

汇添富纳斯达克 100 交易型开放式指数证券 投资基金（QDII）2024 年中期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2024 年 08 月 30 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 28 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 2024 年 01 月 01 日起至 06 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	5
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	6
2.6 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的成员简介	13
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	14
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	16
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	18
6.3 净资产变动表	19
6.4 报表附注	21
§ 7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	47
7.3 期末按行业分类的权益投资组合	47
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	47
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动	69
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	71
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	71

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	71
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	71
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	71
7.11 投资组合报告附注	72
§ 8 基金份额持有人信息	72
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	72
8.2 期末上市基金前十名持有人	73
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	73
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情况	74
§ 9 开放式基金份额变动	74
§ 10 重大事件揭示	74
10.1 基金份额持有人大会决议	74
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	74
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	74
10.4 基金投资策略的改变	74
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	74
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	75
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	75
10.8 其他重大事件	78
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	80
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况	80
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	81
§ 12 备查文件目录	81
12.1 备查文件目录	81
12.2 存放地点	82
12.3 查阅方式	82

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)
基金简称	汇添富纳斯达克 100ETF
场内简称	纳指 100ETF
基金主代码	159660
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 03 月 30 日
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额 (份)	428,151,363.00
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2023 年 04 月 17 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的最小化。
投资策略	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化进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近标的指数的表现。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 4%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金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，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。本基金的投资策略主要包括：资产配置策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、金融衍生工具投资策略、参与境内融资投资策略、参与境内转融通证券出借业务策略、境内外存托凭证的投资策略。
业绩比较基准	经人民币汇率调整的纳斯达克 100 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金主要投资于境外证券市场，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，本基金还将面临汇率风险、境外证券市场风险等特殊投资风险。

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	汇添富基金管理股份有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏
	联系电话	021-28932888
	电子邮箱	service@99fund.com
客户服务电话	400-888-9918	021-60637228
传真	021-28932998	021-60635778
注册地址	上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 H686 室	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	上海市黄浦区外马路 728 号	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	200010	100033
法定代表人	李文	张金良

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目	境外资产托管人	
名称	中文	道富银行
	英文	State Street Bank and Trust Company
注册地址	One Lincoln Street, Boston, Massachusetts 02111, United States	
办公地址	One Lincoln Street, Boston, Massachusetts 02111, United States	
邮政编码	无	

注：本基金无境外投资顾问。

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.99fund.com
基金中期报告备置地点	上海市黄浦区外马路 728 号 汇添富基金管理股份有限公司

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 - 2024 年 06 月 30 日)
本期已实现收益	15,571,080.31
本期利润	68,053,257.93

加权平均基金份额本期利润	0.2150
本期加权平均净值利润率	15.19%
本期基金份额净值增长率	17.90%
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	71,571,136.37
期末可供分配基金份额利润	0.1672
期末基金资产净值	657,972,011.40
期末基金份额净值	1.5368
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	53.68%

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。

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（例如：基金的申购赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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。

3.2 基金净值表现

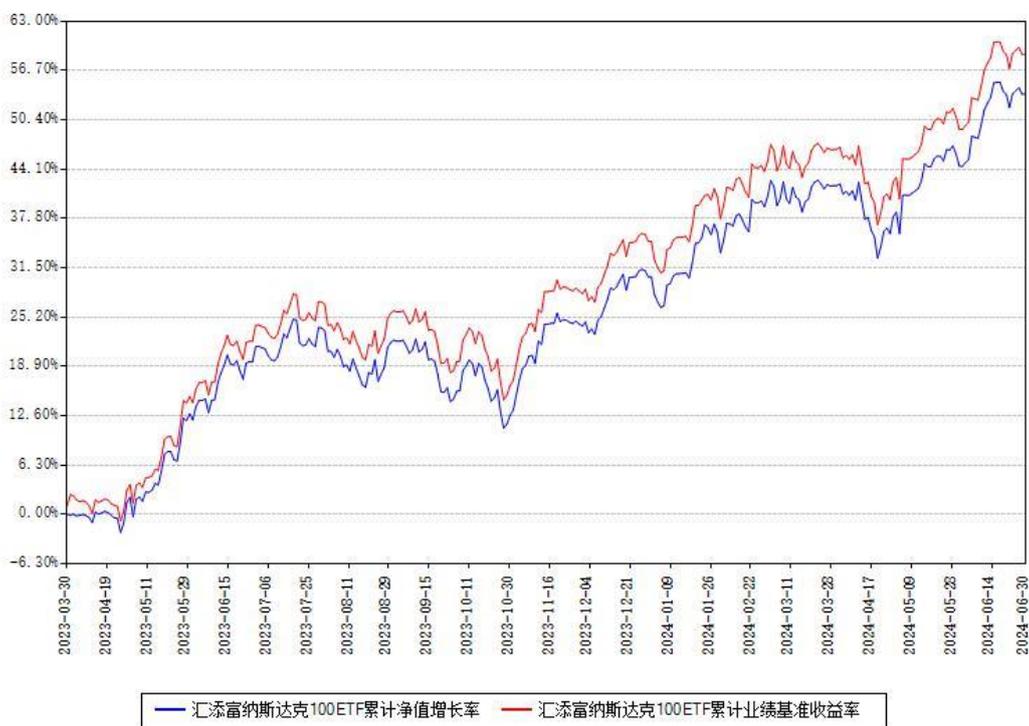
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	6.38%	0.76%	6.45%	0.77%	-0.07%	-0.01%
过去三个月	8.23%	0.99%	8.31%	0.99%	-0.08%	0.00%
过去六个月	17.90%	0.98%	17.71%	0.98%	0.19%	0.00%
过去一年	26.57%	0.98%	27.89%	0.98%	-1.32%	0.00%
自基金合同生效日起至今	53.68%	1.00%	58.78%	1.01%	-5.10%	-0.01%

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

汇添富纳斯达克100ETF累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2023年03月30日）起6个月，建仓期结束各项资产配置比例符合合同约定。

本基金各类份额自实际有资产之日起披露业绩数据。

§ 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

汇添富基金成立于2005年2月，是中国一流的综合性资产管理公司之一。公司总部设立于上海，在北京、上海、广州、成都、南京、深圳等地设有分公司，在香港、上海、美国及新加坡设有子公司——汇添富资产管理（香港）有限公司、汇添富资本管理有限公司、汇添富资产管理（美国）控股有限公司、汇添富资产管理（新加坡）有限公司、汇添富投资管理有限公司。公司及旗下子公司业务牌照齐全，拥有全国社保基金境内委托投资管理人、全国社保基金境外配售策略方案投资管理人、基本养老保险基金投资管理人、保险资金投资管理人、专户资产管理人、特定客户资产管理子公司、QDII 基金管理人、RQFII 基金管理人、QFII 基金管理人、基金投资顾问等业务资格。

汇添富基金现已形成公募业务、私募资管业务、私募股权业务、养老金业务、电商业务、国际业务、基金投顾业务等七大业务板块，被誉为“选股专家”，赢得广大基金持有人和海内外机构的认可和信赖。

成立以来，公司屡获殊荣，包括“金牛奖”“金基金奖”“明星基金奖”等多项权威荣誉奖项。汇添富始终坚持“客户第一”的价值观和“一切从长期出发”的经营理念，致力于打造中国最受认可的资产管理品牌。

