

B122 信息披露 Disclosure

广发纳斯达克100指数证券投资基金

2014 第二季度报告

基金管理人:广发基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2014年7月18日

1.1 重要提示
基金管理人及基金托管人本报告所载数据不存在虚假记载、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法律责任。
基金管理人广发银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2014年7月16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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,基金的投资有风险,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。
本报告期内基金未发生涉及诉讼的事项。
本报告日期为2014年4月1日起至6月30日止。

4.1 基金产品概况

基金名称	广发纳斯达克100指数证券投资基金
基金代码	270024
交易代码	270024
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年8月16日
报告期末基金份额总额	182,962,707.66

投资策略
本基金主要投资于纳斯达克100指数成份股,通过严格的资产配置手段,分享美国经济的长期增长,追求长期资本增值。
本基金主要投资于纳斯达克100指数成份股,通过严格的资产配置手段,分享美国经济的长期增长,追求长期资本增值。
本基金主要投资于纳斯达克100指数成份股,通过严格的资产配置手段,分享美国经济的长期增长,追求长期资本增值。

5.1 主要财务指标

主要财务指标		报告期(2014年4月1日-2014年6月30日)	
1.本期已实现收益		2,795,574.65	
2.本期利润		14,637,433.86	
3.加权平均基金份额本期利润		0.0804	
4.期末基金份额净值		239,581,709.00	
5.期末基金份额净值增长率		1.310	

6.1 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为纳斯达克100指数收益率。本基金业绩比较基准为纳斯达克100指数收益率。本基金业绩比较基准为纳斯达克100指数收益率。

5.1 投资组合报告

5.1.1 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	214,923,801.69	89.71
2	其中:普通股	210,785,470.87	83.06
3	存托凭证	4,138,330.82	1.63
4	基金投资	13,722,974.39	5.41
5	其中:债券	-	-
6	资产支持证券	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
9	货币市场工具	-	-
10	银行存款和结算备付金合计	22,633,452.11	8.92
11	其他各项资产	2,488,239.73	0.98
12	合计	253,768,454.41	100.00

5.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

行业	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
美国	214,923,801.69	89.71
合计	214,923,801.69	89.71

5.1.3 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投资明细

序号	股票代码	股票名称	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	48,960	27,994,334.31	11.68
2	MICROSOFT CORP	微软	67,073	17,209,037.66	7.18
3	GOOGLE INC-CL C	谷歌公司	2,738	9,691,377.66	4.05
4	GOOGLE INC-CL A	谷歌公司	2,287	8,227,156.78	3.43
5	INTEL CORP	英特尔	40,420	7,684,711.84	3.21
6	AMAZON COM INC	亚马逊	3,736	7,465,672.65	3.12
7	FACEBOOK INC-A	脸书	16,189	6,702,607.3	2.80
8	QUALCOMM INC	高通	13,765	6,678,470.62	2.79
9	GILEAD SCIENCES	吉利科学	12,649	6,360,794.11	2.65
10	CISCO SYSTEMS INC	思科	41,955	6,339,754.04	2.65

6.5 报告期末按市值分类的债券投资组合
本基金本报告期末持有债券。
6.6 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债券投资明细
本基金本报告期末持有债券。
6.7 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资产支持证券投资明细
本基金本报告期末持有资产支持证券。
6.8 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衍生金融工具投资明细
本基金本报告期末持有衍生金融工具。
6.9 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贵金属投资明细
本基金本报告期末持有贵金属。
6.10 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其他资产投资明细
本基金本报告期末持有其他资产。

5.1.4 投资组合报告附注
1.1 本基金报告期内未持有股票期权。
1.2 本基金报告期内未持有股指期货。
1.3 本基金报告期内未持有国债期货。
1.4 本基金报告期内未持有权证。
1.5 本基金报告期内未持有融资融券。
1.6 本基金报告期内未持有股指期货。
1.7 本基金报告期内未持有国债期货。
1.8 本基金报告期内未持有权证。
1.9 本基金报告期内未持有融资融券。
1.10 本基金报告期内未持有股指期货。
1.11 本基金报告期内未持有国债期货。
1.12 本基金报告期内未持有权证。
1.13 本基金报告期内未持有融资融券。

