

广发纳斯达克100指数证券投资基金

2014年度报告摘要

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：2015年3月30日

1.1 重要提示

基金管理人、基金托管人、基金销售机构等披露的信息均不存在虚假记载、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。本年度报告已经经过以上关联方签字盖章，并由本会长签字。

基金管理人中国银行股份有限公司根据中国证监会有关规定，于2015年3月24日复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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或及时赎回。投资者风险，投资者在作出投资决策前应先仔细阅读本基金的招募说明书及其投资。

基金管理人于本年度报告正文“投资者须知”章节中提供了了解基金具体情况，应阅读年度报告正文。本年度报告自2015年3月11日起可在3月31日前。

基金简称	广发纳斯达克100指数(QDII)
基金代码	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
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
报告期基金份额总额	172,612,418.24
基金份额持有人数	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标

本基金采用被动式指数投资策略，通过严格的投资程序实现数量化风险管理手段，力求取得与标的指数相近的投资回报，追求跟踪偏离度最小。

基金运作方式

本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，力求跟踪偏离度最小。在股指期货及其他金融衍生品的运用上，本基金将根据基金资产净值增长率与标的指数同期日均跟踪偏离度不超过±0.5%，基金净值增长率与标的指数收益率之间的跟踪误差不得超过±2.5%。

投资策略

本基金跟踪标的指数100指数的投资策略为：按照标的指数的成分股及其权重构建跟踪组合。当跟踪标的指数成份股发生变化或发生配股、增发、分红等行为时，以及因基金的申购和赎回导致基金净资产规模发生较大波动时，基金经理会对跟踪组合进行动态调整，以保持投资组合的净资产净值与标的指数的表现一致，并使跟踪误差控制在限定的范围之内。

名称	基金经理人	基金托管人
基金管理人	广发基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司	中国银行股份有限公司
基金经理	王杰	王杰

姓名	职位	姓名	职位
王杰	基金经理	王杰	基金经理
李琦	副经理	李琦	副经理
张明	副经理	张明	副经理

项目	单位
基金管理人	人民币元
基金托管人	人民币元
基金份额持有人	人民币元
基金资产净值	人民币元
基金净资产	人民币元
基金总资产	人民币元
基金总负债	人民币元

项目	本期	上期
基金资产净值	172,612,418.24	172,612,418.24
基金总资产	172,612,418.24	172,612,418.24
基金总负债	0	0
基金净资产	172,612,418.24	172,612,418.24

2.3 基金管理人

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

基金管理人地址：广州黄埔大道西62号
基金托管人地址：北京市西城区金融大街28号

项目	本期	上期
基金资产净值	172,612,418.24	172,612,418.24
基金总资产	172,612,418.24	172,612,418.24
基金总负债	0	0
基金净资产	172,612,418.24	172,612,418.24

项目	本期	上期
基金资产净值	172,612,418.24	172,612,418.24
基金总资产	172,612,418.24	172,612,418.24
基金总负债	0	0
基金净资产	172,612,418.24	172,612,418.24

项目	本期	上期
基金资产净值	172,612,418.24	172,612,418.24
基金总资产	172,612,418.24	172,612,418.24
基金总负债	0	0
基金净资产	172,612,418.24	172,612,418.24

项目	本期	上期
基金资产净值	172,612,418.24	172,612,418.24
基金总资产	172,612,418.24	172,612,418.24
基金总负债	0	0
基金净资产	172,612,418.24	172,612,418.24

项目	本期	上期
基金资产净值	172,612,418.24	172,612,418.24
基金总资产	172,612,418.24	172,612,418.24
基金总负债	0	0
基金净资产	172,612,418.24	172,612,418.24

项目	本期	上期
基金资产净值	172,612,418.24	172,612,418.24
基金总资产	172,612,418.24	172,612,418.24
基金总负债	0	0
基金净资产	172,612,418.24	172,612,418.24

项目	本期	上期
基金资产净值	172,612,418.24	172,612,418.24
基金总资产	172,612,418.24	172,612,418.24
基金总负债	0	0
基金净资产	172,612,418.24	172,612,418.24

项目	本期	上期
基金资产净值	172,612,418.24	172,612,418.24
基金总资产	172,612,418.24	172,612,418.24
基金总负债	0	0
基金净资产	172,612,418.24	172,612,418.24

项目	本期	上期
基金资产净值	172,612,418.24	172,612,418.24
基金总资产	172,612,418.24	172,612,418.24
基金总负债	0	0
基金净资产	172,612,418.24	172,612,418.24

项目	本期	上期
基金资产净值	172,612,418.24	172,612,418.24
基金总资产	172,612,418.24	172,612,418.24
基金总负债	0	0
基金净资产	172,612,418.24	172,612,418.24

项目	本期	上期
基金资产净值	172,612,418.24	172,612,418.24
基金总资产	172,612,418.24	172,612,418.24
基金总负债	0	0
基金净资产	172,612,418.24	172,612,418.24