2024 上半年，汇添富基金新成立 22 只公开募集证券投资基金，包括 12 只股票型基金、9 只债券型基金、1 只混合型基金。截至 2024 年 6 月 30 日，公司共管理 336 只公开募集证券投资基金，形成了覆盖高、中、低各类风险收益特征，较为完善、有效的产品线。

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（助理）期限		证券从业年限（年）	说明
		任职日期	离任日期		
过蓓蓓	本基金的基金经理, 指数与量化投资部副总监	2023 年 03 月 30 日	-	13	国籍: 中国。学历: 中国科学技术大学金融工程博士。从业资格: 证券投资基金从业资格。从业经历: 曾任国泰基金管理有限公司金融工程部助理分析师、量化投资部基金经理助理。2015 年 6 月加入汇添富基金管理股份有限公司, 现任指数与量化投资部副总监。2015 年 8 月 3 日至今任汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2015 年 8 月 3 日至 2023 年 4 月 13 日任中证金融地产交易型开放

					<p>式指数证券投资基金的基金经理。2015年8月3日至2023年4月6日任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2015年8月3日至今任中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2015年8月3日至今任中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2015年8月18日至2023年8月29日任汇添富深证300交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2015年8月18日至2023年5月22日任深证300交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2016年12月22日至今任汇添富中证生物科技主题指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2016年12月29日至2022年12月1日任汇添富中证中药指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2018年5月23日至今</p>
--	--	--	--	--	--

					<p>任汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2018年10月23日至2023年5月22日任中证银行交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019年3月26日至今任汇添富中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019年4月15日至2022年6月13日任中证银行交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019年10月8日至今任中证800交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021年2月1日至今任汇添富国证生物医药交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021年6月3日至今任汇添富中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021年9月29日至2023年5月18日任汇添富中证800交易型开放式指数证券投资</p>
--	--	--	--	--	---

				<p>基金联接基金的基金经理。2022 年 2 月 28 日至 2022 年 10 月 31 日任汇添富国证生物医药交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022 年 8 月 15 日至今任汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2022 年 9 月 26 日至今任汇添富中证中药交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 10 月 20 日至 2024 年 4 月 8 日任汇添富中证 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 12 月 2 日至今任汇添富中证中药交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）的基金经理。2023 年 3 月 14 日至今任汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）的基金经理。2023 年 3 月 30 日至今任汇添富纳斯达克 100 交易型开放式指</p>
--	--	--	--	--

					<p>数证券投资基金（QDII）的基金经理。2023 年 8 月 2 日至今任汇添富纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）的基金经理。2023 年 8 月 23 日至今任汇添富黄金及贵金属证券投资基金（LOF）的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	--

注:基金的首任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日,其“离任日期”为根据公司决议确定的解聘日期。

非首任基金经理,其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期。

证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注:截至本报告期末,本基金的基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的成员简介

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

本基金管理人在本报告期内遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定,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。本基金无重大违法、违规行为,本基金投资运作符合有关法规及基金合同的约定。

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

本基金管理人通过建立事前、事中和事后全程嵌入式的管控模式,保障公平交易制度的执行和实现。具体情况如下:

本基金管理人建立了内部公平交易管理规范 and 流程, 公平交易管控覆盖公司所有业务类型、投资策略、投资品种, 以及投资授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动相关的各个环节。

本着“时间优先、价格优先”的原则, 对同一证券有相同交易需求的投资组合采用交易系统内的公平交易模块, 实现事中交易执行层面的公平管控。

对不同投资组合进行同向交易价差分析, 具体方法为: 在不同时间窗口(日内、3 日内、5 日内)下, 对不同组合同一证券同向交易的平均价差率进行 T 检验。对于未通过 T 检验的交易, 再根据同向交易占优比、交易价格、交易频率、交易数量和交易时间等进行具体分析, 进一步判断是否存在重大利益输送的可能性。

对于反向交易, 根据交易顺序、交易时间窗口跨度、交易价格、交易数量等综合判断交易是否涉及利益输送。

综上, 本基金管理人通过事前的制度规范、事中的监控和事后的分析评估, 严格执行了公平交易制度, 公平对待旗下各投资组合。本报告期内, 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, 本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内, 本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价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% 的情况有 6 次, 投资组合因投资策略与其他组合发生反向交易。基金管理人事前严格根据内部规定进行管控, 事后对交易时点、交易数量、交易价差等多方面进行综合分析, 未发现导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

此外, 为防范基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的潜在利益冲突, 本基金管理人从投资指令、交易行为、交易监测等多方面, 对兼任组合进行监控管理和分析评估。本报告期内兼任组合未出现违反公平交易或异常交易的情况。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

美股主要股指继续上涨创出新高, 表现超出市场预期。科技股为主的纳斯达克 100(NDX) 上半年上涨 16.98%, 大盘股指数标普 500 (SPX) 上涨 14.48%, 周期制造业为主的道琼斯指数 (DJI) 微涨 3.79%, 医药指数纳斯达克生物科技 (NBI) 上涨 4.00%。市场整体体现大盘成长风格占优的状态。

虽然美股上行, 但是经济增速边际下行, 多项经济数据边际趋冷。从数据上看, 包括居民消费、ISM 制造业 PMI、以及 Q1 经济增长在内的多项宏观经济指标下修。通胀方面回落是

大方向，但通胀冷却幅度依然不够，核心通胀的最后一公里的主要阻力在于住房，租金上涨是美国通胀居高不下的关键因素，高通胀对超额储蓄的消耗加重，未来或将拖累消费和经济增长。Q2 核心 PCE 季环比折年仍在 3%附近，预计美联储仍将观望等待。

市场反复博弈美联储降息预期，但除了贵金属资产外，权益、债券、外汇等资产对降息预期的敏感度在下降。反而是美国以外其他经济体，如日本，受到较大影响，日元兑美元出现大幅贬值，致使日本政府花费巨大进行干预。欧洲央行降息开启全球主要经济体降息周期，也在一定程度上反映出高通胀对经济的压制到了临界点，需要货币政策的变换来应对。

作为被动投资的指数基金，本基金在投资运作上严格遵守基金合同，坚持既定的投资策略，积极采取有效方法控制基金相对业绩比较基准的跟踪误差，实现投资目标。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期基金份额净值增长率为 17.90%。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

当前，美股投资需要计入的风险是美国总统选举可能带来的对国内和国际经济政治格局的多重影响。从竞选纲领透露出的施政方向来看，共和党的关税和减税政策，以及制造业本土化，一方面可能会带来美国国内更多的通胀压力，财政和债务压力进一步上升，引发滞涨风险以及之后的深度衰退的风险。另一方面，全球产业链重塑的压力也将持续，新的关税壁垒将增加全球经济的不确定性，也将加速亚洲区域产业链重塑进程。

下半年，美股风格可能从大盘成长向价值风格切换，进行防御型投资，以减少各种不确定带来的投资波动。纳指 100 是偏大盘成长风格，下半年需要留意高位回调的风险。科技股的业绩报如果能够实现超预期，将在很大程度上减轻高位回调的风险。总的来说，投资纳斯达克 100 是对 A 股投资的补充，尤其是两个市场存在较低的相关性。不可否认，全球优秀的科技龙头大多在美股上市，从全球资产配置的角度来看，也有相应的价值。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值，并保持估值政策和程序的一贯性。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责构建估值决策体系、适时更新估值相关制度、指导并监督各类投资品种的估值程序。估值委员会由投资、研究、集中交易、合规稽核、风险管理、基金营运等部门中具有丰富从业经验和专业胜任能力的员工担任，且互相不存在直接的重大利益冲突。基金经理可参与估值委员会对于估值方法的讨论，但无最终决策

