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

（2018年2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
二〇一八年九月

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基本未来表现。

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2018年8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2018年6月30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50%）、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%）三家公司。

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。曾任银丰共青团哈尔滨市委、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。

崔天鹏先生，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；2014年10月，任大成基金管理有限公司公司董事；2015年1月起任大成基金管理有限公司副董事长。

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，国家“千人计划”专家。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；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。

周璇先生，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），上海市黄浦区政协委员。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2018年2月任职于中泰信托有限责任公司，历任副总裁、总裁，现为中泰信托有限责任公司董事。

孙学林先生，董事，硕士研究生。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资委委员、总裁助理，兼任投资二部总经理兼行政负责人、投资决策委员会副主任。2012年4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。

窦勇女士，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、二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，现任英国中非大学商学院华侨崇正教授（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：

许闯平先生，监事会主席，中国人民大学国民经济学博士。1987年至2004年先后任中国人民银行国际司处长，东京代表处代表，研究局调研员，金融稳定局体改处处长；2005年6月至2008年1月任中央汇金投资有限责任公司建行股权管理部主任；2005年8月至2016年11月任中国银河金融控股有限责任公司董事，副总经理，党委委员；2007年2月至2016年11月任中国银河投资管理有限公司董事长、总裁，党委书记；2010年6月至2014年3月兼任北京银河吉星创业投资有限责任公司董事长；2007年1月至2015年6月任中国银河证券股份有限公司董事；2014年1月至2017年6月任银河基金管理有限公司党委书记；2014年3月至2018年1月任银河基金管理有限公司董事长（至2017年11月）及法定代表人；2018年3月加入大成基金管理有限公司，任监事会主席。

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、风险管理部总监，现任信息技术部总监。

吴萍女士，职工监事，文学学士，中国注册会计师协会非执业会员。曾任职于中国农业银行深圳分行、日本三和银行深圳分行、普华永道会计师事务所深圳分所。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。2016年10月起兼任大成国际资产管理有限公司董事。

其他高级管理人员：

肖剑先生，副总经理，哈佛大学公共管理硕士。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。2014年11月加入大成基金管理有限公司，2015年1月起任公司副总经理。

崔智敬先生，副总经理，哈佛大学法学博士，曾任职于美国Hunton & Williams律师事务所纽约州执业律师。中银国际投行业务副总裁，香港三山投资公司董事总经理，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，任首席战略官，2015年8月起任公司副总经理。2016年10月起兼任大成国际资产管理有限公司董事。

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、新疆精河县人民广场路党委书记、新疆博尔塔拉蒙古自治州团委副书记及少工委主任、江苏省铁路发展投资有限公司办公室主任、江苏省铁路发展投资有限公司控股企业及江苏省铁路运输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。

谢颖民先生，副总经理，哈佛大学公共行政管理硕士，曾任财政部世界银行司科长，世界银行中国执基办技术顾问，财政部办公厅处长，全国社保基金理事会办公厅处长、海外投资部副主任。2016年7月加入大成基金管理有限公司，2017年2月起任公司副总经理。

姚余栋先生，副总经理，英国剑桥大学经济学博士。曾任职于前国家经贸委企业司发展部处长、美国花旗银行伦敦分行。曾任世界银行咨询顾问，国际货币基金组织国际货币市场部和非洲部经济学家，原英龙汇省经商局副局长，黑龙江省商务厅副厅长，中国人民银行货币政策二司副司长兼处长，中国人民银行金融研究所所长。2016年9月加入大成基金管理有限公司，任首席经济学家，2017年2月起任公司副总经理。

陈翔凯先生，副总经理，香港中文大学工商管理硕士。曾任职于广发证券海南分公司，平安保险集团公司，平安保险集团公司资产保险有限公司高级投资经理，国投瑞银基金管理有限公司固定收益部总监，招商证券资产管理有限公司副总经理。2016年11月加入大成基金管理有限公司，2017年2月起任公司副总经理。

赵冰女士，复旦长江商学院工商管理硕士，曾供职于中国证券业协会资格管理部、专业联络部、基金公司总部，曾任中国证券业协会分析师委员会委员、基金销售专业委员会委员。曾参与基金业协会等备组的筹备工作。曾先后任中国证券投资基金业协会投教与媒体公关部负责人、理财及服务机构部负责人。2017年7月加入大成基金管理有限公司，2017年8月起任公司督察长。

