大成中证100交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书摘要

（2016年1期）

基金管理人：大成基金管理有限公司
基金托管人：中国银行股份有限公司

二〇一六年三月

重 要 提 示

大成中证100交易型开放式指数证券投资基金经中国证监会2012年12月19日证监许可【2012】1699号文核准募集，本基金的基金合同于2013年2月7日正式生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明中国证监会对本基金的价值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。

基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。

投资有风险，投资者申购本基金时应认真阅读本更新的招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本更新招募说明书已经基金托管人复核。本更新招募说明书所载内容截至日为2016年2月7日（其中人员变动信息以公告日为准），有关基金投资组合及财务数据截止日为2015年12月31日（财务数据未经审计）。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：大成基金管理有限公司

住所：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层

办公地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层

设立日期：1999年4月12日

注册资本：贰亿元人民币

股权结构：公司股东为中泰信托有限责任公司（持股比例48%）、中国银河投资管理有限公司（持股比例25%）、光大证券股份有限公司（持股比例25%）、广东证券股份有限公司（持股比例2%）四家公司。

法定代表人：刘卓

电话：0755-83183388

传真：0755-83199588

联系人：肖剑

（二）主要人员情况

1.公司高级管理人员

董事会：

刘卓先生，董事长，工学学士。曾任职于共青团哈尔滨市委、哈尔滨银行股份有限公司、中泰信托有限责任公司；2007年6月，任哈尔滨银行股份有限公司执行董事；2008年8月，任哈尔滨银行股份有限公司董事会秘书；2012年4月，任哈尔滨银行股份有限公司副董事长；2012年11月至今，任中泰信托有限责任公司监事会主席。2014年12月15日起任大成基金管理有限公司董事长。

靳天鹏先生，副董事长，国际法学硕士。1991年7月至1993年2月，任职于共青团河南省委；1993年3月至12月，任职于深圳市国际经济与法律咨询公司；1994年1月至6月，任职于深圳市蛇口律师事务所；1994年7月至1997年4月，任职于蛇口招商港务股份有限公司；1997年5月至2015年1月，先后任光大证券有限责任公司南方总部研究部部研究员、南方总部机构管理部副总经理、光大证券股份有限公司债券业务部总经理助理、资产管理总部投资部副总经理（主持工作），法律合规部副总经理、零售交易业务总部副总经理。

罗登攀先生，董事、总经理，耶鲁大学经济学博士。具注册金融分析师(CFA)、金融风险管理师（FRM）资格。曾任毕马威（KPMG）法律诉讼部资深咨询师、金融部资深咨询师，以及SLCG证券诉讼和咨询公司合伙人；2009年至2012年，任中国证券监督管理委员会规划委专家顾问委员，机构部创新处负责人，兼任国家“千人计划”专家；2013年2月至2014年10月，任中信并购基金管理有限公司董事总经理，执委会委员。2014年11月26日起任大成基金管理有限公司总经理。2015年3月起兼任大成国际资产管理有限公司董事长。2015年10月起兼任大成国际资产管理有限公司董事总经理。

周雄先生，董事，金融学博士，北京大学光华管理学院高级管理人员工商管理硕士（EMBA）。1987年8月至1993年4月，任厦门大学财经系教师；1993年4月至1996年8月，任华夏证券有限公司厦门分公司经理；1996年8月至1999年2月，任人民日报社事业发展局企业管理处副处长；1999年2月至今任职于中泰信托有限责任公司，历任副总裁、总裁，现任中泰信托有限责任公司董事、总裁。

孙学林先生，董事，博士研究生在读。具注册会计师、注册资产评估师资格。现任中国银河投资管理有限公司投资二部董事总经理、投资决策委员会委员。2012年6月起，兼任镇江银河创业投资有限公司总经理、投资决策委员会委员。

黄隽女士，独立董事，经济学博士。现任中国人民大学经济学院教授、博士生导师，中国人民大学经济学院院长助理，中国人民大学艺术品金融研究所副所长。

叶林先生，独立董事，法学博士。现任中国人民大学法学院教授、民商法教研室主任，博士研究生导师、国家社会科学重点基地中国民商事法律科学研究中心兼职教授。

吉敏女士，独立董事，金融学博士，现任东北财经大学讲师，教研室主任，东北财经大学金融学国家级教学团队成员，东北财经大学开发金融研究中心助理研究员，主要从事金融业产业组织结构、银行业竞争方面的研究。参与两项国家自然科学基金、三项国家社科基金、三项教育部人文社会科学一般项目、多项省级创新团队项目，并负责撰写项目总结报告，在国内财经类期刊发表多篇学术论文。

