

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

(2019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
二〇一九年三月
重 告 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。

基金管理人承诺本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书说明书中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。

本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。

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2019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2018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：人民币亿元
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：0755-83199568
联系人：肖剑

（二）主要人员情况
1. 董事会成员：
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1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有限公司；1997年5月至2015年1月，先后任中大证券有限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，在大成基金管理有限公司董事；2015年1月起兼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。曾任华马德(CKPMG)法务诉讼部资深律师、金融部资深咨询师，以及SLCG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月兼任大成国际资产管理有限公司董事长。

吴庆斌先生，董事，清华大学法学与文学双学士。先后任职业于西南证券飞虎网、北京国际信托有限责任公司、广联(南宁)投资股份有限公司等机构。2012年7月至今，任广联(南宁)投资股份有限公司董事长；2012年任任职于中泰信托有限责任公司，2013年6月至今，任中泰信托有限责任公司董事长。

孙林先生，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党委委员、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6月起，兼任镇江银河创业板投资有限公司总经理、投资决策委员会委员。

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院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，主要从事金融企业组织结构、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、多项省部级创新团队项目，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授和正教授（博士生导师）和北京大学光华管理学院席教授（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。曾在国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。

2. 监事会成员：

许国平先生，监事会主席，中国人民大学国民经济学博士。1987年至2004年先先后任中国银行国际司处长、东证代表处研究员，基金管理调研员，金融稳定局处助理；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处长；2005年8月至2011年6月任中国银行金融控股有限公司董事、副总经济师、党委书记；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；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，任监事长。

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、金融产品高级工程师、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。曾任任职于中国农业银行深圳分行、平安银行深圳分行、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。

高德管理人员情况：
刘卓先生，董事长。简历同上。
罗登攀先生，总经理。简历同上。

肖剑先生，副经理，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，深圳市聚能投资有限公司副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月起任公司副经理。

温智敏先生，副总经理，哈佛法学博士。曾任职于美国 Hunton & Williams国际律师事务所纽约州执业律师、中银国际投行债务总裁助理、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。

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、新疆精河县团委副科级书记、新疆精河县人民政府体改委副主任、新疆精河县八户农场党委副书记、新疆精河县团委副书记。2016年9月加入大成基金管理有限公司，任客户服务中心总监助理、市场部副总监，风险管理部总监，现任信息技术部总监。

谭晖先生，副经理，哈佛法学公共行政管理硕士。曾任世界银行中国政策司科长、世界银行中国执事局顾问，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月起任公司副经理。

姚余称先生，副总经理，英国剑桥大学经济学博士。曾任职于原国家经贸委企业司、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资本市场部和非洲经济部经济学家，原黑龙江省政府副厅长，黑龙江省商务厅副厅长，中国人行货币政策司副巡视员，中国人民银行货币政策司副司长，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，任首席战略官，2017年2月起任公司副经理。

陈鹏凯先生，副总经理，清华大学工商管理硕士。曾任任职于广发证券海南分公司，平安保险集团总公司。曾任华安财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裁。2016年11月加入大成基金管理有限公司，2017年2月起任公司副经理。

赵冰女士，督察长，清华大学工商管理硕士。曾供职于中国证券业协会资格管理部、专业联络部、基金公司会员，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。曾参与基金业协会筹备组的筹备工作。曾先后任中国证券投资基金业协会投教与媒体公关负责人，理财及服务机构负责人。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：

苏秉毅，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，曾担任规划发展部高级产品设计师、数量与指数投资部基金经理，现任数量与指数投资部副总监。2012年8月23日至2014年1月23日任大成健康主题股票型开放式指数证券投资基金基金经理接任基金经理。2014年1月23日至2014年4月17日任大成健康产业股票型开放式指数证券投资基金基金经理接任基金经理。2014年4月17日至2014年5月25日任大成沪深300指数证券投资基金基金经理接任基金经理。2015年3月20日起任大成深证成份指数型开放式指数证券投资基金基金经理接任基金经理。2015年6月29日起任大成恒指混合型证券投资基金基金经理接任基金经理。2016年3月4日起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接任基金经理。2018年6月26日起任大成景恒混合型证券投资基金基金经理接任基金经理。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；李绍，期货投资部总监，量化投资决策委员会委员；苏秉毅，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；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

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
首次登记注册日期：1983年10月31日
注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整
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) 基金托管人及主要人员情况

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。为客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、境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、一对二）、社保基金、保险资金、QFII、ROFI、ODII、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、股权投资基金、私募基金、基金托管等十类齐全、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) 证券投资基金管理情况

截至2018年12月31日，中国银行已托管700只证券投资基金，其中境内基金662只，QDII基金83只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、FOF等多类型基金，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

中国银行托管业务风险管理与控制工作是中国银行全面风险管理工作的组成部分，秉承中国银行风险管理理念，坚持“规范运作、稳健经营”的原则。中国银行托管业务风险管理与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、内部风险管理与控制、外部风险管理与控制、内部审计及风险管理与控制、外部风险管理与控制、内部控制审计报告、中国银行托管业务内部控制完善、内控措施严密，能够有效保证托管财产的安全。