基金管理人:广发基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2014年7月18日

1.1 重要提示
基金管理人及基金托管人本报告所载数据不存在虚假记载、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法律责任。
基金管理人广发银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2014年7月16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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,基金的投资有风险,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。
本报告期内基金未发生涉及诉讼的事项。
本报告日期为2014年4月1日起至6月30日止。

4.1 基金产品概况

基金名称	广发钱袋子货币市场基金
基金代码	000509
交易代码	000509
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年1月10日
报告期末基金份额总额	2,245,012,181.39

投资策略
本基金主要投资于货币市场工具,通过严格的资产配置手段,分享货币市场的长期增长,追求长期资本增值。
本基金主要投资于货币市场工具,通过严格的资产配置手段,分享货币市场的长期增长,追求长期资本增值。
本基金主要投资于货币市场工具,通过严格的资产配置手段,分享货币市场的长期增长,追求长期资本增值。

5.1 主要财务指标

主要财务指标		报告期(2014年4月1日-2014年6月30日)	
1.本期已实现收益		19,556,590.12	
2.本期利润		19,556,590.12	
3.期末基金份额净值		2,245,012,181.39	

6.1 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为一年期定期存款利率。本基金业绩比较基准为一年期定期存款利率。本基金业绩比较基准为一年期定期存款利率。

5.1 投资组合报告

5.1.1 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	现金	900,694,558.68	34.53
2	其中:货币存款	900,694,558.68	34.53
3	买入返售金融资产	494,001,501.00	18.94
4	银行存款和结算备付金合计	1,189,893,853.74	45.62
5	其他各项资产	23,518,369.79	0.90
6	合计	2,608,108,283.21	100.00

5.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

行业	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
美国	214,923,801.69	89.71
合计	214,923,801.69	89.71

5.1.3 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投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	011424002	14中债SCP002	1,000,000.00	100,319,301.13	4.47
2	071422005	14开普债券CP05	900,000.00	90,006,404.22	4.01
3	041458049	14中债CP03	600,000.00	60,001,987.97	2.67
4	011470005	14国债逆回购005	500,000.00	50,126,757.40	2.23
5	140410	14央行工	500,000.00	50,050,435.82	2.23
6	041609031	14鲁鲁工CP01	500,000.00	50,032,538.03	2.23
7	011478002	14沪电SCP002	500,000.00	49,997,627.16	2.23
8	071423003	14长城债券CP03	400,000.00	39,993,210.67	1.78
9	041458021	14川新CP01	300,000.00	30,157,192.34	1.34
10	041452020	14南水CP01	300,000.00	30,042,275.99	1.34

6.5 报告期末按市值分类的债券投资组合
本基金本报告期末持有债券。
6.6 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债券投资明细
本基金本报告期末持有债券。
6.7 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资产支持证券投资明细
本基金本报告期末持有资产支持证券。
6.8 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衍生金融工具投资明细
本基金本报告期末持有衍生金融工具。
6.9 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贵金属投资明细
本基金本报告期末持有贵金属。
6.10 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其他资产投资明细
本基金本报告期末持有其他资产。

5.1.4 投资组合报告附注
1.1 本基金报告期内未持有股票期权。
1.2 本基金报告期内未持有股指期货。
1.3 本基金报告期内未持有国债期货。
1.4 本基金报告期内未持有权证。
1.5 本基金报告期内未持有融资融券。
1.6 本基金报告期内未持有股指期货。
1.7 本基金报告期内未持有国债期货。
1.8 本基金报告期内未持有权证。
1.9 本基金报告期内未持有融资融券。
1.10 本基金报告期内未持有股指期货。
1.11 本基金报告期内未持有国债期货。
1.12 本基金报告期内未持有权证。
1.13 本基金报告期内未持有融资融券。

基金管理人:广发基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2014年7月18日

1.1 重要提示
基金管理人及基金托管人本报告所载数据不存在虚假记载、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法律责任。
基金管理人广发银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2014年7月16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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,基金的投资有风险,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。
本报告期内基金未发生涉及诉讼的事项。
本报告日期为2014年4月1日起至6月30日止。