金李先生，独立董事，博士。现任英国牛津大学商学院终身教职正教授（博士生导师）和北京大学光华管理学院讲席教授（博士生导师），金融系联合系主任，院长助理，北京大学国家金融研究中心主任。曾在美国哈佛大学商学院任教十多年，并兼任哈佛大学费正清东亚研究中心执行理事。

监事会：

陈希先生，监事长，中国人民大学经济学专业研究生，高级经济师。2006年被亚洲风险与危机管理协会授予“企业风险管理师”资格。2007年起任中国银河投资管理有限公司董事、常务副总裁（至2012年7月），党委委员；2010年7月起，兼任吉林省国家生物产业创业投资有限责任公司董事长兼总经理、吉林省国家汽车电子产业创业投资有限责任公司董事，2012年6月起，兼任镇江银河创业投资有限公司董事长；2012年7月起至今，任中国银河投资管理有限公司总裁。

蒋卫强先生，职工监事，经济学硕士。1997年7月至1998年10月任杭州益和电脑公司开发部软件工程师。1998年10月至1999年8月任杭州新利电子技术有限公司电子商务部高级程序员。1999年8月加入大成基金管理有限公司，历任信息技术部系统开发员、金融工程部高级工程师、监察稽核部总监助理、信息技术部副总监、风险管理部副总监，现任风险管理部总监。

吴萍女士，职工监事，文学学士。1991年至1992年任中国农业银行深圳分行国际业务部会计。1993年至1998年任日本三和银行深圳分行单证部、信贷部主任。1999年至2009年任普华永道会计师事务所深圳分所审计部经理、高级经理。2010年6月加入大成基金管理有限公司，历任计划财务部高级会计师、总监助理，现任计划财务部副总监。

其他高级管理人员：

杜鹏女士，督察长，研究生学历。1992年–1994年，历任原中国银行陕西省信托咨询公司证券部驻上交所出市代表、上海业务部负责人；1994年–1998年，历任广东省南方金融服务总公司投资基金管理部证券投资部副经理、广东华侨信托投资公司证券总部资产管理部经理；1998年9月参与大成基金管理有限公司的筹建；1999年3月起，任大成基金管理有限公司督察长。2009年3月—2015年7月兼任大成国际资产管理有限公司董事。

钟鸣远先生，副总经理，金融学硕士。曾任国家开发银行深圳分行资金计划部职员，联合证券有限责任公司固定收益部投资经理，泰康人寿保险股份有限公司固定收益部研究员，新华资产管理股份有限公司固定收益部高级投资经理，易方达基金管理有限公司固定收益总部总经理兼固定收益投资部总经理。2014年3月加入大成基金管理有限公司，任公司助理总经理。2014年11月起兼任大成国际资产管理有限公司董事。2015年1月起任大成基金管理有限公司副总经理。

肖剑先生，副总经理，公共管理硕士。曾任深圳市南山区委（政府）办公室副主任，深圳市广聚能源股份有限公司副总经理兼广聚投资控股公司执行董事、总经理，深圳市人民政府国有资产监督管理委员会副处长、处长。2015年1月加入大成基金管理有限公司，任公司副总经理。

温智敏先生，副总经理，哈佛大学法学博士。2000至2002年就职于Hunton & Williams美国及国际律师事务所，2002至2006年任中银国际投行业务副总裁，2006至2009年任香港三山投资公司董事总经理，2009至2014年任标准银行亚洲有限公司董事总经理兼中国投行业务主管。2015年4月加入大成基金管理有限公司，出任首席战略官，2015年8月起任公司副总经理。

周立新先生，副总经理，大学本科学历。曾任新疆精河县党委办公室机要员、新疆精河县团委副书记、新疆精河县人民政府体改委副主任、新疆精河县八家户农场党委书记、新疆博尔塔拉蒙古自治州团委副书记及少工委主任、江苏省铁路发展股份有限公司办公室主任、江苏省铁路发展股份有限公司控股企业及江苏省铁路实业集团有限公司控股企业负责人、中国华润投资控股有限公司燃气战略管理部项目经理。2005年1月加入大成基金管理有限公司，历任客户服务中心总监助理、市场部副总经理、上海分公司副总经理、客户服务部总监兼上海分公司总经理、公司助理总经理，2015年8月起任公司副总经理。

