

## 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

## 2017年年度报告摘要

2017年12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  
送出日期:2018年3月28日

重要提示:2018年3月28日  
1.1重要提示  
1.1.1重要提示  
基金管理人的董事会、董事、监事及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的法律责任。本基金年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。  
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  
根据本基金合同规定,于2018年3月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。  
基金管理人秉承诚实信用、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及其更新。

本报告财务数据已经审计,德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了标准无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

本报告期自2017年1月1日起至2017年12月31日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

## § 2基金简介

## 2.1基金基本情况

基金简称	华润元大中创100交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	000713
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
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
报告期基金总份额	12,541,405,499份
基金资产总值	不适用

## 2.1.1目标基金基本情况

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
基金主代码	159942
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
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
报告期基金总份额	12,541,405,499份
基金资产总值	不适用

## 2.2基金产品说明

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的最小化。
本基金是华润元大中创100ETF基金(即ETF)作为其主要投资标的,本基金不参与直接投资于ETF份额,主要以组合投资的方式投资于目标ETF,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的最小化。	
本基金报告期内,基金管理人对旗下管理的不同投资组合在连续四个季度期间内,不同时间窗(日、内3日、内5日)的同向交易交易情况正常,价差均在可合理解释范围内。	
4.3.3异常交易行为的专项说明	
4.3.4代理人对报告期内基金运作情况的专项说明	
4.3.5公平交易制度和控制方法	
4.3.6根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和《证券投资基金评价公司公平交易制度指导意见》等法律法规,公司制定了“华润元大基金管理有限公司公平交易管理制度”,对投资决策的内部控制、交易执行的内部控制、公平交易的实施效果评估与监察稽核、信息披露和报告进行了规定,以确保旗下公司旗下管理的不同投资组合得到公平对待,保护投资者合法权益。公司对所有投资品种实行集中交易制度,严格遵循优先级优先、业绩优先的原则,同时对可能导致不公平交易利益输送的异常交易行为进行监控,对不同投资组合间向交易的交易的异常行为进行分析,防止利益输送的发生。	
4.3.7公平交易制度的执行情况	

投资策略	本基金报告期内,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、遵循“公开、公平、公正”的原则,在合法合规的前提下,基金管理人旗下管理的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。
4.3.8代理人对报告期内基金运作情况的专项说明	
4.3.9报告期内基金投资策略和运作分析	
4.3.10公平交易制度和控制方法	
4.3.11根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和《证券投资基金评价公司公平交易制度指导意见》等法律法规,公司制定了“华润元大基金管理有限公司公平交易管理制度”,对投资决策的内部控制、交易执行的内部控制、公平交易的实施效果评估与监察稽核、信息披露和报告进行了规定,以确保旗下公司旗下管理的不同投资组合得到公平对待,保护投资者合法权益。公司对所有投资品种实行集中交易制度,严格遵循优先级优先、业绩优先的原则,同时对可能导致不公平交易利益输送的异常交易行为进行监控,对不同投资组合间向交易的交易的异常行为进行分析,防止利益输送的发生。	
4.3.12公平交易制度的执行情况	

投资策略	本基金报告期内,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、遵循“公开、公平、公正”的原则,在合法合规的前提下,基金管理人旗下管理的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。
4.3.13异常交易行为的专项说明	
4.3.14代理人对报告期内基金运作情况的专项说明	
4.3.15报告期内基金投资策略和运作分析	
4.3.16公平交易制度和控制方法	
4.3.17根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和《证券投资基金评价公司公平交易制度指导意见》等法律法规,公司制定了“华润元大基金管理有限公司公平交易管理制度”,对投资决策的内部控制、交易执行的内部控制、公平交易的实施效果评估与监察稽核、信息披露和报告进行了规定,以确保旗下公司旗下管理的不同投资组合得到公平对待,保护投资者合法权益。公司对所有投资品种实行集中交易制度,严格遵循优先级优先、业绩优先的原则,同时对可能导致不公平交易利益输送的异常交易行为进行监控,对不同投资组合间向交易的交易的异常行为进行分析,防止利益输送的发生。	
4.3.18公平交易制度的执行情况	

投资策略	本基金报告期内,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、遵循“公开、公平、公正”的原则,在合法合规的前提下,基金管理人旗下管理的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。
4.3.19异常交易行为的专项说明	
4.3.20代理人对报告期内基金运作情况的专项说明	
4.3.21报告期内基金投资策略和运作分析	
4.3.22公平交易制度和控制方法	
4.3.23根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和《证券投资基金评价公司公平交易制度指导意见》等法律法规,公司制定了“华润元大基金管理有限公司公平交易管理制度”,对投资决策的内部控制、交易执行的内部控制、公平交易的实施效果评估与监察稽核、信息披露和报告进行了规定,以确保旗下公司旗下管理的不同投资组合得到公平对待,保护投资者合法权益。公司对所有投资品种实行集中交易制度,严格遵循优先级优先、业绩优先的原则,同时对可能导致不公平交易利益输送的异常交易行为进行监控,对不同投资组合间向交易的交易的异常行为进行分析,防止利益输送的发生。	
4.3.24公平交易制度的执行情况	

