

广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资 基金

2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年八月三十日

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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 26 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 2021 年 1 月 1 日起至 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	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	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
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 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	13
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.....	13
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.....	13
6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	34
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	35
7.4 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.....	35
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	43
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	44
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.....	44
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.....	44
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.....	45
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.....	45
7.11 投资组合报告附注.....	45
8 基金份额持有人信息	46

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	46
8.2 期末上市基金前十名持有人	46
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	47
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	47
9 开放式基金份额变动	47
10 重大事件揭示	47
10.1 基金份额持有人大会决议	47
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	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	47
10.4 基金投资策略的改变	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	47
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	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	48
10.8 其他重大事件	49
11 影响投资者决策的其他重要信息	50
12 备查文件目录	50
12.1 备查文件目录	50
12.2 存放地点	50
12.3 查阅方式	50

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	广发纳指 100ETF
基金主代码	159941
交易代码	159941
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015 年 6 月 10 日
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	227,052,541.00 份
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	2015-07-13

注：本基金的扩位证券简称为“纳指 ETF”。

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	本基金主要采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。 正常情况下，本基金力求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	汇率调整后的纳斯达克 100 指数（Nasdaq-100 Index）收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

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		广发基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	程才良	许俊
	联系电话	020-83936666	010-66594319
	电子邮箱	ccl@gffunds.com.cn	fcid@bankofchina.com

客户服务电话	95105828	95566
传真	020-89899158	010-66594942
注册地址	广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室-49848（集中办公区）	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址	广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码	510308	100818
法定代表人	孙树明	刘连舸

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	-	BANK OF CHINA NEW YORK BRANCH
	中文	-	中国银行纽约分行
注册地址		-	1045 Avenue of the Americas, New York City, New York County, New York 10018
办公地址		-	1045 Avenue of the Americas, New York City, New York County, New York 10018
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	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.gffunds.com.cn
基金中期报告备置地点	广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

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（2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	100,099,943.97
本期利润	81,778,954.43
加权平均基金份额本期利润	0.2748
本期加权平均净值利润率	10.23%
本期基金份额净值增长率	11.51%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	269,646,907.31
期末可供分配基金份额利润	1.1876
期末基金资产净值	661,349,825.83
期末基金份额净值	2.9128
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	191.28%

注：（1）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

（2）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

（3）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	7.98%	0.78%	7.93%	0.78%	0.05%	0.00%
过去三个月	9.42%	1.10%	9.50%	1.09%	-0.08%	0.01%
过去六个月	11.51%	1.44%	12.22%	1.42%	-0.71%	0.02%
过去一年	29.85%	1.47%	31.73%	1.47%	-1.88%	0.00%
过去三年	88.76%	1.70%	107.71%	1.70%	-18.95%	0.00%
自基金合同生效起至今	191.28%	1.41%	270.36%	1.41%	-79.08%	0.00%

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

广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 （2015 年 6 月 10 日至 2021 年 6 月 30 日）



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

经中国证监会证监基金字[2003]91 号文批准，本基金管理人于 2003 年 8 月 5 日成立，总部设在广州，在北京、上海、广州、香港等地设有分公司或子公司。本基金管理人拥有公募基金管理、特定客户资产管理、社保基金境内投资管理人、基本养老保险基金证券投资管理机构、保险资金投资管理人、保险保障基金委托资产管理投资管理人、QDII 等业务资格，旗下产品覆盖主动权益、债券、货币、海外投资、被动投资、量化对冲、另类投资等不同类别，为境内外客户提供标准化和定制化的资产管理服务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券从 业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘杰	本基金的基金 经理；广发沪 深 300 交易型 开放式指数证 券投资基金联 接基金的基金 经理；广发中 证 500 交易型 开放式指数证 券投资基金的 基金经理；广 发中证 500 交 易型开放式指 数证券投资基 金联接基金 (LOF)的基金 经理；广发沪 深 300 交易型 开放式指数证 券投资基金的 基金经理；广 发创业板交易 型开放式指数 证券投资基金 的基金经理； 广发创业板交 易型开放式指 数证券投资基 金发起式联接 基金的基金经 理；广发道琼 斯美国石油开 发与生产指数 证券投资基金 (QDII-LOF) 的基金经理； 广发港股通恒 生综合中型股 指数证券投资 基金(LOF)的 基金经理；广 发美国房地产	2018-08-06	-	17 年	刘杰先生，工学学士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任广发基金管理有限公司信息技术部系统开发专员、数量投资部研究员、广发沪深 300 指数证券投资基金基金经理(自 2014 年 4 月 1 日至 2016 年 1 月 17 日)、广发中证环保产业指数型发起式证券投资基金基金经理(自 2016 年 1 月 25 日至 2018 年 4 月 25 日)、广发量化稳健混合型证券投资基金基金经理(自 2017 年 8 月 4 日至 2018 年 11 月 30 日)、广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(自 2016 年 1 月 25 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2016 年 1 月 25 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发中证养老产业指数型发起式证券投资基金基金经理(自 2016 年 1 月 25 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2016 年 8 月 30 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自 2016 年 9 月 26 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资

	<p>指数证券投资基金的基金经理；广发纳斯达克 100 指数证券投资基金的基金经理；广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金的基金经理；广发全球医疗保健指数证券投资基金的基金经理；广发恒生中国企业精明指数型发起式证券投资基金（QDII）的基金经理；广发中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理；广发粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理；指数投资部总经理助理</p>			<p>1 月 25 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自 2018 年 4 月 26 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发标普全球农业指数证券投资基金基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2020 年 2 月 28 日)。</p>
--	--	--	--	--

注：1.“任职日期”和“离职日期”指公司公告聘任或解聘日期。

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内基金运作合法合规，无损害基金持有人利益的行为，基金的投资管理符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司通过建立科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控与及时的分析评估，保证公平交易原则的实现。