2.现任基金经理

苏秉毅先生，数量经济学硕士，12年证券从业经验。2004年9月至2008年5月就职于华夏基金管理有限公司基金运作部。2008年加入大成基金管理有限公司，历任产品设计师、高级产品设计师、基金经理助理、基金经理。2012年8月28日至2014年1月23日担任大成中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2014年1月24日至2014年2月17日任大成健康产业股票型证券投资基金基金经理。2012年2月9日至2014年9月11日担任深证成长40交易型开放式指数证券投资基金及大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2012年8月24日起任中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2013年1月1日至2015年8月25日兼任大成沪深300指数证券投资基金基金经理。2013年2月7日起任大成中证100交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2015年6月5日起任大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2015年6月29日起担任大成中证互联网金融指数分级证券投资基金基金经理。2016年3月5日起担任大成核心双动力混合型证券投资基金及大成沪深300指数证券投资基金基金经理。现任数量与指数投资部副总监。具有基金从业资格。国籍：中国

3、公司投资决策委员会（投票投资）

公司股票投资决策委员会由9名成员组成，名单如下：

周德昕，股票投资部成长组投资总监，大成财富管理2020生命周期证券投资基金基金经理及大成新锐产业混合型证券投资基金基金经理，股票投资决策委员会委员；李本刚，股票投资部总监，大成内需增长混合型证券投资基金基金经理，大成睿景灵活配置混合型证券投资基金基金经理，股票投资决策委员会委员；王文祥，研究部总监兼任社保基金及机构投资部总监，股票投资决策委员会委员；于雷，交易管理部总监，股票投资决策委员会委员；蒋卫强，风险管理部总监，股票投资决策委员会委员；孙蓓琳，股票投资部混合组投资总监，大成积极成长混合型证券投资基金基金经理，大成灵活配置混合型证券投资基金基金经理，股票投资决策委员会委员；徐彦，大成策略回报混合型证券投资基金基金经理，大成竞争优势混合型证券投资基金基金经理，大成高新技术产业股票型证券投资基金基金经理，景阳领先混合型证券投资基金基金经理，股票投资决策委员会委员；石国武，股票投资部价值组投资总监，大成价值增长证券投资基金基金经理，大成优选混合型证券投资基金（LOF）基金经理，股票投资决策委员会委员；苏秉毅，数量与指数投资部副总监，中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金基金经理，大成中证100交易型开放式指数证券投资基金基金经理，大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金经理，大成中证互联网金融指数分级证券投资基金基金经理，大成沪深300指数证券投资基金，大成核心双动力混合型证券投资基金基金经理，股票投资决策委员会委员，股票投资决策委员会委员。

上述人员之间不存在亲属关系。

二、基金托管人

（一）基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

法定代表人：田国立

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管部门信息披露联系人：王永民

传真：010 66594942

中国银行客服电话：95566

（二）基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工110余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

（三）证券投资基金托管情况

截至2015年9月30日，中国银行已托管401只证券投资基金，其中境内基金375只，QDII基金26只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

（四）托管业务的内部控制制度

中国银行托管业务部风险管理与控制工作是中国银行全面风险控制工作的组成部分，秉承中国银行风险控制理念，坚持“规范运作、稳健经营”的原则。中国银行托管业务部风险控制工作贯穿业务各环节，通过风险识别与评估、风险控制措施设定及制度建设、内外部检查及审计等措施强化托管业务全员、全面、全程的风险管控。

2007年起，中国银行连续聘请外部会计会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获得基于“SAS70”、“AAF01/06”、“ISAE3402”和“SSAE16”等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2014年，中国银行同时获得了基于“ISAE3402”和“SSAE16”双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善，内控措施严密，能够有效保证托管资产的安全。

（五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

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》的相关规定，基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、网下现金及网下股票发售机构

