

大成纳斯达克 100 指数证券投资基金 更新招募说明书摘要

(2015 年第 2 期)

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

二〇一五年十二月

重要提示

大成纳斯达克 100 指数证券投资基金经中国证监会 2014 年 7 月 3 日证监许可【2014】656 号文核准募集，基金合同于 2014 年 11 月 13 日正式生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但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。

大成纳斯达克 100 指数证券投资基金为美国股票指数型证券投资基金，风险与预期收益高于混合型基金、债券基金以及货币市场基金，属于预期风险较高的产品。本基金投资于美国证券市场，基金净值除了会因美国证券市场波动等因素产生波动之外，还需面临汇率风险等投资海外市场的特殊风险。

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。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现，基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。

投资有风险，投资人申购基金时，请仔细阅读本基金的招募说明书及基金合同。

本更新的招募说明书所载内容截止日为 2015 年 11 月 13 日（其中人员变动内容的更新以公告日期为准），有关财务数据和基金净值表现截止日为 2015 年 9 月 30 日，本报告中列财务数据未经审计。

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：贰亿元人民币

股权结构：公司股东为中泰信托有限责任公司（持股比例 48%）、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%）、广东证券股份有限公司（持股比例 2%）四家公司。

法定代表人：刘卓

电话：0755-83183388

传真：0755-83199588

联系人：肖剑

大成基金管理有限公司设有股东会、董事会、监事会。公司组织架构下设二十三个部门，分别为股票投资部、研究部、社保基金及机构投资部、固定收益总部（下设公募投资部、非公募投资部、固收研究部、运营交易室）、数量与指数投资部、专户投资部、市场部、战略客户部、互联网金融总部（下设电子商务部、平台创新部、研发部与技术支持部）、产品研发与金融工程部、品牌管理与营销策划部、信息技术部、交易管理部、基金运营部、客户服务部、国际业务部、监察稽核部、风险管理部、总经理办公室、董事会办公室、人力资源部、计划财务部以及行政部。公司在北京、上海、西安、成都、武汉、福州、沈阳、广州、南京和青岛等地设立了十家分公司，拥有两家子公司，分别为大成国际资产管理有限公司及大成创新资本管理有限公司。此外，公司还设立了投资决策委员会、投资风险控制委员会和战略规划委员会等专业委员会。

公司以“责任、回报、专业、进取”为经营理念，坚持“诚实信用、勤勉尽责”的企业精神，致力于开拓基金及证券市场业务，以稳健灵活的投资策略和注重绩优、高成长的投资组合，力求为投资者获得更大投资回报。

（二）证券投资基金管理情况

截至 2015 年 11 月 13 日,本基金管理人共管理 5 只 ETF 及 1 只 ETF 联接基金:大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金、深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金及大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金、中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金。2 只 QDII 基金:大成标普 500 等权重指数证券投资基金、大成纳斯达克 100 指数证券投资基金及 53 只开放式证券投资基金:大成景丰债券型证券投资基金(LOF)、大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、大成蓝筹稳健证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、大成货币市场证券投资基金、大成沪深 300 指数证券投资基金、大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金、大成积极成长混合型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金(LOF)、大成景阳领先混合型证券投资基金、大成强化收益定期开放债券型证券投资基金、大成策略回报混合型证券投资基金、大成行业轮动混合型证券投资基金、大成中证红利指数证券投资基金、大成核心双动力混合型证券投资基金、大成竞争优势混合型证券投资基金、大成景恒保本混合型证券投资基金、大成内需增长混合型证券投资基金、大成可转债增强债券型证券投资基金、大成消费主题混合型证券投资基金、大成新锐产业混合型证券投资基金、大成优选混合型证券投资基金(LOF)、大成月添利理财债券型证券投资基金、大成现金增利货币市场证券投资基金、大成月月盈短期理财债券型证券投资基金、大成现金宝场内实时申赎货币市场基金、大成景安短融债券型证券投资基金、大成景兴信用债债券型证券投资基金、大成景旭纯债债券型证券投资基金、大成景祥分级债券型证券投资基金、大成信用增利一年定期开放债券型证券投资基金、大成健康产业混合型证券投资基金、大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)、大成灵活配置混合型证券投资基金、大成丰财宝货币市场基金、大成景益平稳收益混合型证券投资基金、大成添利宝货币市场基金、大成景利混合型证券投资基金、大成产业升级股票型证券投资基金(LOF)、大成高新技术产业股票型证券投资基金、大成景秀灵活配置混合型证券投资基金、大成互联网思维混合型证券投资基金、大成景明灵活配置混合型证券投资基金、大成景穗灵活配置混合型证券投资基金、大成景鹏灵活配置混合型证券投资基金、大成景源灵活配置混合型证券投资基金、大成睿景灵活配置混合型证券投资基金、大成景裕灵活配置混合型证券投资基金、大成中证互联网金融指数分级证券投资基金、大成正向回报灵活配置混合型证券投资基金、大成恒丰宝货币市场基金和大成绝对收益策略混合型发起式证券投资基金。

