

博时纳斯达克 100 指数型发起式证券投资  
基金（QDII）  
2022 年第 3 季度报告  
2022 年 9 月 30 日

基金管理人：博时基金管理有限公司  
基金托管人：中信银行股份有限公司  
报告送出日期：二〇二二年十月二十六日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 7 月 26 日起至 9 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

### 2.1 基金产品概况

基金简称	博时纳斯达克 100 指数发起 (QDII)
基金主代码	016055
交易代码	016055
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 7 月 26 日
报告期末基金份额总额	61,199,379.31 份
投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。在正常情况下，本基金力争控制投资组合的净值增长率与业绩比较基准之间的预期日均跟踪偏离度的绝对值小于 0.35%，预期年化跟踪误差不超过 4%。
投资策略	本基金主要采用完全复制法进行投资，即按照成份股在标的指数中的基准权重来构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。但因特殊情况（比如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可使用其他合理方法进行适当的替代。特殊情况包括但不限于以下情形：（1）法律法规的限制；（2）标的指数成份股流动性严重不足；（3）标的指数的成份股长期停牌；（4）其它合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等。在正常情况下，本基金力争控制投资组合的净值增长率与业绩比较基准之间的预期日均跟踪偏离度的绝对值小于 0.35%，预期年化跟踪误差不超过 4%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金日均跟踪

	偏离度和跟踪误差变大, 基金管理人应采取合理措施, 避免日均跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。其他投资策略包括债券(除可转换债券)投资策略、目标基金投资策略、资产支持证券投资策略、港股通标的股票投资策略、可转换债券投资策略、融资和转融通证券出借策略、存托凭证投资策略、金融衍生品投资策略等。	
业绩比较基准	经汇率调整的纳斯达克 100 指数收益率 x95%+活期存款利率(税后)x5%	
风险收益特征	本基金属于股票型基金, 其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为被动式投资的股票型指数基金, 跟踪纳斯达克 100 指数, 其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。本基金投资于境外证券, 需承担汇率风险以及境外市场的风险。	
基金管理人	博时基金管理有限公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	博时纳斯达克 100 指数发起(QDII) A 人民币	博时纳斯达克 100 指数发起(QDII) C 人民币
下属分级基金的交易代码	016055	016057
报告期末下属分级基金的份额总额	26,711,462.69 份	34,487,916.62 份

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位: 人民币元

主要财务指标	报告期 (2022 年 7 月 26 日(基金合同生效日)-2022 年 9 月 30 日)	
	博时纳斯达克 100 指数发起(QDII) A 人民币	博时纳斯达克 100 指数发起(QDII) C 人民币
1. 本期已实现收益	-545,706.67	-573,916.50
2. 本期利润	-2,780,157.75	-3,383,600.79
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.1382	-0.1884
4. 期末基金资产净值	23,827,825.77	30,736,395.85
5. 期末基金份额净值	0.8920	0.8912

本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不包含公允价值变动收益)扣除相关费用和信用减值损失后的余额, 本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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 本报告期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

##### 1. 博时纳斯达克100指数发起 (QDII) A人民币:

阶段	净值增长率 ①	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
自基金 合同生 效起至 今	-10.80%	1.48%	-6.11%	1.71%	-4.69%	-0.23%

##### 2. 博时纳斯达克100指数发起 (QDII) C人民币:

阶段	净值增长率 ①	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
自基金 合同生 效起至 今	-10.88%	1.49%	-6.11%	1.71%	-4.77%	-0.22%

#### 3.2.2 自基金合同生效以来 基金累计份额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

博时纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金 (QDII)  
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2022 年 7 月 26 日至 2022 年 9 月 30 日)

##### 1. 博时纳斯达克100指数发起 (QDII) A人民币:



##### 2. 博时纳斯达克100指数发起 (QDII) C人民币:



注：本基金的基金合同于 2022 年 7 月 26 日生效。按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同“投资范围”、“投资禁止行为与限制”章节的有关约定。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
万琼	指数与量化投资部投资总监助理/基金经理	2022-07-26	-	15.5	万琼女士，硕士。2004 年起先后在中企动力科技股份有限公司、华夏基金工作。2011 年加入博时基金管理有限公司。历任投资助理、基金经理助理、博时富时中国 A 股指数证券投资基金(2017 年 9 月 29 日-2019 年 9 月 5 日)、博时上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2015 年 6 月 8 日-2019 年 10 月 11 日)、上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金(2015 年 6 月 8 日-2019 年 10 月 11 日)、博时恒生沪深港通大湾区综合交易型开放式指数证券投资基金(2020 年 4 月 30 日-2022 年 5 月 27 日)、上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金(2015 年 6 月 8 日-2022 年 7 月 7 日)、博时上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2015 年 6 月

