

富国纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）

二〇二四年中期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人： 富国基金管理有限公司

基金托管人： 招商银行股份有限公司

送出日期： 2024 年 08 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

富国基金管理有限公司的董事会、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。本中期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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 29 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。

富国基金管理有限公司承诺以诚实信用、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 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 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 .....	6
2.1	基金基本情况 .....	6
2.2	基金产品说明 .....	6
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.....	7
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 .....	8
3.1	主要会计数据和财务指标.....	8
3.2	基金净值表现 .....	8
§4	管理人报告 .....	10
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	10
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 .....	11
4.3	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 .....	11
4.4	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	12
4.5	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明 .....	13
4.6	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	13
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	13
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	14
4.9	报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....	14
§5	托管人报告 .....	15
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 .....	15
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 .....	15
5.3	托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 .....	15
§6	中期财务报告（未经审计） .....	16
6.1	资产负债表 .....	16
6.2	利润表 .....	17
6.3	净资产变动表 .....	18
6.4	报表附注 .....	19

§7	投资组合报告 .....	42
7.1	期末基金资产组合情况.....	42
7.2	期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布 .....	42
7.3	期末按行业分类的权益投资组合 .....	42
7.4	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细 .....	43
7.5	报告期内权益投资组合的重大变动.....	49
7.6	期末按债券信用等级分类的债券投资组合 .....	56
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 .....	56
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 .....	56
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 .....	56
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 .....	56
7.11	投资组合报告附注 .....	56
§8	基金份额持有人信息 .....	58
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	58
8.2	期末上市基金前十名持有人.....	58
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	58
8.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	58
§9	开放式基金份额变动 .....	59
§10	重大事件揭示 .....	60
10.1	基金份额持有人大会决议.....	60
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 .....	60
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	60
10.4	基金投资策略的改变 .....	60
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	60
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 .....	60
10.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	61
10.8	其他重大事件 .....	82
§11	影响投资者决策的其他重要信息 .....	83
11.1	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.....	83
11.2	影响投资者决策的其他重要信息.....	83
§12	备查文件目录 .....	84



## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	富国纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)
基金简称	富国纳斯达克 100ETF (QDII)
场内简称	纳指 ETF 富国
基金主代码	513870
交易代码	513870
基金运作方式	契约型, 交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 10 月 25 日
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	207,671,000.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2023 年 11 月 2 日

### 2.2 基金产品说明

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	本基金采用完全复制法, 即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化进行相应调整。在正常市场情况下, 本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%, 年跟踪误差不超过 3%。本基金的资产配置策略、存托凭证投资策略、可转换债券 (含分离交易可转债) 及可交换债券投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略、股票期权投资策略、境外市场基金投资策略、境外金融衍生品投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	纳斯达克 100 指数收益率 (经汇率调整后)
风险收益特征	本基金属于股票型基金, 预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股, 具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金为投资境外证券的基金, 主要投资于美国市场, 除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外, 本基金还面临汇率风险、美国市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

### 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		富国基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵瑛	张姗
	联系电话	021-20361818	400-61-95555

	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		95105686、4008880688	400-61-95555
传真		021-20361616	0755-83195201
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址		上海市浦东新区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		200120	518040
法定代表人		裴长江	缪建民

#### 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	—	Citibank, N. A.
	中文	—	花旗银行
注册地址		—	—
办公地址		—	—
邮政编码		—	—

#### 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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.fullgoal.com.cn
基金中期报告备置地点	富国基金管理有限公司 上海市浦东新区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层 招商银行股份有限公司 深圳市深南大道7088号招商银行大厦

#### 2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

### § 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(2024年01月01日至2024年06月30日)
本期已实现收益	13,273,685.38
本期利润	34,900,511.54
加权平均基金份额本期利润	0.1403
本期加权平均净值利润率	11.45%
本期基金份额净值增长率	16.95%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年06月30日)
期末可供分配利润	55,206,854.48
期末可供分配基金份额利润	0.2658
期末基金资产净值	277,949,530.54
期末基金份额净值	1.3384
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年06月30日)
基金份额累计净值增长率	33.84%

注：上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（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。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。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）。

#### 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	6.40%	0.77%	6.45%	0.77%	-0.05%	0.00%
过去三个月	8.39%	0.99%	8.31%	0.99%	0.08%	0.00%
过去六个月	16.95%	0.97%	17.71%	0.98%	-0.76%	-0.01%
自基金合同生效起至今	33.84%	0.93%	32.52%	0.97%	1.32%	-0.04%

注：本基金业绩比较基准根据基金合同中投资策略及资产配置比例等相关规定构建，能够较好地反映本基金的风险收益特征。本基金每个交易日对业绩比较基准依据合同约定的权重比例进行再平衡处理，并用每日连乘方式计算得到指数基准的时间序列。

### 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



注：1、截止日期为2024年6月30日。

2、本基金于2023年10月25日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。本基金建仓期6个月，从2023年10月25日起至2024年4月24日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

## § 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

富国基金管理有限公司于 1999 年 4 月 13 日获国家工商行政管理局登记注册成立，是经中国证监会批准设立的首批十家基金管理公司之一。公司于 2001 年 3 月从北京迁址上海。2003 年 9 月，加拿大蒙特利尔银行（BMO）参股富国基金管理有限公司的工商变更登记办理完毕，富国基金管理有限公司成为国内首批成立的十家基金公司中，第一家中外合资的基金管理公司。

目前，公司注册资本金 5.2 亿元人民币，股东为：海通证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、加拿大蒙特利尔银行及山东省金融资产管理股份有限公司。公司在北京、成都、广州设立有分公司，并全资设有两家子公司——富国资产管理（上海）有限公司和富国资产管理（香港）有限公司。公司拥有公募基金、特定客户资产管理、QDII、社保、企业年金、基本养老保险基金等基金公司全部业务牌照。

截至 2024 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理富国天盛灵活配置混合型证券投资基金、富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）、富国新兴产业股票型证券投资基金、富国中证智能汽车指数证券投资基金（LOF）、富国中证红利指数增强型证券投资基金、上证综指交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、富国天利增长债券投资基金、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、富国中债-1-3 年国开行债券指数证券投资基金、富国全球科技互联网股票型证券投资基金（QDII）、富国鑫旺稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、富国富钱包货币市场基金、富国首创水务封闭式基础设施证券投资基金等 350 只公开募集证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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		
田希蒙	本基金现任基金经理	2023-10-25	—	7	硕士，自 2017 年 5 月加入富国基金管理有限公司，历任助理定量研究员、定量研究员、定量投资经理；现任富国基金量化投资部定量基金经理。自 2023 年 01 月起任富

					<p>国中证港股通互联网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 2023 年 01 月起任富国中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2023 年 03 月起任富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2023 年 03 月起任富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；自 2023 年 04 月起任富国恒生港股通高股息低波动交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理；自 2023 年 06 月起任富国恒生港股通医疗保健交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2023 年 09 月起任富国恒生港股通高股息低波动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 2023 年 10 月起任富国纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理；自 2023 年 11 月起任富国标普石油天然气勘探及生产精选行业交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理；自 2023 年 12 月起任富国恒生港股通医疗保健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；具有基金从业资格。</p>
--	--	--	--	--	--

注：1、上述任职日期为根据公司决定确定的聘任日期，离任日期为根据公司确定的解聘日期；首任基金经理任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的涵义遵从中国证监会《证券基金经营机构董事、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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

注：本基金无境外投资顾问。

#### 4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《富国纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基

金（QDII）基金合同》以及其它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，以尽可能减少和分散投资风险、力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定收益为目标，基金投资组合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**

本基金管理人根据相关法规要求，结合实际情况，制定了内部的《公平交易管理办法》，对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节，实行事前控制、事中监控、事后评估及反馈的流程化管理。在制度、操作层面确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。事前控制主要包括：1、一级市场，通过标准化的办公流程，对关联方审核、价格公允性判断及证券公平分配等相关环节进行控制；2、二级市场，通过交易系统的投资备选库、交易对手库及授权管理，对投资标的、交易对手和操作权限进行自动化控制。事中监控主要包括组合间相同投资标的的交易方向、市场冲击的控制，银行间市场交易价格的公允性评估等。1、将主动投资组合的同日反向交易列为限制行为，非经特别控制流程审核同意，不得进行；对于同日同向交易，通过交易系统对组合间的交易公平性进行自动化处理。2、同一基金经理管理的不同组合，对同一投资标的采用相同投资策略的，必须通过交易系统采取同时、同价下达投资指令，确保公平对待其所管理的组合。事后评估及反馈主要包括组合间同一投资标的的临近交易日的同向交易和反向交易的合理性分析评估，以及不同时间窗口下（1日、3日、5日）的季度公平性交易分析评估等。1、通过公平性交易的事后分析评估系统，对涉及公平性交易的投资行为进行分析评估，分析对象涵盖公募、年金、社保及专户产品，并重点分析同类组合（股票型、混合型、债券型）间、不同产品间以及同一基金经理管理不同组合间的交易行为，若发现异常交易行为，风险管理部视情况要求相关当事人做出合理性解释，并按法规要求上报辖区监管机构。2、季度公平性交易分析报告按规定经基金经理或投资经理签字，并经督察长、总经理审阅签字后，归档保存，以备后查。本报告期内公司旗下基金严格遵守公司的相关公平交易制度，未出现违反公平交易制度的情况。

#### **4.4.2 异常交易行为的专项说明**

本报告期内未发现异常交易行为。公司旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，报告期内本组合与其他投资组合之间未出现成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%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**

