

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

1.1 重要提示

基金管理人承诺:遵守法律法规,恪守基金管理人职责,诚实守信,勤勉尽责,按照基金合同约定,公平对待所有基金份额持有人,维护基金份额持有人的合法权益,保障基金财产的安全,实现基金财产保值增值,并依法披露基金信息,接受基金份额持有人的监督。

2.1 基金基本情况

Table with 2 columns: 基金名称, 广发纳斯达克100指数(QDII)
基金代码, 270042
交易代码, 270042

投资目标:本基金采用指数化投资,通过严格的资产配置和数量化风险管理手段,力求实现对指数的有效跟踪,追求跟踪误差的最小化。

投资策略:本基金主要采用完全复制,即完全复制指数的成份股及其权重,并根据指数成份股变动,并跟踪指数的成份股及其权重,进行相应的调整。

Table with 2 columns: 项目, 基金管理人
名称, 广发基金管理有限公司
信息披露负责人, 魏志军

3.1 主要会计数据和财务指标

Table with 3 columns: 项目, 2014年, 2013年
3.1.1 本期收益指标, 本期收益, 4,740,321.42
3.1.2 本期基金份额净值, 2014年末, 0.0775

Table with 3 columns: 阶段, 份额净值增长率, 业绩比较基准增长率
过三个月, 3.94%, 0.95%



图 3.2 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比

Table with 3 columns: 年度, 每 10 份基金份额净值增长率, 业绩比较基准增长率
2012, -, -

3.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比

Table with 3 columns: 年度, 每 10 份基金份额净值增长率, 业绩比较基准增长率
2012, -, -

4.1 基金管理人及基金托管人

4.1.1 基金管理人:广发基金管理有限公司
4.1.2 基金托管人:中国银行股份有限公司

4.2 基金管理人及基金托管人

4.2.1 基金管理人:广发基金管理有限公司
4.2.2 基金托管人:中国银行股份有限公司

4.3 基金管理人及基金托管人

4.3.1 基金管理人:广发基金管理有限公司
4.3.2 基金托管人:中国银行股份有限公司

4.4 基金管理人及基金托管人

4.4.1 基金管理人:广发基金管理有限公司
4.4.2 基金托管人:中国银行股份有限公司

4.5 基金管理人及基金托管人

4.5.1 基金管理人:广发基金管理有限公司
4.5.2 基金托管人:中国银行股份有限公司

4.6 基金管理人及基金托管人

4.6.1 基金管理人:广发基金管理有限公司
4.6.2 基金托管人:中国银行股份有限公司

4.7 基金管理人及基金托管人

4.7.1 基金管理人:广发基金管理有限公司
4.7.2 基金托管人:中国银行股份有限公司

4.7.3 基金管理人:广发基金管理有限公司
4.7.4 基金托管人:中国银行股份有限公司

广发纳斯达克100 指数证券投资基金

2014 年度 报告摘要

2014年12月31日

4.3.3 异常交易行为的专项说明
报告期内未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人及基金托管人的投资职责履行的说明
4.4.1 报告期内,本基金严格遵守法律法规,3月份美股经历了三波调整行情,尤其是前期大幅下跌的互联网科技和生物医药类股票出现明显回调。

