

大成纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（QDII）（A 类份额）

基金产品资料概要更新

编制日期：2024 年 6 月 3 日

送出日期：2024 年 6 月 28 日

本概要提供本基金的重要信息，是招募说明书的一部分。

作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。

一、产品概况

基金简称	大成纳斯达克 100ETF 联接（QDII）	基金代码	000834
下属基金简称	大成纳斯达克 100ETF 联接（QDII）A	下属基金交易代码	000834
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
境外托管人	纽约梅隆银行		The Bank of New York Mellon Corporation
基金合同生效日	2023 年 9 月 1 日		
基金类型	股票型	交易币种	人民币
运作方式	普通开放式	开放频率	每个开放日
基金经理	冉凌浩	开始担任本基金基金经理的日期	2023 年 9 月 1 日
		证券从业日期	2003 年 4 月 1 日
其他	《基金合同》生效后，基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续 20 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会说明原因并报送解决方案。 法律法规另有规定时，从其规定。自 2023 年 9 月 1 日起，大成纳斯达克 100 指数证券投资基金变更为本基金。		

二、基金投资与净值表现

（一）投资目标与投资策略

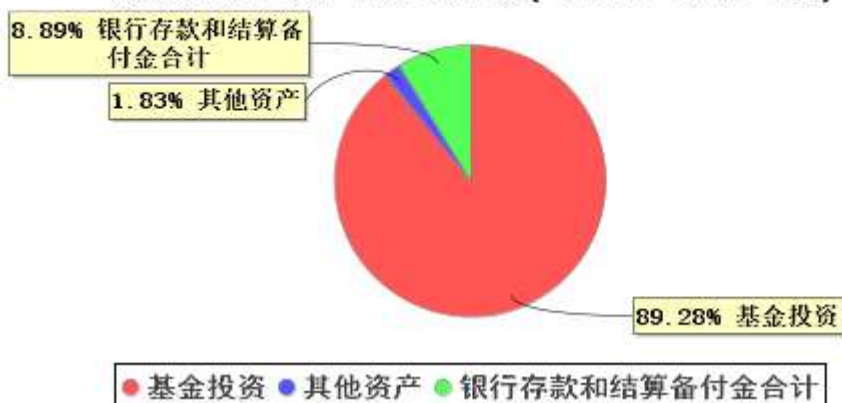
详见《大成纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（QDII）招募说明书》第四部分“基金的投资”。

投资目标	本基金主要通过投资于目标 ETF，紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资范围	本基金主要投资于目标 ETF、标的指数成份股（含存托凭证）、备选成份股（含存托凭证），以及以纳斯达克 100 指数为跟踪标的的其他公募基金、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）、

	<p>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。</p> <p>本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%，其中投资于现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）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%。</p> <p>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。</p>
主要投资策略	<p>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%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。</p> <p>一）目标 ETF 投资策略</p> <p>本基金主要通过交易所买卖或申购赎回的方式投资于目标 ETF。根据投资者申购、赎回的现金流情况，本基金将综合目标 ETF 的流动性、折溢价率、标的指数成份股流动性等因素分析，对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数。</p> <p>在投资运作过程中，本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用一级市场申购赎回的方式或二级市场买卖的方式对目标 ETF 进行投资。</p> <p>二）股票投资策略</p> <p>根据投资者申购、赎回的现金流情况，本基金将综合目标 ETF 的流动性、折溢价率、标的指数成份股流动性等因素分析，对投资组合进行监控和调整，也可以通过买入标的指数成份股、备选成份股紧密跟踪标的指数。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致无法获得足够数量的个券时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代，包括通过投资其他股票进行替代，以降低跟踪误差，优化投资组合的配置结构。</p> <p>三）衍生品投资策略</p> <p>本基金在金融衍生品的投资中主要遵循有效管理投资策略，对冲某些成份股的特殊突发风险和某些特殊情况下的流动性风险，以及利用金融衍生产品的杠杆作用，达到对标的指数的有效跟踪，同时降低仓位频繁调整带来的交易成本。本基金投资境外股指期货将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数，实现投资目标。</p>
业绩比较基准	纳斯达克 100 指数
风险收益特征	<p>本基金为 ETF 联接基金，主要通过投资于目标 ETF 来实现对标的指数的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现与标的指数及目标 ETF 的表现密切相关，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。</p>