在回顾 2024 年上半年的纳斯达克指数表现时，我们可以看到市场经历了一段波动起伏的时期。初期，市场受到美联储政策预期调整的影响较大。

另一方面，美国国内消费仍然表现出强大的韧性，尤其是头部公司的业绩持续上修，这不仅带动了相关行业的增长，也推动了整体纳斯达克指数的上涨。头部公司在科技和消费领域的领先地位，为市场提供了稳定的增长动力。

##### **4.5.2 报告期内基金的业绩表现**

截至 2024 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.3384 元；份额累计净值为 1.3384 元；本报告期，本基金份额净值增长率为 16.95%，同期业绩比较基准收益率为 17.71%。

#### **4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望**

展望未来的第三季度，我们认为市场仍然存在一定的上涨空间。首先，6 月到 7 月初的数据显示，美国经济增长速度放缓，这使得市场对未来经济的走弱并未完全定价，为降息预期带来了显著的交易空间。此外，AI 应用的不断迭代，有望增强公司未来 AI 方向的确信性，提高公司的估值。

后续，纳斯达克有望在经济复苏的前期充分受益，更加受益于全球的降息周期，如果后面 9 月份出现降息，那么指数或将受益该过程。

#### **4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明**

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等法律法规、估值指引的相关规定，以及基金合同对估值程序的相关约定，对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值的账务处理、基金份额净值的计算由基金管理人独立完成，并与基金托管人进行账务核对，经基金托管人复核无误后，由基金管理人

外公布。

#### **4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

根据相关法律法规、本基金《基金合同》的约定以及基金的实际运作情况，本报告期内本基金未进行收益分配。本基金将严格按照法律法规及基金合同约定进行收益分配。

#### **4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

本基金本报告期无需要说明的相关情形。

## § 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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 中期财务报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：富国纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）

报告截止日：2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>		
货币资金	36,089,669.88	7,633,673.93
结算备付金	—	—
存出保证金	—	—
交易性金融资产	275,328,880.18	44,928,163.42
其中：股票投资	275,328,880.18	44,928,163.42
基金投资	—	—
债券投资	—	—
资产支持证券投资	—	—
贵金属投资	—	—
其他投资	—	—
衍生金融资产	—	—
买入返售金融资产	—	—
应收清算款	147,982.34	7,849.60
应收股利	30,154.42	37,748.25
应收申购款	—	—
递延所得税资产	—	—
其他资产	75,409.68	—
资产总计	311,672,096.50	52,607,435.20
<b>负债和净资产</b>	<b>本期末</b> 2024 年 06 月 30 日	<b>上年度末</b> 2023 年 12 月 31 日
<b>负 债：</b>		
短期借款	—	—
交易性金融负债	—	—
衍生金融负债	—	—
卖出回购金融资产款	—	—
应付清算款	33,520,585.47	7,119,179.77
应付赎回款	—	—
应付管理人报酬	88,986.42	17,099.04
应付托管费	17,797.28	3,419.79
应付销售服务费	—	—
应付投资顾问费	—	—
应交税费	—	—

应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	95,196.79	66,287.67
负债合计	33,722,565.96	7,205,986.27
<b>净资产：</b>		
实收基金	207,671,000.00	39,671,000.00
其他综合收益	—	—
未分配利润	70,278,530.54	5,730,448.93
净资产合计	277,949,530.54	45,401,448.93
负债和净资产总计	311,672,096.50	52,607,435.20

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.3384 元，基金份额总额 207,671,000.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：富国纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）

本报告期：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 (2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日)
<b>一、营业总收入</b>	36,004,908.94
1.利息收入	27,654.00
其中：存款利息收入	27,654.00
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）	15,660,900.46
其中：股票投资收益	14,373,369.78
基金投资收益	—
债券投资收益	—
资产支持证券投资收益	—
贵金属投资收益	—
衍生工具收益	—
股利收益	1,287,530.68
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益	—
其他投资收益	—
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	21,626,826.16
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-1,143,712.23
5.其他收入（损失以“-”号填列）	-166,759.45
<b>减：二、营业总支出</b>	1,104,397.40

1. 管理人报酬	781,569.35
2. 托管费	156,313.90
3. 销售服务费	—
4. 投资顾问费	—
5. 利息支出	—
其中：卖出回购金融资产支出	—
6. 信用减值损失	—
7. 税金及附加	—
8. 其他费用	166,514.15
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	34,900,511.54
减：所得税费用	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	34,900,511.54
五、其他综合收益的税后净额	—
六、综合收益总额	34,900,511.54

注：本基金合同生效日为 2023 年 10 月 25 日，无上年度同期对比数据。

### 6.3 净资产变动表

会计主体：富国纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）

本报告期：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 (2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日)		
	实收基金	未分配 利润	净资产 合计
一、上期期末净资产	39,671,000.00	5,730,448.93	45,401,448.93
二、本期期初净资产	39,671,000.00	5,730,448.93	45,401,448.93
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	168,000,000.00	64,548,081.61	232,548,081.61
（一）、综合收益总额	—	34,900,511.54	34,900,511.54
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	168,000,000.00	29,647,570.07	197,647,570.07
其中：1. 基金申购款	542,000,000.00	110,227,634.41	652,227,634.41
2. 基金赎回款	—	-80,580,064.34	—
	374,000,000.00		454,580,064.34
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	—	—	—
（四）、其他综合收益结转留存收益	—	—	—
四、本期期末净资产	207,671,000.00	70,278,530.54	277,949,530.54

注：本基金合同生效日为 2023 年 10 月 25 日，无上年度同期对比数据。

报表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：

陈 戈	林志松	徐慧
-----	-----	-----
基金管理公司负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

富国纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金(QDII) 以下简称“本基金”) 系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2023]2023 号文《关于准予富国纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)注册的批复》准予公开募集注册。由基金管理人富国基金管理有限公司自 2023 年 10 月 16 日至 2023 年 10 月 20 日止期间向社会公开发行人募集,募集期结束经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具德师报(验)字(23)第 00248 号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2023 年 10 月 25 日正式生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。富国纳斯达克 100ETF(QDII)基金份额净有效认购资金金额为人民币 237,671,000.00 元,折算成基金份额计 237,671,000.00 份(其中,网上现金认购净有效认购资金为人民币 237,671,000.00 元,折算成基金份额计 237,671,000.00 份;网下现金认购净有效认购资金为人民币 0.00 元,折算成基金份额计 0.00 份);有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币 39,336.80 元(其中,根据注册登记机构的记录,网上现金认购的有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币 39,336.80 元,计入基金财产,不折算成投资者基金份额;网下现金认购有效净认购资金在募集期间产生的折算基金份额的利息为人民币 0.00 元,折算成基金份额计 0.00 份)本基金的基金管理人为富国基金管理有限公司,招商银行股份有限公司担任基金托管人,境外资产托管人为花旗银行(CitibankN.A.)。

本基金的投资范围主要为标的指数成份股、备选成份股（均含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金可以少量投资于境内、境外市场的其他资产，包括但不限于其他非成份股的股票、存托凭证。针对境内投资，本基金可少量投资于国内依法发行上市的股票（包含主板、科创板、创业板及其他经中国证监会允许发行的股票）、存托凭证、债券（国债、央行票据、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、衍生工具（股指期货、股票期权等）、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。针对境外投资，本基金可投资于下列金融产品或工具：1、在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金（含交易型开放式指数基金 ETF）；2、已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证；3、政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；4、银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；5、远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品；6、与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品；7、本基金可以进行境外证券借贷交易、境外正回购交易、逆回购交易。有关证券借贷交易的内容以专门签署的三方或多方协议约定为准；8、中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股（均含存托凭证）的比例不得低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。如法律法规对该比例要求有变更的，在履行适当程序后，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

本基金的业绩比较基准为纳斯达克 100 指数收益率（经汇率调整后）。

#### **6.4.2 会计报表的编制基础**

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第3号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号《年度报告和中期报告》》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2024年6月30日的财务状况以及2024年1月1日至2024年6月30日止期间的经营成果和净资产变动情况。

#### **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**

本基金报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

#### **6.4.5 会计差错更正的说明**

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### **6.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增

增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定；

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育费附加的单位外）及地方教育费附加；

基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂免征营业税或增值税和企业所得税；

基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂未征收个人所得税和企业所得税。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 (2024年06月30日)
活期存款	36,089,669.88
等于：本金	36,089,383.50
加：应计利息	286.38
减：坏账准备	—
定期存款	—

等于：本金	—
加：应计利息	—
减：坏账准备	—
其中：存款期限 1 个月以内	—
存款期限 1-3 个月	—
存款期限 3 个月以上	—
其他存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
减：坏账准备	—
合计	36,089,669.88

注：本基金本报告期末未持有定期存款。

本基金外币存款余额构成列示如下

	2024年6月30日				
	外币本金	外币应计利息	外币总额	折算汇率	总额折合人民币
美元	4,552,537.70	—	4,552,537.70	7.1268	32,445,025.68
合计					32,445,025.68

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末（2024年06月30日）			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	250,213,412.22	—	275,328,880.18	25,115,467.96
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—	—
债券	交易所市场	—	—	—
	银行间市场	—	—	—
	合计	—	—	—
资产支持证券	—	—	—	—
基金	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	250,213,412.22	—	275,328,880.18	25,115,467.96

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本报告期末本基金未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末无买断式逆回购交易。

#### 6.4.7.5其他资产

单位：人民币元

项目	本期末（2024年06月30日）
应收利息	—
其他应收款	—
待摊费用	75,409.68
合计	75,409.68

#### 6.4.7.6其他负债

单位：人民币元

项目	本期末（2024年06月30日）
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	—
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	—
其中：交易所市场	—
银行间市场	—
应付利息	—
预提信息披露费	42,500.00
预提审计费	39,464.64
IOPV 计算发布费	13,232.15
合计	95,196.79

