

**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：国泰基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年八月三十一日

## 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约定，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

<b>1 重要提示及目录</b> .....	2
1.1 重要提示.....	2
<b>2 基金简介</b> .....	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.....	6
2.4 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
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
<b>4 管理人报告</b> .....	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.....	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	16
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.....	17
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	17
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	18
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	18
4.8 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.....	18
<b>5 托管人报告</b> .....	18
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	18
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.....	19
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.....	19
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	19
6.1 资产负债表.....	19
6.2 利润表.....	20
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	21
6.4 报表附注.....	22
<b>7 投资组合报告</b> .....	40
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	41
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	41
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.....	42
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.....	42
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前五名权益投资明细.....	49
7.5 报告期内股票投资组合的重大变动.....	49
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	51
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.....	51
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.....	51
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.....	51
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.....	52
7.11 投资组合报告附注.....	52

<b>8 基金份额持有人信息</b> .....	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	53
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	53
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	54
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.....	54
<b>9 开放式基金份额变动</b> .....	54
<b>10 重大事件揭示</b> .....	54
10.1 基金份额持有人大会决议.....	54
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.....	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	54
10.4 基金投资策略的改变.....	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	55
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.....	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	55
10.8 其他重大事件.....	56
<b>11 备查文件目录</b> .....	57
11.1 备查文件目录.....	57
11.2 存放地点.....	57
11.3 查阅方式.....	57

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	国泰纳斯达克 100 (QDII-ETF)
场内简称	纳指 ETF
基金主代码	513100
交易代码	513100
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013 年 4 月 25 日
基金管理人	国泰基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	371,622,120.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2013 年 5 月 15 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	<p>本基金主要采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但因特殊情况（如成份股长期停牌、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量发生变化、成份股公司行为、市场流动性不足等）导致本基金管理人无法按照标的指数构成及权重进行同步调整时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。</p> <p>在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。</p> <p>另外，本基金基于流动性管理的需要，将投资于与本基金有相近的投资目标、投资策略、且以本基金的标的指数为投资标的的指数型公募基金（包括 ETF）。同时，为更好地实现本基金的投资目标，本基金还将在条件允许的情况下，开展证券借贷业务以及投资于股指期货等金融衍生品，以期降低跟踪误差水平。本基金投资于金融衍生品的目标是替代跟踪标的指数的成份股，使基金的投资组合更紧密地跟踪标的指数。不得应用于投机交易目的，或用作杠杆工具放大基金的投资。</p>
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数收益率（经汇率调整后的总收益指数收益率）。本基金的标的指数为纳斯达克 100 指数（Nasdaq-100 Index）。
风险收益特征	本基金属于股票型基金，预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收

	益特征。
--	------

### 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		国泰基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘国华	李申
	联系电话	021-31081600转	021-60637102
	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		(021)31089000, 400-888-8688	021-60637111
传真		021-31081800	021-60635778
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区 浦东大道1200号2层225室	北京市西城区金融大街25号
办公地址		上海市虹口区公平路18号8号 楼嘉昱大厦16层-19层	北京市西城区闹市口大街1号 院1号楼
邮政编码		200082	100033
法定代表人		邱军	田国立

### 2.4 境外资产托管人

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

### 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	<a href="http://www.gtfund.com">http://www.gtfund.com</a>
基金中期报告备置地点	上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层-19层和本基金托管人住所

### 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	26,528,808.14
本期利润	188,464,967.48
加权平均基金份额本期利润	0.5022
本期加权平均净值利润率	11.25%
本期基金份额净值增长率	11.46%
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	404,088,087.23
期末可供分配基金份额利润	1.0874
期末基金资产净值	1,792,944,770.63
期末基金份额净值	4.825
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	382.50%

注：（1）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

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

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 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	7.80%	0.78%	7.93%	0.78%	-0.13%	0.00%
过去三个月	9.24%	1.08%	9.50%	1.09%	-0.26%	-0.01%
过去六个月	11.46%	1.42%	12.22%	1.42%	-0.76%	0.00%
过去一年	30.30%	1.46%	31.73%	1.47%	-1.43%	-0.01%
过去三年	97.34%	1.68%	107.71%	1.70%	-10.37%	-0.02%
自基金合同生效起至今	382.50%	1.28%	483.83%	1.30%	-101.33%	-0.02%

注：同期业绩比较基准以人民币计价。

##### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比

较

纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金  
 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  
 (2013 年 4 月 25 日至 2021 年 6 月 30 日)



注：（1）本基金的合同生效日为 2013 年 4 月 25 日。本基金在 3 个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

（2）同期业绩比较基准以人民币计价。

## 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

国泰基金管理有限公司成立于 1998 年 3 月 5 日，是经中国证监会证监基字[1998]5 号文批准的首批规范的全国性基金管理公司之一。公司注册资本为 1.1 亿元人民币，公司注册地为上海，并在北京和深圳设有分公司。

截至 2021 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 179 只开放式证券投资基金：国泰金鹰增长灵活配置混合型证券投资基金、国泰金龙系列证券投资基金（包括 2 只子基金，分别为国泰金龙行业精选证券投资基金、国泰金龙债券证券投资基金）、国泰金马稳健回报证券投资基金、国泰货币市场证



券投资基金、国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金、国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金（由金鼎证券投资基金转型而来）、国泰金牛创新成长混合型证券投资基金、国泰沪深 300 指数证券投资基金（由国泰金象保本增值混合证券投资基金转型而来）、国泰双利债券证券投资基金、国泰区位优势混合型证券投资基金、国泰中小盘成长混合型证券投资基金（LOF）（由金盛证券投资基金转型而来）、国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金、国泰价值经典灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国泰事件驱动策略混合型证券投资基金、国泰信用互利债券型证券投资基金（由国泰信用互利分级债券型证券投资基金转型而来）、国泰成长优选混合型证券投资基金、国泰大宗商品配置证券投资基金（LOF）、国泰现金管理货币市场基金、国泰金泰灵活配置混合型证券投资基金（由国泰金泰平衡混合型证券投资基金变更注册而来，国泰金泰平衡混合型证券投资基金由金泰证券投资基金转型而来）、国泰民安增利债券型发起式证券投资基金、国证房地产行业指数证券投资基金（由国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金终止分级运作变更而来）、国泰估值优势混合型证券投资基金（LOF）（由国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金封闭期届满转换而来）、上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金、纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金、国泰中国企业境外高收益债券型证券投资基金、国泰黄金交易型开放式证券投资基金、国泰国证医药卫生行业指数证券投资基金（由国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金终止分级运作变更而来）、国泰聚信价值优势灵活配置混合型证券投资基金、国泰民益灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、国泰国策驱动灵活配置混合型证券投资基金、国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金、国泰安康定期支付混合型证券投资基金（由国泰安康养老定期支付混合型证券投资基金更名而来）、国泰金鑫股票型证券投资基金（由金鑫证券投资基金转型而来）、国泰新经济灵活配置混合型证券投资基金、国泰国证食品饮料行业指数证券投资基金（由国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金终止分级运作变更而来）、国泰国证有色金属行业指数证券投资基金（由国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金终止分级运作变更而来）、国泰睿吉灵活配置混合型证券投资基金、国泰兴益灵活配置混合型证券投资基金、国泰互联网+股票型证券投资基金、国泰央企改革股票型证券投资基金、国泰大健康股票型证券投资基金、国泰黄金交易型开放式证券投资基金联接基金、国泰融丰外延增长灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（由国泰融丰定增灵活配置混合型证券投资基金转换而来）、国泰国证新能源汽车指数证券投资基金（LOF）（由国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金转型而来，国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金由中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金转型而来）、国泰中证军工交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、国泰创业板指数证券投资基金（LOF）、国泰利是宝货币市场基金、国泰安益灵活配置混合型

