

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
基金合同生效日:2012年3月26日

§ 1 重要提示

基金管理人和基金托管人承诺本报告在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对内容的真实性、准确性和完整性承担法律责任。本基金的基金合同由基金管理人和基金托管人根据有关法律法规及基金合同，按照诚实信用、勤勉尽责的原则共同编制。本报告经基金管理人和基金托管人签字盖章后，由基金管理人正式对外披露。
本报告所载数据截止日期为2012年3月15日，报告期间为2012年1月1日至2012年3月15日。

§ 2 基金简介

基金基本情况

广发纳斯达克100指数证券投资基金

270002

交易代码

270042

基金运作方式

契约型开放式

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

142,021,165.41

报告期末基金份额总额

基金合同存续期

不定期

2.2 基金产品说明

本基金采用被动式指数化投资策略，通过严格的投

资程序管理的和数量化风险管理手段，力求实现对所

指的指数的有效跟踪，追求跟踪误差的最小化。

本基金以追踪标的指数长期稳定的收益为目标，

在降低跟踪误差控制稳定性风险和双重约束下

构建指数的投资组合。

本基金力争控制基金净值增长率与业绩比较基准

之间的日均跟踪偏离度小于±0.5%，净值增长

率与业绩比较基准之间的年均跟踪误差不超过5%。

本基金对纳斯达克100指数成份股的投资比例不

低于本基金净资产的85%，对纳斯达克100指数成

份股以及纳斯达克100指数为投资标的的交易型

开放式指数基金(EFT)的投资比例不高于基金

净资产的10%，现金或者到期日在一年内的政府

债券不高于基金净资产的5%。

本基金主要采用完全复制法，即完全按照标的

指数的成份股及其权重构建股票投资组合，

并根据标的指数成份股的重大变化进行相

应调整。

当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增

发、分拆等行为时，因基金的申购和赎回对本基

金跟踪标的指数的影响可能将产生影响，基金管理人

会对投资组合进行适当调整以降低跟踪误差。

本基金主要通过降低跟踪误差和投资组合流动

性管理为主的，考虑动态波动性和收敛性，构建本

基金债券和货币市场上的投资组合。

业绩比较基准：纳斯达克100指数收益率。

本基金为股票型基金，风险等级高于所有市场上

基金，股票型基金风险较高，具有较高风险，较

高预期收益率的风险。本基金分为股票型基金，

将采用完全复制法跟踪标的指数，具有与标的有

所不同的股票投资组合相拟合的收益特征。

3.1 基金管理人和基金托管人

项目

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

信息披露负责人

姓名:段军

性别:男

联系电话:020-83966666

电子邮箱:dxj@efunds.com.cn

客户服务电话

95105828, 020-83936999

传真

020-8999158

4.2 境外资产配置情况

境外资产配置情况