新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加中国工商银行股份有限公司基金定期定额投资业务优惠活动的公告

公告送出日期:2018年12月24日

为满足广大投资者的理财需求,新华基金管理股份有限公司(以下简称"本公司")经与中国工商银行股份有限公司(以下简称"中国工商银行")协商,决定自2019年1 月1 日起至2019年12月31日,本公司旗下部分基金参加中国工商银行开展的的基金定期定额投资业务优惠活动。

定期定额投资(以下简称"定投")是基金申购的一种业务方式,指在一定的投资期间内投资者在固定时间、以固定金额定期申购基金。

一、优惠活动时间

2019年1 月1 日起至2019年12月31日,该期间全部法定基金交易日。

二、适用基金

本公司以下基金参加此次优惠活动:

基金代码	基金名称
519089	新华优选成长混合型证券投资基金
519091	新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金
519093	新华钻石品质企业混合型证券投资基金
519095	新华行业周期轮换混合型证券投资基金
519097	新华中小市值优选混合型证券投资基金
519099	新华灵活主题混合型证券投资基金
519150	新华优选消费混合型证券投资基金
519156	新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金A类
519158	新华趋势领航混合型证券投资基金
519152	新华纯债添利债券型发起式证券投资基金A类
519153	新华纯债添利债券型发起式证券投资基金C类
519162	新华增怡债券型证券投资基金A类
519163	新华增怡债券型证券投资基金C类
001294	新华战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金
001681	新华积极价值灵活配置混合型证券投资基金
002272	新华科技创新主题灵活配置混合型证券投资基金
002421	新华增强债券型证券投资基金A类
002422	新华增强债券型证券投资基金C类
002715	新华健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金
003221	新华丰利债券型证券投资基金A类
003222	新华丰利债券型证券投资基金C类
003025	新华红利回报混合型证券投资基金

三、优惠活动内容

在活动期间,投资者通过中国工商银行进行上述基金定投申购,基金定投申购费率均按8折优惠(即实收申购费率=原申购费率×0.8),基金申购费率参见上述基金《基金合同》、《招募说明书》及相关公告。

具体优惠活动规则请参考中国工商银行的相关规定。

四、注意事项

1、本次优惠活动结束后,上述基金定投申购费率继续按原标准实施。

2、本次优惠活动的最终解释权归中国工商银行所有。

3、投资者欲了解上述基金产品的详细情况,请仔细阅读刊登于本公司网站(www.ncfund.com.cn)的上述基金《基金合同》、《招募说明书》等法律文件,以及相关业务公告。

4、投资者可以通过以下途径咨询有关事宜

(1)中国工商银行股份有限公司

客服电话:95588

网址:www.icbc.com.cn

(2)新华基金管理股份有限公司

客服电话:400-819-8866

网址:www.ncfund.com.cn

五、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。本公司充分重视投资者教育工作,以保障投资者利益为己任,特此提醒广大投资者正确认识投资基金所存在的风险,慎重考虑、谨慎决策,选择与自身风险承受能力相匹配的产品,做理性的基金投资者,享受长期投资理财的快乐!

特此公告。

新华基金管理股份有限公司

2018年12月24日

鹏华中证国防指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告

根据《鹏华中证国防指数分级证券投资基金基金合同》(以下简称"基金合同")中关于不定期份额折算的相关规定,当鹏华中证国防指数分级证券投资基金之B份额的基金份额参考净值跌至0.250元时,鹏华国防分级份额(场内简称:国防分级,基础份额)、鹏华国防A份额(场内简称:国防A)、鹏华国防B份额(场内简称:国防B)将进行不定期份额折算。

由于近期A股市场波动较大,截至2018年12月21日,国防B的基金份额参考净值接近基金合同规定的不定期份额折算条件,因此本基金管理人敬请投资者密切关注国防B近期的参考净值波动情况,并警惕可能出现的风险。

针对不定期折算所带来的风险,本基金管理人特别提示如下:

一、由于国防A、国防B折算前可能存在折溢价交易情形,不定期份额折算后,国防A、国防B的折溢价率可能发生较大变化。特提请参与二级市场交易的投资者注意高溢价所带来的风险。