(三) 主要人员情况

1. 公司高级管理人员

董事会：

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11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股份有限公司；1997年5月至2015年1月，先后任光大证券有限责任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。

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)、金融风险管理者(FRM)资格。曾任毕马威(KPMG)法律诉讼部资深咨询师、金融部资深咨询师，以及SLCG证券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，兼任国家“千人计划”专家；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。

周雄先生，董事，金融学博士，北京大学光华管理学院高级管理工商管理硕士(EMBA)。1987年8月至1993年4月，任厦门大学财经系教师；1993年4月至1996年8月，任华夏证券有限公司厦门分公司经理；1996年8月至1999年2月，任人民日报社事业发展局企业管理处副处长；1999年2月至今任职于中泰信托有限责任公司，历任副总裁、总裁，现任中泰信托有限责任公司董事、总裁。

孙学林先生，董事，博士研究生在读。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投资二部董事总经理、投资决策委员会委员。2012年6月起，兼任镇江银河创业投资有限公司总经理、投资决策委员会委员。

黄隽女士，独立董事，经济学博士。现任中国人民大学经济学院教授、博士生导师，中国人民大学经济学院院长助理，中国人民大学艺术品金融研究所副所长。

叶林先生，独立董事，法学博士。现任中国人民大学法学院教授、民商法教研室主任，博士研究生导师、国家社会科学重点基地中国民商事法律科学研究中心兼职教授。

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，主要从事金融业产业组织结构、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职正教授（博士生导师）和北京大学光华管理学院讲席教授（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。

监事会：

陈希先生，监事长，中国人民大学经济学专业研究生，高级经济师。2006 年被亚洲风险与危机管理协会授予“企业风险管理师”资格。2007 年起任中国银河投资管理有限公司董事、常务副总裁（至 2012 年 7 月）、党委委员；2010 年 7 月起，兼任吉林省国家生物产业创业投资有限责任公司董事长兼总经理、吉林省国家汽车电子产业创业投资有限责任公司董事，2012 年 6 月起，兼任镇江银河创业投资有限公司董事长；2012 年 7 月起至今，任中国银河投资管理有限公司总裁。

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 月任杭州新利信息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、金融工程部高级工程师、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，现任风险管理部总监。

吴萍女士，职工监事，文学学士。1991 年至 1992 年任中国农业银行深圳分行国际业务部会计。1993 年至 1998 年任日本三和银行深圳分行单证部、信贷部主任。1999 年至 2009 年任普华永道会计师事务所深圳分所审计部经理、高级经理。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。

其他高级管理人员：

杜鹏女士，督察长，研究生学历。1992 年—1994 年，历任原中国银行陕西省信托咨询公司证券部驻上交所上市代表、上海业务部负责人；1994 年—1998 年，历任广东省南方金融服务总公司投资基金管理部证券投资部副经理、广东华侨信托投资公司证券总部资产管理部经理；1998 年 9 月参与大成基金管理有限公司的筹建；1999 年 3 月起，任大成基金管理有限公司督察长。2009 年 3 月—2015 年 7 月兼任大成国际资产管理有限公司董事。

钟鸣远先生，副总经理，金融学硕士。曾任国家开发银行深圳分行资金计划部职员，联合证券有限责任公司固定收益部投资经理，泰康人寿保险股份有限公司固定收益部研究员，新华资产管理股份有限公司固定收益部高级投资经理，易方达基金管理有限公司固定收益总部总经理兼固定收益投资部总经理。2014 年 3 月加入大成基金管理有限公司，任公司助理总经理。2015 年 1 月起任大成基金管理有限公司副总经理。

肖剑先生，副总经理，公共管理硕士。曾任深圳市南山区委（政府）办公室副主任，深圳市广聚能源股份有限公司副总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。2015 年 1 月加入大成基金管理有限公司，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、新疆精河县团委副书记、新疆精河县人民政府体改委副主任、新疆精河县八家户农场党委书记、新疆博尔塔拉蒙古自治州团委副书记及少工委主任、江苏省铁路发展股份有限公司办公室主任、江苏省铁路发展股份有限公司控股企业及江苏省铁路实业集团有限公司控股企业负责人、中国华闻投资控股有限公司燃气战略管理部项目经理。2005 年 1 月加入大成基金管理有限公司，历任客户服务中心总监助理、市场部副总经理、上海分公司副总经理、客户服务部总监兼上海分公司总经理，2013 年 5 月起任公司助理总经理。2015 年 8 月起任公司副总经理。

温智敏先生，副总经理，哈佛大学法学博士。2000 至 2002 年就职于 Hunton & Williams 美国及国际律师事务所，2002 至 2006 年任中银国际投行业务副总裁，2006 至 2009 年任香港三山投资公司董事总经理，2009 至 2014 年任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，出任首席战略官。2015 年 8 月 28 日起任公司副总经理。2015 年 8 月起任公司副总经理。

