

广发纳斯达克 100 指数证券投资基金

2013 年半年度报告

2013 年 6 月 30 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

报告送出日期：二〇一三年八月二十四日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2013 年 8 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2013 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1	重要提示及目录.....	2
1.1	重要提示.....	2
1.2	目录.....	3
2	基金简介.....	5
2.1	基金基本情况.....	5
2.2	基金产品说明.....	5
2.3	基金管理人和基金托管人.....	6
2.4	境外投资顾问和境外资产托管人.....	6
2.5	信息披露方式.....	7
2.6	其他相关资料.....	7
3	主要财务指标和基金净值表现.....	7
3.1	主要会计数据和财务指标.....	7
3.2	基金净值表现.....	8
4	管理人报告.....	9
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2	境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介.....	10
4.3	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	10
4.4	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.5	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	11
4.6	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
5	托管人报告.....	13
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	13
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	
	明	13
5.3	托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
6	半年度财务会计报告（未经审计）.....	14
6.1	资产负债表.....	14
6.2	利润表.....	15
6.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4	报表附注.....	17
7	投资组合报告.....	31
7.1	期末基金资产组合情况.....	31
7.2	期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	31
7.3	期末按行业分类的权益投资组合.....	32
7.4	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....	32
7.5	报告期内股票投资组合的重大变动.....	53
7.6	期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	55

7.7	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	55
7.8	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	55
7.9	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	55
7.10	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	55
7.11	投资组合报告附注	56
8	基金份额持有人信息	56
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57
9	开放式基金份额变动	57
10	重大事件揭示	57
10.1	基金份额持有人大会决议	57
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	57
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
10.4	基金投资策略的改变	58
10.5	报告期内改聘会计师事务所情况	58
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	58
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	58
10.8	其他重大事件	59
11	备查文件目录	60
11.1	备查文件目录	60
11.2	存放地点	60
11.3	查阅方式	60

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发纳斯达克100指数证券投资基金
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
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
报告期末基金份额总额	106,390,656.28份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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	<p>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%。</p> <p>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%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。</p> <p>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。</p> <p>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</p>

	<p>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。</p> <p>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。</p>
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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		广发基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	段西军	唐州徽
	联系电话	020-83936666	95566
	电子邮箱	dxj@gffunds.com.cn	tgxxpl@bank-of-china.com.cn
客户服务电话		95105828, 020-83936999	95566
传真		020-89899158	010-66594942
注册地址		广东省珠海市横琴新区宝中 路3号4004-56室	北京市西城区复兴门内大街1 号
办公地址		广州市海珠区琶洲大道东1 号保利国际广场南塔31-33 楼	北京市西城区复兴门内大街1 号
邮政编码		510308	100818
法定代表人		王志伟	田国立

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	无	Bank of China(Hong Kong)
	中文	无	中国银行(香港)有限公司
注册地址		无	香港花园道1号中银大厦
办公地址		无	香港花园道1号中银大厦
邮政编码		无	无

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.gffunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	广发基金管理有限公司	广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	919,001.44
本期利润	9,292,422.44
加权平均基金份额本期利润	0.0717
本期加权平均净值利润率	7.13%
本期基金份额净值增长率	6.70%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2013 年 6 月 30 日）
期末可供分配利润	-2,180,822.47
期末可供分配基金份额利润	-0.0205
期末基金资产净值	108,387,573.47
期末基金份额净值	1.019
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2013 年 6 月 30 日）
基金份额累计净值增长率	1.90%

注：1、基金合同生效日期为 2012 年 8 月 15 日，至披露时点未满一年。

2、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。

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

4、所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 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	-2.39%	0.93%	-2.37%	0.97%	-0.02%	-0.04%
过去三个月	1.29%	0.91%	1.95%	0.94%	-0.66%	-0.03%
过去六个月	6.70%	0.82%	7.64%	0.84%	-0.94%	-0.02%
自基金合同生效起至今	1.90%	0.75%	2.94%	0.88%	-1.04%	-0.13%

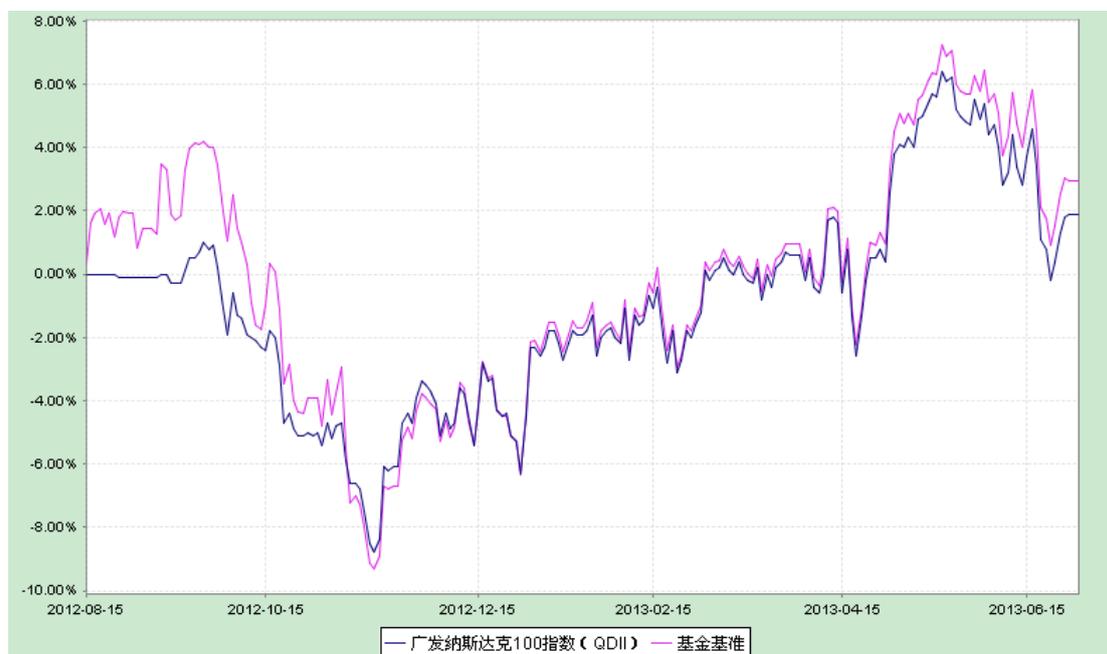
注：本基金业绩比较基准：人民币计价的纳斯达克 100 总收益指数收益率。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计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

