

广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金

2022 年第 2 季度报告

2022 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：二〇二二年七月二十日

§ 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 2022 年 7 月 18 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 2022 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 广发纳指 100ETF |
| 场内简称 | 纳指 ETF |
| 基金主代码 | 159941 |
| 交易代码 | 159941 |
| 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 |
| 报告期末基金份额总额 | 3,329,052,541.00 份 |
| 投资目标 | 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。 |
| 投资策略 | 本基金主要采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构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。 |

| | |
|-------------|---|
| | 正常情况下，本基金力求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因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。 |
| 业绩比较基准 | 汇率调整后的纳斯达克 100 指数（Nasdaq-100 Index）收益率 |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，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 NEW YORK BRANCH |
| 境外资产托管人中文名称 | 中国银行纽约分行 |

§ 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 (2022 年 4 月 1 日-2022 年 6 月 30 日) |
|----------------|---|
| 1.本期已实现收益 | -78,032,679.17 |
| 2.本期利润 | -595,333,355.64 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.3676 |
| 4.期末基金资产净值 | 7,929,359,676.85 |
| 5.期末基金份额净值 | 2.3819 |

注：（1）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。

（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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

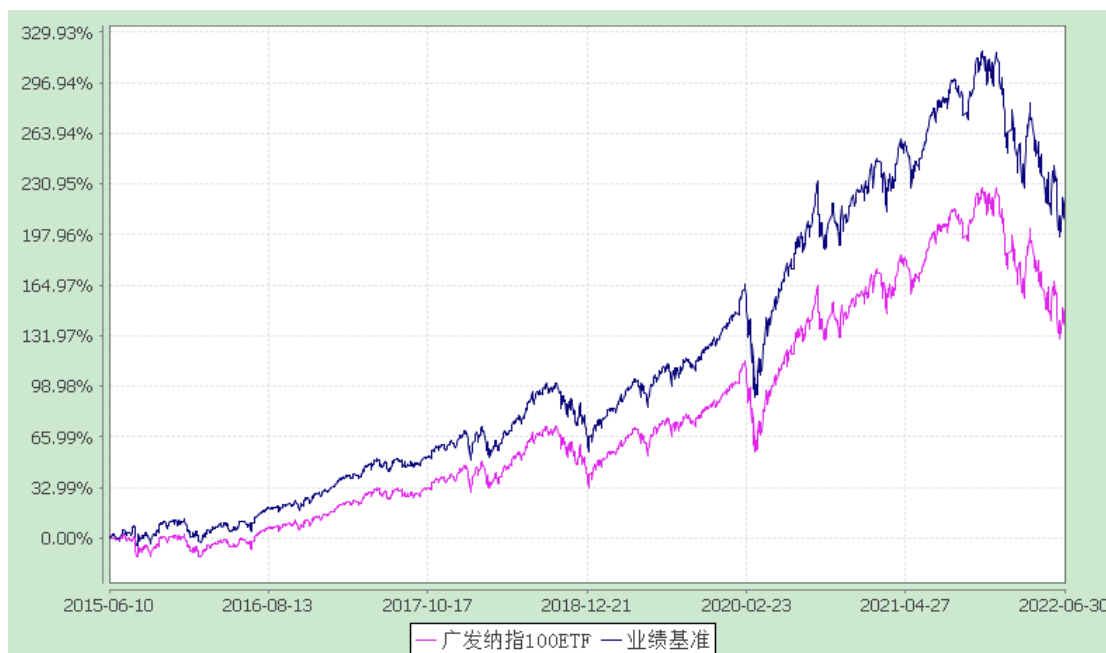
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 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 | -18.69% | 2.29% | -17.86% | 2.29% | -0.83% | 0.00% |
| 过去六个月 | -26.35% | 2.14% | -25.50% | 2.13% | -0.85% | 0.01% |
| 过去一年 | -18.23% | 1.65% | -17.28% | 1.64% | -0.95% | 0.01% |
| 过去三年 | 39.63% | 1.76% | 50.11% | 1.77% | -10.48% | -0.01% |
| 过去五年 | 88.53% | 1.59% | 111.46% | 1.58% | -22.93% | 0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 138.19% | 1.45% | 206.36% | 1.44% | -68.17% | 0.01% |

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 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比较基准收益率历史走势对比图