证券投资基金、国泰普益灵活配置混合型证券投资基金、国泰润利纯债债券型证券投资基金、国泰润泰纯债债券型证券投资基金、国泰融信灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（由国泰融信定增灵活配置混合型证券投资基金转换而来）、国泰景气行业灵活配置混合型证券投资基金、国泰国证航天军工指数证券投资基金（LOF）、国泰民丰回报定期开放灵活配置混合型证券投资基金、国泰中证申万证券行业指数证券投资基金（LOF）、国泰策略价值灵活配置混合型证券投资基金（由国泰保本混合型证券投资基金变更而来）、国泰量化收益灵活配置混合型证券投资基金、国泰大农业股票型证券投资基金、国泰智能装备股票型证券投资基金、国泰融安多策略灵活配置混合型证券投资基金、国泰智能汽车股票型证券投资基金、上证 10 年期国债交易型开放式指数证券投资基金、国泰瞬利交易型货币市场基金、国泰民安增益纯债债券型证券投资基金（由国泰民安增益定期开放灵活配置混合型证券投资基金转型而来）、国泰聚优价值灵活配置混合型证券投资基金、国泰可转债债券型证券投资基金、国泰招惠收益定期开放债券型证券投资基金、国泰江源优势精选灵活配置混合型证券投资基金、国泰聚利价值定期开放灵活配置混合型证券投资基金、国泰量化成长优选混合型证券投资基金、国泰优势行业混合型证券投资基金、国泰价值精选灵活配置混合型证券投资基金、国泰瑞和纯债债券型证券投资基金、国泰嘉睿纯债债券型证券投资基金、国泰恒生港股通指数证券投资基金（LOF）、国泰聚禾纯债债券型证券投资基金、国泰丰祺纯债债券型证券投资基金、国泰利享中短债债券型证券投资基金、国泰多策略收益灵活配置混合型证券投资基金（由国泰新目标收益保本混合型证券投资基金变更而来）、国泰聚享纯债债券型证券投资基金、国泰丰盈纯债债券型证券投资基金、国泰量化策略收益混合型证券投资基金（由国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金变更而来，国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金由国泰目标收益保本混合型证券投资基金转型而来）、国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金（由国泰鑫保本混合型证券投资基金变更而来）、国泰价值优选灵活配置混合型证券投资基金、国泰金鹿混合型证券投资基金（由国泰金鹿保本增值混合证券投资基金转型而来）、国泰消费优选股票型证券投资基金、国泰惠盈纯债债券型证券投资基金、国泰润鑫定期开放债券型发起式证券投资基金（由国泰润鑫纯债债券型证券投资基金变更注册而来）、国泰惠富纯债债券型证券投资基金、国泰农惠定期开放债券型证券投资基金、国泰信利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰民福策略价值灵活配置混合型证券投资基金（由国泰民福保本混合型证券投资基金保本期到期变更而来）、国泰沪深 300 指数增强型证券投资基金（由国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金转型而来）、国泰中证生物医药交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国泰中证生物医药交易型开放式指数证券投资基金、国泰 CES 半导体芯片行业交易型开放式指数证券投资基金（由国泰 CES 半导体行业交易型开放式指数证券投资基金更名而来）、国泰中证 500 指数增强型证券投资基金（由国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金变更注册而

来)、国泰瑞安三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金、国泰民安养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金 (FOF)、国泰民利策略收益灵活配置混合型证券投资基金 (由国泰民利保本混合型证券投资基金保本期到期变更而来)、国泰兴富三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰惠丰纯债债券型证券投资基金、国泰惠融纯债债券型证券投资基金、国泰中证全指通信设备交易型开放式指数证券投资基金、国泰裕祥三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰中证全指通信设备交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰丰鑫纯债债券型证券投资基金、国泰盛合三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰惠信三年定期开放债券型证券投资基金、国泰鑫睿混合型证券投资基金、国泰 CES 半导体芯片行业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 (由国泰 CES 半导体行业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金更名而来)、国泰惠享三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰添瑞一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰研究精选两年持有期混合型证券投资基金、国泰聚盈三年定期开放债券型证券投资基金、国泰合融纯债债券型证券投资基金、国泰惠鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰中证煤炭交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证钢铁交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证煤炭交易型开放式指数证券投资基金、国泰鑫利一年持有期混合型证券投资基金、国泰中证钢铁交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证全指家用电器交易型开放式指数证券投资基金、国泰蓝筹精选混合型证券投资基金、国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证全指家用电器交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰聚鑫纯债债券型证券投资基金、国泰聚瑞纯债债券型证券投资基金、国泰大制造两年持有期混合型证券投资基金、国泰惠泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰宏益一年持有期混合型证券投资基金、国泰民泽平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、国泰致远优势混合型证券投资基金、国泰添福一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰浩益 18 个月封闭运作混合型证券投资基金、国泰惠瑞一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰上证综合交易型开放式指数证券投资基金、国泰医药健康股票型证券投资基金、国泰中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、国泰研究优势混合型证券投资基金、国泰民裕进取灵活配置混合型证券投资基金、国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (由国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金转型而来)、国泰中证医疗交易型开放式指数证券投资基金、国泰金福三个月定期开放混合型发起式证券投资基金、国泰上证综合交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰合益混合型证券投资基金、国泰中证全指软件交易型开放式指数证券投资基金、国泰通利 9 个月持有期混合型证券投资基金、国泰中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证畜牧

养殖交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证细分化工产业主题交易型开放式指数证券投资基金、国泰价值先锋股票型证券投资基金、国泰中证环保产业 50 交易型开放式指数证券投资基金、国泰成长价值混合型证券投资基金、国泰中证细分机械设备产业主题交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证 800 汽车与零部件交易型开放式指数证券投资基金、国泰同益 18 个月持有期混合型证券投资基金、国泰诚益混合型证券投资基金、国泰鑫享稳健 6 个月滚动持有债券型证券投资基金、国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰核心价值两年持有期股票型证券投资基金、国泰中证环保产业 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证细分机械设备产业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证全指建筑材料交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证有色金属交易型开放式指数证券投资基金、国泰佳益混合型证券投资基金、国泰利优 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金、国泰中证医疗交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证全指软件交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证细分化工产业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金。另外，本基金管理人于 2004 年获得全国社会保障基金理事会社保基金资产管理人资格，目前受托管理全国社保基金多个投资组合。2007 年 11 月 19 日，本基金管理人获得企业年金投资管理人资格。2008 年 2 月 14 日，本基金管理人成为首批获准开展特定客户资产管理业务（专户理财）的基金公司之一，并于 3 月 24 日经中国证监会批准获得合格境内机构投资者（QDII）资格，囊括了公募基金、社保、年金、专户理财和 QDII 等管理业务资格。

#### 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		
吴向军	国泰中国企业境外高收益债券（QDII）、国泰纳斯达克 100 指数（QDII）、国泰大宗商品（QDII-LOF）、国泰纳斯达克 100（QDII-ETF）、国泰恒生港股通指数（LOF）	2018-05-31	-	17 年	硕士研究生。2004 年 6 月至 2011 年 4 月在美国 Guggenheim Partners 工作，历任研究员，高级研究员，投资经理。2011 年 5 月起加盟国泰基金管理有限公司，2013 年 4 月起任国泰中国企业境外高收益债券型证券投资基金的基金经理，2013 年 8 月至 2017 年 12 月任国泰美国房地产开

