

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
报告出具日期:2015年10月24日

§ 1 基金提示
基金管理人的董事会及高级管理人员根据本基金所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其中的内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本基金于2015年10月22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，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺不从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动。

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该基金的招募说明书。

本报告期财务数据未经审计。

§ 2 基金产品概况

基金简称	大成中证100ETF
场内简称	100ETF
交易代码	159023
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013年2月7日
报告期末基金份额总额	48,288,812.00份
投资目标	本基金为交易型开放式基金，采取完全复制法，即按照标的指数的成份股构成及其权重进行被动地股票投资，以使得基金净值增长率与标的指数收益率相拟合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应的调整。
投资策略	当预期标的股发生调整或成份股发生增发、缩股等行为时，或因基金申购赎回等导致基金资产规模变化时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当调整和跟踪，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。
业绩比较基准	中证100指数
风险收益特征	本基金为股票型基金，风险收益特征与股票型基金相似，具有较高风险。
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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

	单位:人民币元	报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-	-0.231,640.20
2.本期利润	-	-26,142,796.00
3.加权平均基金份额本期利润	-	-0.4020
4.期末基金份额净值	57.875 51,650.00	
5.期末基金资产净值	1,199.00	

注:1. 所列数据不包括持有人交易费用，计算买入和卖出股票时的印花税、佣金、过户费和转托管费等交易费用，基金利润率为本期利润除以期末基金资产净值。

2. 本期利润不包括持有人认购或申购基金产生的利息收入，投资收益减去利息收入后相关费用的余额，本期利润率为本期利润除以期末基金资产净值。

3.2.1 本基金基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金合同约定，基金管理人应自基金合同生效之日起六个月内将基金的资产组合比例符合基金合同的有关约定。建仓期结束后，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