				<p>8 日-2022 年 7 月 7 日)的基金经理。现任指数与量化投资部投资总监助理兼博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2015 年 10 月 8 日—至今)、博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金(2015 年 10 月 8 日—至今)、博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(2019 年 8 月 1 日—至今)、博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(2019 年 12 月 30 日—至今)、博时中证可持续发展 100 交易型开放式指数证券投资基金(2020 年 1 月 19 日—至今)、博时中证红利交易型开放式指数证券投资基金(2020 年 3 月 20 日—至今)、博时沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(2020 年 4 月 3 日—至今)、博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金(QDII)(2021 年 3 月 18 日—至今)、博时创业板指数证券投资基金(2021 年 4 月 2 日—至今)、博时恒生港股通高股息率交易型开放式指数证券投资基金(2021 年 5 月 11 日—至今)、博时恒生科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)(2021 年 5 月 17 日—至今)、博时中证全球中国教育主题交易型开放式指数证券投资基金(QDII)(2021 年 6 月 8 日—至今)、博时恒生科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(QDII)(2021 年 12 月 21 日—至今)、博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(QDII)(2021 年 12 月 28 日—至今)、博时恒生港股通高股息率交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(2022 年 1 月 10 日—至今)、博时中证港股通消费主题交易型开放式指数证券投资基金(2022 年 3 月 3 日—至今)、博时纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金(QDII)(2022 年 7 月 26 日—至今)的基金经理。</p>
--	--	--	--	---

注：上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信

于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，由于证券市场波动等原因，本基金曾出现个别投资监控指标超标的情况，基金管理人在规定期限内进行了调整，对基金份额持有人利益未造成损害。

### 4.3 公平交易专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，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 25 次，均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。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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

2022 年 3 季度，美国经济依然具有韧性，但通胀风险仍在。经济基本面方面，就业市场持续在改善，9 月美国非农就业偏强，失业率回落至历史低点；消费依然有韧性，尤其是服务消费；9 月服务业 PMI 指数仍居高位。但同时美国通胀压力仍然比较大，8 月美国 PCE 同比增速处于高位，尤其是核心 PCE 同比反弹；而在美联储持续加息背景下，美国房价增速虽有放缓，但仍居高位。货币政策方面，9 月 FOMC 会议美联储宣布加息 75bp，并预计后续或将持续上调。9 月美联储开始加速缩表。美债收益率也回升至 3.89%。3 季度，美股先扬后抑，标普 500 指数下跌 5.28%，纳斯达克 100 指数下跌 4.63%。

展望 2022 年 4 季度，美国经济面临的主要问题仍然是通胀高企，以及因持续加息导致的对经济衰退的担忧。受非农就业强劲影响，美国加息预期再次升温，11 月预期加息 75BP 的概率超过 80%。加息预期导致市场回调明显，但随着市场风险持续释放，短期情绪已有明显缓解。尽管如房租和工资等内生粘性有可能降幅较慢，但是在高基数的作用下，10 月 CPI 数据有望明显回落。在 11 月政策转机能够出现前，市场预计还会持续震荡调整一段时间。短期的风险暴露及后续紧缩和通胀路径的变化仍可能带来一些波折和反复，因此还需等待转机。

截至 2022 年 09 月 30 日，本基金 A 基金份额净值为 0.8920 元，份额累计净值为 0.8920 元，本基金 C 基金份额净值为 0.8912 元，份额累计净值为 0.8912 元，报告期内，本基金 A 基金份额净值

增长率为-10.80%，本基金 C 基金份额净值增长率为-10.88%，本基金 A 类同期业绩基准增长率为-6.11%。本基金 C 类同期业绩基准增长率为-6.11%。

#### 4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

## §5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	49,982,734.80	78.18
	其中：普通股	49,206,667.37	76.96
	存托凭证	776,067.43	1.21
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的 买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付 金合计	11,139,682.95	17.42
8	其他各项资产	2,811,615.64	4.40
9	合计	63,934,033.39	100.00

注：金融衍生品投资项下的期货投资,在当日无负债结算制度下，结算备付金已包括所持期货合约产生的持仓损益，则金融衍生品投资项下的期货投资与相关的期货结算暂收款（结算所得的持仓损益）相抵消后的净额为 0，具体投资情况详见下表：

期货类型	期货代码	期货名称	持仓量(买/卖)	合约价值 (人民币元)	公允价值变动 (人民币元)
股指期货	NQZ2	NASDAQ 100 E-MINI	1.00	1,566,996.86	-138,375.10