名称：大成基金管理有限公司

住所：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层

办公地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层

法定代表人：刘卓

电话：0755-83183388

传真：0755-83199588

联系人：王为开

公司网址：www.defund.com.cn

大成基金客户服务热线：400-888-5558（免长途固话费）

大成基金管理有限公司现分别在深圳、上海设有投资理财中心：

①大成基金深圳投资理财中心

地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层

联系人：王欢欢、白小雪

电话：0755-83195236/22223555/22223556

传真：0755-83195239/83195235/83195242/83195232

②大成基金上海投资理财中心

地址：上海市黄浦区广东路689号海通证券大厦19层

联系人：徐舲

电话：021-62185377/63513925

传真：021-63513928/62185233

2、申购赎回代理证券公司

①国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路618号

法定代表人：杨德红

客服电话：400-8888-666、95521

网址：www.gtja.com

联系人：芮敏祺、朱雅崴

联系电话：021-38676666

电话：021-38676666

传真：021-38670161

网址：www.gtja.com

②中信证券股份有限公司

注册地址：深圳市深南路7088号招商银行大厦

法定代表人：王东明

客服电话：010-84588888

联系人：顾凌

电话：010-60838696

传真：010-84865560

网址：www.cs.ecitic.com

③中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

法定代表人：陈有安

客服电话：4008-888-888

联系人：宋明

联系电话：010-66568450

传真：010-66568990

网址：www.chinastock.com.cn

④招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层

法定代表人：宫少林

客服电话：95565

联系人：黄婵君

电话：0755-82960167

传真：0755-82943636

网址：www.newone.com.cn

⑤申万宏源证券股份有限公司

通讯地址：上海市徐汇区长乐路989号40层

法定代表人：陈亮

客服电话：95523、4008895523

联系人：曹晔

电话：021-54033888

传真：021-54038844

网址：www.sywg.com

⑥光大证券股份有限公司

办公地址：上海市静安区新闸路1508号

法定代表人：薛峰

客服电话：400-888-8788、95525

联系人：刘晨

电话：021-22169999

传真：021-22169134

网址：www.ebscn.com

⑦西南证券股份有限公司

地址：重庆市渝中区临江支路2号合景国际大厦A幢

法定代表人：余维佳

客服电话：4008096096

联系人：张煜

联系电话：023-63786633

网址：www.swsc.com.cn

3、网上现金发售代理机构

投资者可直接通过具有基金代销业务资格及深圳证券交易所会员资格的证券公司办理网上现金认购业务。详见基金份额发售公告。

本基金募集期结束前获得基金代销资格的深交所会员可通过深交所网上系统办理本基金的网上现金认购业务。

4、基金管理人可根据有关法律法规要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金或变更上述发售代理机构，并及时公告。

（二）登记结算机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

地址：北京市西城区太平桥大街17号

法定代表人：金颖

联系人：刘玉生

电话：（010）66213961

传真：（010）59378907

（三）律师事务所和经办律师

名称：北京市金杜律师事务所

注册地址：北京市朝阳区东三环中路7号财富中心写字楼A座40层

办公地址：北京市朝阳区东三环中路7号财富中心写字楼A座40层

负责人：王玲

电话：0755-22163333

传真：0755-22163390

经办律师：靳庆军、冯艾

联系人：冯艾

（四）会计师事务所和经办注册会计师

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

办公地址：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼

执行事务合伙人：李丹

经办注册会计师：薛竟、俞伟敏

电话：021-23238888

传真：021-23238800

联系人：俞伟敏

四、基金的名称

大成中证100交易型开放式指数证券投资基金

五、基金的类型

基金类型：股票型指数基金

六、基金的运作方式

基金运作方式：开放式

七、基金的投资目标

本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

八、基金的投资范围

本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股。

为更好地实现基金的投资目标，本基金可能会少量投资于国内依法发行上市的非标的指数成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、新股、债券（含中期票据）、货币市场工具、银行存款、权证、股指期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

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。

本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

九、基金的投资策略

本基金为被动式指数基金，采取完全复制法，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合，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。

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品，如权证以及其他与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求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%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过了上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。

①决策依据

有关法律法规、基金合同和标的指数的相关规定是基金管理人运用基金资产的决策依据。

②投资管理体制

本基金实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策委员会负责决定有关指数重大调整的应对决策、其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策；基金经理负责决定日常指数跟踪维护过程中的组合构建、调整决策以及每日申购、赎回清单的编制决策。

③投资程序

研究支持、投资决策、组合构建、交易执行、投资绩效评估、组合维护的有机配合共同构成了本基金的投资管理程序。严格的投资管理程序可以保证投资理念的正确执行，避免重大风险的发生。

①研究支持：数量与指数投资部依托公司整体研究平台，整合外部信息以及券商等外部研究力量的研究成果开展指数跟踪、成份股公司行为等相关信息的搜集与分析、流动性分析、跟踪误差及其归因分析等工作，作为基金投资决策的重要依据。

②投资决策：投资决策委员会依据数量与指数投资部提供的研究报告，定期召开或遇重大事项时召开投资决策会议，决策相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议，每日进行基金投资管理的日常决策。