二、国防B表现为高风险、高收益的特征,不定期份额折算后其杠杆将恢复至初始杠杆水平。

三、由于触发折算阀值当日,国防B的参考净值可能已低于阀值,而折算基准日在触发阀值日后才能确定,此折算基准日国防B的净值可能与折算阀值0.250元有一定差异。

四、国防A表现为低风险、收益相对稳定的特征,但在不定期份额折算后国防A持有人的风险收益特征将发生较大变化,由持有单一的较低风险收益特征国防A变为同时持有较低风险收益特征国防A与较高风险收益特征国防分级的情况,因此国防A持有人预期收益实现的不确定性将会增加。

本基金管理人的其他重要提示:

一、根据深圳证券交易所的相关业务规则,场内份额数将取整计算(最小单位为1份),舍去部分计入基金资产,持有极小数量国防分级、国防A、国防B的持有人存在折算后份额因为不足1份而被强制归入基金资产的风险。

二、为保证折算期间本基金的平稳运作,基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停国防A份额与国防B份额的上市交易和鹏华国防分级份额的申购及赎回等相关业务。届时本基金管理人将会对相关事项进行公告,敬请投资者予以关注。

投资者若希望了解基金不定期份额折算业务详情,请参阅本基金的基金合同及《鹏华中证国防指数分级证券投资基金招募说明书》(更新)(以下简称"招募说明书")或者拨打本公司客服电话:400-6788-999(免长途话费)。

三、本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,也不保证最低收益。

本基金管理人提醒投资者基金投资的"买者自负"原则,在做出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行承担。投资有风险,选择须谨慎。敬请投资者于投资前认真阅读本基金的基金合同和招募说明书等相关法律文件。

特此公告。

鹏华基金管理有限公司

2018年12月24日

证券代码:000979 证券简称:中弘退 公告编号:2018-214

中弘控股股份有限公司关于公司股票进入退市整理期交易的第七次风险提示性公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

特别风险提示:

1、公司股票已被深圳证券交易所决定终止上市,将在退市整理期届满后被摘牌。

2、在退市整理期期间,公司股票价格即使达到1元面值以上,根据《深圳证券交易所股票上市规则》相关规定,亦不能改变深圳证券交易所已作出的终止上市决定,公司股票将在退市整理期结束后被摘牌。

3、根据《深圳证券交易所股票上市规则》14.5.1条的规定,公司申请重新上市应当符合的条件包括最近三年公司无重大违法行为,财务会计报告无虚假记载;公司最近三个会计年度经审计的净利润均为正值且累计超过三千万元(净利润以扣除非经常性损益前后较低者为计算依据);等等。公司于2018年8月14日收到安徽证监局《调查通知书》(皖证调查字2018043号),因公司披露的2017年一季度报告、半年度报告、三季度报告涉嫌虚假记载,公司被立案调查;此外,2018年前三季度归属于上市公司股东的净利润为-18.85亿元。

4、公司股票属于深股通标的,公司股票终止上市后进入退市整理期的同时将被调出深股通标的,届时深股通投资者将不能买入只能卖出。后续公司股票进入股转系统后深股通投资者可能无法进行股票转让,提请深股通投资者注意投资风险。

5、公司股票已于2018年11月16日进入退市整理期,在退市整理期交易30个交易日后公司股票将被摘牌。截止2018年12月21日收市已交易26个交易日,预计公司股票将于4个交易日(或者于2018年12月27日)后被终止上市。敬请投资者审慎投资、注意风险。

6、截止目前,公司及下属控股子公司累计逾期债务本息合计金额为1,146,406.04万元,全部为各类借款。

7、公司控股股东中弘卓业集团有限公司持有的质押给国元证券股份有限公司的14,284.2万股本公司无限售流通股因司法强制执行将被出售。具体情况详见2018年11月17日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》和巨潮资讯网(www.cninfo.com.cn)上披露的公司2018-204号公告。

2018年11月8日,中弘控股股份有限公司(以下简称"公司"或"本公司")收到深圳证券交易所《关于中弘控股股份有限公司股票终止上市的决定》(深证上[2018]540号),深圳证券交易所决定公司股票终止上市。根据《深圳证券交易所股票上市规则》的相关规定,公司股票已于2018年11月16日起进入退市整理期交易。