份额累计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 2013 年 6 月 30 日)



4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人经中国证监会证监基金字[2003]91 号文批准，于 2003 年 8 月 5 日成立，注册资本 1.2 亿元人民币。公司的股东为广发证券股份有限公司、烽火通信科技股份有限公司、深圳市前海香江金融控股集团有限公司、康美药业股份有限公司和广州科技风险投资有限公司。公司拥有公募基金、企业年金投资管理人、社保基金投资管理人、受托管理保险资金投资管理人、合格境内机构投资者境外证券投资管理（QDII）和特定客户资产管理等业务资格。

本基金管理人在董事会下设合规及风险管理委员会、薪酬与资格审查委员会、战略规划委员会三个专业委员会。公司下设投资决策委员会、风险控制委员会和 19 个部门：综合管理部、财务部、人力资源部、监察稽核部、基金会计部、注册登记部、信息技术部、中央交易部、金融工程部、研究发展部、投资管理部、固定收益部、机构投资部、数量投资部、量化投资部、机构理财部、市场拓展部、电商及客服部、国际业务部。此外，还设立了广发国际资产管理有限公司（香港子公司）、瑞元资本管理有限公司以及北京办事处、北京分公司、广州分公司、上海分公司、深圳理财中心、杭州理财中心。

截至 2013 年 6 月 30 日，本基金管理人管理三十五只开放式基金——广发聚富开放式证券投资基金、广发稳健增长开放式证券投资基金、广发小盘成长股票型证券投资基金（LOF）、广发货币市场基金、广发聚丰股票型证券投资基金、广发策略优选混合型证券投资基金、广发大盘成长混合型证券投资基金、广发增强债券型证券投资基金、广发核心精选股票型证券投资基金、广发沪深 300 指数证券投资基金、广发聚瑞股票型证券投资基金、广发中证 500 指数证券投资基金（LOF）、广发内需增长灵活配置混合型证券投资基金、广发亚太（除日本）精选股票证券投资基金、广发行业领先股票型证券投资基金、广发聚祥保本混合型证券投资基金、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、广发标普全球农业指数证券投资基金、广发聚利债券型证券投资基金、广发制造业精选股票型证券投资基金、广发聚财信用债证券投资基金、广发深证 100 指数分级证券投资基金、广发消费品精选股票型证券投资基金、广发理财年年红债券型证券投资基金、广发纳斯达克 100 指数证券投资基金，广发双债添利债券型证券投资基金、广发纯债债券型证券投资基金、广发理财 30 天债券型证券投资基金、广发新经济股票型发

起式证券投资基金、广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、广发聚源定期开放债券型证券投资基金、广发轮动配置股票型证券投资基金、广发聚鑫债券型证券投资基金和广发理财 7 天债券型证券投资基金，管理资产规模为 1012.7 亿元。同时，公司还管理着多个企业年金基金、特定客户资产管理投资组合和社保基金投资组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 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；广发全球农业指数基金的基金经理	2012-08-15	-	6	男，中国籍，统计学博士，持有证券业执业资格证书，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。

注：1. 基金经理的“任职日期”和“离任日期”指公司公告聘任或解聘日期。

2. 基金经理助理的“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

3. 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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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。本报告期内，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。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 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。

4.4.2 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。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

受美国经济复苏的带动，欧美主要市场均是稳健上涨的走势，在美联储 5 月表达了 QE 退出的迹象之后，市场出现了较大幅度的调整，但毕竟 QE 退出的前提条件就是经济恢复到无须刺激政策了，市场在六月中旬企稳恢复上涨。整体美国经济复苏迹象明显，虽然宏观经济增速由于年初的政府减支影响而不明显，但从微观来看，各类型的企业盈利增长均显示出强劲复苏的态势，尤其是消费者的信心指数，美国消费者对于未来的预期指数，均显示出了

非常强劲的复苏迹象，甚至部分消费品比如大排量 SUV 和皮卡销量回到了 2007 年危机之前的水平，这都证明了微观老百姓预期的改善，也即美国经济从微观层面来看，确实是稳健复苏了。

纳斯达克 100 指数上半年的走势是一个上扬的走势，4 月中旬开始加速上涨导致了五月中旬出现调整，但六月中旬市场已经见底回升。

本基金以达到基金合同所规定的仓位，并严格按照指数复制操作，严格按照基金合同允许的范围对日常申购赎回进行操作。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金净值上涨 6.70%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

总的来说纳指是美国未来经济的希望所在，其包含的核心创新企业层出不穷，例如微软苹果谷歌，再到 facebook 和特斯拉，这都代表了未来经济复苏乃至更上一层楼的方向所在，故纳斯达克 100 指数中长期来讲是非常有潜力的一个指数，而短期则会受市场因素的影响，比如 QE 退出的话题导致的市场情绪波动。