	的基金经理、国际业务部总监、投资总监（海外）				发股票型证券投资基金的基金经理，2015 年 7 月起兼任国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金和国泰大宗商品配置证券投资基金 (LOF) 的基金经理，2015 年 12 月至 2020 年 10 月任国泰全球绝对收益型基金优选证券投资基金的基金经理，2017 年 9 月至 2021 年 5 月任国泰中国企业信用精选债券型证券投资基金 (QDII) 的基金经理，2018 年 5 月起兼任纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2018 年 11 月起兼任国泰恒生港股通指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2015 年 8 月至 2016 年 6 月任国际业务部副总监，2016 年 6 月至 2018 年 7 月任国际业务部副总监（主持工作），2017 年 7 月起任投资总监（海外），2018 年 7 月起任国际业务部总监。
徐成城	国泰纳斯达克 100 (QDII-ETF)、国泰中证煤炭 ETF、国泰中证钢铁 ETF、国泰中证全指家用电器 ETF、国泰中证新能源汽车 ETF、国泰中证动漫游戏 ETF、国泰中证细分机械设备产业主题 ETF、国泰中证 800 汽车与零部件 ETF、国泰中证细分机械设备产业主题 ETF	2018-11-14	-	15 年	硕士研究生。曾任职于闽发证券。2011 年 11 月加入国泰基金管理有限公司，历任交易员、基金经理助理。2017 年 2 月至 2021 年 7 月任国泰创业板指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理，2017 年 2 月至 2020 年 12 月任国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金和国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金的基金经理，2018 年 1 月至 2021 年 7 月任国泰黄金交易型开放式证券投资基金和国泰黄金交易型开放式证券投资基金联接基金的基金经理，2018 年 4 月至 2018 年 8 月任国泰中

	<p>联接、国泰中证有色金属 ETF、国泰中证动漫游戏 ETF 联接、国泰中证光伏产业 ETF、国泰中证 800 汽车与零部件 ETF 发起联接、国泰中证有色金属 ETF 发起联接的基金经理</p>			<p>证国有企业改革指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理, 2018 年 5 月至 2020 年 12 月任国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金的基金经理, 2018 年 5 月至 2019 年 10 月任国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金和国泰国证新能源汽车指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理, 2018 年 11 月起兼任纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理, 2019 年 4 月至 2020 年 12 月任国泰中证生物医药交易型开放式指数证券投资基金联接基金和国泰中证生物医药交易型开放式指数证券投资基金的基金经理, 2020 年 1 月起兼任国泰中证煤炭交易型开放式指数证券投资基金和国泰中证钢铁交易型开放式指数证券投资基金的基金经理, 2020 年 1 月至 2021 年 7 月任国泰中证煤炭交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金和国泰中证钢铁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, 2020 年 2 月起兼任国泰中证全指家用电器交易型开放式指数证券投资基金的基金经理, 2020 年 3 月起兼任国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金的基金经理, 2020 年 4 月至 2021 年 7 月任国泰中证全指家用电器交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金和国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金发</p>
--	---	--	--	--

				<p>起式联接基金的基金经理，2021 年 1 月至 2021 年 7 月任国泰国证房地产行业指数证券投资基金（由国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金终止分级运作变更而来）的基金经理，2021 年 2 月起兼任国泰中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2021 年 4 月起兼任国泰中证细分机械设备产业主题交易型开放式指数证券投资基金和国泰中证 800 汽车与零部件交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2021 年 6 月起兼任国泰中证细分机械设备产业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证有色金属交易型开放式指数证券投资基金和国泰中证动漫游戏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，2021 年 7 月起兼任国泰中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2021 年 8 月起兼任国泰中证 800 汽车与零部件交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金和国泰中证有色金属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。</p>
--	--	--	--	--

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 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《证券法》、《证券投资基金法》、《基金管理公司公平交易

制度指导意见》等有关法律法规的规定，严格遵守基金合同和招募说明书约定，本着诚实信用、勤勉尽责、最大限度保护投资人合法权益等原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合法合规，未发生损害基金份额持有人利益的行为，未发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为，信息披露及时、准确、完整，本基金与本基金管理人管理的其他基金资产、投资组合与公司资产之间严格分开、公平对待，基金管理团队保持独立运作，并通过科学决策、规范运作、精心管理和健全内控体系，有效保障投资人的合法权益。

### 4.3 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

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定，通过严格的内部风险控制制度和流程，对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制，确保公平对待所管理的所有基金和投资组合，切实防范利益输送行为。

##### （一）本基金管理人管理的基金或组合间同向交易价差分析

根据证监会公平交易指导意见，我们计算了公司旗下基金、组合间同向交易记录配对。通过对这些配对的交易价差分析，我们发现有效配对溢价率均值都在 1% 数量级及以下，且大多数溢价率均值都可以通过 95% 置信度下等于 0 的 t 检验。

##### （二）扩展时间窗口下的价差分析

本基金管理人选取 T=3 和 T=5 作为扩展时间窗口，将基金或组合交易情况分别在这两个时间窗口内作平均，并以此为依据，进行基金或组合间在扩展时间窗口中的同向交易价差分析。对于有足够多观测样本的基金配对（样本数 $\geq 30$ ），溢价率均值普遍在 1% 数量级及以下。为稳妥起见，对于溢价率均值过大的基金或组合配对，我们也进行了模拟溢价金额计算。

##### （三）基金或组合间模拟溢价金额分析

对于不能通过溢价率均值为零的 t 检验的基金组合配对、对于在时间窗口中溢价率均值过大的基金组合配对，基金经理也对价差作出了解释，公司旗下基金或组合间没有可能导致不公平交易和利益输送的行为。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金与本基金管理人管理的其他投资组合未发生大额同日反向交易。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。



#### 4.4 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

2021 年上半年，美股延续上行趋势。美股大盘指数标普 500 上涨 14.4%，周期股为主的道琼斯指数上涨 12.7%，科技股为主的纳斯达克指数上涨 12.5%，其中市值排名前 100 公司组成的纳斯达克 100 指数（也是本基金跟踪的指数）上涨 12.9%。疫情缓解后经济的大幅恢复、美联储维持宽松、拜登激进的财政刺激计划为上涨主要驱动因素。

宏观经济层面，上半年美国疫情有所缓和，复工复产节奏加快。就业、零售消费、工业产出、固定资产投资、GDP 预测等各项经济数据持续改善，包括各大科技巨头在内的主要指数成分股均实现超预期的良好业绩表现，反映出美国经济修复情况向好。疫苗推进工作同样有条不紊的进行中，截止 6 月底，美国累计接种疫苗超过 3.2 亿剂，完成二针接种的人口比例超过 40%。整体经济较强的韧性支撑起股市上涨的基本面。

上半年股市风格出现两次轮换。一季度中，被疫苗普及、复工复产、拜登财政刺激推升的通胀预期导致美国国债长端收益率显著上行。作为全球资产的定价锚，美债利率的上行对美股高估值成长股形成了一定压制，对低估值价值股形成了一定支撑，导致市场呈现出从科技到周期的风格切换特征。二季度中，受益于美联储持续放鸽、通胀预期见顶以及一系列交易性因素驱动，长端美债利率显著回落，从而导致科技再次跑赢周期。

快速上涨的物价也导致了有关美联储货币政策提前转向的担忧。二季度中，物价上行压力引发了美联储缩表加息提前的预期，美股市场波动加剧。自 4 月初美联储公布 3 月 FOMC 会议纪要，将就业最大化和物价稳定的双重目标与未来政策走向直接挂钩以来，市场因紧密跟随此后每月公布的就业和通胀指标而大幅震荡。总体而言，尽管 CPI、PCE 等核心通胀数据屡创新高，但包括美联储主席鲍威尔在内的多位官员仍然秉持“暂时性通胀”论调不断为市场降温；而受制于高额补贴、劳动意愿不足等因素，就业人数增长和失业率情况不及预期，从而帮助美联储整体维持鸽派。这也为美股整体震荡不改向上的走势提供了宽松的沃土。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金在 2021 年上半年的单位净值增长率为 11.46%，同期业绩比较基准收益率为 12.22%（注：同期业绩比较基准以人民币计价）。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2021 年下半年，我们认为新冠疫情、美联储政策动向将成为美股焦点。