③组合构建：根据标的指数情况，结合研究支持，基金经理以完全复制标的指数成份股及其权重的方法构建组合。在追求实现基金投资目标的前提下，基金经理将采取适当的方法，以降低买入成本、控制投资风险。

④交易执行：交易管理部负责具体的交易执行，同时履行一线监控的职责。

⑤投资绩效评估：风险管理部定期和不定期对基金进行投资绩效评估，并提供相关报告。绩效评估能够确认组合是否实现了投资预期、组合跟踪误差的来源及投资策略成功与否，基金经理可以据此检讨投资策略，进而调整投资组合。

⑥组合监控与调整：基金经理将跟踪标的指数变动，结合成份股基本面情况、成份股公司行为、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果等，采取适当的跟踪技术对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数。

基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据环境变化和实际需要对上述投资管理程序做出调整，并在更新的招募说明书中公告。

十、基金的业绩比较基准

本基金的标的指数及业绩比较基准为：中证100指数。

中证100指数是从沪深300指数样本股中挑选规模最大的100只股票组成样本股，以综合反映沪深证券市场中最具市场影响力的一批大市值公司的整体状况。

如果指数编制单位变更或停止中证100指数的编制及发布，或中证100指数由其他指数替代，或由于指数编制方法等重大变更导致中证100指数不宜继续作为标的指数，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，在履行适当的程序后，变更本基金的标的指数并相应地变更业绩比较基准，而无须召开基金份额持有人大会。

标的指数更换后，业绩比较基准随之变更，基金管理人可根据需要替换或删除基金名称中与原标的指数相关的商号或字样。

十一、基金的风险收益特征

本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。本基金为指数型基金，被动跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

十二、基金的投资组合报告（截至2015年12月31日）

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。

基金托管人中国银行根据基金合同规定，于2016年2月25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。

本投资组合报告所载数据截至2015年12月31日，本报告中所列财务数据未经审计。

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	54,326,433.59	98.74
	其中：股票	54,326,433.59	98.74
2	固定收益投资	-	0.00
	其中：债券	-	0.00
	资产支持证券	-	0.00
3	贵金属投资	-	0.00
4	金融衍生品投资	-	0.00
5	买入返售金融资产	-	0.00
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
6	银行存款和结算备付金合计	680,714.28	1.24
7	其他资产	10,603.68	0.02
8	合计	55,017,751.55	100.00

2.报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	0.00
B	采掘业	1,716,963.79	3.13
C	制造业	14,553,163.86	26.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,173,319.88	3.97
E	建筑业	2,636,092.53	4.81
F	批发和零售业	549,311.45	1.00
G	交通运输、仓储和邮政业	1,434,564.64	2.62
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,778,371.38	3.24
J	金融业	26,029,813.96	47.49
K	房地产业	2,771,887.30	5.06
L	租赁和商务服务业	-	0.00
M	科学研究和技术服务业	-	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	298,944.80	0.55
O	居民服务、修理和其他服务业	-	0.00
P	教育	-	0.00
Q	卫生和社会工作	-	0.00
R	文化、体育和娱乐业	384,000.00	0.70
S	综合	-	0.00
	合计	54,326,433.59	99.12

2.2报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资。

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

3.1报告期末指数投资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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	100,088	3,603,168.00	6.57
2	600016	民生银行	272,738	2,629,194.32	4.80
3	601166	兴业银行	122,878	2,097,527.46	3.83
4	000002	万 科A	75,142	1,835,719.06	3.35
5	600036	招商银行	95,261	1,713,745.39	3.13
6	600000	浦发银行	86,003	1,571,274.81	2.87
7	600030	中信证券	72,499	1,402,855.65	2.56
8	601328	交通银行	217,085	1,398,027.40	2.55
9	600837	海通证券	74,679	1,181,421.78	2.16
10	601288	农业银行	352,333	1,138,035.59	2.08

3.2报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资。

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.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

6.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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支持证券。

7.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

9.报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

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。

9.2本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

10.报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

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。

10.3本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

11.投资组合报告附注

11.1本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

本基金投资的前十名证券之一中信证券，2015年1月16日因“涉嫌为到期融资融券合约展期，受过处理仍未改正，且涉及客户数量较多”被中国证券监督管理委员会处罚“暂停新开融资融券客户信用账户3个月”。2015年11月26日因“公司涉嫌违反《证券公司监督管理条例》相关规定”被中国证监会立案调查。本基金认为，对中信证券的处罚及调查不会对其投资价值构成实质性负面影响。