投资策略	本基金报告期内,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、遵循“公开、公平、公正”的原则,在合法合规的前提下,基金管理人旗下管理的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。
4.3.25异常交易行为的专项说明	
4.3.26代理人对报告期内基金运作情况的专项说明	
4.3.27报告期内基金投资策略和运作分析	
4.3.28公平交易制度和控制方法	
4.3.29根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和《证券投资基金评价公司公平交易制度指导意见》等法律法规,公司制定了“华润元大基金管理有限公司公平交易管理制度”,对投资决策的内部控制、交易执行的内部控制、公平交易的实施效果评估与监察稽核、信息披露和报告进行了规定,以确保旗下公司旗下管理的不同投资组合得到公平对待,保护投资者合法权益。公司对所有投资品种实行集中交易制度,严格遵循优先级优先、业绩优先的原则,同时对可能导致不公平交易利益输送的异常交易行为进行监控,对不同投资组合间向交易的交易的异常行为进行分析,防止利益输送的发生。	
4.3.30公平交易制度的执行情况	

投资策略	本基金报告期内,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、遵循“公开、公平、公正”的原则,在合法合规的前提下,基金管理人旗下管理的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。
4.3.31异常交易行为的专项说明	
4.3.32代理人对报告期内基金运作情况的专项说明	
4.3.33报告期内基金投资策略和运作分析	
4.3.34公平交易制度和控制方法	
4.3.35根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和《证券投资基金评价公司公平交易制度指导意见》等法律法规,公司制定了“华润元大基金管理有限公司公平交易管理制度”,对投资决策的内部控制、交易执行的内部控制、公平交易的实施效果评估与监察稽核、信息披露和报告进行了规定,以确保旗下公司旗下管理的不同投资组合得到公平对待,保护投资者合法权益。公司对所有投资品种实行集中交易制度,严格遵循优先级优先、业绩优先的原则,同时对可能导致不公平交易利益输送的异常交易行为进行监控,对不同投资组合间向交易的交易的异常行为进行分析,防止利益输送的发生。	
4.3.36公平交易制度的执行情况	

投资策略	本基金报告期内,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、遵循“公开、公平、公正”的原则,在合法合规的前提下,基金管理人旗下管理的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。
4.3.37异常交易行为的专项说明	
4.3.38代理人对报告期内基金运作情况的专项说明	
4.3.39报告期内基金投资策略和运作分析	
4.3.40公平交易制度和控制方法	
4.3.41根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和《证券投资基金评价公司公平交易制度指导意见》等法律法规,公司制定了“华润元大基金管理有限公司公平交易管理制度”,对投资决策的内部控制、交易执行的内部控制、公平交易的实施效果评估与监察稽核、信息披露和报告进行了规定,以确保旗下公司旗下管理的不同投资组合得到公平对待,保护投资者合法权益。公司对所有投资品种实行集中交易制度,严格遵循优先级优先、业绩优先的原则,同时对可能导致不公平交易利益输送的异常交易行为进行监控,对不同投资组合间向交易的交易的异常行为进行分析,防止利益输送的发生。	
4.3.42公平交易制度的执行情况	

投资策略	本基金报告期内,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、遵循“公开、公平、公正”的原则,在合法合规的前提下,基金管理人旗下管理的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。
4.3.43异常交易行为的专项说明	
4.3.44代理人对报告期内基金运作情况的专项说明	
4.3.45报告期内基金投资策略和运作分析	
4.3.46公平交易制度和控制方法	
4.3.47根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和《证券投资基金评价公司公平交易制度指导意见》等法律法规,公司制定了“华润元大基金管理有限公司公平交易管理制度”,对投资决策的内部控制、交易执行的内部控制、公平交易的实施效果评估与监察稽核、信息披露和报告进行了规定,以确保旗下公司旗下管理的不同投资组合得到公平对待,保护投资者合法权益。公司对所有投资品种实行集中交易制度,严格遵循优先级优先、业绩优先的原则,同时对可能导致不公平交易利益输送的异常交易行为进行监控,对不同投资组合间向交易的交易的异常行为进行分析,防止利益输送的发生。	
4.3.48公平交易制度的执行情况	

投资策略	本基金报告期内,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、遵循“公开、公平、公正”的原则,在合法合规的前提下,基金管理
------	--