广发纳斯达克100指数证券投资基金

【2015】第二季度报告

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:二〇一五年七月二十一日

§1 重要提示

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2015年7月15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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发纳斯达克100指数(QDII)
基金主代码	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
报告期末基金份额总额	149,489,597.60份
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。
投资策略	本基金以追求标的指数长期增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%,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85%,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%,现金或套到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的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组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。 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。
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。
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似的风险收益特征。
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
境外资产托管人英文名称	Bank of China(Hong Kong)
境外资产托管人中文名称	中国银行(香港)有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年4月1日-2015年6月30日)
1.本期已实现收益	8,922,009.51
2.本期利润	3,874,146.84
3.加权平均基金份额本期利润	0.0238
4.期末基金资产净值	221,679,139.50
5.期末基金份额净值	1.483

注:1、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。

2、上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。

3.2 基金净值表现

3.2.1本报告期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

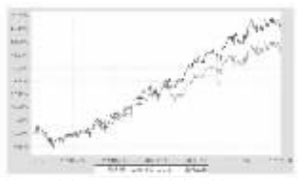
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.30%	0.85%	1.70%	0.82%	-0.40%	0.03%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与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

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2012年8月15日至2015年6月30日)



注:本基金建仓期为基金合同生效后六个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同有关规定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
邱炜	本基金的基金经理;广发全球农业指数(QDII)基金的基金经理;广发美国房地产指数(QDII)基金的基金经理;广发亚太中高收益债券(QDII)基金的基金经理;广发全球医疗保健(QDII)基金的基金经理;广发生物科技指数(QDII)基金的基金经理;广发纳指100ETF基金的基金经理;国际业务部副总经理;另类投资部副总经理	2012-08-15	-	8年	男,中国籍,统计学博士,持有基金业执业资格证书,2007年5月至2008年7月在摩根大通集团(纽约)任高级分析师兼助理副总裁,2008年7月至2011年6月任广发基金管理有限公司国际业务部研究员,2011年6月28日起任广发标普全球农业指数证券投资基金的基金经理,2012年8月15日起任广发纳斯达克100指数证券投资基金的基金经理,2013年8月9日起任广发美国房地产指数证券投资基金的基金经理,2013年11月28日起任广发亚太中高收益债券型证券投资基金的基金经理,2013年12月10日起任广发全球医疗保健指数证券投资基金的基金经理,2014年1月21日起任广发基金管理有限公司国际业务部副总经理,2015年1月14日起任广发基金管理有限公司另类投资部副总经理,2015年3月30日起任广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金的基金经理,2015年6月10日起任广发纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。

注:1."任职日期"和"离职日期"指公司公告聘任或解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规、《广发纳斯达克100指数证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,基金运作合法合规,无损害基金持有人利益的行为,基金的投资管理符合有关法规及基金合同的规定。

4.3公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司通过建立科学、制衡的投资决策体系,加强交易分配环节的内部控制,并通过实时的行为监控与及时的分析评估,保证公平交易原则的实现。

在投资决策的内部控制方面,公司制度规定投资组合投资的股票必须来源于备选股票库,重点投资的股票必须来源于核心股票库。公司建立了严格的投资授权制度,投资组合经理在授权范围内可以自主决策,超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易过程中,中央交易部按照"时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡"的原则,公平分配投资指令。监察稽核部风险控制岗通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控及预警,实现投资风险的事中风险控制;稽核岗通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核,实现投资风险的事后控制。

本报告期内,上述公平交易制度总体执行情况良好,不同的投资组合受到了公平对待,未发生任何不公平的交易事项。

4.3.2异常交易行为的专项说明

本公司原则上禁止不同投资组合之间(完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合除外)或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易。如果因应对大额赎回等特殊情况需要进行反向交易的,则需经公司领导严格审批并留痕备查。