权，从而将其影响程度进行适当限制，保证基金估值的公平、合理。

基金日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由管理人完成估值后，经托管人复核无误后由管理人对外公布。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配采用现金分红；每一基金份额享有同等分配权；本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

本基金本报告期内未进行收益分配。

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

无。

§ 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

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，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 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：汇添富纳斯达克 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	附注号	本期末 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	45,985,119.10	31,967,512.05
结算备付金		2,933,683.20	10,649,067.27
存出保证金		1,040,690.97	2,758,003.38
交易性金融资产	6.4.7.2	637,606,818.01	177,137,267.90
其中：股票投资		637,606,818.01	177,137,267.90
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		74,445.13	141,660.37
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		687,640,756.41	222,653,510.97
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 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		-	-
应付清算款		29,250,605.47	4,495,150.36
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		220,717.57	81,556.21
应付托管费		66,215.28	24,466.85
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-

应交税费		46,671.33	51,142.92
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	84,535.36	120,000.00
负债合计		29,668,745.01	4,772,316.34
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	428,151,363.00	167,151,363.00
未分配利润	6.4.7.9	229,820,648.40	50,729,831.63
净资产合计		657,972,011.40	217,881,194.63
负债和净资产总计		687,640,756.41	222,653,510.97

注：1、报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.5368 元，基金份额总额 428,151,363.00 份。

2、本基金合同于 2023 年 03 月 30 日生效，上年度实际报告期间为 2023 年 03 月 30 日至 2023 年 12 月 31 日，特此说明。

6.2 利润表

会计主体：汇添富纳斯达克 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	附注号	本期 2024 年 01 月 01 日 至 2024 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 03 月 30 日 (基金合同生效日) 至 2023 年 06 月 30 日
一、营业总收入		69,604,940.78	20,078,346.34
1. 利息收入		200,707.49	117,294.32
其中：存款利息收入	6.4.7.10	200,707.49	117,294.32
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）		17,101,103.34	7,426,705.02
其中：股票投资收益	6.4.7.11	10,600,506.84	6,769,137.00
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	4,869,971.40	509,976.47
股利收益	6.4.7.17	1,630,625.10	147,591.55
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）	6.4.7.18	52,482,177.62	12,889,085.81
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-5,020,176.55	-388,240.04
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	4,841,128.88	33,501.23
减：二、营业总支出		1,551,682.85	267,780.33
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,113,996.42	172,740.63
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	334,198.97	51,822.17
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	6.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		17,538.04	1,838.07
8. 其他费用	6.4.7.21	85,949.42	41,379.46
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		68,053,257.93	19,810,566.01
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		68,053,257.93	19,810,566.01
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		68,053,257.93	19,810,566.01

6.3 净资产变动表

会计主体：汇添富纳斯达克 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	167,151,363.00	50,729,831.63	217,881,194.63
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	167,151,363.00	50,729,831.63	217,881,194.63
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	261,000,000.00	179,090,816.77	440,090,816.77
（一）、综合收益总额	-	68,053,257.93	68,053,257.93

(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)	261,000,000.00	111,037,558.84	372,037,558.84
其中:1.基金申购款	483,000,000.00	196,890,266.95	679,890,266.95
2.基金赎回款	-222,000,000.00	-85,852,708.11	-307,852,708.11
(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、本期期末净资产	428,151,363.00	229,820,648.40	657,972,011.40
项目	上年度可比期间 2023年03月30日(基金合同生效日)至2023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	-	-	-
加:会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	244,151,363.00	-	244,151,363.00
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-126,000,000.00	25,310,915.84	-100,689,084.16
(一)、综合收益总额	-	19,810,566.01	19,810,566.01
(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)	-126,000,000.00	5,500,349.83	-120,499,650.17
其中:1.基金申购款	132,000,000.00	16,297,952.95	148,297,952.95
2.基金赎回款	-258,000,000.00	-10,797,603.12	-268,797,603.12
(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、本期期末净资产	118,151,363.00	25,310,915.84	143,462,278.84
-----------	----------------	---------------	----------------

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：

<u>张暉</u>	<u>李骁</u>	<u>雷青松</u>
基金管理人负责人	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

汇添富纳斯达克 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[2022]1697 号文《关于准予汇添富纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）注册的批复》准予注册，由汇添富基金管理股份有限公司向社会公开募集。基金合同于 2023 年 3 月 30 日生效。首次设立基金募集规模为 244,151,363.00 份基金份额，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）出具安永华明（2023）验字第 60466941_B22 号验资报告予以验证。本基金为交易型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为汇添富基金管理股份有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司，境外托管人为道富银行。

本基金的标的指数为纳斯达克 100 指数及其未来可能发生的变更。本基金投资于标的指数的成份股、备选成份股。此外，本基金还可投资于以下金融产品或工具：针对境外投资，本基金可投资于银行存款、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；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；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（包括港股通标的股票）、优先股、全球存托凭证、房地产信托凭证；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；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；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以及法律法规或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。其中，对于非成份股、备选成份股的投资部分，本基金若投资于香港市场的，可通过合格境内机构投资者(QDII)境外投资额度或内地与香港股票市场交易互联互通机制进行投资。针对境内投资，本基金可投资于国内依法发行上市的股票、债券等金融工具，具体包括：股票（包含主板、创业板、其他依法上市的股票、存托凭证），衍生工具（股指期货、国债期货、股票期权等），债券（国债、金融债、企业（公司）债、次级债、可交换债券、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具等资产以及法律法规或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）。本基金将根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。本基金为对冲外币的汇率风险，可以投资于境外外汇远期合约、结构性外汇远期合约、外汇期权及外汇期权组合、外汇互换协议、与汇率挂钩的结构性投资产品等金融工具。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：本基金投资于股票的比例不低于基金资产的 80%；投资于标的指数成份股和备选成份股、跟踪同一标的指数的基金、期货期权等相关衍生工具的合约市值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。如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金的业绩比较基准为：经人民币汇率调整的纳斯达克 100 指数收益率。

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 06 月 30 日的财务状况以及 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日的经营成果和净值变动情况。

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

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，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品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，自 2018 年 1 月 1 日起，本基金的基金管理人运营本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。对本基金在 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，已纳税额从本基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

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事业费附加的单位外）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	45,985,119.10
等于：本金	45,968,196.12
加：应计利息	16,922.98
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	45,985,119.10

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	569,655,004.82	-	637,606,818.01	67,951,813.19
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	境外 OTC 市场	-	-	-

合计	-	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	569,655,004.82	-	637,606,818.01	67,951,813.19

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

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
（国债期货投资）	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
（外汇期货投资）	-	-	-	-
权益衍生工具	17,017,128.37	-	-	-
（权证投资）	-	-	-	-
（股指期货投资）	17,017,128.37	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	17,017,128.37	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
NQ2409	NASDAQ 100	6	17,042,103.04	24,974.67

	E-MINI Sep24		
合计			24,974.67
减：可抵销期货暂收款			24,974.67
净额			-

注：在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产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为 0。

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：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金无债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金不存在债权投资减值准备计提情况。

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 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	-
应付审计费	24,863.02
应付信息披露费	59,672.34