2. 基金经理

(1) 现任基金经理

冉凌浩，金融学硕士，12 年证券从业经历。金融学硕士。2003 年 4 月至 2004 年 6 月就职于国信证券研究部，任研究员；2004 年 6 月至 2005 年 9 月就职于华西证券研究部，任高

级研究员；2005 年 9 月加入大成基金管理有限公司，历任金融工程师、境外市场研究员及基金经理助理。2011 年 8 月 26 日起担任大成标普 500 等权重指数型证券投资基金基金经理。2014 年 11 月 13 日起担任大成纳斯达克 100 指数证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国

3. 投资决策委员会境外投资决策小组

投资决策委员会境外投资决策小组由 2 名成员组成，名单如下：邓韶勇，国际业务部总监，境外投资决策委员会委员；冉凌浩，大成标普 500 等权重指数型证券投资基金基金经理，境外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

（一）基金托管人情况

1、基本情况

名称：中国农业银行股份有限公司（简称中国农业银行）

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座

法定代表人：刘士余

成立日期：2009 年 1 月 15 日

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13 号

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]23 号

注册资本：32,479,411.7 万元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010-66060069

传真：010-68121816

联系人：林葛

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分,总行设在北京。经国务院批准,中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于 2009 年 1 月 15 日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡,成为国内网点最多、业务辐射范围最广,服务领域最广,

服务对象最多，业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外，中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉，每年位居《财富》世界 500 强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行，中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念，坚持审慎稳健经营、可持续发展，立足县域和城市两大市场，实施差异化竞争策略，着力打造“伴你成长”服务品牌，依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品，致力为广大客户提供优质的金融服务，与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行，经验丰富，服务优质，业绩突出，2004 年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007 年中国农业银行通过了美国 SAS70 内部控制审计，并获得无保留意见的 SAS70 审计报告，表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设，品牌声誉进一步提升，在 2010 年首届“‘金牌理财’ TOP10 颁奖盛典”中成绩突出，获“最佳托管银行”奖。2010 年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。

中国农业银行证券投资基金托管部于 1998 年 5 月经中国证监会和中国人民银行批准成立，2004 年 9 月更名为托管业务部，内设养老金管理中心、技术保障处、营运中心、委托资产托管处、保险资产托管处、证券投资基金托管处、境外资产托管处、综合管理处、风险管理处，拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工 140 余名，其中高级会计师、高级经济师、高级工程师、律师等专家 10 余名，服务团队成员专业水平高、业务素质好、剪务能力强，高级管理层均有 20 年以上金融从业经验和高级技术职称，精通国内外证券市场的运作。

基金托管业务经营情况

截止到 2015 年 9 月 30 日，中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共 306 只。

(二) 基金托管人的内部风险控制制度说明

1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

2、内部控制组织结构

风险管理委员会总体负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作,对托管业务风险管理和内部控制工作进行监督和评价。托管业务部专门设置了风险管理处,配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作,独立行使监督稽核职权。

3、内部控制制度及措施

具备系统、完善的制度控制体系,建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程,可以保证托管业务的规范操作和顺利进行;业务人员具备从业资格;业务管理实行严格的复核、审核、检查制度,授权工作实行集中控制,业务印章按规程保管、存放、使用,账户资料严格保管,制约机制严格有效;业务操作区专门设置,封闭管理,实施音像监控;业务信息由专职信息披露人负责,防止泄密;业务实现自动化操作,防止人为事故的发生,技术系统完整、独立。

(三) 基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人通过参数设置将《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议规定的投资比例和禁止投资品种输入监控系统,每日登录监控系统监督基金管理人的投资运作,并通过基金资金账户、基金管理人的投资指令等监督基金管理人的其他行为。

当基金出现异常交易行为时,基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理:

- 1、电话提示。对媒体和舆论反映集中的问题,电话提示基金管理人;
- 2、书面警示。对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等问题,以书面方式对基金管理人进行提示;
- 3、书面报告。对投资比例超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为,书面提示有关基金管理人并报中国证监会。

三、境外托管人

(一) 基本情况

名称: 纽约梅隆银行股份有限公司 The Bank of New York Mellon Corporation

注册地址: One Wall Street, New York, NY 10286

办公地址: One Wall Street, New York, NY 10286

法定代表人: Gerald L. Hassell (Chairman & CEO - 董事长兼首席执行官)

股东权益: 380 亿美元 (截止 2014 年 12 月 31 日)

托管资产规模: 28.5 万亿美元 (截止 2014 年 12 月 31 日)

组织形式:股份有限公司

存续期间:持续经营

信用等级: Aa2 评级 (穆迪), AA- (标普) (截止 2014 年 12 月 31 日)

