

信息披露 disclosure

国泰纳斯达克100指数证券投资基金

【2015】半年度报告摘要

7.5.1累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

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	WALGREEN BOOTS ALLIANCE INC	WBA US	9,547,284.72	157
2	AMAZON.COM INC	AMZN US	2,304,975.93	0.38
3	APPLE INC	AAPL US	2,022,368.02	0.33
4	QUALCOMM INC	QCOM US	1,729,700.39	0.28
5	CSICO SYSTEMS INC	CSOO US	1,467,028.74	0.24
6	MICROSOFT CORP	MSFT US	1,190,367.22	0.20
7	INTEL CORP	INTC US	1,067,291.63	0.17
8	BIOGEN IDEC INC	BIIB US	1,037,393.01	0.17
9	AMERICAN AIRLINES GROUP INC	AAL US	979,501.34	0.16
10	GILEAD SCIENCES INC	GILD US	922,791.55	0.14
11	PRICELINE.COM INC	PCNL US	725,811.49	0.12
12	BAIDU INC - SPON ADR	BIDU US	633,140.23	0.10
13	CELGENE CORP	CELG US	430,767.80	0.07
14	COMCAST CORP-CLASS A	CMCSA US	429,406.49	0.07
15	EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	ESRX US	401,695.22	0.07
16	SANDEP CORP	SNDE US	398,790.80	0.07
17	YAHOO INC	YAHOO US	348,676.04	0.06
18	APPLIED MATERIALS INC	AMAT US	326,215.51	0.05
19	REGENERON PHARMACEUTICALS	REGN US	277,380.05	0.05
20	KRAFT FOODS GROUP INC	KRFT US	274,109.20	0.04

注:1.此表中所用证券代码的类别是当地市场代码。
2.卖出金额按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.5.2累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	APPLE INC	AAPL US	24,231,620.48	3.99
2	MICROSOFT CORP	MSFT US	13,628,440.02	2.24
3	GILEAD SCIENCES INC	GILD US	9,104,409.57	1.49
4	AMAZON.COM INC	AMZN US	6,697,714.09	1.00
5	INTEL CORP	INTC US	5,698,260.23	0.93
6	CSICO SYSTEMS INC	CSOO US	4,905,466.06	0.81
7	QUALCOMM INC	QCOM US	4,396,678.76	0.72
8	FACEBOOK INC-A	FB US	4,286,078.00	0.69
9	AMGEN INC	AMGN US	4,179,414.07	0.68
10	GOOGLE INC-CL C	GOOGL US	4,020,763.72	0.66
11	COMCAST CORP-CLASS A	CMCSA US	3,678,414.07	0.64
12	CELGENE CORP	CELG US	3,694,744.65	0.59
13	GOOGLE INC-CL A	GOOGL US	3,396,929.63	0.56
14	BIOGEN IDEC INC	BIIB US	3,071,232.43	0.50
15	KRAFT FOODS GROUP INC	KRFT US	2,682,317.27	0.44
16	EBAY INC	EBAY US	2,606,727.00	0.43
17	MONDIELE INTERNATIONAL INC-A	MDLZ US	2,568,723.16	0.42
18	STARBUCKS CORP	SBUX US	2,342,112.15	0.39
19	PRICELINE.COM INC	PCNL US	2,296,118.04	0.37
20	REGENERON PHARMACEUTICALS	REGN US	2,060,461.32	0.34

注:1.此表中所用证券代码的类别是当地市场代码。
2.卖出金额按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.5.3权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

买入成本(成交总额)	卖出收入(成交总额)
31,918,714.68	176,995,096.20

注:1.买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.6期末按债券信用等级分类的债券投资组合

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	PROSHARE ULTIAPRO ODO	ETF基金	开放式	ProShare Trust	16,377,347.89	3.54
2	POWERShares WANGDAO 100	ETF基金	开放式	Investco PowerShares Capital	9,164,164.13	2.00

7.7投资组合报告附注
7.7.1.1.本报告期末持有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受到公开谴责、处罚的情况。
7.7.1.2.本报告期末持有的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情况。
7.7.1.3.期末其他各项资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	172,344.03
4	应收利息	6,162.06
5	应收申购款	1,679,797.22
6	其他应收款	46,906.41
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,905,210.22

7.11.4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。
7.11.5期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
7.11.5.1. 期末未报告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指数投资中不存在流通受限情况。
7.11.5.2. 本报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末未持有有极投资股票。

8. 期末基金份额持有人人数及持有人结构

持有人结构	份额单位:份
机构投资者	持有份额(份)
个人投资者	持有份额(份)
合计	持有份额(份)

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	172,344.03
4	应收利息	6,162.06
5	应收申购款	1,679,797.22
6	其他应收款	46,906.41
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,905,210.22

7.11.4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。
7.11.5期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
7.11.5.1. 期末未报告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指数投资中不存在流通受限情况。
7.11.5.2. 本报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末未持有有极投资股票。

8. 期末基金份额持有人人数及持有人结构

8	其他	-
9	合计	1,803,210.22

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	172,344.03
4	应收利息	6,162.06
5	应收申购款	1,679,797.22
6	其他应收款	46,906.41
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,905,210.22

7.11.4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。
7.11.5期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
7.11.5.1. 期末未报告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指数投资中不存在流通受限情况。
7.11.5.2. 本报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末未持有有极投资股票。

8. 期末基金份额持有人人数及持有人结构

3.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

		持有人结构

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	172,344.03
4	应收利息	6,162.06
5	应收申购款	1,679,797.22
6	其他应收款	46,906.41
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,905,210.22