2.现任基金经理

吉清辉，经济学硕士。证券从业年限14年。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7月21日担任大成融通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日担任深证成指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10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2016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4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。2018年6月26日起担任大成景恒混合型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.公司量化投资决策委员会

公司量化投资决策委员会由6名成员组成，设量化投资决策委员会主席1名，其他委员5名。名单如下：

黎新平，基金经理，数量与指数投资部总监，量化投资决策委员会主席；李栋，期货投资部总监，量化投资决策委员会委员；苏末毅，基金经理，数量与指数投资部副总监，量化投资决策委员会委员；冉凌浩，基金经理，量化投资决策委员会委员；夏高，基金经理，量化投资决策委员会委员，张钟玉，基金经理，量化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：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰陆拾玖万叁仟贰佰肆拾壹元整

法定代表人：陈四清

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2018年6月30日，中国银行已托管674只证券投资基金，其中境内基金638只，QDII基金36只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF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）托管业务的内控控制制度

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。2017年，中国银行继续获得了基于“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

一、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：肖剑

公司网址：www.dcfund.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：杨成卫、史起帅、白小雪

电话：0755－22228523/22223177/22223555

传真：0755－83196235/83195242/83195232

邮编：518040

二、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

办公地址：上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼

法定代表人：杨德红

客服电话：95521

联系人：冯敏祺、朱雅崴

联系电话：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：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座

法定代表人：张佑君

客服电话：010－84588888

联系人：臧凌

电话：010－60838696

传真：010－84865560

网址：www.cs.ecitic.com

3.中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区香港东路195号9层

办公地址：青岛市东海西路28号

法定代表人：杨宝林

客服电话：95548

联系人：吴忠超

电话：0532－85022326

传真：0532－85022605

网址：www.xsw.cn

4.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：宋卫刚

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

5.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

6.申万宏源证券有限公司

通讯地址：上海市徐汇区长乐路989号45层

法定代表人：李梅

客服电话：95523、4008895523

联系人：曹晔

电话：021－54033888

传真：021－54038844

网址：www.swyg.com

7.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

8.西南证券股份有限公司

办公地址：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

电话：023－63786633

网址：www.swsc.com.cn

9.上海证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区福山路500号城建国际中心26楼

法定代表人：李俊杰

客服电话：021－962518、4008918918

联系人：汪莹华

电话：021－53519888

传真：021－63608830

网址：www.962518.com

三、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。

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：周明

联系人：赵亦清

电话：（010）50938782

传真：（010）50938907

（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：崔庆军、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：中国上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

办公地址：上海市黄浦区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼

执行事务合伙人：李丹

电话：021－23238189

联系人：俞伟敏

经办注册会计师：张振波、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：交易型开放式

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审标的指数成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）。前提，合中期票据、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，或因其他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。

本基金可投资标的指数以外的非成份股。非成份股主要包括标的指数成份股、备选成份股构成的指数成份股，以获得更高的投资收益。

本基金可参与转融通证券出借业务，以提高基金资产的使用效率和收益。

本基金可投资于国内依法发行上市的债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、可分离交易可转债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、中期票据）、货币市场工具、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他品种。

基金参与股指期货交易，应根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，对冲现货市场风险，提高投资效率，严格控制投资组合的跟踪误差。

基金参与国债期货交易，应根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有效管理基金的利率风险，提高投资效率，严格控制投资组合的风险。

基金参与股票期权交易，应根据风险管理的原则，以有利于对冲基金投资组合的风险为原则，谨慎投资，严格控制投资组合的风险。

十、投资组合比例

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。

十一、基金的投资组合报告

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审标的指数成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）。前提，合中期票据、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。

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审标的指数成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）。前提，合中期票据、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）。

十二、基金的投资组合报告

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2018年9月4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2018年6月30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	51,176,398.76	97.68
	其中：股票	51,176,398.76	97.68
2	基金投资	–	0.00
3	固定收益投资	–	0.00
	其中：债券	–	0.00
	资产支持证券	–	0.00
4	贵金属投资	–	0.00
5	金融衍生品投资	–	0.00
6	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
7	银行存款和结算备付金合计	1,212,900.82	2.32
8	其他资产	1,163.11	0.00
9	合计	52,390,462.69	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境内股票投资组合

