

## 大成纳斯达克100指数证券投资基金

[2015] 年度报告摘要

基金管理人:大成基金管理有限公司  
基金托管人:中国农业银行股份有限公司  
送出日期:2016年3月26日

**§ 1 重要提示**  
基金管理人的董事会、董事保证本基金所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性、完整性、及时性承担法律责任。基金业协会已经“三上二下”以上董事会日常会议，对本报告书进行了复核。

利害关系人配售、财务会计报告、投资组合报告等信息，保证基金净值信息不存在虚假记载、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。

基金管理人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及其更新。

本年度报告摘要属年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

本报告期财务数据已审计。普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本基金报告期自2015年01月01日起至2015年12月31日。

**§ 2 基金简介**

**基金基本情况**

基金名称 大成纳斯达克100指数QDII

基金代码 000834

交易代码 000834

基金运作方式 灵活配置型开放式

基金合同生效日 2014年11月13日

基金管理人 大成基金管理有限公司

基金托管人 中国农业银行股份有限公司

报告期末基金份额总额 10,327,107.94份

基金会计年度 不适用

**2.2 基金产品说明**

投资目标 通过严格的资产纪律约束和数量化风险管理手段，实现基金投资组合对标的资产的准确配置，追求绝对收益。

投资策略 本基金将根据宏观经济形势及权益市场情况，通过主动投资于美国上市交易的股票型基金，实现基金投资组合对标的资产的准确配置，追求绝对收益。

风险特征 本基金主要投资于境外证券市场，因此本基金具有较高的风险。

业绩比较基准 100%纳斯达克100指数。

基金类别 为类别为股票型证券投资基金，风险与预期收益高于货币型基金、债券基金以及货币市场基金，属于预期风险较高的品种。

风险等级 特殊风险提示

基金管理人和基金托管人

基金名称 大成纳斯达克100指数证券投资基金

基金托管人 中国农业银行股份有限公司

报告期末基金份额总额 10,327,107.94份

基金会计年度 不适用

**3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况**

金额单位:人民币元

3.1 期间数据和指标 2015年末 2014年11月13日基金合同生效日至2015年12月31日止期间

本期已实现收益 8,762,714.62 -474,169.32

本期利润 10,404,780.22 -895,960.05

本期平均净值增长率 -18.78% -0.31%

本期净值增长率 -16.30% -0.06%

3.1.2 本期末数据和指标 2015年末 2014年末

期初可供分配基金份额利润 0.1560 -0.0005

期末基金份额净值 11,937,077.02 107,199,609.58200

期末基金份额总额 1,156 0.994

注:1.本期实现的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，本期利润是指基金利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)加上本期公允价值变动收益。

2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额的申购、赎回价格及其计算方法

份额 份额净值增长 份额净值增长 约当期校准系数 业绩评价校准系数 ①-③ ②-④

过去一个月 10.75% 1.00% 9.90% 1.16% 0.87% -0.07%

过去六个月 9.76% 1.32% 4.47% 1.26% 6.31% -0.04%

过去一年 16.30% 1.12% 8.43% 1.17% 7.87% -0.05%

自基金合同生效至今 16.60% 1.06% 9.40% 1.13% 6.12% -0.07%

注:同期间业绩比较基准以美元计价,不包含人民币汇率变动等因素产生的影响。

3.2.2 基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:同期间业绩比较基准以美元计价,不包含人民币汇率变动等因素产生的影响。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:同期间业绩比较基准以美元计价,不包含人民币汇率变动等因素产生的影响。

3.3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标 2015年 2014年11月13日基金合同生效日至2015年12月31日止期间

本期已实现收益 8,762,714.62 -474,169.32

本期利润 10,404,780.22 -895,960.05

本期平均净值增长率 -18.78% -0.31%

本期净值增长率 -16.30% -0.06%

3.1.2 本期末数据和指标 2015年末 2014年末

期初可供分配基金份额利润 0.1560 -0.0005

期末基金份额净值 11,937,077.02 107,199,609.58200

期末基金份额总额 1,156 0.994

注:1.本期实现的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，本期利润是指基金利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)加上本期公允价值变动收益。