在投资决策的内部控制方面，公司建立了严格的投资备选库制度及投资授权制度，投资组合的投资标的必须来源于公司备选库，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易过程中，中央交易部按照“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”的原则，公平分配投资指令。金融工程与风险管理部风险控制岗通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控及预警，实现投资风险的事中风险控制；稽核岗通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核，实现投资风险的事后控制。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，不同的投资组合受到了公平对待，未发生任何不公平的交易事项。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 13 次，其中 7 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，其余 6 次为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现本组合有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金主要采用完全复制法来跟踪纳斯达克 100 指数，按照个股在标的指数中的基准权重构建股票组合，呈现出股票型指数基金的特征。

2021 年上半年，美股呈现震荡上行行情，纳斯达克 100 指数上涨 12.93%，标普 500 指数上涨 14.41%，两个指数点位均在上半年内创出历史新高。

1 季度美股诸多行业，例如汽车、银行、多元金融、零售、科技硬件、能源以及原材料盈利增速较去年 4 季度均大幅抬升，美股大部分板块盈利已经超过疫情前水平。由于去年 2 季度是疫情冲击最严重的时期，存在明显的低基数效应。上半年 QDII 基金，尤其是美股 QDII 基金整体表现相对较好，主要受美国后疫情时期经济好转预期影响，尤其是伴随疫苗的逐步供应，市场情绪逐渐好转。后疫情时代，美国财政刺激相关政策也有利于企业盈利的恢复，相对低的有效税率也对盈利改善起到了积极作用。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金的份额净值增长率为 11.51%，同期业绩比较基准收益率为 12.22%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，新冠病毒变种或将持续干扰海外经济复苏进程，在没有更强财政刺激的情况下，美国经济或将由强复苏转为温和复苏。因此，市场普遍预测美联储加息的步伐将进一步放缓，较低的利率水平将为美股提供支撑。

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设有估值委员会，按照相关法律法规和证监会的相关规定，负责制定旗下基金投资品种的估值原则和估值程序，并选取适当的估值方法，经公司管理层批准后方可实施。估值委员会的成员包括：公司分管投研、估值的公司领导、督察长、各投资部门负责人、研究发展部负责人、合规稽核部负责人、金融工程与风险管理部负责人和基金会计部负责人。估值委员会定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。基金日常估值由基金会计部具体执行，并确保和托管行核对一致。投资研究人员积极

关注市场变化、证券发行机构重大事件等可能对估值产生重大影响的因素，向估值委员会提出估值建议，确保估值的公允性。合规稽核部负责定期对基金估值程序和方法进行核查，确保估值委员会的各项决策得以有效执行。以上所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。为保证基金估值的客观独立，基金经理不参与估值的具体流程，但若存在对相关投资品种估值有失公允的情况，可向估值委员会提出意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以维护基金持有人利益为准则。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按合同约定提供相关债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同中“基金收益与分配”之“基金收益分配原则”的相关规定，本基金本报告期内未进行利润分配，符合合同规定。

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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融

工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

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：广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资 产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	57,314,232.89	81,461,812.71
结算备付金		15,416,029.92	15,559,972.16
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	590,654,373.76	991,430,006.34
其中：股票投资		581,434,212.19	986,014,880.91
基金投资		9,220,161.57	5,415,125.43
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		4,256,499.29	7,493,582.48
应收利息	6.4.7.5	4,831.51	1,155.38
应收股利		62,307.02	213,707.10
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	213,045.31	-
资产总计		667,921,319.70	1,096,160,236.17
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		456,477.62	722,787.04

应付托管费		142,649.24	225,870.95
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
应交税费		123,364.39	509,489.44
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	5,849,002.62	39,289,481.89
负债合计		6,571,493.87	40,747,629.32
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	227,052,541.00	404,052,541.00
未分配利润	6.4.7.10	434,297,284.83	651,360,065.85
所有者权益合计		661,349,825.83	1,055,412,606.85
负债和所有者权益总计		667,921,319.70	1,096,160,236.17

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 2.9128 元，基金份额总额 227,052,541.00 份。

6.2 利润表

会计主体：广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		86,221,909.06	80,948,956.11
1.利息收入		40,693.77	90,026.88
其中：存款利息收入	6.4.7.11	40,693.77	90,026.88
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		106,124,526.27	5,538,992.15
其中：股票投资收益	6.4.7.12	96,766,730.48	-138,981.24
基金投资收益	6.4.7.13	1,268,841.08	2,763,082.67
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	5,778,957.50	1,673,863.72
股利收益	6.4.7.16	2,309,997.21	1,241,027.00
3.公允价值变动收益（损失以“-”号	6.4.7.17	-18,320,989.54	75,513,426.18

填列)			
4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列)		-1,251,712.11	-754,158.84
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	6.4.7.18	-370,609.33	560,669.74
减: 二、费用		4,442,954.63	1,947,571.01
1. 管理人报酬		3,187,901.05	1,296,615.20
2. 托管费		996,219.06	405,192.20
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	67,411.56	79,136.04
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		25,372.07	15,973.00
7. 其他费用	6.4.7.20	166,050.89	150,654.57
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)		81,778,954.43	79,001,385.10
减: 所得税费用		-	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)		81,778,954.43	79,001,385.10

6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: 广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期: 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	404,052,541.00	651,360,065.85	1,055,412,606.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	81,778,954.43	81,778,954.43
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-177,000,000.00	-298,841,735.45	-475,841,735.45
其中: 1. 基金申购款	11,000,000.00	18,137,852.41	29,137,852.41
2. 基金赎回款	-188,000,000.00	-316,979,587.86	-504,979,587.86
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 (净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	227,052,541.00	434,297,284.83	661,349,825.83
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计

一、期初所有者权益（基金净值）	16,052,541.00	15,145,101.06	31,197,642.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	79,001,385.10	79,001,385.10
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	251,000,000.00	237,842,149.47	488,842,149.47
其中：1.基金申购款	264,000,000.00	252,857,252.16	516,857,252.16
2.基金赎回款	-13,000,000.00	-15,015,102.69	-28,015,102.69
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	267,052,541.00	331,988,635.63	599,041,176.63

