

# 纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金

## 2013 年第 3 季度报告

2013 年 9 月 30 日

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一三年十月二十三日

## § 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2013 年 10 月 21 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 2013 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

|            |                                                                                          |
|------------|------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 国泰纳斯达克100（QDII-ETF）                                                                      |
| 基金主代码      | 513100                                                                                   |
| 交易代码       | 513100                                                                                   |
| 基金运作方式     | 交易型开放式                                                                                   |
| 基金合同生效日    | 2013年4月25日                                                                               |
| 报告期末基金份额总额 | 50,622,120份                                                                              |
| 投资目标       | 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。                                                               |
| 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。但因特殊情况（如成份股长期停牌、成份股发生变 |

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
|--------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | <p>更、成份股权重由于自由流通量发生变化、成份股公司行为、市场流动性不足等）导致本基金管理人无法按照标的指数构成及权重进行同步调整时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。</p> <p>在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追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%。如因标的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。</p> <p>另外，本基金基于流动性管理的需要，将投资于与本基金有相近的投资目标、投资策略、且以本基金的标的指数为投资标的的指数型公募基金（包括ETF）。同时，为更好地实现本基金的投资目标，本基金还将在条件允许的情况下，开展证券借贷业务以及投资于股指期货等金融衍生品，以期降低跟踪误差水平。本基金投资于金融衍生品的目标是替代跟踪标的指数的成份股，使基金的投资组合更紧密地跟踪标的指数。不得应用于投机交易目的，或用作杠杆工具放大基金的投资。</p> <p>未来，随着全球证券市场投资工具的发展和丰富，本基金可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新中公告。</p> |
| 业绩比较基准 | <p>本基金的业绩比较基准为标的指数收益率（经汇率调整后的总收益指数收益率）。本基金的标的指数为纳斯达克100指数（Nasdaq-100 Index）。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 风险收益特征 | <p>本基金属于股票型基金，预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |

|             |                                                          |
|-------------|----------------------------------------------------------|
|             | 数型基金，主要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       | 国泰基金管理有限公司                                               |
| 基金托管人       | 中国建设银行股份有限公司                                             |
| 境外资产托管人英文名称 | State Street Bank and Trust Company                      |
| 境外资产托管人中文名称 | 美国道富银行                                                   |

### § 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(2013年7月1日-2013年9月30日) |
|----------------|---------------------------|
| 1.本期已实现收益      | 900,187.36                |
| 2.本期利润         | 6,378,972.16              |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.1012                    |
| 4.期末基金资产净值     | 53,960,245.42             |
| 5.期末基金份额净值     | 1.066                     |

注：（1）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。

（2）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 本报告期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 | 业绩比较基准收益 | 业绩比较基准收益率标 | ①-③ | ②-④ |
|----|--------|--------|----------|------------|-----|-----|
|----|--------|--------|----------|------------|-----|-----|

|       |        | 准差<br>② | 率③     | 准差④   |        |        |
|-------|--------|---------|--------|-------|--------|--------|
| 过去三个月 | 10.01% | 0.65%   | 10.46% | 0.66% | -0.45% | -0.01% |