一、公司股票在退市整理期间的证券代码、证券简称及涨跌幅限制

1、证券代码:000979

2、证券简称:中弘退

3、涨跌幅限制:10%

二、公司股票退市整理期交易期限及预计最后交易日期

公司股票进入退市整理期交易的起始日为2018年11月16日,退市整理期为三十个交易日,预计最后交易日期为2018年12月27日,退市整理期间,公司股票全天停牌的不计入退市整理期。公司因特殊原因向深圳证券交易所申请股票全天停牌的,累计停牌天数不超过五个交易日。退市整理期间,公司股票交易的涨跌幅限制、行情揭示、公开信息等其他交易事项遵守《深圳证券交易所交易规则》等相关规定。退市整理期届满的次一个交易日,深圳证券交易所对公司股票予以摘牌。

三、退市整理期风险提示公告的披露安排

退市整理期间,公司将在首个交易日、前二十五个交易日的每五个交易日发布一次股票被终止上市的风险提示公告,并在最后五个交易日内每日发布一次股票将被终止上市的风险提示公告。

四、股票在退市整理期交易期间公司将不筹划或者实施重大资产重组事宜的说明。

根据《深圳证券交易所退市整理期业务特别规定》的相关规定,公司承诺股票在退市整理期间,公司将不筹划或实施重大资产重组等重大事项。

特此公告。

中弘控股股份有限公司

董 事 会

2018年12月22日

东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国中投证券有限责任公司申购及定期定额申购费率优惠活动的公告

为了答谢广大投资者对东吴基金管理有限公司(以下简称"本公司")的支持和厚爱,经本公司与中国中投证券有限责任公司(以下简称"中国中投证券")协商,本公司自2018年12月26日起,对通过中国中投证券销售渠道申购及定期定额申购指定开放式基金(前端模式)实行费率优惠,目前包括:

序号	基金名称	基金代码
1.	东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金	580001
2.	东吴价值成长双动力混合型证券投资基金前端收费	580002
3.	东吴行业轮动混合型证券投资基金	580003
4.	东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金	580005
5.	东吴新经济混合型证券投资基金	580006
6.	东吴新产业精选混合型证券投资基金	580008
7.	东吴优信稳健债券型证券投资基金A类	582001
8.	东吴增利债券型证券投资基金A类	582002
9.	东吴中证新兴产业指数证券投资基金	585001
10.	东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金	582003
11.	东吴阿尔法灵活配置混合型证券投资基金	000531
12.	东吴新趋势价值线灵活配置混合型证券投资基金	001322
13.	东吴国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金	002159
14.	东吴智慧医疗量化策略灵活配置混合型证券投资基金	002919
15.	东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金	165809

一、活动时间

自2018年12月26日起实施,本优惠活动结束时间以中国中投证券公告为准。

二、申购费率优惠方式

1、活动期间,投资者通过中国中投证券渠道申购(含定期定额申购)上述适用基金,享受基金申购手续费率1折优惠,原基金申购费率按笔收取固定费用的不再享有费率优惠。

2、具体折扣费率请参见中国中投证券相关公告。基金原费率请详见基金合同、招募说明书(更新)等法律文件,以及本公司发布的最新业务公告。

3、申购及定投费率我司后台不设折扣限制,以中国中投证券上报折扣率为准。

三、投资者可通过以下途径咨询有关详情

1、中国中投证券有限责任公司

客户服务电话:400-600-8008

网址:www.china-invs.cn

2、东吴基金管理有限公司

客户服务电话:400-821-0588(免长途话费)

网址:www.scfund.com.cn

四、重要提示

1. 上述优惠仅适用于处于正常申购期的基金(前端收费模式)的日常申购手续费,不包括各基金的后端收费模式的申购手续费以及处于募集期的基金认购费,也不包括基金赎回、转换等其他业务的基金手续费。

2. 本次优惠活动解释权归中国中投证券所有,请遵循中国中投证券基金业务规则及本次活动的具体规定。投资者通过中国中投证券进行基金申购及定期定额申购的费率折扣率以中国中投证券数据为准。

3. 有关本次申购费率优惠活动的具体详情请见中国中投证券网站刊登的公告。投资者欲了解基金产品的详细情况,请仔细阅读本公司旗下基金的基金合同、招募说明书等法律文件。