应付指数使用费	-
应付账户维护费	-
应付汇划费	-
应付上市费	-
应付持有人大会费-公证费	-
应付持有人大会费-律师费	-
应付或有管理费	-
其他	-
合计	84,535.36

6.4.7.8 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	167,151,363.00	167,151,363.00
本期申购	483,000,000.00	483,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-222,000,000.00	-222,000,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	428,151,363.00	428,151,363.00

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.9 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	19,402,478.49	31,327,353.14	50,729,831.63
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	19,402,478.49	31,327,353.14	50,729,831.63
本期利润	15,571,080.31	52,482,177.62	68,053,257.93
本期基金份额交易产生的变动数	36,597,577.57	74,439,981.27	111,037,558.84
其中：基金申购款	67,699,413.00	129,190,853.95	196,890,266.95
基金赎回款	-31,101,835.43	-54,750,872.68	-85,852,708.11
本期已分配利润	-	-	-

本期末	71,571,136.37	158,249,512.03	229,820,648.40
-----	---------------	----------------	----------------

6.4.7.10 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	200,097.72
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	609.77
其他	-
合计	200,707.49

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益——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	10,600,506.84
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	10,600,506.84

6.4.7.11.2 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	171,996,524.03
减：卖出股票成本总额	161,302,966.08
减：交易费用	93,051.11
买卖股票差价收入	10,600,506.84

6.4.7.12 基金投资收益

注：本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 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。

6.4.7.13.2 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。

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

6.4.7.14.1 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。

6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
外汇期货投资收益	-
国债期货投资收益	-
股指期货投资收益	4,869,971.40
外汇远期投资收益	-

6.4.7.17 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	1,630,625.10
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	1,630,625.10

6.4.7.18 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	53,658,640.87
——股票投资	53,658,640.87
——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	-1,176,463.25

——权证投资	-
——期货投资	-1,176,463.25
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	52,482,177.62

6.4.7.19 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	4,841,128.88
其他	-
合计	4,841,128.88

6.4.7.20 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.21 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	24,863.02
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
账户维护费	-
银行费用	1,240.00
指数使用费	-
持有人大会-公证费	-
持有人大会-律师费	-
开户费	-
上市费	-
或有管理费	-
其他	174.06
合计	85,949.42

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

截至财务报表批准日，本基金无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

根据《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》《基金管理公司子公司管理规定》等法律法规的有关规定，经中国证券监督管理委员会同意，汇添富基金管理股份有限公司（以下简称“本公司”）已受让汇添富资本管理有限公司持有的汇添富投资管理有限公司（以下简称“汇添富投资”）全部股权。汇添富投资已由本公司的“全资子公司的全资子公司”变更为“全资子公司”。

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
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人, 基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	基金托管人
道富银行（State Street Bank and Trust Company）（“StateStreet”）	境外资产托管人
汇添富纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）	该基金是本基金的联接基金

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：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 基金交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行基金交易。

6.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间均不存在向关联方支付佣金的情况。

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	上年度可比期间 2023年03月30日（基 金合同生效日）至2023 年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,113,996.42	172,740.63
其中：应支付销售机构的客户维护费	22,448.44	30.33
应支付基金管理人的净管理费	1,091,547.98	172,710.30

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

对于基金中基金、ETF 联接基金等特殊类型的基金产品，由于本基金管理人对基金财产中持有的本基金管理人自身管理的基金部分或基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费，但客户维护费的收取标准并不调减，可能出现净管理费为负值的情况。

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	上年度可比期间 2023年03月30日（基金 合同生效日）至2023年 06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	334,198.97	51,822.17

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.15%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金

管理人无需再出具资金划拨指令。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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未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 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：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

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：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用自有资金投资本基金。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024 年 06 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)
汇添富纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 (QDII)	212,587,100.00	49.65	42,970,000.00	25.71

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用符合基金招募说明书和相关公告的规定。

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		上年度可比期间 2023 年 03 月 30 日（基金合同生效日）至 2023 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
建设银行	20,947,224.74	36,998.35	31,929,610.00	21,280.21
StateStreet	25,037,894.36	163,099.37	6,556,772.36	95,619.55

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：本基金本报告期及上年度可比期间均未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

无。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。于资产负债表日之后、财务报表批准日之前批准、公告或实施的利润分配情况详见资产负债表日后事项章节。

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：本基金本报告期末无因认购新发/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

注：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：截至本报告期末 2024 年 06 月 30 日止，本基金无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董事会、经营管理层、风险管理部门、各职能部门四级风险管理组织架构，并明确了相应的风险管理职能。

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。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。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资产净值的 10%。此外，基金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得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%。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外，基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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。

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模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

除本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，本基金本报告期末的其他资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

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。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

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	45,985,119.10	-	-	-	-	-	45,985,119.10
结算 备付 金	0.12	-	-	-	-	2,933,683.08	2,933,683.20
存出 保证 金	-	-	-	-	-	1,040,690.97	1,040,690.97
交易 性金	-	-	-	-	-	637,606,818.01	637,606,818.01

融资产							
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	74,445.13	74,445.13
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	45,985,119.22	-	-	-	-	641,655,637.19	687,640,756.41
负债							
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	-	-	-	-	-	29,250,605.47	29,250,605.47

款							
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	220,717.57	220,717.57
应付托管费	-	-	-	-	-	66,215.28	66,215.28
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	46,671.33	46,671.33
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	84,535.36	84,535.36
负债总计	-	-	-	-	-	29,668,745.01	29,668,745.01
利率敏感度缺口	45,985,119.22	-	-	-	-	611,986,892.18	657,972,011.40
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	31,967,512.05	-	-	-	-	-	31,967,512.05

结算备付金	1.17	-	-	-	-	10,649,066.10	10,649,067.27
存出保证金	-	-	-	-	-	2,758,003.38	2,758,003.38
交易性金融资产	-	-	-	-	-	177,137,267.90	177,137,267.90
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	141,660.37	141,660.37
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	31,967,513.22	-	-	-	-	190,685,997.75	222,653,510.97
负债							
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	-	-	-	-	-	4,495,150.36	4,495,150.36
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	81,556.21	81,556.21
应付托管费	-	-	-	-	-	24,466.85	24,466.85
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	51,142.92	51,142.92
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	120,000.00	120,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	4,772,316.34	4,772,316.34
利率敏感度缺口	31,967,513.22	-	-	-	-	185,913,681.41	217,881,194.63

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末均未持有债券资产及资产支持证券(不含可转换债券及可交换债券)，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	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
货币资金	25,037,977.53	-	-	25,037,977.53
结算备付金	2,933,683.08	-	-	2,933,683.08
存出保证金	1,040,690.97	-	-	1,040,690.97
交易性金融资产	637,606,818.01	-	-	637,606,818.01
衍生金融资产	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
应收股利	74,445.13	-	-	74,445.13
应收申购款	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	666,693,614.72	-	-	666,693,614.72

以外币计价的负债				
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	23,928,466.47	-	-	23,928,466.47
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
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	-	-	-	-
负债合计	23,928,466.47	-	-	23,928,466.47
资产负债表外外汇风险敞口净额	642,765,148.25	-	-	642,765,148.25
	上年度末 2023 年 12 月 31 日			
项目	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				
货币资金	21,167,190.70	-	-	21,167,190.70
结算备付金	10,649,066.10	-	-	10,649,066.10
存出保证金	2,758,003.38	-	-	2,758,003.38