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：

基金管理人负责人：孙树明，主管会计工作负责人：窦刚，会计机构负责人：张晓章

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金(“本基金”)经中国证券监督管理委员会(“中国证监会”)证监许可[2015]275 号文核准，由广发基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》等有关规定和《广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》(“基金合同”)发起，于 2015 年 6 月 10 日募集成立。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司，境外资产托管人为中国银行纽约分行。

本基金募集期为 2015 年 5 月 20 日至 2015 年 6 月 2 日，本基金为交易型开放式基金，存续期限不定，募集资金总额为人民币 263,052,541.00 元，有效认购户数为 3,617 户。其中，认购资金在募集期间产生的利息共计人民币 10,541.00 元，折合基金份额 10,541.00 份，按照基金合同的有关约定计入基金份额持有人的基金账户。本基金募集资金经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验资。

本基金的财务报表于 2021 年 8 月 26 日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则（以下简称“企业会计准则”）和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国

证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年上半年的经营成果和基金净值变动情况。

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

本基金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

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

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。金融商品转让，按照卖出价扣除买入价后的余额为销售额。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，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 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，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

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，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3% 和 2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	57,314,232.89
定期存款	-
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	-
合计	57,314,232.89

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	437,919,989.35	581,434,212.19	143,514,222.84
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	7,100,760.19	9,220,161.57	2,119,401.38
其他	-	-	-
合计	445,020,749.54	590,654,373.76	145,633,624.22

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 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	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	54,268,180.57	-	-	-
其中：股指期货投资	54,268,180.57	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	54,268,180.57	-	-	-

注：期货投资采用当日无负债结算制度，结算准备金已包括所持期货合约产生的持仓损益，因此衍生金融工具项下的期货投资与相关的期货暂收款结算所得的持仓损益之间按抵销后的净额列示，为人民币零元。本报告期末本基金投资的期货持仓和损益明细为：NASDAQ 100 E-MINI Sep21 买入持仓量 30 手，合约市值人民币 55,943,032.56 元，公允价值变动人民币 1,674,851.99 元。

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

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	4,828.98
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	2.53
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	-
合计	4,831.51

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
其他应收款	-
待摊费用	213,045.31
合计	213,045.31

6.4.7.7 应付交易费用

本基金本报告期末无应付交易费用。

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 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	-
预提费用	76,367.52
应付替代款	5,772,635.10
合计	5,849,002.62

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	404,052,541.00	404,052,541.00
本期申购	11,000,000.00	11,000,000.00
本期赎回 (以“-”号填列)	-188,000,000.00	-188,000,000.00
本期末	227,052,541.00	227,052,541.00

6.4.7.10 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	339,909,937.13	311,450,128.72	651,360,065.85
本期利润	100,099,943.97	-18,320,989.54	81,778,954.43
本期基金份额交易产生的变动数	-170,362,973.79	-128,478,761.66	-298,841,735.45
其中：基金申购款	11,660,361.87	6,477,490.54	18,137,852.41
基金赎回款	-182,023,335.66	-134,956,252.20	-316,979,587.86
本期已分配利润	-	-	-
本期末	269,646,907.31	164,650,377.52	434,297,284.83

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
	活期存款利息收入
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	2,060.99
其他	-
合计	40,693.77

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
	卖出股票成交总额
减：卖出股票成本总额	418,673,770.46
买卖股票差价收入	96,766,730.48

6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
	卖出/赎回基金成交总额
减：卖出/赎回基金成本总额	5,986,284.65

基金投资收益	1,268,841.08
--------	--------------

6.4.7.14 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股指期货投资收益	5,778,957.50

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,309,997.21
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	2,309,997.21

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1.交易性金融资产	-18,857,542.58
——股票投资	-19,730,134.29
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	872,591.71
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	536,553.04
——权证投资	-
——股指期货	536,553.04
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	-18,320,989.54

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	-370,609.33

合计	-370,609.33
----	-------------

注：替代损益是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购（赎回）本基金时，补入（卖出）被替代股票的实际买入成本（实际卖出金额）与申购（赎回）确认日估值的差额或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购（赎回）确认日估值的差额。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	59,668.68
银行间市场交易费用	-
期货交易费用	7,742.88
合计	67,411.56

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	16,860.15
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	8,989.15
指数使用费	80,694.22
合计	166,050.89

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或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害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
中国银行股份有限公司	基金托管人
广发基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人

中国银行纽约分行	基金境外资产托管人
广发证券股份有限公司	基金管理人控股股东、代销机构

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

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.4 基金交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的基金交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间内无应支付关联方的佣金，本报告期末及上年度可比期间末无应付关联方佣金余额。

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 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,187,901.05	1,296,615.20
其中：支付销售机构的客户维护费	55,775.25	22,656.79

注：基金管理人的基金管理费按基金资产净值的[0.80%]年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的[0.80%]年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times [0.80\%] \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年6月30日	2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	996,219.06	405,192.20

注：基金托管人的基金托管费按基金资产净值的[0.25%]年费率计提。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的[0.25%]年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times [0.25\%] \div \text{当年天数}$$

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，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间内无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

本基金本报告期内及上年度可比期间内无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。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间内无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。

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

本报告期内及上年度可比期间内基金管理人无运用自有资金投资本基金的情况。

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 2021年6月30日		上年度末 2020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
广发证券股份有 限公司	361,917.00	0.16%	433,099.00	0.11%

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	33,407,066.98	38,632.78	14,451,184.49	47,649.80
中国银行纽约分行	23,907,165.91	-	10,627,158.79	4,604.75

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行股份有限公司和境外资产托管人中国银行纽约分行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2021 年 6 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

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金无因认购新发/增发证券而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

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金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

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2021 年 6 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