传染性较强的新冠德尔塔变异毒株肆虐导致全球范围内新冠疫情有重燃之势。当前美国新冠疫

苗接种率距离此前所设定的 75% 成年人接种目标还有一定差距，疫苗普及仍将成为拜登政府接下来的工作重心之一。更快速的疫苗推进工作将帮助美国经济复苏步伐进一步加快，从而对风险资产起到有力支撑，尤其是周期板块。

7 月美联储 FOMC 会议延续鸽派风格，但将于随后的联储会议上公布更加明确的退出量化宽松时间表。当前市场判断最早 9 月美联储将释放信号，退出实施时点预计在今年年底至明年年初，但如果后续月份的就业数据超出预期，不排除提前的可能。至于加息时点，尽管 6 月美联储点阵图显示转鹰信号，但考虑到美联储对于通胀一直以来秉持的暂时性论调，预计最快明年 4 季度开始。美联储政策的转向将对各类资产走势产生影响，届时美股市场整体也将受到向下压力，受益于美国经济复苏节奏的低估值周期股有望成为避风港。

接下来我们仍将密切关注美国疫情和疫苗、美国经济、拜登经济刺激计划和美联储政策的变化，并继续利用国泰纳斯达克 100 ETF 指数基金，为投资者跟踪美股表现创造便利。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。报告期内相关基金估值政策由托管银行进行复核。公司估值委员会由主管运营的公司领导负责，成员包括基金核算、风险管理、行业研究方面业务骨干，均具有丰富的行业分析、会计核算等证券投资基金行业从业经验及专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

截至本报告期末，根据本基金基金合同和相关法律法规的规定，本基金无应分配但尚未实施的利润。

#### 4.8 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，本基金未实施利润分配。

## 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：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
<b>资产：</b>		-	-
银行存款	6.4.7.1	105,364,323.44	119,628,934.77
结算备付金		56,105.97	19,002,503.67
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,688,853,565.53	1,486,891,471.10
其中：股票投资		1,631,092,564.63	1,433,813,575.86
基金投资		57,761,000.90	53,077,895.24
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
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		-	46,326.40
应收利息	6.4.7.5	3,948.68	10,623.96
应收股利		204,049.49	275,748.99
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-

资产总计		1,794,481,993.11	1,625,855,608.89
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
<b>负债：</b>		-	-
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		-	24,540,779.03
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		853,614.86	731,734.48
应付托管费		284,538.28	243,911.49
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
应交税费		77,541.32	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	321,528.02	360,101.90
<b>负债合计</b>		<b>1,537,222.48</b>	<b>25,876,526.90</b>
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	6.4.7.9	371,622,120.00	369,622,120.00
未分配利润	6.4.7.10	1,421,322,650.63	1,230,356,961.99
<b>所有者权益合计</b>		<b>1,792,944,770.63</b>	<b>1,599,979,081.99</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>1,794,481,993.11</b>	<b>1,625,855,608.89</b>

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 4.825 元，基金份额总额 371,622,120.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：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
<b>一、收入</b>		<b>195,712,894.90</b>	<b>162,508,311.55</b>
1.利息收入		104,114.54	197,526.26
其中：存款利息收入	6.4.7.11	104,114.54	197,526.26
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）		36,058,431.17	-1,227,268.81
其中：股票投资收益	6.4.7.12	16,873,622.48	309,391.06
基金投资收益	6.4.7.13	14,229,689.34	538,404.21
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-5,833,889.82
股利收益	6.4.7.16	4,955,119.35	3,758,825.74
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	161,936,159.34	163,447,455.77
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-738,580.95	-247,275.74
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-1,647,229.20	337,874.07
<b>减：二、费用</b>		<b>7,247,927.42</b>	<b>4,032,983.34</b>
1. 管理人报酬		4,991,160.21	2,722,069.01
2. 托管费		1,663,720.09	907,356.40
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	24,054.23	39,725.80
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		51,226.88	1,879.73
7. 其他费用	6.4.7.20	517,766.01	361,952.40
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>188,464,967.48</b>	<b>158,475,328.21</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>188,464,967.48</b>	<b>158,475,328.21</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：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）	369,622,120.00	1,230,356,961.99	1,599,979,081.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	188,464,967.48	188,464,967.48
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）	2,000,000.00	2,500,721.16	4,500,721.16
其中：1.基金申购款	28,000,000.00	92,107,570.80	120,107,570.80
2.基金赎回款	-26,000,000.00	-89,606,849.64	-115,606,849.64
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）	371,622,120.00	1,421,322,650.63	1,792,944,770.63
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）	263,622,120.00	570,996,814.24	834,618,934.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	158,475,328.21	158,475,328.21
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）	23,000,000.00	45,263,743.39	68,263,743.39
其中：1.基金申购款	23,000,000.00	45,263,743.39	68,263,743.39
2.基金赎回款	-	-	-
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）	286,622,120.00	774,735,885.84	1,061,358,005.84

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：

基金管理人负责人：周向勇，主管会计工作负责人：倪莹，会计机构负责人：吴洪涛

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金(简称“本基金”)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[2013]262 号《关于核准纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金募集的批复》核准，由国泰基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》公开募集。本基金为交易型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 267,618,000.00 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2013)第 226 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，本基金基金合同于 2013 年 4 月 25 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 267,622,120.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 4,120.00 份基金份额。本基金的基金管理人为国泰基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司，境外资产托管人为道富银行 State Street Bank and Trust

Company。经上海证券交易所(以下简称“上交所”)上证基字[2013]118 号文审批同意,本基金于 2013 年 5 月 15 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为标的指数成份股、备选成份股、境外交易的跟踪同一标的指数的公募基金(包括 ETF)、依法发行或上市的其他股票、固定收益类资产、银行存款、货币市场工具、股指期货等金融衍生品和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的相关规定。本基金投资组合中标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%。本基金的业绩比较基准为:标的指数收益率(经汇率调整后的总收益指数收益率)。本基金的标的指数为纳斯达克 100 指数(Nasdaq-100 Index)。

本财务报表由本基金的基金管理人国泰基金管理有限公司于 2021 年 8 月 26 日批准报出。

#### 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于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

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 2021 年半年度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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 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 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《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》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《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》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关境内外财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(a)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。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，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(b)目前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，在境内暂不征收企业所得税。

(c)目前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，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

(d)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

### 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	105,364,323.44



定期存款	-
其他存款	-
合计	105,364,323.44

注：于 2021 年 6 月 30 日，活期存款包括人民币活期存款 24,319,703.82 元，美元活期存款 12,545,412.55 元（折合人民币 81,044,619.62 元）。

#### 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		1,029,795,022.32	1,631,092,564.63	601,297,542.31
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		29,276,669.22	57,761,000.90	28,484,331.68
其他		-	-	-
合计		1,059,071,691.54	1,688,853,565.53	629,781,873.99

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

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

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 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	3,948.68
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	-

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	-
应收出借证券利息	-
其他	-
合计	3,948.68

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 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余额。

#### 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	119,014.74
指数使用费	202,513.28
合计	321,528.02

#### 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	369,622,120.00	369,622,120.00
本期申购	28,000,000.00	28,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-26,000,000.00	-26,000,000.00
本期末	371,622,120.00	371,622,120.00

#### 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	375,664,046.53	854,692,915.46	1,230,356,961.99

本期利润	26,528,808.14	161,936,159.34	188,464,967.48
本期基金份额交易产生的变动数	1,895,232.56	605,488.60	2,500,721.16
其中：基金申购款	28,780,414.78	63,327,156.02	92,107,570.80
基金赎回款	-26,885,182.22	-62,721,667.42	-89,606,849.64
本期已分配利润	-	-	-
本期末	404,088,087.23	1,017,234,563.40	1,421,322,650.63

#### 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	92,090.74
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	12,023.80
其他	-
合计	104,114.54

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	40,271,228.66
减：卖出股票成本总额	23,397,606.18
买卖股票差价收入	16,873,622.48