交易性金融资产	177,137,267.90	-	-	177,137,267.90
衍生金融资产	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
应收股利	141,660.37	-	-	141,660.37
应收申购款	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	211,853,188.45	-	-	211,853,188.45
以外币计价的负债				
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	4,343,123.11	-	-	4,343,123.11
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
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	-	-	-	-

负债合计	4,343,123.11	-	-	4,343,123.11
资产负债表外汇率风险敞口净额	207,510,065.34	-	-	207,510,065.34

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	1. 除汇率以外的其他市场变量保持不变，且未考虑基金管理人为降低汇率风险而可能采取的风险管理活动。		
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
	美元相对人民币升值 5%	32,138,257.41	10,375,503.27
	美元相对人民币贬值 5%	-32,138,257.41	-10,375,503.27

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。

本基金管理人通过标准差、跟踪误差、beta 值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

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	637,606,818.01	96.90	177,137,267.90	81.30
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	637,606,818.01	96.90	177,137,267.90	81.30

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变； 2. 以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
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
	纳斯达克 100 指数(汇率调整)上涨 5%	32,869,842.70	10,607,557.71
	纳斯达克 100 指数(汇率调整)下跌 5%	-32,869,842.70	-10,607,557.71

注：本基金管理人运用资本—资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上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，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

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
第一层次	637,606,818.01
第二层次	-
第三层次	-

合计	637,606,818.01
----	----------------

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值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

截至资产负债表日，除本报告“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”章节中所列示情况外，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	637,606,818.01	92.72
	其中：普通股	627,039,645.68	91.19
	存托凭证	10,567,172.33	1.54
	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	48,918,802.30	7.11
8	其他各项资产	1,115,136.10	0.16
9	合计	687,640,756.41	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	637,606,818.01	96.90
合计	637,606,818.01	96.90

注：按公允价值占基金资产净值比例从大到小排序；国家（地区）类别根据其所在的证券交易所确定；此处股票包括普通股和优先股；ADR、GDR 按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

7.3.1 期末指数投资按行业分类的权益投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
10 能源	3,033,334.85	0.46
15 原材料	9,037,929.10	1.37
20 工业	27,197,731.81	4.13
25 可选消费	80,029,611.52	12.16
30 日常消费	38,358,621.68	5.83
35 医疗保健	38,927,878.68	5.92
40 金融	2,600,930.43	0.40
45 信息技术	330,576,014.05	50.24
50 电信服务	99,105,881.66	15.06
55 公用事业	7,441,180.61	1.13
60 房地产	1,297,703.62	0.20
合计	637,606,818.01	96.90

7.3.2 期末积极投资按行业分类的权益投资组合

注：本报告期末未持有积极投资。

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 期末指数投资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 Corp	微软	MSFT US	纳斯达克证券交易所	美国	17,301	55,109,277.72	8.38
2	Apple Inc	苹果公司	AAPL US	纳斯达克证券交易所	美国	35,695	53,579,858.96	8.14
3	NVIDIA Corp	英伟达	NVDA US	纳斯达克证券交易所	美国	57,260	50,414,273.37	7.66
4	Alphabet Inc	Alphabet 公司	GOOG L US	纳斯达克证券交易所	美国	13,674	17,750,856.88	2.70

				所				
4	Alphabet Inc	Alphabet 公 司	GOOG US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	13,07 5	17,091,609.3 5	2.60
5	Amazon.com Inc	亚马逊公司	AMZN US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	24,22 5	33,363,980.5 7	5.07
6	Broadcom Inc	博通股份有 限公司	AVGO US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	2,786	31,878,223.2 9	4.84
7	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	8,116	29,164,643.8 8	4.43
8	Costco Wholesale Corp	开市客	COST US	纳 斯 达 克 证 券 交	美 国	2,667	16,155,909.1 9	2.46

				易所				
9	Tesla Inc	特斯拉公司	TSLA US	纳斯达克 证券交易 所	美国	11,237	15,846,992.55	2.41
10	Netflix Inc	奈飞公司	NFLX US	纳斯达克 证券交易 所	美国	2,591	12,462,022.83	1.89
11	Advanced Micro Devices Inc	AMD 公司	AMD US	纳斯达克 证券交易 所	美国	9,718	11,234,379.50	1.71
12	Adobe Inc	奥多比	ADBE US	纳斯达克 证券交易 所	美国	2,694	10,666,145.34	1.62
13	PepsiCo Inc	百事可乐	PEP US	纳斯达克 证券	美国	8,266	9,716,047.54	1.48

				交易所				
14	QUALCOMM Inc	高通公司	QCOM US	纳斯达克 证券交易 所	美国	6,710	9,524,952.52	1.45
15	Linde PLC	-	LIN US	纳斯达克 证券交易 所	美国	2,890	9,037,929.10	1.37
16	T-Mobile US Inc	T-Mobile US 股份有限公 司	TMUS US	纳斯达克 证券交易 所	美国	7,046	8,846,954.95	1.34
17	Applied Materials Inc	应用材料	AMAT US	纳斯达克 证券交易 所	美国	4,978	8,372,266.88	1.27
18	Cisco Systems Inc	思科	CSCO US	纳斯达克 证	美国	24,22 3	8,201,768.95	1.25

				券交易所				
19	Intuit Inc	Intuit 股份有限公司	INTU US	纳斯达克证 券交易所	美国	1,681	7,873,474.91	1.20
20	Texas Instruments Inc	德州仪器	TXN US	纳斯达克证 券交易所	美国	5,474	7,589,024.44	1.15
21	Amgen Inc	安进公司	AMGN US	纳斯达克证 券交易所	美国	3,225	7,181,328.93	1.09
22	Intuitive Surgical Inc	直觉外科手 术公司	ISRG US	纳斯达克证 券交易所	美国	2,133	6,762,371.44	1.03
23	Comcast Corp	康卡斯特公 司	CMCS A US	纳斯达克	美国	23,53 4	6,567,997.87	1.00

				证 券 交 易 所				
24	Micron Technology Inc	美光科技股 份有限公司	MU US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	6,658	6,241,129.33	0.95
25	Lam Research Corp	泛林集团	LRCX US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	786	5,964,932.76	0.91
26	Honeywell International Inc	霍尼韦尔	HON US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	3,915	5,958,069.65	0.91
27	Booking Holdings Inc	Booking 控股 股份有限公 司	BKNG US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	204	5,759,494.91	0.88
28	Intel Corp	英特尔	INTC US	纳 斯 达 克	美 国	25,59 5	5,649,251.51	0.86

				克 证 券 交 易 所				
29	Vertex Pharmaceuticals Inc	福泰制药	VRTX US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,552	5,184,415.18	0.79
30	Regeneron Pharmaceuticals Inc	再生元制药 股份有限公司	REGN US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	652	4,883,793.35	0.74
31	Analog Devices Inc	亚德诺半导 体	ADI US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	2,983	4,852,635.13	0.74
32	KLA Corp	KLA 公司	KLAC US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	810	4,759,655.47	0.72
33	Palo Alto Networks Inc	Palo Alto Networks 股	PANW US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,947	4,704,061.94	0.71