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要是信用风险、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。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人奉行全面风险管理的理念，在董事会下设立合规及风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由合规稽核部、金融工程与风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。合规稽核部、金融工程与风险管理部对公司总经理负责。本基金管理人建立了以合规及风险管理委员会为核心的、由总经理和风险控制委员会、督察长、合规稽核部、金融工程与风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险指由于在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或所投资证券之发行人出现违约、无法支付到期本息，或由于债券发行人信用等级降低导致债券价格下降，将对基金资产造成的损失。为了防范信用风险，本基金主要投资于信用等级较高的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。但是，随着短期资金市场的发展，本基金的投资范围扩大以后，可能会在一定程度上增加信用风险。

本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，违约风险较小；银行间同业市场主要通过对交易对手进行风险评估防范相应的信用风险。本基金管理人认为与应收证券清算款相关的信用风险不重大。本基金本报告期末及上年度末未持有债券、资产支持证券、同业存单，因此无相关重大信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险指因市场交易不活跃，基金资产无法以适当价格及时变现的风险或基金无法应付基金赎回支付的要求所引起的风险。本基金坚持组合持有、分散投资的原则，基金管理人根据市场运行情况和基金运行情况制订本基金的风险控制目标和方法，具体计算与分析各类风险控制指标，从而对流动性风险进行监控和防范。

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，除在附注 6.4.12 中列示的流通暂时受限的证券外，本基金所持大部分投资品种均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，资产变现能力强。本基金持有的其他资产主要为银行存款等期限短、流动性强的品种。本基金的负债水平也严格按照基金合同及中国证监会相关规定进行管理，因此无重大流动性风险。

此外，本基金申购赎回采用一篮子股票的形式，流动性风险低于其他类型基金。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金投资标的为具有良好流动性的金融工具，主要投资品种均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，本身具有较好的流动性；在投资限制中采取多种措施保障本基金分散投资；同时，

本基金投资策略成熟，能够支持不同市场情形下的投资者赎回要求。实际投资中，本基金投资组合的流动性能够与本基金申购和赎回的安排相匹配。

综上所述，本基金的流动性良好，无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

基金的市场风险是指由于证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理等各种因素的影响，导致基金收益水平变化而产生的风险，反映了基金资产中金融工具或证券价值对市场参数变化的敏感性。一般来讲，市场风险是开放式基金面临的重大风险，也往往是众多风险中最基本和最常见，也是最难防范的风险，其他如流动性风险最终是因为市场风险在起作用。市场风险包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金管理人通过久期、凸性、风险价值模型（VAR）等方法来评估投资组合中债券的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产：					
银行存款	57,314,232.89	-	-	-	57,314,232.89
结算备付金	-	-	-	15,416,029.92	15,416,029.92
交易性金融资产	-	-	-	590,654,373.76	590,654,373.76
应收证券清算款	-	-	-	4,256,499.29	4,256,499.29
应收利息	-	-	-	4,831.51	4,831.51
应收股利	-	-	-	62,307.02	62,307.02
其他资产	-	-	-	213,045.31	213,045.31
资产总计	57,314,232.89	-	-	610,607,086.81	667,921,319.70
负债：					
应付管理人报酬	-	-	-	456,477.62	456,477.62
应付托管费	-	-	-	142,649.24	142,649.24
应交税费	-	-	-	123,364.39	123,364.39
其他负债	-	-	-	5,849,002.62	5,849,002.62
负债总计	-	-	-	6,571,493.87	6,571,493.87

利率敏感度缺口	57,314,232.89	-	-	604,035,592.94	661,349,825.83
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产：					
银行存款	81,461,812.71	-	-	-	81,461,812.71
结算备付金	40,899.44	-	-	15,519,072.72	15,559,972.16
交易性金融资产	-	-	-	991,430,006.34	991,430,006.34
应收证券清算款	-	-	-	7,493,582.48	7,493,582.48
应收利息	-	-	-	1,155.38	1,155.38
应收股利	-	-	-	213,707.10	213,707.10
资产总计	81,502,712.15	-	-	1,014,657,524.02	1,096,160,236.17
负债：					
应付管理人报酬	-	-	-	722,787.04	722,787.04
应付托管费	-	-	-	225,870.95	225,870.95
应交税费	-	-	-	509,489.44	509,489.44
其他负债	-	-	-	39,289,481.89	39,289,481.89
负债总计	-	-	-	40,747,629.32	40,747,629.32
利率敏感度缺口	81,502,712.15	-	-	973,909,894.70	1,055,412,606.85

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

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未持有债券资产（不含可转债、可交换债），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			
	2021年6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				
银行存款	49,996,630.80	-	-	49,996,630.80
结算备付金	15,416,029.92	-	-	15,416,029.92
交易性金融资产	590,654,373.76	-	-	590,654,373.76
应收证券清算款	4,256,499.29	-	-	4,256,499.29
应收利息	56.40	-	-	56.40
应收股利	62,307.02	-	-	62,307.02
其他资产	213,045.31	-	-	213,045.31
资产合计	660,598,942.50	-	-	660,598,942.50
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	660,598,942.50	-	-	660,598,942.50
项目	上年度末			
	2020年12月31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				
银行存款	38,309,365.06	-	-	38,309,365.06
结算备付金	15,519,072.72	-	-	15,519,072.72
交易性金融资产	991,430,006.34	-	-	991,430,006.34
应收证券清算款	7,493,582.48	-	-	7,493,582.48
应收利息	29.88	-	-	29.88

应收股利	213,707.10	-	-	213,707.10
资产合计	1,052,965,763.58	-	-	1,052,965,763.58
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	1,052,965,763.58	-	-	1,052,965,763.58

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
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 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
	所有外币相对人民币升值 5%	33,029,947.13	52,648,288.18
	所有外币相对人民币贬值 5%	-33,029,947.13	-52,648,288.18

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。本基金管理人通过采用 Barra 风险管理系统，以及标准差、跟踪误差、beta 值、风险价值模型（VAR）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

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		上年度末 2020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	581,434,212.19	87.92	986,014,880.91	93.42
交易性金融资产—基金投资	9,220,161.57	1.39	5,415,125.43	0.51
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	590,654,373.76	89.31	991,430,006.34	93.94