		Dec22			
总额合计					-138,375.10
减：可抵消期货暂收款					-138,375.10
股指期货投资净额					0.00

## 5.2 期末投资目标基金明细

本基金本报告期末未持有基金。

## 5.3 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家（地区）	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例（%）
美国	49,982,734.80	91.60
合计	49,982,734.80	91.60

## 5.4 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
非日常生活消费品	8,530,379.82	15.63
信息技术	24,483,578.92	44.87
电信业务	7,916,886.37	14.51
消费必需品	3,350,982.35	6.14
工业	1,708,661.60	3.13
医疗健康	3,278,363.90	6.01
公用事业	713,881.84	1.31
合计	49,982,734.80	91.60

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

## 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证投资明细

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(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	APPLE INC	苹果	AAPL US	纳斯达克交易所	美国	6,785.00	6,657,390.16	12.20
2	MICROSOFT CORP	微软	MSFT US	美国纽约	美国	3,149.00	5,207,008.23	9.54
3	AMAZON.COM INC	亚马逊	AMZN US	美国纽约	美国	4,301.00	3,450,595.10	6.32
4	TESLA INC	特斯拉	TSLA US	纳斯达克交易	美国	1,312.00	2,470,787.20	4.53

				所				
5	ALPHABET INC-CL C	谷歌	GOOG US	纳斯达克交易 所	美国	2,602.00	1,776,244.29	3.26
6	ALPHABET INC-CL A		GOOG L US	美国纽 约	美国	2,531.00	1,718,791.65	3.15
7	META PLATFORMS INC-CLASS A	META 平台	META US	纳斯达 克交易 所	美国	1,442.00	1,389,079.85	2.55
8	NVIDIA CORP	英伟达	NVDA US	美国纽 约	美国	1,479.00	1,274,668.34	2.34
9	PEPSICO INC	百事	PEP US	纳斯达 克交易 所	美国	966.00	1,119,703.49	2.05
10	COSTCO WHOLESALE CORP	开市客	COST US	纳斯达 克交易 所	美国	310.00	1,039,436.99	1.90

注：所用证券代码采用当地市场代码。

## 5.6 报告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。

## 5.7 报告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。

## 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资 明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 5.9 报告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

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值 (人民币元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	期货投资	NASDAQ 100 E-MINI Dec22	-138,375.10	-0.25

## 5.10 报告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

本基金本报告期末未持有基金。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1 基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的投资决策程序说明

基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期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。

### 5.11.2 报告期内基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	128,861.37
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	17,490.50
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,665,263.77
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,811,615.64

### 5.11.4 报告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。

### 5.11.5 报告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。

### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	博时纳斯达克 100 指数发起 (QDII) A 人民币	博时纳斯达克 100 指数发起 (QDII) C 人民币
基金合同生效日基金份额总额	13,146,952.10	5,728,668.58
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	14,814,737.14	45,996,466.13
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	1,250,226.55	17,237,218.09
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	26,711,462.69	34,487,916.62

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

基金合同生效日管理人持有的本基金份额	10,000,658.90
基金合同生效日起至报告期期末买入/申购总份额	-
基金合同生效日起至报告期期末卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,000,658.90
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	16.34

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额 (份)	交易金额 (元)	适用费率
1	认购	2022-07-25	10,000,658.90	10,000,688.90	-
合计			10,000,658.90	10,000,688.90	

## §8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,658.90	16.34%	10,000,658.90	16.34%	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,658.90	16.34%	10,000,658.90	16.34%	-

## §9 影响投资者决策的其他重要信息

### 9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

无。

## 9.2 影响投资者决策的其他重要信息

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。“为国民创造财富”是博时的使命。博时的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 2022 年 9 月 30 日，博时基金公司共管理 335 只公募基金，并受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金，以及多个企业年金、职业年金及特定专户，管理资产总规模逾 16597 亿元人民币，剔除货币基金后，博时基金公募资产管理总规模逾 5970 亿元人民币，累计分红逾 1721 亿元人民币，是目前我国资产管理规模最大的基金公司之一。

## §10 备查文件目录

---

### 10.1 备查文件目录

10.1.1 中国证券监督管理委员会批准博时纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金 (QDII) 设立的文件

10.1.2 《博时纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金 (QDII) 基金合同》

10.1.3 《博时纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金 (QDII) 托管协议》

10.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

10.1.5 报告期内博时纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金 (QDII) 在指定报刊上各项公告的原稿

### 10.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

### 10.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查询，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

博时一线通：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司

二〇二二年十月二十六日