

华安纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)

2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：华安基金管理有限公司

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规定，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

| | |
|---|----|
| 1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示..... | 2 |
| 2 基金简介 | 5 |
| 2.1 基金基本情况..... | 5 |
| 2.2 基金产品说明..... | 5 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人..... | 5 |
| 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人..... | 6 |
| 2.5 信息披露方式..... | 6 |
| 2.6 其他相关资料..... | 6 |
| 3 主要财务指标和基金净值表现 | 7 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 7 |
| 3.2 基金净值表现..... | 7 |
| 4 管理人报告 | 8 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 8 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明..... | 10 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 11 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明..... | 12 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 12 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 13 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 13 |
| 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..... | 13 |
| 5 托管人报告 | 14 |
| 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明..... | 14 |
| 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..... | 14 |
| 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..... | 14 |
| 6 半年度财务会计报告（未经审计） | 14 |
| 6.1 资产负债表..... | 14 |
| 6.2 利润表..... | 15 |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表..... | 16 |
| 6.4 报表附注..... | 17 |
| 7 投资组合报告 | 38 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 38 |
| 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布..... | 39 |
| 7.3 期末按行业分类的权益投资组合..... | 39 |
| 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..... | 39 |
| 7.4.1 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..... | 39 |
| 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..... | 47 |
| 7.5 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 47 |
| 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合..... | 49 |
| 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..... | 49 |
| 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..... | 49 |
| 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..... | 49 |
| 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..... | 50 |
| 7.11 投资组合报告附注..... | 50 |

| | |
|--|----|
| 8 基金份额持有人信息 | 50 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 50 |
| 8.2 期末上市基金前十名持有人..... | 51 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 51 |
| 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..... | 51 |
| 9 开放式基金份额变动 | 52 |
| 10 重大事件揭示 | 52 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 52 |
| 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..... | 52 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 52 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 52 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 52 |
| 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..... | 52 |
| 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况..... | 52 |
| 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况..... | 52 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 53 |
| 10.8 其他重大事件..... | 54 |
| 11 影响投资者决策的其他重要信息 | 55 |
| 12 备查文件目录 | 56 |
| 12.1 备查文件目录..... | 56 |
| 12.2 存放地点..... | 56 |
| 12.3 查阅方式..... | 56 |

2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|--------------|---------------------------------|
| 基金名称 | 华安纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII） |
| 基金简称 | 华安纳斯达克 100ETF（QDII） |
| 场内简称 | 纳斯达克 ETF |
| 基金主代码 | 159632 |
| 交易代码 | 159632 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2022 年 7 月 21 日 |
| 基金管理人 | 华安基金管理有限公司 |
| 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 | 4,265,720,640.00 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 深圳证券交易所 |
| 上市日期 | 2022 年 8 月 3 日 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。本基金力求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.3%，年跟踪误差不超过 4%。 |
| 投资策略 | <p>本基金主要采取完全复制法进行投资，即参考纳斯达克 100 指数的成份股组成及权重构建股票投资组合，并根据纳斯达克 100 指数的成份股组成及权重变动对股票投资组合进行相应调整。</p> <p>当市场流动性不足等情况导致本基金无法按照指数构成及权重进行组合构建时，基金管理人将通过投资其他成份股、非成份股、成份股个股衍生品进行替代。</p> <p>正常情况下，本基金力求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.3%，年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。</p> |
| 业绩比较基准 | 纳斯达克 100 指数收益率（经汇率调整） |
| 风险收益特征 | <p>本基金为股票型指数基金，因此本基金的预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。</p> <p>本基金为主要投资于境外证券交易市场的证券投资基金，需要承担汇率风险、境外证券交易市场投资所面临的特别投资风险。</p> |

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 | 华安基金管理有限公司 | 中国建设银行股份有限公司 |

| | | | |
|-------------|------|--|------------------------|
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 杨牧云 | 王小飞 |
| | 联系电话 | 021-38969999 | 021-60637103 |
| | 电子邮箱 | service@huaan.com.cn | wangxiaofei.zh@ccb.com |
| 客户服务电话 | | 4008850099 | 021-60637228 |
| 传真 | | 021-68863414 | 021-60635778 |
| 注册地址 | | 中国（上海）自由贸易试验区 临港新片区环湖西二路888号B 楼2118室 | 北京市西城区金融大街25号 |
| 办公地址 | | 中国（上海）自由贸易试验区 世纪大道8号国金中心二期31 —32层 | 北京市西城区闹市口大街1号 院1号楼 |
| 邮政编码 | | 200120 | 100033 |
| 法定代表人 | | 朱学华 | 田国立 |

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

| 项目 | | 境外投资顾问 | 境外资产托管人 |
|------|----|--------|---|
| 名称 | 英文 | - | 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 | 证券时报 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.huaan.com.cn |
| 基金中期报告备置地点 | 上海市世纪大道8号上海国金中心二期31、32层 |

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 | 238,018,944.71 |
| 本期利润 | 1,623,214,025.67 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.3795 |
| 本期加权平均净值利润率 | 36.61% |
| 本期基金份额净值增长率 | 43.55% |
| 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 | 296,588,758.49 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0695 |
| 期末基金资产净值 | 5,406,097,727.40 |
| 期末基金份额净值 | 1.2673 |
| 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 | 26.73% |