展望下半年，纳斯达克 100 指数的成分企业盈利将保持增长，大型企业比如苹果的企稳更确保了未来一段时间指数的稳健性，而新兴企业比如谷歌、facebook 和特斯拉将在创新领域带领整体科技行业进一步向前发展，从而推动美国实体经济的稳健复苏。而美元的强势带来的资金回流，也在一定程度能够提高市场对于纳斯达克 100 指数的估值，故未来一段时间纳斯达克 100 指数成份股将很有可能出现盈利估值双提升。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设有估值委员会，按照相关法律法规和证监会的相关规定，负责制定旗下基金投资品种的估值原则和估值程序，并选取适当的估值方法，经公司管理层批准后方可实施。估值委员会的成员包括：公司分管投研、估值的副总经理、督察长、投资管理部负责人、研究发展部负责人、金融工程部负责人、监察稽核部负责人和基金会计部负责人。估值委员会定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。基金日常估值由基金会计部具体执行，并确保和托管行

核对一致。投资研究人员积极关注市场变化、证券发行机构重大事件等可能对估值产生重大影响的因素，向估值委员会提出估值建议，确保估值的公允性。金融工程部负责提供有关涉及模型的技术支持。监察稽核部负责定期对基金估值程序和方法进行核查，确保估值委员会的各项决策得以有效执行。以上所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。为保证基金估值的客观独立，基金经理不参与估值的具体流程，但若存在对相关投资品种估值有失公允的情况，可向估值委员会提出意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以维护基金持有人利益为准则。本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按合同约定提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配，本期末可供分配利润为-2,180,822.47。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对广发纳斯达克 100 指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确

和完整。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：广发纳斯达克 100 指数证券投资基金

报告截止日：2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	5,911,743.43	7,155,448.28
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	102,985,269.31	128,300,729.32
其中：股票投资		98,625,455.70	117,135,337.45
基金投资		4,359,813.61	11,165,391.87
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		1,089,867.87	2,777,509.65
应收利息	6.4.7.5	610.95	566.02
应收股利		74,540.65	65,030.66
应收申购款		227,874.37	88,210.41
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	31,189.80	156,642.71
资产总计		110,321,096.38	138,544,137.05
负 债 和 所 有 者 权 益	附注号	本期末 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		1,655,097.91	2,664,161.23
应付管理人报酬		73,360.78	94,154.51
应付托管费		22,925.27	29,423.30

应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	182,138.95	90,040.70
负债合计		1,933,522.91	2,877,779.74
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	106,390,656.28	142,021,651.41
未分配利润	6.4.7.10	1,996,917.19	-6,355,294.10
所有者权益合计		108,387,573.47	135,666,357.31
负债和所有者权益总计		110,321,096.38	138,544,137.05

注：报告截止日 2013 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 1.019 元，基金份额总额 106,390,656.28 份。

6.2 利润表

会计主体：广发纳斯达克 100 指数证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
一、收入		10,318,758.60	-
1.利息收入		15,777.56	-
其中：存款利息收入	6.4.7.11	15,777.56	-
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,319,751.72	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,272,094.50	-
基金投资收益	6.4.7.13	288,289.46	-
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收 益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	759,367.76	-

3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	8,373,421.00	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-466,761.04	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	76,569.36	-
减：二、费用		1,026,336.16	-
1. 管理人报酬		517,488.36	-
2. 托管费		161,715.09	-
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	44,001.23	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	303,131.48	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		9,292,422.44	-
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		9,292,422.44	-

注：基金合同生效日期为 2012 年 8 月 15 日，上年度可比期间无数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发纳斯达克 100 指数证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	142,021,651.41	-6,355,294.10	135,666,357.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	9,292,422.44	9,292,422.44
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-35,630,995.13	-940,211.15	-36,571,206.28
其中：1. 基金申购款	24,400,781.53	281,935.96	24,682,717.49
2. 基金赎回款	-60,031,776.66	-1,222,147.11	-61,253,923.77
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金	-	-	-

净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	106,390,656.28	1,996,917.19	108,387,573.47
项目	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-	-
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	-	-	-

注：基金合同生效日期为 2012 年 8 月 15 日，无可比较期间数据。

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：王志伟，主管会计工作负责人：林传辉，会计机构负责人：张晓章

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

广发纳斯达克 100 指数证券投资基金（“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称中国证监会）《关于同意广发纳斯达克 100 指数证券投资基金设立的批复》（证监许可[2012]568）批准，由广发基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》等有关规定和《广发纳斯达克 100 指数证券投资基金基金合同》（“基金合同”）发起，于 2012 年 8 月 15 日募集成立。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

限公司，境外资产托管人为中国银行(香港)有限公司。

本基金募集期为 2012 年 7 月 9 日至 2012 年 8 月 10 日，本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，募集资金总额为人民币 254,721,739.44 元，有效认购户数为 2,762 户。其中，认购款项在基金验资确认日之前产生的利息共计人民币 24,467.21 元，折合基金份额 24,467.21 份，按照基金合同的有关约定计入基金份额持有人的基金账户。本基金募集资金经天健会计师事务所(特殊普通合伙)验资。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和基金合同等有关规定，本基金的投资范围包括：美国证券市场中的纳斯达克 100 指数成份股、备选成份股、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)、新股(一级市场初次发行或增发)等，其中，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%，现金或者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。

本基金的财务报表于 2013 年 8 月 22 日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金执行企业会计准则、中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会于 2010 年 2 月 8 日颁布的证监会公告[2010]5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板 3 号<年度报告和半年度报告>》及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合企业会计准则和中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日修订的《证券投资基金会计核算业务指引》规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2013 年 6 月 30 日的财务状况以及 2013 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税 [2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关境内外税务法规和实务操作，主要税收优惠项目列示如下：

1. 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不缴纳营业税。
2. 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。
3. 基金取得的源自境外的收入，其涉及的境外所得税按照相关国家或地区税收法律和法规执行。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日
活期存款	5,911,743.43
定期存款	-
其他存款	-
合计	5,911,743.43

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	92,481,917.63	98,625,455.70	6,143,538.07
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	债券合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	4,338,493.20	4,359,813.61	21,320.41

其他	-	-	-
合计	96,820,410.83	102,985,269.31	6,164,858.48

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	610.95
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	-
合计	610.95