（2015 年 6 月 10 日至 2022 年 6 月 30 日）



§ 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 | | |
| 刘杰 | 本基金的基金 经理；广发沪 深 300 交易型 开放式指数证 券投资基金联 接基金的基金 经理；广发中 证 500 交易型 开放式指数证 券投资基金的 基金经理；广 发中证 500 交 易型开放式指 数证券投资基金 联接基金 (LOF)的基金 | 2018-08- 06 | - | 18 年 | 刘杰先生，工学学士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任广发基金管理有限公司信息技术部系统开发专员、数量投资部研究员、广发沪深 300 指数证券投资基金基金经理(自 2014 年 4 月 1 日至 2016 年 1 月 17 日)、广发中证环保产业指数型发起式证券投资基金基金经理(自 2016 年 1 月 25 日至 2018 年 4 月 25 日)、广发量化稳健混合型证券投资基金基金经理 |

| | | | | |
|--|--|--|--|---|
| | <p>经理；广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发创业板交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理；广发港股通恒生综合中型股指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理；广发纳斯达克 100 指数证券投资基金的基金经理；广发恒生科技指数证券投资基金 (QDII) 的基金经理；广发恒生科技交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 的基金经理；指数投资部总经理助理</p> | | | <p>(自 2017 年 8 月 4 日至 2018 年 11 月 30 日)、广发中证养老产业指数型发起式证券投资基金基金经理(自 2016 年 1 月 25 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2016 年 1 月 25 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(自 2016 年 1 月 25 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2016 年 8 月 30 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自 2016 年 9 月 26 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2017 年 1 月 25 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自 2018 年 4 月 26 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发标普全球农业指数证券投资基金基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2020 年 2 月 28 日)、广发粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(自 2020 年 5 月 21 日至 2021 年 7 月 2</p> |
|--|--|--|--|---|

| | | | | |
|--|--|--|--|---|
| | | | | <p>日)、广发全球医疗保健指数证券投资基金基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2021 年 9 月 16 日)、广发道琼斯美国石油开发与生产指数证券投资基金(QDII-LOF)基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2021 年 9 月 16 日)、广发美国房地产指数证券投资基金基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2021 年 9 月 16 日)、广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2021 年 9 月 16 日)、广发粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2019 年 12 月 16 日至 2021 年 9 月 16 日)、广发中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2019 年 9 月 20 日至 2021 年 11 月 17 日)、广发中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(自 2019 年 11 月 6 日至 2021 年 11 月 17 日)、广发纳斯达克 100 指数证券投资基金基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2022 年 3 月 31 日)、广发恒生中国企业精明指数型发起式证券投资基金(QDII)基金经理(自 2019 年 5 月 9 日至 2022 年 4 月 28 日)。</p> |
|--|--|--|--|---|

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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从

业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 报告期内本基金运作合规守信情况说明

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》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，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。

4.3 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，公司建立了严格的投资备选库制度及投资授权制度，投资组合的投资标的必须来源于公司备选库，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。金融工程与风险管理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

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 7 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，有关投资经理按规定履行了审批程序。

本报告期内，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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

本基金主要采用完全复制法来跟踪纳斯达克 100 指数，按照个股在标的指数

中的基准权重构建股票组合，呈现出股票型指数基金的特征。

2022 年 2 季度，美股整体深度回调，标普 500 指数下跌 16.45%，纳斯达克 100 指数下跌 22.47%，道琼斯工业指数下跌 11.25%、纳斯达克生物科技指数下跌 10.02%，道琼斯美国石油开发与生产指数上涨 7.87%，MSCI 美国 REIT 指数下跌 17.67%，标普全球 1200 医疗保健指数下跌 6.98%。2022 年 2 季度以来，全球市场受到以石油为主的大宗商品上涨带来的通胀压力、美元加息缩表以及俄乌冲突的不利影响，市场情绪受到打击。

随着美联储针对抑制通胀采取的激进紧缩行动，市场担忧经济可能会陷入衰退，恐慌情绪使得美股抛售潮延续。对于 5 月初的市场氛围而言，美国 4 月 CPI 和 PPI 通胀数据虽然环比呈现增速放缓迹象，但同比增幅仍处在数十年高位，无法打消投资者对通胀上升的担忧，并试图寻找着当前市场上最具防御性的资产标的；同时，5 月份美联储选择加息的同时进行缩表，也导致了美股 5 月中上旬市场的震荡，直到 5 月下旬至 6 月上旬，市场情绪才初步稳定并且出现明显反弹。对于 6 月而言，5 月份美国通胀数据大幅超出市场预期以及 6 月超预期加息导致美股再次动荡，市场多空博弈依然激烈，呈现了一定的磨底特征。美股表现出一定的疲弱，几乎所有板块的股票都在抛售，市场更为担心美联储政策、经济衰退的可能性等等的负面情绪，这意味着市场情绪依然在激烈博弈，短期恐慌、不确定性以及情绪主导并左右了市场。