		份有限公司		达 克 证 券 交 易 所				
34	Automatic Data Processing Inc	ADP 公司	ADP US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	2,461	4,186,396.99	0.64
35	ASML Holding NV	阿斯麦控股 公司	ASML US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	547	3,986,969.31	0.61
36	Synopsys Inc	新思科技公 司	SNPS US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	921	3,905,844.59	0.59
37	PDD Holdings Inc	拼多多	PDD US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	4,016	3,805,192.37	0.58
38	Crowdstrike	CrowdStrike	CRWD	纳 美	美	1,387	3,787,783.95	0.58

	Holdings Inc	控股股份有 限公司	US	斯 达 克 证 券 交 易 所	国			
39	Starbucks Corp	星巴克	SBUX US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	6,810	3,778,333.60	0.57
40	Mondelez International Inc	亿滋国际	MDLZ US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	8,065	3,761,336.89	0.57
41	Gilead Sciences Inc	吉利德科学	GILD US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	7,491	3,662,872.38	0.56
42	Cadence Design Systems Inc	Cadence 设 计系统股份 有限公司	CDNS US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,636	3,588,194.14	0.55

43	MercadoLibre Inc	MercadoLibre 股份有限公司	MELI US	纳斯达克证券交易所	美国	305	3,572,215.85	0.54
44	Cintas Corp	Cintas 公司	CTAS US	纳斯达克证券交易所	美国	610	3,044,273.91	0.46
45	Marriott International Inc/MD	万豪国际	MAR US	纳斯达克证券交易所	美国	1,717	2,958,470.73	0.45
46	NXP Semiconductors NV	恩智浦半导体公司	NXPI US	纳斯达克证券交易所	美国	1,537	2,947,582.69	0.45
47	Airbnb Inc	爱彼迎股份有限公司	ABNB US	纳斯达克证券交易所	美国	2,654	2,868,009.76	0.44

				所				
48	CSX Corp	CSX 公司	CSX US	纳斯达克 证 券 交 易 所	美国	11,754	2,802,053.22	0.43
49	Constellation Energy Corp	美国联合能源公司	CEG US	纳斯达克 证 券 交 易 所	美国	1,895	2,704,703.63	0.41
50	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	354	2,664,320.26	0.40
51	PayPal Holdings Inc	Paypal 控股股份有限公司	PYPL US	纳斯达克 证 券 交 易 所	美国	6,289	2,600,930.43	0.40
52	Marvell Technology Inc	美满电子科技公司	MRVL US	纳斯达克 证 券 交	美国	5,204	2,592,441.92	0.39

				易所				
53	Roper Technologies Inc	儒博技术公司	ROP US	纳斯达克证券交易所	美国	644	2,587,007.30	0.39
54	PACCAR Inc	帕卡	PCAR US	纳斯达克证券交易所	美国	3,151	2,311,676.93	0.35
55	Autodesk Inc	欧特克	ADSK US	纳斯达克证券交易所	美国	1,296	2,285,530.55	0.35
56	Copart Inc	Copart 股份有限公司	CPRT US	纳斯达克证券交易所	美国	5,786	2,233,323.61	0.34
57	Monster Beverage Corp	怪兽饮料公司	MNST US	纳斯达克证券交易所	美国	6,263	2,229,525.66	0.34

				交易所				
58	Microchip Technology Inc	微芯科技股份有限公司	MCHP US	纳斯达克证券交易所	美国	3,228	2,104,985.90	0.32
59	Ross Stores Inc	罗斯百货股份有限公司	ROST US	纳斯达克证券交易所	美国	2,016	2,087,903.82	0.32
60	Workday Inc	Workday 股份有限公司	WDAY US	纳斯达克证券交易所	美国	1,275	2,031,415.95	0.31
61	American Electric Power Co Inc	美国电力	AEP US	纳斯达克证券交易所	美国	3,169	1,981,592.91	0.30
62	Fortinet Inc	Fortinet 股份有限公司	FTNT US	纳斯达克证	美国	4,593	1,972,841.56	0.30

				券交易所				
63	Moderna Inc	莫德纳公司	MRNA US	纳斯达克证 券交易所	美国	2,304	1,949,892.48	0.30
64	AstraZeneca PLC	阿斯利康公 共有限公司	AZN US	纳斯达克证 券交易所	美国	3,501	1,945,922.78	0.30
65	Keurig Dr Pepper Inc	Keurig Dr Pepper 有限 公司	KDP US	纳斯达克证 券交易所	美国	8,150	1,939,986.23	0.29
66	Dexcom Inc	Dexcom 股份 有限公司	DXCM US	纳斯达克证 券交易所	美国	2,391	1,932,015.47	0.29
67	Trade Desk Inc/The	Trade Desk 股份有限公 司	TTD US	纳斯达克	美国	2,677	1,863,391.59	0.28

				证 券 交 易 所				
68	Charter Communications Inc	Charter 通信 公司	CHTR US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	866	1,845,123.96	0.28
69	Paychex Inc	Paychex 公 司	PAYX US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	2,164	1,828,479.17	0.28
70	DoorDash Inc	DoorDash 股 份有限公司	DASH US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	2,295	1,779,206.33	0.27
71	IDEXX Laboratories Inc	爱德士股份 有限公司	IDXX US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	497	1,725,671.95	0.26
72	Datadog Inc	Datadog 股 份有限公司	DDOG US	纳 斯 达 克	美 国	1,855	1,714,529.55	0.26

				克 证 券 交 易 所				
73	Kraft Heinz Co/The	卡夫亨氏公 司	KHC US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	7,301	1,676,495.75	0.25
74	Verisk Analytics Inc	Verisk 分析 公司	VRSK US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	858	1,648,242.83	0.25
75	Old Dominion Freight Line Inc	Old Dominion Freight Line 股份有 限公司	ODFL US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,306	1,643,722.30	0.25
76	Electronic Arts Inc	电子艺界	EA US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,602	1,590,749.22	0.24
77	Lululemon Athletica Inc	Lululemon Athletica 股	LULU US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	726	1,545,490.77	0.23

		份有限公司		达 克 证 券 交 易 所				
78	Fastenal Co	法思诺公司	FAST US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	3,442	1,541,493.20	0.23
79	Diamondback Energy Inc	Diamondback 能源股份有 限公司	FANG US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,072	1,529,437.51	0.23
80	GE HealthCare Technologies Inc	-	GEHC US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	2,744	1,523,798.78	0.23
81	Baker Hughes Co	贝克休斯公 司	BKR US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	6,000	1,503,897.34	0.23
82	Exelon Corp	Exelon 公司	EXC	纳	美	6,013	1,483,157.85	0.23

			US	斯达克证 券交易 所	国			
83	Cognizant Technology Solutions Corp	高知特科技 公司	CTSH US	纳斯达 克证 券交 易所	美国	2,989	1,448,536.35	0.22
84	Biogen Inc	渤健公司	BIIB US	纳斯达 克证 券交 易所	美国	875	1,445,617.93	0.22
85	Coca-Cola Europacific Partners PLC	可口可乐欧 洲合伙公 司	CCEP US	纳斯达 克证 券交 易所	美国	2,761	1,433,869.90	0.22
86	CoStar Group Inc	CoStar 集 团股 份有 限公 司	CSGP US	纳斯达 克证 券交 易所	美国	2,456	1,297,703.62	0.20