#### 6.4.7.7实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	39,671,000.00	39,671,000.00
本期申购	542,000,000.00	542,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-374,000,000.00	-374,000,000.00
本期末	207,671,000.00	207,671,000.00

#### 6.4.7.8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	8,476,527.20	-2,746,078.27	5,730,448.93
本期期初	8,476,527.20	-2,746,078.27	5,730,448.93
本期利润	13,273,685.38	21,626,826.16	34,900,511.54
本期基金份额交易产生的变动数	33,456,641.90	-3,809,071.83	29,647,570.07
其中：基金申购款	119,150,794.35	-8,923,159.94	110,227,634.41
基金赎回款	-85,694,152.45	5,114,088.11	-80,580,064.34
本期已分配利润	—	—	—
本期末	55,206,854.48	15,071,676.06	70,278,530.54

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
活期存款利息收入	27,654.00
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	—
合计	27,654.00

#### 6.4.7.10 股票投资收益

##### 6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
股票投资收益——买卖股票差价收入	14,373,369.78
股票投资收益——赎回差价收入	—
股票投资收益——申购差价收入	—
合计	14,373,369.78

##### 6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
卖出股票成交总额	390,843,159.85
减：卖出股票成本总额	376,403,707.43
减：交易费用	66,082.64
买卖股票差价收入	14,373,369.78

##### 6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
赎回基金份额对价总额	454,580,064.34
减：现金支付赎回款总额	454,580,064.34
减：赎回股票成本总额	—
减：交易费用	—
赎回差价收入	—

注：本基金本报告期无股票投资收益——赎回差价收入。

##### 6.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无股票投资收益——申购差价收入。

#### 6.4.7.11 基金投资收益

注：本基金本报告期无基金投资收益。

#### 6.4.7.12 债券投资收益

##### 6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无债券投资收益。

##### 6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期无买卖债券差价收入。

#### 6.4.7.13 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

##### 6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无买卖贵金属交易。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

##### 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

##### 6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
股票投资产生的股利收益	1,287,530.68
其中：证券出借权益补偿收入	—
基金投资产生的股利收益	—
合计	1,287,530.68

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
1. 交易性金融资产	21,626,826.16
股票投资	21,626,826.16
债券投资	—

资产支持证券投资	—
基金投资	—
贵金属投资	—
其他	—
2. 衍生工具	—
权证投资	—
3. 其他	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	—
合计	21,626,826.16

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
基金赎回费收入	—
替代损益	-166,759.45
合计	-166,759.45

#### 6.4.7.19 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
审计费用	6,464.64
信息披露费	42,500.00
证券出借违约金	—
银行费用	33,014.71
其他	84,534.80
合计	166,514.15

#### 6.4.7.21 分部报告

本基金目前以一个经营分部运作。

### 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，本基金无需要说明的重大或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大影响关系的关联方未发生变化。

### 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
富国基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
海通证券股份有限公司（“海通证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
申万宏源证券有限公司（“申万宏源”）	基金管理人的股东、基金代销机构
招商银行股份有限公司	基金托管人
Citibank, N. A.	基金境外托管人

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 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

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。本基金合同生效日为2023年10月25日，无上年度同期对比数据。

#### 6.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。本基金合同生效日为2023年10月25日，无上年度同期对比数据。

#### 6.4.10.1.3 债券交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。本基金合同生效日为2023年10月25日，无上年度同期对比数据。

#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行回购交易。本基金合同生效日为2023年10月25日，无上年度同期对比数据。

#### 6.4.10.1.5 基金交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行基金交易。本基金合同生效日为2023年10月25日，无上年度同期对比数据。

#### 6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期无应支付关联方的佣金。本基金合同生效日为2023年10月25日，无上年度同期对比数据。

### 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（2024年01月01日至2024年06月30日）
当期发生的基金应支付的管理费	781,569.35
其中：支付销售机构的客户维护费	27,570.44
应支付基金管理人的净管理费	753,998.91

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

本基金合同生效日为2023年10月25日，无上年度同期对比数据。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
当期发生的基金应支付的托管费	156,313.90

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.10%年费率计提。托管费的计算方法如下：

$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$

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

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

本基金合同生效日为 2023 年 10 月 25 日，无上年度同期对比数据。

#### **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**

注：本基金本报告期末与关联方通过银行间同业市场进行债券（含回购）交易。

本基金合同生效日 2023 年 10 月 25 日，无上年度同期对比数据。

#### **6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明**

##### **6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

注：本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率从事证券出借业务。

##### **6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况**

注：本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率从事证券出借业务。

#### **6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**

##### **6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况**

注：本报告期内本基金的基金管理人未运用自有资金投资本基金。本基金合同生效日为 2023 年 10 月 25 日，无上年度同期对比数据。

##### **6.4.10.5.2 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**

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方本报告期末及上年度末均未投资本基

金。

#### 6.4.10.6 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（2024年01月01日至2024年06月30日）	
	期末余额	当期利息收入
花旗银行	32,443,818.12	150.13
招商银行股份有限公司	3,645,851.76	27,503.87

注：本基金合同生效日为2023年10月25日，无上年度同期对比数据。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2024年06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

注：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

注：本基金本报告期末未持有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

注：截至本报告期末2024年06月30日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2024年06月30日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

## **6.4.13 金融工具风险及管理**

### **6.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、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。本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、风险管理部和合规稽核部、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

### **6.4.13.2 信用风险**

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金持有同一机构（政府、国际金融组织除外）发行的证券市值不超过基金净值的 10%，持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不超过基金资产净值的 10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的 3%。本基金投资于远期合约、互换等柜台交易金融衍生品时，要求所有参与交易对手方（中资商业银行除外）应当具有不低于中国证监会认可的信用评级机构评级，并且任一交易对手方的市值计价敞口不得超过基金资产净值的 20%。

### **6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

#### **6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析**

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易

对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。本基金除在 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过合同及法规规定。本基金本报告期末无重大流动性风险。

#### **6.4.13.4 市场风险**

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，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**

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为货币资金、债券投资等。

###### **6.4.13.4.1.1 利率风险敞口**

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

单位：人民币元

本期末（2024年06月30日）	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	36,089,669.88	—	—	—	—	—	36,089,669.88
交易性金融资产	—	—	—	—	—	275,328,880.18	275,328,880.18
应收清算款	—	—	—	—	—	147,982.34	147,982.34
应收股利	—	—	—	—	—	30,154.42	30,154.42
其他资产	—	—	—	—	—	75,409.68	75,409.68
资产总计	36,089,669.88	—	—	—	—	275,582,426.62	311,672,096.50
负债							
应付清算款	—	—	—	—	—	33,520,585.47	33,520,585.47
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	88,986.42	88,986.42
应付托管费	—	—	—	—	—	17,797.28	17,797.28
其他负债	—	—	—	—	—	95,196.79	95,196.79
负债总计	—	—	—	—	—	33,722,565.96	33,722,565.96
利率敏感度缺口	36,089,669.88	—	—	—	—	241,859,860.66	277,949,530.54
上年度末（2023年12月31日）	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	7,633,673.93	—	—	—	—	—	7,633,673.93
交易性金融资产	—	—	—	—	—	44,928,163.42	44,928,163.42
应收清算款	—	—	—	—	—	7,849.60	7,849.60
应收股利	—	—	—	—	—	37,748.25	37,748.25

资产总计	7,633,673.93	—	—	—	—	44,973,761.27	52,607,435.20
负债							
应付清算款	—	—	—	—	—	7,119,179.77	7,119,179.77
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	17,099.04	17,099.04
应付托管费	—	—	—	—	—	3,419.79	3,419.79
其他负债	—	—	—	—	—	66,287.67	66,287.67
负债总计	—	—	—	—	—	7,205,986.27	7,205,986.27
利率敏感度缺口	7,633,673.93	—	—	—	—	37,767,775.00	45,401,448.93

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本期末及上年度末均未持有债券资产（不含可转债），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。本基金可持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，本基金的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（2024年06月30日）				
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	欧元 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产					
货币资金	32,445,025.68	—	—	—	32,445,025.68
交易性金融资产	275,328,880.18	—	—	—	275,328,880.18
应收股利	30,154.42	—	—	—	30,154.42
资产合计	307,804,060.28	—	—	—	307,804,060.28
以外币计价的负债					
应付清算款	30,488,917.42	—	—	—	30,488,917.42
负债合计	30,488,917.42	—	—	—	30,488,917.42
资产负债表外汇风险敞口净额	277,315,142.86	—	—	—	277,315,142.86
项目	上年度末（2023年12月31日）				
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	欧元 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产					
货币资金	104,816.03	—	—	—	104,816.03
交易性金融资产	44,928,163.42	—	—	—	44,928,163.42
应收股利	37,748.25	—	—	—	37,748.25
资产合计	45,070,727.70	—	—	—	45,070,727.70
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	45,070,727.70	—	—	—	45,070,727.70

##### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	(1) 假设本基金的单一外币汇率变化1%，其他变量不变；(2) 此项影响并未考虑管理层为减低汇率风险而可能采取的风险管理活动；(3) 计算外汇风险敏感性时，包含
----	--

	了远期外汇敞口。		
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：人民币元）	
		本期末（2024年06月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	美元相对人民币贬值1%	-2,773,151.43	-450,707.28
	美元相对人民币升值1%	2,773,151.43	450,707.28

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金其他价格风险主要系市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金的投资范围包括但不限于在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的股票和存托凭证，在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金（含ETF）、债券、货币市场工具、金融衍生品以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关要求），所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本基金的投资范围主要为标的指数成份股、备选成份股（均含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金可以少量投资于境内、境外市场的其他资产，包括但不限于其他非成份股的股票、存托凭证。

