广发纳斯达克100指数证券投资基金更新的招募说明书摘要

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
时间：二〇一八年九月

【重要提示】

本基金于2012年4月26日经中国证监会证监许可[2012]608号文核准。本基金基金合同于2012年8月15日正式生效。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。

本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证。也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书。

基金管理人依照恪尽职守，诚实信用、勤勉尊贵的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险；由于基金投资人连续大额赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理完毕过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险等。本基金投资于美国证券市场，基金净值会因为美国证券市场波动、汇率变动等因素产生波动。

投资有风险，投资人购买（或申购）基金份额时应认真阅读本基金的风险收益特征，充分考虑投资人自身的风险承受能力，并对于认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资人基金投资要面临的风险。基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本招募说明书（更新）所载内容截止日为2018年8月15日，有关财务数据和投资组合报表截止日为2018年6月30日（财务数据未经审计）。

第一部分 基金的名称

广发纳斯达克100指数证券投资基金

第二部分 基金的类型

股票型

第三部分 基金的投资目标

本基金采用被动式指数化投资策略，通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，力求实现对标的指数的有效跟踪，追求跟踪误差的最小化。

第四部分 基金的投资范围

本基金投资范围为美国证券市场中的纳斯达克100指数成份股、备选成份股、以纳斯达克100指数为投资标的的交易型开放式指数基金（ETF）、新股（一级市场初次发行或增发）等。其中，对纳斯达克100指数成份股的投资比例不低于基金资产净值的80%，对纳斯达克100指数备选成份股及以纳斯达克100指数为投资标的的交易型开放式指数基金（ETF）的投资比例不高于基金资产净值的10%。现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金还可投资法律法律允许基金投资其他品种。其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金还可投资法律法律允许基金投资其他品种。

如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

第五部分 基金的投资策略

（一）投资策略

本基金以追求标的指数长期跟长的稳定收益为宗旨，在降低跟踪误差和控制流动性风险的双重约束下构建指数化的投资组合。

本基金力争把标基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪误差控制在一个1%以内，基金净值增长率与业绩比较基准之间的年跟踪误差不超过5%。

本基金对纳斯达克100指数成份股的投资比例不低于基金资产净值的80%。对纳斯达克100指数备选成份股及以纳斯达克100指数为投资标的的交易型开放式指数基金（ETF）的投资比例不高于基金资产净值的10%。现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

（二）具体投资策略

1.股票组合构建原则

本基金主要采用完全复制法来跟踪纳斯达克100指数，按照个股在标的指数中的基准权重和调整原则组合。

2.股票组合构建方法

本基金主要采用完全复制法，即完全按照标的指数的成份股权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。

当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，基金管理人会对投资组合进行适当调整，降低跟踪误差。

如有纳斯达克指数除息、投资者必须或其他一些影响指数复制的市场因素的限制，使基金管理人无法依照数权重购买成份股，基金管理人可以根据市场情况，结合经验判断，对投资组合进行适当调整，以获得更接近标的指数的效益。

2.股票组合调整

（1）定期调整

本基金股票组合按照所跟踪的纳斯达克100指数对其成份股的调整而进行相应的定期跟踪调整。

（2）不定期调整

1）与指数相关的调整

当标的指数成份股回增发、送配等股权变动而需进行成份股权重调整时，本基金将根据指数公司发布的调整决定及其需调整的权重比例，进行相应调整。

2）申购赎回调整

根据本基金的申购赎回情况，对投票投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数。

3）其他调整

对于标的指数成份股，若因其出现停牌期利，存在严重的流动性风险，或者财务风险较大，或者面临退大的不利的司法诉讼，或者有充分而合理的理由认为其被市场操纵等情形时，本基金可以不投资该成份股，而用替选股，甚至现金来代替，也可以选择与其行业相近、定价特征类似或者收益率相关性较高的其它股票来代替。

4.投资合规性评估

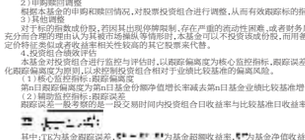
本基金对投资组合进行监控与评估时，以跟踪偏离度为核心监控指标，跟踪误差为辅助监控指标，对投资组合的日常调整就以最小化跟踪偏离度为原则，以控制投资组合相对于业绩比较基准的偏离风险。