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	采矿业	1,738,926.14	3.33
C	制造业	18,764,430.26	35.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,538,507.26	2.95
E	建筑业	1,854,649.24	3.55
F	批发和零售业	568,397.28	1.09
G	交通运输、仓储和邮政业	1,401,035.02	2.68
H	住宿和餐饮业	–	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	853,210.18	1.63
J	金融业	21,327,543.73	40.85
K	房地产业	2,365,615.73	4.53
L	租赁和商务服务业	463,723.92	0.89
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	–	0.00
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	–	0.00
S	综合	–	0.00
	合计	50,876,038.76	97.44

2.2报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	采矿业	1,738,926.14	3.33
C	制造业	18,764,430.26	35.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,538,507.26	2.95
E	建筑业	1,854,649.24	3.55
F	批发和零售业	568,397.28	1.09
G	交通运输、仓储和邮政业	1,401,035.02	2.68
H	住宿和餐饮业	–	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	853,210.18	1.63
J	金融业	21,327,543.73	40.85
K	房地产业	2,365,615.73	4.53
L	租赁和商务服务业	463,723.92	0.89
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	–	0.00
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	176,936.00	0.34
S	综合	–	0.00
	合计	300,360.00	0.58

2.3报告期末行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

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	77,689	4,550,963.04	8.72
2	600519	贵州茅台	3,705	2,710,059.30	5.19
3	600036	招商银行	77,761	2,056,000.84	3.94
4	000333	美的集团	33,017	1,724,147.74	3.30
5	000651	格力电器	34,484	1,625,920.60	3.11
6	601166	兴业银行	96,478	1,389,283.20	2.66
7	601328	交通银行	234,585	1,346,517.90	2.58
8	600887	伊利股份	44,842	1,251,091.80	2.40
9	600016	民生银行	178,038	1,246,266.00	2.39
10	600276	恒瑞医药	15,827	1,199,053.52	2.30

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

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	002739	万达电影	3,400	176,936.00	0.34
2	600485	信威集团	11,600	123,424.00	0.24

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投资。

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投资。

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

本基金本报告期末未投资股指期货。

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未出现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。

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	958.47
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	204.64
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	1,163.11

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

本基金本报告期末指数投资前十名股票中无流通受限情况。

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

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	002739	万达电影	176,936.00	0.34	临时停牌
2	600485	信威集团	123,424.00	0.24	临时停牌

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

基金管理人承诺以恪尽职守，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。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2018年6月30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	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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
自基金合同生效起至2017年12月31日	1.5687%	0.0013%	0.5326%	0.0000%	1.0261%	0.0013%
2018年1月1日至2018年6月30日	2.0970%	0.0013%	0.6695%	0.0000%	1.4275%	0.0013%
自基金合同生效起至2018年6月30日	3.6894%	0.0013%	1.2021%	0.0000%	2.4863%	0.0013%

（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2018年6月30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外算而产生的费用（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。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、基金份额持有人的基金托管费

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。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、基金申购费及赎回费

本基金在申购时收取申购费用，申购费用不计入基金资产，主要用于基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

本基金在赎回时收取赎回费用，赎回费用扣除赎回费用后余额归基金资产所有。

本基金对通过基金管理人的网上交易系统申购本基金的养老金客户实施费率优惠，降低申购费率。

本基金的申购费率、赎回费率和赎回费用归基金资产所有的比例如下表所示：

申购金额（M）（含申购费）	申购费率
M＜100万元	1.50%
100万元≤M＜500万元	1.00%
500万元≤M＜1000万元	0.50%
M≥1000万元	1000元/笔

赎回金额（N）（含赎回费）	赎回费率	赎回费用归基金资产的比例
N＜100万元	0.50%	25%
100万元≤N＜500万元	0.30%	25%
500万元≤N＜1000万元	0.10%	25%
N≥1000万元	1000元/笔	25%

4、基金第（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财产的损失；

基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、（基金合同）生效前的相关费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（四）基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

（五）与基金销售有关的费用

1、本基金的基金份额净值保持为人民币1.00元。

2、本基金在一般情况下不收取申购费用和赎回费用，但在满足相关流动性风险管理要求的前提下，当基金持有的现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计低于5%且偏离度为负时，为确保基金平稳运作，避免诱发系统性风险，对当日单个基金份额持有人申请赎回基金份额超过基金总份额的1%以上的赎回申请（即超过基金总份额1%以上的部分）征收1%的强制赎回费用，并将上述赎回费用全额计入基金资产。基金管理人与基金托管人协商确认上述临时调整费率的情形除外。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投