

# 国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金

2023 年中期报告

2023 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：二〇二三年八月三十日

## 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2023 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 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.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
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.....	12
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.....	12
<b>5 托管人报告</b> .....	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	12
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.....	12
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.....	12
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	17
<b>7 投资组合报告</b> .....	33
7.1 期末基金资产组合情况.....	33
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.....	34
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
7.4.1 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.....	35
7.4.2 期末积极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.....	43
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.....	45
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.....	45
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.....	45
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

<b>8 基金份额持有人信息</b> .....	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	46
8.3 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 .....	46
<b>9 开放式基金份额变动</b> .....	46
<b>10 重大事件揭示</b> .....	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 .....	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	47
<b>11 备查文件目录</b> .....	50
11.1 备查文件目录 .....	50
11.2 存放地点 .....	50
11.3 查阅方式 .....	50

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金
基金简称	国泰纳斯达克 100 指数 (QDII)
基金主代码	160213
交易代码	160213
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 4 月 29 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	345,751,460.70 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	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, 以下简称“标的指数”) 的有效跟踪，追求跟踪误差最小化。
投资策略	<p>本基金原则上采取完全复制策略，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。但因特殊情况导致基金无法及时获得足够数量的股票时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。</p> <p>本基金的风险控制目标是追求日均跟踪误差不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 5%（注：以美元资产计价计算）。</p> <p>开放式指数基金跟踪误差的来源主要包括现金拖累、成份股调整时的交易策略以及基金每日现金流入/流出的建仓/变现策略、成份股股息的再投资策略等。基金管理人将通过对这些因素的有效管理，追求跟踪误差最小化。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 Nasdaq-100 指数为投资标的的指数型公募基金（包括 ETF）（以下简称“目标基金”）。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	纳斯达克 100 指数 (Nasdaq-100 Index) 收益率（总收益指数收益率）
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，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。

### 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	王小飞
	联系电话	021-31081600转	021-60637103
	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		(021) 31089000, 400-888-8688	021-60637228
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	《证券日报》
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（2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	62,343,172.97
本期利润	723,762,144.93
加权平均基金份额本期利润	1.9550
本期加权平均净值利润率	36.91%
本期基金份额净值增长率	43.67%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	937,042,951.98
期末可供分配基金份额利润	2.7102
期末基金资产净值	2,236,194,791.28
期末基金份额净值	6.468
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	678.56%

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

(2)所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，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	8.56%	1.02%	6.55%	1.03%	2.01%	-0.01%
过去三个月	20.92%	1.11%	15.39%	1.08%	5.53%	0.03%
过去六个月	43.67%	1.27%	39.35%	1.26%	4.32%	0.01%
过去一年	39.58%	1.60%	33.13%	1.57%	6.45%	0.03%
过去三年	48.66%	1.57%	53.02%	1.54%	-4.36%	0.03%
自基金合同生效起至今	678.56%	1.30%	770.72%	1.33%	-92.16%	-0.03%

注：同期业绩比较基准以美元计价，不包含人民币汇率变动等因素产生的效应。

##### 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

国泰纳斯达克 100 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  
 (2010 年 4 月 29 日至 2023 年 6 月 30 日)



注：（1）本基金的合同生效日为 2010 年 4 月 29 日。本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

（2）同期业绩比较基准以美元计价，不包含人民币汇率变动等因素产生的效应。

## 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 2023 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 244 只开放式证券投资基金。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		
朱丹	国泰大宗商品（QDII-LOF）、国泰纳斯达克 100 指数（QDII）、国泰蓝筹精选混合的基金经理、国际业务部副总监	2022-01-27	-	7 年	硕士研究生。2016 年 1 月加入国泰基金，历任研究员、基金经理助理。2020 年 11 月至 2023 年 5 月任国泰恒生港股通指数证券投资基金（LOF）的基金经理，2022 年 1 月起兼任国泰大宗商品配置证券投资基金（LOF）和国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金的基金经理，2022 年 12 月起兼任国泰蓝筹精选混合型证券投资基金的基金经理。2023 年 6 月起任国际业务部副总监。

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）本基金管理人所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所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

2023 年上半年美股震荡上行，不同指数表现有所分化。大盘指数标普 500 上涨 15.9%，周期股为主的道琼斯工业指数上涨 3.8%，科技股为主的纳斯达克指数上涨 31.7%，其中市值排名前 100 名公司组成的纳斯达克 100 指数（本基金跟踪的指数）上涨 38.9%。上半年美元兑人民币升值 4.5%，对本基金人民币计价净值有正向帮助。剔除汇率因素后，本基金净值走势和纳斯达克 100 指数走势高度吻合。