（1）核心监控指标：跟踪偏离度

第n日跟踪偏离度为第n日基金份额净值增长率减去第n日基金业绩比较基准增长率后的绝对值。

（2）辅助监控指标：跟踪误差

跟踪误差一般考察的是一段交易时间内投资组合日收益率与比较基准日收益率的偏离情况，计算公式如下：



其中：CT_t为基金跟踪误差，$R_{p,t}$为基金超额收益率，$R_{b,t}$为基金净值收益率。

μ_T为基准收益率，T为历史天数。

基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法，并予以公告。

（3）固定收益类投资策略

本基金将主要以降低跟踪误差和投资组合流动性管理为目的，综合考虑流动性和收益性，构建本基金债券和货币市场工具的投资组合。

（四）衍生品投资策略

本基金可投资于经中国证监会允许的各种金融衍生品，如与标的指数成标的指数成分股相关的股指期货、期权、权证以及其他衍生工具。本基金金融衍生品的投资中主要遵循有效管理投资策略，对冲某些或全股的特殊资发风险和某些特殊情况下的流动性风险，以及利用金融衍生产品的杠杆作用，达到对标的指数的有效跟踪，同时降低合约履约成本的目的。

第六部分 基金的业绩比较基准

本基金的标的指数为纳斯达克100指数（NASDAQ-100 Index）。

当指数编制机构停止标的指数的编制时，或发生标的指数的实质性变化时，基金管理人将根据本基金的投资目标，选择其他合适的指数作为本基金的业绩比较基准，并及时公告。

第七部分 基金的风险收益特征

本基金为股票型基金，风险和收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相应的风险收益特征。

第八部分 基金的投资组合报告

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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年9月20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。

本投资组合报告所载数据截至2018年6月30日，本报告中所列财务数据未经审计。

（一）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	581,116,998189	82.70
	其中：普通股	568,819,489.98	80.95
	存托凭证	12,297,512.91	1.75
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	11,218,889.01	1.60
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	100,910,598.27	14.36
8	其他各项资产	9,437,551.05	1.34
9	合计	702,684,037.22	100.00

（二）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(人民币)	占基金资产净值比例（%）
美国	581,116,998189	89.45
合计	581,116,998189	89.45

注：1.国家（地区）类别根据股票及存托凭证所在的证券交易所确定。

2.上述国际金融公司法律地为开曼群岛，股票在美国上市的ADR。

（三）报告期末按行业分类的股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
金融	-	-
公用事业	-	-
地产	-	-
房地产	-	-
原材料	-	-
信息技术	353,286,682.52	54.47
非日常生活消费品	133,874,239.70	20.63
医疗保健	53,820,369.08	8.29
日常消费品	23,364,975.60	3.60
工业	11,670,947.50	1.80
电信业务	4,520.82	0.00
合计	581,116,998.189	89.45

注：以大分类采用全球行业分类标准（GICS）。

（四）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

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（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	APPLE INC	苹果公司	AAPL US	纳斯达克证券交易所	美国	54,155.00	66,328,980.42	10.21
2	AMAZON.COM INC	亚马逊公司	AMZN US	纳斯达克证券交易所	美国	5,346.00	60,125,909.65	9.26
3	MICROSOFT CORP	微软一T	MSFT US	纳斯达克证券交易所	美国	84,463.00	55,232,944.07	8.50
4	FACEBOOK INC-A	Facebook公司	FB US	纳斯达克证券交易所	美国	26,427.00	33,979,190.52	5.23
5	ALPHABET INC-CL C	Alphabet公司	GOOG US	纳斯达克证券交易所	美国	3,844.00	28,375,676.83	4.37
6	ALPHABET INC-CL A	Alphabet公司	GOOGL US	纳斯达克证券交易所	美国	3,290.00	24,580,901.24	3.78
7	INTEL CORP	英特尔公司	INTC US	纳斯达克证券交易所	美国	51,344.00	16,887,615.93	2.60
8	CISCO SYSTEMS INC	思科一T	CSCO US	纳斯达克证券交易所	美国	51,816.00	14,752,652.43	2.27
9	NETFLIX INC	奈飞公司	NFLX US	纳斯达克证券交易所	美国	4,789.00	12,403,202.25	1.91
10	COMCAST CORP--CLASS A	康卡斯特	CMCSA US	纳斯达克证券交易所	美国	50,597.00	10,884,135.42	1.68

注：此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

（五）报告期末按债券品种等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

（六）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

本基金本报告期末未持有债券。

（七）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资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