特此公告。

东吴基金管理有限公司

2018年12月24日

关于《华润元大中创100交易型开放式指数证券投资基金基金合同》终止的公告

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"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")2015年3月9日证监许可【2015】363号文准予募集注册,自2015年5月25日起基金合同正式生效,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。

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交易型开放式指数证券投资基金基金合同》(以下简称"《基金合同》")等有关规定,《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,无需召开基金份额持有人大会审议,基金管理人应当直接终止本基金合同进行清算。法律另有规定时,从其规定。截至2018年9月7日日终,本基金已连续60个工作日基金资产净值低于5000万元。

根据《基金合同》及《关于华润元大中创100交易型开放式指数证券投资基金发生基金合同终止事由并进入基金财产清算程序的公告》,本基金最后运作日为2018年11月5日,于2018年11月6日起进入清算期。本基金清算期自2018年11月6日至2018年11月19日止。本基金的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、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。在获得中国证监会《关于华润元大中创100交易型开放式指数证券投资基金清算备案的回函》(机构部函[2018]2983号)后,基金管理人华润元大基金管理有限公司已于2018年12月24日刊登了《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》。

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》、《基金合同》的有关规定,《华润元大中创100交易型开放式指数证券投资基金基金合同》自本公告发布之日起终止。

投资者可登录本基金管理人网站www.cryuantafund.com或拨打客户服务热线4000-1000-89(免长途费)咨询相关信息。

特此公告。

华润元大基金管理有限公司

二〇一八年十二月二十四日

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的提示性公告

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为华润元大中创100指数型证券投资基金的基金份额。为维护基金份额持有人的利益,本公司进行如下提示:

预计自2019年1月3日起,本基金将转型为华润元大中创100指数型证券投资基金。

为保护投资者利益,自2018年9月15日起,本基金已暂停申购、转换转入及定期定额投资业务,自2018年11月6日起,本基金已暂停赎回、转换转出业务。转型后,华润元大中创100指数型证券投资基金将开放日常申购、赎回等业务,本基金管理人将按照相关规定发布开放日常申购、赎回等业务的公告,敬请投资者留意。

为方便投资者,届时本公司将修订后的《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。届时投资者欲了解详情,请登录本公司网站(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。

华润元大基金管理有限公司

二〇一八年十二月二十四日

华润元大现金收益货币市场基金关于元旦假期前暂停大额申购(含转换转入及定期定额投资)业务的公告

公告送出日期:2018年12月24日

1. 公告基本信息

基金名称		华润元大现金收益货币市场基金	
基金简称		华润元大现金收益货币	
基金主代码		000324	
基金管理人名称		华润元大基金管理有限公司	
公告依据		《华润元大现金收益货币市场基金基金合同》、《华润元大现金收益货币市场基金招募说明书》	
暂停相关业务的起始日、金额及原因说明	暂停大额申购起始日	2018年12月27日	
	暂停大额转换转入起始日	2018年12月27日	
	暂停定期定额投资起始日	2018年12月27日	
	限制申购金额(单位:人民币元)	5,000,000.00	
	限制转换转入金额(单位:人民币元)	5,000,000.00	
	限制定期定额投资金额(单位:人民币元)	5,000,000.00	
	暂停大额申购(含转换转入及定期定额投资)的原因说明	保护基金份额持有人利益	
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
该分级基金是否暂停大额申购(含转换转入及定期定额投资)		是	是
下属分级基金的限制申购金额(单位:人民币元)		-	-
下属分级基金的限制转换转入金额(单位:人民币元)		-	-

注:-

2. 其他需要提示的事项

(1)本基金单日单个基金账户单笔申购(或转换转入、定期定额投资)不超过500万元(含500万元),给予确认,若超过500万元,该笔申购(或转换转入、定期定额投资)不予确认。

(2)本基金单日单个基金账户多笔申购(或转换转入、定期定额投资),则按金额从大到小逐笔排序,逐笔累加至符合不超过500万元限额的申请给予确认,其余不予确认。

(3)在暂停大额申购(含转换转入及定期定额投资)业务期间,赎回及转换转出业务等其他业务仍照常办理。本公司自2019年1月2日开始恢复办理本基金的大额申购(含转换转入及定期定额投资)业务,届时将不再另行公告。