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日
其他应收款	-
待摊费用	31,189.80
合计	31,189.80

6.4.7.7 应付交易费用

本基金本报告期末无应付交易费用。

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	6,237.69
预提费用	175,901.26
其他应付款	-
合计	182,138.95

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	142,021,651.41	142,021,651.41
本期申购	24,400,781.53	24,400,781.53
本期赎回（以“-”号填列）	-60,031,776.66	-60,031,776.66
本期末	106,390,656.28	106,390,656.28

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-4,427,911.30	-1,927,382.80	-6,355,294.10
本期利润	919,001.44	8,373,421.00	9,292,422.44
本期基金份额交易产生的变动数	1,328,087.39	-2,268,298.54	-940,211.15
其中：基金申购款	-893,037.00	1,174,972.96	281,935.96
基金赎回款	2,221,124.39	-3,443,271.50	-1,222,147.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,180,822.47	4,177,739.66	1,996,917.19

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
	活期存款利息收入
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	-
其他	117.01
合计	15,777.56

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
	卖出股票成交总额
减：卖出股票成本总额	42,679,097.41
买卖股票差价收入	1,272,094.50

6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期

	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	17,102,399.16
减：卖出/赎回基金成本总额	16,814,109.70
基金投资收益	288,289.46

6.4.7.14 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无权证投资收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
股票投资产生的股利收益	733,782.36
基金投资产生的股利收益	25,585.40
合计	759,367.76

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
1. 交易性金融资产	8,373,421.00
——股票投资	8,107,924.53
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	265,496.47
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	8,373,421.00

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
基金赎回费收入	76,569.36
合计	76,569.36

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
交易所市场交易费用	44,001.23

银行间市场交易费用	-
合计	44,001.23

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
审计费用	27,133.74
信息披露费	148,767.52
银行汇划费	1,777.31
指数使用费	125,452.91
合计	303,131.48

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期新增关联方瑞元资本管理有限公司，为基金管理人的控股子公司。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
广发基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人、注册登记与过户机构、直销机构
中国银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
中国银行（香港）有限公司	基金境外资产托管人

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内无应支付关联方的佣金，本报告期末无应付关联方佣金余额。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月 30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	517,488.36	-
其中：支付销售机构的客户 维护费	119,239.50	-

注：1、基金合同生效日期为 2012 年 8 月 15 日，无可比较期间数据。

2、基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.80% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金的管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月 30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托 管费	161,715.09	-

注：1、基金合同生效日期为 2012 年 8 月 15 日，无可比较期间数据。

2、基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

本基金托管费包含境外托管人托管费。

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
----	-------------------------	---------------------------------

	30日	
基金合同生效日（2012年8月15日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	20,000,000.00	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	20,000,000.00	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	18.80%	-

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	1,493,340.11	15,660.55	-	-
中国银行(香港)有限公司	4,418,403.32	-	-	-

注：1、基金合同生效日期为2012年8月15日，无可比较期间数据。

2、本基金的银行存款由基金托管人中国银行股份有限公司和境外资产托管人中国银行(香港)有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2013年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

截至本报告期末2013年06月30日止，本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末2013年06月30日止，本基金无持有的暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2013年06月30日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成

的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2013 年 06 月 30 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要是信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人奉行全面风险管理的理念，在董事会下设立合规及风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部对公司总裁负责。

本基金管理人建立了以合规及风险管理委员会为核心的、由总裁和风险控制委员会、督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险指由于在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或所投资证券之发行人出现违约、无法支付到期本息，或由于债券发行人信用等级降低导致债券价格下降，将对基金资产造成的损失。为了防范信用风险，本基金主要投资于信用等级较高的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。但是，随着短期资金市场的发展，本基金的投资范围扩大以后，可能会在一定程度上增加信用风险。

本报告期末本基金未持有债券投资。

6.4.13.3 流动性风险

开放式基金的流动性是指基金管理人为满足投资者赎回要求，在一定时间内将一定数量的基金资产按正常市场价格变现的能力。流动性风险指因市场交易量不足，导致不能以适当价格及时进行证券交易的风险，或基金无法应付基金赎回支付的要求所引起的违约风险。本基金坚持组合持有、分散投资的原则，在一定程度上减轻了投资变现压力。本基金所持大部分交易性金融资产在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，除附注 6.4.12 披露的流通受限不能自由转让的基金资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。本基金所持有的其他金融负债以及可赎回基金份额净值(所有者权益)的合同约定到期日均为无固定期限且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人在对市场特征和发展形势等方面进行分析和判断的基础上，由投资决策委员会根据市场运行情况和基金运行情况制订本基金的风险控制目标和方法，由基金绩效评估与风险管理组具体计算与监控各类风险控制指标，从而对流动性风险进行监控。

6.4.13.4 市场风险

本基金的市场风险是指由于证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理等各种因素的影响，导致基金收益水平变化而产生的风险，反映了基金资产中金融工具或证券价值对

市场参数变化的敏感性。一般来讲，市场风险是开放式基金面临的重大风险，也往往是众多风险中最基本和最常见，也是最难防范的风险，其他如流动性风险最终是因为市场风险在起作用。市场风险包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的利率敏感性资产主要是债券投资。本基金管理人通过久期、凸性、风险价值模型 (VAR) 等方法来评估投资组合中债券的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2013年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	5,911,743.43	-	-	-	5,911,743.43
交易性金融资产	-	-	-	102,985,269.31	102,985,269.31
应收股利	-	-	-	74,540.65	74,540.65
应收利息	-	-	-	610.95	610.95
应收申购款	227,874.37	-	-	-	227,874.37
应收证券清算款	-	-	-	1,089,867.87	1,089,867.87
其他资产	-	-	-	31,189.80	31,189.80
资产总计	6,139,617.80	-	-	104,181,478.58	110,321,096.38
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,655,097.91	1,655,097.91
应付管理人报酬	-	-	-	73,360.78	73,360.78
应付托管费	-	-	-	22,925.27	22,925.27
其他负债	-	-	-	182,138.95	182,138.95
负债总计	-	-	-	1,933,522.91	1,933,522.91
利率敏感度缺口	6,139,617.80	-	-	102,247,955.67	108,387,573.47
上年度末 2012年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	7,155,448.28	-	-	-	7,155,448.28
交易性金融资产	-	-	-	128,300,729.32	128,300,729.32
应收股利	-	-	-	65,030.66	65,030.66
应收利息	-	-	-	566.02	566.02