7.11.4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。
7.11.5期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
7.11.5.1. 期末未报告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指数投资中不存在流通受限情况。
7.11.5.2. 本报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末未持有有极投资股票。

8. 期末基金份额持有人人数及持有人结构

3.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	
项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	172,344.03
4	应收利息	6,162.06
5	应收申购款	1,679,797.22
6	其他应收款	46,906.41
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,905,210.22

7.11.4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。
7.11.5期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
7.11.5.1. 期末未报告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指数投资中不存在流通受限情况。
7.11.5.2. 本报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末未持有有极投资股票。

8. 期末基金份额持有人人数及持有人结构

本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	244,307,723.65

10重大事件揭示

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	172,344.03
4	应收利息	6,162.06
5	应收申购款	1,679,797.22
6	其他应收款	46,906.41
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,905,210.22

7.11.4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。
7.11.5期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
7.11.5.1. 期末未报告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指数投资中不存在流通受限情况。
7.11.5.2. 本报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末未持有有极投资股票。

8. 期末基金份额持有人人数及持有人结构

10.4 基金投资策略的改变

报告期内,本基金投资策略无改变。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

报告期内,为本基金提供审计服务的会计师事务所无改聘情况。

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	172,344.03
4	应收利息	6,162.06
5	应收申购款	1,679,797.22
6	其他应收款	46,906.41
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,905,210.22

7.11.4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。
7.11.5期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
7.11.5.1. 期末未报告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指数投资中不存在流通受限情况。
7.11.5.2. 本报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末未持有有极投资股票。

8. 期末基金份额持有人人数及持有人结构

券商名称	交易单 元数量	股票交易		应支付给券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	佣金	占当期佣金 总量的比例	
Monaco Securities						

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	172,344.03
4	应收利息	6,162.06
5	应收申购款	1,679,797.22
6	其他应收款	46,906.41
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,905,210.22

7.11.4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。
7.11.5期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
7.11.5.1. 期末未报告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指数投资中不存在流通受限情况。
7.11.5.2. 本报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末未持有有极投资股票。

8. 期末基金份额持有人人数及持有人结构

注:基金租用席位的选择标准是:

- (1) 财力雄厚, 信誉良好;
- (2) 财务状况良好, 各项财务指标显示公司经营状况稳定;
- (3) 经营行为规范, 在最近一年内无重大违规经营行为;

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	172,344.03
4	应收利息	6,162.06
5	应收申购款	1,679,797.22
6	其他应收款	46,906.41
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,905,210.22

7.11.4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。
7.11.5期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
7.11.5.1. 期末未报告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指数投资中不存在流通受限情况。
7.11.5.2. 本报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末未持有有极投资股票。

8. 期末基金份额持有人人数及持有人结构

07.2.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券交易的情况						金额单位:人民币元		
券商名称	债券交易		回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金	占当期债券成	成交金	占当期回购成	成交金	占当期权证成交	成交金	占当期基金成

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	172,344.03
4	应收利息	6,162.06
5	应收申购款	1,679,797.22
6	其他应收款	46,906.41
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,905,210.22

7.11.4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。
7.11.5期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
7.11.5.1. 期末未报告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指数投资中不存在流通受限情况。
7.11.5.2. 本报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末未持有有极投资股票。

8. 期末基金份额持有人人数及持有人结构

man Sachs Inter-national State	-	-	-	-	-	-	35,732,166.94	59.66%
State								

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	172,344.03
4	应收利息	6,162.06
5	应收申购款	1,679,797.22
6	其他应收款	46,906.41
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,905,210.22

7.11.4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。
7.11.5期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
7.11.5.1. 期末未报告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指数投资中不存在流通受限情况。
7.11.5.2. 本报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末未持有有极投资股票。

8. 期末基金份额持有人人数及持有人结构

持有人结构	份额单位:份
机构投资者	持有份额(份)
个人投资者	持有份额(份)
合计	持有份额(份)

7.11.4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。
7.11.5期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
7.11.5.1. 期末未报告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指数投资中不存在流通受限情况。
7.11.5.2. 本报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末未持有有极投资股票。

8. 期末基金份额持有人人数及持有人结构

持有人结构	份额单位:份
机构投资者 <td>持有份额(份)</td>	持有份额(份)
个人投资者 <td>持有份额(份)</td>	持有份额(份)
合计 <td>持有份额(份)</td>	持有份额(份)

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	172,344.03
4	应收利息	6,162.06
5	应收申购款	1,679,797.22
6	其他应收款	46,906.41
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,905,210.22

7.11.4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。
7.11.5期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
7.11.5.1. 期末未报告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指数投资中不存在流通受限情况。
7.11.5.2. 本报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末未持有有极投资股票。

8. 期末基金份额持有人人数及持有人结构

持有人结构	份额单位:份
机构投资者 <td>持有份额(份)</td>	持有份额(份)
个人投资者 <td>持有份额(份)</td>	持有份额(份)
合计 <td>持有份额(份)</td>	持有份额(份)

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	172,344.03
4	应收利息	6,162.06
5	应收申购款	1,679,797.22
6	其他应收款	46,906.41
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,905,210.22

7.11.4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。
7.11.5期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
7.11.5.1. 期末未报告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指数投资中不存在流通受限情况。
7.11.5.2. 本报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末未持有有极投资股票。

8. 期末基金份额持有人人数及持有人结构

持有人结构	份额单位:份
机构投资者 <td>持有份额(份)</td>	持有份额(份)
个人投资者 <td>持有份额(份)</td>	持有份额(份)