

广发纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金

[2015]第四季度报告

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:二〇一六年一月二十日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及高级管理人员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约定，于2015年1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。

本报告期自2015年10月1日至2015年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称:广发纳斯达克100ETF
场内简称:纳斯100
基金代码:169941
交易时间:9:30-15:00
基金运作方式:交易型开放式
基金合同生效日:2015年6月10日
报告期末基金资产总额:36,062,514,000
投资目标:紧密跟踪纳斯达克100指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

1. 基金费用概要

本基金的管理费率为0.50%，托管费率为0.10%，申购费率为1.50%，赎回费率为0.50%，申购赎回费率为0.50%。

当申购的基金份额与赎回的基金份额的核算结果可能影响申购、赎回金额时，基金管理人有权暂停或拒绝申购、赎回。如有申购限制，基金管理人有权对申购或赎回的基金份额的核算结果可能影响申购、赎回金额时，基金管理人有权暂停或拒绝申购、赎回。基金管理人可以对根据申购、赎回金额时，基金管理人有权暂停或拒绝申购、赎回。

2. 基金的申购和赎回

本基金将主要以低风险和低费用的申购和赎回为原则，综合考虑申购和赎回的便利性，构建基金资产在市场中的投资组合。

3. 基金的申购和赎回

当申购的基金份额与赎回的基金份额的核算结果可能影响申购、赎回金额时，基金管理人有权暂停或拒绝申购、赎回。

4. 基金的申购和赎回

本基金将主要以低风险和低费用的申购和赎回为原则，综合考虑申购和赎回的便利性，构建基金资产在市场中的投资组合。

5. 基金的申购和赎回

本基金将主要以低风险和低费用的申购和赎回为原则，综合考虑申购和赎回的便利性，构建基金资产在市场中的投资组合。

6. 基金的申购和赎回

本基金将主要以低风险和低费用的申购和赎回为原则，综合考虑申购和赎回的便利性，构建基金资产在市场中的投资组合。

7. 基金的申购和赎回

本基金将主要以低风险和低费用的申购和赎回为原则，综合考虑申购和赎回的便利性，构建基金资产在市场中的投资组合。

8. 其他各项资产

16,141,931 0.004

9. 合计 36,087,464,931 100.000

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	32,865,138,761	88.85
其中:普通股	32,272,264,411	87.25	
存托凭证	592,872,271	1.60	
优先股	-	-	
房地产业务	-	-	
2	基金投资	2,060,795,911	5.57
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	-	-	
b	买入返售金融资产	-	-
其中:质押式回购	-	-	
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,046,419,771	5.53
8	其他各项资产	16,141,931	0.004
9	合计	36,087,464,931 100.000	

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 公允价值(人民币元) 占基金资产净值比例(%)

美国 32,865,138,761 90.57

合计 32,865,138,761 90.57

注:1.美国(本土)为剔除股票及存托凭证所在的证券交易所确定。

2.上述美国(本土)重申标注为境外托管,在美国上市的ADR。

3.4.3 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 408,561,179 1.37

非必须消费品 6,366,096,781 18.16

必须消费品 2,204,181,611 6.32

保健 4,163,296,696 13.57

金融 - -

信息技术 18,466,722,691 50.89

电信服务 166,409,695 0.46

公共事业 - -

合计 32,865,138,761 90.57

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债券及存托凭证投资明细

序号 公司名称(中文) 公司名称(英文) 证券代码 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 AAPLUS 纳斯达克证券交易所(美国) 5,462,000 3,733,366,231 10.29