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

4、本基金于 2022 年 7 月 21 日成立，截止本报告期末，本基金成立不满一年。

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 | 8.50% | 1.01% | 8.65% | 1.02% | -0.15% | -0.01% |
| 过去三个月 | 20.82% | 1.10% | 21.09% | 1.10% | -0.27% | 0.00% |
| 过去六个月 | 43.55% | 1.27% | 43.96% | 1.28% | -0.41% | -0.01% |
| 过去一年 | - | - | - | - | - | - |
| 过去三年 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|--------|
| 过去五年 | - | - | - | - | - | - |
| 自基金合同生效起至今 | 26.73% | 1.57% | 30.69% | 1.62% | -3.96% | -0.05% |

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

华安纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)
 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
 (2022 年 7 月 21 日至 2023 年 6 月 30 日)



4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]20 号文批准于 1998 年 6 月设立,是国内首批基金管理公司之一,注册资本 1.5 亿元人民币,公司总部设在上海陆家嘴金融贸易区。目前的股东为国泰君安证券股份有限公司、上海上国投资产管理有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司、上海工业投资(集团)有限公司和国泰君安投资管理股份有限公司。公司在香港和上海设有子公司——华安资产管理(香港)有限公司、华安未来资产管理(上海)有限公司。截至 2023 年 6 月

30 日, 公司旗下共管理华安创新混合、华安 MSCI 中国 A、华安现金富利货币、华安稳定收益债券、华安黄金易 ETF、华安沪港深外延增长混合、华安全球美元收益债券等 239 只证券投资基金, 管理资产规模达到 6,023.30 亿元人民币。

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 | | |
| 倪斌 | 本基金的基金经理、指数与量化投资部助理总监 | 2022-07-21 | - | 12 年 | 硕士研究生, 12 年基金行业从业经历。曾任毕马威华振会计师事务所审计员。2010 年 7 月加入华安基金, 历任基金运营部基金会计、指数与量化投资部分析师、基金经理助理。2018 年 9 月起, 同时担任华安标普全球石油指数证券投资基金 (LOF)、华安纳斯达克 100 指数证券投资基金 (2022 年 12 月起, 转型为华安纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (QDII))、华安国际龙头 (DAX) 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、华安 CES 港股通精选 100 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。2019 年 6 月起, 同时担任华安三菱日联日经 225 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 的基金经理。2020 年 5 月起, 同时担任华安法国 CAC40 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 的基金经理。2021 年 1 月至 2022 年 7 月, 同时担任华安中证全指证券公司指数型证券投资基金的基金经理。2021 |

| | | | | |
|--|--|--|--|--|
| | | | | <p>年 2 月起, 同时担任华安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。2021 年 3 月至 2022 年 7 月, 同时担任华安中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 4 月起, 同时担任华安中证申万食品饮料交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 5 月起, 同时担任华安恒生科技交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 的基金经理。2021 年 6 月起, 同时担任华安中证沪港深科技 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 10 月起, 同时担任华安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的基金经理。2022 年 4 月起, 同时担任华安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) 的基金经理。2022 年 7 月起, 同时担任华安纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 的基金经理。2023 年 1 月起, 同时担任华安恒生互联网科技业交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 的基金经理。</p> |
|--|--|--|--|--|

注: 此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日, 即以公告日为准。证券从业的含义遵从行业协会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》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《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说

明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

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

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，将各投资组合在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括：在研究环节，研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中，使用晨会发言、邮件发送、登录在研究报告管理系统中等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节，公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略，制定并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节，公司实行强制公平交易机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。（1）交易所二级市场业务，遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则，实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。（2）交易所一级市场业务，投资组合经理按意愿独立进行业务申报，集中交易部以投资组合名义对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签，则按实际中签情况以价格优先、比例分配原则进行分配。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在合规监察员监督参与下，进行公平协商分配。（3）银行间市场业务遵循指令时间优先原则，先到先询价的控制原则。通过内部共同的 iwind 群，发布询价需求和结果，做到信息公开。若是多个投资组合进行一级市场投标，则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向，交易员以此进行投标，以确保中签结果与投资组合投标意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在风险管理部投资监督参与下，进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节，公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上市交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（日内、3日内、5

日内）的本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司风险管理部会同基金投资、交易部门讨论制定了各类投资组合针对股票、债券、回购等投资品种在交易所及银行间的同日反向交易控制规则，并在投资系统中进行了设置，实现了完全的系统控制。同时加强了对各类投资组合间的同日反向交易的监控与隔日反向交易的检查；风险管理部开发了同向交易分析系统，对相关同向交易指标进行持续监控，并定期对组合间的同向交易行为进行了重点分析。

本报告期内，因组合流动性管理或投资策略调整需要，除指数基金以外的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% 的次数为 7 次，未出现异常交易。