(二) 最近一个会计年度、托管资产规模、信用等级等

纽约梅隆银行公司总部设在美国纽约华尔街 1 号, 是美国历史最悠久的商业银行, 也是全球最大的金融服务公司之一。公司集多元化及其配套业务于一体, 服务内容包括资产管理、资产服务、发行人服务、清算服务、资金服务和财富管理。公司通过在全球 35 个国家和地区设立分支机构, 为超过 100 个金融市场的投资提供证券托管服务, 为全球最大的托管行, 并且是全球最大的资产管理服务提供商之一。公司在存托凭证、公司信托、股东服务、清算贸易、融资服务、佣金管理等业务方面都位居全球前列, 并且是领先的美元现金管理、结算服务和全球支付服务供应公司。

截至 2014 年 12 月 31 日, 纽约梅隆银行托管资产规模达 28.5 万亿美元, 管理资产规模为 1.70 万亿美元, 股东权益为 380 亿美元, 一级资本充足率为 12.2%, 全球员工总人数为 50,300。信用等级: Aa2 评级 (穆迪), AA- (标普)。

四、相关服务机构

(一) 销售机构及联系人

1. 直销机构: 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

法定代表人: 刘卓

电话: 0755-83183388

传真: 0755-83199588

联系人: 王为开

公司网址: www.dcfund.com.cn

大成基金客户服务热线: 400-888-5558 (免长途固话费)

大成基金管理有限公司现分别在深圳、上海设有投资理财中心:

(1) 大成基金深圳投资理财中心

地址: 深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层

联系人：王欢欢、白小雪

电话：0755-83195236/22223555/22223556

传真：0755-83195239/83195235/83195242/83195232

(2) 大成基金上海投资理财中心

地址：上海市浦东新区陆家嘴东路161号101室

联系人：徐聆

电话：021-62185377/62185277/63513925/62173331

传真：021-63513928/62185233

2. 代销机构

(1) 中国银行股份有限公司

注册地址：北京西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：田国立

客服电话：95566

联系人：王娟

电话：010-66594909

传真：010-66594942

网址：www.boc.cn

(2) 中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：刘士余

客服电话：95599

电话：010-85109219

传真：010-85109219

网址：www.abchina.com

(3) 上海农村商业银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东大道 981 号

法定代表人：胡平西

客服电话：021-962999

电话：021-38576985

传真：021-50105124

联系人：周睿

网址：www.shrcb.com

(4) 北京农村商业银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区阜成门内大街 410 号

法定代表人：王金山

联系人：董汇

联系电话：010-85605588

传真：010-66506163

客服电话：96198

网址：www.bjrcb.com

(5) 光大证券股份有限公司

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：薛峰

客服电话：400-888-8788、95525

联系人：刘晨、李芳芳

电话：021-22169081

传真：021-22169134

网址：www.ebscn.com

(6) 海通证券股份有限公司

注册地址：上海市淮海中路 98 号

法定代表人：王开国

客服电话：95553、400-888-8001

联系人：金芸、李笑鸣

电话：021-23219000

传真：021-63602722

网址：www.htsec.com

(7) 中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：陈有安

客服电话：4008-888-888

联系人：田薇

联系电话：010-66568430

传真：010-66568990

网址：www.chinastock.com.cn

(8) 中信建投股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

法定代表人：王常青

客服电话：400888108

联系人：权唐

电话：010-85130577

传真：010-65182261

网址：www.csc108.com

(9) 中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层（1507-1510 室）

办公地址：青岛市东海西路 28 号

法定代表人：杨宝林

客服电话：0532-96577

联系人：吴忠超

电话：0532-85022326

传真：0532-85022605

网址：www.zxwt.com.cn

(10) 中信证券（浙江）有限责任公司

注册地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 588 号恒鑫大厦主楼 19、20 层

法定代表人：沈强

客服电话：95548

联系人：王霏霏

电话：0571-87112507

传真：0571-85783771

网址：www.bigsun.com.cn

(11) 中信证券股份有限公司

注册地址：深圳市深南路 7088 号招商银行大厦

法定代表人：王东明

客服电话：010-84588888

联系人：顾凌

电话：010-60838696

传真：010-84865560

网址：www.cs.ecitic.com

(12) 东海证券股份有限公司

注册地址：江苏省常州市延陵西路 2 3 号投资广场 1 8 - 1 9 楼

办公地址：上海市东方路 1928 号东海证券大厦

法定代表人：朱科敏

客服电话：95531

免费服务热线：95531

联系人：汪汇

电话：021-20333333

传真：021-50498825

网址：www.longone.com.cn

(13) 兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 268 号

法定代表人：兰荣

客户服务电话：95562

联系人：黄英

电话：0591-38162212

传真：0591-38507538

网址：www.xyzq.com.cn

(14) 华鑫证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01 (b) 单元

办公地址：上海市肇嘉浜路 750 号

法定代表人：洪家新

联系人：陈敏

网站: www.cfsc.com.cn

客户服务电话: 021-32109999; 029-68918888; 4001099918

(15) 上海证券有限责任公司

注册地址: 上海市西藏中路 336 号

法定代表人: 龚德雄

客服电话: 021-962518, 4008918918

联系人: 张瑾

电话: 021-53519888

传真: 021-63608830

网址: www.962518.com

(16) 浙商证券股份有限公司

地址: 浙江省杭州市杭大路 1 号黄龙世纪广场 A 座 6-7 楼

法定代表人: 吴承根

联系人: 谢项辉

电话: 0571-87901053

客服电话: 967777

网址: www.stocke.com.cn

(17) 中航证券有限公司

注册地址: 南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼

办公地址: 南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼

法人代表: 王宜四

客户服务热线: 4008866567

联系人: 戴蕾

电话: 0791-86768681

传真: 0791-86770178

网址: www.avicsec.com

(18) 财富证券有限责任公司

办公地址: 湖南长沙芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 层

法人代表: 蔡一兵

客户服务热线: 0731-84403319

联系人：胡智

电话：0731-84779521

传真：0731-84403439

网址：www.cfzq.com

（19）天风证券股份有限公司

注册地址：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦四楼

法定代表人：余磊

联系人：翟璟

联系电话：（027）87618882/（028）86711410

传真：（027）87618863

公司网站：www.tfzq.com

（20）中原证券股份有限公司

地址：郑州市郑东新区商务外环路 10 号

法定代表人：菅明军

客服电话：0371-967218、4008139666

联系人：卢琳

联系电话：0371-68599287 联系传真：0371-65585665

网址：www.ccnew.com

（21）渤海证券股份有限公司

注册地址：天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

法定代表人：王春峰

联系人：蔡霆

电话：022-28451991

传真：022-28451892

客服电话：4006515988

网址：www.bhzq.com

（22）国都证券有限责任公司

注册地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

法定代表人：常喆

客户服务电话：400-818-8118

联系人：黄静

电话：010-84183333

传真：010-84183311-3389

网址：www.guodu.com

(23) 中国民族证券有限责任公司

注册地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼 40 层-43 层

法人代表：赵大建

联系人：李微

客户服务电话：400-889-5618

网址：www.e5618.com

(24) 申万宏源西部证券有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室

法定代表人：许建平

电话：010-88085858

传真：010-88085195

联系人：李巍

客户服务电话：400-800-0562

网址：www.hysec.com

(25) 齐鲁证券有限公司

办公地址：山东省济南市经十路 20518 号

法定代表人：李玮

客户服务电话：95538

联系人：吴阳

电话：0531-81283938

传真：0531-81283900

网址：www.qlzq.com.cn

(26) 民生证券股份有限公司

地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座

法定代表人：余政

客服电话：4006198888

联系人：赵明

联系电话：010-85127622

联系传真：010-85127917

公司网址：www.msq.com

(27) 中国光大银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心

法定代表人：唐双宁

客服电话：95595

联系人：李伟

电话：010-68098778

传真：010-68560312

网址：www.cebbank.com

(28) 华宝证券有限责任公司

地址：上海市浦东新区环球金融中心 57 楼

法定代表人：陈林

客户服务电话：400-820-9898

联系人：汪明丽

电话：021-68778075

传真：021-68868117

网址：www.cnhbstock.com

(29) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006 号

法定代表人：杨懿

办公地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006 号

联系人：文雯

网站：<http://8.jrj.com.cn>

客户服务电话：400-166-1188

(30) 上海陆金所资产管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

法定代表人：郭坚

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

联系人：宁博宇

网站：www.lufunds.com

客户服务电话：4008219031

(31) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市文二西路 1 号元茂大厦 903

法定代表人：凌顺平

办公地址：浙江省杭州市西湖区翠柏路 7 号电子商务产业园 2 号楼

联系人：林海明

网站：www.5ifund.com

客户服务电话：4008-773-772

(32) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

法定代表人：汪静波

办公地址：上海市杨浦区昆明路 508 号北美广场 B 座 12 楼

联系人：张裕

网站：www.noah-fund.com

客户服务电话：400-821-5399

(33) 上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 9 楼

法人代表：其实

联系人：高莉莉

电话：021-54509988

传真：021-64383798

客户服务电话：400-1818-188

网址：www.1234567.com.cn

(二) 注册登记机构

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 33 层

法定代表人：刘卓

电话：0755-83183388

传真：0755-83195239

联系人：范瑛

（三）律师事务所和经办律师

名称：北京市金杜律师事务所

注册地址：北京市朝阳区东三环中路7号财富中心写字楼A座40层

办公地址：北京市朝阳区东三环中路7号财富中心写字楼A座40层

负责人：王玲

电话：0755-22163333

传真：0755-22163390

经办律师：靳庆军、冯艾

联系人：冯艾

（四）会计师事务所和经办注册会计师

会计师事务所名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼

法人代表：杨绍信

经办注册会计师：汪棣、金毅

电话：021-23238888

传真：021-23238800

联系人：刘莉

五、基金的名称

大成纳斯达克 100 等权重指数证券投资基金

六、基金的类型

指数型

七、基金的运作方式

开放式

八、基金的投资目标

通过严格的投资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指数的有效跟踪,追求跟踪误差最小化。

九、基金的投资范围

本基金主要投资于纳斯达克 100 指数成份股、备选成份股,以纳斯达克 100 指数为跟踪标的的公募基金、上市交易型基金、结构性产品等。本基金还可以投资于全球证券市场中具有良好流动性的其他金融工具,包括在证券交易市场挂牌的普通股、优先股、存托凭证,固定收益类证券(含中期票据)、银行存款、现金等货币市场工具、权证、股指期货以及中国证监会允许本基金投资的其他产品或金融工具。