87	CDW Corp/DE	特拉华 CDW 公司	CDW US	纳斯达克 证券交易 所	美国	808	1,288,972.43	0.20
88	Xcel Energy Inc	Xcel 能源	XEL US	纳斯达克 证券交易 所	美国	3,341	1,271,726.22	0.19
89	ON Semiconductor Corp	安森美半导 体公司	ON US	纳斯达克 证券交易 所	美国	2,587	1,263,858.52	0.19
90	Zscaler Inc	Zscaler 股份 有限公司	ZS US	纳斯达克 证券交易 所	美国	901	1,234,099.42	0.19
91	Atlassian Corp	-	TEAM US	纳斯达克 证券交易 所	美国	958	1,207,643.67	0.18

				所				
92	ANSYS Inc	ANSYS 股份有限公司	ANSS US	纳斯达克 证 券 交 易 所	美国	525	1,202,914.76	0.18
93	GLOBALFOUNDRIES Inc	格罗方德半 导体股份有 限公司	GFS US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	3,316	1,194,857.62	0.18
94	Take-Two Interactive Software Inc	Take-Two 互 动软件股份 有限公司	TTWO US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,030	1,141,390.52	0.17
95	Dollar Tree Inc	美元树公司	DLTR US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,312	998,338.11	0.15
96	ARM Holdings PLC	-	ARM US	纳 斯 达 克 证 券 交	美国	711	829,087.87	0.13

				易所				
97	MongoDB Inc	MongoDB 股份有限公司	MDB US	纳斯达克 证券交易所	美国	441	785,603.98	0.12
98	Warner Bros Discovery Inc	华纳兄弟探 索股份有限 公司	WBD US	纳斯达克 证券交易所	美国	14,73 2	781,140.61	0.12
99	Illumina Inc	Illumina 公 司	ILMN US	纳斯达克 证券交易所	美国	958	712,651.78	0.11
10 0	Walgreens Boots Alliance Inc	沃博联股份 有限公司	WBA US	纳斯达克 证券交易所	美国	5,187	447,112.41	0.07
10 1	GRAIL Inc	-	GRAL US	纳斯达克 证券	美国	160	17,526.23	0.00

				交易所				
--	--	--	--	-----	--	--	--	--

7.4.2 积极投资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

注:本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。

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 Corp	MSFT US	49,097,912.86	22.53
2	Apple Inc	AAPL US	48,217,553.97	22.13
3	NVIDIA Corp	NVDA US	32,677,400.09	15.00
4	Alphabet Inc	GOOGL US	14,587,332.28	6.70
4	Alphabet Inc	GOOG US	14,106,318.28	6.47
5	Amazon.com Inc	AMZN US	27,538,578.27	12.64
6	Broadcom Inc	AVGO US	26,244,534.57	12.05
7	Meta Platforms Inc	META US	24,476,294.51	11.23
8	Tesla Inc	TSLA US	14,945,488.87	6.86
9	Costco Wholesale Corp	COST US	13,363,776.27	6.13
10	Advanced Micro Devices Inc	AMD US	11,481,339.66	5.27
11	Linde PLC	LIN US	10,445,413.31	4.79
12	Adobe Inc	ADBE US	10,444,549.93	4.79
13	Netflix Inc	NFLX US	10,425,905.57	4.79
14	PepsiCo Inc	PEP US	9,328,630.70	4.28
15	Cisco Systems Inc	CSCO US	8,205,927.91	3.77
16	QUALCOMM Inc	QCOM US	8,060,713.61	3.70
17	T-Mobile US Inc	TMUS US	7,906,730.81	3.63
18	Intel Corp	INTC US	7,535,854.42	3.46
19	Intuit Inc	INTU US	7,311,793.30	3.36
20	Comcast Corp	CMCSA US	6,794,757.54	3.12
21	Applied Materials Inc	AMAT US	6,792,081.51	3.12
22	Texas Instruments Inc	TXN US	6,594,733.13	3.03
23	Amgen Inc	AMGN US	6,563,643.53	3.01
24	Intuitive Surgical Inc	ISRG US	5,657,781.69	2.60

25	Honeywell International Inc	HON US	5,476,084.18	2.51
26	Booking Holdings Inc	BKNG US	5,081,248.51	2.33
27	Micron Technology Inc	MU US	5,070,112.72	2.33
28	Lam Research Corp	LRCX US	5,006,214.60	2.30
29	Vertex Pharmaceuticals Inc	VRTX US	4,569,680.02	2.10
30	Palo Alto Networks Inc	PANW US	4,361,738.69	2.00

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，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	Microsoft Corp	MSFT US	14,962,292.34	6.87
2	Apple Inc	AAPL US	14,592,786.53	6.70
3	NVIDIA Corp	NVDA US	10,173,697.78	4.67
4	Alphabet Inc	GOOGL US	4,225,198.22	1.94
4	Alphabet Inc	GOOG US	4,164,103.96	1.91
5	Amazon.com Inc	AMZN US	8,102,725.31	3.72
6	Meta Platforms Inc	META US	8,068,876.36	3.70
7	Broadcom Inc	AVGO US	8,028,137.31	3.68
8	Tesla Inc	TSLA US	4,107,060.33	1.88
9	Costco Wholesale Corp	COST US	3,892,862.60	1.79
10	Advanced Micro Devices Inc	AMD US	3,545,573.41	1.63
11	Netflix Inc	NFLX US	3,259,427.17	1.50
12	Adobe Inc	ADBE US	3,164,880.76	1.45
13	PepsiCo Inc	PEP US	2,829,721.91	1.30
14	QUALCOMM Inc	QCOM US	2,525,031.68	1.16
15	Cisco Systems Inc	CSCO US	2,497,316.21	1.15
16	T-Mobile US Inc	TMUS US	2,273,300.47	1.04
17	Intel Corp	INTC US	2,222,791.23	1.02
18	Intuit Inc	INTU US	2,222,240.91	1.02
19	Comcast Corp	CMCSA US	2,213,990.65	1.02
20	Applied Materials Inc	AMAT US	2,129,966.94	0.98

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额填列，不考虑相关交易费用。

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	568,113,875.32
卖出收入（成交）总额	171,996,524.03

注：“买入成本”、“卖出收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.6 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序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序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

金额单位：人民币元

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	期货品种_指数	NASDAQ 100 E-MINI Sep24	-	-

注：期货投资采用当日无负债结算制度，相关价值已包含在结算备付金中，具体投资情况详见下表（买入持仓量以正数表示、卖出持仓量以负数表示）：

代码	名称	持仓量（买/卖）（单位：手）	合约市值	公允价值变动
NQ2409	NASDAQ 100 E-MINI Sep24		6.00	17,042,103.04
				24,974.67
	公允价值变动总额合计		24,974.67	
	期货投资本期收益		4,869,971.40	
	期货投资本期公允价值变动		-1,176,463.25	

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投资。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1

报告期内本基金投资前十名证券的发行主体没有被中国人民银行及其派出机构、国家金融监督管理总局（前身为中国银保监会）及其派出机构、中国证监会及其派出机构、国家市场监督管理总局及机关单位、交易所立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.11.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

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	1,040,690.97
2	应收清算款	-
3	应收股利	74,445.13
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	1,115,136.10

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不存在流通受限情况。

§ 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	中国建设银行股份有限公司-汇添富纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 (QDII)

		持有份额	占总 份额 比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
4,905	87,288.7 6	262,643,107. 00	61.3 4	165,508,256. 00	38.6 6	212,587,100. 00	49.6 5

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中包含“汇添富纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