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

上半年，美国经济在就业、消费等方面持续呈现较强韧性，一季度 GDP 年化环比增速终值从 1.3% 大幅上修至 2%，二季度 GDP 增速更是达到 2.4%，均远超市场预期。整体通胀持续降温，6 月 CPI 同比上涨 3%，环比上涨 0.2%，同比涨幅降至 2021 年 3 月以来的最低水平。但核心 CPI 粘性较强，同比涨幅回落至 4.8%。美国劳动力市场表现持续强劲，失业率维持较低区间。美联储上半年仍持续加息三次，在 6 月 FOMC 决议中，暂停加息，维持联邦基准利率目标区间在 5%-5.25%。在美国宏观经济具备韧性的背景下，叠加生成式 AI 技术浪潮推动，美股科技公司的整体净利润同比增速显著回升，相关科技公司的盈利预期持续改善，纳指 100 指数大幅上行。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.2673 元，本报告期份额净值增长率为 43.55%，同期业绩比较基准增长率为 43.96%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，在高利率的背景下，美国经济继续放缓但维持韧性，衰退迹象将更为明显，但得益于居民部门仍相对健康的资产负债表，经济陷入深度衰退的概率不高，通胀整体将继续放缓，但中枢仍会维持相对高位，美联储货币政策短期预计仍将偏鹰派，不排除年内继续加息的可能。我们认为，下阶段业绩将逐步成为影响美股科技股的主要因素。随着全球 AIGC 商业化浪潮的演进，全

球科技巨头有望持续受益于云计算基础设施、大模型产品、芯片等方面需求的爆发式增长。以高科技和高成长为代表的纳斯达克 100 指数成份股中长期看仍将是现代科技创新进步的主要驱动力之一。

作为基金管理人，我们继续坚持积极将基金回报与指数相拟合的原则，降低跟踪偏离和跟踪误差，勤勉尽责，为投资者获得长期稳定的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，负责在证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时，评估重大事件对投资品种价值的影响程度、评估对基金估值的影响程度、确定采用的估值方法、确定该证券的公允价值；同时将采用的估值方法以及采用该方法对相关证券的估值与基金的托管银行进行沟通。估值委员会成员由首席投资官、公司分管运营、专户的领导、指数与量化投资部负责人、固定收益部负责人、投资研究部负责人、基金运营部负责人、产品部负责人、风险管理部负责人、全球投资部负责人等人员组成，具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期不进行收益分配。

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

本基金报告期内不存在基金持有人数低于 200 人或基金资产净值低于 5000 万元的情形。

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

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

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

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：华安纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)

报告截止日：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 |
|---------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | - | - |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 321,770,826.28 | 1,070,848,040.67 |
| 结算备付金 | | 73,359,624.84 | 15,060,737.12 |
| 存出保证金 | | 31,246,671.46 | 11,015,072.07 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 4,986,173,263.48 | 2,667,536,064.68 |
| 其中：股票投资 | | 4,986,173,263.48 | 2,667,536,064.68 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - | - |
| 应收清算款 | | - | - |
| 应收股利 | | 603,847.82 | 226,863.99 |
| 应收申购款 | | - | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.5 | - | - |
| 资产总计 | | 5,413,154,233.88 | 3,764,686,778.53 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
| 负债： | | - | - |
| 短期借款 | | - | - |

| | | | |
|-----------------|---------|-------------------------|-------------------------|
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付清算款 | | 1,778,535.03 | 724,661,909.30 |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 2,486,886.81 | 495,373.00 |
| 应付托管费 | | 828,962.26 | 165,124.33 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | 1,866,910.95 | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.6 | 95,211.43 | 104,000.00 |
| 负债合计 | | 7,056,506.48 | 725,426,406.63 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.7 | 4,265,720,640.00 | 3,442,720,640.00 |
| 其他综合收益 | | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.8 | 1,140,377,087.40 | -403,460,268.10 |
| 净资产合计 | | 5,406,097,727.40 | 3,039,260,371.90 |
| 负债和净资产总计 | | 5,413,154,233.88 | 3,764,686,778.53 |

注：报告截至日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.2673 元，基金份额总额 4,265,720,640.00 份。

6.2 利润表

会计主体：华安纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)

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 |
|------------------|----------|---------------------------------------|
| 一、营业总收入 | | 1,641,211,560.14 |
| 1.利息收入 | | 1,570,405.48 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.9 | 1,570,405.48 |
| 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) | | 247,296,319.26 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.10 | 147,188,339.46 |

| | | |
|----------------------------|-----------------|-------------------------|
| 基金投资收益 | | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.11 | - |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.12 | - |
| 贵金属投资收益 | | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.13 | 84,184,025.02 |
| 股利收益 | 6.4.7.14 | 15,923,954.78 |
| 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 | 1,385,195,080.96 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | 10,585,719.02 |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.16 | -3,435,964.58 |
| 减：二、营业总支出 | | 17,997,534.47 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2 | 13,185,508.60 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2 | 4,395,169.48 |
| 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 | | 303,341.22 |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.17 | 113,515.17 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 1,623,214,025.67 |
| 减：所得税费用 | | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 1,623,214,025.67 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - |
| 六、综合收益总额 | | 1,623,214,025.67 |

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华安纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)