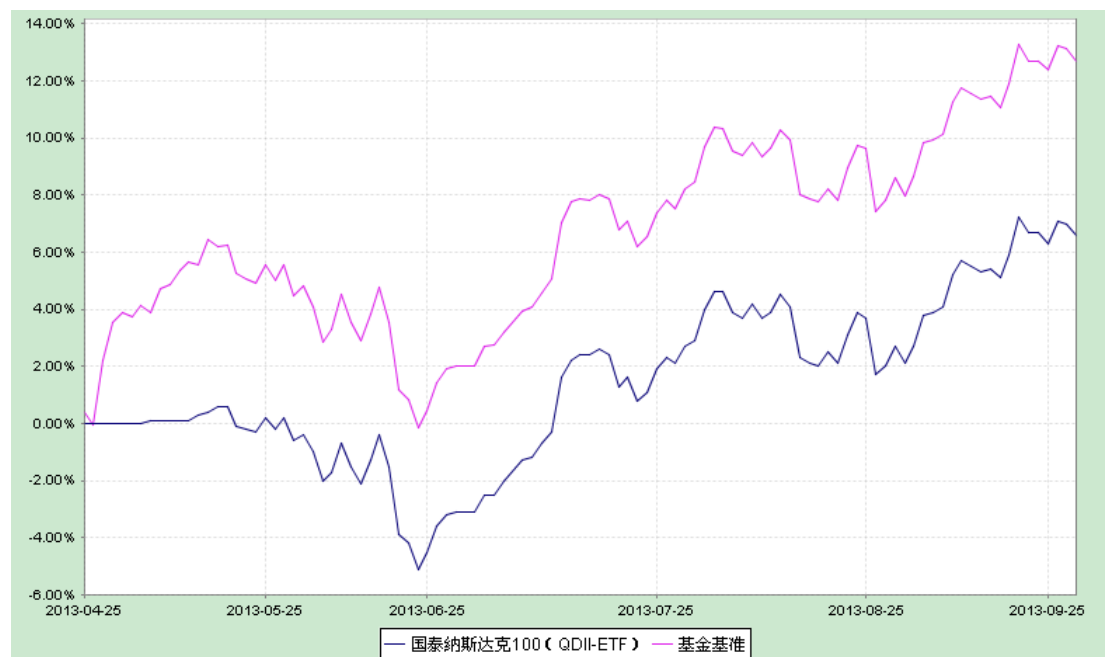
注：同期业绩比较基准以人民币计价。

### 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

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的历史走势对比图

(2013 年 4 月 25 日至 2013 年 9 月 30 日)



注：(1) 本基金的合同生效日为 2013 年 4 月 25 日，截止至 2013 年 9 月 30 日不满一年；

(2) 本基金在 3 个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

(3) 同期业绩比较基准以人民币计价。

## § 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<br>期限 |      | 证券<br>从业<br>年限 | 说明                                                                                                                                                                                                                                        |
|----|-------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|------|----------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |                                                                                           | 任职日期            | 离任日期 |                |                                                                                                                                                                                                                                           |
| 崔涛 | 本基金的<br>基金经理，<br>国泰纳<br>斯达克100指<br>数、国泰大<br>宗商品<br>(LOF)基金<br>的基金经<br>理、国际业<br>务部总监<br>助理 | 2013-4-25       | -    | 9              | 硕士研究生。曾任职于Paloma Partners资产管理公司、富通银行（纽约）。2009年6月加入国泰基金管理有限公司，任高级经理（量化研究方向），从事量化及衍生品投资、指数基金和ETF的投资研究以及境外市场投资研究。2011年5月起任国泰纳斯达克100指数证券投资基金的基金经理，2011年5月起任国际业务部总监助理，2012年5月起兼任国泰大宗商品配置证券投资基金(LOF)的基金经理，2013年4月起兼任纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。 |

注：1、此处的任职日期和离任日期均指公司决定生效之日，首任基金经理，任职日期为基金合同生效日。

2、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 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《证券法》、《证券投资基金法》、《基金管理公司公平交易制度指导意见》等有关法律法规的规定，严格遵守基金合同和招募说明书约定，本着诚实信用、勤勉尽责、最大限度保护投资人合法权益等原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。

本报告期内，本基金未发生损害基金份额持有人利益的行为，投资运作符合法律法规和基金合同的规定，未发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为，信息披露及时、准确、完整，本基金与本基金管理人管理的其他基金资产、投资组合与公司资产之间严格分开、公平对待，基金管理小组保持独立

运作，并通过科学决策、规范运作、精心管理和健全内控体系，有效保障投资人的合法权益。

### 4.3 公平交易专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定，通过严格的内部风险控制制度和流程，对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制，严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易，确保公平对待所管理的所有基金和投资组合，切实防范利益输送行为。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金与本基金管理人管理的其他投资组合未发生大额同日反向交易。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