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
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 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	上升 5%	33,392,612.19	50,480,830.05
	下降 5%	-33,392,612.19	-50,480,830.05

注：上年度末的假设条件为“除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变”。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1、公允价值

(1) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值接近于公允价值。

(2) 以公允价值计量的金融工具

(i) 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。

(ii) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 590,654,373.76 元，无属于第二层次和第三层次的金额（2020 年 12 月 31 日：属于第一层次的余额为人民币 991,430,006.34 元，无属于第二层次和第三层次的金额）。

(iii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别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证券的公允价值列

入第二层次或第三层次，上述事项解除时将相关证券的公允价值列入第一层次。

2、除公允价值外，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	581,434,212.19	87.05
	其中：普通股	571,633,296.73	85.58
	存托凭证	9,800,915.46	1.47
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	9,220,161.57	1.38
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	72,730,262.81	10.89
8	其他各项资产	4,536,683.13	0.68
9	合计	667,921,319.70	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 7.2 的合计项不含可退替代款估值增值。

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	581,434,212.19	87.92

合计	581,434,212.19	87.92
----	----------------	-------

注：1、国家（地区）类别根据股票及存托凭证所在的证券交易所确定。

2、ADR、GDR 按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

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（%）
金融	-	-
原材料	-	-
能源	-	-
房地产	-	-
信息技术	286,973,128.27	43.39
通信服务	112,804,367.12	17.06
非日常生活消费品	112,394,736.71	16.99
医疗保健	33,213,525.38	5.02
日常消费品	23,335,162.37	3.53
工业	8,519,937.30	1.29
公用事业	4,193,355.04	0.63
合计	581,434,212.19	87.92

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

7.4 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	Apple Inc	苹果公司	AAPL US	纳斯达 克证券 交易所	美国	92,931.00	82,223,053.03	12.43
2	Microsoft Corp	微软	MSFT US	纳斯达 克证券 交易所	美国	39,598.00	69,298,127.08	10.48
3	Amazon.c om Inc	亚马逊公 司	AMZN US	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,632.00	58,492,982.69	8.84
4	Alphabet Inc	Alphabet 公司	GOOG US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,711.00	27,702,934.17	4.19

			GOOGL US	纳斯达克 证券交易所	美国	1,374.00	21,673,761.21	3.28
5	Tesla Inc	特斯拉公 司	TSLA US	纳斯 达克证 券交易 所	美国	6,066.00	26,635,381.20	4.03
6	Facebook Inc	Facebook 公司	FB US	纳斯 达克证 券交易 所	美国	10,290.00	23,113,823.71	3.49
7	NVIDIA Corp	英伟达	NVDA US	纳斯 达克证 券交易 所	美国	3,395.00	17,547,824.80	2.65
8	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	6,658.00	12,536,947.07	1.90
9	Adobe Inc	奥多比	ADBE US	纳斯 达克证 券交易 所	美国	2,688.00	10,169,491.49	1.54
10	Comcast Corp	康卡斯特	CMCSA US	纳斯 达克证 券交易 所	美国	24,882.00	9,165,406.67	1.39
11	Intel Corp	英特尔	INTC US	纳斯 达克证 券交易 所	美国	24,650.00	8,939,815.85	1.35
12	Netflix Inc	奈飞公司	NFLX US	纳斯 达克证 券交易 所	美国	2,413.00	8,233,854.37	1.25
13	Cisco Systems Inc/Delaw are	思科-T	CSCO US	纳斯 达克证 券交易 所	美国	23,490.00	8,042,630.70	1.22
14	PepsiCo Inc	百事可乐	PEP US	纳斯 达克证 券交易 所	美国	7,609.00	7,283,281.67	1.10
15	Broadcom Inc	博通股份 有限公司	AVGO US	纳斯 达克证 券交易 所	美国	2,173.00	6,693,783.26	1.01
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	7,026.00	6,573,640.00	0.99
17	Texas Instrumen ts Inc	德州仪器	TXN US	纳斯 达克证 券交易 所	美国	5,215.00	6,478,475.75	0.98
18	Costco	开市客	COST US	纳斯 达克证 券交易 所	美国	2,449.00	6,259,809.96	0.95

	Wholesale Corp			克证券交易所				
19	QUALCOMM Inc	高通公司	QCOM US	纳斯达克证券交易所	美国	6,383.00	5,893,692.58	0.89
20	Charter Communications Inc	查特通信公司	CHTR US	纳斯达克证券交易所	美国	1,159.00	5,401,680.77	0.82
21	Amgen Inc	-	AMGN US	纳斯达克证券交易所	美国	3,312.00	5,215,238.73	0.79
22	Applied Materials Inc	应用材料	AMAT US	纳斯达克证券交易所	美国	5,133.00	4,721,940.33	0.71
23	Starbucks Corp	星巴克	SBUX US	纳斯达克证券交易所	美国	6,504.00	4,697,863.79	0.71
24	Intuit Inc	Intuit 公司	INTU US	纳斯达克证券交易所	美国	1,364.00	4,319,170.40	0.65
25	Intuitive Surgical Inc	直觉外科手术公司	ISRG US	纳斯达克证券交易所	美国	697.00	4,140,853.56	0.63
26	Advanced Micro Devices Inc	AMD 公司	AMD US	纳斯达克证券交易所	美国	6,222.00	3,775,492.13	0.57
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	238.00	3,364,196.69	0.51
28	Mondelez International Inc	亿滋国际	MDLZ US	纳斯达克证券交易所	美国	7,979.00	3,218,478.41	0.49
29	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	5,824.00	3,197,255.43	0.48
30	Zoom Video Communications Inc	-	ZM US	纳斯达克证券交易所	美国	1,239.00	3,097,812.85	0.47
31	Gilead Sciences Inc	吉利德科学	GILD US	纳斯达克证券交易所	美国	6,947.00	3,090,320.75	0.47