(4)投资者可登录本公司网站www.cryuantafund.com或拨打客户服务热线4000-1000-89(免长途费)咨询相关信息。

(5)风险提示: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财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。投资者购买货币市场基金并不等于将资金作为存款存放在银行或者存款类金融机构。投资者投资于本基金时应认真阅读本基金的基金合同、招募说明书。敬请投资者留意投资风险。

特此公告。

华润元大基金管理有限公司

2018年12月24日

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

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:二〇一八年十一月十九日

清算报告公告日:二〇一八年十二月二十四日

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(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")2015年3月9日证监许可【2015】363号文准予募集注册,自2015年5月25日起基金合同正式生效,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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《华润元大中创100交易型开放式指数证券投资基金基金合同》(以下简称"《基金合同》")等有关规定,《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,无需召开基金份额持有人大会审议,基金管理人应当直接终止本基金合同进行清算。法律另有规定时,从其规定。根据《基金合同》及《关于华润元大中创100交易型开放式指数证券投资基金发生基金合同终止事由并进入基金财产清算程序的公告》,本基金最后运作日为2018年11月5日,于2018年11月6日起进入清算期。

本基金清算期自2018年11月6日至2018年11月19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交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华润元大中创100ETF
场内简称	中创100
基金主代码	159942
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015年5月25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交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《华润元大中创100交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市交易日	2015年6月25日
投资目标	本基金采用被动式投资策略,通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段,力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准表现相当,以便为投资者带来长期收益。
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,以获得更接近目标指数的收益率。 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。 为有效管理投资组合,基金可投资于经中国证监会允许的各种金融衍生产品,如股指期货、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。基金投资于衍生工具的目标,是使得基金的投资组合更紧密地跟踪标的指数,以便更好地实现基金的投资目标。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10%。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0.2%,年跟踪误差不超过2%。
业绩比较基准	中创100指数
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。同时本基金为交易型开放式指数基金,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

本基金经中国证监会2015年3月9日证监许可【2015】363号文准予募集注册,由基金管理人依照法律法规、《基金合同》等规定自2015年4月15日至2015年5月15日期间向社会公开募集。本基金《基金合同》于2015年5月25日正式生效,基金合同生效日的基金份额总数为381,376,296.00份(含募集期间利息结转的份额,其中认购资金利息折合37296.00份基金份额)。

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》、《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,无需召开基金份额持有人大会审议,基金管理人应当直接终止本基金合同进行清算。法律另有规定时,从其规定。截至2018年9月7日日终,本基金的基金资产净值持续低于5000万元,即本基金已连续60个工作日基金资产净值低于5000万元。为维护基金份额持有人利益,根据基金合同约定,基金管理人已向中国证监会报告,本基金将依法进入基金财产清算程序,无需召开基金份额持有人大会审议。基金管理人向深圳证券交易所申请终止本基金的上市交易,现已获得深圳证券交易所同意(《终止上市通知书》深证上[2018]507号)。本基金最后运作日为2018年11月5日,于2018年11月6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交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日:2018年11月05日

单位:人民币元

	最后运作日 2018年11月5日
资产:	
银行存款	411,954.12
结算备付金	25,460.58
存出保证金	578.41
交易性金融资产	21,436,009.76
其中:股票投资	21,436,009.76
应收证券清算款	63,061.06
应收利息	1,114.81
资产总计	21,938,178.74
负债:	
应付管理人报酬	1,681.84
应付托管费	336.36
应付交易费用	69.65
其他负债	195,305.61
负债合计	197,393.46
所有者权益:	
实收基金	50,723,185.67
未分配利润	-28,982,400.39
所有者权益合计	21,740,785.28
负债和所有者权益总计	21,938,178.74

注1:报告截止日2018年11月5日(基金最后运作日),基金份额净值1.4030元,基金份额总额15,493,705.00份。

注2:本财务报表的实际编制期间为2018年1月1日至2018年11月5日(基金最后运作日)。

四、清算情况

自2018年11月6日至2018年11月19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、负债进行第一次清算,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人民币25,460.58元,截至2018年11月19日结算备付金余额为人民币747.31元,该款项将于第二次清算时再向基金份额持有人分配。

(2)本基金最后运作日存出保证金人民币578.41元,截至2018年11月19日存出保证金余额为人民币578.41元,该款项将于第二次清算时再向基金份额持有人分配。

