

广发纳斯达克100指数证券投资基金

2013第四季度报告

2013年12月31日

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

报告期截止日:二〇一四年一月二十二日

§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。

基金销售人员承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则，履行受托义务，对投资人披露基金的有关信息。

基金投资组合报告是基金管理人定期披露的信息，不能作为投资决策的依据，投资人须谨慎投资。

本报告期自2013年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称 广发纳斯达克100指数(QDII)

基金代码 270042

交易方式 场内型开放式

基金合同生效日 2012年8月15日

报告期末基金份额总额 129,433,983.96份

投资目标 本基金通过投资于纳斯达克100指数，通过严控仓位比例和量化策略实现和最大化风险管理手段，力求在扣除必要的管理费用后，取得与业绩比较基准相当的回报。

投资策略 本基金通过分析纳斯达克100指数的行业配置、估值水平、成长性等指标，通过严格的选股策略和量化策略实现和最大化风险管理手段，力求在扣除必要的管理费用后，取得与业绩比较基准相当的回报。

风险收益特征 本基金为股票型基金，风险收益高于货币市场基金、债券型基金与货币市场基金。本基金的风险主要来自于对标的指数的跟踪误差。

报告期末资产配置情况

§3 主要财务指标

2013年12月31日

序号 项目 金额(人民币元) 占基金总资产的比例 (%)

| 1 权益投资 134,824,984.47 78.02 |
| 2 衍生工具投资 134,824,984.47 78.02 |
| 3 衍生工具负债 3,512,463.32 2.03 |
| 4 货币类资产 - - |
| 5 其他资产 15,603,844.77 9.03 |
| 6 合计 173,380,833.52 100.00 |
| 7 报告期内基金投资组合变动表 | |
| 8 报告期内基金现金类资产及按摊余成本计算的期末现金类资产余额 | 4,994,106.35 2.89 |
| 9 合计 173,380,833.52 100.00 |

本基金通过投资于纳斯达克100指数，通过严控仓位比例和量化策略实现和最大化风险管理手段，力求在扣除必要的管理费用后，取得与业绩比较基准相当的回报。

报告期末资产配置情况

报告期末资产配置情况