32	Automatic Data Processing Inc	ADP 公司	ADP US	纳斯达克证券交易所	美国	2,373.00	3,044,808.31	0.46
33	Lam Research Corp	泛林集团	LRCX US	纳斯达克证券交易所	美国	713.00	2,997,157.58	0.45
34	JD.com Inc	京东集团	JD US	纳斯达克证券交易所	美国	5,411.00	2,789,806.52	0.42
35	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	769.00	2,774,724.45	0.42
36	MercadoLibre Inc	Mercadolibre 股份有限公司	MELI US	纳斯达克证券交易所	美国	271.00	2,727,202.86	0.41
37	Moderna Inc	莫德纳公司	MRNA US	纳斯达克证券交易所	美国	1,773.00	2,691,403.89	0.41
38	CSX Corp	CSX 公司	CSX US	纳斯达克证券交易所	美国	12,831.00	2,659,096.54	0.40
39	Fiserv Inc	Fiserv 公司	FISV US	纳斯达克证券交易所	美国	3,812.00	2,632,262.58	0.40
40	Activision Blizzard Inc	动视暴雪股份有限公司	ATVI US	纳斯达克证券交易所	美国	4,172.00	2,572,254.71	0.39
41	Autodesk Inc	欧特克	ADSK US	纳斯达克证券交易所	美国	1,314.00	2,477,813.99	0.37
42	Pinduoduo Inc	拼多多	PDD US	纳斯达克证券交易所	美国	3,005.00	2,465,788.52	0.37
43	Baidu Inc	百度	BIDU US	纳斯达克证券交易所	美国	1,728.00	2,276,146.47	0.34
44	Analog Devices Inc	亚德诺半导体	ADI US	纳斯达克证券交易所	美国	2,043.00	2,272,164.98	0.34
45	eBay Inc	eBay 公司	EBAY US	纳斯达克证券交易所	美国	4,894.00	2,219,740.36	0.34

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	1,666.00	2,214,066.97	0.33
47	Illumina Inc	Illumina 公司	ILMN US	纳斯达克证券交易所	美国	716.00	2,188,800.49	0.33
48	Biogen Inc	百健	BIIB US	纳斯达克证券交易所	美国	932.00	2,084,826.99	0.32
49	DocuSign Inc	DocuSign 股份有限公司	DOCU US	纳斯达克证券交易所	美国	1,123.00	2,028,194.33	0.31
50	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	492.00	2,007,299.07	0.30
51	KLA Corp	KLA 公司	KLAC US	纳斯达克证券交易所	美国	938.00	1,964,574.42	0.30
52	Dexcom Inc	Dexcom 股份有限公司	DXCM US	纳斯达克证券交易所	美国	659.00	1,817,826.92	0.27
53	Monster Beverage Corp	怪兽饮料公司	MNST US	纳斯达克证券交易所	美国	3,037.00	1,792,225.22	0.27
54	Vertex Pharmaceuticals Inc	福泰制药	VRTX US	纳斯达克证券交易所	美国	1,361.00	1,772,770.50	0.27
55	Kraft Heinz Co/The	卡夫亨氏公司	KHC US	纳斯达克证券交易所	美国	6,669.00	1,756,900.55	0.27
56	Lululemon Athletica Inc	Lululemon Athletica 股份有限公司	LULU US	纳斯达克证券交易所	美国	735.00	1,732,940.88	0.26
57	Walgreens Boots Alliance Inc	沃博联公司	WBA US	纳斯达克证券交易所	美国	4,811.00	1,635,094.66	0.25
58	NetEase Inc	网易	NTES US	纳斯达克证券交易所	美国	2,170.00	1,615,622.56	0.24
59	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	436.00	1,594,789.12	0.24

60	Synopsys Inc	新思科技公司	SNPS US	纳斯达克证券交易所	美国	889.00	1,583,869.94	0.24
61	Alexion Pharmaceuticals Inc	亚力兄弟制药公司	ALXN US	纳斯达克证券交易所	美国	1,315.00	1,560,622.24	0.24
62	Exelon Corp	Exelon 公司	EXC US	纳斯达克证券交易所	美国	5,415.00	1,550,027.67	0.23
63	Ross Stores Inc	Ross 商店有限公司	ROST US	纳斯达克证券交易所	美国	1,903.00	1,524,402.72	0.23
64	Marriott International Inc/MD	万豪国际	MAR US	纳斯达克证券交易所	美国	1,717.00	1,514,278.71	0.23
65	Cintas Corp	CINTAS 公司	CTAS US	纳斯达克证券交易所	美国	611.00	1,507,800.26	0.23
66	Workday Inc	Workday 股份有限公司	WDAY US	纳斯达克证券交易所	美国	973.00	1,500,642.60	0.23
67	Align Technology Inc	Align 科技股份有限公司	ALGN US	纳斯达克证券交易所	美国	377.00	1,488,064.65	0.23
68	American Electric Power Co Inc	美国电力	AEP US	纳斯达克证券交易所	美国	2,697.00	1,473,802.24	0.22
69	Electronic Arts Inc	电子艺界	EA US	纳斯达克证券交易所	美国	1,568.00	1,456,916.89	0.22
70	ASML Holding NV	阿斯麦控股公司	ASML US	纳斯达克证券交易所	美国	325.00	1,450,441.03	0.22
71	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	1,625.00	1,436,290.18	0.22
72	Keurig Dr Pepper Inc	Keurig 彭泉思蓝宝公司	KDP US	纳斯达克证券交易所	美国	6,103.00	1,389,371.90	0.21
73	Cognizant Technology	高知特科技公司	CTSH US	纳斯达克证券交易所	美国	3,072.00	1,374,494.29	0.21