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在截止 2013 年 9 月 30 日的本报告期内，基金单位净值从 0.969 元上涨到 1.066 元，基金在报告期内的单位净值增长率为 10.01%。

2013 年第三季度美国股市延续涨势。在美股今年以来的稳步上涨之后，市场一度担忧九月的一系列事件可能会引发回调，例如美联储是否退出 QE、德国大选是否导致欧债又生变数、叙利亚问题是否会恶化等等。然而随着靴子逐一落地，结果大多符合甚至超出市场预期。美联储出人意外的在九月议息会议上维持每月总额 850 亿美元的资产购买计划不变，并没有对何时削减 QE3 发表评论；默克尔成功连任德国总理，对待欧债危机的态度和解决方式也有望延续；九月初一度剑拔弩张的叙利亚危机，在俄罗斯的调停下也已逐渐平息并达成框架性协议。随着不确定性的消除，市场乐观情绪再度升温，推动美股上扬。整个报告期内纳斯达克 100 全收益指数上涨 11.01%。

由于本基金成立时间不满一年，目前尚无足够数据计算跟踪误差。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金在 2013 年第 3 季度的净值增长率为 10.01%，同期业绩比较基准收益率为 10.46%（注：同期业绩比较基准以人民币计价）。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望第四季度，短期内最大的风险事件就是美国关于债务上限的谈判。随着量化宽松政策的推行，美国国债上限不断提高，每次都会引发政治上的纷争。债务上限提高本身并不是太大的问题，但美国两党把这一议案当成了谈判的筹码，这次共和党就想在解决方案中附加一项把全民健保法案拖延一年生效的提案，遭到了民主党的强烈反对。这种并非外因、完全由于内部政治纷争引发的僵局，我们判断不会造成恶性的结果，最终仍将和以往一样有惊无险的解决。但在债务上限达成之前，谨慎的投资者会保持观望，市场短期内仍可能有较大震荡。

在短期政治风险扰动以外，三季度美国各项经济仍整体良好，企业二季度盈利也大多超出预期，显示美国稳步复苏的态势不改。一旦债务上限谈判顺利解决，市场风险偏好上扬，纳斯达克 100 指数有望延续涨势。

### § 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   | 50,923,264.87 | 92.64        |
|    | 其中：普通股 | 50,923,264.87 | 92.64        |
|    | 存托凭证   | -             | -            |
|    | 优先股    | -             | -            |
|    | 房地产信托  | -             | -            |
| 2  | 基金投资   | -             | -            |
| 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      | 4,026,080.37  | 7.32   |
| 8 | 其他各项资产            | 19,841.44     | 0.04   |
| 9 | 合计                | 54,969,186.68 | 100.00 |

## 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     | 50,923,264.87 | 94.37        |
| 合计     | 50,923,264.87 | 94.37        |

## 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（%） |
|--------|---------------|--------------|
| 信息技术   | 29,460,022.67 | 54.60        |
| 非必需消费品 | 10,228,870.25 | 18.96        |
| 保健     | 6,838,791.13  | 12.67        |
| 必需消费品  | 2,474,687.42  | 4.59         |
| 工业     | 1,073,729.75  | 1.99         |

|      |               |       |
|------|---------------|-------|
| 电信服务 | 645,859.69    | 1.20  |
| 材料   | 201,303.96    | 0.37  |
| 合计   | 50,923,264.87 | 94.37 |

