

华润元大中创 100 指数型证券投资基金 2019 年第 1 季度报告

2019 年 3 月 31 日

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

报告送出日期：2019 年 4 月 20 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。

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 4 月 19 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 2019 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

转型后：

基金简称	中创 100
交易代码	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
报告期末基金份额总额	4,685,422.21 份
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	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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</p>

	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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%。</p>
业绩比较基准	<p>中创 100 指数收益率×95%+银行活期存款收益率（税后）×5%</p>
风险收益特征	<p>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。</p>
基金管理人	<p>华润元大基金管理有限公司</p>
基金托管人	<p>招商证券股份有限公司</p>

转型前：

基金简称	中创 100 联接
交易代码	001713
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 12 月 23 日
报告期末基金份额总额	5,336,141.85 份
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。
投资策略	<p>本基金以华润元大中创 100ETF 基金（目标 ETF）作为其主要投资标的。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进行投资，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。</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>为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，将严格遵照投资范围的约定进行投资。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%。</p> <p>2、目标 ETF 的投资策略</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。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购的方式或二级市场交易的方式进行目标 ETF 的买卖。</p> <p>3、本基金可通过买入标的指数成份股来跟踪标的指数。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。</p> <p>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，结合宏观分析和微观分析制定投资策略。此外，本基</p>

	<p>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。</p> <p>4、投资组合的调整</p> <p>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，决定对目标 ETF 的操作方式和数量。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。</p>
业绩比较基准	中创 100 指数收益率×95%+银行活期存款收益率（税后）×5%
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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标（转型后）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2019年1月3日—2019年3月31日）
1. 本期已实现收益	-48,047.95
2. 本期利润	-48,047.95
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0098
4. 期末基金资产净值	3,270,433.17
5. 期末基金份额净值	0.6980

3.1 主要财务指标（转型前）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2019年1月1日—2019年1月2日）
1. 本期已实现收益	-56.40
2. 本期利润	-56.40
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0000
4. 期末基金资产净值	3,776,702.99
5. 期末基金份额净值	0.708