	Solutions Corp							
74	Paychex Inc	Paychex 公司	PAYX US	纳斯达克证券交易所	美国	1,893.00	1,312,168.41	0.20
75	Peloton Interactive Inc	-	PTON US	纳斯达克证券交易所	美国	1,559.00	1,249,042.12	0.19
76	Xilinx Inc	赛灵思	XLNX US	纳斯达克证券交易所	美国	1,294.00	1,209,099.19	0.18
77	PACCAR Inc	帕卡	PCAR US	纳斯达克证券交易所	美国	2,070.00	1,193,487.32	0.18
78	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	1,224.00	1,184,018.50	0.18
79	Xcel Energy Inc	Xcel 能源	XEL US	纳斯达克证券交易所	美国	2,748.00	1,169,525.13	0.18
80	Match Group Inc	Match Group 股份有限公司	MTCH US	纳斯达克证券交易所	美国	1,094.00	1,139,610.09	0.17
81	Skyworks Solutions Inc	思佳讯解决方案公司	SWKS US	纳斯达克证券交易所	美国	913.00	1,130,955.17	0.17
82	ANSYS Inc	ANSYS 股份有限公司	ANSS US	纳斯达克证券交易所	美国	501.00	1,123,263.20	0.17
83	Okta Inc	-	OKTA US	纳斯达克证券交易所	美国	682.00	1,078,008.26	0.16
84	Fastenal Co	快扣公司	FAST US	纳斯达克证券交易所	美国	3,199.00	1,074,624.71	0.16
85	Sirius XM Holdings Inc	Sirius XM 控股公司	SIRI US	纳斯达克证券交易所	美国	25,168.00	1,063,324.19	0.16
86	Verisk Analytics Inc	Verisk 分析公司	VRSK US	纳斯达克证券交易所	美国	941.00	1,062,114.86	0.16
87	Marvell Technology Inc	-	MRVL US	纳斯达克证券交易所	美国	2,795.00	1,053,205.28	0.16

88	Copart Inc	Copart 股份有限公司	CPRT US	纳斯达克证券交易所	美国	1,201.00	1,022,813.61	0.15
89	VeriSign Inc	威瑞信股份有限公司	VRSN US	纳斯达克证券交易所	美国	670.00	985,503.11	0.15
90	Atlassian Corp PLC	Atlassian 公共有限公司	TEAM US	纳斯达克证券交易所	美国	583.00	967,395.97	0.15
91	Maxim Integrated Products Inc	美信	MXIM US	纳斯达克证券交易所	美国	1,334.00	907,968.61	0.14
92	Splunk Inc	Splunk 公司	SPLK US	纳斯达克证券交易所	美国	929.00	867,687.17	0.13
93	Seagen Inc	Seagen 股份有限公司	SGEN US	纳斯达克证券交易所	美国	835.00	851,633.69	0.13
94	Cerner Corp	塞纳公司	CERN US	纳斯达克证券交易所	美国	1,669.00	842,713.84	0.13
95	Fox Corp	福克斯公司	FOXA US	纳斯达克证券交易所	美国	2,057.00	493,399.25	0.07
			FOX US	纳斯达克证券交易所	美国	1,416.00	321,992.06	0.05
96	Dollar Tree Inc	Dollar Tree 公司	DLTR US	纳斯达克证券交易所	美国	1,140.00	732,769.14	0.11
97	CDW Corp/DE	特拉华 CDW 公司	CDW US	纳斯达克证券交易所	美国	625.00	705,160.29	0.11
98	Incyte Corp	因赛特公司	INCY US	纳斯达克证券交易所	美国	1,263.00	686,425.61	0.10
99	Trip.com Group Ltd	携程集团	TCOM US	纳斯达克证券交易所	美国	2,853.00	653,551.39	0.10
100	Check Point Software Technologies Ltd	Check Point 软件技术有限公司	CHKP US	纳斯达克证券交易所	美国	715.00	536,401.16	0.08

注：此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

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	Apple Inc	AAPL US	2,981,436.40	0.28
2	Microsoft Corp	MSFT US	2,603,023.33	0.25
3	Amazon.com Inc	AMZN US	2,307,241.30	0.22
4	Pinduoduo Inc	PDD US	2,142,042.89	0.20
5	Alphabet Inc	GOOG US	1,051,305.94	0.10
		GOOGL US	1,003,808.05	0.10
6	Facebook Inc	FB US	1,054,617.92	0.10
7	Tesla Inc	TSLA US	994,341.17	0.09
8	Peloton Interactive Inc	PTON US	858,101.74	0.08
9	NVIDIA Corp	NVDA US	755,340.25	0.07
10	Moderna Inc	MRNA US	744,142.73	0.07
11	Match Group Inc	MTCH US	707,076.68	0.07
12	Okta Inc	OKTA US	692,887.98	0.07
13	Keurig Dr Pepper Inc	KDP US	676,977.59	0.06
14	Marvell Technology Inc	MRVL US	629,167.68	0.06
15	PayPal Holdings Inc	PYPL US	624,615.77	0.06
16	Comcast Corp	CMCSA US	534,481.76	0.05
17	Align Technology Inc	ALGN US	507,161.42	0.05
18	Adobe Inc	ADBE US	504,370.46	0.05
19	Intel Corp	INTC US	487,164.22	0.05
20	Netflix Inc	NFLX US	480,416.95	0.05

注：本项及下项 7.5.2、7.5.3 的买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，此外，“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5.2 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	Apple Inc	AAPL US	61,802,661.32	5.86

2	Microsoft Corp	MSFT US	52,166,512.46	4.94
3	Amazon.com Inc	AMZN US	43,209,612.43	4.09
4	Alphabet Inc	GOOG US	20,497,926.99	1.94
		GOOGL US	17,665,590.41	1.67
5	Tesla Inc	TSLA US	22,577,129.21	2.14
6	Facebook Inc	FB US	18,229,998.51	1.73
7	NVIDIA Corp	NVDA US	14,320,646.72	1.36
8	PayPal Holdings Inc	PYPL US	12,092,144.88	1.15
9	Comcast Corp	CMCSA US	9,901,318.03	0.94
10	Intel Corp	INTC US	9,757,065.11	0.92
11	Netflix Inc	NFLX US	9,487,551.17	0.90
12	Adobe Inc	ADBE US	9,445,930.54	0.89
13	Cisco Systems Inc/Delaware	CSCO US	8,332,881.02	0.79
14	PepsiCo Inc	PEP US	7,787,621.56	0.74
15	Broadcom Inc	AVGO US	7,329,758.07	0.69
16	T-Mobile US Inc	TMUS US	6,553,026.24	0.62
17	Texas Instruments Inc	TXN US	6,518,264.19	0.62
18	Costco Wholesale Corp	COST US	6,495,914.29	0.62
19	QUALCOMM Inc	QCOM US	6,388,942.04	0.61
20	Amgen Inc	AMGN US	5,540,581.62	0.52