##### 6.4.7.12.2 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	115,606,849.64
减：现金支付赎回款总额	115,606,849.64
减：赎回股票成本总额	-
赎回差价收入	-

#### 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	57,286,398.09
减：卖出/赎回基金成本总额	43,056,708.75
基金投资收益	14,229,689.34

#### 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

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 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	4,936,343.50
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	18,775.85
合计	4,955,119.35

#### 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	161,936,159.34
——股票投资	158,197,189.18
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	3,738,970.16
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	161,936,159.34

#### 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	-1,647,229.20
合计	-1,647,229.20

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，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	24,054.23
银行间市场交易费用	-
合计	24,054.23

#### 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	59,507.37
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费用	1,369.54
存托费用	479.85
指数使用费	396,901.88
合计	517,766.01

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的0.06%(基金资产净值中不超过1亿美元或等值人民币的部分)及0.04%(基金资产净值中超过1亿美元或等值人民币的部分)的年费率计提，逐日累计，按季支付，标的指数许可使用费的收取下限为每年(自然年度)40,000.00美元或等值人民币。

#### 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，本基金并无须作披露的或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作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
国泰基金管理有限公司	基金管理人
美国道富银行（State Street Bank and Trust Company）	境外资产托管人
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人

注：下述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

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

##### 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	4,991,160.21	2,722,069.01
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：支付基金管理人国泰基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.6% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 0.6% / 当年天数。

###### 6.4.10.2.2 基金托管费

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托管费	1,663,720.09	907,356.40

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.20% / 当年天数。

**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**

本基金本报告期及上年度可比期间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 各关联方投资本基金的情况****6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本基金本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

**6.4.10.4.2 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**

本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

**6.4.10.5 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		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	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	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
中国建设银行	24,369,722.05	92,090.74	44,347,448.86	190,302.95
道富银行	80,994,601.39	-	18,100,886.41	1,885.66

注：本基金的银行存款分别由基金托管人中国建设银行和境外资产托管人道富银行保管，按适用利率计息。

**6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金在本报告期及上年度可比期间未有在承销期间参与关联方承销证券的情况。

**6.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

**6.4.11 利润分配情况**

本基金本报告期无利润分配事项。

**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**

本基金本报告期末未持有因认购新发/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**

本基金本报告期末未持有暂时停牌的股票。

### 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

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

### 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

本基金属于股票型基金，预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资及基金投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。本基金为指数型基金，跟踪标的指数市场表现，目标为获取市场平均收益，是股票基金中处于中等风险水平的基金产品。

本基金的基金管理人奉行全员与全程结合、风控与发展并重的风险管理理念。董事会主要负责公司的风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。在公司经营管理层下设风险管理委员会，制定公司日常经营过程中各类风险的防范和管理措施；在业务操作层面，一线业务部门负责对各自业务领域风险的管控，公司具体的风险管理职责由风险管理部、审计部和稽核监察部负责，组织、协调并与各业务部门一道，共同完成对法律风险、投资风险、操作风险、合规风险等风险类别的管理，并定期向公司专门的风险管理委员会报告公司风险状况。风险管理部、审计部和稽核监察部由督察长分管，配置有法律、风控、审计、信息披露等方面专业人员。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行及境外资产托管人道富银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以通过有资格的经纪商进行为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有信用类债券比例为 0.00%(2020 年 12 月 31 日：0.00%)。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险来自调整基金投资组合时，由于部分成分股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 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在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本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%。本基金持有非流动性资产市值不得超过基金净值的 10%，投资于一只境外基金的比例不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一只境外基金不得超过该基金总份额的 20%。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。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投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 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

利率风险是指金融工具的公允价值或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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款及结算备付金等。

##### 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	105,364,323.44	-	-	-	105,364,323.44
结算备付金	-	-	-	56,105.97	56,105.97

交易性金融资产	-	-	-	1,688,853,565.53	1,688,853,565.53
应收股利	-	-	-	204,049.49	204,049.49
应收利息	-	-	-	3,948.68	3,948.68
资产总计	105,364,323.44	-	-	1,689,117,669.67	1,794,481,993.11
负债	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	853,614.86	853,614.86
应付托管费	-	-	-	284,538.28	284,538.28
应交税费	-	-	-	77,541.32	77,541.32
其他负债	-	-	-	321,528.02	321,528.02
负债总计	-	-	-	1,537,222.48	1,537,222.48
利率敏感度缺口	105,364,323.44	-	-	1,687,580,447.19	1,792,944,770.63
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	119,628,934.77	-	-	-	119,628,934.77
结算备付金	18,945,834.91	-	-	56,668.76	19,002,503.67
交易性金融资产	-	-	-	1,486,891,471.10	1,486,891,471.10
应收证券清算款	-	-	-	46,326.40	46,326.40
应收利息	-	-	-	10,623.96	10,623.96
应收股利	-	-	-	275,748.99	275,748.99
资产总计	138,574,769.68	-	-	1,487,280,839.21	1,625,855,608.89
负债	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	24,540,779.03	24,540,779.03
应付管理人报酬	-	-	-	731,734.48	731,734.48
应付托管费	-	-	-	243,911.49	243,911.49
其他负债	-	-	-	360,101.90	360,101.90
负债总计	-	-	-	25,876,526.90	25,876,526.90
利率敏感度缺口	138,574,769.68	-	-	1,461,404,312.31	1,599,979,081.11

					99
--	--	--	--	--	----

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.00%(2020 年 12 月 31 日:0.00%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2020 年 12 月 31 日：同)。

#### 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 2021年6月30日	
	美元 折合人民币	合计
以外币计价的资产		
银行存款	81,044,619.62	81,044,619.62
交易性金融资产	1,688,853,565.53	1,688,853,565.53
应收股利	204,049.49	204,049.49
结算备付金	56,105.97	56,105.97
资产合计	1,770,158,340.61	1,770,158,340.61
以外币计价的负债		
其他负债	202,513.28	202,513.28
负债合计	202,513.28	202,513.28
资产负债表外	1,769,955,827.33	1,769,955,827.33

汇风险敞口净额		
项目	上年度末 2020年12月31日	
	美元 折合人民币	合计
以外币计价的资产		
银行存款	52,952,669.16	52,952,669.16
交易性金融资产	1,486,855,365.79	1,486,855,365.79
应收利息	12.46	12.46
应收股利	275,748.99	275,748.99
结算备付金	56,668.76	56,668.76
资产合计	1,540,140,465.16	1,540,140,465.16
以外币计价的负债		
应付证券清算款	17,678,217.65	17,678,217.65
其他负债	157,301.90	157,301.90
负债合计	17,835,519.55	17,835,519.55
资产负债表外 汇风险敞口净额	1,522,304,945.61	1,522,304,945.61

#### 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：人民币万元）	
		本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
	美元相对人民币贬值 5%	减少约 8,850	减少约 7,612
	美元相对人民币升值 5%	增加约 8,850	增加约 7,612

### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和基金，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，以低成本、低换手率实现本基金对纳斯达克 100 指数（Nasdaq-100 Index）的有效跟踪，追求跟踪误差最小化。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票和目标基金投资比例不低于基金资产的 80%，目标基金的比例不超过 10%。在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR（Value at Risk）指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 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	1,631,092,564.63	90.97	1,433,813,575. 86	89.61
交易性金融资产—基金投资	57,761,000.90	3.22	53,077,895.24	3.32
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,688,853,565.53	94.19	1,486,891,471. 10	92.93

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除纳斯达克 100 指数外其他市场变量不变
----	-----------------------

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：人民币万元）	
		本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	纳斯达克 100 指数上升 5%	增加约 8,393	增加约 7,662
	纳斯达克 100 指数下降 5%	减少约 8,393	减少约 7,662