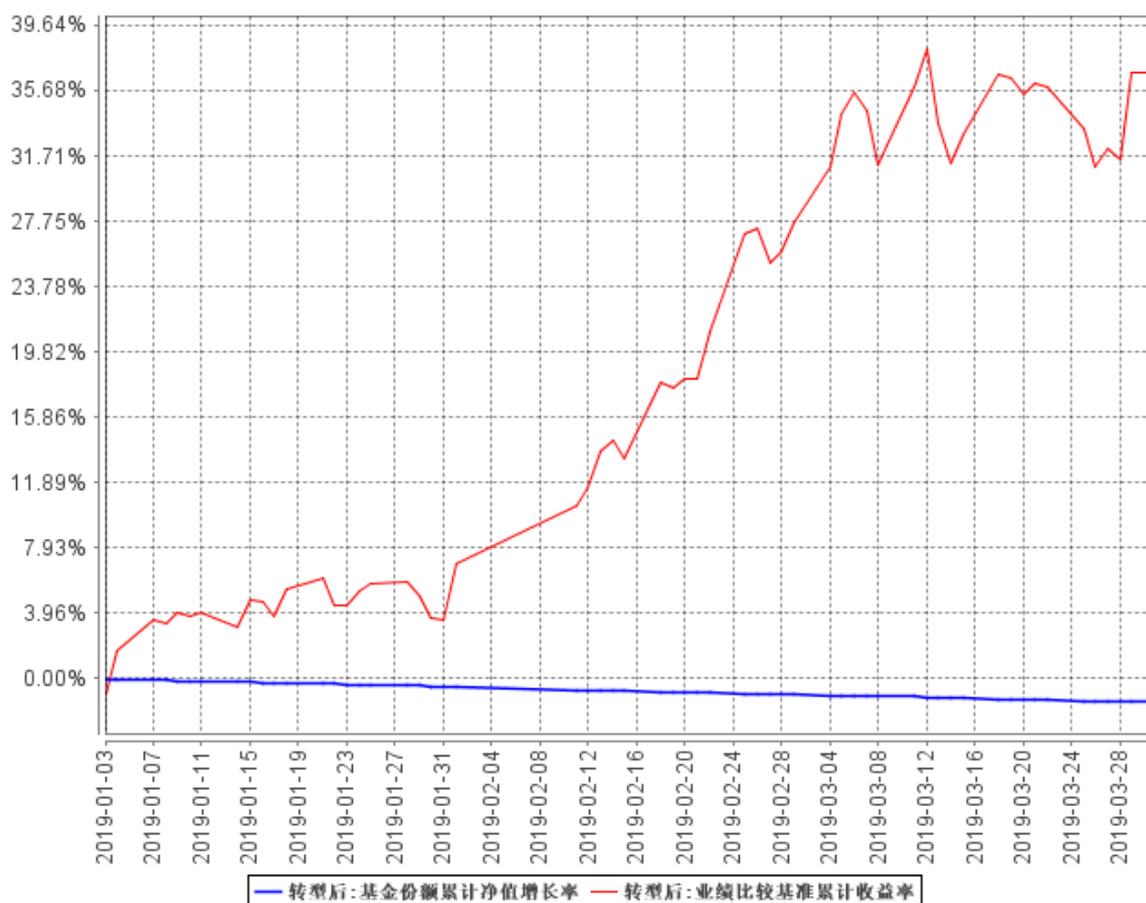
3.2 基金净值表现（转型后）

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	-1.41%	0.03%	36.79%	1.73%	-38.20%	-1.70%

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



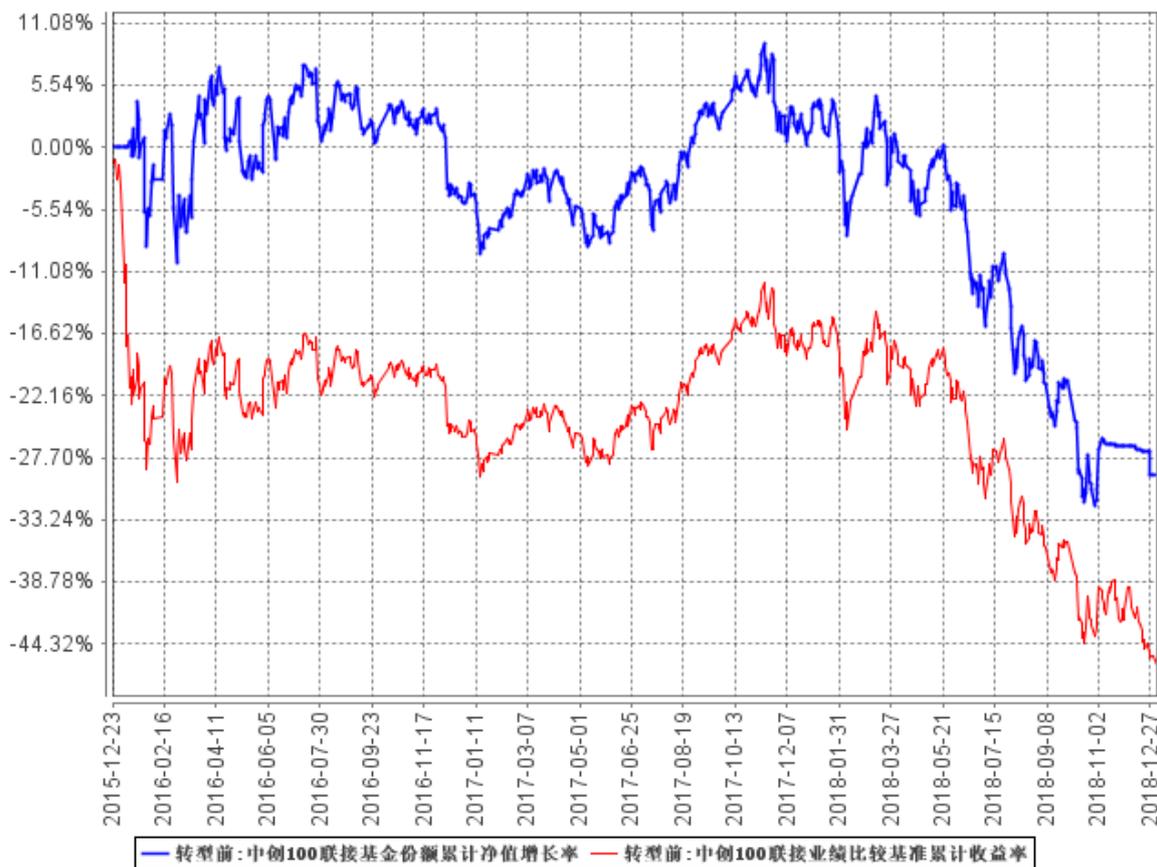
3.2 基金净值表现（转型前）

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	0.00%	0.00%	-1.44%	0.00%	1.44%	0.00%

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

中创100联接基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型前）

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		
李武群	本基金基金经理、指数投资部副总经理	2016年7月20日	-	10年	中国，中国科学院研究生院微电子学与固体电子学博士，具有基金从业资格。曾任中信银行福州分行统计分析岗、华西证券股份有限公司研究所高级研究员和股票投资部投资经理助理，2016年4月20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，2016年7月20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联接基金基金经理，2017 年 8 月 2 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。
--	--	--	--	--	-----------------------------------------------------------------------------------