本报告期内,本投资组合与本公司管理的其他投资组合未发生过同日反向交易的情况。

4.4报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

二季度初,美股经历了一季度末的大幅回落,在四月份受中国股市红火带动而上扬。但是随后两个月主要受到市场对美国加息的分歧制约,美股表现疲软,在区间震荡,尽管企业盈利数据超预期,强势美元的影响低于预期,美股在三季度仍然表现为上下两难。虽然美联储在六月底的议息会议将加息推后,符合市场预期,但是希腊的债务问题又为美股短期走势形成不确定性;不仅如此,六月中旬中国股市遇到流动性问题,投资者在衡量中国股市流动性对美国市场的影响,这也在一定程度上制约了美国股市的上涨。

但总体来说,美国仍然是上半年表现最好的发达经济体之一。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金的净值增长率为1.30%,同期比较业绩基准收益率为1.70%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度,希腊问题和中国股市流动性问题的解决是三季度最重要的问题。希腊的大选结果表明希腊可以获得债权人的让步的可能性十分小,意味着希腊退出欧元区的风险刚增,虽然希腊退欧没有2011年时影响大,但是还是会对金融市场产生冲击,短期市场会受到卖压。但是我们相信市场对这一点已经消化了很多,现在的欧洲央行有足够的流动性去应对希腊违约以及退欧的影响。而中国也是第二个影响国际市场的风险因素,虽然我们认为中国有能力解决股市的流动性风险,但是短期的冲击会对投资者的短期风险偏好产生影响。不过这些问题也将会是美联储考虑三季度加息的因素。总的来说我们对美国经济增长的预期是非常正面的,特别是对于美国高新技术行业集中的纳斯达克100指数尤其有信心。明年随着人工智能,虚拟现实的普及,纳斯达克指数中的优秀企业有望迎来新一轮估值上涨,我们坚定看好纳斯达克100指数未来的增长空间。

§5 投资组合报告

5.1 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	210,145,681.47	92.58
	其中:普通股	206,844,887.14	91.12
	存托凭证	3,300,794.33	1.45
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	4,358,954.31	1.92
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	0.00	0.00
	其中:远期	-	-
	期货	0.00	0.00
	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	10,117,924.13	4.46
8	其他各项资产	2,373,617.48	1.05
9	合计	226,996,177.39	100.00

5.2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(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
美国	210,145,681.47	94.80
合计	210,145,681.47	94.80

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、上述美国比重包括注册地为开曼群岛、百慕大和英国在美国上市的ADR。

5.3报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
能源	-	-
材料	690,915.36	0.31
工业	4,303,782.85	1.94
非必须消费品	41,516,917.87	18.73
必须消费品	13,210,572.38	5.96
保健	32,824,547.47	14.81
金融	-	-
信息技术	115,969,350.23	52.31
电信服务	1,629,595.31	0.74
公共事业	-	-
合计	210,145,681.47	94.80

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

5.4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	39,510.00	30,296,200.04	13.67
2	MICROSOFT CORP	微软	MSFT US	纳斯达克证券交易所	美国	55,647.00	15,019,984.49	6.78
3	AMAZON.COM INC	亚马逊公司	AMZN US	纳斯达克证券交易所	美国	3,150.00	8,359,635.77	3.77
4	FACEBOOK INC-A	Facebook公司	FB US	纳斯达克证券交易所	美国	15,169.00	7,953,605.85	3.59
5	GOOGLE INC-CL C	谷歌公司	GOOG US	纳斯达克证券交易所	美国	2,317.00	7,373,134.08	3.33
6	GILEAD SCIENCES INC	吉利德科学	GILD US	纳斯达克证券交易所	美国	10,103.00	7,231,528.25	3.26
7	GOOGLE INC-CL A	谷歌公司	GOOGL US	纳斯达克证券交易所	美国	1,947.00	6,428,192.90	2.90
8	INTEL CORP	英特尔公司	INTC US	纳斯达克证券交易所	美国	32,125.00	5,973,487.78	2.69
9	CISCO SYSTEMS INC	思科	CSCO US	纳斯达克证券交易所	美国	34,626.00	5,812,994.04	2.62
10	COMCAST CORP-CLASS A	康卡斯特	CMCSA US	纳斯达克证券交易所	美国	14,456.00	5,315,065.04	2.40