项目	本期	上期
基金资产净值	172,612,418.24	172,612,418.24
基金总资产	172,612,418.24	172,612,418.24
基金总负债	0	0
基金净资产	172,612,418.24	172,612,418.24

本报告期内，上述公司交易制度总体执行情况良好。通过对本年度该组合与公司其余各组合的对比，3月1日至3月31日期间的交易制度执行情况良好。本报告披露与实际控制在不同期间进行不同交易在足够的样本且差异率均能显著不超于的情况，表明报告期内该组合未发生可能损害不公平交易和利益输送的异常情形。

4.1 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.1.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2014年，纳斯达克100指数在年初上涨后，3月份美股经历了一波调整行情，尤其是前期涨幅较大。3月份调整行情主要是由科技股率先调整引发的，随后其他板块跟进调整。进入3月份，美股市场在科技股率先调整后，开始企稳回升，并带动其他板块跟进调整。进入3月份，纳斯达克100指数在年初上涨后，3月份美股经历了一波调整行情，尤其是前期涨幅较大。3月份调整行情主要是由科技股率先调整引发的，随后其他板块跟进调整。进入3月份，美股市场在科技股率先调整后，开始企稳回升，并带动其他板块跟进调整。

4.2 报告期内基金净值表现

本报告期基金份额净值增长率为14.4%，同期比较业绩基准收益率为22.46%。

本报告期基金份额净值增长率为14.4%，同期比较业绩基准收益率为22.46%。

4.3 基金管理人内部控制的说明

基金管理人建立了健全内部控制体系，加强对交易环节的内部控制，并通过及时的行行为监控及及时的评估，保证公平交易原则的贯彻。

基金管理人建立了健全内部控制体系，加强对交易环节的内部控制，并通过及时的行行为监控及及时的评估，保证公平交易原则的贯彻。

4.4 基金管理人内部控制的说明

基金管理人建立了健全内部控制体系，加强对交易环节的内部控制，并通过及时的行行为监控及及时的评估，保证公平交易原则的贯彻。

基金管理人建立了健全内部控制体系，加强对交易环节的内部控制，并通过及时的行行为监控及及时的评估，保证公平交易原则的贯彻。

4.5 基金管理人内部控制的说明

基金管理人建立了健全内部控制体系，加强对交易环节的内部控制，并通过及时的行行为监控及及时的评估，保证公平交易原则的贯彻。

基金管理人建立了健全内部控制体系，加强对交易环节的内部控制，并通过及时的行行为监控及及时的评估，保证公平交易原则的贯彻。

4.6 基金管理人内部控制的说明

基金管理人建立了健全内部控制体系，加强对交易环节的内部控制，并通过及时的行行为监控及及时的评估，保证公平交易原则的贯彻。

基金管理人建立了健全内部控制体系，加强对交易环节的内部控制，并通过及时的行行为监控及及时的评估，保证公平交易原则的贯彻。

4.7 基金管理人内部控制的说明

基金管理人建立了健全内部控制体系，加强对交易环节的内部控制，并通过及时的行行为监控及及时的评估，保证公平交易原则的贯彻。

基金管理人建立了健全内部控制体系，加强对交易环节的内部控制，并通过及时的行行为监控及及时的评估，保证公平交易原则的贯彻。

4.8 基金管理人内部控制的说明

基金管理人建立了健全内部控制体系，加强对交易环节的内部控制，并通过及时的行行为监控及及时的评估，保证公平交易原则的贯彻。

基金管理人建立了健全内部控制体系，加强对交易环节的内部控制，并通过及时的行行为监控及及时的评估，保证公平交易原则的贯彻。

4.9 基金管理人内部控制的说明

基金管理人建立了健全内部控制体系，加强对交易环节的内部控制，并通过及时的行行为监控及及时的评估，保证公平交易原则的贯彻。

基金管理人建立了健全内部控制体系，加强对交易环节的内部控制，并通过及时的行行为监控及及时的评估，保证公平交易原则的贯彻。

4.10 基金管理人内部控制的说明

基金管理人建立了健全内部控制体系，加强对交易环节的内部控制，并通过及时的行行为监控及及时的评估，保证公平交易原则的贯彻。

基金管理人建立了健全内部控制体系，加强对交易环节的内部控制，并通过及时的行行为监控及及时的评估，保证公平交易原则的贯彻。

4.11 基金管理人内部控制的说明

基金管理人建立了健全内部控制体系，加强对交易环节的内部控制，并通过及时的行行为监控及及时的评估，保证公平交易原则的贯彻。

基金管理人建立了健全内部控制体系，加强对交易环节的内部控制，并通过及时的行行为监控及及时的评估，保证公平交易原则的贯彻。

4.12 基金管理人内部控制的说明

基金管理人建立了健全内部控制体系，加强对交易环节的内部控制，并通过及时的行行为监控及及时的评估，保证公平交易原则的贯彻。

基金管理人建立了健全内部控制体系，加强对交易环节的内部控制，并通过及时的行行为监控及及时的评估，保证公平交易原则的贯彻。

4.13 基金管理人内部控制的说明