应收申购款	88,210.41	-	-	-	88,210.41
应收证券清算款	-	-	-	2,777,509.65	2,777,509.65
其他资产	-	-	-	156,642.71	156,642.71
资产总计	7,243,658.69	-	-	131,300,478.36	138,544,137.05
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,664,161.23	2,664,161.23
应付管理人报酬	-	-	-	94,154.51	94,154.51
应付托管费	-	-	-	29,423.30	29,423.30
其他负债	-	-	-	90,040.70	90,040.70
负债总计	-	-	-	2,877,779.74	2,877,779.74
利率敏感度缺口	7,243,658.69	-	-	128,422,698.62	135,666,357.31

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。

本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产	-	-	-	-
银行存款	4,418,403.32	-	-	4,418,403.32
交易性金融资产	102,985,269.31	-	-	102,985,269.31
应收股利	74,540.65	-	-	74,540.65
应收利息	-	-	-	-
应收证券清算款	1,089,867.87	-	-	1,089,867.87

其他资产	-	-	-	-
资产合计	108,568,081.15	-	-	108,568,081.15
以外币计价的负债	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	108,568,081.15	-	-	108,568,081.15
项目	上年度末 2012年12月31日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产	-	-	-	-
银行存款	4,914,586.75	-	-	4,914,586.75
交易性金融资产	128,300,729.32	-	-	128,300,729.32
应收股利	65,030.66	-	-	65,030.66
应收证券清算款	2,777,509.65	-	-	2,777,509.65
资产合计	136,057,856.38	-	-	136,057,856.38
以外币计价的负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	136,057,856.38	-	-	136,057,856.38

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	-		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币）	
		本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日

所有外币相对人民币升值 5%	5,428,404.06	6,802,892.82
所有外币相对人民币贬值 5%	-5,428,404.06	-6,802,892.82

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金管理人通过采用 Barra 风险管理系统，通过标准差、跟踪误差、beta 值、风险价值模型 (VAR) 等指标监控投资组合面临的市场价格波动风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日		上年度末 2012 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	98,625,455.70	90.99	117,135,337.45	86.34
交易性金融资产-基金投资	4,359,813.61	4.02	11,165,391.87	8.23
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	102,985,269.31	95.02	128,300,729.32	94.57

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	-		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币)	
		本期末 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升5%	5,668,140.41	4,908,408.81
	业绩比较基准下降5%	-5,668,140.41	-4,908,408.81

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无需要说明有助于理解和分析财务报表的其他事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	98,625,455.70	89.40
	其中：普通股	96,982,561.49	87.91
	存托凭证	1,642,894.21	1.49
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	4,359,813.61	3.95
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	5,911,743.43	5.36
8	其他各项资产	1,424,083.64	1.29
9	合计	110,321,096.38	100.00

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
美国	98,625,455.70	90.99
合计	98,625,455.70	90.99

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、泽西岛和英国在美国上市的 ADR。

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
能源	-	-
材料	326,575.87	0.30
工业	1,998,112.63	1.84
非必须消费品	18,028,457.71	16.63
必须消费品	4,751,660.35	4.38
保健	12,955,490.60	11.95
金融	-	-
信息技术	59,477,773.82	54.88
电信服务	1,087,384.72	1.00
公共事业	-	-
合计	98,625,455.70	90.99

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

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	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	4,366	10,684,734.96	9.86
2	MICROSOFT CORP	微软	MSFT US	纳斯达克证券	美国	41,163	8,782,147.08	8.10

				交易所				
3	GOOGLE INC-CLA	谷歌公司	GOOG US	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,259	6,848,383.53	6.32
4	ORACLE CORP	甲骨文	ORCL US	纳斯达克 证券交易 所	美国	23,376	4,436,990.71	4.09
5	CISCO SYSTEMS INC	思科	CSCO US	纳斯达克 证券交易 所	美国	25,125	3,773,880.45	3.48
6	AMAZON.COM INC	亚马逊公司	AMZN US	纳斯达克 证券交易 所	美国	2,143	3,676,880.54	3.39
7	INTEL CORP	英特尔	INTC US	纳斯达克 证	美国	23,303	3,487,250.00	3.22

				券交易所				
8	QUALCOMM INC	高通公司	QCOM US	纳斯达克 证券交易 所	美国	8,507	3,210,499.23	2.96
9	COMCAST CORP-CLASS A	康卡斯特	CMCSA US	纳斯达克 证券交易 所	美国	10,001	2,587,898.32	2.39
10	GILEAD SCIENCES INC	Gilead 科学	GILD US	纳斯达克 证券交易 所	美国	7,173	2,269,617.73	2.09
11	AMGEN INC	安进	AMGN US	纳斯达克 证券交易 所	美国	3,527	2,150,025.84	1.98
12	EBAY INC	电子湾	EBAY US	纳斯达克	美国	6,109	1,952,206.48	1.80

				证 券 交 易 所				
13	MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	Mondelez 国 际公司	MDLZ US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	8,734	1,539,614.77	1.42
14	NEWS CORP-CLASS A	美国新闻集 团	NWSA US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	7,526	1,515,929.22	1.40
15	STARBUCKS CORP	星巴克	SBUX US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	3,680	1,489,086.47	1.37
16	BIOGEN IDEC INC	生物基因	BIIB US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,114	1,481,237.05	1.37
17	EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	快捷药方	ESRX US	纳 斯 达	美 国	3,857	1,470,149.56	1.36