(3)本基金最后运作日交易性金融资产人民币21,436,009.76元,系股票投资人民币21,436,009.76元,其明细如下:

单位:人民币元

股票代码	股票名称	最后运作日估值单价	数量(单位:股)	最后运作日成本总额	最后运作日估值总额
002001	新和成	15.10	11,890	139,814.97	179,539.00
002007	华兰生物	36.90	7,361	219,685.18	271,620.90
002008	大族激光	34.00	9,801	245,530.28	333,234.00
002010	传化智联	8.75	4,200	80,746.53	36,750.00
002013	中航机电	8.13	17,100	125,906.19	139,023.00
002019	亿帆医药	11.61	6,800	150,712.76	78,948.00
002024	苏宁易购	12.05	43,100	578,344.95	519,355.00
002027	分众传媒	6.49	71,760	739,197.63	465,722.40
002038	双鹭药业	28.82	4,500	141,584.06	129,690.00
002044	美年健康	16.16	16,620	235,701.94	268,579.20
002049	紫光国微	32.55	4,100	163,079.40	133,455.00
002050	三花智控	12.54	11,500	209,371.71	144,210.00
002065	东华软件	7.62	22,000	249,517.54	167,640.00
002074	国轩高科	13.00	9,000	243,567.75	117,000.00
002081	金螳螂	8.59	16,500	204,073.08	141,735.00
002085	万丰奥威	7.94	13,928	264,758.33	110,588.32
002092	中泰化学	7.76	18,500	234,646.14	143,560.00
002110	三钢闽光	16.65	8,000	128,405.20	133,200.00
002129	中环股份	6.32	22,377	283,946.71	141,422.64
002142	宁波银行	17.78	27,914	316,687.55	496,310.92
002146	荣盛发展	7.84	22,100	195,596.21	173,264.00
002153	石基信息	31.25	4,900	150,936.16	153,125.00
002176	江特电机	6.25	17,001	244,743.08	106,256.25
002179	中航光电	39.45	4,089	126,270.81	161,311.05
002185	华天科技	4.08	21,500	120,759.20	87,720.00
002195	二三四五	4.07	34,288	196,248.89	139,552.16
002202	金风科技	10.21	25,080	328,367.92	256,066.80
002223	鱼跃医疗	18.03	8,500	198,627.94	153,255.00
002230	科大讯飞	24.93	19,922	445,702.79	496,655.46
002236	大华股份	13.50	19,350	292,859.07	261,225.00
002241	歌尔股份	7.61	25,000	357,703.76	190,250.00
002252	上海莱士	19.52	20,420	430,779.39	398,598.40
002271	东方雨虹	14.77	10,630	246,250.69	157,005.10
002273	水晶光电	10.16	8,363	174,129.74	84,968.08
002294	信立泰	26.07	5,800	165,425.14	151,206.00
002304	洋河股份	97.66	7,647	513,969.55	746,806.02
002310	东方园林	9.36	17,801	220,577.88	166,617.36
002340	格林美	4.36	33,860	185,961.36	147,629.60
002352	顺丰控股	38.68	3,100	153,493.01	119,908.00
002385	大北农	3.52	26,550	222,511.44	93,456.00
002405	四维图新	16.08	9,552	210,036.26	153,596.16
002415	海康威视	28.23	42,930	744,218.31	1,211,913.90
002422	科伦药业	24.92	11,000	197,411.87	274,120.00
002439	启明星辰	20.93	7,600	209,456.48	159,068.00
002450	康得新	17.01	34,081	564,637.19	579,717.81
002456	欧菲科技	13.27	24,700	302,177.79	327,769.00
002460	赣锋锂业	25.28	9,750	228,922.24	246,480.00
002465	海格通信	7.67	18,400	265,905.77	141,128.00