5.5报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.6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

本金本报告期末未持有债券。

5.7报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十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。

5.8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

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	股指期货	SEP 15 IMM EMINI NSDQ GLOBEX TRADE SPREAD TRADE	0.00	0.00
-	-	-	-	-
-	-	-	-	-
-	-	-	-	-
-	-	-	-	-

5.9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	契约型开放式	ProShares Trust	4,358,954.31	1.97
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-

5.10投资组合报告附注

5.10.1根据公开市场信息,本基金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。

5.10.2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。

5.10.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	1,194,402.11
3	应收股利	86,724.66
4	应收利息	710.19
5	应收申购款	1,091,780.52
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,373,617.48

5.10.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 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未存在流通受限情况的情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	178,272,894.14
本报告期基金总申购份额	37,987,903.85
减:本报告期基金总赎回份额	66,771,200.39
本报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	149,489,597.60

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内,基金管理人不存在运用固有资金(认)申购、赎回或买卖本基金的情况。

§8备查文件目录

8.1备查文件目录

1.中国证监会批准广发纳斯达克100指数证券投资基金募集的文件

2.《广发纳斯达克100指数证券投资基金基金合同》

3.《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》

4.《广发纳斯达克100指数证券投资基金托管协议》

5.法律意见书

6.基金管理人业务资格批件、营业执照

7.基金托管人业务资格批件、营业执照

8.2存放地点

广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

8.3查阅方式

1.书面查阅:查阅时间为每工作日8:30-11:30,13:30-17:00。投资者可免费查阅,也可按工本费购买复印件;

2.网站查阅:基金管理人网址:http://www.gffunds.com.cn。

投资者如对本报告有疑问,可咨询本基金管理人广发基金管理有限公司,咨询电话95105828或020-83936999,或发电子邮件:services@gf-funds.com.cn。

广发基金管理有限公司
二〇一五年七月二十一日

广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金

【2015】第二季度报告

基金管理人:广发基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年七月二十一日

§1 重要提示

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年7月15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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发生物科技指数(QDII)
基金主代码	001092
交易代码	001092
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年3月30日
报告期末基金份额总额	629,596,910.25份
投资目标	本基金采用被动式指数化投资策略,紧密跟踪纳斯达克生物科技指数,力求实现对标的指数的跟踪偏离度和跟踪误差最小化,为投资者提供一个投资美国纳斯达克生物科技市场的有效投资工具。
投资策略	(一)资产配置策略本基金为被动管理的指数型基金,在正常情况下,力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.5%以内,年跟踪误差控制在5%以内。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。(二)权益类投资策略 股票组合构建方法本基金主要采用完全复制法跟踪标的指数,以完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则,进行被动式指数化投资。(三)固定收益类投资策略(四)衍生品投资策略
业绩比较基准	95%×人民币计价的纳斯达克生物科技指数收益率+5%×人民币活期存款收益率(税后)。
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。本基金为被动管理的指数型基金,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年4月1日-2015年6月30日)
1.本期已实现收益	4,413,405.45
2.本期利润	27,270,805.64
3.加权平均基金份额本期利润	0.0293
4.期末基金资产净值	650,365,398.76
5.期末基金份额净值	1.033

注:注:1、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。

2、上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。

3.2 基金净值表现

3.2.1本报告期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

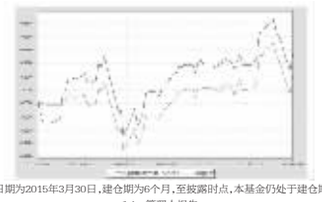
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.30%	1.22%	7.38%	1.34%	-4.08%	-0.12%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2015年3月30日至2015年6月30日)



