
基金概况

基金名称： 国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金
基金代码： 160213.OF
基金类型： 被动指数型基金
成立日期： 2010-04-29
基金规模： 4.28（亿元）
单位净值： 2.00（元）
累计净值： 2.10（元）
成立以来收益率： 118.12%

风险等级： 较高

基金公司： 国泰基金管理有限公司

基金经理： 徐皓
2010 年 5 月加入国泰基金管理有限公司。自 2014 年 11 月起管理本基金。

投资范围： 至少 80%的资产投资于 Nasdaq-100 指数的成份股和目标基金，其中，本基金持有的目标基金的市值合计不超过本基金资产净值的 10%。持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。

标的指数投资价值分析

纳斯达克 100 指数是纳斯达克的主要指数，以美国科技股为代表。成份股数量达到 100 只，均具有高科技、高成长和非金融的特点。这些高成长性股票的良好业绩，均来自内生性的高成长和创新，而非资产注入等外延式的增长。从十大权重成份股来看，主要为高科技企业，计算机行业的公司居多。本基金跟踪纳斯达克 100 指数，具有与标的指数相似的风险收益特征和投资价值。

投资策略

本基金为被动式指数基金，采取完全复制法，完全按照标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，以保证基金组合与指数的一致性，达到跟踪标的指数的目的。基金管理人每日对基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

基金评价

对被动指数型基金来说，严控跟踪误差，紧密跟踪标的指数是最重要的。因此在选择被动指数型基金时，跟踪误差无疑是最重要的一个标准。国泰纳斯达克 100 在 2014 和 2015 年度日跟踪误差分别是 0.1982%和 0.3630%。影响跟踪误差的因素是多方面的，其中最主要的因素就是申购和赎回的冲击。