

# 广发纳斯达克 100 指数证券投资基金

## 2016 年第 3 季度报告

2016 年 9 月 30 日

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一六年十月二十四日

## § 1 重要提示

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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 10 月 20 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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	广发纳斯达克 100 指数 (QDII)
基金主代码	270042
交易代码	270042
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012 年 8 月 15 日
报告期末基金份额总额	178,061,319.85 份
投资目标	本基金采用被动式指数化投资策略，通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，力求实现对标的指数的有效跟踪，追求跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金以追求标的指数长期增长的稳定收益为宗旨，在降低跟踪误差和控制流动性风险的双重约

	<p>束下构建指数化的投资组合。</p> <p>本基金力争控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度小于 0.5%，基金净值增长率与业绩比较基准之间的年跟踪误差不超过 5%。</p> <p>本基金对纳斯达克 100 指数成份股的投资比例不低于基金资产净值的 85%，对纳斯达克 100 指数备选成份股及以纳斯达克 100 指数为投资标的的交易型开放式指数基金（ETF）的投资比例不高于基金资产净值的 10%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。</p> <p>本基金主要采用完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成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进行相应调整。</p> <p>当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，基金管理人会对投资组合进行适当调整，降低跟踪误差。</p> <p>本基金将主要以降低跟踪误差和投资组合流动性管理为目的，综合考虑流动性和收益性，构建本基金债券和货币市场工具的投资组合。</p>
<p>业绩比较基准</p>	<p>人民币计价的纳斯达克 100 总收益指数收益率。</p>
<p>风险收益特征</p>	<p>本基金为股票型基金，风险和收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。</p>

基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
境外资产托管人英文名称	Bank of China(Hong Kong)
境外资产托管人中文名称	中国银行(香港)有限公司

### § 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

主要财务指标	报告期
	(2016 年 7 月 1 日-2016 年 9 月 30 日)
1.本期已实现收益	10,925,218.68
2.本期利润	32,598,384.01
3.加权平均基金份额本期利润	0.1673
4.期末基金资产净值	265,939,078.69
5.期末基金份额净值	1.494

注：1、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。

2、上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要低于所列数字。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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
过去三个月	12.08%	0.73%	10.90%	0.65%	1.18%	0.08%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

广发纳斯达克 100 指数证券投资基金  
 累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2012 年 8 月 15 日至 2016 年 9 月 30 日)



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
李耀柱	本基金的基金经理；广发全球农业指数（QDII）的基金经	2016-08-23	-	6 年	男，中国籍，理学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书，2010 年 8 月至 2014 年 7 月在广发基金管理有限公司中央交易部任股票交易员，2014 年 8 月至 2015 年 12 月在国际业务部先后任 QDII 基金的研究员、基金经理助理，2015 年 12 月 17 日起任广发纳指 100ETF 基金

	<p>理； 广发纳斯达克 100 指数 (QD II) 基金的基金经理； 广发美国房地产指数 (QDII) 基金的基金经理； 广发亚太中高收益债券 (QD II) 基金的基金经理； 广发全球医疗保健 (QD II) 基金的基金经理； 广发</p>				<p>的基金经理，2016 年 8 月 23 日起任广发全球农业指数(QDII)、广发纳斯达克 100 指数 (QDII)、广发美国房地产指数(QDII)、广发亚太中高收益债券 (QDII)、广发全球医疗保健(QDII)和广发生物科技指数(QDII)基金的基金经理。</p>
--	---	--	--	--	---

	生物科技指数 (QD II) 基金的基金经理				
邱炜	本基金的基金经理	2012-08-15	2016-08-23	9 年	男，中国籍，统计学博士，持有中国证券投资基金从业证书，2007 年 5 月至 2008 年 7 月在摩根大通集团（纽约）任高级分析师兼助理副总裁，2008 年 7 月至 2011 年 6 月任广发基金管理有限公司国际业务部研究员，2011 年 6 月 28 日至 2016 年 8 月 22 日任广发全球农业指数 (QDII) 基金的基金经理，2012 年 8 月 15 日至 2016 年 8 月 22 日任广发纳斯达克 100 指数 (QDII) 基金的基金经理，2013 年 8 月 9 日至 2016 年 8 月 22 日任广发美国房地产指数 (QDII) 基金的基金经理，2013 年 11 月 28 日至 2016 年 8 月 22 日任广发亚太中高收益债券 (QDII) 基金的基金经理，2013 年 12 月 10 日至 2016 年 8 月 22 日任广发全球医疗保健 (QDII) 基金的基金经理，2014 年 1 月 21 日至 2016 年 1 月 27 日任国际业务部副总经理，2015 年 1 月 14 日至 2016 年 1 月 27 日任另