针对境内投资，本基金可少量投资于国内依法发行上市的股票（包含主板、科创板、创业板及其他经中国证监会允许发行的股票）、存托凭证、债券（国债、央行票据、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、衍生工具（股指期货、股票期权等）、货币市场工具以及中国证

监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。

针对境外投资，本基金可投资于下列金融产品或工具：

1、在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金（含交易型开放式指数基金 ETF）；

2、已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证；

3、政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；

4、银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；

5、远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品；

6、与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品；

7、本基金可以进行境外证券借贷交易、境外正回购交易、逆回购交易。有关证券借贷交易的内容以专门签署的三方或多方协议约定为准；

8、中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股（均含存托凭证）的比例不得低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。

如法律法规对该比例要求有变更的，在履行适当程序后，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

金额单位：人民币元

项目	本期末（2024 年 06 月 30 日）		上年度末（2023 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	275,328,880.18	99.06	44,928,163.42	98.96
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	275,328,880.18	99.06	44,928,163.42	98.96

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金管理人运用资产-资本定价模型（CAPM）对本基金的市场价格风险进行分析。下表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，业绩比较基准所对应的市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

假设	1. 基金的市场价格风险主要源于市场的系统性风险，即与基金的贝塔系数紧密相关；2. 以下分析，除业绩比较基准发生变动，其他影响基金资产公允价值的风险变量保持不变。		
	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：人民币元）	
		本期末（2024年06月30日）	上年度末（2023年12月31日）
分析	1. 业绩比较基准增加 1%	2,764,033.02	321,851.67
	2. 业绩比较基准减少 1%	-2,764,033.02	-321,851.67

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 (2024年06月30日)	上年度末 (2023年12月31日)
第一层次	275,328,880.18	44,928,163.42
第二层次	—	—
第三层次	—	—
合计	275,328,880.18	44,928,163.42

##### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

##### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 6.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

##### 6.4.15.2 其他事项

---

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 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	275,328,880.18	88.34
	其中：普通股	272,487,513.96	87.43
	存托凭证	2,841,366.22	0.91
	房地产信托凭证	—	—
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	36,089,669.88	11.58
8	其他各项资产	253,546.44	0.08
9	合计	311,672,096.50	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	275,328,880.18	99.06
合计	275,328,880.18	99.06

### 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 (%)
信息技术	142,748,763.56	51.36
通信服务	42,799,469.73	15.40
非日常生活消费品	34,563,824.33	12.44
医疗保健	16,803,766.17	6.05
日常消费品	16,559,542.06	5.96
工业	11,743,610.81	4.23
原材料	3,902,884.26	1.40
公用事业	3,213,154.21	1.16

能源	1,310,001.62	0.47
金融	1,123,251.24	0.40
房地产	560,612.19	0.20
合计	275,328,880.18	99.06

#### 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细

##### 7.4.1 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	Microsoft Corporation	微软公司	MSFT	美国证券交易 所	美国	7,471.00	23,797,550.08	8.56
2	Apple Inc.	苹果公司	AAPL	美国证券交易 所	美国	15,414.00	23,137,132.54	8.32
3	NVIDIA Corporation	英伟达公司	NVDA	美国证券交易 所	美国	24,727.00	21,770,760.35	7.83
4	Alphabet Inc.	谷歌(Alphabet)	GOOGL	美国证券交易 所	美国	5,905.00	7,665,555.79	2.76
			GOOG	美国证券交易 所	美国	5,646.00	7,380,437.97	2.66
5	Amazon.Com, Inc.	亚马逊公司	AMZN	美国证券交易 所	美国	10,461.00	14,407,455.14	5.18
6	Broadcom Inc.	博通公司	AVGO	美国证券交易 所	美国	1,203.00	13,765,076.32	4.95
7	Meta Platforms, Inc.	Meta Platforms, Inc.	META	美国证券交易 所	美国	3,505.00	12,595,130.21	4.53
8	Costco Wholesale Corporation	好市多公司	COST	美国证券交易 所	美国	1,151.00	6,972,422.75	2.51
9	Tesla, Inc.	特斯拉公司	TSLA	美国证券交易 所	美国	4,853.00	6,843,949.00	2.46
10	Netflix, Inc.	奈飞公司	NFLX	美国证券交易 所	美国	1,119.00	5,382,093.22	1.94
11	Advanced Micro Devices, Inc.	美国超威半导体 公司	AMD	美国证券交易 所	美国	4,196.00	4,850,736.40	1.75
12	Adobe Inc.	奥多比公司	ADBE	美国证券交易 所	美国	1,163.00	4,604,575.73	1.66
13	Pepsico, Inc.	百事公司	PEP	美国证券交易 所	美国	3,569.00	4,195,085.13	1.51

14	Qualcomm Incorporated	高通公司	QCOM	美国证券交易所	美国	2,898.00	4,113,757.44	1.48
15	Linde PLC	Linde PLC	LIN	美国证券交易所	美国	1,248.00	3,902,884.26	1.40
16	T-Mobile US, Inc.	T-Mobile US, Inc.	TMUS	美国证券交易所	美国	3,043.00	3,820,789.66	1.37
17	Applied Materials, Inc.	应用材料	AMAT	美国证券交易所	美国	2,150.00	3,615,985.09	1.30
18	Cisco Systems, Inc.	思科	CSCO	美国证券交易所	美国	10,460.00	3,541,696.04	1.27
19	Intuit Inc.	财捷公司	INTU	美国证券交易所	美国	726.00	3,400,441.87	1.22
20	Texas Instruments Incorporated	德州仪器公司	TXN	美国证券交易所	美国	2,364.00	3,277,393.82	1.18
21	Amgen Inc.	安进公司	AMGN	美国证券交易所	美国	1,393.00	3,101,888.74	1.12
22	Intuitive Surgical, Inc.	直觉外科手术公司	ISRG	美国证券交易所	美国	921.00	2,919,898.78	1.05
23	Comcast Corporation	康卡斯特公司	CMCSA	美国证券交易所	美国	10,163.00	2,836,345.81	1.02
24	Micron Technology, Inc.	美光科技公司	MU	美国证券交易所	美国	2,875.00	2,694,990.51	0.97
25	Honeywell International Inc.	霍尼韦尔国际公司	HON	美国证券交易所	美国	1,691.00	2,573,459.97	0.93
26	Lam Research Corporation	拉姆研究公司	LRCX	美国证券交易所	美国	339.00	2,572,661.84	0.93
27	Booking Holdings Inc.	Booking Holdings Inc.	BKNG	美国证券交易所	美国	88.00	2,484,488.00	0.89
28	Intel Corporation	英特尔公司	INTC	美国证券交易所	美国	11,053.00	2,439,584.96	0.88
29	Vertex Pharmaceuticals Incorporated	福泰制药公司	VRTX	美国证券交易所	美国	670.00	2,238,117.38	0.81
30	Regeneron Pharmaceuticals, Inc.	再生元制药股份有限公司	REGN	美国证券交易所	美国	281.00	2,104,825.05	0.76
31	Analog	亚德诺公司	ADI	美国证券交	美国	1,288.00	2,095,271.22	0.75

	Devices, Inc.			易所				
32	KLA Corporation	科天半导体公司	KLAC	美国证券交易所	美国	350.00	2,056,641.25	0.74
33	Palo Alto Networks, Inc.	Palo Alto Networks, Inc.	PANW	美国证券交易所	美国	841.00	2,031,903.49	0.73
34	Automatic Data Processing, Inc.	自动数据处理公司	ADP	美国证券交易所	美国	1,063.00	1,808,264.93	0.65
35	ASML Holding NV	阿斯麦公司	ASML	美国证券交易所	美国	236.00	1,720,154.95	0.62
36	Synopsys, Inc.	新思科技公司	SNPS	美国证券交易所	美国	398.00	1,687,867.70	0.61
37	PDD Holdings Inc.	拼多多	PDD	美国证券交易所	美国	1,734.00	1,642,978.98	0.59
38	CrowdStrike Holdings, Inc.	CrowdStrike Holdings, Inc.	CRWD	美国证券交易所	美国	599.00	1,635,820.18	0.59
39	Starbucks Corporation	星巴克	SBUX	美国证券交易所	美国	2,941.00	1,631,729.68	0.59
40	Mondelez International, Inc.	亿滋国际有限公司	MDLZ	美国证券交易所	美国	3,483.00	1,624,393.85	0.58
41	Gilead Sciences, Inc.	吉利德科学公司	GILD	美国证券交易所	美国	3,235.00	1,581,817.13	0.57
42	Cadence Design Systems, Inc.	铿腾电子公司	CDNS	美国证券交易所	美国	707.00	1,550,643.80	0.56
43	Mercadolibre, Inc.	Mercadolibre, Inc.	MELI	美国证券交易所	美国	132.00	1,546,008.17	0.56
44	Cintas Corporation	信达思公司	CTAS	美国证券交易所	美国	263.00	1,312,531.21	0.47
45	Marriott International, Inc.	万豪国际	MAR	美国证券交易所	美国	742.00	1,278,500.46	0.46
46	Nxp Semiconductors N.V.	恩智浦半导体公司	NXPI	美国证券交易所	美国	664.00	1,273,386.41	0.46
47	Airbnb, Inc.	爱彼迎	ABNB	美国证券交易所	美国	1,146.00	1,238,409.64	0.45
48	CSX	CSX 运输公司	CSX	美国证券交	美国	5,076.00	1,210,075.05	0.44