本基金投资的前十名证券之一海通证券，2015年1月16日因“涉嫌为到期融资融券合约展期，受过处理仍未改正，且涉及客户数量较多”被中国证券监督管理委员会处罚“暂停新开融资融券客户信用账户3个月”。2015年8月24日因“公司涉嫌未按规定审查、了解客户身份等违法违规行为”被中国证监会立案调查。2015年9月10日因“涉嫌未按规定审查、了解客户真实身份违法违规案”收到中国证监会行政处罚事先告知书（处罚字【2015】73号）。2015年11月26日因“公司涉嫌违反《证券公司监督管理条例》相关规定”被中国证监会立案调查。本基金认为，对海通证券的处罚及调查不会对其投资价值构成实质性负面影响。

11.2本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

11.3其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	10,400.66
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	203.02
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,603.68

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处于转股期的可转换债券。

11.5.报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

11.5.1报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000002	万 科A	1,835,719.06	3.35	重大事项

11.5.2报告期末积极投资前五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积极投资。

11.6投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

十三、基金业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉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。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

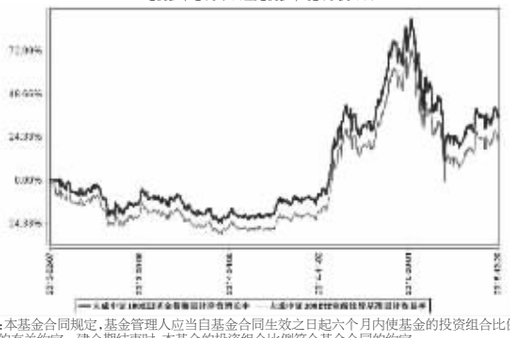
（一）自基金合同生效日（为2013年2月7日），至2015年12月31日基金合同生效以来完整会计年度的基金份额净值增长率投资业绩以及与同期业绩比较基准收益率的比较：

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
2013.02.07-2013.12.31	-14.00%	1.37%	-21.39%	1.47%	7.39%	-0.10%
2014.01.01-2014.12.31	60.23%	1.31%	59.64%	1.33%	0.59%	-0.02%
2015.01.01-2015.12.31	-1.31%	2.43%	-1.52%	2.47%	0.21%	-0.04%
2013.02.07-2015.12.31	36.00%	1.79%	23.60%	1.84%	12.40%	-0.05%

（二）自基金合同生效以来基金份额增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较：

大成中证100ETF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

（2013年2月7日至2015年12月31日）



注：本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

十四、费用概览

（一）基金费用的种类

1、基金管理人的管理费；

2、基金托管人的托管费；

3、标的指数许可使用费；

4、因基金的证券交易或结算而产生的费用（包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等）；

5、基金合同生效以后的信息披露费用；

6、基金份额持有人大会费用（含公证费）；

7、基金合同生效以后的会计师费和律师费；

8、基金资产的资金汇划费用；

9、基金上市费及年费；

10、按照国家有关法律法规规定和基金合同约定可以列入的其他费用。

（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

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的0.5%年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的0.5%年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.5%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

2、基金托管人的基金托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的0.1%年费率计提。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.1%年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.1%÷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

基金托管费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

3、基金合同生效后的指数许可使用费

本基金按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数许可使用费计提方法支付指数许可使用费。其中，基金合同生效前的许可使用固定费不列入基金费用。

在通常情况下，指数使用许可费按前一日基金资产净值的0.03%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.03%÷当年天数

H 为每日计提的指数使用许可费

E 为前一日的基金资产净值

基金合同生效后的指数许可使用费按日计提，按季支付。根据基金管理人与标的指供应商签订的相应指数许可协议的规定，标的指数许可使用费的收取下限为每季（自然季度）人民币50,000元，当季标的指数许可使用费不足50,000元的，按照50,000元支付。由基金管理人向基金托管人发送基金标的指数许可使用费划付指令，经基金托管人复核后于每年1月、4月、7月、10月的前10个工作日内将上季度标的指数许可使用费从基金财产中一次性支付给标的指数许可方。

如果指数使用许可协议约定的指数许可使用费的计算方法、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指数使用费。基金管理人应在招募说明书及其更新中披露基金最新适用的方法。

4、本条第（一）款第4至第10项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入或摊入当期基金费用。

（三）不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金资产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他不从基金资产中支