(五) 托管人对管理人运作监督进行监督的方法

截至2018年12月31日，中国银行已托管700只证券投资基金，其中境内基金662只，QDII基金83只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、FOF等多类型基金，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。

(六) 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基金投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。

当预期成份股发生变动和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金份额的申购赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况下导致流动性不足时，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。

本基金可投资股票期货和其他中国证监会允许的衍生金融产品，如权证以及法律法规或中国证监会允许的衍生金融产品，如权证、股指期货等，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。

十、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

无。

10.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

10.3本期国债期货投资评价

无。

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。

1. 本基金投资的前十名证券之一兴业银行（601166.SH）的发行主体兴业银行股份有限公司于2018年3月19日因重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监银罚字〔2018〕1号）。兴业银行于2018年3月26日因未按照规定履行客户身份识别义务等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监银罚字〔2018〕1号）。兴业银行于2018年3月26日因未按照规定履行客户身份识别义务等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监银罚字〔2018〕1号）。兴业银行于2018年3月26日因未按照规定履行客户身份识别义务等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监银罚字〔2018〕1号）。

2. 本基金投资的前十名证券之一交通银行（601328.SH）的发行主体交通银行股份有限公司于2018年3月26日因未按照规定履行客户身份识别义务等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监银罚字〔2018〕1号）。交通银行于2018年3月26日因未按照规定履行客户身份识别义务等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监银罚字〔2018〕1号）。

3. 本基金投资的前十名证券之一民生银行（600016.SH）的发行主体中国民生银行股份有限公司于2018年3月19日因贷款业务严重违反审慎经营规则等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监银罚字〔2018〕1号）。民生银行于2018年3月19日因不良贷款率未达监管要求，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监银罚字〔2018〕1号）。

4. 本基金投资的前十名证券之一光大银行（600365.SH）的发行主体招商银行股份有限公司于2019年2月12日因违规批贷批借让个人为借款主体的不良贷款等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银监罚决字〔2018〕1号）。招商银行于2019年2月12日因违规批贷批借让个人为借款主体的不良贷款等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银监罚决字〔2018〕1号）。

5. 本基金投资的前十名证券之一工商银行（601398.SH）的发行主体工商银行股份有限公司于2019年2月12日因违规批贷批借让个人为借款主体的不良贷款等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银监罚决字〔2018〕1号）。工商银行于2019年2月12日因违规批贷批借让个人为借款主体的不良贷款等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银监罚决字〔2018〕1号）。

6. 本基金投资的前十名证券之一中国银行（601988.SH）的发行主体中国银行股份有限公司于2019年2月12日因违规批贷批借让个人为借款主体的不良贷款等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银监罚决字〔2018〕1号）。中国银行于2019年2月12日因违规批贷批借让个人为借款主体的不良贷款等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银监罚决字〔2018〕1号）。

7. 本基金投资的前十名证券之一建设银行（601939.SH）的发行主体建设银行股份有限公司于2019年2月12日因违规批贷批借让个人为借款主体的不良贷款等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银监罚决字〔2018〕1号）。建设银行于2019年2月12日因违规批贷批借让个人为借款主体的不良贷款等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银监罚决字〔2018〕1号）。

8. 本基金投资的前十名证券之一邮储银行（601998.SH）的发行主体中国邮政储蓄银行股份有限公司于2019年2月12日因违规批贷批借让个人为借款主体的不良贷款等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银监罚决字〔2018〕1号）。中国邮政储蓄银行于2019年2月12日因违规批贷批借让个人为借款主体的不良贷款等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银监罚决字〔2018〕1号）。

9. 本基金投资的前十名证券之一平安银行（000001.SZ）的发行主体平安银行股份有限公司于2019年2月12日因违规批贷批借让个人为借款主体的不良贷款等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银监罚决字〔2018〕1号）。平安银行于2019年2月12日因违规批贷批借让个人为借款主体的不良贷款等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银监罚决字〔2018〕1号）。

10. 本基金投资的前十名证券之一招商银行（600036.SH）的发行主体招商银行股份有限公司于2019年2月12日因违规批贷批借让个人为借款主体的不良贷款等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银监罚决字〔2018〕1号）。招商银行于2019年2月12日因违规批贷批借让个人为借款主体的不良贷款等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银监罚决字〔2018〕1号）。

11. 本基金投资的前十名证券之一浦发银行（600000.SH）的发行主体上海浦东发展银行股份有限公司于2019年2月12日因违规批贷批借让个人为借款主体的不良贷款等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银监罚决字〔2018〕1号）。上海浦东发展银行于2019年2月12日因违规批贷批借让个人为借款主体的不良贷款等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银监罚决字〔2018〕1号）。

12. 本基金投资的前十名证券之一民生银行（600016.SH）的发行主体