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 | 其他综合 | 未分配利润 | 净资产合计 |

| | | 收益 (若有) | | |
|---|-------------------|---------|------------------|-------------------|
| 一、上期期末净资产 (基金净值) | 3,442,720,640.00 | - | -403,460,268.10 | 3,039,260,371.90 |
| 二、本期期初净资产 (基金净值) | 3,442,720,640.00 | - | -403,460,268.10 | 3,039,260,371.90 |
| 三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列) | 823,000,000.00 | - | 1,543,837,355.50 | 2,366,837,355.50 |
| (一)、综合收益总额 | - | - | 1,623,214,025.67 | 1,623,214,025.67 |
| (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) | 823,000,000.00 | - | -79,376,670.17 | 743,623,329.83 |
| 其中：1.基金申购款 | 2,364,000,000.00 | - | -52,670,370.42 | 2,311,329,629.58 |
| 2.基金赎回款 | -1,541,000,000.00 | - | -26,706,299.75 | -1,567,706,299.75 |
| (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) | 4,265,720,640.00 | - | 1,140,377,087.40 | 5,406,097,727.40 |

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：朱学华，主管会计工作负责人：朱学华，会计机构负责人：陈松一

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华安纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2022]628 号《关于准予华安纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)注册的批复》核准，由华安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《华安纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式基金，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 269,701,000.00 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2022)第 0476

号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华安纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金合同》于 2022 年 7 月 21 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 269,720,640.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 19,640.00 份基金份额。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司,境外托管人为道富银行。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2022]713 号文审核同意,本基金 269,720,640.00 份基金份额于 2022 年 8 月 3 日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金合同》的有关规定,本基金的标的指数为纳斯达克 100 指数,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括标的指数成份股(含存托凭证)及其备选成份股(含存托凭证)、其他股票(包括创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证)、股指期货、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。基金在境外可投资于已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金(包括开放式基金和交易型开放式指数基金(ETF));已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证;政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等固定收益投资工具;银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具;与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品;远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品;以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会相关规定。本基金将根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。本基金投资标的指数成份股、备选成份股的资产不低于基金资产净值的 90%,且不低于非现金基金资产的 80%。本基金的业绩比较基准为:纳斯达克 100 指数收益率(经汇率调整)。

本基金的基金管理人华安基金管理有限公司以本基金为目标 ETF,将华安纳斯达克 100 指数证券投资基金转型为华安纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(QDII)(以下简称“纳斯达克 100ETF 联接基金”)。纳斯达克 100ETF 联接基金为交易型开放式基金,投资目标与本基金类

似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

本财务报表由本基金的基金管理人华安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》、《华安纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金(QDII) 基金合同》和在财务报表附注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 年上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 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 所采用的会计政策上年度会计报表相一致的说明

本基金报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无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 | 321,770,826.28 |
| 等于：本金 | 321,563,343.02 |
| 加：应计利息 | 207,483.26 |
| 定期存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 其他存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 合计 | 321,770,826.28 |

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 | | 3,645,006,425.11 | - | 4,986,173,263.48 | 1,341,166,838.37 |
| 债券 | 交易所市场 | - | - | - | - |
| | 银行间市场 | - | - | - | - |
| | 合计 | - | - | - | - |
| 资产支持证券 | | - | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - | - |
| 合计 | | 3,645,006,425.11 | - | 4,986,173,263.48 | 1,341,166,838.37 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | | | |
|--------|------------------------|------|----|----|
| | 合同/名义 金额 | 公允价值 | | 备注 |
| | | 资产 | 负债 | |
| 利率衍生工具 | - | - | - | - |
| 货币衍生工具 | - | - | - | - |
| 权益衍生工具 | 389,142,821.27 | - | - | - |
| 其他衍生工具 | - | - | - | - |
| 合计 | 389,142,821.27 | - | - | - |

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

| 代码 | 名称 | 持仓量(买/卖) | 合约市值 | 公允价值变动 |
|------------|-------------------------------|----------|--------------------|--------------|
| NQ2309 | NASDAQ 100 E-MINI SEP23 | 180.00 | 398,959,540.5 6 | 9,816,719.29 |
| 合计 | - | - | - | 9,816,719.29 |
| 减：可抵销期货暂收款 | - | - | - | 9,816,719.29 |
| 净额 | - | - | - | - |

注：1、买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

2、衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末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

本基金本报告期末无其他资产。

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 | - |
| 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 | - |
| 预提审计费 | 35,704.06 |
| 预提信息披露费 | 59,507.37 |

| | |
|----|-----------|
| 合计 | 95,211.43 |
|----|-----------|

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 | 3,442,720,640.00 | 3,442,720,640.00 |
| 本期申购 | 2,364,000,000.00 | 2,364,000,000.00 |
| 本期赎回 (以“-”号填列) | -1,541,000,000.00 | -1,541,000,000.00 |
| 本期末 | 4,265,720,640.00 | 4,265,720,640.00 |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 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 | 45,417,964.96 | -448,878,233.06 | -403,460,268.10 |
| 本期利润 | 238,018,944.71 | 1,385,195,080.96 | 1,623,214,025.67 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 13,151,848.82 | -92,528,518.99 | -79,376,670.17 |
| 其中：基金申购款 | 59,978,982.67 | -112,649,353.09 | -52,670,370.42 |
| 基金赎回款 | -46,827,133.85 | 20,120,834.10 | -26,706,299.75 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 296,588,758.49 | 843,788,328.91 | 1,140,377,087.40 |