002466	天齐锂业	31.70	9,110	387,399.87	288,787.00
002470	金正大	6.00	18,300	164,419.21	109,800.00
002475	立讯精密	16.04	28,284	329,680.66	453,675.36
002500	山西证券	6.10	18,967	247,090.20	115,698.70
002508	老板电器	22.31	6,000	257,767.64	133,860.00
002555	三七互娱	12.58	5,600	101,612.89	70,448.00
002558	巨人网络	18.98	5,200	222,941.09	98,696.00
002572	索菲亚	19.48	8,800	352,273.47	171,424.00
002573	清新环境	8.21	8,200	146,368.06	67,322.00
002594	比亚迪	48.25	11,400	677,114.68	550,050.00
002600	领益智造	2.90	17,500	90,650.00	50,750.00
002601	龙蟒佰利	13.53	7,500	121,327.83	101,475.00
002624	完美世界	26.56	3,300	108,295.85	87,648.00
002673	西部证券	8.68	22,456	446,257.90	194,918.08
002714	牧原股份	23.58	8,500	254,286.64	200,430.00
002736	国信证券	8.97	21,573	363,507.36	193,509.81
002739	万达电影	31.10	20,685	1,161,772.40	643,303.50
002797	第一创业	5.34	24,440	291,651.49	130,509.60
300003	乐普医疗	30.73	10,401	196,127.70	319,622.73
300014	亿纬锂能	12.95	6,681	97,509.59	86,518.95
300015	爱尔眼科	28.25	11,200	361,970.25	316,400.00
300017	网宿科技	8.24	18,381	351,161.91	151,459.44
300024	机器人	14.82	15,040	452,146.35	222,892.80
300027	华谊兄弟	4.81	18,959	360,217.63	91,192.79
300033	同花顺	39.26	1,900	124,984.34	74,594.00
300055	万邦达	8.36	7,001	130,435.75	58,528.36
300058	蓝色光标	4.74	16,106	228,682.90	76,342.44
300059	东方财富	12.93	46,958	757,594.40	607,166.94
300070	碧水源	9.60	18,195	319,014.64	174,672.00
300072	三聚环保	12.39	13,645	195,485.29	169,061.55
300088	长信科技	5.02	23,000	132,710.00	115,460.00
300113	顺网科技	15.26	5,100	136,061.05	77,826.00
300115	长盈精密	9.00	7,800	150,827.30	70,200.00
300122	智飞生物	38.36	5,500	251,012.16	210,980.00
300124	汇川技术	24.29	11,942	247,081.57	290,071.18
300136	信维通信	26.72	10,400	407,316.29	277,888.00
300142	沃森生物	16.22	13,600	271,293.21	220,592.00
300144	宋城演艺	22.20	8,611	202,591.92	191,164.20
300156	神雾环保	4.26	8,100	260,993.56	34,506.00
300168	万达信息	12.26	9,500	286,000.60	116,470.00
300251	光线传媒	7.49	11,481	141,994.81	85,992.69
300274	阳光电源	6.88	11,600	104,284.00	79,808.00
300296	利亚德	8.80	18,050	235,762.66	158,840.00
300315	掌趣科技	3.95	30,500	338,675.74	120,475.00
300355	蒙草生态	4.36	13,400	168,905.53	58,424.00
300383	光环新网	13.73	11,400	208,352.46	156,522.00
300408	三环集团	20.25	14,101	226,216.53	285,545.25
300418	昆仑万维	13.86	6,900	193,856.28	95,634.00
300433	蓝思科技	8.59	9,179	152,455.54	78,847.61
300498	温氏股份	25.05	47,165	1,376,869.19	1,181,483.25
300618	寒锐钴业	83.36	200	20,725.88	16,672.00
300676	华大基因	58.00	200	13,124.08	11,600.00