2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

3.2.4 基金份额的申购、赎回价格及其计算方法

份额 份额净值增长 份额净值增长 约当期校准系数 业绩评价校准系数 ①-③ ②-④

过去一个月 10.75% 1.00% 9.90% 1.16% 0.87% -0.07%

过去六个月 9.76% 1.32% 4.47% 1.26% 6.31% -0.04%

过去一年 16.30% 1.12% 8.43% 1.17% 7.87% -0.05%

自基金合同生效至今 16.60% 1.06% 9.40% 1.13% 6.12% -0.07%

注:同期间业绩比较基准以美元计价,不包含人民币汇率变动等因素产生的影响。

3.2.5 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:同期间业绩比较基准以美元计价,不包含人民币汇率变动等因素产生的影响。

3.2.6 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:同期间业绩比较基准以美元计价,不包含人民币汇率变动等因素产生的影响。

3.2.7 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:同期间业绩比较基准以美元计价,不包含人民币汇率变动等因素产生的影响。

3.2.8 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:同期间业绩比较基准以美元计价,不包含人民币汇率变动等因素产生的影响。

3.2.9 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:同期间业绩比较基准以美元计价,不包含人民币汇率变动等因素产生的影响。

3.2.10 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:同期间业绩比较基准以美元计价,不包含人民币汇率变动等因素产生的影响。

3.2.11 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:同期间业绩比较基准以美元计价,不包含人民币汇率变动等因素产生的影响。

3.2.12 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:同期间业绩比较基准以美元计价,不包含人民币汇率变动等因素产生的影响。

3.2.13 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:同期间业绩比较基准以美元计价,不包含人民币汇率变动等因素产生的影响。

3.2.14 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:同期间业绩比较基准以美元计价,不包含人民币汇率变动等因素产生的影响。

3.2.15 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:同期间业绩比较基准以美元计价,不包含人民币汇率变动等因素产生的影响。

3.2.16 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:同期间业绩比较基准以美元计价,不包含人民币汇率变动等因素产生的影响。

3.2.17 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:同期间业绩比较基准以美元计价,不包含人民币汇率变动等因素产生的影响。

3.2.18 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:同期间业绩比较基准以美元计价,不包含人民币汇率变动等因素产生的影响。

3.2.19 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:同期间业绩比较基准以美元计价,不包含人民币汇率变动等因素产生的影响。

3.2.20 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:同期间业绩比较基准以美元计价,不包含人民币汇率变动等因素产生的影响。

3.2.21 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:同期间业绩比较基准以美元计价,不包含人民币汇率变动等因素产生的影响。

3.2.22 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:同期间业绩比较基准以美元计价,不包含人民币汇率变动等因素产生的影响。

3.2.23 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:同期间业绩比较基准以美元计价,不包含人民币汇率变动等因素产生的影响。

3.2.24 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:同期间业绩比较基准以美元计价,不包含人民币汇率变动等因素产生的影响。

3.2.25 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:同期间业绩比较基准以美元计价,不包含人民币汇率变动等因素产生的影响。

3.2.26 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:同期间业绩比较基准以美元计价,不包含人民币汇率变动等因素产生的影响。

3.2.27 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:同期间业绩比较基准以美元计价,不包含人民币汇率变动等因素产生的影响。

3.2.28 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:同期间业绩比较基准以美元计价,不包含人民币汇率变动等因素产生的影响。

3.2.29 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:同期间业绩比较基准以美元计价,不包含人民币汇率变动等因素产生的影响。

3.2.30 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:同期间业绩比较基准以美元计价,不包含人民币汇率变动等因素产生的影响。

3.2.31 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:同期间业绩比较基准以美元计价,不包含人民币汇率变动等因素产生的影响。

3.2.32 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:同期间业绩比较基准以美元计价,不包含人民币汇率变动等因素产生的影响。

3.2.33 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:同期间业绩比较基准以美元计价,不包含人民币汇率变动等因素产生的影响。