	Corporation			易所				
49	Constellation Energy Corp	Constellation Energy Corp	CEG	美国证券交易所	美国	818.00	1,167,518.51	0.42
50	O'Reilly Automotive, Inc.	奥莱利汽车股份有限公司	ORLY	美国证券交易所	美国	153.00	1,151,528.25	0.41
51	Paypal Holdings, Inc.	Paypal Holdings, Inc.	PYPL	美国证券交易所	美国	2,716.00	1,123,251.24	0.40
52	Marvell Technology, Inc.	Marvell Technology, Inc.	MRVL	美国证券交易所	美国	2,247.00	1,119,372.98	0.40
53	Roper Technologies, Inc.	儒博科技公司	ROP	美国证券交易所	美国	278.00	1,116,751.60	0.40
54	Paccar Inc	帕卡公司	PCAR	美国证券交易所	美国	1,361.00	998,474.23	0.36
55	Autodesk, Inc.	欧特克有限公司	ADSK	美国证券交易所	美国	559.00	985,811.40	0.35
56	Copart, Inc.	科帕特公司	CPRT	美国证券交易所	美国	2,498.00	964,196.75	0.35
57	Monster Beverage Corporation	怪物饮料公司	MNST	美国证券交易所	美国	2,705.00	962,935.80	0.35
58	Microchip Technology Incorporated	微芯科技公司	MCHP	美国证券交易所	美国	1,394.00	909,030.47	0.33
59	Ross Stores, Inc.	罗斯百货公司	ROST	美国证券交易所	美国	871.00	902,065.59	0.32
60	Workday, Inc.	Workday, Inc.	WDAY	美国证券交易所	美国	550.00	876,297.07	0.32
61	American Electric Power Company, Inc.	美国电力公司	AEP	美国证券交易所	美国	1,369.00	856,043.14	0.31
62	Fortinet, Inc.	飞塔公司	FTNT	美国证券交易所	美国	1,983.00	851,762.42	0.31
63	Moderna, Inc.	Moderna, Inc.	MRNA	美国证券交易所	美国	995.00	842,075.96	0.30
64	AstraZeneca PLC	阿斯利康制药公司	AZN	美国证券交易所	美国	1,512.00	840,398.53	0.30
65	Keurig Dr Pepper Inc.	Keurig Dr Pepper Inc.	KDP	美国证券交易所	美国	3,520.00	837,883.62	0.30

66	Dexcom, Inc.	德康医疗公司	DXCM	美国证券交易所	美国	1,033.00	834,701.79	0.30
67	The Trade Desk, Inc.	The Trade Desk, Inc.	TTD	美国证券交易所	美国	1,156.00	804,662.19	0.29
68	Charter Communications, Inc.	特许通讯公司	CHTR	美国证券交易所	美国	374.00	796,854.92	0.29
69	Paychex, Inc.	沛齐公司	PAYX	美国证券交易所	美国	935.00	790,031.44	0.28
70	DoorDash, Inc.	DoorDash, Inc.	DASH	美国证券交易所	美国	991.00	768,276.02	0.28
71	IDEXX Laboratories, Inc.	IDEXX 实验室公司	IDXX	美国证券交易所	美国	214.00	743,045.87	0.27
72	Datadog, Inc.	Datadog, Inc.	DDOG	美国证券交易所	美国	801.00	740,344.03	0.27
73	The Kraft Heinz Company	卡夫亨氏公司	KHC	美国证券交易所	美国	3,153.00	724,009.19	0.26
74	Verisk Analytics, Inc.	Verisk Analytics, Inc.	VRSK	美国证券交易所	美国	370.00	710,780.71	0.26
75	Old Dominion Freight Line, Inc.	统领货运线公司	ODFL	美国证券交易所	美国	564.00	709,846.38	0.26
76	Electronic Arts Inc.	艺电公司	EA	美国证券交易所	美国	692.00	687,140.11	0.25
77	Lululemon Athletica Inc.	露露乐蒙公司	LULU	美国证券交易所	美国	314.00	668,435.40	0.24
78	Fastenal Company	快扣	FAST	美国证券交易所	美国	1,487.00	665,950.14	0.24
79	Diamondback Energy, Inc.	DIAMONDBACK 能源公司	FANG	美国证券交易所	美国	463.00	660,568.62	0.24
80	GE Healthcare Technologies Inc.	GE Healthcare Technologies Inc.	GEHC	美国证券交易所	美国	1,185.00	658,054.50	0.24
81	Baker Hughes Company	贝克休斯公司	BKR	美国证券交易所	美国	2,591.00	649,433.00	0.23
82	Exelon Corporation	爱克斯龙电力公司	EXC	美国证券交易所	美国	2,596.00	640,325.59	0.23
83	Cognizant Technology Solutions	高知特科技公司	CTSH	美国证券交易所	美国	1,291.00	625,647.52	0.23

	Corporation							
84	Biogen Inc.	生物基因公司	BIIB	美国证券交易 所	美国	378.00	624,506.95	0.22
85	COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	可口可乐欧洲合 伙公司	CCEP	美国证券交易 所	美国	1,192.00	619,041.26	0.22
86	Costar Group, Inc.	科斯塔集团	CSGP	美国证券交易 所	美国	1,061.00	560,612.19	0.20
87	CDW Corporation	CDW Corporation	CDW	美国证券交易 所	美国	349.00	556,746.76	0.20
88	Xcel Energy Inc.	埃克西尔能源公 司	XEL	美国证券交易 所	美国	1,443.00	549,266.97	0.20
89	ON Semiconductor Corporation	安森美半导体	ON	美国证券交易 所	美国	1,117.00	545,701.57	0.20
90	Zscaler, Inc.	Zscaler, Inc.	ZS	美国证券交易 所	美国	389.00	532,813.18	0.19
91	Atlassian Corporation	Atlassian Corporation	TEAM	美国证券交易 所	美国	414.00	521,883.59	0.19
92	Ansys, Inc.	安西斯公司	ANSS	美国证券交易 所	美国	227.00	520,117.43	0.19
93	Globalfoundr ies Inc.	格芯股份有限公 司	GFS	美国证券交易 所	美国	1,432.00	515,994.00	0.19
94	Take-Two Interactive Software, Inc.	TAKE-TWO 互动软 件公司	TTWO	美国证券交易 所	美国	445.00	493,125.03	0.18
95	Dollar Tree, Inc.	美元树	DLTR	美国证券交易 所	美国	566.00	430,685.49	0.15
96	Arm Holdings Limited	Arm Holdings Limited	ARM	美国证券交易 所	美国	307.00	357,988.71	0.13
97	Mongodb, Inc.	Mongodb, Inc.	MDB	美国证券交易 所	美国	190.00	338,468.84	0.12
98	Warner Bros. Discovery, Inc.	Warner Bros. Discovery, Inc.	WBD	美国证券交易 所	美国	6,362.00	337,334.82	0.12
99	Illumina, Inc.	Illumina, Inc.	ILMN	美国证券交易 所	美国	414.00	307,972.69	0.11
100	Walgreens Boots Alliance, Inc.	沃尔格林联合博 姿集团	WBA	美国证券交易 所	美国	2,240.00	193,084.97	0.07
101	Grail, Inc.	Grail, Inc.	GRAL	美国证券交	美国	59.00	6,462.80	0.00

				易所				
--	--	--	--	----	--	--	--	--

## 7.5 报告期内权益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	Microsoft Corporation	MSFT US	51,216,518.87	112.81
2	Apple Inc.	AAPL US	50,810,960.21	111.91
3	Alphabet Inc.	GOOGL US	15,280,135.26	33.66
		GOOG US	14,876,486.38	32.77
4	NVIDIA Corporation	NVDA US	28,440,796.15	62.64
5	Amazon.Com, Inc.	AMZN US	28,261,133.46	62.25
6	Broadcom Inc.	AVGO US	25,833,153.00	56.90
7	Meta Platforms, Inc.	META US	24,159,395.73	53.21
8	Tesla, Inc.	TSLA US	15,607,473.93	34.38
9	Costco Wholesale Corporation	COST US	13,623,288.85	30.01
10	Advanced Micro Devices, Inc.	AMD US	12,312,003.13	27.12
11	Adobe Inc.	ADBE US	11,950,618.64	26.32
12	Netflix, Inc.	NFLX US	10,818,131.99	23.83
13	Pepsico, Inc.	PEP US	10,014,939.11	22.06
14	Cisco Systems, Inc.	CSCO US	9,054,669.99	19.94
15	Linde PLC	LIN US	8,439,448.57	18.59
16	Intel Corporation	INTC US	8,283,429.37	18.24
17	T-Mobile US, Inc.	TMUS US	8,240,316.14	18.15
18	Intuit Inc.	INTU US	7,807,543.48	17.20
19	Comcast Corporation	CMCSA US	7,730,044.71	17.03
20	Qualcomm Incorporated	QCOM US	7,688,797.95	16.94
21	Amgen Inc.	AMGN US	7,227,241.06	15.92
22	Texas Instruments Incorporated	TXN US	6,735,788.87	14.84
23	Applied Materials, Inc.	AMAT US	6,467,469.69	14.25
24	Intuitive Surgical, Inc.	ISRG US	5,866,477.98	12.92