4.4.2 报告期内,本基金严格遵守法律法规,3月份美股经历了三波调整行情,尤其是前期大幅下跌的互联网科技和生物医药类股票出现明显回调。

4.4.3 报告期内,本基金严格遵守法律法规,3月份美股经历了三波调整行情,尤其是前期大幅下跌的互联网科技和生物医药类股票出现明显回调。

4.4.4 报告期内,本基金严格遵守法律法规,3月份美股经历了三波调整行情,尤其是前期大幅下跌的互联网科技和生物医药类股票出现明显回调。

4.4.5 报告期内,本基金严格遵守法律法规,3月份美股经历了三波调整行情,尤其是前期大幅下跌的互联网科技和生物医药类股票出现明显回调。

4.4.6 报告期内,本基金严格遵守法律法规,3月份美股经历了三波调整行情,尤其是前期大幅下跌的互联网科技和生物医药类股票出现明显回调。

4.4.7 报告期内,本基金严格遵守法律法规,3月份美股经历了三波调整行情,尤其是前期大幅下跌的互联网科技和生物医药类股票出现明显回调。

4.4.8 报告期内,本基金严格遵守法律法规,3月份美股经历了三波调整行情,尤其是前期大幅下跌的互联网科技和生物医药类股票出现明显回调。

4.4.9 报告期内,本基金严格遵守法律法规,3月份美股经历了三波调整行情,尤其是前期大幅下跌的互联网科技和生物医药类股票出现明显回调。

4.4.10 报告期内,本基金严格遵守法律法规,3月份美股经历了三波调整行情,尤其是前期大幅下跌的互联网科技和生物医药类股票出现明显回调。

4.4.11 报告期内,本基金严格遵守法律法规,3月份美股经历了三波调整行情,尤其是前期大幅下跌的互联网科技和生物医药类股票出现明显回调。

4.4.12 报告期内,本基金严格遵守法律法规,3月份美股经历了三波调整行情,尤其是前期大幅下跌的互联网科技和生物医药类股票出现明显回调。

4.4.13 报告期内,本基金严格遵守法律法规,3月份美股经历了三波调整行情,尤其是前期大幅下跌的互联网科技和生物医药类股票出现明显回调。

4.4.14 报告期内,本基金严格遵守法律法规,3月份美股经历了三波调整行情,尤其是前期大幅下跌的互联网科技和生物医药类股票出现明显回调。

4.4.15 报告期内,本基金严格遵守法律法规,3月份美股经历了三波调整行情,尤其是前期大幅下跌的互联网科技和生物医药类股票出现明显回调。

4.4.16 报告期内,本基金严格遵守法律法规,3月份美股经历了三波调整行情,尤其是前期大幅下跌的互联网科技和生物医药类股票出现明显回调。

4.4.17 报告期内,本基金严格遵守法律法规,3月份美股经历了三波调整行情,尤其是前期大幅下跌的互联网科技和生物医药类股票出现明显回调。

4.4.18 报告期内,本基金严格遵守法律法规,3月份美股经历了三波调整行情,尤其是前期大幅下跌的互联网科技和生物医药类股票出现明显回调。

4.4.19 报告期内,本基金严格遵守法律法规,3月份美股经历了三波调整行情,尤其是前期大幅下跌的互联网科技和生物医药类股票出现明显回调。

4.4.20 报告期内,本基金严格遵守法律法规,3月份美股经历了三波调整行情,尤其是前期大幅下跌的互联网科技和生物医药类股票出现明显回调。

4.4.21 报告期内,本基金严格遵守法律法规,3月份美股经历了三波调整行情,尤其是前期大幅下跌的互联网科技和生物医药类股票出现明显回调。

4.4.22 报告期内,本基金严格遵守法律法规,3月份美股经历了三波调整行情,尤其是前期大幅下跌的互联网科技和生物医药类股票出现明显回调。

4.4.23 报告期内,本基金严格遵守法律法规,3月份美股经历了三波调整行情,尤其是前期大幅下跌的互联网科技和生物医药类股票出现明显回调。

4.4.24 报告期内,本基金严格遵守法律法规,3月份美股经历了三波调整行情,尤其是前期大幅下跌的互联网科技和生物医药类股票出现明显回调。

4.4.25 报告期内,本基金严格遵守法律法规,3月份美股经历了三波调整行情,尤其是前期大幅下跌的互联网科技和生物医药类股票出现明显回调。

4.4.26 报告期内,本基金严格遵守法律法规,3月份美股经历了三波调整行情,尤其是前期大幅下跌的互联网科技和生物医药类股票出现明显回调。

4.4.27 报告期内,本基金严格遵守法律法规,3月份美股经历了三波调整行情,尤其是前期大幅下跌的互联网科技和生物医药类股票出现明显回调。