本基金投资于纳斯达克 100 指数成份股、备选成份股以及以纳斯达克 100 指数为跟踪标的的公募基金、上市交易型基金、结构性产品的比例占基金资产的 80%-95%,其中投资于以纳斯达克 100 指数为跟踪标的的公募基金、上市交易型基金、结构性产品的比例不超过 10%;投资于现金、银行存款、固定收益类证券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具的比例为基金资产的 5%-20%,其中投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。

如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。

十、基金的投资策略

本基金将按照标的指数的成份股及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况(如股票停牌、流动性不足)导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

本基金可能将一定比例的基金资产投资于以纳斯达克 100 指数为跟踪标的的公募基金、上市交易型基金以及股指期货等金融衍生品,以优化投资组合的建立,达到节约交易成本和有效追踪标的指数表现的目的。本基金投资股指期货等金融衍生品的目的是为了为了更好的实现基金的投资目标,不得用于投机交易目的,或用作杠杆工具放大基金的投资。

本基金在投资的过程中,由于必须保有一定比例的现金资产,导致在市场上涨的过程中,基金投资组合的表现可能会落后于标的指数的表现。另外,由于基金投资组合权重与目标指数成份股权重的不一致、股票买卖价格与股票收盘价的差异、指数成份股的调整与指数成份股权重的调整所产生的交易费用、基金运作过程中的各项费用与开支都会使基金投资组合产生跟踪误差。

基金管理人会定期对跟踪误差进行归因分析,为基金投资组合下一步的调整及跟踪目标指数偏离风险的控制提供量化决策依据。在正常情况下,本基金力争控制净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%,年化跟踪误差不超过5%(以美元资产计价)。

十一、基金的业绩比较基准

纳斯达克100价格指数

The NASDAQ OMX Group, Inc.及其附属机构(NASDAQ OMX及其附属机构合称为“公司”)未发起、支持、销售或推介本基金。该公司并未审核本基金的合法性或适用性、与本基金有关的表述及信息披露的准确性或完整性。该公司未就证券投资、投资本基金或纳斯达克100®指数跟踪证券市场总体表现的能力,对本基金份额持有人或任何公众作出明示或暗示的陈述或保证。该公司与大成基金管理有限公司(被许可方)间的关系仅在于许可使用注册商标NASDAQ®、OMX®、NASDAQ OMX®、NASDAQ-100®及NASDAQ-100指数®,和该公司的特定商号,以及使用由NASDAQ OMX不考虑被许可方或本基金而确定、构建和计算的NASDAQ-100指数®。NASDAQ OMX在确定、构建和计算NASDAQ-100指数®时无须

考虑被许可方或本基金份额持有人的需要。该公司不负责并且未参与确定本基金发售的时间、发售价格或发售规模，也未参与确定或计算将本基金转换为现金的计算方法。该公司对本基金的管理、销售和交易不承担责任。

该公司不保证NASDAQ-100指数®或其中任何数据的准确性及/或数据计算的连续性。该公司未就被许可方、本基金份额持有人、任何个人或实体使用NASDAQ-100指数®或其中任何数据的结果，作出明示或暗示的保证。该公司未作出明示或暗示的保证，并且明示不对有关NASDAQ-100指数®或其中任何数据的特定目的或用途的适销性和适当性作出保证。在不限上述规定的前提下，即使已告知损害发生的可能，该公司不会对任何损失的利润或特定的、偶然的、惩罚性的、间接的或衍生的损害承担责任。

未来，如果纳斯达克100指数的提供商终止对基金管理人继续使用该指数的授权，或者是指数提供商基于其独立判断停止继续发布该指数，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的股票指数时，本基金管理人在保护持有人合法利益的前提下，以不损害持有人利益为原则，可以与基金托管人协商一致并报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

十二、基金的风险收益特征

本基金为美国股票指数型证券投资基金，风险与预期收益高于混合型基金、债券基金以及货币市场基金，属于预期风险较高的产品。

十三、基金投资组合报告

基金管理人的董事会及董事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、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国农业银行根据基金合同规定，于2015年*月*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内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据取自本基金2015年第3季度报告，截至2015年9月31日。
(财务数据未经审计)