				克 证 券 交 易 所				
18	CELGENE CORP	Celgene 公司	CELG US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,975	1,426,644.84	1.32
19	COSTCO WHOLESALE CORP	好市多批发	COST US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	2,053	1,402,566.20	1.29
20	FACEBOOK INC-A	Facebook 公 司	FB US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	8,329	1,279,355.07	1.18
21	TEXAS INSTRUMENTS INC	德州仪器	TXN US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	5,408	1,165,160.46	1.07
22	PRICELINE.COM INC	Priceline.com 股份有限公	PCLN US	纳 斯	美 国	216	1,103,887.04	1.02

		司		达 克 证 券 交 易 所				
23	DIRECTV	DIRECTV 公 司	DTV US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	2,705	1,029,878.69	0.95
24	AUTOMATIC DATA PROCESSING	ADP 公司	ADP US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	2,286	972,613.63	0.90
25	KRAFT FOODS GROUP INC	-	KRFT US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	2,792	963,809.48	0.89
26	VIACOM INC-CLASS B	维 亚 康 姆 公 司	VIAB US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	2,097	881,705.74	0.81
27	YAHOO! INC	雅 虎	YHOO	纳	美	5,599	868,668.93	0.80

			US	纳斯达克证券交易所	美国			
28	VODAFONE GROUP PLC-SP ADR	沃达丰	VOD US	纳斯达克证券交易所	美国	4,638	823,596.74	0.76
29	BAIDU INC - SPON ADR	百度	BIDU US	纳斯达克证券交易所	美国	1,295	756,373.90	0.70
30	DELL INC	戴尔	DELL US	纳斯达克证券交易所	美国	8,190	675,557.43	0.62
31	ADOBE SYSTEMS INC	奥多比	ADBE US	纳斯达克证券交易所	美国	2,350	661,528.69	0.61

32	SIRIUS XM RADIO INC	Sirius XM 电台公司	SIRI US	纳斯达克证 券交易所	美国	31,767	657,533.86	0.61
33	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	459	637,764.92	0.59
34	INTUITIVE SURGICAL INC	直觉外科手 术公司	ISRG US	纳斯达克证 券交易所	美国	189	591,571.10	0.55
35	PACCAR INC	帕卡	PCAR US	纳斯达克证 券交易所	美国	1,692	560,980.98	0.52
36	WHOLE FOODS MARKET INC	全食超市	WFM US	纳斯达克证 券交易	美国	1,745	555,048.69	0.51

				所				
37	COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	高知特科技公司	CTSH US	纳斯达克证券交易所	美国	1,421	549,711.59	0.51
38	INTUIT INC	Intuit 公司	INTU US	纳斯达克证券交易所	美国	1,396	526,412.14	0.49
39	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	Alexion 制药公司	ALXN US	纳斯达克证券交易所	美国	920	524,329.42	0.48
40	APPLIED MATERIALS INC	应用材料	AMAT US	纳斯达克证券交易所	美国	5,656	521,055.70	0.48
41	BROADCOM CORP-CL A	Broadcom 公司	BRCM US	纳斯达克证券交	美国	2,441	509,175.30	0.47

				易所				
42	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	987	487,077.36	0.45
43	SEAGATE TECHNOLOGY	希捷科技公 司	STX US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,754	485,842.43	0.45
44	CERNER CORP	塞纳公司	CERN US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	811	481,499.85	0.44
45	BED BATH & BEYOND INC	-	BBBY US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,068	467,858.58	0.43
46	MATTEL INC	美泰	MAT US	纳 斯 达 克 证 券	美 国	1,666	466,408.19	0.43

				交易所				
47	ACTIVISION BLIZZARD INC	动视暴雪股份有限公司	ATVI US	纳斯达克证 券交易所	美国	5,247	462,304.05	0.43
48	SANDISK CORP	-	SNDK US	纳斯达克证 券交易所	美国	1,161	438,299.06	0.40
49	WESTERN DIGITAL CORP	西部数据公 司	WDC US	纳斯达克证 券交易所	美国	1,136	435,809.91	0.40
50	ROSS STORES INC	Ross 商店有 限公司	ROST US	纳斯达克证 券交易所	美国	1,046	418,861.86	0.39
51	SYMANTEC CORP	赛门铁克	SYMC US	纳斯达克证	美国	2,995	415,811.99	0.38

				券交易所				
52	LIBERTY MEDIA CORP - A	-	LMCA US	纳斯达克证券交易所	美国	525	411,186.31	0.38
53	ANALOG DEVICES INC	模拟器件	ADI US	纳斯达克证券交易所	美国	1,441	401,192.01	0.37
54	FASTENAL CO	快扣公司	FAST US	纳斯达克证券交易所	美国	1,398	396,044.17	0.37
55	PAYCHEX INC	Paychex 公司	PAYX US	纳斯达克证券交易所	美国	1,723	388,788.27	0.36
56	CA INC	冠群国际	CA US	纳斯达克	美国	2,150	380,326.79	0.35

				证 券 交 易 所				
57	WYNN RESORTS LTD	永利度假村 有限公司	WYNN US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	474	374,874.09	0.35
58	LIFE TECHNOLOGIES CORP	Life 科技公 司	LIFE US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	817	373,602.32	0.34
59	O'REILLY AUTOMOTIVE INC	O'Reilly 汽 车股份有限 公司	ORLY US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	511	355,576.89	0.33
60	MYLAN INC	迈兰实验室	MYL US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,852	355,074.81	0.33
61	LIBERTY INTERACTIVE CORP-A	自由媒体公 司 - 互动	LINTA US	纳 斯 达	美 国	2,420	344,055.97	0.32