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型后）

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		
李武群	本基金基金经理、指数投资部副总经理	2016 年 7 月 20 日	-	10 年	中国，中国科学院研究生院微电子学与固体电子学博士，具有基金从业资格。曾任中信银行福州分行统计分析岗、华西证券股份有限公司研究所高级研究员和股票投资部投资经理助理；2017 年 8 月 2 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；2019 年 1 月 3 日起担任华润元大中创 100 指数型证券投资基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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运作分析

2019 年第一季度中国股票市场各主要指数均大幅反弹，价格成交屡创新高，从板块行业上看，中小板块表现强于蓝筹股板块，科技、消费行业表现强于银行、周期性行业。创业板指数上涨 35.43%，中小板指数上涨 35.66%，上证综指上涨 23.93%，沪深 300 指数上涨 28.62%，上证 50 指数上涨 23.78%，中创 100 指数上涨 36.87%。中信一级 29 个行业中农林牧渔（48.80%）、计算机（47.30%）、非银金融（42.39%）板块走势较强，涨幅较大；而电力及公用事业（17.09%）、建筑（18.36%）、银行（16.39%）板块走势明显较弱，涨幅较小。

本基金作为被动指数型基金，报告期内，本基金处于转型后的建仓期，建仓期后将采用完全复制法紧密跟踪中创 100 指数，取得与业绩比较基准基本一致的业绩表现。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.6980 元；本报告期基金份额净值增长率为-1.41%，业绩比较基准收益率为 34.81%。

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，本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，本基金管理人已向中国证监会报告本基金的解决方案。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的情形。

§ 5 投资组合报告

转型后：

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	-	-
	其中：股票	-	-
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	3,535,450.11	99.72
8	其他资产	10,076.42	0.28
9	合计	3,545,526.53	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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

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

本基金本报告期末未持有资产持有证券。

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

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

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

本基金本报告期末投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末持仓股指期货。

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

本基金本报告期末持仓国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末持仓国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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。

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	2,253.40
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,660.40
5	应收申购款	6,162.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,076.42

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

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。

转型前：

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	-	-

	其中：股票	-	-
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	3,795,255.04	99.12
8	其他资产	33,524.11	0.88
9	合计	3,828,779.15	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末（2019 年 1 月 2 日（基金合同失效前日））未持有股票。

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

本基金本报告期末（2019 年 1 月 2 日（基金合同失效前日））未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末（2019 年 1 月 2 日（基金合同失效前日））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

本基金本报告期末（2019 年 1 月 2 日（基金合同失效前日））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

本基金本报告期末（2019 年 1 月 2 日（基金合同失效前日））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

本基金本报告期末（2019 年 1 月 2 日（基金合同失效前日））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

本基金本报告期末（2019 年 1 月 2 日（基金合同失效前日））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

本基金本报告期（2019 年 1 月 1 日至 2019 年 1 月 2 日（基金合同失效前日））未投资股指期货

货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期（2019 年 1 月 1 日至 2019 年 1 月 2 日（基金合同失效前日））未持仓股指期货。

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（2019 年 1 月 1 日至 2019 年 1 月 2 日（基金合同失效前日））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

本基金本报告期（2019 年 1 月 1 日至 2019 年 1 月 2 日（基金合同失效前日））未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期（2019 年 1 月 1 日至 2019 年 1 月 2 日（基金合同失效前日））未持仓国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

-

5.11.2

-

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,937.18
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,293.90
5	应收申购款	-
6	其他应收款	30,293.03
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	33,524.11

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末（2019 年 1 月 2 日（基金合同失效前日））未持有债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末（2019 年 1 月 2 日（基金合同失效前日））未持有股票。

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（转型后）

单位：份

基金合同生效日（2019 年 1 月 3 日）基金份额总额	5,336,141.85
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	1,216,703.32
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	1,867,422.96
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	4,685,422.21

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。

§ 6 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

报告期期初基金份额总额	5,336,141.85
报告期期间基金总申购份额	-
减：报告期期间基金总赎回份额	-
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	5,336,141.85

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（转型后）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型后）

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（转型后）

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型前）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型前）

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（转型前）

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

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

2019 年 1 月 3 日发布了《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》，2019 年 3 月 5 日发布了《华润元大中创 100 交易型开放式指数证券投资基金清算报告》，2019 年 3 月 7 日发布了《华润元大中创 100 交易型开放式指数证券投资基金剩余财产分配公告》，2019 年 3 月 9 日发布了《华润元大基金管理有限公司关于董事变更的公告》、《华润元大基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》、《华润元大基金管理有限公司关于总经理助理人员变更的公告》，欲了解具体公告详情，请登录本公司官网或指定报刊查阅相关公告。

§ 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

以上被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
2019 年 4 月 20 日