

国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金 2016 年第 4 季度报告

2016-12-31

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2017-01-21

[目录全部展开](#) [目录全部收拢](#)

重要提示

基金产品概况

基金基本情况

主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标

基金净值表现

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

自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较

管理人报告

基金经理（或基金经理小组）简介

境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

公平交易专项说明

公平交易制度的执行情况

异常交易行为的专项说明

报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

投资组合报告

报告期末基金资产组合情况

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

报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

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

报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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

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

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

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

投资组合报告附注

受到调查以及处罚情况

申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

其他资产构成

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

投资组合报告附注的其他文字描述部分

开放式基金份额变动

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

备查文件目录

备查文件目录

存放地点

查阅方式

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 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 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

基金基本情况

项目

数值

基金简称

国泰纳斯达克 100 指数（QDII）

场内简称

基金主代码

160213

基金运作方式

契约型开放式

基金合同生效日

2010-04-29

报告期末基金份额总额

182,236,383.24

投资目标

通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，以低成本、低换手率实现本基金对纳斯达克 100 指数（Nasdaq-100 Index,以下简称“标的指数”）的有效跟踪，追求跟踪误差最小化。

投资策略

本基金原则上采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构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。但因特殊情况导致基金无法及时获得足够数量的股票时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。

本基金的风险控制目标是追求日均跟踪误差不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 5%（注：以美元资产计价计算）。

业绩比较基准

纳斯达克 100 指数（Nasdaq-100 Index）收益率（总收益指数收益率）（注：以美元计价计算）。

风险收益特征

本基金属于股票型基金，预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，跟踪标的指数市场表现，目标为获取市场平均收益，是股票基金中处于中等风险水平的基金产品。

基金管理人

国泰基金管理有限公司

基金托管人

中国建设银行股份有限公司

境外资产托管人

英文名称：State Street Bank and Trust Company

中文名称：美国道富银行

主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标

报告期（2016-10-01 至 2016-12-31）

本期已实现收益

16,994,030.50

本期利润

14,354,720.38

加权平均基金份额本期利润

0.0764

期末基金资产净值

419,510,083.87

期末基金份额净值

2.302

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）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要低于所列数字。

基金净值表现

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

3.46%

0.84%

0.08%

0.78%

3.38%

0.06%

注：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。
自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较

注：（1）本基金的合同生效日为 2010 年 4 月 29 日。本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

（2）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。

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

徐皓

本基金的基金经理、国泰国证新能源汽车指数（LOF）、国泰国证房地产行业指数分级、国泰纳斯达克 100（QDII-ETF）、国泰国证有色金属行业指数分级、国泰创业板指数（LOF）的基金经理

2014-11-04

-

9 年

硕士研究生，FRM，注册黄金投资分析师（国家一级）。曾任职于中国工商银行总行资产托管部。2010 年 5 月加盟国泰基金，任高级风控经理。2011 年 6 月至 2014 年 1 月担任上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金及国泰沪深 300 指数证券投资基金的基金经理助理，2012 年 3 月至 2014 年 1 月兼任中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金、国泰中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理助理。2014 年 1 月至 2015 年 8 月任国泰中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理，2014 年 1 月至 2015 年 8 月任中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2014 年 6 月起兼任国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金的基金经理，2014 年 11 月起兼任国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金和纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2015 年 3 月起兼任国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金的基金经理，2015 年 8 月至 2016 年 6 月任国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金（原中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金）的基金经理，2016 年 7 月 1 日起任国泰国证新能源汽车指数证券投资基金（LOF）（原国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金）的基金经理，2016 年 11 月起兼任国泰创业板指数证券投资基金（LOF）的基金经理。

吴向军

本基金的基金经理、国泰中国企业境外高收益债、国泰美国房地产开发股票（QDII）、国

泰大宗商品配置证券投资基金(LOF)、国泰全球绝对收益(QDII-FOF)的基金经理、国际业务部副总监(主持工作)