				克 证 券 交 易 所				
62	NETAPP INC	网域存储技术	NTAP US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,466	342,210.27	0.32
63	FISERV INC	Fiserv 公司	FISV US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	630	340,250.51	0.31
64	DOLLAR TREE INC	Dollar Tree 公司	DLTR US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,071	336,427.99	0.31
65	CITRIX SYSTEMS INC	思杰系统	CTXS US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	878	327,284.13	0.30
66	DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	探索传播公司	DISCA US	纳 斯	美 国	684	326,307.28	0.30

				达克 证 券 交 易 所				
67	ALTERA CORP	Altera 公司	ALTR US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,507	307,179.82	0.28
68	LIBERTY GLOBAL PLC-A	自由国际传 媒公司	LBTYA US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	667	305,297.97	0.28
69	NETFLIX INC	奈飞公司	NFLX US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	233	303,893.00	0.28
70	XILINX INC	赛灵思	XLNX US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,233	301,762.33	0.28
71	CHECK POINT	-	CHKP	纳	美	969	297,442.12	0.27

	SOFTWARE TECH		US	纳斯达克 证券交易所	美国			
72	CATAMARAN CORP	SXC 健康解 决方案公司	CTRX US	纳斯达克 证券交易所	美国	968	291,393.42	0.27
73	MONSTER BEVERAGE CORP	怪兽饮料公 司	MNST US	纳斯达克 证券交易所	美国	774	290,621.21	0.27
74	VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	Verisk 分析 公司	VRSK US	纳斯达克 证券交易所	美国	760	280,339.98	0.26
75	KLA-TENCOR CORPORATION	Kla-Tencor 公司	KLAC US	纳斯达克 证券交易所	美国	783	269,617.40	0.25

76	AVAGO TECHNOLOGIES LTD	安华高科技 有限公司	AVGO US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,161	268,144.33	0.25
77	STERICYCLE INC	Stericycle 公 司	SRCL US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	392	267,467.03	0.25
78	C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	罗宾逊全球 物流有限公 司	CHRW US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	761	264,769.10	0.24
79	SBA COMMUNICATIONS CORP-CLA	SBA 通信公 司	SBAC US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	576	263,787.98	0.24
80	SIGMA-ALDRICH	西格玛-奥德 里奇	SIAL US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	531	263,652.30	0.24

81	EQUINIX INC	Equinix 公司	EQIX US	纳斯达克 证券交易 所	美国	231	263,647.11	0.24
82	STAPLES INC	Staples 公司	SPLS US	纳斯达克 证券交易 所	美国	2,574	252,237.02	0.23
83	HENRY SCHEIN INC	亨利香恩公 司	HSIC US	纳斯达克 证券交易 所	美国	414	244,926.76	0.23
84	LINEAR TECHNOLOGY CORP	凌特	LLTC US	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,048	238,549.23	0.22
85	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	美信	MXIM US	纳斯达克 证券交	美国	1,386	237,898.98	0.22

				易所				
86	EXPEDITORS INTL WASH INC	华盛顿康捷国际物流公司	EXPD US	纳斯达克证券交易所	美国	973	228,511.37	0.21
87	AUTODESK INC	欧特克	ADSK US	纳斯达克证券交易所	美国	1,054	221,029.15	0.20
88	AKAMAI TECHNOLOGIES INC	阿卡迈技术公司	AKAM US	纳斯达克证券交易所	美国	836	219,787.48	0.20
89	EXPEDIA INC	艾派迪公司	EXPE US	纳斯达克证券交易所	美国	578	214,813.01	0.20
90	GARMIN LTD	佳明有限公司	GRMN US	纳斯达克证券	美国	921	205,771.47	0.19

				交易所				
91	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	Microchip 科技股份有限公司	MCHP US	纳斯达克证券交易所	美国	871	200,466.38	0.18
92	BMC SOFTWARE INC	BMC 软件	BMC US	纳斯达克证券交易所	美国	674	187,982.99	0.17
93	FOSSIL GROUP INC	化石集团	FOSL US	纳斯达克证券交易所	美国	281	179,368.34	0.17
94	DENTSPLY INTERNATIONAL INC	登士柏国际集团	XRAY US	纳斯达克证券交易所	美国	674	170,575.62	0.16
95	NUANCE COMMUNICATIONS INC	Nuance 通讯股份有限公司	NUAN US	纳斯达克证	美国	1,461	165,917.74	0.15

				券交易所				
96	F5 NETWORKS INC	F5 Networks 公司	FFIV US	纳斯达克证券交易所	美国	370	157,284.99	0.15
97	SEARS HOLDINGS CORP	西尔斯控股	SHLD US	纳斯达克证券交易所	美国	472	122,719.86	0.11
98	RANDGOLD RESOURCES LTD-ADR	RANDGOLD 资源有限公司	GOLD US	纳斯达克证券交易所	美国	159	62,923.57	0.06
99	NVIDIA CORP	NVIDIA 公司	NVDA US	纳斯达克证券交易所	美国	590	51,145.42	0.05
100	MICRON TECHNOLOGY INC	美光技术	MU US	纳斯达克	美国	114	10,093.65	0.01

				证 券 交 易 所				
--	--	--	--	-----------------------	--	--	--	--

注：本基金对以上证券代码采用当地市场代码。

7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	APPLE INC	AAPL US	5,788,581.69	4.27
2	KRAFT FOODS GROUP INC	KRFT US	1,176,101.36	0.87
3	LIBERTY MEDIA CORP - A	LMCA US	910,851.17	0.67
4	REGENERON PHARMACEUTICALS	REGN US	663,083.61	0.49
5	FACEBOOK INC-A	FB US	658,429.54	0.49
6	ANALOG DEVICES INC	ADI US	504,668.27	0.37
7	CATAMARAN CORP	CTRX US	418,931.66	0.31
8	EQUINIX INC	EQIX US	417,406.66	0.31
9	WESTERN DIGITAL CORP	WDC US	408,440.82	0.30
10	NETFLIX INC	NFLX US	378,388.70	0.28
11	LIBERTY GLOBAL PLC-A	LBTYA US	375,904.84	0.28
12	DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	DISCA US	375,231.42	0.28
13	VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	VRSK US	356,569.84	0.26
14	SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	SBAC US	348,941.55	0.26
15	MICROSOFT CORP	MSFT US	266,127.25	0.20
16	GOOGLE INC-CL A	GOOG US	250,395.69	0.18
17	ORACLE CORP	ORCL US	195,187.68	0.14
18	SIRIUS XM RADIO INC	SIRI US	172,778.70	0.13