其中,截至最后运作日,本基金持有的流通受限股票明细如下:

单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	最后运作日估值单价	数量(单位:股)	最后运作日成本总额	最后运作日估值总额
002252	上海莱士	2018/02/23	重大事项	19.52	20,420	430,779.39	398,598.40
002450	康得新	2018/06/04	重大事项	17.01	34,081	564,637.19	579,717.81
002558	巨人网络	2018/09/17	重大事项	18.98	5,200	222,941.09	98,696.00

本基金于第一次清算期间对可变现的交易性金融资产进行处置变现,实际变现金额为人民币20,458,012.88元,其中,于最后运作日流通受限的股票在第一次清算期间的复牌处置情况如下:

单位:人民币元

股票代码	股票名称	复牌日期	卖出数量(单位:股)	卖出所得金额
002252	上海莱士	未复牌	-	-
002450	康得新	2018/11/15	34,081	409,567.27
002558	巨人网络	2018/11/06	5,200	103,471.23

待停牌股票复牌后,基金管理人将及时变现停牌股票,并于第二次清算时向基金份额持有人进行分配。

(1)本基金最后运作日应收利息人民币1,114.81元,其中应收银行存款利息人民币1,092.07元、应收结算备付金利息人民币21.54元、应收存出保证金利息人民币1.20元。截至2018年11月19日应收利息余额为人民币13,024.20元,其中应收银行存款利息人民币12,997.66元,管理人将以自有资金垫付截至最后运作日的银行存款利息人民币1,092.07元,待结息后再将管理人垫付的部分划至管理人账户,实际结息与垫付利息之间的差额由管理人承担,余下应收银行存款利息人民币11,905.59元、应收结算备付金利息人民币24.92元及应收存出保证金利息人民币1.62元将于第二次清算时再向基金份额持有人分配。

(2)本基金最后运作日应收证券清算款人民币63,061.06元,截至2018年11月19日应付证券清算款人民币2.09元,系第一次清算期间股票投资处置产生的应付证券清算款。

2、负债清偿情况

(1)本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币1,681.84元,该款项已于2018年11月14日支付。

(2)本基金最后运作日应付托管费为人民币336.36元,该款项已于2018年11月14日支付。

(3)本基金最后运作日应付交易费用为人民币69.65元,该款项已于2018年11月14日支付。截至2018年11月19日,应付交易费用为人民币381.85元,该款项将于第二次清算时支付。

(4)本基金最后运作日其他负债为人民币195,305.61元,其中应付指数使用费人民币893.61元已于2018年11月19日支付,应付审计费35,891.38元已于2018年11月16日支付,应付信息披露费人民币158,520.62元已分别于2018年11月14日、2018年11月19日共支付人民币124,340.00元,并于2018年11月19日冲销多计提的信息披露费人民币34,180.62元。

3、清算期间的清算损益情况

单位:人民币元

项目	自2018年11月6日至2018年11月19日止清算期间
一、清算收益	
1、利息收入(注1)	11,909.39
2、投资收益	-6,569,249.69
其中:股息红利个税(注2)	-4,523.23
3、公允价值变动损益	6,007,625.44
清算收入小计	-549,714.86
二、清算费用	
1、交易费用	41,370.72
2、其他费用(注3)	9,490.99
清算费用小计(注4)	50,861.71
三、清算净收益	-600,576.57

注1:利息收入系计提的第一次清算期间的银行存款利息、存出保证金利息及结算备付金利息。其中,存出保证金利息人民币0.42元、结算备付金利息人民币3.38元将于第二次清算时再向基金份额持有人分配,银行存款利息人民币11,905.59元,其中截至最后运作日的银行存款利息人民币1,092.07元将由管理人以自有资金垫付,待结息后再将管理人垫付的部分划至管理人账户,实际结息与垫付利息之间的差额由管理人承担。

注2:股息红利个税系根据《股息红利差别化纳税会计核算细则》(中基协发[2012]21号),于转让交割股票后的次一交易日,根据中登公司按投资者实际持股期限计算的应缴税额计提应缴税款而确认的红字股利收益。

注3:其他费用系计提的律师费人民币25,000.00元、指数使用费18,671.61元以及冲销计提信息披露费人民币34,180.62元。

注4:根据本基金的基金合同约定,清算费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2018年11月5日基金净资产	21,740,785.28
加:清算期间净收益	-600,576.57
二、2018年11月19日基金净资产	21,140,208.71

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。

2018年11月19日本基金剩余财产为人民币21,140,208.71元,其中包括未变现资产:交易性金融资产人民币398,598.40元(该金额为停牌股票最后运作日估值金额,与停牌股票资产复牌后实际变现金额可能存在差异),结算备付金人民币747.31元,存出保证金人民币578.41元,应收银行存款、存出保证金及结算备付金利息人民币13,024.20元。上述未变现的资产中,截至最后运作日的应收银行存款利息人民币1,092.07元将由管理人以自有资金垫付,待结息后再将垫付的部分划至管理人账户,实际结息与垫付利息之间的差额由管理人承担;剩余未变现的资产将根据变现情况在第二次清算期间按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

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份额持有人所有,将于第二次清算结束时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交易型开放式指数证券投资基金清算审计报告》

2、《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交易型开放式指数证券投资基金

基金财产清算小组

二〇一八年十二月二十四日