1 月美国通胀回落趋势持续，主要经济数据如制造业、服务业 PMI 等不及预期，宽松预期不断强化，市场风险偏好抬升带动股市上涨。2 月 FOMC 如期放缓加息步伐至 25bp，但此后公布的非农就业以及通胀数据均显强韧，零售销售等重要消费指标也显示美国经济增长预期有所修复，叠加美联储 2 月会议纪要重申抗通胀决心，市场修正过于乐观的降息预期，股市出现回落。3 月欧美银行风险引发市场恐慌情绪，市场一度跌超 5%，但基于防风险和抗通胀两害取其轻的考量，短期内市场大幅押注美联储年内转向，美债利率快速回落，从而一定程度上帮助成长股企稳。3 月 FOMC 继续加息 25bp，但对后续紧缩路径措辞有所软化，同时强调银行体系风险可控，市场风险偏好在美联储及时介入下再度回暖。4 月美国就业数据韧性较强，核心通胀粘性较大，市场加息预期不断抬升，美股总体收平。5 月第一共和银行暴雷、美国债务上限临近等事件一度让市场趋于谨慎，但最终风险都平稳化解，美股也随市场风险偏好回升而重拾升势。6 月美国就业、消费、地产等多方面经济数据超预期，印证美国经济内生动能仍强，市场重新开始追逐风险，股市继续走高。

聚焦到美股科技股层面，一季度公布的 22 年四季度净利润均出现不同程度的下滑。来自于宏观经济的逆风、美元走强等问题是科技股业绩承压的主要因素。这些公司普遍意识到当前宏观压力，积极通过削减开支、降本增效的方式提升盈利能力。但是到二季度，五家公司公布的 23 年第一季度业绩表现环比改善，普遍超市场预期。考虑到美国二季度宏观经济的超预期坚韧，其后续业绩或仍有支撑。科技创新仍是抵御周期的最强劲武器。自年初被收购的 Open AI 发布 ChatGPT 应用后，生成式人工智能（AIGC）迅速成为新一轮数字产业化变革浪潮，所涉及的产业链已迅速成为全球资本瞩目的焦点，相关公司股价在 23 年上半年均实现大幅上涨。我们有理由相信科技企业巨头们已通过持之以恒的研究创新，逐渐具备从量变到质变的厚积薄发能力，从而有望在中长期持续推动自身不断成长进化。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内的净值增长率为 43.67%，同期业绩比较基准收益率为 39.35%。

#### 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 2023 年下半年，我们认为需关注美联储货币政策、AIGC 为代表的产业创新浪潮。

美联储货币政策方面，考虑到美国经济韧性十足，核心通胀仍具粘性，美联储仍可能进一步加大紧缩力度。紧缩预期的变化可能导致美债利率波动加大，从而对利率敏感的成长股产生扰动。

产业创新浪潮方面，目前美股科技股汇集了全球最头部的 AI 产业链公司，我们看好美股科技龙头通过深厚研发实力将预期兑现为业绩的能力，未来几个季度 AI 技术和产品的推广能否为这些公司打开新的增长曲线，并带动估值的提升，值得重点关注。不过短期需注意交易拥挤带来的股价波动。

接下来我们仍将继续利用国泰纳斯达克 100 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，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组

合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	283,839,067.42	107,185,664.51
结算备付金		55,277.37	53,279.19
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	2,109,755,631.80	1,471,140,672.24
其中：股票投资		2,041,971,847.16	1,421,242,043.36
基金投资		67,783,784.64	49,898,628.88
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		8,311,930.37	-
应收股利		264,044.40	541,243.79
应收申购款		15,438,507.90	8,204,126.97
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		2,417,664,459.26	1,587,124,986.70
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>
<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		-	-
应付清算款		-	13,222,058.88
应付赎回款		178,228,591.97	6,748,561.64
应付管理人报酬		1,466,878.24	1,095,989.09
应付托管费		458,399.47	342,496.63

应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		290,228.58	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	1,025,569.72	501,687.80
负债合计		181,469,667.98	21,910,794.04
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	345,751,460.70	347,667,342.12
未分配利润	6.4.7.8	1,890,443,330.58	1,217,546,850.54
净资产合计		2,236,194,791.28	1,565,214,192.66
负债和净资产总计		2,417,664,459.26	1,587,124,986.70

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 6.468 元，基金份额总额 345,751,460.70 份。

## 6.2 利润表

会计主体：国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		734,685,280.23	-482,878,272.57
1.利息收入		495,130.16	139,664.86
其中：存款利息收入	6.4.7.9	495,130.16	139,664.86
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）		67,875,894.11	38,316,524.79
其中：股票投资收益	6.4.7.10	51,915,095.22	34,380,723.51
基金投资收益	6.4.7.11	8,508,050.23	-1,211,163.43
债券投资收益	6.4.7.12	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	7,452,748.66	5,146,964.71
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	661,418,971.96	-524,243,850.95
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		4,204,515.63	2,470,923.44

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	690,768.37	438,465.29
<b>减：二、营业总支出</b>		10,923,135.30	8,658,377.33
1. 管理人报酬		7,757,432.84	6,151,276.33
2. 托管费		2,424,197.72	1,922,273.87
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		31,095.92	1,051.76
8. 其他费用	6.4.7.17	710,408.82	583,775.37
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>723,762,144.93</b>	<b>-491,536,649.90</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>723,762,144.93</b>	<b>-491,536,649.90</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		723,762,144.93	-491,536,649.90