1. 期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	12,967,940.45	91.04
	其中：普通股	12,967,940.45	91.04
	优先股	-	0.00
	存托凭证	-	0.00
	房地产信托凭证	-	0.00
2	基金投资	-	0.00
3	固定收益投资	-	0.00
	其中：债券	-	0.00
	资产支持证券	-	0.00
4	金融衍生品投资	-	0.00
	其中：远期	-	0.00
	期货	-	0.00
	期权	-	0.00
	权证	-	0.00
5	买入返售金融资产	-	0.00
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
6	货币市场工具	-	0.00
7	银行存款和结算备付金合计	998,228.87	7.01
8	其他资产	278,255.32	1.95
9	合计	14,244,424.64	100.00

2. 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家（地区）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
美国	12,967,940.45	93.47
合计	12,967,940.45	93.47

3. 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

（1）报告期末指数投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
金融	-	0.00
消费者非必需品	2,637,579.21	19.01
信息技术	7,256,075.81	52.30
工业	269,400.17	1.94
医疗保健	1,846,843.27	13.31
能源	-	0.00
消费者常用品	864,762.43	6.23
公用事业	-	0.00
基础材料	-	0.00

电信服务	93,279.56	0.67
合计	12,967,940.45	93.47

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

（2）报告期末积极投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。

4. 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

（1）报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明

细

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家 (地区)	数量 (股)	公允价值 (人民币元)	占基金资产净值比例 (%)
1	Apple Inc.	苹果公司	AAPL UQ	纳斯达克交易所	美国	2,468	1,731,675.63	12.48
2	Microsoft Corp	微软公司	MSFT UQ	纳斯达克交易所	美国	3,466	975,856.24	7.03
3	Amazon.com Inc	亚马逊公司	AMZN UQ	纳斯达克交易所	美国	199	648,000.89	4.67
4	Alphabet Inc C	Alphabet 公司	GOOG UQ	纳斯达克交易所	美国	146	565,069.95	4.07
5	Facebook Inc	Facebook 公司	FB UQ	纳斯达克交易所	美国	963	550,721.28	3.97
6	Alphabet Inc A	Alphabet 公司	GOOGL UQ	纳斯达克交易所	美国	123	499,486.16	3.6
7	Gilead Sciences Inc	吉利德科学公司	GILD UQ	纳斯达克交易所	美国	629	392,883.49	2.83

				所				
8	Intel Corp	英特尔公司	INTC UQ	纳斯达克交易所	美国	2,032	389,594.51	2.81
9	Cisco Systems Inc	思科公司	CSCO UQ	纳斯达克交易所	美国	2,179	363,858.41	2.62
10	Comcast Corp A	康卡斯特	CMCSA UQ	纳斯达克交易所	美国	909	328,904.15	2.37

(2) 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权益投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。

5. 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

6. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金额衍生品。

9. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

10. 投资组合报告附注

(1) 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

(2) 基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

(3) 其他资产构成

序号	名称	金额（人民币元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	2,815.07
4	应收利息	87.03
5	应收申购款	211,216.81
6	其他应收款	-
7	待摊费用	64,136.41
8	其他	-
9	合计	278,255.32

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

①报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况。

②报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。

(6) 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

十四、基金业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

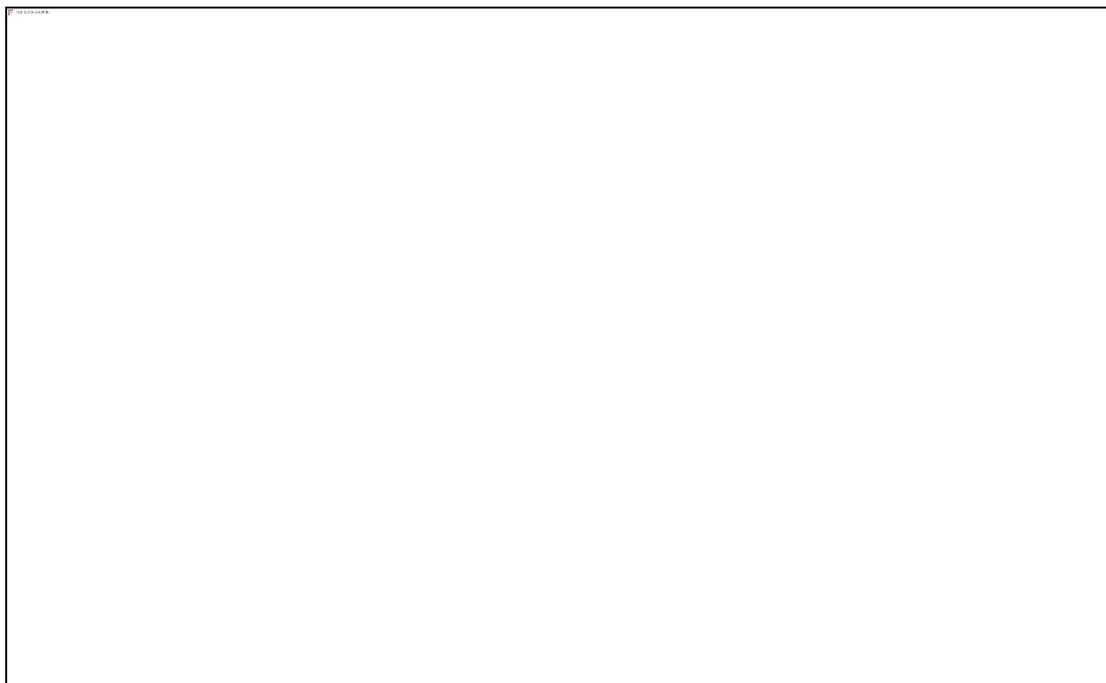
(一) 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较：