25	Honeywell International Inc.	HON US	5,826,941.09	12.83
26	Booking Holdings Inc.	BKNG US	5,371,440.69	11.83
27	Lam Research Corporation	LRCX US	4,997,232.35	11.01
28	Vertex Pharmaceuticals Incorporated	VRTX US	4,891,714.70	10.77
29	Palo Alto Networks, Inc.	PANW US	4,673,330.26	10.29
30	Starbucks Corporation	SBUX US	4,516,192.88	9.95
31	Micron Technology, Inc.	MU US	4,512,106.60	9.94
32	Regeneron Pharmaceuticals, Inc.	REGN US	4,491,159.30	9.89
33	Mondelez International, Inc.	MDLZ US	4,362,487.98	9.61
34	Analog Devices, Inc.	ADI US	4,328,363.53	9.53
35	Automatic Data Processing, Inc.	ADP US	4,277,496.22	9.42
36	Gilead Sciences, Inc.	GILD US	4,246,906.72	9.35
37	PDD Holdings Inc.	PDD US	4,083,816.98	8.99
38	Mercadolibre, Inc.	MELI US	3,818,400.41	8.41
39	KLA Corporation	KLAC US	3,806,050.31	8.38
40	Synopsys, Inc.	SNPS US	3,619,422.98	7.97
41	Cadence Design Systems, Inc.	CDNS US	3,501,221.78	7.71
42	ASML Holding NV	ASML US	3,445,438.67	7.59
43	Marriott International, Inc.	MAR US	3,062,327.52	6.75
44	CrowdStrike Holdings, Inc.	CRWD US	3,048,885.30	6.72
45	CSX Corporation	CSX US	3,002,784.98	6.61
46	Paypal Holdings, Inc.	PYPL US	2,872,058.71	6.33
47	Airbnb, Inc.	ABNB US	2,769,436.70	6.10

48	Cintas Corporation	CTAS US	2,713,356.58	5.98
49	O'Reilly Automotive, Inc.	ORLY US	2,638,263.37	5.81
50	Marvell Technology, Inc.	MRVL US	2,632,274.23	5.80
51	Workday, Inc.	WDAY US	2,601,395.18	5.73
52	Roper Technologies, Inc.	ROP US	2,570,161.25	5.66
53	Nxp Semiconductors N.V.	NXPI US	2,517,505.71	5.54
54	Monster Beverage Corporation	MNST US	2,479,645.39	5.46
55	Lululemon Athletica Inc.	LULU US	2,410,759.93	5.31
56	Autodesk, Inc.	ADSK US	2,353,832.10	5.18
57	Charter Communications, Inc.	CHTR US	2,327,574.79	5.13
58	Paccar Inc	PCAR US	2,324,065.52	5.12
59	Old Dominion Freight Line, Inc.	ODFL US	2,192,476.27	4.83
60	Fortinet, Inc.	FTNT US	2,175,305.78	4.79
61	Dexcom, Inc.	DXCM US	2,109,250.49	4.65
62	Microchip Technology Incorporated	MCHP US	2,092,273.82	4.61
63	Ross Stores, Inc.	ROST US	2,080,179.38	4.58
64	Copart, Inc.	CPRT US	2,064,008.99	4.55
65	The Kraft Heinz Company	KHC US	1,955,907.34	4.31
66	Keurig Dr Pepper Inc.	KDP US	1,918,756.21	4.23
67	Paychex, Inc.	PAYX US	1,910,924.96	4.21
68	IDEXX Laboratories, Inc.	IDXX US	1,881,665.20	4.14
69	American Electric Power Company, Inc.	AEP US	1,812,544.23	3.99
70	Constellation Energy Corp	CEG US	1,802,215.86	3.97
71	DoorDash, Inc.	DASH US	1,756,510.15	3.87
72	Moderna, Inc.	MRNA US	1,745,218.04	3.84

73	AstraZeneca PLC	AZN US	1,730,191.10	3.81
74	Fastenal Company	FAST US	1,703,709.51	3.75
75	Cognizant Technology Solutions Corporation	CTSH US	1,668,088.12	3.67
76	Datadog, Inc.	DDOG US	1,642,274.00	3.62
77	Electronic Arts Inc.	EA US	1,622,226.54	3.57
78	Atlassian Corporation	TEAM US	1,608,707.09	3.54
79	Verisk Analytics, Inc.	VRSK US	1,554,896.05	3.42
80	Biogen Inc.	BIIB US	1,540,060.96	3.39
81	Zscaler, Inc.	ZS US	1,509,752.02	3.33
82	Exelon Corporation	EXC US	1,509,663.59	3.33
83	Costar Group, Inc.	CSGP US	1,482,520.64	3.27
84	GE Healthcare Technologies Inc.	GEHC US	1,464,867.38	3.23
85	The Trade Desk, Inc.	TTD US	1,410,503.50	3.11
86	Xcel Energy Inc.	XEL US	1,406,816.14	3.10
87	COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	CCEP US	1,375,039.42	3.03
88	Globalfoundries Inc.	GFS US	1,374,155.49	3.03
89	ON Semiconductor Corporation	ON US	1,371,216.25	3.02
90	Baker Hughes Company	BKR US	1,339,408.70	2.95
91	CDW Corporation	CDW US	1,335,052.01	2.94
92	Ansys, Inc.	ANSS US	1,271,469.17	2.80
93	Diamondback Energy, Inc.	FANG US	1,248,423.44	2.75
94	Dollar Tree, Inc.	DLTR US	1,227,684.54	2.70
95	Take-Two Interactive Software, Inc.	TTWO US	1,226,585.47	2.70
96	Mongodb, Inc.	MDB US	1,214,445.94	2.67
97	Warner Bros. Discovery, Inc.	WBD US	1,075,399.66	2.37

98	Splunk Inc.	SPLK US	998,294.20	2.20
99	Illumina, Inc.	ILMN US	955,667.07	2.10

### 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	Microsoft Corporation	MSFT US	34,138,878.44	75.19
2	Apple Inc.	AAPL US	30,664,081.78	67.54
3	NVIDIA Corporation	NVDA US	23,543,301.30	51.86
4	Amazon.Com, Inc.	AMZN US	20,522,577.70	45.20
5	Alphabet Inc.	GOOGL US	10,154,783.17	22.37
		GOOG US	9,927,934.79	21.87
6	Meta Platforms, Inc.	META US	18,976,258.34	41.80
7	Broadcom Inc.	AVGO US	17,536,797.87	38.63
8	Tesla, Inc.	TSLA US	9,396,152.64	20.70
9	Costco Wholesale Corporation	COST US	9,384,170.90	20.67
10	Advanced Micro Devices, Inc.	AMD US	7,905,874.62	17.41
11	Netflix, Inc.	NFLX US	7,595,537.37	16.73
12	Pepsico, Inc.	PEP US	6,793,181.21	14.96
13	Adobe Inc.	ADBE US	6,713,961.93	14.79
14	Cisco Systems, Inc.	CSCO US	5,685,213.03	12.52
15	Qualcomm Incorporated	QCOM US	5,423,563.71	11.95
16	T-Mobile US, Inc.	TMUS US	5,331,022.71	11.74
17	Intuit Inc.	INTU US	5,116,013.62	11.27
18	Applied Materials, Inc.	AMAT US	4,862,965.06	10.71
19	Comcast Corporation	CMCSA US	4,763,219.31	10.49
20	Intel Corporation	INTC US	4,596,933.45	10.13
21	Texas Instruments Incorporated	TXN US	4,526,390.88	9.97
22	Amgen Inc.	AMGN US	4,381,532.00	9.65
23	Linde PLC	LIN US	4,156,139.71	9.15
24	Intuitive Surgical, Inc.	ISRG US	3,891,042.59	8.57
25	Honeywell International Inc.	HON US	3,764,940.01	8.29
26	Booking Holdings Inc.	BKNG US	3,602,670.37	7.94
27	Lam Research Corporation	LRCX US	3,517,773.57	7.75

28	Micron Technology, Inc.	MU US	3,464,860.84	7.63
29	Vertex Pharmaceuticals Incorporated	VRTX US	3,057,958.22	6.74
30	Regeneron Pharmaceuticals, Inc.	REGN US	2,912,353.75	6.41
31	Automatic Data Processing, Inc.	ADP US	2,905,497.49	6.40
32	Starbucks Corporation	SBUX US	2,830,680.37	6.23
33	Analog Devices, Inc.	ADI US	2,820,675.95	6.21
34	Mondelez International, Inc.	MDLZ US	2,776,764.02	6.12
35	KLA Corporation	KLAC US	2,694,406.13	5.93
36	Palo Alto Networks, Inc.	PANW US	2,648,375.33	5.83
37	Gilead Sciences, Inc.	GILD US	2,513,179.43	5.54
38	PDD Holdings Inc.	PDD US	2,434,257.37	5.36
39	Synopsys, Inc.	SNPS US	2,434,133.95	5.36
40	ASML Holding NV	ASML US	2,392,437.21	5.27
41	Cadence Design Systems, Inc.	CDNS US	2,323,985.43	5.12
42	Mercadolibre, Inc.	MELI US	2,253,490.33	4.96
43	Marriott International, Inc.	MAR US	2,078,553.17	4.58
44	CrowdStrike Holdings, Inc.	CRWD US	2,062,933.30	4.54
45	CSX Corporation	CSX US	2,038,462.99	4.49
46	Paypal Holdings, Inc.	PYPL US	1,970,547.79	4.34
47	Airbnb, Inc.	ABNB US	1,963,054.89	4.32
48	Cintas Corporation	CTAS US	1,921,164.29	4.23
49	Nxp Semiconductors N.V.	NXPI US	1,818,467.05	4.01
50	O'Reilly Automotive, Inc.	ORLY US	1,810,405.45	3.99
51	Marvell Technology, Inc.	MRVL US	1,718,159.87	3.78
52	Paccar Inc	PCAR US	1,695,788.38	3.74
53	Monster Beverage Corporation	MNST US	1,680,461.11	3.70
54	Constellation Energy Corp	CEG US	1,667,421.03	3.67