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 | 203.36 |
| 其他 | - |
| 合计 | 1,570,405.48 |

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----|
|----|----|

| | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|------------------|---------------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | 147,188,339.46 |
| 股票投资收益——赎回差价收入 | - |
| 股票投资收益——申购差价收入 | - |
| 股票投资收益——证券出借差价收入 | - |
| 合计 | 147,188,339.46 |

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 1,239,936,698.49 |
| 减：卖出股票成本总额 | 1,092,446,095.03 |
| 减：交易费用 | 302,264.00 |
| 买卖股票差价收入 | 147,188,339.46 |

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|-------------|---------------------------------------|
| 赎回基金份额对价总额 | 1,567,706,299.75 |
| 减：现金支付赎回款总额 | 1,567,706,299.75 |
| 减：赎回股票成本总额 | - |
| 减：交易费用 | - |
| 赎回差价收入 | - |

6.4.7.11 债券投资收益

无。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 |
|----|----------------------------|
|----|----------------------------|

| | |
|--------|---------------|
| 期货投资收益 | 84,184,025.02 |
| 合计 | 84,184,025.02 |

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 | 15,923,954.78 |
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | 15,923,954.78 |

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 | 1,374,311,719.95 |
| ——股票投资 | 1,374,311,719.95 |
| ——债券投资 | - |
| ——资产支持证券投资 | - |
| ——基金投资 | - |
| ——其他 | - |
| 2.衍生工具 | 10,883,361.01 |
| ——权证投资 | - |
| ——期货投资 | 10,883,361.01 |
| 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 | 1,385,195,080.96 |

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 | - |
| 替代损益收入 | -3,435,964.58 |
| 合计 | -3,435,964.58 |

注：替代损益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。

6.4.7.17 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 | 35,704.06 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 银行汇划费 | 18,303.74 |
| 合计 | 113,515.17 |

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

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

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

无。

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 |
|--|-----------------|
| 华安基金管理有限公司 (“华安基金公司”) | 基金管理人 |
| 中国建设银行股份有限公司 (“建设银行”) | 基金托管人 |
| 道富银行 (State Street Bank and Trust Company) | 基金境外托管人 |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 基金管理人的股东、基金销售机构 |
| 华安纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (QDII) | 本基金的联接基金 |

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

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

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 |
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 13,185,508.60 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 97,396.84 |

注：支付基金管理人华安基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.60% 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 0.60% / 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 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 4,395,169.48 |

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

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 | |
|--|------------------------|------------------------------|--------------------------|--------------------------|
| | 持有的 基金份额 | 持有的基金 份额占基金 总份额的比 例 | 持有的 基金份额 | 持有的基金份 额占基金总份 额的比例 |
| 国泰君安证券股份 有限公司 | 10,368,000.00 | 0.24% | 4,002,000.00 | 0.12% |
| 中国建设银行股份 有限公司—华 安纳斯达克 100 交易型开放式指 数证券投资基金 联接基金 (QDII) | 2,667,987,812.00 | 62.54% | 2,602,963,012.00 | 75.61% |

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | |
|--------|---------------------------------------|--------------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国建设银行 | 126,611,154.01 | 328,738.55 |
| 道富银行 | 195,159,672.27 | 1,241,463.57 |
| 合计 | 321,770,826.28 | 1,570,202.12 |

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，按适用利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

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

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为股票型指数基金,因此本基金的预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金为主要投资于境外证券交易市场的证券投资基金,需要承担汇率风险、境外证券交易市场投资所面临的特别投资风险。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。本基金完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整,但因特殊情况(如流动性不足、成份股长期停牌、法律法规限制等)导致无法获得足够数量的股票时,本基金可以选择其他证券或证券组合对标的指数中的股票加以替换,从而能够紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人建立了董事会、监事会、管理层、合规与风险管理委员会、督察长、合规监察稽核部、风险管理部与部门风险合规员各负其责的多层次的风险管理体系,形成高效运转、有效制衡的监督约束机制,保证风险管理的贯彻执行。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制

委员会，负责制订公司的风险管理政策，颁布统一的风险定义和风险评估标准；在管理层层面设立合规与风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由合规监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成风险管理各项工作。

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。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，通过特定的风险量化指标、模型，形成常规的量化报告，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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人中国建设银行以及境外次托管行道富银行，因而与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，违约风险发生的可能性很小；在场外交易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 2023 年 06 月 30 日，本基金无债券投资。

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(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》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。

本基金投资于一家公司发行的证券市值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家发行的证券不得超过该证券的 10%。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上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市,其余亦可在银行间同业市场交易,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%。

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。

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未来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、结算备付金和存出保证金等。