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股票及存托凭证投资明细

| 序号 | 公司名称<br>(英文)               | 公司名称<br>(中文) | 证券代<br>码    | 所在<br>证<br>券<br>市<br>场 | 所属国<br>家<br>(地<br>区) | 数量<br>(股) | 公允价值<br>(人民币<br>元) | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) |
|----|----------------------------|--------------|-------------|------------------------|----------------------|-----------|--------------------|--------------------------|
| 1  | APPLE INC                  | 苹果公司         | AAPL<br>US  | 纳斯<br>达克               | 美国                   | 2,200     | 6,448,329.80       | 11.95                    |
| 2  | MICROSOFT<br>CORP          | 微软公司         | MSFT<br>US  | 纳斯<br>达克               | 美国                   | 19,300    | 3,948,884.99       | 7.32                     |
| 3  | GOOGLE<br>INC-CL A         | 谷歌公司         | GOOG<br>US  | 纳斯<br>达克               | 美国                   | 600       | 3,231,056.81       | 5.99                     |
| 4  | AMAZON.COM<br>INC          | 亚马逊公<br>司    | AMZN<br>US  | 纳斯<br>达克               | 美国                   | 1,000     | 1,922,110.72       | 3.56                     |
| 5  | CISCO<br>SYSTEMS INC       | 思科公司         | CSCO<br>US  | 纳斯<br>达克               | 美国                   | 12,800    | 1,843,888.49       | 3.42                     |
| 6  | INTEL CORP                 | 英特尔公<br>司    | INTC US     | 纳斯<br>达克               | 美国                   | 11,800    | 1,662,836.03       | 3.08                     |
| 7  | QUALCOMM<br>INC            | 高通公司         | QCOM<br>US  | 纳斯<br>达克               | 美国                   | 4,000     | 1,655,533.44       | 3.07                     |
| 8  | COMCAST<br>CORP-CLASS<br>A | 康卡斯特         | CMCSA<br>US | 纳斯<br>达克               | 美国                   | 4,900     | 1,359,098.40       | 2.52                     |
| 9  | GILEAD<br>SCIENCES INC     | 吉利德科<br>学公司  | GILD<br>US  | 纳斯<br>达克               | 美国                   | 3,500     | 1,352,836.66       | 2.51                     |
| 10 |                            | 脸书           | FB US       | 纳斯                     | 美国                   | 4,100     | 1,266,137.56       | 2.35                     |

|  |                   |  |  |    |  |  |  |  |
|--|-------------------|--|--|----|--|--|--|--|
|  | FACEBOOK<br>INC-A |  |  | 达克 |  |  |  |  |
|--|-------------------|--|--|----|--|--|--|--|

### 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

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

### 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

本基金本报告期末未持有基金。

### 5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

5.10.2 基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情况。

#### 5.10.3 其他各项资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（人民币元） |
|----|---------|----------|
| 1  | 存出保证金   | -        |
| 2  | 应收证券清算款 | -        |

|   |       |           |
|---|-------|-----------|
| 3 | 应收股利  | 18,894.46 |
| 4 | 应收利息  | 946.98    |
| 5 | 应收申购款 | -         |
| 6 | 其他应收款 | -         |
| 7 | 待摊费用  | -         |
| 8 | 其他    | -         |
| 9 | 合计    | 19,841.44 |

#### 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

|               |            |
|---------------|------------|
| 本报告期期初基金份额总额  | 71,622,120 |
| 本报告期基金总申购份额   | 6,000,000  |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 27,000,000 |
| 本报告期基金拆分变动份额  | -          |
| 本报告期期末基金份额总额  | 50,622,120 |

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

本报告期内，本基金的基金管理人未运用固有资金交易本基金。

## § 8 备查文件目录

### 8.1 备查文件目录

1、纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同

- 2、纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金托管协议
- 3、纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金募集的批复
- 4、报告期内披露的各项公告
- 5、法律法规要求备查的其他文件

## 8.2 存放地点

本基金管理人国泰基金管理有限公司办公地点——上海市世纪大道 100 号上海环球金融中心 39 楼。

本基金托管人中国建设银行股份有限公司办公地点——北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼。

## 8.3 查阅方式

可咨询本基金管理人；部分备查文件可在本基金管理人公司网站上查阅。

客户服务中心电话：(021) 38569000，400-888-8688

客户投诉电话：(021) 38569000

公司网址：<http://www.gtfund.com>

国泰基金管理有限公司  
二〇一三年十月二十三日