					类投资部副总经理，2015 年 3 月 30 日至 2016 年 8 月 22 日任广发生物科技指数(QDII)基金的基金经理，2015 年 6 月 10 日至 2016 年 8 月 22 日任广发纳指 100ETF 基金的基金经理，2016 年 1 月 15 日至 2016 年 8 月 22 日任广发鑫享混合基金的基金经理，2016 年 1 月 28 日至 2016 年 9 月 24 日任国际业务部总经理。
--	--	--	--	--	--

注：1.“任职日期”和“离职日期”指公司公告聘任或解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规、《广发纳斯达克 100 指数证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金持有人利益的行为，基金的投资管理符合有关法规及基金合同的规定。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司通过建立科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控与及时的分析评估，保证公平交易原则的实现。

在投资决策的内部控制方面，公司制度规定投资组合投资的股票必须来源于备选股票库，重点投资的股票必须来源于核心股票库。公司建立了严格的投资授权制度，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易过程中，中央交易部按照“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”的原则，公平分配投资指令。监察稽核部风险控制岗

通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控及预警，实现投资风险的事中风险控制；稽核岗通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核，实现投资风险的事后控制。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，不同的投资组合受到了公平对待，未发生任何不公平的交易事项。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司原则上禁止不同投资组合之间（完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合除外）或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易。如果因应对大额赎回等特殊情况进行反向交易的，则需经公司领导严格审批并留痕备查。

本投资组合为完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合。本报告期内，本投资组合与本公司管理的其他投资组合发生过同日反向交易的情况，但成交较少的单边交易量不超过该证券当日成交量的 5%。这些交易不存在任何利益输送的嫌疑。

### 4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

七月，英国退欧的影响放缓，受到美联储鸽派意向、环球央行推行宽松的货币政策影响，美国股市大幅上扬，纳斯达克 100 指数大幅反弹并创出反弹新高。

八月，多家科技蓝筹股公布业绩，均超过市场预期，科技板块带领美国股市继续上行。同时 FOMC 声明对经济的前景乐观，但是短期加息的意愿不大，股指进一步上行。八月下旬公布的 FOMC 会议纪要显示在加息问题上，美联储官员存在分歧，市场在之后高位整固。

九月，由于部分美联储官员在公开场合演讲，在加息立场上鹰派，市场应声大跌。直到美联储九月的议息会不加息，并且表明低利率环境会延长一段时间，纳斯达克指数进一步上涨，并且创出新高。

总结三季度，美国股市大幅上行。主要由于环球央行的宽松预期导致。同时由于美国主要科技股如 FACEBOOK、亚马逊等科技股的业绩均超市场预期，纳斯达克 100 指数表现强劲。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金的净值增长率为 12.08%，同期业绩比较基准收益率为 10.90%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望四季度，美国加息问题将会影响四季度的行情。市场预期四季度美国将会加息一次，并预期流动性拐点将要出现，所以在四季度美国加息前，市场仍然会表现谨慎。同时，欧洲央行是否退出 QE 也会对市场产生影响。我们预计四季度美国以及全球股市波动会增大。但是我们还是继续看好纳斯达克 100 指数的中长期趋势。现在美国的科技公司慢慢由原来的互联网转向人工智能。过去的互联网实际是在提高效率和缩减成本，但是未来的人工智能将是大幅的提高劳动生产率，可以说是一个新的技术革新，这个市场是巨大的。而受益于这个浪潮的将会是美国有创新研发能力的科技巨头，如谷歌、FACEBOOK 和亚马逊。我们非常看好这个行业兴起而产生的巨大机会，纳斯达克 100 指数将持续看好。

### § 5 投资组合报告

#### 5.1 报告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	253,309,862.75	94.53
	其中：普通股	243,784,359.14	90.97
	存托凭证	9,525,503.61	3.55
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-