4.4.28 报告期内,本基金严格遵守法律法规,3月份美股经历了三波调整行情,尤其是前期大幅下跌的互联网科技和生物医药类股票出现明显回调。

4.4.29 报告期内,本基金严格遵守法律法规,3月份美股经历了三波调整行情,尤其是前期大幅下跌的互联网科技和生物医药类股票出现明显回调。

4.4.30 报告期内,本基金严格遵守法律法规,3月份美股经历了三波调整行情,尤其是前期大幅下跌的互联网科技和生物医药类股票出现明显回调。

4.4.31 报告期内,本基金严格遵守法律法规,3月份美股经历了三波调整行情,尤其是前期大幅下跌的互联网科技和生物医药类股票出现明显回调。

4.4.32 报告期内,本基金严格遵守法律法规,3月份美股经历了三波调整行情,尤其是前期大幅下跌的互联网科技和生物医药类股票出现明显回调。

4.4.33 报告期内,本基金严格遵守法律法规,3月份美股经历了三波调整行情,尤其是前期大幅下跌的互联网科技和生物医药类股票出现明显回调。

4.4.34 报告期内,本基金严格遵守法律法规,3月份美股经历了三波调整行情,尤其是前期大幅下跌的互联网科技和生物医药类股票出现明显回调。

4.4.35 报告期内,本基金严格遵守法律法规,3月份美股经历了三波调整行情,尤其是前期大幅下跌的互联网科技和生物医药类股票出现明显回调。

4.4.36 报告期内,本基金严格遵守法律法规,3月份美股经历了三波调整行情,尤其是前期大幅下跌的互联网科技和生物医药类股票出现明显回调。

4.4.37 报告期内,本基金严格遵守法律法规,3月份美股经历了三波调整行情,尤其是前期大幅下跌的互联网科技和生物医药类股票出现明显回调。

4.4.38 报告期内,本基金严格遵守法律法规,3月份美股经历了三波调整行情,尤其是前期大幅下跌的互联网科技和生物医药类股票出现明显回调。

4.4.39 报告期内,本基金严格遵守法律法规,3月份美股经历了三波调整行情,尤其是前期大幅下跌的互联网科技和生物医药类股票出现明显回调。

4.4.40 报告期内,本基金严格遵守法律法规,3月份美股经历了三波调整行情,尤其是前期大幅下跌的互联网科技和生物医药类股票出现明显回调。

4.4.41 报告期内,本基金严格遵守法律法规,3月份美股经历了三波调整行情,尤其是前期大幅下跌的互联网科技和生物医药类股票出现明显回调。

4.4.42 报告期内,本基金严格遵守法律法规,3月份美股经历了三波调整行情,尤其是前期大幅下跌的互联网科技和生物医药类股票出现明显回调。

4.4.43 报告期内,本基金严格遵守法律法规,3月份美股经历了三波调整行情,尤其是前期大幅下跌的互联网科技和生物医药类股票出现明显回调。

4.4.44 报告期内,本基金严格遵守法律法规,3月份美股经历了三波调整行情,尤其是前期大幅下跌的互联网科技和生物医药类股票出现明显回调。

Table with 7 columns: 序号, 基金名称, 基金代码, 基金管理人, 基金托管人, 基金净值, 基金份额

8.6.1 截至报告期末,本基金资产净值 20.00 亿元,基金份额总额 20.00 亿份,基金份额净值为 1.00 元。

Table with 5 columns: 序号, 公司名称(英文), 证券代码, 本期累计买入金额, 占期末资产净值比例

注:本基金及上述 8.5.2.3 表中的基金名称一级市场上主动的 A 类、B 类、C 类、D 类、E 类、F 类、G 类、H 类、I 类、J 类、K 类、L 类、M 类、N 类、O 类、P 类、Q 类、R 类、S 类、T 类、U 类、V 类、W 类、X 类、Y 类、Z 类。

8.6.2 截至报告期末,本基金资产净值 20.00 亿元,基金份额总额 20.00 亿份,基金份额净值为 1.00 元。

Table with 5 columns: 序号, 公司名称(英文), 证券代码, 本期累计卖出金额, 占期末资产净值比例

注:本基金及上述 8.5.2.3 表中的基金名称一级市场上主动的 A 类、B 类、C 类、D 类、E 类、F 类、G 类、H 类、I 类、J 类、K 类、L 类、M 类、N 类、O 类、P 类、Q 类、R 类、S 类、T 类、U 类、V 类、W 类、X 类、Y 类、Z 类。

