

大成中证100交易型开放式指数证券投资基金

[2016] 第一季度报告

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
报告日期:2016年4月22日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事声明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责任。
基金托管人声明本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、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。投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2016年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金名称	大成中证100ETF
场内简称	100ETP
交易代码	160922
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013年6月24日
报告期末基金资产净值	41,285,012,009.00

本基金通过被动(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。

本基金通过完全复制法,即完全按照标的指数的构成及其权重来构建基金的股票投资组合,并定期根据标的指数成份股及其权重的变化进行调整,从而使得基金的收益与标的指数的表现相一致。

投资策略 本基金通过完全复制法实现对标的指数的跟踪,通过定期调整和不定期的调仓,以保证基金资产与标的指数成分股的构成及权重相一致。

基金经理 陈海峰,男,经济学硕士,具有基金从业资格,2013年6月加入本公司,历任研究员、基金经理助理,2015年1月起任基金经理。

基金托管人 大成基金管理有限公司

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

主要财务指标 报告期:2016年1月1日 - 2016年3月31日

1.本期已实现收益 -677,403.63

2.本期利润 -6,098,962.06

3.期末可供分配基金份额利润 -0.1494

4.期末基金份额净值 49.031,060.62

5.期末基金份额总资产 1,207

注:1. 所列数据不包括持有人交易费用等其他列项目数。

2. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3. 基金净值 本基金份额净值不高于1.00元,但不低于0.50元。

4. 期末基金份额总资产=期末基金资产净值+期末持有的未变现的公允价值。

5. 期末基金份额净值=期末基金资产净值/期末基金份额总额。

注:本基金业绩指标不包括持有交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数据。

6. 本期末实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

7. 基金净值 本基金份额净值不高于1.00元,但不低于0.50元。

8. 期末基金份额总资产=期末基金资产净值+期末持有的未变现的公允价值。

9. 期末基金份额净值=期末基金资产净值/期末基金份额总额。

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。建仓期满时,本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

10. 基金管理人 陈海峰,男,经济学硕士,具有基金从业资格,2013年6月加入本公司,历任研究员、基金经理助理,2015年1月起任基金经理。

11. 基金托管人 中国银行股份有限公司

<p