4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	5,378,390.92	2.01
8	其他各项资产	9,286,687.48	3.47
9	合计	267,974,941.15	100.00

## 5.2 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	253,309,862.75	95.25
合计	253,309,862.75	95.25

注：1、国家（地区）类别根据股票及存托凭证所在的证券交易所确定。

2、上述美国比重包括注册地为开曼群岛、英国在美国上市的 ADR。

## 5.3 报告期末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（%）
能源	-	-
材料	-	-
工业	4,574,461.81	1.72
非必须消费品	53,224,144.08	20.01
必须消费品	16,353,490.27	6.15
保健	29,627,182.98	11.14
金融	-	-
信息技术	146,709,210.24	55.17
电信服务	2,821,373.37	1.06
公共事业	-	-

合计	253,309,862.75	95.25
----	----------------	-------

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

#### 5.4 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股票及存托凭证投资明细

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 US	纳斯达克证券交易所	美国	36,254.00	27,369,061.46	10.29
2	MICROSOFT CORP	微软	MSFT US	纳斯达克证券交易所	美国	52,027.00	20,011,731.87	7.52
3	AMAZON.COM INC	亚马逊公司	AMZN US	纳斯达克证券交易所	美国	3,123.00	17,461,906.97	6.57
4	FACEBOOK INC-A	Facebook 公司	FB US	纳斯达克证券交易所	美国	15,302.00	13,107,102.63	4.93
5	ALPHABET INC-CL C	Alphabet 公司	GOOG US	纳斯达克证券交易所	美国	2,274.00	11,803,395.21	4.44
6	ALPHABET INC-CL A	Alphabet 公司	GOOGL US	纳斯达克证券交易所	美国	1,944.00	10,438,020.03	3.92
7	INTEL CORP	英特尔公司	INTC	纳斯达克	美国	31,254.00	7,878,725.54	2.96

			US	证券交易所				
8	COMCAST CORP-CLASS A	康卡斯特	CMCSA US	纳斯达克证券交易所	美国	16,004.00	7,089,856.05	2.67
9	CISCO SYSTEMS INC	思科	CSCO US	纳斯达克证券交易所	美国	33,291.00	7,051,693.49	2.65
10	AMGEN INC	安进	AMGN US	纳斯达克证券交易所	美国	4,973.00	5,539,543.15	2.08

#### 5.5 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。

#### 5.6 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。

#### 5.7 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。

#### 5.8 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

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值 (人民币元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	股指期货	NASDAQ 100 E-MINI Sep16	0.00	0.00
-	-	-	-	-
-	-	-	-	-
-	-	-	-	-
-	-	-	-	-

注：股指期货投资采用当日无负债结算制度，相关价值已包含在结算备付

金中。

### 5.9 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。

### 5.10 投资组合报告附注

5.10.1 根据公开市场信息，本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.10.2 报告期内本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

#### 5.10.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	9,191,669.96
3	应收股利	94,652.74
4	应收利息	364.78
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,286,687.48

#### 5.10.4 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。

#### 5.10.5 报告期末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股票中不存在流通受限情况。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	217,252,880.11
本报告期基金总申购份额	6,129,487.90

减：本报告期基金总赎回份额	45,321,048.16
本报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	178,061,319.85

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人不存在运用固有资金（认）申购、赎回或买卖本基金的情况。

## § 8 备查文件目录

### 8.1 备查文件目录

- 1.中国证监会批准广发纳斯达克 100 指数证券投资基金募集的文件
- 2.《广发纳斯达克 100 指数证券投资基金基金合同》
- 3.《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》
- 4.《广发纳斯达克 100 指数证券投资基金托管协议》
- 5.法律意见书
- 6.基金管理人业务资格批件、营业执照
- 7.基金托管人业务资格批件、营业执照

### 8.2 存放地点

广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

### 8.3 查阅方式

1.书面查阅：查阅时间为每工作日 8:30-11:30，13:30-17:00。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件；

2.网站查阅：基金管理人网址：<http://www.gffunds.com.cn>。

投资者如对本报告有疑问，可咨询本基金管理人广发基金管理有限公司，咨询电话 95105828 或 020-83936999，或发电子邮件：[services@gf-funds.com.cn](mailto:services@gf-funds.com.cn)。

广发基金管理有限公司  
二〇一六年十月二十四日