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	33,823,236.03
卖出收入（成交）总额	515,440,500.94

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

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

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	股指期货	NASDAQ 100 E-MINI Sep21	0.00	0.00

注：期货投资采用当日无负债结算制度，结算准备金已包括所持期货合约产生的持仓损益，因此衍生金融工具项下的期货投资与相关的期货暂收款结算所得的持仓损益之间按抵销后的净额列示，为人民币零元。本报告期末本基金投资的期货持仓和损益明细为：NASDAQ 100 E-MINI Sep21 买入持仓量 30 手，合约市值人民币 55,943,032.56 元，公允价值变动人民币 1,674,851.99 元。

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

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	ProShares UltraPro QQQ	ETF 基金	开放式	ProShare Advisors LLC	9,220,161.57	1.39

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，特斯拉在报告编制日前一年内曾受到美国国家公路交通安全管理局的处罚。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.11.2 本报告期内，基金投资的前十名股票未出现超出基金合同规定的备选股票库的情形。

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	应收证券清算款	4,256,499.29
3	应收股利	62,307.02
4	应收利息	4,831.51
5	应收申购款	-

6	其他应收款	-
7	待摊费用	213,045.31
8	其他	-
9	合计	4,536,683.13

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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
10,326	21,988.43	73,113,212.00	32.20%	153,939,329.00	67.80%

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	上海威海储运中心	12,568,400.00	5.54%
2	林晓辉	10,051,500.00	4.43%
3	野村新加坡有限公司-自有资金	8,403,171.00	3.70%
4	法国兴业银行	7,651,874.00	3.37%
5	太平资管-建设银行-太平资产量化 10 号 资管产品	6,170,400.00	2.72%
6	太平资产-工商银行-太平之星量化 2 号 资管产品	6,015,648.00	2.65%
7	黄志霖	6,007,300.00	2.65%
8	太平资管-建设银行-太平资产量化 9 号 资管产品	5,586,500.00	2.46%
9	常州投资集团有限公司	5,283,500.00	2.33%
10	太平资产-建设银行-太平资产量化 3 号 权益型资管产品	5,042,000.00	2.22%

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	0.00	0.0000%

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（2015 年 6 月 10 日）基金份额总额	263,052,541.00
本报告期期初基金份额总额	404,052,541.00
本报告期基金总申购份额	11,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	188,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	227,052,541.00

10 重大事件揭示**10.1 基金份额持有人大会决议**

本报告期内未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，本基金管理人、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

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、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

本报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

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

本报告期内，本基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	
China International Capital Corporation Limited	-	57,255,929.78	10.42%	7,725.78	14.31%	-
Citigroup	-	492,007,807.01	89.58%	46,262.85	85.69%	-
Credit Suisse	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs Group Inc.	-	-	-	-	-	-
State Street Global Markets International Ltd.	-	-	-	-	-	-

注：1、为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

- i.财务状况良好，经营状况稳定，信誉良好，符合监管标准；
- ii.研究实力较强，分析报告质量高，准确及时，同时报告覆盖范围广泛；
- iii.交易执行能力强，交易效率高，能保证较佳成交价格，及时反馈交易结果；
- iv.清算和交割能力强，能确保流程顺畅以及结果准确；
- v.能与服务匹配的合理的佣金和收费标准；
- vi.经营行为规范，有健全的内部控制制度；
- vii.具备高效、安全的通讯条件。

2、券商专用交易单元选择程序：

i.本基金管理人组织相关部门人员，根据经纪商选择原则与标准对交易单元候选经纪商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用的交易单元经纪商。

ii.本基金管理人与选用的交易单元经纪商签署交易单元租用协议，并通知基金托管人。

iii. 本基金管理人定期对经纪商的服务进行评分, 可根据结果调整交易分配比例以及更换经纪商。

3、此处股票交易含股票、存托凭证及信托凭证交易, 佣金指基金通过单一券商进行股票、基金等交易而合计支付该券商的佣金合计。

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
China International Capital Corporation Limited	-	-	-	-	-	-	4,717,516.20	29.10%
Citigroup	-	-	-	-	-	-	11,494,403.86	70.90%
Credit Suisse	-	-	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs Group Inc.	-	-	-	-	-	-	-	-
State Street Global Markets International Ltd.	-	-	-	-	-	-	-	-

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	关于广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金暂停申购与赎回业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-01-14
2	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-01-21
3	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-03-30
4	关于广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金暂停申购与赎回业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-03-31
5	关于旗下部分基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》修改基金合同等法律文件的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-03-31

6	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-04-21
7	关于广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金暂停申购与赎回业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-05-27

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 影响投资者决策的其他重要信息

根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》和《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》等法律法规的规定和基金合同的约定，经与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，本公司决定自 2021 年 3 月 31 日起，对旗下部分基金的基金合同、托管协议等法律文件进行修订。详情可见基金管理人网站（www.gffunds.com.cn）刊登的《关于旗下部分基金根据〈公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引〉修改基金合同等法律文件的公告》。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件
2. 《广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
3. 《广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
4. 法律意见书
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照
6. 基金托管人业务资格批件、营业执照

12.2 存放地点

广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

12.3 查阅方式

1. 书面查阅：投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件；
2. 网站查阅：基金管理人网址 <http://www.gffunds.com.cn>。

广发基金管理有限公司

二〇二一年八月三十日