

### 3、标的指数许可使用费

本基金按照基金管理人与标的指数许可方所签订标的指数使用协议的约定计提标的指数使用费。基金合同生效后的标的指数使用费从基金财产中列支。标的指数许可使用费的费率、具体计算方法和支付方式请参见招募说明书。

如果标的指数使用协议约定的标的指数使用相关费用的计算方法、费率和支付方式等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算标的指数使用相关费用。此项调整无需召开基金份额持有人大会审议，基金管理人将在招募说明书更新或其他公告中披露本基金最新适用的方法。 新增标的指数许可使用费

56 第十五部分基金费用与税收 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。 4、上述“一、基金费用的种类”中除管理费、托管费和标的指数许可使用费之外的其他费用，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。 新增标的指数许可使用费

### 第十五部分基金费用与税收 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。 删除 该调整需召开基金份额持有人大会

### 60 第十七部分基金的会计与审计 一、基金会计政策

2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果基金合同生效少于2个月，可以并入下一个会计年度披露； 一、基金会计政策

2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日； 不再进行基金募集，相应调整

### 62 第十八部分基金的信息披露 五、公开披露的基金信息

#### (一) 基金招募说明书、基金合同、基金托管协议

2、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。 五、公开披露的基金信息

#### (一) 基金招募说明书、基金合同、基金托管协议

2、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金申购和赎回安排、基

金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。 不再进行认购，相应删除  
62 第十八部分基金的信息披露 3、基金托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金  
运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。

基金募集申请经中国证监会注册后，基金管理人在基金份额发售的 3 日前，将基金招募说明书、基金合同  
摘要登载在指定媒介上；基金管理人、基金托管人应当将基金合同、基金托管协议登载在网站上。 3、基  
金托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的  
法律文件。 根据实际情况删除

#### 第十八部分基金的信息披露 （二）基金份额发售公告

基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指  
定媒介上。

##### （三）基金合同生效公告

基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日在指定媒介上登载基金合同生效公告。 删除 根据实际  
情况删除

#### 62 第十八部分基金的信息披露 （四）基金资产净值、基金份额净值

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网  
点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

##### （五）基金份额申购、赎回价格

基金管理人应当在基金合同、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有  
关申购、赎回费率，并保证投资者能够在基金份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。 （二）基金资  
产净值、基金份额净值

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额销售网  
点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

##### （三）基金份额申购、赎回价格

基金管理人应当在基金合同、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有  
关申购、赎回费率，并保证投资者能够在基金份额销售网点查阅或者复制前述信息资料。 不再进行发售，  
改为“销售”

#### 第十八部分基金的信息披露 （七）临时报告

7、基金募集期延长； 删除 根据实际情况删除

#### 64 第十八部分基金的信息披露 （七）临时报告

26、变更目标 ETF 或标的指数； （五）临时报告

25、变更标的指数； 根据实际情况调整

71 第二十二部分基金合同的效力 1、基金合同经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人  
或授权代表签字并在募集结束后经基金管理人向中国证监会办理基金备案手续，并经中国证监会书面确认  
后生效。 1、本基金合同由《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基金合同》修订  
而成。基金合同经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字后报中国证监  
会备案。 补充本基金合同的历史沿革