2015-07-14

-

12年

硕士研究生。2004年6月至2007年6月在美国Avera Global Partners工作,担任股票分析师;2007年6月至2011年4月美国Security Global Investors工作,担任高级分析师。2011年5月起加盟国泰基金管理有限公司,2013年4月起任国泰中国企业境外高收益债券型证券投资基金的基金经理,2013年8月起兼任国泰美国房地产开发股票型证券投资基金的基金经理,2015年7月起任国泰纳斯达克100指数证券投资基金和国泰大宗商品配置证券投资基金(LOF)的基金经理,2015年12月起任国泰全球绝对收益型基金优选证券投资基金的基金经理。2015年8月至2016年6月任国际业务部副总监,2016年6月起任国际业务部副总监(主持工作)。

注:1、此处的任职日期和离任日期均指公司决定生效之日,首任基金经理,任职日期为基金合同生效日。

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。

境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

姓名

在境外投资顾问所任职务

证券从业年限

说明

报告期内本基金运作合规守信情况说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《基金管理公司公平交易制度指导意见》等有关法律法规的规定,严格遵守基金合同和招募说明书约定,本着诚实信用、勤勉尽责、最大限度保护投资人合法权益等原则管理和运用基金资产,在控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。本报告期内,本基金运作合法合规,未发生损害基金份额持有人利益的行为,未发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为,信息披露及时、准确、完整,本基金与本基金管理人管理的其他基金资产、投资组合与公司资产之间严格分开、公平对待,基金管理小组保持独立运作,并通过科学决策、规范运作、精心管理和健全内控体系,有效保障投资人的合法权益。

公平交易专项说明

公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定,通过严格的内部风险控制制度和流程,对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制,严格控制不同投资组合之间的同日反向交易,严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易,确保公平对待所管理的所有基金和投资组合,切实防范利益输送行为。

异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金与本基金管理人管理的其他投资组合未发生大额同日反向交易。本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前美国良好的就业数据和通胀数据都支持美联储释放加快升息节奏的信号,虽然加息在一定程度上不利于企业融资,但整体来看美国实际利率在经历两次加息后依然较低,企业

盈利能力仍有望继续提高。此外，随着 2008 年金融危机以后美国楼市、股市和就业市场都已经经历了较为彻底的调整，释放了矛盾并且利空出尽，使得美股基本面开始周期性恢复。当前美国各主要经济数据中，除了债务指标依然偏高外，其他诸如投资、消费、就业等都已进入良性循环，这证明了当前美国经济正处于良性扩张的局面。美股上涨过程是不断消化利空、恢复信心、长期向上的过程，随着美国经济稳步复苏及美元对全球其他主要货币的升值预期不改，美元资产对全球资金的吸引力正在不断提高，高配美股或将是未来确定性较强的配置。国泰纳指 100 是国内首只跟踪海外指数的 QDII 产品，汇聚了目前全世界具有核心竞争力、拥有革命性技术的公司，投资者可充分利用国泰纳斯达克 100 指数基金（160213）的投资价值。

报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明
无。

投资组合报告

报告期末基金资产组合情况

序号

项目

金额（元）

占基金总资产的比例（%）

1

权益投资

365,759,540.45

86.47

其中：普通股

365,759,540.45

86.47

存托凭证

-

-

2

基金投资

17,281,135.30

4.09

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

39,814,847.61

9.41

8

其他各项资产

129,233.91

0.03

9

合计

422,984,757.27

100.00

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（元）

占基金资产净值比例（%）

美国

365,759,540.45

87.19

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（元）	
占基金资产净值比例（%）	
信息技术	
211,213,506.63	
50.35	
非必需消费品	
78,458,588.28	
18.70	
保健	
41,511,851.95	
9.90	
必需消费品	
23,815,008.19	
5.68	
工业	
6,413,063.92	
1.53	
电信服务	
4,347,521.48	
1.04	
材料	
-	
-	
合计	
365,759,540.45	
87.19	