（八）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

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

（九）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（人民币元）	占基金资产净值比例(%)
1	PROSHARES ULTRA QQQ	ETF 基金	契约型开放式基金	ProShares Trust	11,218,889.01	1.73

（十）投资组合报告附注

1.报告期内投资的前十名证券的发行主体在本报告期内没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2.报告期内本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

3.其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	96,219.85
4	应收利息	2,692.06
5	应收申购款	9,338,639.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,437,551.05

4.报告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。

5.报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

第九部分 基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尊贵的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。

投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。基金业绩数据截至2018年6月30日。

1. 本基金本报告期单位基金资产净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

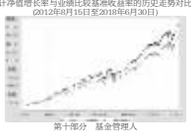
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2012.8.15-2012.12.31	-4.50%	0.67%	-4.37%	0.92%	-0.13%	-0.25%
2013.1.1-2013.12.31	29.53%	0.74%	31.04%	0.76%	-1.51%	-0.02%
2014.1.1-2014.12.31	16.14%	0.94%	22.46%	0.87%	-6.32%	-0.03%
2015.1.1-2015.12.31	17.11%	1.16%	14.70%	1.17%	2.40%	-0.01%
2016.1.1-2016.12.31	11.22%	1.03%	14.75%	1.01%	-3.53%	0.02%
2017.1.1-2017.12.31	23.02%	0.70%	24.69%	0.70%	-1.67%	0.00%
2018.1.1-2018.6.30	12.74%	1.34%	12.68%	1.27%	0.06%	0.07%
2012.8.15-2018.6.30	169.71%	0.94%	189.32%	0.96%	-29.61%	-0.01%

2. 本基金自基金合同生效以来单位基金资产净值的变动与同期业绩比较基准的比较图

广发纳斯达克100指数证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2012年8月15日至2018年6月30日）



第十部分 基金管理人

一、概况

1.名称：广发基金管理有限公司

2.住所：广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室-49848（集中办公区）

3.办公地址：广州市海珠区阅岗大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

4.法定代表人：孙柳明

5.设立时间：2003年8月5日

6.电话：020-83206666

全国统一客服热线：95105828

7.联系人：段西军

8.注册资本：1.26882亿元人民币

9.股权结构：广发证券股份有限公司（以下简称"广发证券"）、烽火通信科技股份有限公司、深圳市前海香江金融控股集团有限公司、康芝药业股份有限公司和广州科技金融创新投资控股有限公司，分别持有本基金管理人51.135%、15.763%、15.763%、9.458%和7.881%的股权。

二、主要人员情况

1.董事会成员

孙柳明先生：董事长，博士，高级经济师。兼任广发证券股份有限公司董事长、执行董事、党委书记，中证机构间报价系统股份有限公司董事长，中国证券业协会第六届理事会兼职顾问委员，上海证券交易所第四届理事会理事，深圳证券交易所第二届监事会监事，中国上市公司协会第二届理事会兼职顾问委员，证券业协会外部专家咨询委员会委员，广东金融学会副会长，广东省国有资本经营委员会委员，广东省国有资产专家咨询委员会财政金融运行规范组成员，中证机构间报价系统股份有限公司董事长，曾任财政部金融司副处长、处长，财政部经济发展研究所副所长，财政部国有金融资本管理司副司长，中国银行业监督管理委员会第六届董事会董事，曾任广发证券股份有限公司党委书记、副总裁、广发证券股份有限公司总经理、广发证券股份有限公司董事、广发证券股份有限公司董事长、广发证券股份有限公司党委书记、总经理、总裁、广发证券股份有限公司董事长、党委书记、总经理、总裁、中国证券业协会第一届理事会兼职顾问委员、证券业协会外部专家咨询委员会委员、广东省证券业协会会长、香江社会救助基金会主席，深圳市深商控股集团股份有限公司董事、广东南粤银行董事，深圳龙岗国安村镇银行董事，曾任深圳市前海香江金融控股集团有限公司副董事长、总经理，香江集团有限公司总裁，深圳市金海马实业股份有限公司董事长、董事会主席、党委书记、总裁、分红等行为时，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，基金管理人会对投资组合进行适当调整，降低跟踪误差。

如有纳斯达克指数除息、投票必须或其他一些影响指数复制的市场因素的限制，使基金管理人无法依照数权重购买成份股，基金管理人可以根据市场情况，结合经验判断，对投资组合进行适当调整，以获得更接近标的指数的效益。