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2014.11.13-2014.12.31	-0.60%	0.22%	0.97%	0.89%	-1.57%	-0.67%
2015.01.01-2015.09.30	5.03%	1.13%	-1.30%	1.17%	6.33%	-0.04%
2014.11.13-2015.09.30	4.40%	1.04%	-0.34%	1.13%	4.74%	-0.09%

(二) 自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况，并与同期业绩比较基准的变动的比较

本基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2014年11月13日至2015年9月30日)



- 注：1、本基金合同生效日为 2014 年 11 月 13 日，截止报告期末本基金合同生效未满一年。
- 2、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约定。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。
- 3、同期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效应。

十五、费用概览

（一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 5、基金份额持有人大会费用，包括但不限于公证费、会计师费、律师费和场地费等；
- 6、基金的证券交易费用；
- 7、基金的证券交易费用及在境外市场的交易、清算、登记等实际发生的费用（out-of-pocket fees），包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、基金进行外汇兑换的相关费用；
- 10、基金依照有关法律法规应当缴纳的，购买或处置证券有关的任何税收、征费、关税、印花税、交易及其他税收及预扣提税（以及与前述各项有关的任何利息及费用）；
- 11、与基金缴纳税收有关的手续费、汇款费等；
- 12、基金合同生效以后的基金的指数使用费；
- 13、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.8% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.8\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费（如基金托管人委托境外资产托管人，包括向其支付的相应服务费）按

前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 10 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

3、基金的指数使用费

本基金按照基金管理人与标的指数供应商所签订的指数使用许可协议中所规定的指数使用许可费计提方法计提指数使用费。通常情况下，基金的指数使用费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

(1) 当 $E \leq 6.5$ 亿人民币时，

$$H = E \times 0.06\% \div 365$$

(2) 当 $E > 6.5$ 亿人民币时，

$$H = 6.5 \text{ 亿人民币} \times 0.06\% \div 365 + (E - 6.5 \text{ 亿人民币}) \times 0.04\% \div 365$$

H 为每日应计提的基金标的指数使用费

E 为前一日基金资产净值

指数使用费收取下限为每年 4 万美元（年度最低指数使用费），即不足 4 万美元时按照 4 万美元收取。

年度最低指数使用费应在基金合同生效日及其后每个公历年度起始日时支付，如基金合同生效日至本公历年度截止日不足一年时，按照实际存续时间占年度 365 天的比例进行支付。

指数使用费按日计提，按季支付。若该季度累计计提的指数使用费金额 / 该季度末最后一工作日（如为节假日取前一工作日）中国人民银行或其授权机构公布的汇率中间价小于指数使用许可协议规定的按年度最低指数使用费计算出的季度最低指数使用费，则基金于季度最后一日补提指数使用费至指数使用许可协议规定的按年度最低指数使用费计算出的季度最低指数使用费。

在指数使用费支付日，基金管理人向基金托管人发送基金指数使用费划付指令，经基金托管人复核后从基金财产中支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

如果指数使用费的计算方法和费率水平发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计

算指数使用费。基金管理人应及时按照《信息披露管理办法》的规定在指定媒体进行公告并通知基金托管人。此项调整无需召开基金份额持有人大会。

上述“（一）基金费用的种类中第 3—11 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（四）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

（五）基金管理费和基金托管费的调整

经基金管理人和基金托管人协商一致，基金管理人和基金托管人可协商酌情降低基金管理费和基金托管费，此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 日前在指定媒体上刊登公告。

十六、对招募说明书更新部分的说明

本更新招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求，并根据本基金管理人对本基金实施的投资经营活动，对 2015 年 6 月 26 日公布的《大成纳斯达克 100 指数证券投资基金招募说明书（2015 年 1 期）》进行了内容补充和更新，本更新的招募说明书主要更新的内容如下：

1. 根据最新数据，对“四、基金的投资”部分内容进行了更新。
2. 根据最新财务数据，对“五、基金的业绩”部分内容。
3. 根据最新资料，对“六、基金管理人”部分内容进行了更新。
4. 根据最新资料，对“十六、基金托管人”部分内容进行了更新。
5. 根据最新公告，对“十八、相关服务机构”部分内容进行了更新。

6. 根据最新情况，更新了“二十三、招募说明书更新部分的说明”。

大成基金管理有限公司

二〇一五年十二月二十八日