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	敦和资产管理有限公司—敦和云栖 1 号积极成长私募基金	19,895,500.00	4.65
2	敦和资产管理有限公司—敦和云栖 3 号平衡配置私募基金	7,005,700.00	1.64
3	张宇鑫	5,670,000.00	1.32
4	叶人平	3,138,000.00	0.73
5	袁陈兵	3,043,200.00	0.71
6	祝玉琴	2,924,500.00	0.68
7	中国平安人寿保险股份有限公司—自有资金	2,780,300.00	0.65
8	中国银河证券股份有限公司	2,522,100.00	0.59
9	张力扬	2,470,800.00	0.58
10	陈锦辉	2,273,300.00	0.53
11	中国建设银行股份有限公司—汇添富纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）	212,587,100.00	49.65

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

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 03 月 30 日） 基金份额总额	244,151,363.00
本报告期期初基金份额总额	167,151,363.00
本报告期基金总申购份额	483,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	222,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	428,151,363.00

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

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，本基金基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产的重大诉讼事项。

本报告期无涉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，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的机构未发生变化，为安永华明会计师事务所（特殊

普通合伙)。

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

注：本报告期内未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.6.2 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，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

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 (%)	
Jefferies International Limited	-	305,500,232.86	41.33	15,059.89	16.46	
CLSA Asia-Pacific Markets	-	290,313,425.23	39.27	55,904.15	61.11	
Sanford C. Bernstein (Hong Kong) Limited	-	118,002,620.02	15.96	18,097.06	19.78	
麦格理证券	-	25,373,005.02	3.43	2,414.94	2.64	
财通证券	2	-	-	-	-	
长江证券	2	-	-	-	-	
川财证券	2	-	-	-	-	
大和证券	2	-	-	-	-	
东北证券	1	-	-	-	-	
东方证券	2	-	-	-	-	
东吴证券	3	-	-	-	-	
方正证券	2	-	-	-	-	
广发证券	1	-	-	-	-	
国金证券	2	-	-	-	-	
国联证券	2	-	-	-	-	
国投证券	2	-	-	-	-	
海通证券	4	-	-	-	-	

华安证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
华兴证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
摩根大通证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源证券	3	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
野村东方国际	2	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投证券	4	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
中邮证券	2	-	-	-	-	-

注:此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计,不单指股票交易佣金。

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 (%)
Jefferies International Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
CLSA Asia-Pacific Markets	-	-	-	-	-	-	-	-
Sanford C. Bernstein (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
麦格理证券	-	-	-	-	-	-	-	-

财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-	-	-
大和证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
摩根大通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
野村东方国际	-	-	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-	-	-

注:1、专用交易单元的选择标准和程序:

(1) 基金交易单元选择和成交量的分配工作由公司投资研究总部/指数与量化投资部(合称“投资研究部门”)根据法律法规及公司内部规定相应负责组织、协调和监督。投资研究部门选择财务状况良好、经营行为规范、合规风控能力和交易、研究服务能力较强的证券公司,租用其交易单元。

(2) 交易单元分配的目标是按照中国证监会的有关规定和对券商交易或研究服务的评价控

制交易单元的分配比例。

(3) 投资研究部门根据定期评分的结果决定交易单元分配比例。通过一家证券公司进行证券交易的年交易佣金总额的上限，需符合相关法律法规规定的要求。(采用券商交易模式的基金不适用相关法律法规规定的证券交易佣金分配比例上限。)

(4) 每半年综合考虑近半年及最新的评分情况，作为增加或更换券商交易单元的依据。

(5) 调整租用交易单元的选择及决定交易单元成交量的分布情况由投资研究部门决定。

(6) 交易单元的选择程序为投资研究部门按上述标准对券商进行评估，根据法律法规及公司内部规定确认选用的券商，与被选中的券商签订相关协议。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内新增 4 家证券公司的 7 个交易单元：摩根大通证券（上交所单元，深交所单元）、国联证券（上交所单元，深交所单元）、财通证券（上交所单元，深交所单元）、华安证券（深交所单元）。

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	关于防范不法分子冒用汇添富基金名义进行非法活动的重要提示	公司网站	2024 年 01 月 02 日
2	汇添富基金管理股份有限公司关于指定证券投资基金主流动性服务商的公告	上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 01 月 05 日
3	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加华宝证券为申购赎回代理券商的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 01 月 08 日
4	关于汇添富纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 因境外主要市场节假日暂停申购、赎回业务的公告	中证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 01 月 11 日
5	关于汇添富基金管理股份有限公司终止与北京增财基金销售有限公司合作关系的公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 01 月 17 日
6	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2023 年第四季度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 01 月 22 日
7	关于汇添富纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 因	中证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基	2024 年 02 月 07 日

	境外主要市场节假日暂停申购、赎回业务的公告	金电子披露网站	
8	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加华金证券为申购赎回代理券商的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 03 月 08 日
9	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 增加申购赎回代理券商的公告	中证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 03 月 11 日
10	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 增加申购赎回代理券商的公告	中证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 03 月 20 日
11	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新招募说明书及基金产品资料概要	上交所, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 03 月 22 日
12	关于汇添富纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 因境外主要市场节假日暂停申购、赎回业务的公告	中证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 03 月 27 日
13	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2023 年年度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 03 月 29 日
14	汇添富基金管理股份有限公司关于提醒投资者持续完善客户身份信息资料的公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 04 月 03 日
15	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富投资管理有限公司股东变更的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 04 月 16 日
16	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2024 年第一季度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 04 月 22 日
17	关于调整汇添富纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 主流流动性服务商为一般流动性服务商的公告	中证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 04 月 24 日
18	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加渤海证券为申购赎回代理券商的公告	中证报, 上交所, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 05 月 20 日

19	关于汇添富纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 因境外主要市场节假日暂停申购、赎回业务的公告	中证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 05 月 23 日
20	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新基金产品资料概要	上交所, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 05 月 24 日
21	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加财达证券为申购赎回代理券商的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 06 月 03 日
22	关于汇添富基金管理股份有限公司终止与北京中期时代基金销售有限公司合作关系的公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 06 月 13 日
23	汇添富基金管理股份有限公司关于调整旗下部分 ETF 申购、赎回清单计算公式的公告	中证报, 上交所, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 06 月 15 日
24	关于汇添富纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 因境外主要市场节假日暂停申购、赎回业务的公告	中证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 06 月 17 日
25	汇添富纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 更新招募说明书 (2024 年 6 月 17 日更新)	公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 06 月 17 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者超过 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 (%)

中国建设银行股份有限公司—汇添富纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 (QDII)	1	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 1 月 23 日, 2024 年 2 月 6 日至 2024 年 6 月 30 日	42,970,000.00	183,000,000.00	13,382,900.00	212,587,100.00	49.65
产品特有风险							
<p>1、持有人大会投票权集中的风险 当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。</p> <p>2、基金规模较小导致的风险 持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致基金规模较小，基金持续稳定运作可能面临一定困难。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。</p> <p>3、提前终止基金合同的风险 持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元，进而可能导致本基金终止、转换运作方式或与其他基金合并。</p>							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 募集的文件；
- 2、《汇添富纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 基金合同》；
- 3、《汇添富纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内汇添富纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 在规定报刊

上披露的各项公告；

6、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

上海市黄浦区外马路 728 号 汇添富基金管理股份有限公司

12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，或登录基金管理人网站 www.99fund.com 查阅，还可拨打基金管理人客户服务中心电话：400-888-9918 查询相关信息。

汇添富基金管理股份有限公司

2024 年 08 月 30 日