2.股票组合调整

（1）定期调整

本基金股票组合按照所跟踪的纳斯达克100指数对其成份股的调整而进行相应的定期跟踪调整。

（2）不定期调整

1）与指数相关的调整

当标的指数成份股回增发、送配等股权变动而需进行成份股权重调整时，本基金将根据指数公司发布的调整决定及其需调整的权重比例，进行相应调整。

2）申购赎回调整

根据本基金的申购赎回情况，对投票投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数。

3）其他调整

对于标的指数成份股，若因其出现停牌期利，存在严重的流动性风险，或者财务风险较大，或者面临退大的不利的司法诉讼，或者有充分而合理的理由认为其被市场操纵等情形时，本基金可以不投资该成份股，而用替选股，甚至现金来代替，也可以选择与其行业相近、定价特征类似或者收益率相关性较高的其它股票来代替。

4.投资合规性评估

本基金对投资组合进行监控与评估时，以跟踪偏离度为核心监控指标，跟踪误差为辅助监控指标，对投资组合的日常调整就以最小化跟踪偏离度为原则，以控制投资组合相对于业绩比较基准的偏离风险。

（1）核心监控指标：跟踪偏离度

第n日跟踪偏离度为第n日基金份额净值增长率减去第n日基金业绩比较基准增长率后的绝对值。

（2）辅助监控指标：跟踪误差

跟踪误差一般考察的是一段交易时间内投资组合日收益率与比较基准日收益率的偏离情况，计算公式如下：

其中：CT_t为基金跟踪误差，$R_{p,t}$为基金超额收益率，$R_{b,t}$为基金净值收益率。

μ_T为基准收益率，T为历史天数。

基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法，并予以公告。

（3）固定收益类投资策略

本基金将主要以降低跟踪误差和投资组合流动性管理为目的，综合考虑流动性和收益性，构建本基金债券和货币市场工具的投资组合。

（四）衍生品投资策略

本基金可投资于经中国证监会允许的各种金融衍生品，如与标的指数成标的指数成分股相关的股指期货、期权、权证以及其他衍生工具。本基金金融衍生品的投资中主要遵循有效管理投资策略，对冲某些或全股的特殊资发风险和某些特殊情况下的流动性风险，以及利用金融衍生产品的杠杆作用，达到对标的指数的有效跟踪，同时降低合约履约成本的目的。

第六部分 基金的业绩比较基准

本基金的标的指数为纳斯达克100指数（NASDAQ-100 Index）。

当指数编制机构停止标的指数的编制时，或发生标的指数的实质性变化时，基金管理人将根据本基金的投资目标，选择其他合适的指数作为本基金的业绩比较基准，并及时公告。

第七部分 基金的风险收益特征

本基金为股票型基金，风险和收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相应的风险收益特征。

第八部分 基金的投资组合报告

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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年9月20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。

本投资组合报告所载数据截至2018年6月30日，本报告中所列财务数据未经审计。

（一）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	581,116,998.189	82.70
	其中：普通股	568,819,489.98	80.95
	存托凭证	12,297,512.91	1.75
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	11,218,889.01	1.60
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	100,910,598.27	14.36
8	其他各项资产	9,437,551.05	1.34
9	合计	702,684,037.22	100.00

（二）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(人民币)	占基金资产净值比例（%）
美国	581,116,998189	89.45
合计	581,116,998189	89.45

注：1.国家（地区）类别根据股票及存托凭证所在的证券交易所确定。

2.上述国际金融公司法律地为开曼群岛。股票在美国上市的ADR。

（三）报告期末按行业分类的股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
金融	-	-
公用事业	-	-
地产	-	-
房地产	-	-
原材料	-	-
信息技术	353,286,682.52	54.47
非日常生活消费品	133,874,239.70	20.63
医疗保健	53,820,369.08	8.29
日常消费品	23,364,975.60	3.60
工业	11,670,947.50	1.80
电信业务	4,520.82	0.00
合计	581,116,998.189	89.45