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 | 321,770,826.28 | - | - | - | 321,770,826.28 |
| 结算备付金 | 707.52 | - | - | 73,358,917.32 | 73,359,624.84 |
| 存出保证金 | - | - | - | 31,246,671.46 | 31,246,671.46 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 4,986,173,263.48 | 4,986,173,263.48 |
| 应收股利 | - | - | - | 603,847.82 | 603,847.82 |
| 资产总计 | 321,771,533.80 | - | - | 5,091,382,700.08 | 5,413,154,233.88 |
| 负债 | | | | | |
| 短期借款 | - | - | - | - | - |
| 交易性金融负债 | - | - | - | - | - |
| 衍生金融负债 | - | - | - | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | - | - | - | - | - |
| 应付清算款 | - | - | - | 1,778,535.03 | 1,778,535.03 |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 2,486,886.81 | 2,486,886.81 |
| 应付托管费 | - | - | - | 828,962.26 | 828,962.26 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - |
| 应交税费 | - | - | - | 1,866,910.95 | 1,866,910.95 |
| 应付利润 | - | - | - | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | 95,211.43 | 95,211.43 |
| 负债总计 | - | - | - | 7,056,506.48 | 7,056,506.48 |
| 利率敏感度缺口 | 321,771,533.80 | - | - | 5,084,326,193.60 | 5,406,097,727.40 |

| 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 | 1,070,848,040.67 | - | - | - | 1,070,848,040.67 |
| 结算备付金 | 15,060,737.12 | - | - | - | 15,060,737.12 |
| 存出保证金 | 11,015,072.07 | - | - | - | 11,015,072.07 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 2,667,536,064.68 | 2,667,536,064.68 |
| 应收清算款 | - | - | - | - | - |
| 应收股利 | - | - | - | 226,863.99 | 226,863.99 |
| 资产总计 | 1,096,923,849.86 | - | - | 2,667,762,928.67 | 3,764,686,778.53 |
| 负债 | | | | | |
| 短期借款 | - | - | - | - | - |
| 交易性金融负债 | - | - | - | - | - |
| 衍生金融负债 | - | - | - | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | - | - | - | - | - |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 724,661,909.30 | 724,661,909.30 |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 495,373.00 | 495,373.00 |
| 应付托管费 | - | - | - | 165,124.33 | 165,124.33 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - |
| 应交税费 | - | - | - | - | - |
| 应付利润 | - | - | - | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | 104,000.00 | 104,000.00 |
| 负债总计 | - | - | - | 725,426,406.63 | 725,426,406.63 |
| 利率敏感度缺口 | 1,096,923,849.86 | - | - | 1,942,336,522.04 | 3,039,260,371.90 |

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2023 年 06 月 30 日, 本基金未持有交易性债券投资(2022 年 12 月 31 日: 同), 因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(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。本基金持有不以记账本位币计价的资产, 因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位: 人民币元

| 项目 | 本期末 2023年6月30日 | | |
|---------------------|-------------------------|---------------|-------------------------|
| | 美元 折合人民币 | 其他币种 折合人民币 | 合计 |
| 以外币计价的资产 | | | |
| 银行存款 | 195,163,852.18 | - | 195,163,852.18 |
| 备付金 | 73,358,917.32 | - | 73,358,917.32 |
| 存出保证金 | 31,246,671.46 | - | 31,246,671.46 |
| 交易性金融资产 | 4,986,173,263.48 | - | 4,986,173,263.48 |
| 应收股利 | 603,847.82 | - | 603,847.82 |
| 资产合计 | 5,286,546,552.26 | - | 5,286,546,552.26 |
| 以外币计价的负债 | | | |
| 应付证券清算款 | - | - | - |
| 负债合计 | - | - | - |
| 资产负债表外汇风险敞口净 | 5,286,546,552.26 | - | 5,286,546,552.26 |

| 额 | | | |
|----------------------|-------------------------|---------------|-------------------------|
| 项目 | 上年度末 2022年12月31日 | | |
| | 美元 折合人民币 | 其他币种 折合人民币 | 合计 |
| 以外币计价的资产 | | | |
| 银行存款 | 649,401,230.58 | - | 649,401,230.58 |
| 结算备付金 | 15,060,701.09 | - | 15,060,701.09 |
| 存出保证金 | 11,015,072.07 | - | 11,015,072.07 |
| 交易性金融资产 | 2,667,536,064.68 | - | 2,667,536,064.68 |
| 应收股利 | 226,863.99 | - | 226,863.99 |
| 资产合计 | 3,343,239,932.41 | - | 3,343,239,932.41 |
| 以外币计价的负债 | | | |
| 应付证券清算款 | 620,184,345.79 | - | 620,184,345.79 |
| 负债合计 | 620,184,345.79 | - | 620,184,345.79 |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | 2,723,055,586.62 | - | 2,723,055,586.62 |

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

| 假设 | 除外汇以外的其他市场变量保持不变 | | |
|----|------------------|-----------------------------------|---------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的 影响金额 (单位: 人民币元) | |
| | | 本期末 2023年6月30日 | 上年度末 2022年12月31日 |
| | 所有外币相对人民币升值 5% | 264,330,000.00 | 136,150,000.00 |

| | | | |
|--|----------------|-----------------|-----------------|
| | 所有外币相对人民币贬值 5% | -264,330,000.00 | -136,150,000.00 |
|--|----------------|-----------------|-----------------|