对于美股科技龙头企业而言，市场长期逻辑关注的更多是科技龙头公司的盈利能力。以美国纳指 100 为代表的高科技企业依然是美国经济的重要参考指标，根据彭博数据预测，在现有市场情况下，美股科技巨头盈利增速仍然十分强劲。在现有加息预期与市场充分沟通的趋势下以及美联储较好把握加息节奏的前提下，从长期角度看，美股科技龙头的二级市场表现可能仍由其基本面情况来决定。

美股中存在众多优秀公司，尤其是医药和科技类公司，体现了很强的科技公司护城河效应，一般情况下，对于全球新兴机会的把握上具备了很强的竞争优势，从互联网革命到生物科技革命，从日常的电子消费到全球计算机的不断迭代，全球现代化中的很多应用都与此类高科技公司息息相关。根据纳斯达克统计，参照与现有的纳斯达克主题指数或其他相关主题指数的重合情况，纳斯达克 100 在诸多热点主题前沿领域保持暴露，包括人工智能、自动化、5G、云计算、未来出

行、半导体、绿色经济、清洁能源等，纳斯达克 100 指数中有 62 家公司近期在 34 个颠覆性科技领域至少储备 1 个或更多的专利，具备极强的创新性，通过配置纳斯达克 100 指数可以实现一键配置市场热点主题的细分龙头。

展望未来，通胀尤其是油价等大宗商品的价格会影响到美联储加息的政策、加息幅度和次数，若未来油价回落的趋势能够保持或油价稳定，通胀趋势缓和或明显改善，贸易关税合理，经济趋势向好或将给科技公司基本面带来更多利好，也会给美股市场带来更多的结构性投资机会。

美国市场依然是全世界最重要的金融市场之一，是全球化资产配置的重要目的地，纳斯达克 100 指数作为纳斯达克的主要指数，呈现了高科技、高成长和非金融的特点，是美国科技股指数的代表。而科技又是美国的核心竞争力之一，因此纳斯达克 100 指数中长期依然是值得投资者关注的指数之一。

本报告期内，本基金的份额净值增长率为-18.69%，同期业绩比较基准收益率为-17.86%。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 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 | 7,261,073,093.27 | 89.33 |
| | 其中：普通股 | 7,152,401,884.00 | 87.99 |
| | 存托凭证 | 108,671,209.27 | 1.34 |
| | 优先股 | - | - |
| | 房地产信托 | - | - |
| 2 | 基金投资 | 20,308,320.56 | 0.25 |

| | | | |
|---|-------------------|------------------|--------|
| 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 | 815,307,208.66 | 10.03 |
| 8 | 其他资产 | 31,929,651.60 | 0.39 |
| 9 | 合计 | 8,128,618,274.09 | 100.00 |

注：上表中的权益投资项含可退替代款估值增值，而 5.2 的合计项不含可退替代款估值增值。

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 | 7,261,073,093.27 | 91.57 |
| 合计 | 7,261,073,093.27 | 91.57 |

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）ADR、GDR 按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

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 | - | - |
| 原材料 | - | - |
| 工业 | 244,698,940.65 | 3.09 |
| 非日常生活消费品 | 1,079,712,344.59 | 13.62 |

| | | |
|-------|------------------|-------|
| 日常消费品 | 483,351,290.96 | 6.10 |
| 医疗保健 | 469,134,188.49 | 5.92 |
| 金融 | - | - |
| 信息技术 | 3,633,090,973.19 | 45.82 |
| 通信服务 | 1,248,640,266.86 | 15.75 |
| 公用事业 | 102,445,088.53 | 1.29 |
| 房地产 | - | - |
| 合计 | 7,261,073,093.27 | 91.57 |

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

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 | 1,007,722. 00 | 924,668,180. 90 | 11.66 |
| 2 | Microsoft Corp | 微软 | MSFT US | 纳 斯 达 克 证 券 交 易 所 | 美 国 | 462,605.00 | 797,387,086. 01 | 10.06 |
| 3 | Alphabet Inc | Alphab et 公司 | GOOG US | 纳 斯 | 美 国 | 18,633.00 | 273,548,314. 01 | 3.45 |