注：以大分类采用全球行业分类标准（GICS）。

（四）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

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（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	APPLE INC	苹果公司	AAPL US	纳斯达克证券交易所	美国	54,155.00	66,328,980.42	10.21
2	AMAZON.COM INC	亚马逊公司	AMZN US	纳斯达克证券交易所	美国	5,346.00	60,125,909.65	9.26
3	MICROSOFT CORP	微软一T	MSFT US	纳斯达克证券交易所	美国	84,463.00	55,232,944.07	8.50
4	FACEBOOK INC-A	Facebook公司	FB US	纳斯达克证券交易所	美国	26,427.00	33,979,190.52	5.23
5	ALPHABET INC-CL C	Alphabet公司	GOOG US	纳斯达克证券交易所	美国	3,844.00	28,375,676.83	4.37
6	ALPHABET INC-CL A	Alphabet公司	GOOGL US	纳斯达克证券交易所	美国	3,290.00	24,580,901.24	3.78
7	INTEL CORP	英特尔公司	INTC US	纳斯达克证券交易所	美国	51,344.00	16,887,615.93	2.60
8	CISCO SYSTEMS INC	思科一T	CSCO US	纳斯达克证券交易所	美国	51,816.00	14,752,652.43	2.27
9	NETFLIX INC	奈飞公司	NFLX US	纳斯达克证券交易所	美国	4,789.00	12,403,202.25	1.91
10	COMCAST CORP--CLASS A	康卡斯特	CMCSA US	纳斯达克证券交易所	美国	50,597.00	10,884,135.42	1.68

注：此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

（五）报告期末按债券品种等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

（六）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

本基金本报告期末未持有债券。

（七）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资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

（八）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

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

（九）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（人民币元）	占基金资产净值比例(%)
1	PROSHARES ULTRA QQQ	ETF 基金	契约型开放式基金	ProShares Trust	11,218,889.01	1.73

（十）投资组合报告附注

1.报告期内投资的前十名证券的发行主体在本报告期内没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2.报告期内本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

3.其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	96,219.85
4	应收利息	2,692.06
5	应收申购款	9,338,639.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,437,551.05

4.报告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。

5.报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

第九部分 基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尊贵的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。

投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。基金业绩数据截至2018年6月30日。

1. 本基金本报告期单位基金资产净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

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
2012.8.15-2012.12.31	-4.50%	0.67%	-4.37%	0.92%	-0.13%	-0.25%
2013.1.1-2013.12.31	29.53%	0.74%	31.04%	0.76%	-1.51%	-0.02%
2014.1.1-2014.12.31	16.14%	0.94%	22.46%	0.87%	-6.32%	-0.03%
2015.1.1-2015.12.31	17.11%	1.16%	14.70%	1.17%	2.40%	-0.01%
2016.1.1-2016.12.31	11.22%	1.03%	14.75%	1.01%	-3.53%	0.02%
2017.1.1-2017.12.31	23.02%	0.70%	24.69%	0.70%	-1.67%	0.00%
2018.1.1-2018.6.30	12.74%	1.34%	12.68%	1.27%	0.06%	0.07%
2012.8.15-2018.6.30	169.71%	0.94%	189.32%	0.96%	-29.61%	-0.01%

2. 本基金自基金合同生效以来单位基金资产净值的变动与同期业绩比较基准的比较图

广发纳斯达克100指数证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2012年8月15日至2018年6月30日）

第十部分 基金管理人

一、概况

1.名称：广发基金管理有限公司

2.住所：广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室-49848（集中办公区）

3.办公地址：广州市海珠区阅岗大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

4.法定代表人：孙柳明

5.设立时间：2003年8月5日

6.电话：020-83206666

全国统一客服热线：95105828

7.联系人：段西军

8.注册资本：1.26882亿元人民币

9.股权结构：广发证券股份有限公司（以下简称"广发证券"）、烽火通信科技股份有限公司、深圳市前海香江金融控股集团有限公司、康芝药业股份有限公司和广州科技金融创新投资控股有限公司，分别持有本基金管理人51.135%、15.763%、15.763%、9.458%和7.881%的股权。