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，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。

本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。根据标的指数，结合研究报告，基金经理以完全复制标的指数成分股权重方法构建组合。基金经理将跟踪标的指数变动，结合成份股基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果，对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。为有效控制指数的跟踪误差，本基金在注重风险管理的前提下，将适度运用股指期货。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 | 4,986,173,263.48 | 92.23 | 2,667,536,064.68 | 87.77 |
| 交易性金融资产—基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产—债券投资 | - | - | - | - |
| 衍生金融资产—权证投资 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 4,986,173,263.48 | 92.23 | 2,667,536,064.68 | 87.77 |

| | | | | |
|--|--|--|----|--|
| | | | 68 | |
|--|--|--|----|--|

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 基金的市场价格风险决定于业绩比较基准的变动 | | |
|----|-----------------------|-------------------------------|--------------------------|
| | 除上述基准以外的其他市场变量保持不变 | | |
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位: 人民币元) | |
| | | 本期末 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% | 262,320,000.00 | - |
| | 业绩比较基准下降 5% | -262,320,000.00 | - |

注: 于 2022 年 12 月 31 日, 本基金成立尚未满 6 个月, 无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金净资产的影响。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次, 由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定: 第一层次: 相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价; 第二层次: 除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值; 第三层次: 相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位: 人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | 上期末 2022 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|-------------------------|
| 第一层次 | 4,986,173,263.48 | 2,667,536,064.68 |
| 第二层次 | - | - |
| 第三层次 | - | - |
| 合计 | 4,986,173,263.48 | 2,667,536,064.68 |

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。对于公开市场交易的股票、债券等投资, 若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况, 本基金不会于停牌

日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

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 | 4,986,173,263.48 | 92.11 |
| | 其中：普通股 | 4,931,884,954.40 | 91.11 |
| | 存托凭证 | 54,288,309.08 | 1.00 |
| | 优先股 | - | - |
| | 房地产信托凭证 | - | - |
| 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 | 395,130,451.12 | 7.30 |

| | | | |
|---|--------|------------------|--------|
| 8 | 其他各项资产 | 31,850,519.28 | 0.59 |
| 9 | 合计 | 5,413,154,233.88 | 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 | 4,986,173,263.48 | 92.23 |
| 合计 | 4,986,173,263.48 | 92.23 |

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 | 2,560,983,344.01 | 47.37 |
| 通信服务 | 822,491,637.27 | 15.21 |
| 非日常生活消费品 | 757,926,283.28 | 14.02 |
| 医疗保健 | 282,765,052.60 | 5.23 |
| 日常消费品 | 264,510,346.28 | 4.89 |
| 工业 | 205,252,548.19 | 3.80 |
| 公用事业 | 49,080,934.62 | 0.91 |
| 金融 | 24,683,155.26 | 0.46 |
| 能源 | 18,479,961.97 | 0.34 |
| 房地产 | - | - |
| 原材料 | - | - |
| 合计 | 4,986,173,263.48 | 92.23 |

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

无。

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 | 微软公司 | MSFT US | 美国 | 美国 | 261,800 | 644,204,435.40 | 11.92 |

| | | | | | | | | |
|----|--|-----------------------|----------|----|----|---------|----------------|-------|
| | CORP | | | | | | | |
| 2 | APPLE INC | 苹果公司 | AAPL US | 美国 | 美国 | 447,215 | 626,811,367.93 | 11.59 |
| 3 | NVIDIA CORP | 英伟达 | NVDA US | 美国 | 美国 | 113,322 | 346,386,588.36 | 6.41 |
| 4 | AMAZO N.COM INC | 亚马逊公 司 | AMZN US | 美国 | 美国 | 362,740 | 341,684,861.17 | 6.32 |
| 5 | TESLA INC | 特斯拉公 司 | TSLA US | 美国 | 美国 | 112,102 | 212,040,671.35 | 3.92 |
| 6 | META PLATFO RMS INC-CLA SS A | Meta 平台 股份有限 公司 | META US | 美国 | 美国 | 101,457 | 210,387,331.14 | 3.89 |
| 7 | ALPHAB ET INC-CLA | Alphabet 公司 | GOOGL US | 美国 | 美国 | 214,036 | 185,125,785.06 | 3.42 |
| 8 | ALPHAB ET INC-CL C | Alphabet 公司 | GOOG US | 美国 | 美国 | 207,718 | 181,567,347.79 | 3.36 |
| 9 | BROADC OM INC | 博通股份 有限公司 | AVGO US | 美国 | 美国 | 19,109 | 119,772,836.64 | 2.22 |
| 10 | PEPSICO INC | 百事可乐 | PEP US | 美国 | 美国 | 63,191 | 84,572,475.86 | 1.56 |
| 11 | COSTCO WHOLE SALE CORP | 开市客 | COST US | 美国 | 美国 | 20,412 | 79,407,297.28 | 1.47 |
| 12 | ADOBE INC | 奥多比 | ADBE US | 美国 | 美国 | 21,113 | 74,599,490.65 | 1.38 |
| 13 | CISCO SYSTEM S INC | 思科系统 股份有限 公司 | CSCO US | 美国 | 美国 | 186,942 | 69,890,676.76 | 1.29 |
| 14 | NETFLIX INC | 奈飞公司 | NFLX US | 美国 | 美国 | 20,412 | 64,969,204.61 | 1.20 |
| 15 | ADVANC ED MICRO DEVICES | AMD 公司 | AMD US | 美国 | 美国 | 73,856 | 60,790,199.89 | 1.12 |
| 16 | COMCAS T CORP-CL ASS A | 康卡斯特 公司 | CMCSA US | 美国 | 美国 | 190,750 | 57,269,252.09 | 1.06 |