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	347,667,342.12	1,217,546,850.54	1,565,214,192.66
二、本期期初净资产（基金净值）	347,667,342.12	1,217,546,850.54	1,565,214,192.66
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,915,881.42	672,896,480.04	670,980,598.62
（一）、综合收益总额	-	723,762,144.93	723,762,144.93
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”	-1,915,881.42	-50,865,664.89	-52,781,546.31

号填列)			
其中：1.基金申购款	115,641,865.91	496,462,885.01	612,104,750.92
2.基金赎回款	-117,557,747.33	-547,328,549.90	-664,886,297.23
(三)、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)	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	345,751,460.70	1,890,443,330.58	2,236,194,791.28
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	304,448,956.61	1,602,771,833.99	1,907,220,790.60
二、本期期初净资产(基金净值)	304,448,956.61	1,602,771,833.99	1,907,220,790.60
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-3,364,119.97	-508,610,722.58	-511,974,842.55
(一)、综合收益总额	-	-491,536,649.90	-491,536,649.90
(二)、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)	-3,364,119.97	-17,074,072.68	-20,438,192.65
其中：1.基金申购款	87,075,351.81	373,974,357.37	461,049,709.18
2.基金赎回款	-90,439,471.78	-391,048,430.05	-481,487,901.83
(三)、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)	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	301,084,836.64	1,094,161,111.41	1,395,245,948.05

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

国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金(以下简称“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[2010]第 208 号《关于核准国泰纳斯达克 100 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》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，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 555,798,507.70 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(2010)第 098 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金基金合同》于 2010 年 4 月 29 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 555,982,545.46 份基金份额，其中认购资金利息折合 184,037.76 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。

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《国泰纳斯达克 100 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具有良好流动性的金融工具，包括 Nasdaq-100 指数成份股、在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的、以 Nasdaq-100 指数为投资标的的指数型公募基金(包括 ETF)(以下简称“目标基金”)、货币市场工具以及中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等；本基金至少 80%的资产投资于 Nasdaq-100 指数的成份股和目标基金，其中，本基金持有的目标基金的市值合计不超过本基金资产净值的 10%。本基金的业绩比较基准为：纳斯达克 100 指数(Nasdaq-100 Index)收益率(总收益指数收益率)。

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 2023 年 8 月 28 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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(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》、《国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、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 2023 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 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

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：

(1) 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，对国债、地方政府债以及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。

(2) 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。

(3) 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。

(4) 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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	283,839,067.42
等于：本金	283,826,808.76
加：应计利息	12,258.66
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	283,839,067.42

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	1,398,127,222.94	-	2,041,971,847.16	643,844,624.22
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		53,505,071.73	-	67,783,784.64	14,278,712.91
其他		-	-	-	-
合计		1,451,632,294.67	-	2,109,755,631.80	658,123,337.13

### 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 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	592,853.80
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	119,014.74
应付指数使用费	313,701.18
合计	1,025,569.72

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	347,667,342.12	347,667,342.12
本期申购	115,641,865.91	115,641,865.91
本期赎回（以“-”号填列）	-117,557,747.33	-117,557,747.33
本期末	345,751,460.70	345,751,460.70

#### 6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	881,038,324.31	336,508,526.23	1,217,546,850.54
本期利润	62,343,172.97	661,418,971.96	723,762,144.93
本期基金份额交易产生的变动数	-6,338,545.30	-44,527,119.59	-50,865,664.89
其中：基金申购款	293,524,979.60	202,937,905.41	496,462,885.01
基金赎回款	-299,863,524.90	-247,465,025.00	-547,328,549.90
本期已分配利润	-	-	-
本期末	937,042,951.98	953,400,378.60	1,890,443,330.58

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	-
其他	2,670.61
合计	495,130.16

#### 6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
	卖出股票成交总额
减：卖出股票成本总额	154,774,896.04
减：交易费用	67,631.10

买卖股票差价收入	51,915,095.22
----------	---------------

#### 6.4.7.11 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	113,329,073.58
减：卖出/赎回基金成本总额	104,432,185.46
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	259,132.66
减：交易费用	129,705.23
基金投资收益	8,508,050.23

#### 6.4.7.12 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

#### 6.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	6,929,169.94
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	523,578.72
合计	7,452,748.66

#### 6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	661,418,971.96
——股票投资	611,536,394.65
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	49,882,577.31
——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	661,418,971.96

#### 6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	690,768.37
合计	690,768.37

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

#### 6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023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	6,583.94
存托凭证费用	3,002.72
指数使用费	581,807.42
合计	710,408.82

注：根据《国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金基金合同》，本基金的指数使用费从基金财产中列支。在通常情况下，指数使用费按前一日的基金资产净值的 0.06% 的年费率计提，逐日累计，每季支付一次。计算方法如下：

每日指数使用费 = 前一日基金资产净值 X 0.06% / 当年天数。

### 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
-------	---------

国泰基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
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、基金销售机构

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

本基金本报告期内及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

##### 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 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6 月30日
当期发生的基金应支付的管理费	7,757,432.84	6,151,276.33
其中：支付销售机构的客户维护费	2,908,385.09	2,339,348.26

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 0.80% 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 0.80% / 当年天数。

###### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,424,197.72	1,922,273.87

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 0.25% 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 0.25% / 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