4.1 基金产品概况

基金名称	广发趋势优选灵活配置混合型证券投资基金
基金代码	000510
交易代码	000510
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年9月11日
报告期末基金份额总额	69,857,323.58

投资策略
本基金主要投资于股票、债券、货币市场工具,通过严格的资产配置手段,分享中国股市的长期增长,追求长期资本增值。
本基金主要投资于股票、债券、货币市场工具,通过严格的资产配置手段,分享中国股市的长期增长,追求长期资本增值。
本基金主要投资于股票、债券、货币市场工具,通过严格的资产配置手段,分享中国股市的长期增长,追求长期资本增值。

5.1 主要财务指标

主要财务指标		报告期(2014年4月1日-2014年6月30日)	
1.本期已实现收益		-4,013,720.59	
2.本期利润		1,855,738.22	
3.加权平均基金份额本期利润		0.0260	
4.期末基金份额净值		70,896,722.73	
5.期末基金份额净值增长率		1.019	

6.1 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为沪深300指数收益率。本基金业绩比较基准为沪深300指数收益率。本基金业绩比较基准为沪深300指数收益率。

5.1 投资组合报告

5.1.1 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	54,949,049.54	76.36
2	其中:普通股	54,949,049.54	76.36
3	基金投资	-	-
4	存托凭证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	资产支持证券	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	4,827,558.78	6.76
8	其他各项资产	11,091,875.72	15.68
9	合计	71,897,484.04	100.00

5.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

行业	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
农林牧渔	-	-
采矿业	-	-
制造业	41,920,135.54	59.13
电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,112,000.00	5.80
建筑业	-	-
批发和零售业	6,849,414.00	9.66
交通运输、仓储和邮政业	-	-
住宿和餐饮业	-	-
信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
金融业	-	-
房地产业	2,067,500.00	2.92
L 租赁和商务服务业	-	-
M 科学研究和技术服务业	-	-
N 水利、环境和公共设施管理业	-	-
O 居民服务、修理和其他服务业	-	-
P 教育	-	-
Q 卫生和社会工作	-	-
R 文化、体育和娱乐业	-	-
S 综合	-	-
合计	54,949,049.54	77.50

5.1.3 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投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	600594	益佰制药	185,000	7,058,050.00	9.96
2	600079	人福医药	186,963	5,580,845.55	7.87
3	000963	华东医药	89,841	4,851,414.00	6.84
4	600323	南海发展	320,000	4,112,000.00	5.80
5	000400	许继电气	195,003	3,909,750.99	5.51
6	000513	顺电集团	75,013	3,542,863.99	5.00
7	600887	伊泰股份	105,000	3,477,600.00	4.91
8	000222	科华生物	135,000	3,111,750.00	4.39
9	600557	康隆药业	90,000	2,583,000.00	3.64
10	600703	三安光电	100,000	2,246,000.00	3.17

6.5 报告期末按市值分类的债券投资组合
本基金本报告期末持有债券。
6.6 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债券投资明细
本基金本报告期末持有债券。
6.7 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资产支持证券投资明细
本基金本报告期末持有资产支持证券。
6.8 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衍生金融工具投资明细
本基金本报告期末持有衍生金融工具。
6.9 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贵金属投资明细
本基金本报告期末持有贵金属。
6.10 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其他资产投资明细
本基金本报告期末持有其他资产。

5.1.4 投资组合报告附注
1.1 本基金报告期内未持有股票期权。
1.2 本基金报告期内未持有股指期货。
1.3 本基金报告期内未持有国债期货。
1.4 本基金报告期内未持有权证。
1.5 本基金报告期内未持有融资融券。
1.6 本基金报告期内未持有股指期货。
1.7 本基金报告期内未持有国债期货。
1.8 本基金报告期内未持有权证。
1.9 本基金报告期内未持有融资融券。
1.10 本基金报告期内未持有股指期货。
1.11 本基金报告期内未持有国债期货。
1.12 本基金报告期内未持有权证。
1.13 本基金报告期内未持有融资融券。