

广发纳斯达克100指数证券投资基金

2018年半年度报告摘要

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：二〇一八年八月二十四日

1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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2018年8月22日复核了本报告中的财务指标、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。

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及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2018年1月1日起至6月30日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	广发纳斯达克100指数(LOF)
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1月16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
报告期末基金资产净值	304,500,405,079
基金份额净值	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用主动风险管理策略，通过标的指数的投资架构和量化风险控制手段，力求实现资产的长期增值。
投资策略	本基金将主要通过投资于纳斯达克100指数成分股，分享美国科技行业发展的收益。本基金将通过严格的风险控制，力争在有效控制风险的前提下，获得超越标的指数的收益。
业绩比较基准	人民币计价的纳斯达克100指数收益率。
风险收益特征	本基金为股票型基金，风险和收益均高于混合型基金，且具有较高的波动性，适合风险承受能力较强的投资者。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	广发基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
姓名	段军海	王永琪
信息员负责	020-89909006	010-69938906
电子邮箱	dxf@fundsf.com.cn	fcmb@chushipin.com
客户服务电话	9510529-020-89909999	95566
传真	020-899168	010-699389042

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目	境外投资顾问
名称	BANK OF CHINA NEW YORK BRANCH
英文	-
中文	-
注册地址	106 Avenue of the Americas, New York City, New York County, New York 10013
办公地址	106 Avenue of the Americas, New York City, New York County, New York 10013
邮政编码	-

2.5 信息披露方式

本基金公告的信息披露栏名称	中国证券报/上海证券报/证券时报
登载基金半年度报告的管理人互联网网址	http://www.gffund.com
基金半年度报告备置地点	广州市天河区珠江新城华夏路9号广发证券大厦南座31-33层

3 主要财务指标和基金净值表现

项目	金额单位：人民币元
3.1.1期间数据和指标	报告期(2018年1月1日至2018年6月30日)
本期已实现收益	8,096,907.04
本期可供分配利润	60,320,944.01
本期平均基金份额本期利润	0.2681
本期基金份额净值增长率为	12.74%
3.1.2期末数据指标	报告期(2018年6月30日)
期末可供分配利润	649,444,010.23
期末基金份额净值	2.133

注：(1)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。

(2)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。

(3)期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额，不是当期发生数)。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

4月份，多重利空因素再度来袭，包括美股利率一度突破3%的重要关口，美英法德联合军事干涉叙利亚，地缘政治再度紧张，中东政治局势的动荡影响市场恐慌情绪，导致指数出现大幅回调，美债利率大涨，引发投资者对利率过快上升后的估值压制的担忧。叠加此前美股涨幅较大，技术面上处于超买状态，盈亏比的获利给了指数带来大量卖压，指数出现深度回调。

5月份，月初2月份非农就业数据大幅超预期，显示劳动力市场稳健，指数收复2月跌幅。但随后受科技股负面消息、美联储加息，以及中美贸易摩擦等负面影响，指数出现恐慌性抛售，大幅下跌。

6月份，多重利空因素再度来袭，包括美股利率一度突破3%的重要关口，美英法德联合军事干涉叙利亚，地缘政治再度紧张，中东政治局势的动荡影响市场恐慌情绪，导致指数出现大幅回调，美债利率大涨，引发投资者对利率过快上升后的估值压制的担忧。叠加此前美股涨幅较大，技术面上处于超买状态，盈亏比的获利给了指数带来大量卖压，指数出现深度回调。

7月份，月初2月份非农就业数据大幅超预期，引发通胀上升的预期，市场对美联储加快加息节奏的担忧，导致指数出现大幅回调，美债利率大涨，引发投资者对利率过快上升后的估值压制的担忧。叠加此前美股涨幅较大，技术面上处于超买状态，盈亏比的获利给了指数带来大量卖压，指数出现深度回调。

8月份，美国8月CPI同比上涨，但环比有所下降，缓解加息担忧，对市场形成提振作用，另一方面美股一度上涨破纪录，多家公司宣布回购股份，指数反弹。随着8月1日中美两国就贸易磋商达成联合声明，双方达成协议，贸易战停火，中方将增加购买商品和服务，减缓对华货物贸易逆差。短期内，中美贸易战的阴云暂时散去，对市场情绪形成一定支撑。

9月份，月初2月份非农就业数据大幅超预期，显示劳动力市场稳健，指数收复2月跌幅。但随后受科技股负面消息、美联储加息，以及中美贸易摩擦等负面影响，指数出现恐慌性抛售，大幅下跌。

10月份，美国10月CPI同比上涨，但环比有所下降，缓解加息担忧，对市场形成提振作用，另一方面美股一度上涨破纪录，多家公司宣布回购股份，指数反弹。随着10月1日中美两国就贸易磋商达成联合声明，双方达成协议，贸易战停火，中方将增加购买商品和服务，减缓对华货物贸易逆差。短期内，中美贸易战的阴云暂时散去，对市场情绪形成一定支撑。

11月份，月初2月份非农就业数据大幅超预期，引发通胀上升的预期，市场对美联储加快加息节奏的担忧，导致指数出现大幅回调，美债利率大涨，引发投资者对利率过快上升后的估值压制的担忧。叠加此前美股涨幅较大，技术面上处于超买状态，盈亏比的获利给了指数带来大量卖压，指数出现深度回调。

12月份，月初2月份非农就业数据大幅超预期，引发通胀上升的预期，市场对美联储加快加息节奏的担忧，导致指数出现大幅回调，美债利率大涨，引发投资者对利率过快上升后的估值压制的担忧。叠加此前美股涨幅较大，技术面上处于超买状态，盈亏比的获利给了指数带来大量卖压，指数出现深度回调。

注：业绩比较基准：人民币计价的纳斯达克100总收益指数收益率。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动与其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

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2018年8月15日至2018年6月30日)

该图展示了广发纳斯达克100指数证券投资基金成立以来的份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比情况。

该图展示了广发纳斯达克100指数证券投资基金成立以来的份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比情况。