基金管理人建立了健全内部控制体系，加强对交易环节的内部控制，并通过及时的行行为监控及及时的评估，保证公平交易原则的贯彻。

基金管理人建立了健全内部控制体系，加强对交易环节的内部控制，并通过及时的行行为监控及及时的评估，保证公平交易原则的贯彻。

4.14 基金管理人内部控制的说明

基金管理人建立了健全内部控制体系，加强对交易环节的内部控制，并通过及时的行行为监控及及时的评估，保证公平交易原则的贯彻。

基金管理人建立了健全内部控制体系，加强对交易环节的内部控制，并通过及时的行行为监控及及时的评估，保证公平交易原则的贯彻。

4.15 基金管理人内部控制的说明

基金管理人建立了健全内部控制体系，加强对交易环节的内部控制，并通过及时的行行为监控及及时的评估，保证公平交易原则的贯彻。

基金管理人建立了健全内部控制体系，加强对交易环节的内部控制，并通过及时的行行为监控及及时的评估，保证公平交易原则的贯彻。

4.16 基金管理人内部控制的说明

基金管理人建立了健全内部控制体系，加强对交易环节的内部控制，并通过及时的行行为监控及及时的评估，保证公平交易原则的贯彻。

基金管理人建立了健全内部控制体系，加强对交易环节的内部控制，并通过及时的行行为监控及及时的评估，保证公平交易原则的贯彻。

4.17 基金管理人内部控制的说明

基金管理人建立了健全内部控制体系，加强对交易环节的内部控制，并通过及时的行行为监控及及时的评估，保证公平交易原则的贯彻。

基金管理人建立了健全内部控制体系，加强对交易环节的内部控制，并通过及时的行行为监控及及时的评估，保证公平交易原则的贯彻。

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	APPLE INC.	AAPL US	35,199,811.23	15.69
2	GOOGLE INC - CL	GOOGL US	9,577,612.24	5.98
3	MICROSOFT CORP	MSFT US	9,310,970.84	5.82
4	AMGEN INC	AMGN US	7,746,263.78	4.85
5	GILEAD SCIENCES INC	GILD US	7,117,940.49	4.48
6	QQQ	QQLU US	6,749,704.55	4.21
7	TECHNOLOGY CO-ADR	CSCO US	5,440,980.22	3.90
8	REGENERON	REGN US	4,634,770.21	2.67
9	FACEBOOK INC - A	FB US	4,137,061.60	2.58
10	AMAZON.COM INC	AMZN US	3,479,968.13	2.17
11	BAIDU INC - SPON ADR	BIDU US	2,998,345.19	1.87
12	INTEL CORP	INTC US	2,933,705.28	1.83
13	MYLAN INC	MYL US	2,529,778.48	1.58
14	QUALCOMM INC	QCOM US	2,512,042.54	1.57
15	COMCAST GROUP - CLASS A	CMCSA US	2,382,490.32	1.49
16	SOUFLA HOLDINGS LTD - ADR	SFLN US	2,338,470.36	1.46
17	BOGEN DIEB INC	BIIB US	2,149,686.12	1.34
18	ALEXION	ALXN US	1,857,243.68	1.16
19	AMERICAN AIRLINES GROUP INC	AAI US	1,798,665.78	1.12
20	NXP SEMICONDUCTORS	NXPI US	1,647,588.44	1.03

7.1.1 基金合同变更

本报告期无基金合同变更事项。

7.1.2 基金合同变更

本报告期无基金合同变更事项。

7.1.3 基金合同变更

本报告期无基金合同变更事项。

7.1.4 基金合同变更

本报告期无基金合同变更事项。

7.1.5 基金合同变更

本报告期无基金合同变更事项。

7.1.6 基金合同变更

本报告期无基金合同变更事项。

7.1.7 基金合同变更

本报告期无基金合同变更事项。

7.1.8 基金合同变更

本报告期无基金合同变更事项。

7.1.9 基金合同变更

本报告期无基金合同变更事项。

7.1.10 基金合同变更

本报告期无基金合同变更事项。

7.1.11 基金合同变更

本报告期无基金合同变更事项。

7.1.12 基金合同变更

本报告期无基金合同变更事项。

7.1.13 基金合同变更

本报告期无基金合同变更事项。

7.1.14 基金合同变更

本报告期无基金合同变更事项。

7.1.15 基金合同变更

本报告期无基金合同变更事项。

7.1.16 基金合同变更

本报告期无基金合同变更事项。

7.1.17 基金合同变更

本报告期无基金合同变更事项。

7.1.18 基金合同变更

本报告期无基金合同变更事项。