| | | | | | | | | |
|---|--------------------|---|----------|---|--------|------------|----------------|------|
| | | | | 达 克 证 券 交 易 所 | | | | |
| | | | GOOGL US | 纳 斯 达 克 证 券 交 易 所 | 美 国 | 18,296.00 | 267,595,202.28 | 3.37 |
| 4 | Amazon.com Inc | 亚 马 逊 公 司 | AMZN US | 纳 斯 达 克 证 券 交 易 所 | 美 国 | 608,025.00 | 433,411,039.20 | 5.47 |
| 5 | Tesla Inc | 特 斯 拉 公 司 | TSLA US | 纳 斯 达 克 证 券 交 易 所 | 美 国 | 65,403.00 | 295,594,809.39 | 3.73 |
| 6 | Meta Platforms Inc | Meta 平 台 股 份 有 限 公 司 | META US | 纳 斯 达 克 证 券 交 易 所 | 美 国 | 212,138.00 | 229,578,554.43 | 2.90 |
| 7 | NVIDIA | 英 伟 达 | NVDA | 纳 | 美 | 219,113.00 | 222,921,430. | 2.81 |

| | | | | | | | | |
|--------|-----------------------------|------------------|------------|-----------------------------------|--------|------------|--------------------|------|
| | Corp | | US | 斯达克证 券交易 所 | 国 | | 66 | |
| 8 | PepsiCo Inc | 百事可 乐 | PEP US | 纳斯 达克 证 券 交 易 所 | 美 国 | 140,186.00 | 156,801,114. 44 | 1.98 |
| 9 | Costco Wholesale Corp | 开市客 | COST US | 纳斯 达克 证 券 交 易 所 | 美 国 | 45,374.00 | 145,951,813. 92 | 1.84 |
| 1 0 | Broadcom Inc | 博通股 份有限 公司 | AVGO US | 纳斯 达克 证 券 交 易 所 | 美 国 | 42,190.00 | 137,559,028. 22 | 1.73 |

注：此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

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

| 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 | NASDAQ 100 E-MINI Sep22 | 0.00 | 0.00 |

注：期货投资采用当日无负债结算制度，结算准备金已包括所持期货合约产生的持仓损益，因此衍生金融工具项下的期货投资与相关的期货暂收款结算所得的持仓损益之间按抵销后的净额列示，为人民币零元。本报告期末本基金投资的期货持仓和损益明细为：NASDAQ 100 E-MINI Sep22 买入持仓量 233 手，合约市值人民币 359,733,793.83 元，公允价值变动人民币 9,978,180.66 元。

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 UltraPro QQQ | 股票 型 | 交易型 开放式 | ProShare Advisors LLC | 20,308,320.56 | 0.26 |

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中，谷歌在报告编制日前一年内曾受到法国国家信息自由委员会的处罚。亚马逊在报告编制日前一年内曾受到意大利反垄断监管机构的处罚。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期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 本报告期内，基金投资的前十名股票未出现超出基金合同规定的备选股票库的情形。

5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(人民币元) |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | 30,962,372.76 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | 967,278.84 |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 31,929,651.60 |

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

本基金本报告期末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 | 405,052,541.00 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 2,927,000,000.00 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 3,000,000.00 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 3,329,052,541.00 |

§ 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 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|--|----------------|------------------------|------|------------------|---------------|------------------|--------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| 广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（QDII） | 1 | 20220419-20220630 | - | 2,390,364,917.00 | 42,271,900.00 | 2,348,093,017.00 | 70.53% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| <p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：</p> <p>① 当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；</p> <p>② 在极端情况下，基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；</p> <p>③ 当个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；</p> <p>④ 在特定情况下，当个别投资者大额赎回，可能导致本基金资产规模和基金份额持有人数量未能满足合同约定，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；</p> <p>⑤ 在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时，持有基金份额占比较高的投资者可能拥有较大话语权。</p> <p>本基金管理人将对基金的大额申赎进行审慎评估并合理应对，完善流动性风险管控机制，切实保护持有人利益。</p> | | | | | | | |

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据《广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，为更好地服务投资者，本基金管理人决定对本基金（基金代码：159941；场内简称：纳指 ETF）进行基金份额拆分，拆分比例为 1:4，即每 1 份基金份额拆为 4 份；并自 2022 年 7 月 5 日起，将本基金的最小申购、赎回单位由 100 万份调整为 130 万份。详情可见本基金管理人网站（www.gffunds.com.cn）刊登的《关于广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金实施份额拆分业务并调整最小申购赎回单位的公告》。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1.中国证监会批准广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件
- 2.《广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 3.《广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- 4.法律意见书
- 5.基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6.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：投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件；
- 2.网站查阅：基金管理人网址 www.gffunds.com.cn。

广发基金管理有限公司
二〇二二年七月二十日