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。
 报告期末积极投资按行业分类的权益投资组合

行业类别	
公允价值（元）	
占基金资产净值比例（%）	

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。
 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
 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	
占基金资产净值比例（%）	

1

APPLE INC

苹果公司

AAPL US

纳斯达克

美国

52,822

42,439,484.11

10.12

2

MICROSOFT CORP

微软公司

MSFT US

纳斯达克

美国

69,835

30,103,436.85

7.18

3

AMAZON.COM INC

亚马逊公司

AMZN US

纳斯达克

美国

4,622

24,042,942.33

5.73

4

FACEBOOK INC-A

脸书

FB US

纳斯达克

美国

23,600

18,835,203.66

4.49

5

ALPHABET INC-CL C

ALPHABET 公司

GOOG US

纳斯达克

美国

3,224

17,261,667.86

4.11

6

ALPHABET INC-CL A

ALPHABET 公司

GOOGL US

纳斯达克

美国

2,811

15,452,701.30

3.68

7

INTEL CORP

英特尔公司

INTC US

纳斯达克

美国

45,096

11,346,378.63

2.70

8

COMCAST CORP-CLASS A

康卡斯特

CMCSA US

纳斯达克

美国

22,631

10,840,245.61

2.58

9

CISCO SYSTEMS INC

思科公司

CSCO US

纳斯达克

美国

47,646

9,988,323.53

2.38

10

AMGEN INC

安进公司

AMGN US

纳斯达克

美国

7,785

7,896,004.52

1.88

报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

序号

债券代码

债券名称

数量

公允价值（元）

占基金资产净值比例（%）

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细

注：本基金本报告期末未持有金融衍生品。

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

序号

基金名称

基金类型

运作方式

管理人

公允价值（元）

占基金资产净值比例（%）

1

PROSHARES ULTRAPRO QQQ

ETF 基金

开放式

ProShares Trust

14,651,068.87

3.49

2

POWERSHARES QQQ NASDAQ 100

ETF 基金

开放式

Invesco Powershares Capital

2,630,066.43

0.63

投资组合报告附注

受到调查以及处罚情况

本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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的情况。

其他资产构成

单位：人民币元

序号

名称

金额（元）

1

存出保证金

-

2

应收证券清算款

-

3

应收股利

123,408.05

4

应收利息

5,825.86

5

应收申购款

-

6

其他应收款

-

7

待摊费用

-

9

其他

-

10

合计

129,233.91

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有可转换债券。

报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

投资组合报告附注的其他文字描述部分

开放式基金份额变动

单位：份

项目

数值

报告期期初基金份额总额

194,613,232.89

报告期期间基金总申购份额

减：报告期期间基金总赎回份额

12,376,849.65

报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）

报告期期末基金份额总额

182,236,383.24

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号

交易方式

交易日期

交易份额（份）

交易金额（元）

适用费率

合计

注：本报告期内，本基金的基金管理人未运用固有资金投资本基金。截至本报告期末，本基金管理人未持有本基金。

报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目

持有份额总数

持有份额占基金总份额比例

发起份额总数

发起份额占基金总份额比例

发起份额承诺持有期限

基金管理人固有资金

-%

-%

基金管理人高级管理人员

-%

-%

基金经理等人员

-%

-%

基金管理人股东

-%

-%

其他

-%

-%

合计

-%

-%

备查文件目录

1、关于核准国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金募集的批复

2、国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金基金合同

3、国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金托管协议

4、报告期内披露的各项公告

5、法律法规要求备查的其他文件

存放地点

本基金管理人国泰基金管理有限公司办公地点——上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 16 层-19 层。

本基金托管人中国建设银行股份有限公司办公地点——北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼。

查阅方式

可咨询本基金管理人；部分备查文件可在本基金管理人公司网站上查阅。

客户服务中心电话：（021）31089000，400-888-8688

客户投诉电话：（021）31089000

公司网址：<http://www.gtfund.com>