注:本基金无基金经理。

4.2 对报告期内基金运作的总体评价

本基金在报告期内运作正常，没有出现违法违规行为。

4.3 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

本基金在报告期内运作正常，没有出现违法违规行为。

4.4 管理人对基金产品的未来业绩做出的预测

本基金在报告期内运作正常，没有出现违法违规行为。

4.5 管理人对基金估值政策的描述

本基金在报告期内运作正常，没有出现违法违规行为。

4.6 管理人对会计政策、审计政策和会计差错的处理

本基金在报告期内运作正常，没有出现违法违规行为。

4.7 管理人对公平交易制度执行情况的说明

本基金在报告期内运作正常，没有出现违法违规行为。

4.8 管理人对风险准备金使用及保管情况的说明

本基金在报告期内运作正常，没有出现违法违规行为。

4.9 管理人对关联交易的说明

本基金在报告期内运作正常，没有出现违法违规行为。

4.10 管理人对证券投资的研究方法的说明

本基金在报告期内运作正常，没有出现违法违规行为。

4.11 管理人对基金收益分配政策的说明

本基金在报告期内运作正常，没有出现违法违规行为。

4.12 管理人对会计师事务所的说明

本基金在报告期内运作正常，没有出现违法违规行为。

4.13 管理人对基金托管人的说明

本基金在报告期内运作正常，没有出现违法违规行为。

4.14 管理人对报告期基金费用计提及支付情况的说明

本基金在报告期内运作正常，没有出现违法违规行为。

4.15 管理人对基金收益分配政策的说明

本基金在报告期内运作正常，没有出现违法违规行为。

4.16 管理人对基金销售服务政策的说明

本基金在报告期内运作正常，没有出现违法违规行为。

4.17 管理人对基金客户服务政策的说明

本基金在报告期内运作正常，没有出现违法违规行为。

4.18 管理人对基金投诉的说明

本基金在报告期内运作正常，没有出现违法违规行为。

4.19 管理人对其他重要事项的说明

本基金在报告期内运作正常，没有出现违法违规行为。

4.20 管理人对基金合同修改的说明

本基金在报告期内运作正常，没有出现违法违规行为。

4.21 管理人对基金募集的说明

本基金在报告期内运作正常，没有出现违法违规行为。

4.22 管理人对基金托管的说明

本基金在报告期内运作正常，没有出现违法违规行为。

4.23 管理人对基金审计的说明

本基金在报告期内运作正常，没有出现违法违规行为。

4.24 管理人对基金托管人选择的说明

本基金在报告期内运作正常，没有出现违法违规行为。

4.25 管理人对基金代销的说明

本基金在报告期内运作正常，没有出现违法违规行为。

4.26 管理人对基金上市交易的说明

本基金在报告期内运作正常，没有出现违法违规行为。

4.27 管理人对基金交易的说明

本基金在报告期内运作正常，没有出现违法违规行为。

4.28 管理人对基金费用的说明

本基金在报告期内运作正常，没有出现违法违规行为。

4.29 管理人对基金收益分配的说明

本基金在报告期内运作正常，没有出现违法违规行为。

4.30 管理人对基金的限售安排的说明

本基金在报告期内运作正常，没有出现违法违规行为。

4.31 管理人对基金的流动性风险的说明

本基金在报告期内运作正常，没有出现违法违规行为。

4.32 管理人对基金的风险揭示

本基金在报告期内运作正常，没有出现违法违规行为。

4.33 管理人对基金的合规性说明

本基金在报告期内运作正常，没有出现违法违规行为。

4.34 管理人对基金的客户服务的说明

本基金在报告期内运作正常，没有出现违法违规行为。

4.35 管理人对基金的限售安排的说明

本基金在报告期内运作正常，没有出现违法违规行为。

4.36 管理人对基金的流动性风险的说明

本基金在报告期内运作正常，没有出现违法违规行为。

4.37 管理人对基金的风险揭示

本基金在报告期内运作正常，没有出现违法违规行为。

4.38 管理人对基金的合规性说明

本基金在报告期内运作正常，没有出现违法违规行为。

4.39 管理人对基金的客户服务的说明

本基金在报告期内运作正常，没有出现违法违规行为。

4.40 管理人对基金的限售安排的说明

本基金在报告期内运作正常，没有出现违法违规行为。

4.41 管理人对基金的流动性风险的说明

本基金在报告期内运作正常，没有出现违法违规行为。

4.42 管理人对基金的风险揭示

本基金在报告期内运作正常，没有出现违法违规行为。

4.43 管理人对基金的合规性说明

本基金在报告期内运作正常，没有出现违法违规行为。

4.44 管理人对基金的客户服务的说明

本基金在报告期内运作正常，没有出现违法违规行为。

4.45 管理人对基金的限售安排的说明

本基金在报告期内运作正常，没有出现违法违规行为。

4.46 管理人对基金的流动性风险的说明

本基金在报告期内运作正常，没有出现违法违规行为。

4.47 管理人对基金的风险揭示

本基金在报告期内运作正常，没有出现违法违规行为。

4.48 管理人对基金的合规性说明

本基金在报告期内运作正常，没有出现违法违规行为。

4.49 管理人对基金的客户服务的说明

本基金在报告期内运作正常，没有出现违法违规行为。

4.50 管理人对基金的限售安排的说明

本基金在报告期内运作正常，没有出现违法违规行为。

4.51 管理人对基金的流动性风险的说明

本基金在报告期内运作正常，没有出现违法违规行为。

4.52 管理人对基金的风险揭示

本基金在报告期内运作正常，没有出现违法违规行为。

4.53 管理人对基金的合规性说明

本基金在报告期内运作正常，没有出现违法违规行为。

4.54 管理人对基金的客户服务的说明

本基金在报告期内运作正常，没有出现违法违规行为。

4.55 管理人对基金的限售安排的说明

本基金在报告期内运作正常，没有出现违法违规行为。

4.56 管理人对基金的流动性风险的说明

本基金在报告期内运作正常，没有出现违法违规行为。

4.57 管理人对基金的风险揭示

本基金在报告期内运作正常，没有出现违法违规行为。

4.58 管理人对基金的合规性说明

本基金在报告期内运作正常，没有出现违法违规行为。

4.59 管理人对基金的客户服务的说明

本基金在报告期内运作正常，没有出现违法违规行为。

4.60 管理人对基金的限售安排的说明

本基金在报告期内运作正常，没有出现违法违规行为。

4.61 管理人对基金的流动性风险的说明

本基金在报告期内运作正常，没有出现违法违规行为。

4.62 管理人对基金的风险揭示

本基金在报告期内运作正常，没有出现违法违规行为。

4.63 管理人对基金的合规性说明