

# 大成纳斯达克100指数证券投资基金

## [2015] 第四季度报告

基金管理人:大成基金管理有限公司  
基金托管人:中国农业银行股份有限公司  
报告送出日期:2016年1月20日

### § 1 重要提示

基金管理人的董事会及基金经理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、完整性和及时性承担个别及连带责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据基金合同的约定，于2016年1月18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內容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金财产独立于基金管理人、基金托管人及其各自的股东、实际控制人以及任何个人，保证基金财产的安全，不受基金管理人、基金托管人及其各自的股东、实际控制人以及任何个人的损害和不利影响。

基金管理人承诺不从事内幕交易、操纵市场的行为，并严格遵守基金合同关于禁止从事关联交易的规定。

基金投资有风险，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。

本报告财务数据未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至12月31日止。

### § 2 基金产品概况

**2.1 基金的基本情况**

基金名称 大成纳斯达克100指数(ODCI)

交易代码 000034

基金运作方式 约定契约开放式

基金合同生效日 2014年1月13日

报告期末基金份额总额 10,327,107.74份

**投资目标** 通过严谨的资产配置策略和动态风险管理手段，实现基金投资组合的相对收益，力求超越基准最小化。

本基金将主要投资于纳斯达克100指数成分股（即纳斯达克上市股票中，具有代表性的股票）以及纳斯达克上市的其他股票，但因特殊情况导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将适时调整其投资策略以适应当时的环境。

本基金可能将一定比例的基金资产投资于纳斯达克100指数成分股以外的股票，上市交易基金以及其他指数基金、货币基金、以及货币化资产组合的建立，这将导致本基金和有效指数的表现有所差异。

**业绩比较基准** 纳斯达克100指数

**风险收益特征** 本基金为股票型证券投资基金，风险与预期收益高于货币市场基金，属于预期风险较高的产品。

**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

**2.2 国外投资顾问和境外资产托管人**

项目 揭示资产/费用收入

名称 美交 The Bank of New York Mellon Corporation

注册地址 One Wall Street New York, NY10296

办公地址 One Wall Street New York, NY10296

邮政编码 NY10296

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

**3.1 主要财务指标**

单位:人民币元 报告期( 2015年10月1日 - 2015年12月31日 )

1.本期已实现收益 224,140.41

2.本期利润 1,442,347.20

3.加权平均基金份额本期利润 0.1248

4.期末未分配利润 11,937,377.02

5.期末基金份额 1,126,136

注:1.本期实现收益指基金利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期期间内大成纳斯达克100指数上升幅度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交易基金的各项费用，计价费用实际收益水平要低于所列数字。

3.基金净值=基金总资产/基金份额总额。

4.管理人报告

5.1 基金经理( 或基金经理小组 ) 简介

姓名 职务 任期基金的经理期限 证券从业年限 说明

芮凌先生 本基金 基金 经理 2014年11月13 日 - 12年

金融学硕士，2003年4月至2004年6月就职于国泰君安证券有限公司，任研究员；2004年6月至2006年10月就职于国泰君安证券有限公司，任研究员；2006年9月加入大成基金管理有限公司，历任金融工程师、国外研究部研究员、基金经理助理、基金经理，2010年1月起担任大成纳斯达克100指数基金经理，现任基金经理。具有基金从业资格。

4.2 基金销售机构

基金管理人将基金提供给销售的主要是简要介绍。

基金管理人将基金提供给销售的客户情况说明

基金管理人将基金提供给销售的客户情况说明