#### 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

##### (a) 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。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 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且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 1,688,853,565.53 元，无属于第二层次和第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日：第一层次 1,486,891,471.10 元，无属于第二层次和第三层次的余额)。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2020 年 12 月 31 日：同)。

(d) 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，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 基金申购款

于本会计期间，本基金申购基金份额的对价总额为 120,107,570.80 元，全部以现金支付。

(3) 除基金申购款和公允价值外，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	1,631,092,564.63	90.89
	其中：普通股	1,599,618,388.93	89.14
	存托凭证	31,474,175.70	1.75
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	57,761,000.90	3.22
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	105,420,429.41	5.87
8	其他各项资产	207,998.17	0.01
9	合计	1,794,481,993.11	100.00

注：上述股票投资包括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	1,631,092,564.63	90.97
合计	1,631,092,564.63	90.97

## 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股票及存托凭证投资组合

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（%）
工业	28,029,288.61	1.56
保健	110,808,861.43	6.18
通信服务	320,944,974.88	17.90
必需消费品	79,328,768.27	4.42
信息技术	794,636,177.02	44.32
非必需消费品	282,761,884.58	15.77
公用事业	14,582,609.84	0.81
能源	-	-
金融	-	-
房地产	-	-
材料	-	-
合计	1,631,092,564.63	90.97

注：以上行业分类采用全球行业分类标准（GICS）。

### 7.3.2 期末积极投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票及存托凭证。

## 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

## 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	APPLE INC	苹果公司	AAPL US	纳斯达 克	美国	200,900	177,751,356.97	9.91
2	MICROS OFT CORP	微软	MSFT US	纳斯达 克	美国	91,300	159,778,751.52	8.91
3	AMAZO N.COM INC	亚马逊公 司	AMZN US	纳斯达 克	美国	6,100	135,565,043.46	7.56
4	FACEBO OK INC-CLA SS A	Facebook 公司	FB US	纳斯达 克	美国	29,500	66,264,120.44	3.70
5	ALPHAB ET INC-CL C	Alphabet 公司	GOOG US	纳斯达 克	美国	4,000	64,764,311.33	3.61
6	TESLA INC	特斯拉公 司	TSLA US	纳斯达 克	美国	14,400	63,229,391.57	3.53
7	NVIDIA CORP	英伟达	NVDA US	纳斯达 克	美国	11,500	59,440,349.12	3.32
8	ALPHAB ET INC-CLA	Alphabet 公司	GOOGL US	纳斯达 克	美国	3,600	56,787,147.28	3.17
9	PAYPAL HOLDIN GS INC	Paypal 控 股股份有 限公司	PYPL US	纳斯达 克	美国	21,700	40,860,881.87	2.28
10	ADOBE INC	奥多比	ADBE US	纳斯达 克	美国	8,900	33,671,307.38	1.88
11	COMCAS T CORP-CL ASS A	康卡斯特	CMCSA US	纳斯达 克	美国	83,900	30,904,976.28	1.72
12	NETFLIX INC	奈飞公司	NFLX US	纳斯达 克	美国	8,200	27,980,773.25	1.56
13	INTEL CORP	英特尔公 司	INTC US	纳斯达 克	美国	74,300	26,946,382.04	1.50
14	CISCO SYSTEM	思科-T	CSCO US	纳斯达 克	美国	78,600	26,911,484.58	1.50

	S INC							
15	PEPSICO INC	百事可乐	PEP US	纳斯达克	美国	25,300	24,216,983.33	1.35
16	BROADCOM INC	博通股份有限公司	AVGO US	纳斯达克	美国	7,600	23,411,299.04	1.31
17	T-MOBILE US INC	T-Mobile US 有限公司	TMUS US	纳斯达克	美国	23,200	21,706,297.77	1.21
18	TEXAS INSTRUMENTS INC	德州仪器	TXN US	纳斯达克	美国	17,200	21,367,168.36	1.19
19	COSTCO WHOLESALE CORP	好市多批发	COST US	纳斯达克	美国	8,200	20,959,755.69	1.17
20	QUALCOMM INC	高通公司	QCOM US	纳斯达克	美国	21,000	19,390,183.95	1.08
21	AMGEN INC	AMGEN-T	AMGN US	纳斯达克	美国	10,800	17,006,213.25	0.95
22	CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	Charter Communications Inc	CHTR US	纳斯达克	美国	3,600	16,778,300.92	0.94
23	INTUIT INC	Intuit 公司	INTU US	纳斯达克	美国	5,100	16,149,390.81	0.90
24	STARBUCKS CORP	星巴克—T	SBUX US	纳斯达克	美国	21,900	15,818,452.80	0.88
25	APPLIED MATERIALS INC	应用材料—T	AMAT US	纳斯达克	美国	16,900	15,546,618.26	0.87
26	ADVANCED MICRO DEVICES	AMD 公司	AMD US	纳斯达克	美国	22,500	13,652,936.84	0.76
27	INTUITIVE SURGICAL INC	直觉外科手术公司	ISRG US	纳斯达克	美国	2,200	13,070,126.00	0.73
28	MICRON TECHNO	美光科技股份有限	MU US	纳斯达克	美国	20,800	11,418,769.40	0.64

	LOGY INC	公司						
29	MODERNA INC	MODERNA 股份有限公司	MRNA US	纳斯达克	美国	7,500	11,384,957.24	0.63
30	LAM RESEARCH CORP	泛林集团 股份有限公司	LRCX US	纳斯达克	美国	2,700	11,349,685.09	0.63
31	BOOKING HOLDINGS INC	Booking 控股 股份有限公司	BKNG US	纳斯达克	美国	800	11,308,224.17	0.63
32	ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	ZOOM 视 频通讯公 司	ZM US	纳斯达克	美国	4,300	10,751,085.76	0.60
33	MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	Mondelez 国际公司	MDLZ US	纳斯达克	美国	26,600	10,729,605.93	0.60
34	GILEAD SCIENCES INC	吉利德科 学	GILD US	纳斯达克	美国	23,200	10,320,345.68	0.58
35	AUTOMATIC DATA PROCESSING	ADP 公司	ADP US	纳斯达克	美国	8,000	10,264,840.50	0.57
36	MERCADOLIBRE INC	Mercadolib re 股份有 限公司	MELI US	纳斯达克	美国	900	9,057,131.26	0.51
37	CSX CORP	CSX 公司	CSX US	纳斯达克	美国	43,200	8,952,768.35	0.50
38	ACTIVISION BLIZZARD INC	动视暴雪 股份有限 公司	ATVI US	纳斯达克	美国	14,400	8,878,347.99	0.50
39	FISERV INC	Fiserv 公司	FISV US	纳斯达克	美国	12,600	8,700,553.12	0.49
40	ILLUMINA INC	Illumina 公 司	ILMN US	纳斯达克	美国	2,700	8,253,856.59	0.46
41	JD.COM INC-ADR	京东	JD US	纳斯达克	美国	15,000	7,733,708.72	0.43

42	AUTODESK INC	欧特克	ADSK US	纳斯达克	美国	4,100	7,731,383.08	0.43
43	ANALOG DEVICES INC	模拟器件	ADI US	纳斯达克	美国	6,900	7,673,978.63	0.43
44	REGENERON PHARMACEUTICALS	再生元制药有限公司	REGN US	纳斯达克	美国	2,000	7,216,448.51	0.40
45	BAIDU INC - SPON ADR	百度	BIDU US	纳斯达克	美国	5,200	6,849,514.83	0.38
46	NXP SEMICONDUCTORS NV	恩智浦半导体公司	NXPI US	纳斯达克	美国	5,000	6,644,858.86	0.37
47	IDEXX LABORATORIES INC	爱德士股份有限公司	IDXX US	纳斯达克	美国	1,600	6,527,801.85	0.36
48	BIOGEN INC	百健	BIIB US	纳斯达克	美国	2,900	6,487,122.60	0.36
49	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	Vertex 制药股份有限公司	VRTX US	纳斯达克	美国	4,900	6,382,494.82	0.36
50	ASML HOLDING NV-NY REG SHS	阿斯麦控股公司	ASML US	纳斯达克	美国	1,400	6,248,053.68	0.35
51	KRAFT HEINZ CO/THE	卡夫亨氏公司	KHC US	纳斯达克	美国	23,500	6,190,907.63	0.35
52	DOCUSIGN INC	DocuSign 股份有限公司	DOCU US	纳斯达克	美国	3,400	6,140,570.53	0.34
53	KEURIG DR PEPPER INC	Keurig 澎泉思蓝宝公司	KDP US	纳斯达克	美国	26,700	6,078,359.77	0.34
54	ALIGN TECHNO	Align 科技股份有限公司	ALGN US	纳斯达克	美国	1,500	5,920,681.65	0.33