本基金本报告期内及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

##### 6.4.10.4 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均无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。



#### 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均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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	176,096,389.77	116,086.91	104,750,926.95	136,907.09
美国道富银行	107,742,677.65	376,372.64	21,868,881.40	2,008.53

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美国道富银行保管，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（2023 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

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

###### 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，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。风险管理部和稽核监察部由督察长分管，配置有法律、风控、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人中国建设银行及境外次托管人道富银行，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通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，因此信用风险不重大。

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 2023 年 6 月 30 日，本基金持有信用类债券比例为 0.00%(2022 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一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金份额持有人利益。

于 2023 年 06 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约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(净资产)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综合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间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%，持有境外基金的市值合计不得超过基金净值的 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境外基金总份额的 20%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持证券在证券交易所上市，均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金资产净值的 10%。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%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

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 2023 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	283,839,067.42	-	-	-	283,839,067.42
结算备付金	-	-	-	55,277.37	55,277.37
交易性金融资产	-	-	-	2,109,755,631.80	2,109,755,631.80

					80
应收清算款	-	-	-	8,311,930.37	8,311,930.37
应收股利	-	-	-	264,044.40	264,044.40
应收申购款	390,518.52	-	-	15,047,989.38	15,438,507.90
资产总计	284,229,585.94	-	-	2,133,434,873.32	2,417,664,459.26
负债					
应付赎回款	-	-	-	178,228,591.97	178,228,591.97
应付管理人报酬	-	-	-	1,466,878.24	1,466,878.24
应付托管费	-	-	-	458,399.47	458,399.47
应交税费	-	-	-	290,228.58	290,228.58
其他负债	-	-	-	1,025,569.72	1,025,569.72
负债总计	-	-	-	181,469,667.98	181,469,667.98
利率敏感度缺口	284,229,585.94	-	-	1,951,965,205.34	2,236,194,791.28
上年度末 2022 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	107,185,664.51	-	-	-	107,185,664.51
结算备付金	-	-	-	53,279.19	53,279.19
交易性金融资产	-	-	-	1,471,140,672.24	1,471,140,672.24
应收股利	-	-	-	541,243.79	541,243.79
应收申购款	150,931.57	-	-	8,053,195.40	8,204,126.97
资产总计	107,336,596.08	-	-	1,479,788,390.62	1,587,124,986.70
负债					
应付清算款	-	-	-	13,222,058.88	13,222,058.88
应付赎回款	-	-	-	6,748,561.64	6,748,561.64
应付管理人报酬	-	-	-	1,095,989.09	1,095,989.09
应付托管费	-	-	-	342,496.63	342,496.63
其他负债	-	-	-	501,687.80	501,687.80

负债总计	-	-	-	21,910,794.04	21,910,794.04
利率敏感度缺口	107,336,596.08	-	-	1,457,877,596.58	1,565,214,192.66

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，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 2023 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净资产的比例为 0.00%（2022 年 12 月 31 日：0.00%），因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响（2022 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 2023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	108,004,082.53	108,004,082.53
结算备付金	55,277.37	55,277.37
交易性金融资产	2,109,755,631.80	2,109,755,631.80
应收股利	264,044.40	264,044.40
应收清算款	8,311,930.37	8,311,930.37
资产合计	2,226,390,966.47	2,226,390,966.47
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	2,226,390,966.47	2,226,390,966.47
项目	上年度末 2022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	51,304,787.39	51,304,787.39
结算备付金	53,279.19	53,279.19
交易性金融资 产	1,471,140,672.24	1,471,140,672.24
应收股利	541,243.79	541,243.79
资产合计	1,523,039,982.61	1,523,039,982.61
以外币计价的 负债		
应付清算款	13,222,058.88	13,222,058.88
负债合计	13,222,058.88	13,222,058.88
资产负债表外 汇风险敞口净 额	1,509,817,923.73	1,509,817,923.73

#### 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 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
	美元相对人民币升值 5%	增加约 11,132	增加约 7,549
	美元相对人民币贬值 5%	减少约 11,132	减少约 7,549

### 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。本基金主要投资于上市交易的证券，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。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置。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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	2,041,971,847.16	91.31	1,421,242,043. 36	90.80
交易性金融资产—基金投资	67,783,784.64	3.03	49,898,628.88	3.19
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,109,755,631.80	94.35	1,471,140,672. 24	93.99

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准外的其他市场变量不变		
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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 11,213	增加约 7,866
	业绩比较基准下降 5%	减少约 11,213	减少约 7,866

### 6.4.14 公允价值



#### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	2,109,755,631.80	1,471,140,672.24
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	2,109,755,631.80	1,471,140,672.24

##### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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。

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 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(2022 年 12 月 31 日：同)。

##### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日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	2,041,971,847.16	84.46
	其中：普通股	2,019,487,202.45	83.53
	存托凭证	22,484,644.71	0.93
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	67,783,784.64	2.80
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	283,894,344.79	11.74
8	其他各项资产	24,014,482.67	0.99
9	合计	2,417,664,459.26	100.00