55	Roper Technologies, Inc.	ROP US	1,653,087.36	3.64
56	Old Dominion Freight Line, Inc.	ODFL US	1,627,508.83	3.58
57	Workday, Inc.	WDAY US	1,594,714.75	3.51
58	Copart, Inc.	CPRT US	1,506,588.23	3.32
59	Autodesk, Inc.	ADSK US	1,464,001.67	3.22
60	Dexcom, Inc.	DXCM US	1,449,501.94	3.19
61	Fortinet, Inc.	FTNT US	1,446,672.26	3.19
62	Microchip Technology Incorporated	MCHP US	1,384,321.28	3.05
63	Lululemon Athletica Inc.	LULU US	1,379,990.96	3.04
64	Ross Stores, Inc.	ROST US	1,362,401.93	3.00
65	DoorDash, Inc.	DASH US	1,325,021.19	2.92
66	The Kraft Heinz Company	KHC US	1,282,242.76	2.82
67	American Electric Power Company, Inc.	AEP US	1,280,297.90	2.82
68	Keurig Dr Pepper Inc.	KDP US	1,265,003.14	2.79
69	Paychex, Inc.	PAYX US	1,261,312.62	2.78
70	IDEXX Laboratories, Inc.	IDXX US	1,243,598.29	2.74
71	Charter Communications, Inc.	CHTR US	1,209,242.36	2.66
72	Moderna, Inc.	MRNA US	1,201,073.83	2.65
73	AstraZeneca PLC	AZN US	1,171,485.21	2.58
74	Fastenal Company	FAST US	1,167,568.27	2.57
75	GE Healthcare Technologies Inc.	GEHC US	1,120,379.47	2.47
76	Splunk Inc.	SPLK US	1,112,646.44	2.45
77	The Trade Desk, Inc.	TTD US	1,071,638.90	2.36
78	Datadog, Inc.	DDOG US	1,066,448.29	2.35
79	Exelon Corporation	EXC US	1,050,240.93	2.31
80	Costar Group, Inc.	CSGP US	1,049,568.92	2.31
81	Cognizant Technology Solutions Corporation	CTSH US	1,037,191.59	2.28
82	Electronic Arts Inc.	EA US	1,019,034.25	2.24
83	Diamondback Energy, Inc.	FANG US	993,107.24	2.19
84	Verisk Analytics, Inc.	VRSK US	991,522.38	2.18

85	Baker Hughes Company	BKR US	929,766.71	2.05
86	COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	CCEP US	925,399.15	2.04
87	CDW Corporation	CDW US	921,197.62	2.03

### 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	585,177,598.03
卖出收入（成交）总额	390,843,159.85

### 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

注：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

注：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

注：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

注：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

注：本基金本报告期末未持有基金。

### 7.11 投资组合报告附注

#### 7.11.1 申明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

报告期内本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内受到公开谴责、处罚的情形。

#### 7.11.2 申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

#### 7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	—
2	应收清算款	147,982.34
3	应收股利	30,154.42
4	应收利息	—
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	75,409.68
8	其他	—
9	合计	253,546.44

#### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：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

注：本基金本报告期末前十名股票中未持有流通受限的股票。

#### 7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

## § 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(%)
4,296	48,340.55	46,209,988.00	22.25	161,461,012.00	77.75

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例(%)
1	BARCLAYS BANK PLC	16,154,100.00	7.78
2	吉烈钧	11,000,000.00	5.30
3	杨恩泉	8,547,800.00	4.12
4	周明尧	6,000,000.00	2.89
5	广发证券股份有限公司	5,628,547.00	2.71
6	戴安琪	5,000,000.00	2.41
7	上海森锦投资管理有限公司—森锦2号私募证券投资基金	3,910,300.00	1.88
8	章平	3,582,700.00	1.73
9	上海森锦投资管理有限公司—森锦1号私募证券投资基金	3,188,800.00	1.54
10	何燕	3,000,000.00	1.44

### 8.3 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(%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	—	—

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2023年10月25日)基金份额总额	237,671,000.00
报告期期初基金份额总额	39,671,000.00
本报告期基金总申购份额	542,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	374,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	207,671,000.00

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金没有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

本报告期内本基金基金管理人无重大人事变动。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。

### 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

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	富国基金管理有限公司
受到稽查或处罚等措施的时间	2024-02-02
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会上海监管局
受到的具体措施类型	责令改正
受到稽查或处罚等措施的原因	个别规定及制度未严格执行。
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司已完成整改。
其他	—
措施 2	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	督察长
受到稽查或处罚等措施的时间	2024-02-02
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会上海监管局
受到的具体措施类型	出具警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	个别规定及制度未严格执行。
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司已完成整改。
其他	—

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，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。

## 10.7 本期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 (%)	
ABCI Securities Company Limited	0	—	—	—	—	—
Admiralty Harbour Capital Limited	0	—	—	—	—	—
Australia and New Zealand Banking Group Limited	0	—	—	—	—	—
BANK OF CHINA (HONG KONG) LIMITED	0	—	—	—	—	—
BNP PARIBAS Corporate & Institution Banking	0	—	—	—	—	—
BOCI Securities Limited	0	—	—	—	—	—
BOCOM International Holdings Company Limited	0	—	—	—	—	—
Bank of America - Merrill Lynch International	0	936,130,908.33	95.91	60,474.51	96.78	—
Bank of China HK Branch	0	—	—	—	—	—
Bank of Montreal	0	—	—	—	—	—
Barclays Bank	0	—	—	—	—	—

CCB International Securities Limited	0	—	—	—	—	—
CEB International Capital Corporation Limited	0	—	—	—	—	—
CGS-CIMB Securities (HK) Ltd	0	—	—	—	—	—
CLSA	0	—	—	—	—	—
CMB International Global Markets Limited	0	—	—	—	—	—
CMB Wing Lung Bank Ltd.	0	—	—	—	—	—
CMBC Securities Company Limited	0	—	—	—	—	—
CNCB (Hong Kong) Capital Limited	0	—	—	—	—	—
CREDIT SUISSE (HK) LIMITED	0	—	—	—	—	—
Cathay Securities ((HK) Limited	0	—	—	—	—	—
Central Wealth Securities Investment Limited	0	—	—	—	—	—
China CITIC Bank International Limited	0	—	—	—	—	—
China Galaxy International Financial Holdings Limited	0	—	—	—	—	—

China Industrial Securities International Brokerage Limited	0	—	—	—	—	—
China International Capital Corporation HK Securities Ltd	0	—	—	—	—	—
China Merchants Securities (HK) Co., Limited	0	—	—	—	—	—
China Renaissance Securities (HK) Limited	0	—	—	—	—	—
China Securities (International) Brokerage Company Limited	0	—	—	—	—	—
Citadel Securities (Hong Kong) Limited	0	—	—	—	—	—
Citibank, N. A.	0	—	—	—	—	—
Credit Agricole Corporate and Investment Bank	0	—	—	—	—	—
DBS Bank Ltd., Hong Kong Branch	0	—	—	—	—	—
DBS Vickers (Hong Kong) Ltd	0	—	—	—	—	—
Daiwa Capital Markets (HK) Limited	0	—	—	—	—	—
Deutsche Bank AG, London	0	—	—	—	—	—

Essence International Securities (HK) Limited	0	—	—	—	—	—
Everbright Securities Investment Services (HK) Limited	0	—	—	—	—	—
First Shanghai Investments Limited	0	—	—	—	—	—
GF Securities Co., Ltd.	0	—	—	—	—	—
Goldman Sachs	0	39,889,849.55	4.09	2,010.71	3.22	—
Goldman Sachs Gao Hua Securities Company Limited	0	—	—	—	—	—
Guosen Securities (HK) Financial Holdings Co., Ltd	0	—	—	—	—	—
Guotai Junan Securities (HK) Limited	0	—	—	—	—	—
Haitong Bank, S. A.	0	—	—	—	—	—
Haitong International Securities Company Limited	0	—	—	—	—	—
Huatai Financial Holdings (HK) Limited	0	—	—	—	—	—
ICBC International Securities Limited	0	—	—	—	—	—
Instinet Pacific Ltd.	0	—	—	—	—	—

JPMorgan Chase Bank, National Association	0	—	—	—	—	—
Jefferies International Limited	0	—	—	—	—	—
Macquarie Group Limited	0	—	—	—	—	—
Mirae Asset Securities (HK) Limited	0	—	—	—	—	—
Mizuho Securities International	0	—	—	—	—	—
Morgan Stanley & Co. International PLC	0	—	—	—	—	—
NatWest Markets Plc	0	—	—	—	—	—
Nomura Singapore Limited	0	—	—	—	—	—
Orient Securities (HK) Limited	0	—	—	—	—	—
Royal Bank of Canada	0	—	—	—	—	—
SPDB International Holdings Limited	0	—	—	—	—	—
Sanford C. Bernstein (Hong Kong) Limited	0	—	—	—	—	—
Shenwan Hongyuan Securities (H. K.) Limited	0	—	—	—	—	—

Societe Generale Corporate & Investment Banking	0	—	—	—	—	—
Soochow Securities (Hong Kong) Financial Holdings Limited	0	—	—	—	—	—
Standard Chartered Bank	0	—	—	—	—	—
The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited	0	—	—	—	—	—
Toronto-Dominion Bank	0	—	—	—	—	—
UBS Securities Asia Limited	0	—	—	—	—	—
UOB Kay Hian (HK) Limited	0	—	—	—	—	—
Valuable Capital Limited	0	—	—	—	—	—
Zhongtai International Financial Products Limited	0	—	—	—	—	—
Zurcher Kantonalbank	0	—	—	—	—	—
长城证券	1	—	—	—	—	—
德邦证券	1	—	—	—	—	—
东方证券	2	—	—	—	—	—
国金证券	2	—	—	—	—	—
国盛证券	2	—	—	—	—	—
国泰君安	1	—	—	—	—	—
华创证券	1	—	—	—	—	—
华泰证券	2	—	—	—	—	—