19	AMAZON.COM INC	AMZN US	139,531.92	0.10
20	CISCO SYSTEMS INC	CSCO US	130,932.52	0.10

注：本项及下项 7.5.2、7.5.3 的买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，此外，“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	APPLE INC	AAPL US	10,228,287.83	7.54
2	MICROSOFT CORP	MSFT US	2,477,078.73	1.83
3	GOOGLE INC-CL A	GOOG US	2,373,193.37	1.75
4	ORACLE CORP	ORCL US	1,543,325.92	1.14
5	INTEL CORP	INTC US	1,230,014.40	0.91
6	AMAZON.COM INC	AMZN US	1,229,511.89	0.91
7	CISCO SYSTEMS INC	CSCO US	1,193,105.66	0.88
8	QUALCOMM INC	QCOM US	948,650.76	0.70
9	COMCAST CORP-CLASS A	CMCSA US	909,432.98	0.67
10	AMGEN INC	AMGN US	877,791.04	0.65
11	GILEAD SCIENCES INC	GILD US	845,546.62	0.62
12	EBAY INC	EBAY US	766,380.42	0.56
13	CELGENE CORP	CELG US	595,837.03	0.44
14	BIOGEN IDEC INC	BIIB US	537,339.94	0.40
15	MICRON TECHNOLOGY INC	MU US	533,789.89	0.39
16	VIRGIN MEDIA INC	VMED US	529,662.55	0.39
17	EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	ESRX US	529,509.72	0.39
18	MONDELEZ INTERNATIONAL	MDLZ US	527,104.50	0.39

	INC-A			
19	NEWS CORP - CLASS A	NWSA US	519,751.93	0.38
20	COSTCO WHOLESALE CORP	COST US	512,302.32	0.38

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	16,055,773.91
卖出收入（成交）总额	43,951,191.91

7.6 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。

7.7 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。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。

7.9 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。

7.10 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

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	POWERSHARES QQQ NASDAQ 100	ETF	契约型开放式	Invesco PowerShares Capital Mgmt LLC	4,359,813.61	4.02
2	-	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-	-

6	-	-	-	-	-	-
7	-	-	-	-	-	-
8	-	-	-	-	-	-
9	-	-	-	-	-	-
10	-	-	-	-	-	-

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 根据公开市场信息，报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

7.11.2 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。

7.11.3 其他资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	1,089,867.87
3	应收股利	74,540.65
4	应收利息	610.95
5	应收申购款	227,874.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	31,189.80
8	其他	-
9	合计	1,424,083.64

7.11.4 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。

7.11.5 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。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例

2,184	48,713.67	46,255,159.87	43.48%	60,135,496.41	56.52%
-------	-----------	---------------	--------	---------------	--------

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本基金	3,024,766.26	2.8431%

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为 100 万份以上；

本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 10 万份至 50 万份（含）。

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2012 年 8 月 15 日）基金份额总额	254,721,739.44
本报告期期初基金份额总额	142,021,651.41
本报告期基金总申购份额	24,400,781.53
减：本报告期基金总赎回份额	60,031,776.66
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	106,390,656.28

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

2013 年 3 月 17 日，根据国家金融工作需要，肖钢先生辞去中国银行股份有限公司董事长职务。中国银行股份有限公司已于 2013 年 3 月 17 日公告上述事项。

2013 年 6 月 1 日，中国银行股份有限公司发布公告，自 2013 年 5 月 31 日起，田国立先生就任本行董事长、执行董事、董事会战略发展委员会主席及委员。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及本基金管理人、基金财产及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资组合策略没有重大改变。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期内，因业务发展需要，本基金改聘德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）负责本基金审计事务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金的基金管理人、基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚的情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
Goldman Sachs Group Inc.	-	33,324,513.91	55.53%	28,851.26	67.63%	-
Citigroup	-	13,147,314.01	21.91%	5,322.45	12.48%	-
Morgan Stanley	-	11,987,999.14	19.98%	7,997.50	18.75%	-
United Bank of Switzerland	-	1,547,138.76	2.58%	487.18	1.14%	-
Deutsche Bank	-	-	-	-	-	-

AG						
Brown Brothers Harriman	-	-	-	-	-	-
CITIC Securities International USA	-	-	-	-	-	新增

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
Goldman Sachs Group Inc.	-	-	-	-	-	-	7,892,391.88	29.40%
Citigroup	-	-	-	-	-	-	4,696,516.66	17.49%
Morgan Stanley	-	-	-	-	-	-	14,256,525.59	53.11%
United Bank of Switzerland	-	-	-	-	-	-	-	-
Deutsche Bank AG	-	-	-	-	-	-	-	-
Brown Brothers Harriman	-	-	-	-	-	-	-	-
CITIC Securities International USA	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
----	------	--------	--------

1	广发基金管理有限公司旗下基金改聘会计师事务所公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2013-04-02
2	广发基金管理有限公司关于增加中金公司为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2013-04-10
3	广发基金管理有限公司关于广发基金网上交易增加旗下 QDII 基金定期不定额投资的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2013-05-24

注：无

11 备查文件目录

11.1 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

11.2 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

11.3 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

二〇一三年八月二十四日