## 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
美国	2,041,971,847.16	91.31
合计	2,041,971,847.16	91.31

## 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 (%)
信息技术	1,046,895,655.83	46.82
通讯业务	336,159,722.56	15.03
非日常生活消费品	311,369,834.52	13.92
医疗保健	117,106,250.01	5.24
日常消费品	107,925,726.61	4.83

工业	79,827,693.89	3.57
公用事业	20,090,651.53	0.90
金融	10,077,512.55	0.45
能源	7,566,958.92	0.34
房地产	4,951,840.74	0.22
原材料	-	-
合计	2,041,971,847.16	91.31

注：以上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的股票及存托凭证。

## 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	MICROS OFT CORP	微软公司	MSFT US	纳斯达 克	美国	106,800	262,799,975.94	11.75
2	APPLE INC	苹果公司	AAPL US	纳斯达 克	美国	182,410	255,663,744.79	11.43
3	NVIDIA CORP	英伟达	NVDA US	纳斯达 克	美国	46,200	141,217,595.72	6.32
4	AMAZO N.COM INC	亚马逊公 司	AMZN US	纳斯达 克	美国	148,000	139,409,382.62	6.23
5	TESLA INC	特斯拉公 司	TSLA US	纳斯达 克	美国	45,700	86,441,443.34	3.87
6	META PLATFO RMS INC-CLA SS A	Meta 平台 股份有限 公司	META US	纳斯达 克	美国	41,400	85,849,527.48	3.84
7	ALPHAB ET INC-CLA	Alphabet 公司	GOOGL US	纳斯达 克	美国	87,300	75,508,237.10	3.38
8	ALPHAB ET INC-CL C	Alphabet 公司	GOOG US	纳斯达 克	美国	84,700	74,036,695.70	3.31

9	BROADCOM INC	博通股份有限公司	AVGO US	纳斯达克	美国	7,800	48,889,430.41	2.19
10	PEPSICO INC	百事可乐	PEP US	纳斯达克	美国	25,800	34,529,757.04	1.54
11	COSTCO WHOLESALE CORP	开市客	COST US	纳斯达克	美国	8,300	32,288,877.49	1.44
12	ADOBE INC	奥多比	ADBE US	纳斯达克	美国	8,600	30,386,757.90	1.36
13	CISCO SYSTEMS INC	思科系统股份有限公司	CSCO US	纳斯达克	美国	76,300	28,525,738.66	1.28
14	NETFLIX INC	奈飞公司	NFLX US	纳斯达克	美国	8,400	26,736,298.19	1.20
15	ADVANCED MICRO DEVICES	AMD 公司	AMD US	纳斯达克	美国	30,210	24,865,575.42	1.11
16	COMCAST CORP-CLASS A	康卡斯特公司	CMCSA US	纳斯达克	美国	77,800	23,358,048.82	1.04
17	T-MOBILE US INC	T-Mobile US 股份有限公司	TMUS US	纳斯达克	美国	22,500	22,582,431.45	1.01
18	TEXAS INSTRUMENTS INC	德州仪器	TXN US	纳斯达克	美国	17,000	22,113,404.77	0.99
19	INTEL CORP	英特尔	INTC US	纳斯达克	美国	78,100	18,871,361.73	0.84
20	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	霍尼韦尔	HON US	纳斯达克	美国	12,500	18,741,918.75	0.84
21	QUALCOMM INC	高通公司	QCOM US	纳斯达克	美国	20,900	17,977,327.95	0.80
22	INTUIT INC	Intuit 股份有限公司	INTU US	纳斯达克	美国	5,300	17,547,183.30	0.78
23	APPLIED MATERIALS INC	应用材料	AMAT US	纳斯达克	美国	15,800	16,501,790.69	0.74

24	INTUITIVE SURGICAL INC	直觉外科手术公司	ISRG US	纳斯达克	美国	6,600	16,307,214.34	0.73
25	AMGEN INC	安进公司	AMGN US	纳斯达克	美国	10,000	16,042,721.16	0.72
26	STARBUCKS CORP	星巴克公司	SBUX US	纳斯达克	美国	21,500	15,389,436.58	0.69
27	BOOKING HOLDINGS INC	Booking 控股股份有限公司	BKNG US	纳斯达克	美国	750	14,634,033.39	0.65
28	MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	亿滋国际	MDLZ US	纳斯达克	美国	25,500	13,439,771.23	0.60
29	ANALOG DEVICES INC	亚德诺半导体	ADI US	纳斯达克	美国	9,400	13,231,986.12	0.59
30	GILEAD SCIENCES INC	吉利德科学	GILD US	纳斯达克	美国	23,400	13,031,282.30	0.58
31	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	福泰制药	VRTX US	纳斯达克	美国	4,900	12,459,873.26	0.56
32	AUTOMATIC DATA PROCESSING	ADP 公司	ADP US	纳斯达克	美国	7,800	12,387,636.94	0.55
33	LAM RESEARCH CORP	泛林集团	LRCX US	纳斯达克	美国	2,600	12,077,462.25	0.54
34	REGENERON PHARMACEUTICALS	再生元制药股份有限公司	REGN US	纳斯达克	美国	2,100	10,903,255.30	0.49
35	PALO ALTO NETWORKS	Palo Alto Networks 股份有限	PANW US	纳斯达克	美国	5,800	10,708,332.12	0.48