民生证券	1	—	—	—	—	—
申万宏源	1	—	—	—	—	—
信达证券	2	—	—	—	—	—
野村证券	1	—	—	—	—	—
招商证券	2	—	—	—	—	—
中金财富	1	—	—	—	—	—
中金公司	1	—	—	—	—	—
中信建投	2	—	—	—	—	—
中信山东	1	—	—	—	—	—
中信证券	3	—	—	—	—	—
中银证券	1	—	—	—	—	—

注：我对基金交易单元的选择是综合考虑券商的研究能力及其它相关因素后决定的。

#### 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		债券回购交易		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	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	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 (%)
ABCI Securities Company Limited	—	—	—	—	—	—	—	—
Admiralty Harbour Capital Limited	—	—	—	—	—	—	—	—

Australia and New Zealand Banking Group Limited	—	—	—	—	—	—	—	—
BANK OF CHINA (HONG KONG) LIMITED	—	—	—	—	—	—	—	—
BNP PARIBAS Corporate & Institution Banking	—	—	—	—	—	—	—	—
BOCI Securities Limited	—	—	—	—	—	—	—	—
BOCOM International Holdings Company Limited	—	—	—	—	—	—	—	—

Bank of America Merrill Lynch International	—	—	—	—	—	—	—	—
Bank of China HK Branch	—	—	—	—	—	—	—	—
Bank of Montreal	—	—	—	—	—	—	—	—
Barclays Bank	—	—	—	—	—	—	—	—
CCB International Securities Limited	—	—	—	—	—	—	—	—
CEB International Capital Corporation Limited	—	—	—	—	—	—	—	—

CGS-CIMB Securities (HK) Ltd	—	—	—	—	—	—	—	—
CLSA	—	—	—	—	—	—	—	—
CMB International Global Markets Limited	—	—	—	—	—	—	—	—
CMB Wing Lung Bank Ltd.	—	—	—	—	—	—	—	—
CMBC Securities Company Limited	—	—	—	—	—	—	—	—
CNCB (Hong Kong) Capital Limited	—	—	—	—	—	—	—	—
CREDIT SUISSE (HK) LIMITED	—	—	—	—	—	—	—	—

Cathay Securities((HK) Limited	—	—	—	—	—	—	—	—
Central Wealth Securities Investment Limited	—	—	—	—	—	—	—	—
China CITIC Bank International Limited	—	—	—	—	—	—	—	—
China Galaxy International Financial Holdings Limited	—	—	—	—	—	—	—	—

China Industrial Securities International Brokerage Limited	—	—	—	—	—	—	—	—
China International Capital Corporation HK Securities Ltd	—	—	—	—	—	—	—	—
China Merchants Securities (HK) Co., Limited	—	—	—	—	—	—	—	—
China Renaissance Securities (HK) Limited	—	—	—	—	—	—	—	—

China Securities (International) Brokerage Company Limited	—	—	—	—	—	—	—	—
Citadel Securities (Hong Kong) Limited	—	—	—	—	—	—	—	—
Citibank, N.A.	—	—	—	—	—	—	—	—
Credit Agricole Corporate and Investment Bank	—	—	—	—	—	—	—	—
DBS Bank Ltd., Hong Kong Branch	—	—	—	—	—	—	—	—
DBS Vickers (Hong Kong) Ltd	—	—	—	—	—	—	—	—

Daiwa Capita l Market s (HK) Limite d	—	—	—	—	—	—	—	—
Deutsc he Bank AG, London	—	—	—	—	—	—	—	—
Essenc e Intern ationa l Securi ties (HK) Limite d	—	—	—	—	—	—	—	—
Everbr ight Securi ties Invest ment Servic es (HK) Limite d	—	—	—	—	—	—	—	—
First Shangh ai Invest ments Limite d	—	—	—	—	—	—	—	—

GF Securities Co., Ltd.	—	—	—	—	—	—	—	—
Goldman Sachs	—	—	—	—	—	—	—	—
Goldman Sachs Gao Hua Securities Company Limited	—	—	—	—	—	—	—	—
Guosen Securities (HK) Financial Holdings Co., Ltd	—	—	—	—	—	—	—	—
Guotai Junan Securities (HK) Limited	—	—	—	—	—	—	—	—
Haitong Bank, S.A.	—	—	—	—	—	—	—	—

Haitong International Securities Company Limited	—	—	—	—	—	—	—	—
Huatai Financial Holdings (HK) Limited	—	—	—	—	—	—	—	—
ICBC International Securities Limited	—	—	—	—	—	—	—	—
Instinet Pacific Ltd.	—	—	—	—	—	—	—	—
JPMorgan Chase Bank, National Association	—	—	—	—	—	—	—	—

Jefferies International Limited	—	—	—	—	—	—	—	—
Macquarie Group Limited	—	—	—	—	—	—	—	—
Mirae Asset Securities (HK) Limited	—	—	—	—	—	—	—	—
Mizuho Securities International	—	—	—	—	—	—	—	—
Morgan Stanley & Co. International PLC	—	—	—	—	—	—	—	—
NatWest Markets Plc	—	—	—	—	—	—	—	—
Nomura Singapore Limited	—	—	—	—	—	—	—	—

Orient Securities (HK) Limited	—	—	—	—	—	—	—	—
Royal Bank of Canada	—	—	—	—	—	—	—	—
SPDB International Holdings Limited	—	—	—	—	—	—	—	—
Sanford C. Bernstein (Hong Kong) Limited	—	—	—	—	—	—	—	—
Shenwan Hongyuan Securities (H.K.) Limited	—	—	—	—	—	—	—	—

Societe Generale Corporate & Investment Banking	—	—	—	—	—	—	—	—
Soochow Securities (Hong Kong) Financial Holdings Limited	—	—	—	—	—	—	—	—
Standard Chartered Bank	—	—	—	—	—	—	—	—
The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited	—	—	—	—	—	—	—	—
Toronto-Dominion Bank	—	—	—	—	—	—	—	—

UBS Securities Asia Limited	—	—	—	—	—	—	—	—
UOB Kay Hian (HK) Limited	—	—	—	—	—	—	—	—
Valuable Capital Limited	—	—	—	—	—	—	—	—
Zhongtai International Financial Products Limited	—	—	—	—	—	—	—	—
Zurcher Kanton albank	—	—	—	—	—	—	—	—
长城证券	—	—	—	—	—	—	—	—
德邦证券	—	—	—	—	—	—	—	—
东方证券	—	—	—	—	—	—	—	—
国金证券	—	—	—	—	—	—	—	—
国盛证券	—	—	—	—	—	—	—	—

国泰君安	—	—	—	—	—	—	—	—
华创证券	—	—	—	—	—	—	—	—
华泰证券	—	—	—	—	—	—	—	—
民生证券	—	—	—	—	—	—	—	—
申万宏源	—	—	—	—	—	—	—	—
信达证券	—	—	—	—	—	—	—	—
野村证券	—	—	—	—	—	—	—	—
招商证券	—	—	—	—	—	—	—	—
中金财富	—	—	—	—	—	—	—	—
中金公司	—	—	—	—	—	—	—	—
中信建投	—	—	—	—	—	—	—	—
中信山东	—	—	—	—	—	—	—	—
中信证券	—	—	—	—	—	—	—	—
中银证券	—	—	—	—	—	—	—	—

## 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	富国基金管理有限公司关于旗下部分基金 2024 年境外主要市场（美国）节假日暂停申购、赎回的公告	规定披露媒介	2024年01月02日
2	关于富国纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）交易价格波动提示公告	规定披露媒介	2024年01月23日
3	关于富国纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）交易价格波动提示公告	规定披露媒介	2024年01月23日
4	关于富国纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）交易价格波动提示及临时停牌公告	规定披露媒介	2024年01月24日
5	关于富国纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）交易价格波动提示及临时停牌公告	规定披露媒介	2024年01月25日
6	关于富国基金管理有限公司旗下部分上交所上市基金场内扩位简称变更的公告	规定披露媒介	2024年03月14日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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
机构	1	2024-01-01 至 2024-01-21; 2024-02-27 至 2024-05-21	19,005,000.00	141,485,900.00	144,336,800.00	16,154,100.00	7.78%
产品特有风险							
本基金于本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情形，本基金管理人已经采取措施，审慎确认大额申购与大额赎回，防控产品流动性风险并公平对待投资者。本基金管理人提请投资者注意因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、大额赎回风险以及净值波动风险等特有风险。							

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，经向上海证券交易所申请并获得同意，本基金管理人决定自 2024 年 3 月 14 日起将本基金的场内扩位简称由“纳斯达克指数 ETF”变更为“纳指 ETF 富国”。具体可参见基金管理人于 2024 年 3 月 14 日发布的《关于富国基金管理有限公司旗下部分上交所上市基金场内扩位简称变更的公告》。

## § 12 备查文件目录

备查文件名称	备查文件存放地点	备查文件查阅方式
1、中国证监会批准设立富国纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)的文件	中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层	投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人富国基金管理有限公司。咨询电话:95105686、4008880688(全国统一,免长途话费)公司网址: <a href="http://www.fullgoal.com.cn">http://www.fullgoal.com.cn</a> 。
2、富国纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金合同		
3、富国纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)托管协议		
4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件		
5、富国纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)财务报表及报表附注		
6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告		