二、主要人员情况

1.董事会成员

孙柳明先生：董事长，博士，高级经济师。兼任广发证券股份有限公司董事长、执行董事、党委书记，中证机构间报价系统股份有限公司董事长，中国证券业协会第六届理事会兼职顾问委员，上海证券交易所第四届理事会理事，深圳证券交易所第二届监事会监事，中国上市公司协会第二届理事会兼职顾问委员，证券业协会外部专家咨询委员会委员，广东金融学会副会长，广东省国有资本经营委员会委员，广东省国有资产专家咨询委员会财政金融运行规范组成员，中证机构间报价系统股份有限公司董事长，曾任财政部金融司副处长、处长，财政部经济发展研究所副所长，财政部国有金融资本管理司副司长，中国银行业监督管理委员会第六届董事会董事，曾任广发证券股份有限公司党委书记、副总裁、广发证券股份有限公司总经理、广发证券股份有限公司董事、广发证券股份有限公司董事长、广发证券股份有限公司党委书记、总经理、总裁、广发证券股份有限公司董事长、党委书记、总经理、总裁、中国证券业协会第一届理事会兼职顾问委员、证券业协会外部专家咨询委员会委员、广东省证券业协会会长、香江社会救助基金会主席，深圳市深商控股集团股份有限公司董事、广东南粤银行董事，深圳龙岗国安村镇银行董事，曾任深圳市前海香江金融控股集团有限公司副董事长、总经理，香江集团有限公司总裁，深圳市金海马实业股份有限公司董事长、董事会主席、党委书记、总裁、分红等行为时，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，基金管理人会对投资组合进行适当调整，降低跟踪误差。

如有纳斯达克指数除息、投票必须或其他一些影响指数复制的市场因素的限制，使基金管理人无法依照数权重购买成份股，基金管理人可以根据市场情况，结合经验判断，对投资组合进行适当调整，以获得更接近标的指数的效益。

2.股票组合调整

（1）定期调整

本基金股票组合按照所跟踪的纳斯达克100指数对其成份股的调整而进行相应的定期跟踪调整。

（2）不定期调整

1）与指数相关的调整

当标的指数成份股回增发、送配等股权变动而需进行成份股权重调整时，本基金将根据指数公司发布的调整决定及其需调整的权重比例，进行相应调整。

2）申购赎回调整

根据本基金的申购赎回情况，对投票投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数。

3）其他调整

对于标的指数成份股，若因其出现停牌期利，存在严重的流动性风险，或者财务风险较大，或者面临退大的不利的司法诉讼，或者有充分而合理的理由认为其被市场操纵等情形时，本基金可以不投资该成份股，而用替选股，甚至现金来代替，也可以选择与其行业相近、定价特征类似或者收益率相关性较高的其它股票来代替。

4.投资合规性评估

本基金对投资组合进行监控与评估时，以跟踪偏离度为核心监控指标，跟踪误差为辅助监控指标，对投资组合的日常调整就以最小化跟踪偏离度为原则，以控制投资组合相对于业绩比较基准的偏离风险。

（1）核心监控指标：跟踪偏离度

第n日跟踪偏离度为第n日基金份额净值增长率减去第n日基金业绩比较基准增长率后的绝对值。

（2）辅助监控指标：跟踪误差

跟踪误差一般考察的是一段交易时间内投资组合日收益率与比较基准日收益率的偏离情况，计算公式如下：

其中：CT_t为基金跟踪误差，$R_{p,t}$为基金超额收益率，$R_{b,t}$为基金净值收益率。

μ_T为基准收益率，T为历史天数。

基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法，并予以公告。

（3）固定收益类投资策略

本基金将主要以降低跟踪误差和投资组合流动性管理为目的，综合考虑流动性和收益性，构建本基金债券和货币市场工具的投资组合。

（四）衍生品投资策略

本基金可投资于经中国证监会允许的各种金融衍生品，如与标的指数成标的指数成分股相关的股指期货、期权、权证以及其他衍生工具。本基金金融衍生品的投资中主要遵循有效管理投资策略，对冲某些或全股的特殊资发风险和某些特殊情况下的流动性风险，以及利用金融衍生产品的杠杆作用，达到对标的指数的有效跟踪，同时降低合约履约成本的目的。

第六部分 基金的业绩比较基准

本基金的标的指数为纳斯达克100指数（NASDAQ-100 Index）。

当指数编制机构停止标的指数的编制时，或发生标的指数的实质性变化时，基金管理人将根据本基金的投资目标，选择其他合适的指数作为本基金的业绩比较基准，并及时公告。

第七部分 基金的风险收益特征

本基金为股票型基金，风险和收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相应的风险收益特征。

第八部分 基金的投资组合报告

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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年9月20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。

本投资组合报告所载数据截至2018年6月30日，本报告中所列财务数据未经审计。

（一）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	581,116,998.189	82.70
	其中：普通股	568,819,489.98	80.95
	存托凭证	12,297,512.91	1.75