	RKS INC	公司						
36	PAYPAL HOLDINGS INC	Paypal 控股股份有限公司	PYPL US	纳斯达克	美国	20,900	10,077,512.55	0.45
37	CSX CORP	CSX 公司	CSX US	纳斯达克	美国	38,100	9,387,831.62	0.42
38	MICRON TECHNOLOGY INC	美光科技股份有限公司	MU US	纳斯达克	美国	20,500	9,348,414.88	0.42
39	SYNOPSYS INC	新思科技公司	SNPS US	纳斯达克	美国	2,900	9,123,938.18	0.41
40	KLA CORP	KLA 公司	KLAC US	纳斯达克	美国	2,600	9,112,109.54	0.41
41	ACTIVISION BLIZZARD INC	动视暴雪股份有限公司	ATVI US	纳斯达克	美国	14,800	9,015,197.11	0.40
42	ASML HOLDING NV-NY REG SHS	阿斯麦控股公司	ASML US	纳斯达克	美国	1,700	8,902,727.54	0.40
43	CADENCE DESIGN SYS INC	Cadence 设计系统股份有限公司	CDNS US	纳斯达克	美国	5,100	8,642,432.54	0.39
44	O'REILLY AUTOMOTIVE INC	O'Reilly 汽车股份有限公司	ORLY US	纳斯达克	美国	1,200	8,283,368.09	0.37
45	MONSTER BEVERAGE CORP	怪兽饮料公司	MNST US	纳斯达克	美国	19,600	8,134,979.06	0.36
46	MERCADOLIBRE INC	MercadoLibre 股份有限公司	MELI US	纳斯达克	美国	950	8,131,698.55	0.36
47	FORTINET INC	Fortinet 股份有限公司	FTNT US	纳斯达克	美国	14,700	8,029,113.86	0.36
48	CHARTER COMMUNICATIONS INC	Charter 通信公司	CHTR US	纳斯达克	美国	2,900	7,698,172.22	0.34

	NS INC-A							
49	MARRIO TT INTERN ATIONA L-CLA	万豪国际	MAR US	纳斯达 克	美国	5,700	7,565,651.05	0.34
50	NXP SEMICO DUCTO RS NV	恩智浦半 导体公司	NXPI US	纳斯达 克	美国	4,900	7,246,986.05	0.32
51	AIRBNB INC-CLA SS A	爱彼迎股 份有限公 司	ABNB US	纳斯达 克	美国	7,800	7,223,256.52	0.32
52	CINTAS CORP	CINTAS 公司	CTAS US	纳斯达 克	美国	2,000	7,183,601.33	0.32
53	MARVEL L TECHNO LOGY INC	美满电子 科技公司	MRVL US	纳斯达 克	美国	16,100	6,954,529.02	0.31
54	DEXCO M INC	Dexcom 股 份有限公 司	DXCM US	纳斯达 克	美国	7,300	6,778,689.17	0.30
55	MICROC HIP TECHNO LOGY INC	微芯科技 股份有限 公司	MCHP US	纳斯达 克	美国	10,200	6,603,066.10	0.30
56	WORKD AY INC-CLA SS A	Workday 股 份有限公 司	WDAY US	纳斯达 克	美国	3,900	6,365,720.25	0.28
57	MODER NA INC	莫德纳公 司	MRNA US	纳斯达 克	美国	7,200	6,321,129.84	0.28
58	LULULE MON ATHLETI CA INC	Lululemon Athletica 股份有限 公司	LULU US	纳斯达 克	美国	2,300	6,290,420.19	0.28
59	AUTODE SK INC	欧特克	ADSK US	纳斯达 克	美国	4,100	6,061,730.85	0.27
60	PACCAR INC	帕卡	PCAR US	纳斯达 克	美国	9,850	5,953,715.97	0.27
61	KEURIG DR	Keurig Dr Pepper 有	KDP US	纳斯达 克	美国	26,300	5,942,505.15	0.27

	PEPPER INC	限公司						
62	COPART INC	Copart 股 份有限公 司	CPRT US	纳斯达 克	美国	9,000	5,931,586.96	0.27
63	AMERIC AN ELECTRI C POWER	美国电力	AEP US	纳斯达 克	美国	9,700	5,901,599.89	0.26
64	KRAFT HEINZ CO/THE	卡夫亨氏 公司	KHC US	纳斯达 克	美国	23,000	5,899,865.70	0.26
65	IDEXX LABORA TORIES INC	爱德士股 份有限公 司	IDXX US	纳斯达 克	美国	1,600	5,806,421.65	0.26
66	BIOGEN INC	渤健公司	BIIB US	纳斯达 克	美国	2,800	5,763,153.56	0.26
67	PDD HOLDIN GS INC	拼多多	PDD US	纳斯达 克	美国	11,500	5,745,305.84	0.26
68	ASTRAZ ENECA PLC-SPO NS ADR	阿斯利康 公共有限 公司	AZN US	纳斯达 克	美国	11,100	5,740,370.62	0.26
69	OLD DOMINI ON FREIGHT LINE	Old Dominion Freight Line 股份 有限公司	ODFL US	纳斯达 克	美国	2,100	5,610,653.06	0.25
70	ON SEMICO DUCTO R	安森美半 导体公司	ON US	纳斯达 克	美国	8,100	5,535,670.93	0.25
71	EXELON CORP	Exelon 公 司	EXC US	纳斯达 克	美国	18,700	5,504,889.02	0.25
72	PAYCHE X INC	Paychex 公司	PAYX US	纳斯达 克	美国	6,800	5,496,781.67	0.25
73	ROSS STORES INC	罗斯百货 股份有限 公司	ROST US	纳斯达 克	美国	6,400	5,185,465.31	0.23
74	GE HEALTH CARE	GE HealthCare Technologi	GEHC US	纳斯达 克	美国	8,600	5,048,406.33	0.23