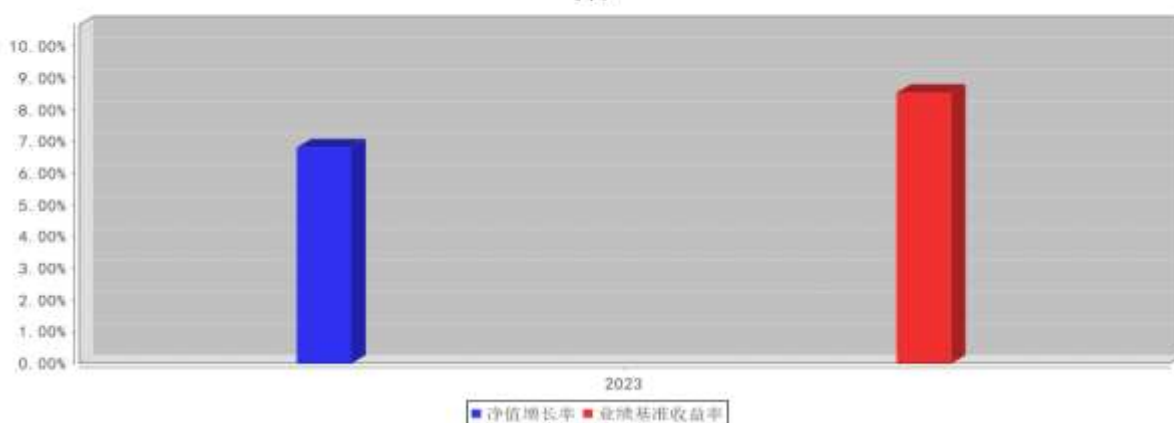
(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

投资组合资产配置图表(2024年3月31日)



(三) 自基金合同生效以来基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

大成纳斯达克100ETF联接(QDII)A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图 (2023年12月31日)



注：1、基金的过往业绩不代表未来表现。

2、如合同生效当年不满完整自然年度的，按实际期限计算净值增长率。

三、投资本基金涉及的费用

(一) 基金销售相关费用

以下费用在认购/申购/赎回基金过程中收取：

费用类型	份额 (S) 或金额 (M) / 持有期限 (N)	收费方式/费率
申购费 (前收费)	M < 50 万元	1.2%
	50 万元 ≤ M < 200 万元	1%
	200 万元 ≤ M < 500 万元	0.6%
	500 万元 ≤ M < 1000 万元	0.4%
	M ≥ 1000 万元	1,000 元/笔
赎回费	N < 7 天	1.5%
	7 天 ≤ N < 1 年	0.5%
	1 年 ≤ N < 2 年	0.25%
	N ≥ 2 年	0.0

注：养老金客户在基金管理人直销中心办理账户认证手续后，可享受申购费率一折优惠，申购费为固定金额的，则按原费率执行，不再享有费率折扣。

(二) 基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除：

费用类别	收费方式/年费率或金额	收取方
管理费	0.8%	基金管理人和销售机构
托管费	0.25%	基金托管人
审计费用	120,000.00 元	会计师事务所
信息披露费	120,000.00 元	规定披露报刊
其他费用	《基金合同》生效后与基金相关的律师费和诉讼费；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；基金的证券交易费用；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；基金的银行汇划费用；基金进行外汇兑换的相关费用；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）；与基金缴纳税收有关的手续费、汇款费等；基金投资目标 ETF 的相关费用（包括但不限于目标 ETF 的交易费用、申赎费用等）；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。	

注：（1）本基金交易证券等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。

（2）审计费用、信息披露费为基金整体承担费用，非单个份额类别费用，且年金额为预估值，最终实际金额以基金定期报告披露为准。

(三) 基金运作综合费用测算

若投资者认购/申购本基金份额，在持有期间，投资者需支出的运作费率如下表：

大成纳斯达克 100ETF 联接(QDII)A

基金运作综合费率（年化）
1.10%

注：基金管理费率、托管费率、销售服务费率（若有）为基金现行费率，其他运作费用以最近一次基金年报披露的相关数据为基准测算。

四、风险揭示与重要提示

(一) 风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。投资有风险，投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