8.6.3 截至报告期末,本基金资产净值 20.00 亿元,基金份额总额 20.00 亿份,基金份额净值为 1.00 元。

Table with 5 columns: 项目, 2014年1月1日至2014年12月31日, 2013年1月1日至2013年12月31日

注:本基金及上述 8.5.2.3 表中的基金名称一级市场上主动的 A 类、B 类、C 类、D 类、E 类、F 类、G 类、H 类、I 类、J 类、K 类、L 类、M 类、N 类、O 类、P 类、Q 类、R 类、S 类、T 类、U 类、V 类、W 类、X 类、Y 类、Z 类。

8.6.4 截至报告期末,本基金资产净值 20.00 亿元,基金份额总额 20.00 亿份,基金份额净值为 1.00 元。

Table with 5 columns: 项目, 2014年1月1日至2014年12月31日, 2013年1月1日至2013年12月31日

注:本基金及上述 8.5.2.3 表中的基金名称一级市场上主动的 A 类、B 类、C 类、D 类、E 类、F 类、G 类、H 类、I 类、J 类、K 类、L 类、M 类、N 类、O 类、P 类、Q 类、R 类、S 类、T 类、U 类、V 类、W 类、X 类、Y 类、Z 类。

8.6.5 截至报告期末,本基金资产净值 20.00 亿元,基金份额总额 20.00 亿份,基金份额净值为 1.00 元。

Table with 5 columns: 项目, 2014年1月1日至2014年12月31日, 2013年1月1日至2013年12月31日

注:本基金及上述 8.5.2.3 表中的基金名称一级市场上主动的 A 类、B 类、C 类、D 类、E 类、F 类、G 类、H 类、I 类、J 类、K 类、L 类、M 类、N 类、O 类、P 类、Q 类、R 类、S 类、T 类、U 类、V 类、W 类、X 类、Y 类、Z 类。

8.6.6 截至报告期末,本基金资产净值 20.00 亿元,基金份额总额 20.00 亿份,基金份额净值为 1.00 元。

Table with 5 columns: 项目, 2014年1月1日至2014年12月31日, 2013年1月1日至2013年12月31日

注:本基金及上述 8.5.2.3 表中的基金名称一级市场上主动的 A 类、B 类、C 类、D 类、E 类、F 类、G 类、H 类、I 类、J 类、K 类、L 类、M 类、N 类、O 类、P 类、Q 类、R 类、S 类、T 类、U 类、V 类、W 类、X 类、Y 类、Z 类。

8.6.7 截至报告期末,本基金资产净值 20.00 亿元,基金份额总额 20.00 亿份,基金份额净值为 1.00 元。

Table with 5 columns: 项目, 2014年1月1日至2014年12月31日, 2013年1月1日至2013年12月31日

注:本基金及上述 8.5.2.3 表中的基金名称一级市场上主动的 A 类、B 类、C 类、D 类、E 类、F 类、G 类、H 类、I 类、J 类、K 类、L 类、M 类、N 类、O 类、P 类、Q 类、R 类、S 类、T 类、U 类、V 类、W 类、X 类、Y 类、Z 类。

8.6.8 截至报告期末,本基金资产净值 20.00 亿元,基金份额总额 20.00 亿份,基金份额净值为 1.00 元。

Table with 5 columns: 项目, 2014年1月1日至2014年12月31日, 2013年1月1日至2013年12月31日

注:本基金及上述 8.5.2.3 表中的基金名称一级市场上主动的 A 类、B 类、C 类、D 类、E 类、F 类、G 类、H 类、I 类、J 类、K 类、L 类、M 类、N 类、O 类、P 类、Q 类、R 类、S 类、T 类、U 类、V 类、W 类、X 类、Y 类、Z 类。

8.6.9 截至报告期末,本基金资产净值 20.00 亿元,基金份额总额 20.00 亿份,基金份额净值为 1.00 元。

8.6.10 截至报告期末,本基金资产净值 20.00 亿元,基金份额总额 20.00 亿份,基金份额净值为 1.00 元。