注:本基金合同生效日期为2015年3月30日,建仓期为6个月,至披露时点,本基金仍处于建仓期,且基金成立未满一年。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
邱炜	本基金的基金经理;广发全球农业指数(QDII)的基金经理;广发美国房地产指数(QDII)基金的基金经理;广发亚太中高收益债券(QDII)基金的基金经理;广发全球医疗保健(QDII)基金的基金经理;广发生物科技指数(QDII)基金的基金经理;广发纳指100ETF基金的基金经理;国际业务部副总经理;另类投资部副总经理	2015-03-30	-	8年	男,中国籍,统计学博士,持有基金业执业资格证书,2007年5月至2008年7月在摩根大通集团(纽约)任高级分析师兼助理副总裁,2008年7月至2011年6月任广发基金管理有限公司国际业务部研究员,2011年6月28日起任广发标普全球农业指数证券投资基金的基金经理,2012年8月15日起任广发纳斯达克100指数证券投资基金的基金经理,2013年8月9日起任广发美国房地产指数证券投资基金的基金经理,2013年11月28日起任广发亚太中高收益债券型证券投资基金的基金经理,2013年12月10日起任广发全球医疗保健指数证券投资基金的基金经理,2014年1月21日起任广发基金管理有限公司国际业务部副总经理,2015年1月14日起任广发基金管理有限公司另类投资部副总经理,2015年3月30日起任广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金的基金经理,2015年6月10日起任广发纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。

注:1."任职日期"和"离职日期"指公司公告聘任或解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规、《广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司通过建立科学、制衡的投资决策体系,加强交易分配环节的内部控制,并通过实时的行为监控与及时的分析评估,保证公平交易原则的实现。

在投资决策的内部控制方面,公司制度规定投资组合投资的股票必须来源于备选股票库,重点投资的股票必须来源于核心股票库。公司建立了严格的投资授权制度,投资组合经理在授权范围内可以自主决策,超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易过程中,中央交易部按照"时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡"的原则,公平分配投资指令。监察稽核部风险控制岗通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控及预警,实现投资风险的事中风险控制;稽核岗通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核,实现投资风险的事后控制。

本报告期内,上述公平交易制度总体执行情况良好,不同的投资组合受到了公平对待,未发生任何不公平的交易事项。

4.3.2异常交易行为的专项说明

本公司原则上禁止不同投资组合之间(完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合除外)或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易。如果因应对大额赎回等特殊情况需要进行反向交易的,则需经公司领导严格审批并留痕备查。

本报告期内,本投资组合与本公司管理的其他投资组合发生过同日反向交易的情况,但成交较少的单边交易量不超过该证券当日成交量的5%。这些交易不存在任何利益输送的嫌疑。

4.4报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

二季度初,在企业盈利超预期和药企重磅药临床数据的利好推动下,纳指生物科技指数在4月上半月反弹,从一季度末希腊问题导致的美股低迷局面中走出来。但是4.5月份是药物临床数据发布的高峰期,生物科技企业此时波动巨大。四月末,基因疗法公司Celladon二期临床试验失败导致了市场对基因疗法的前景产生担忧,生物科技企业被大幅抛售。但是一两个公司的试验数据并不代表整个行业情况,抛售很快结束。随着恐慌抛售潮结束,生物科技板块重拾升势,并在美联储6月推迟加息后再次创出历史新高。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金的净值增长率为3.30%,同期比较业绩基准收益率为7.38%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度,生物科技行业仍然是美国经济复苏中高速增长的行业,但是需要关注希腊问题和中国股市流动性问题对全球风险偏好的影响,目前来看希腊问题和中国股市流动性问题是三季度最重要的风险因素。希腊的大选结果表明希腊可以获得债权人让步的可能性十分小,意味着希腊退出欧元区的风险刚增。虽然希腊退欧没有2011年的时候影响大,但是还是会对金融市场产生冲击,短期市场会受到卖压。但是我们相信市场对这一点已经消化了很多,现在的欧洲央行有足够的流动性去应对希腊违约以及退欧的影响。而中国也是世界第二个影响市场的风险因素,虽然我们认为中国有能力解决股市的流动性风险,但是短期的冲击会对投资者的短期风险偏好产生影响。但是对于生物科技指数的投资可以不必担心,从美国生物科技行业的基本面来看,今年生物科技行业的整体收入和利润增速仍然保持高增长,重要药物的临床试验数据也是大部分符合市场预期,未来随着时间的推移,指数的增长将会追随企业盈利的增长。