	LOGY INC	公司						
55	EBAY INC	eBay 公司	EBAY US	纳斯达克	美国	13,000	5,896,327.07	0.33
56	KLA CORP	Kla-Tencor 公司	KLAC US	纳斯达克	美国	2,800	5,864,401.26	0.33
57	MONSTE R BEVERA GE CORP	怪兽饮料 公司	MNST US	纳斯达克	美国	9,800	5,783,275.32	0.32
58	MARRIO TT INTERN ATIONA L-CLA	万豪国际	MAR US	纳斯达克	美国	6,200	5,467,983.68	0.30
59	LULULE MON ATHLETI CA INC	Lululemon Athletica 股份有限 公司	LULU US	纳斯达克	美国	2,300	5,422,808.20	0.30
60	MATCH GROUP INC	Match Group 股份 有限公司	MTCH US	纳斯达克	美国	5,200	5,416,793.85	0.30
61	WALGRE ENS BOOTS ALLIAN CE INC	Walgreens Boots Alliance 公 司	WBA US	纳斯达克	美国	15,800	5,369,880.60	0.30
62	EXELON CORP	Exelon 公 司(美国)	EXC US	纳斯达克	美国	18,300	5,238,320.67	0.29
63	ROSS STORES INC	Ross 商店 有限公司	ROST US	纳斯达克	美国	6,500	5,206,840.60	0.29
64	SYNOPS YS INC	新思科技 公司	SNPS US	纳斯达克	美国	2,900	5,166,729.84	0.29
65	WORKD AY INC-CLA SS A	Workday 股 份有限公 司	WDAY US	纳斯达克	美国	3,300	5,089,538.10	0.28
66	MICROC HIP TECHNO LOGY INC	微芯科技 股份有限 公司	MCHP US	纳斯达克	美国	5,200	5,030,143.94	0.28
67	DEXCO M INC	DexCom 股 份有限公	DXCM US	纳斯达克	美国	1,800	4,965,232.86	0.28

		司						
68	ELECTR ONIC ARTS INC	电子艺界	EA US	纳斯达克	美国	5,300	4,924,527.77	0.27
69	AMERIC AN ELECTIR C POWER COMPAN Y INC	美国电力	AEP US	纳斯达克	美国	9,000	4,918,138.73	0.27
70	O'REILL Y AUTOM OTIVE INC	O Reilly 汽车股份 有限公司	ORLY US	纳斯达克	美国	1,300	4,755,105.19	0.27
71	ALEXIO N PHARM ACEUTI CAL S INC	Alexion 制 药公司	ALXN US	纳斯达克	美国	4,000	4,747,139.88	0.26
72	CINTAS CORP	CINTAS 公司	CTAS US	纳斯达克	美国	1,900	4,688,740.58	0.26
73	PAYCHE X INC	Paychex 公司	PAYX US	纳斯达克	美国	6,700	4,644,230.49	0.26
74	PINDUO DUO INC-ADR	拼多多	PDD US	纳斯达克	美国	5,600	4,595,146.65	0.26
75	COGNIZ ANT TECH SOLUTI ONS-A	高知特科 技公司	CTSH US	纳斯达克	美国	10,200	4,563,750.57	0.25
76	MARVEL L TECHNO LOGY GROUP LTD	美满电子 科技	MRVL US	纳斯达克	美国	12,100	4,559,493.36	0.25
77	CADENC E DESIGN SYS INC	Cadence 设计系统 股份有限 公司	CDNS US	纳斯达克	美国	5,100	4,507,741.50	0.25

78	XCEL ENERGY INC	Xcel 能源	XEL US	纳斯达克	美国	10,400	4,426,150.44	0.25
79	XILINX INC	赛灵思	XLNX US	纳斯达克	美国	4,700	4,391,627.66	0.24
80	ATLASSIAN CORP PLC-CLASS A	Atlassian 公共有限公司	TEAM US	纳斯达克	美国	2,400	3,982,419.09	0.22
81	NETEAS E INC-ADR	网易公司	NTES US	纳斯达克	美国	5,200	3,871,537.93	0.22
82	SKYWOR KS SOLUTIONS INC	思佳讯解决方案公司	SWKS US	纳斯达克	美国	3,100	3,840,044.94	0.21
83	PELOTON INTERACTIVE INC	PELOTON 股份有限公司	PTON US	纳斯达克	美国	4,700	3,765,553.53	0.21
84	COPART INC	Copart 股份有限公司	CPRT US	纳斯达克	美国	4,300	3,662,030.43	0.20
85	PACCAR INC	帕卡	PCAR US	纳斯达克	美国	6,300	3,632,352.73	0.20
86	FASTENAL CO	快扣公司	FAST US	纳斯达克	美国	10,700	3,594,399.64	0.20
87	ANSYS INC	ANSYS 股份有限公司	ANSS US	纳斯达克	美国	1,600	3,587,267.69	0.20
88	VERISK ANALYTICS INC	Verisk 分析公司	VRSK US	纳斯达克	美国	3,100	3,498,996.88	0.20
89	OKTA INC	Okta 股份有限公司	OKTA US	纳斯达克	美国	2,200	3,477,445.99	0.19
90	SEATTLE GENETICS INC	西雅图遗传学股份有限公司	SGEN US	纳斯达克	美国	3,300	3,365,737.94	0.19
91	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	美信	MXIM US	纳斯达克	美国	4,900	3,335,117.07	0.19



92	SIRIUS XM HOLDING S INC	Sirius XM 控股公司	SIRI US	纳斯达克	美国	77,100	3,257,402.06	0.18
93	VERISIG N INC	威瑞信公 司	VRSN US	纳斯达克	美国	2,100	3,088,890.35	0.17
94	CDW CORP/DE	特拉华 CDW 公司	CDW US	纳斯达克	美国	2,700	3,046,292.46	0.17
95	CERNER CORP	塞纳公司	CERN US	纳斯达克	美国	5,700	2,878,052.07	0.16
96	DOLLAR TREE INC	Dollar Tree 公司	DLTR US	纳斯达克	美国	4,300	2,763,953.79	0.15
97	SPLUNK INC	Splunk 公 司	SPLK US	纳斯达克	美国	2,900	2,708,603.65	0.15
98	INCYTE CORP	Incyte 有 限公司	INCY US	纳斯达克	美国	4,200	2,282,650.49	0.13
99	TRIP.CO M GROUP LTD-AD R	携程旅行 网国际有 限公司	TCOM US	纳斯达克	美国	9,500	2,176,213.89	0.12
100	CHECK POINT SOFTWARE TECH	Check Point 软件 技术有限 公司	CHKP US	纳斯达克	美国	2,600	1,950,549.67	0.11
101	FOX CORP - CLASS A	FOX CORP	FOXA US	纳斯达克	美国	6,000	1,439,181.08	0.08
102	FOX CORP - CLASS B	FOX CORP	FOX US	纳斯达克	美国	4,933	1,121,742.10	0.06