	TECHNOLOGY	es Inc						
75	SEAGEN INC	Seagen 股份有限公司	SGEN US	纳斯达克	美国	3,600	5,006,438.88	0.22
76	COSTAR GROUP INC	CoStar 集团股份有限公司	CSGP US	纳斯达克	美国	7,700	4,951,840.74	0.22
77	ELECTRONIC ARTS INC	电子艺界	EA US	纳斯达克	美国	5,200	4,873,368.55	0.22
78	GLOBALFOUNDRIES INC	格罗方德半导体股份有限公司	GFS US	纳斯达克	美国	10,300	4,806,414.29	0.21
79	XCEL ENERGY INC	Xcel 能源	XEL US	纳斯达克	美国	10,300	4,627,048.26	0.21
80	VERISK ANALYTICS INC	Verisk 分析公司	VRSK US	纳斯达克	美国	2,800	4,573,093.21	0.20
81	FASTENAL CO	法思诺公司	FAST US	纳斯达克	美国	10,700	4,560,874.38	0.20
82	COGNIZANT TECHNO SOLUTIONS-A	高知特科技公司	CTSH US	纳斯达克	美国	9,500	4,481,152.13	0.20
83	CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	CrowdStrike 控股股份有限公司	CRWD US	纳斯达克	美国	4,200	4,457,263.63	0.20
84	DOLLAR TREE INC	美元树公司	DLTR US	纳斯达克	美国	4,200	4,354,989.66	0.19
85	BAKER HUGHES CO	贝克休斯公司	BKR US	纳斯达克	美国	19,000	4,339,743.22	0.19
86	WARNER BROS DISCOVERY INC	华纳兄弟探索股份有限公司	WBD US	纳斯达克	美国	45,600	4,131,885.86	0.18
87	ILLUMINA	Illumina 公	ILMN US	纳斯达	美国	3,000	4,064,295.73	0.18

	A INC	司		克				
88	CONSTELLATION ENERGY	美国联合能源公司	CEG US	纳斯达克	美国	6,133	4,057,114.36	0.18
89	DATADOG INC - CLASS A	Datadog 股份有限公司	DDOG US	纳斯达克	美国	5,600	3,980,895.54	0.18
90	ANSYS INC	ANSYS 股份有限公司	ANSS US	纳斯达克	美国	1,650	3,937,667.19	0.18
91	ALIGN TECHNOLOGY INC	Align 科技股份有限公司	ALGN US	纳斯达克	美国	1,500	3,832,997.87	0.17
92	ATLASSIAN CORP-CLASS A	Atlassian Corp	TEAM US	纳斯达克	美国	2,900	3,516,428.34	0.16
93	WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	沃博联股份有限公司	WBA US	纳斯达克	美国	16,200	3,334,981.28	0.15
94	EBAY INC	eBay 公司	EBAY US	纳斯达克	美国	10,100	3,261,502.12	0.15
95	DIAMONDBACK ENERGY INC	Diamondback 能源股份有限公司	FANG US	纳斯达克	美国	3,400	3,227,215.70	0.14
96	ENPHASE ENERGY INC	Enphase 能源股份有限公司	ENPH US	纳斯达克	美国	2,600	3,146,460.16	0.14
97	ZSCALER INC	Zscaler 股份有限公司	ZS US	纳斯达克	美国	2,800	2,959,976.71	0.13
98	SIRIUS XM HOLDINGS INC	Sirius XM 控股公司	SIRI US	纳斯达克	美国	72,400	2,369,860.08	0.11
99	ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	Zoom 视频通信股份有限公司	ZM US	纳斯达克	美国	4,700	2,305,290.33	0.10

100	JD.COM INC-ADR	京东集团	JD US	纳斯达 克	美国	8,500	2,096,240.71	0.09
101	LUCID GROUP INC	Lucid 集团 股份有限 公司	LCID US	纳斯达 克	美国	34,400	1,712,630.21	0.08