§5 投资组合报告

5.1 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	546,472,168.68	80.45
	其中:普通股	533,559,731.33	78.55
	存托凭证	12,912,437.35	1.90
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	68,432,249.33	10.07
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	24,816,112.43	3.65
8	其他各项资产	39,548,635.28	5.82
9	合计	679,269,165.72	100.00

5.2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(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
美国	546,472,168.68	84.03
合计	546,472,168.68	84.03

注: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、上述美国比重包括注册地为英国、法国在美国上市的ADR。

5.3报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
能源	-	-
材料	-	-
工业	-	-
非必须消费品	-	-
必须消费品	-	-
保健	546,472,168.68	84.03
金融	-	-
信息技术	-	-
电信服务	-	-
公共事业	-	-
合计	546,472,168.68	84.03

5.4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	GILEAD SCIENCES INC	吉利德科学	GILD US	纳斯达克证券交易所	美国	65,931.00	47,192,110.17	7.26
2	BIOGEN INC	百健	BIIB US	纳斯达克证券交易所	美国	16,666.00	41,157,146.71	6.33
3	AMGEN INC	安进	AMGN US	纳斯达克证券交易所	美国	43,279.00	40,619,932.70	6.25
4	CELGENE CORP	新基医药	CELG US	纳斯达克证券交易所	美国	56,166.00	39,740,674.32	6.11
5	REGENERON PHARMACEUTICALS	再生元制药股份有限公司	REGN US	纳斯达克证券交易所	美国	12,565.00	39,186,852.10	6.03
6	MYLAN NV	迈兰公司	MYL US	纳斯达克证券交易所	美国	63,225.00	26,230,085.95	4.03
7	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	Alexion制药公司	ALXN US	纳斯达克证券交易所	美国	22,065.00	24,385,255.49	3.75
8	ILLUMINA INC	Illumina公司	ILMN US	纳斯达克证券交易所	美国	17,462.00	23,311,170.98	3.58
9	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	维特制药股份有限公司	VRTX US	纳斯达克证券交易所	美国	28,577.00	21,572,986.71	3.32
10	BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	BioMarin 制药股份有限公司	BMRN US	纳斯达克证券交易所	美国	20,541.00	17,176,758.21	2.64

5.5报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.6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

5.7报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十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。

5.8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投资。

5.9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 NASD BIOTECH	ETF	契约型开放式	ProShares Trust	68,432,249.33	10.52

5.10投资组合报告附注

5.10.1本基金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。

5.10.2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。

5.10.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	29,528,527.64
3	应收股利	-
4	应收利息	4,572.58
5	应收申购款	3,810,635.06
6	其他应收款	6,204,900.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	39,548,635.28

5.10.4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。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	1,051,001,960.92
本报告期基金总申购份额	80,304,555.75
减:本报告期基金总赎回份额	501,709,606.42
本报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	629,596,910.25

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内,基金管理人不存在运用固有资金(认)申购、赎回或买卖本基金的情况。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,200.02	1.59%	10,000,200.02	1.59%	三年
基金管理人高级管理人员	494,589.84	0.08%	-	-	-
基金经理等人员	1,004,016.54	0.16%	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	11,498,806.40	1.83%	10,000,200.02	1.59%	三年

§9备查文件目录

9.1备查文件目录

(一)中国证监会准予广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金募集注册的文件

(二)《广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金基金合同》

(三)《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》

(四)《广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金托管协议》

(五)法律意见书

(六)基金管理人业务资格批件、营业执照

(七)基金托管人业务资格批件、营业执照

9.2存放地点

广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

9.3查阅方式

1.书面查阅:查阅时间为每工作日8:30-11:30,13:30-17:00。投资者可免费查阅,也可按工本费购买复印件;

2.网站查阅:基金管理人网址:http://www.gffunds.com.cn。

投资者如对本报告有疑问,可咨询本基金管理人广发基金管理有限公司,咨询电话95105828或020-83936999,或发电子邮件:services@gf-funds.com.cn。

广发基金管理有限