2 MICROSOFT CORP 微软 MSFTUS 纳斯达克证券交易所(美国) 7,825,000 2,819,073,966 7.77

3 AMAZONCOM INC 亚马逊公司 AMZNUS 纳斯达克证券交易所(美国) 469,000 2,014,532,322 5.56

4 ALPHABET INC-CL C Alphabet公司 GOOGUS 纳斯达克证券交易所(美国) 338,000 1,666,617,275 4.59

5 FACEBOOK INC-A Facebook公司 FBUS 纳斯达克证券交易所(美国) 2,224,000 1,511,475,271 4.17

6 ALPHABET INC-CL A Alphabet公司 GOOGLUS 纳斯达克证券交易所(美国) 285,000 1,439,844,433 3.97

7 INTEL CORP 英特尔公司 INTCUS 纳斯达克证券交易所(美国) 4,622,000 1,033,962,289 2.85

8 GILEAD SCIENCES INC 吉利德科学 GILDUS 纳斯达克证券交易所(美国) 1,411,000 927,150,530 2.66

9 CISCO SYSTEMS INC 思科 CSCOUS 纳斯达克证券交易所(美国) 4,973,000 876,907,561 2.42

10 COMCAST CORP-CLASS A 康卡斯特 CMCSAUS 纳斯达克证券交易所(美国) 2,392,000 876,500,726 2.42

5.5 本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的各项资产配置比例

广发纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩基准收益率历史走势对比如图

(2015年6月10日至2015年12月31日)

注:1.本基金合同于2015年6月10生效，截至报告期末基金合同生效不满一年。

2.本基金合同为基金合同生效后六个月内，建仓后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 在本基金的基金管理人任职日期 离任日期 证券从业年限 说明

陈若愚 基金经理 2015-06-10 - 8年 男，中国国籍，统计学博士，持有中国基金业协会颁发的基金从业资格证书，2007年7月至2010年6月在广发基金管理有限公司任行业研究员，2010年6月至2011年1月任行业分析师，2011年1月任行业研究员兼助理总监，2012年1月任行业研究员兼助理总监，2013年1月任行业研究员兼助理总监，2014年1月任行业研究员兼助理总监，2015年1月任行业研究员兼助理总监，2015年6月10日起任本基金基金经理。

注:1.本基金的基金经理陈若愚先生的薪酬由广发基金管理有限公司按照行业平均水平支付。

2.本基金的基金经理陈若愚先生的薪酬由广发基金管理有限公司按照行业平均水平支付。

3.本基金的基金经理陈若愚先生的薪酬由广发基金管理有限公司按照行业平均水平支付。

4.3.1 公平交易制度执行情况

4.3.2 公平交易制度执行情况的专项说明

4.3.3 公平交易行为的专项说明

4.3.4 公平交易制度执行情况的专项说明

4.3.5 公平交易制度执行情况的专项说明

4.3.6 公平交易制度执行情况的专项说明

4.3.7 公平交易制度执行情况的专项说明

4.3.8 公平交易制度执行情况的专项说明

4.3.9 公平交易制度执行情况的专项说明

4.3.10 公平交易制度执行情况的专项说明

4.3.11 公平交易制度执行情况的专项说明

4.3.12 公平交易制度执行情况的专项说明

4.3.13 公平交易制度执行情况的专项说明

4.3.14 公平交易制度执行情况的专项说明

4.3.15 公平交易制度执行情况的专项说明

4.3.16 公平交易制度执行情况的专项说明

4.3.17 公平交易制度执行情况的专项说明

4.3.18 公平交易制度执行情况的专项说明

4.3.19 公平交易制度执行情况的专项说明

4.3.20 公平交易制度执行情况的专项说明

4.3.21 公平交易制度执行情况的专项说明

4.3.22 公平交易制度执行情况的专项说明

4.3.23 公平交易制度执行情况的专项说明

4.3.24 公平交易制度执行情况的专项说明

4.3.25 公平交易制度执行情况的专项说明

4.3.26 公平交易制度执行情况的专项说明

4.3.27 公平交易制度执行情况的专项说明

4.3.28 公平交易制度执行情况的专项说明

4.3.29 公平交易制度执行情况的专项说明

4.3.30 公平交易制度执行情况的专项说明

4.3.31 公平交易制度执行情况的专项说明

4.3.32 公平交易制度执行情况的专项说明

4.3.33 公平交易制度执行情况的专项说明

4.3.34 公平交易制度执行情况的专项说明

4.3.35 公平交易制度执行情况的专项说明

4.3.36 公平交易制度执行情况的专项说明

4.3.37 公平交易制度执行情况的专项说明

4.3.38 公平交易制度执行情况的专项说明

4.3.39 公平交易制度执行情况的专项说明

4.3.40 公平交易制度执行情况的专项说明

4.3.41 公平交易制度执行情况的专项说明

4.3.42 公平交易制度执行情况的专项说明

4.3.43 公平交易制度执行情况的专项说明

4.3.44 公平交易制度执行情况的专项说明