本基金为投资于美国市场的股票型指数基金，其主要面临以下三类风险：一是境外投资的特殊风险，包括海外市场风险，汇率风险、政府管制风险、法律风险、政治风险以及税务风险；

二是本基金特有风险：

1. 指数授权风险

本基金管理人依据指数授权许可协议依法取得在中国境内发行纳斯达克 100 指数基金的权利。未来若出现标的指数不符合《指数基金指引》要求（因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指

数不符合要求及法律法规、监管机构另有规定的除外)、指数编制机构退出等情形,基金管理人应当自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案,如更换基金标的指数、转换运作方式,与其他基金合并、或者终止基金合同等,并在 6 个月内召集基金份额持有人大会进行表决。

自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定期间,基金管理人应按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作。

2. 金融模型风险

本基金为指数基金。指数基金的管理人会借用一定的金融模型来进行投资决策。然而任何金融模型都是建立在一定理论假设的基础之上,理论假设是对现实情况的高度抽象,这使得金融模型在实际运用当中可能会产生偏差。此外,在实际运作中,可能因市场结构、投资者行为模式等条件发生变动,导致有关模型出现重大偏离的问题,从而引起基金资产损失的风险。

3. 投资于目标 ETF 基金带来的风险

由于主要投资于目标 ETF,在多数情况下将维持较高的目标 ETF 投资比例,基金净值可能会随目标 ETF 的净值波动而波动,目标 ETF 的相关风险可能直接或间接成为本基金的风险。所以本基金会面临诸如目标 ETF 的管理风险与操作风险、目标 ETF 基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、目标 ETF 的技术风险等风险。

4. 跟踪偏离风险或导致跟踪误差未达约定目标的风险

5. 指数编制机构停止服务的风险

6. 成份股停牌的风险

标的指数成份股可能因各种原因临时或长期停牌,发生成份股停牌时可能面临如下风险:基金可能因无法及时调整投资组合而导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大。

7. 标的指数行业集中度风险

本基金跟踪的标的指数纳斯达克 100 指数成份股行业分布比较集中,主要集中在信息技术、可选消费和医疗保险三个行业。指数表现受上述三个行业,尤其是信息技术行业上市公司股价走势影响较大。

8. 其他投资于目标 ETF 的风险

如目标 ETF 基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、目标 ETF 参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险、目标 ETF 退市风险、申购赎回失败风险等等。

9. 衍生品投资风险

10. 证券借贷和正回购 / 逆回购风险

证券借贷、正回购 / 逆回购的主要风险在于交易对手风险,具体讲,对于证券借贷,作为证券借出方,如果交易对手方(即证券借入方)违约,则基金可能面临到期无法获得证券借贷收入甚至借出证券无法归还的风险,从而导致基金资产发生损失;对于正回购,交易期满时,可能会出现交易对手方未如约卖回已买入证券未如约支付售出证券产生的所有股息、利息和分红的风险;对于逆回购,交易期满时,可能会出现交易对手方未如约买回已售出证券的风险。

11. 启用侧袋机制的风险

三是开放式基金投资的一般风险,包括上市公司经营风险、流动性风险、信用风险、利率风险、大宗交易风险、会计核算风险、交易结算风险、操作或技术风险以及不可抗力风险。

(二) 重要提示

基金产品资料概要信息发生重大变更的,基金管理人将在三个工作日内更新,其他信息发生变更的,基金管理人每年更新一次。因此,本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后,如需及时、准确获取基金的相关信息,敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告等。

大成纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(QDII)(以下简称“本基金”)由大成纳斯达克 100 指数证券投资基金变更而来。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 号文注册募集,基金合同于 2014 年 11 月 13 日正式生效。自 2023 年 9 月 1 日起,大成纳斯达克 100 指数证券投资基金正式根据《大成纳斯达克 100 指数证券投资基金基金合同》的约定变

更为大成纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (QDII)。

中国证监会对本基金募集的注册或核准,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

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。

基金投资者自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。

五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站[www.dcfund.com.cn]客服电话[4008885558]

1. 大成纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (QDII) 基金合同、大成纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (QDII) 托管协议、大成纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (QDII) 招募说明书

2. 定期报告,包括基金季度报告、中期报告和年度报告

3. 基金份额净值

4. 基金销售机构及联系方式

5. 其他重要资料