#### 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前五名权益投资明细

本基金本报告期末未持有积极权益投资。

#### 7.5 报告期内股票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	10,646,596.62	0.67
2	AMAZON.COM INC	AMZN US	8,310,740.44	0.52
3	MICROSOFT CORP	MSFT US	6,379,786.94	0.40
4	TESLA INC	TSLA US	3,124,268.56	0.20
5	FACEBOOK INC-CLASS A	FB US	2,962,786.47	0.19
6	ALPHABET INC-CL A	GOOGL US	2,552,791.62	0.16
7	PAYPAL HOLDINGS INC	PYPL US	1,736,660.89	0.11
8	ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	ZM US	1,653,749.38	0.10
9	ALPHABET INC-CL C	GOOG US	1,152,252.84	0.07
10	INTUIT INC	INTU US	1,038,893.99	0.06
11	NVIDIA CORP	NVDA US	1,028,651.93	0.06
12	MERCADOLIBRE INC	MELI US	887,168.67	0.06
13	BROADCOM INC	AVGO US	860,484.93	0.05
14	CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	CHTR US	830,139.01	0.05
15	BOOKING HOLDINGS INC	BKNG US	742,294.92	0.05
16	NETFLIX INC	NFLX US	705,359.87	0.04
17	COMCAST CORP-CLASS A	CMCSA US	645,874.79	0.04
18	ADOBE INC	ADBE US	641,431.21	0.04
19	INTUITIVE SURGICAL INC	ISRG US	536,741.06	0.03
20	T-MOBILE US INC	TMUS US	520,785.17	0.03

注：1.此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

2.买入金额按买入成交金额（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	13,245,597.41	0.83
2	AMAZON.COM INC	AMZN US	6,643,979.60	0.42
3	MICROSOFT CORP	MSFT US	5,530,692.48	0.35
4	ALPHABET INC-CL A	GOOGL US	3,056,858.87	0.19
5	FACEBOOK INC-CLASS A	FB US	1,574,404.06	0.10
6	ALPHABET INC-CL C	GOOG US	1,491,610.46	0.09

7	PAYPAL HOLDINGS INC	PYPL US	1,234,570.86	0.08
8	MERCADOLIBRE INC	MELI US	947,334.06	0.06
9	CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	CHTR US	847,911.27	0.05
10	TESLA INC	TSLA US	796,542.16	0.05
11	NETEASE INC-ADR	NTES US	700,064.24	0.04
12	JD.COM INC-ADR	JD US	653,855.24	0.04
13	INTEL CORP	INTC US	644,933.52	0.04
14	COMCAST CORP-CLASS A	CMCSA US	585,171.24	0.04
15	NXP SEMICONDUCTORS NV	NXPI US	500,688.67	0.03
16	PEPSICO INC	PEP US	472,738.31	0.03
17	ASML HOLDING NV-NY REG SHS	ASML US	434,981.30	0.03
18	O'REILLY AUTOMOTIVE INC	ORLY US	344,963.44	0.02
19	ILLUMINA INC	ILMN US	292,220.56	0.02
20	ELECTRONIC ARTS INC	EA US	272,110.91	0.02

注：1.此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

2.卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5.3 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	62,479,405.77
卖出收入（成交）总额	40,271,228.66

注：买入股票成本、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。

### 7.6 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

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

### 7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

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	PROSHAR ES ULTRAPR O QQQ	ETF 基金	开放式	Proshares Trust	57,532,035.58	3.21
2	INVESCO QQQ TRUST SERIES 1	ETF 基金	开放式	Invesco Ltd	228,965.32	0.01

### 7.11 投资组合报告附注

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

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

### 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	-
3	应收股利	204,049.49
4	应收利息	3,948.68
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	207,998.17

### 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

#### 7.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

## 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
30,371	12,236.08	79,670,070.00	21.44%	291,952,050.00	78.56%

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	BARCLAYS BANK PLC	21,212,008.00	5.71%
2	蒋荣方	13,236,720.00	3.56%
3	林晓辉	10,000,000.00	2.69%
4	太平资产—工商银行—太平之星量化 2 号资管产品	6,721,900.00	1.81%
5	太平资管—建设银行—太平资产量化 10 号资管产品	6,613,100.00	1.78%
6	太平资管—建设银行—太平资产量化 9 号资管产品	6,281,200.00	1.69%
7	杨腊梅	5,687,700.00	1.53%
8	太平资产—建设银行—太平资产量化 3 号权益型资管产品	5,627,400.00	1.51%
9	上海红墙泰和基金管理有限公司—金湖 AI 对冲五十三期私募基金	5,591,141.00	1.50%
10	永安国富资产管理有限公司—永安国富—多策略 6 号私募证券投资基金	3,853,300.00	1.04%

**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	0.00%

**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（2013 年 4 月 25 日）基金份额总额	267,622,120.00
本报告期期初基金份额总额	369,622,120.00
本报告期基金总申购份额	28,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	26,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	371,622,120.00

**10 重大事件揭示****10.1 基金份额持有人大会决议**

报告期内，本基金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**

报告期内，本基金管理人重大人事变动如下：

2021 年 3 月 31 日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司高级管理人员任职公告》，经本基金管理人第八届董事会第四次会议审议通过，张玮先生担任本基金管理人副总经理。

2021 年 4 月 1 日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司董事变更公告》，经本基金管理人股东会审议通过，对本基金管理人董事会成员进行了调整。

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**

报告期内，本基金无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

**10.4 基金投资策略的改变**

报告期内，本基金投资策略无改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，为本基金提供审计服务的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（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

报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

### 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	
Goldman Sachs International	1	66,688,264.91	64.90%	12,244.61	52.96%	-
Morgan Stanley Co. International plc	1	-	-	-	-	-
Knight Capital Group	1	-	-	-	-	-
Haitong International Securities Company Ltd	1	36,062,369.52	35.10%	10,874.27	47.04%	-

注：基金租用席位的选择标准是：

- (1) 资质雄厚，信誉良好；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，在最近一年内无重大违规经营行为；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

(5) 公司具有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供具有相当质量的关于宏观经济面分析、行业发展趋势及证券市场走向、个股分析的研究报告以及丰富全面的信息服务；能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

选择程序是：根据对各证券公司提供的各项投资、研究服务情况的考评结果，符合交易席位租用标准的，由公司投研业务部门提出租用证券公司交易席位的调整意见（包括调整名单及调整原因等），并经公司批准。

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		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
Goldman Sachs International	-	-	-	-	-	-	44,000,844.25	43.26%
Morgan Stanley Co. International plc	-	-	-	-	-	-	-	-
Knight Capital Group	-	-	-	-	-	-	-	-
Haitong International Securities Company Ltd	-	-	-	-	-	-	57,713,288.77	56.74%

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	纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金暂停申购、赎回业务的公告	《中国证券报》	2021-01-13



2	国泰基金管理有限公司关于旗下 3 只 ETF 变更申赎简称的公告	《中国证券报》、《证券时报》	2021-03-17
3	纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金暂停申购、赎回业务的公告	《中国证券报》	2021-03-30
4	国泰基金管理有限公司高级管理人员任职公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2021-03-31
5	国泰基金管理有限公司关于修订旗下部分公募基金基金合同的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2021-03-31
6	国泰基金管理有限公司董事变更公告	《中国证券报》	2021-04-01
7	纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金暂停申购、赎回业务的公告	《中国证券报》	2021-05-26
8	纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金暂停申购、赎回业务的公告	《中国证券报》	2021-06-30

## 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

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

### 11.2 存放地点

本基金管理人国泰基金管理有限公司办公地点——上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 16 层-19 层。

基金托管人住所。

### 11.3 查阅方式

可咨询本基金管理人；部分备查文件可在本基金管理人公司网站上查阅。

客户服务中心电话：（021）31089000，400-888-8688

客户投诉电话：（021）31089000

公司网址：<http://www.gtfund.com>

国泰基金管理有限公司

二〇二一年八月三十一日