#### 7.4.2 期末积极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

本基金本报告期末未持有积极权益投资。

### 7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

#### 7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金 资产净值比例 （%）
1	MICROSOFT CORP	MSFT US	18,964,064.66	1.21
2	APPLE INC	AAPL US	18,924,161.76	1.21
3	AMAZON.COM INC	AMZN US	10,573,360.68	0.68
4	NVIDIA CORP	NVDA US	6,552,051.60	0.42
5	ALPHABET INC-CL A	GOOGL US	5,981,388.16	0.38
6	ALPHABET INC-CL C	GOOG US	5,975,340.86	0.38
7	ON SEMICONDUCTOR	ON US	5,172,338.20	0.33
8	GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	GEHC US	5,032,754.11	0.32
9	TESLA INC	TSLA US	5,028,965.66	0.32
10	META PLATFORMS INC-CLASS A	META US	4,586,947.87	0.29
11	BROADCOM INC	AVGO US	3,693,647.97	0.24
12	PEPSICO INC	PEP US	3,091,939.07	0.20
13	CISCO SYSTEMS INC	CSCO US	2,684,316.75	0.17
14	COSTCO WHOLESALE CORP	COST US	2,668,718.44	0.17
15	T-MOBILE US INC	TMUS US	2,292,144.39	0.15
16	COMCAST CORP-CLASS A	CMCSA US	2,215,080.95	0.14
17	PACCAR INC	PCAR US	2,191,089.02	0.14
18	TEXAS INSTRUMENTS INC	TXN US	2,159,015.59	0.14
19	PDD HOLDINGS INC	PDD US	1,927,652.98	0.12
20	AMGEN INC	AMGN US	1,912,810.31	0.12

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	27,591,439.04	1.76
2	MICROSOFT CORP	MSFT US	26,323,352.85	1.68
3	AMAZON.COM INC	AMZN US	13,061,930.75	0.83
4	NVIDIA CORP	NVDA US	12,201,867.16	0.78
5	FISERV INC	FI US	10,582,552.41	0.68
6	ALPHABET INC-CL C	GOOG US	10,078,889.53	0.64
7	META PLATFORMS INC-CLASS A	META US	9,126,999.33	0.58
8	ALPHABET INC-CL A	GOOGL US	8,097,747.34	0.52
9	TESLA INC	TSLA US	6,997,043.06	0.45
10	BROADCOM INC	AVGO US	3,881,482.42	0.25
11	PEPSICO INC	PEP US	3,419,826.15	0.22
12	COMCAST CORP-CLASS A	CMCSA US	3,187,548.99	0.20
13	CISCO SYSTEMS INC	CSCO US	3,060,918.20	0.20
14	T-MOBILE US INC	TMUS US	3,051,929.48	0.19
15	COSTCO WHOLESALE CORP	COST US	2,942,617.19	0.19
16	ADOBE INC	ADBE US	2,745,796.79	0.18
17	ADVANCED MICRO DEVICES	AMD US	2,269,129.15	0.14
18	PACCAR INC	PCAR US	2,093,896.45	0.13
19	TEXAS INSTRUMENTS INC	TXN US	2,062,286.25	0.13
20	NETFLIX INC	NFLX US	1,963,635.86	0.13

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	163,968,305.19
卖出收入（成交）总额	206,757,622.36

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 OQQQ	ETF 基金	开放式	ProShares Trust	67,783,784.64	3.03

### 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	应收清算款	8,311,930.37
3	应收股利	264,044.40
4	应收利息	-
5	应收申购款	15,438,507.90
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	24,014,482.67

#### 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的股票。

## 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
150,927	2,290.85	10,605,887.32	3.07%	335,145,573.38	96.93%

### 8.2 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	165,017.47	0.05%

### 8.3 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	0~10
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（2010 年 4 月 29 日）基金份额总额	555,982,545.46
本报告期期初基金份额总额	347,667,342.12
本报告期基金总申购份额	115,641,865.91
减：本报告期基金总赎回份额	117,557,747.33
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	345,751,460.70

## 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，本基金管理人未发生重大人事变动。

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

#### 10.6.1 管理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及高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金托管人及其高级管理人员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	

State Street Global Market	1	-	-	-	-	-
Goldman Sachs And Co. LLC.	1	79,698,052.35	21.50%	15,437.55	23.41%	-
Haitong International Securities Co	1	-	-	-	-	-
Morgan Stanley Co. International plc	1	-	-	-	-	-
Deutsche Bank Asia Limited	1	-	-	-	-	-
China Merchants Securities International Company Limited	1	291,027,875.20	78.50%	50,500.29	76.59%	-
China International Capital Corp (International) Ltd	1	-	-	-	-	-

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	债券交易	回购交易	权证交易	基金交易
----	------	------	------	------



名称	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
State Street Global Market	-	-	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs And Co. LLC.	-	-	-	-	-	-	42,827,915.03	23.06%
Haitong International Securities Co	-	-	-	-	-	-	-	-
Morgan Stanley Co. International plc	-	-	-	-	-	-	-	-
Deutsche Bank Asia Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
China Merchants Securities Inter	-	-	-	-	-	-	137,075,249.03	73.79%

natio nal Com pany Limit ed								
Chin a Inter natio nal Capit al Corp (Inter natio nal) Ltd	-	-	-	-	-	-	5,860, 673.4 3	3.15%

## 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、关于核准国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金募集的批复
- 2、国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金基金合同
- 3、国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金托管协议
- 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。

基金托管人住所或办公场所。

### 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

二〇二三年八月三十日