| | | | | | | | | |
|----|------------------------------|--------------------|---------|----|----|---------|---------------|------|
| 17 | T-MOBILE US INC | T-Mobile US 股份有限公司 | TMUS US | 美国 | 美国 | 55,120 | 55,321,938.73 | 1.02 |
| 18 | TEXAS INSTRUMENTS INC | 德州仪器 | TXN US | 美国 | 美国 | 41,631 | 54,153,126.71 | 1.00 |
| 19 | INTEL CORP | 英特尔 | INTC US | 美国 | 美国 | 191,327 | 46,230,486.89 | 0.86 |
| 20 | HONEYWELL INTERNATIONAL INC | 霍尼韦尔 | HON US | 美国 | 美国 | 30,557 | 45,815,744.90 | 0.85 |
| 21 | QUALCOMM INC | 高通公司 | QCOM US | 美国 | 美国 | 51,095 | 43,949,835.96 | 0.81 |
| 22 | INTUIT INC | Intuit 股份有限公司 | INTU US | 美国 | 美国 | 12,889 | 42,672,763.31 | 0.79 |
| 23 | APPLIED MATERIALS INC | 应用材料 | AMAT US | 美国 | 美国 | 38,577 | 40,290,479.70 | 0.75 |
| 24 | INTUITIVE SURGICAL INC | 直觉外科手术公司 | ISRG US | 美国 | 美国 | 16,061 | 39,683,359.03 | 0.73 |
| 25 | AMGEN INC | 安进公司 | AMGN US | 美国 | 美国 | 24,560 | 39,400,923.17 | 0.73 |
| 26 | STARBUCKS CORP | 星巴克公司 | SBUX US | 美国 | 美国 | 52,625 | 37,668,330.24 | 0.70 |
| 27 | MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A | 亿滋国际 | MDLZ US | 美国 | 美国 | 62,515 | 32,948,521.50 | 0.61 |
| 28 | BOOKING HOLDINGS INC | Booking 控股股份有限公司 | BKNG US | 美国 | 美国 | 1,673 | 32,643,650.47 | 0.60 |
| 29 | ANALOG DEVICES INC | 亚德诺半导体 | ADI US | 美国 | 美国 | 23,038 | 32,429,627.26 | 0.60 |
| 30 | GILEAD SCIENCES INC | 吉利德科学 | GILD US | 美国 | 美国 | 57,271 | 31,893,784.98 | 0.59 |

| | | | | | | | | |
|----|----------------------------|---------------------------|---------|----|----|--------|---------------|------|
| 31 | AUTOMATIC DATA PROCESSING | ADP 公司 | ADP US | 美国 | 美国 | 18,965 | 30,119,427.51 | 0.56 |
| 32 | VERTEX PHARMACEUTICALS INC | 福泰制药 | VRTX US | 美国 | 美国 | 11,771 | 29,931,666.97 | 0.55 |
| 33 | LAM RESEARCH CORP | 泛林集团 | LRCX US | 美国 | 美国 | 6,166 | 28,642,166.24 | 0.53 |
| 34 | PALO ALTO NETWORKS INC | Palo Alto Networks 股份有限公司 | PANW US | 美国 | 美国 | 14,083 | 26,000,938.14 | 0.48 |
| 35 | REGENERON PHARMACEUTICALS | 再生元制药有限公司 | REGN US | 美国 | 美国 | 4,919 | 25,539,577.53 | 0.47 |
| 36 | PAYPAL HOLDINGS INC | Paypal 控股股份有限公司 | PYPL US | 美国 | 美国 | 51,191 | 24,683,155.26 | 0.46 |
| 37 | CSX CORP | CSX 公司 | CSX US | 美国 | 美国 | 93,293 | 22,987,374.68 | 0.43 |
| 38 | MICRON TECHNOLOGY INC | 美光科技股份有限公司 | MU US | 美国 | 美国 | 50,217 | 22,899,968.29 | 0.42 |
| 39 | KLA CORP | KLA 公司 | KLAC US | 美国 | 美国 | 6,292 | 22,051,305.09 | 0.41 |
| 40 | ACTIVISION BLIZZARD INC | 动视暴雪股份有限公司 | ATVI US | 美国 | 美国 | 36,106 | 21,993,426.14 | 0.41 |
| 41 | SYNOPSYS INC | 新思科技公司 | SNPS US | 美国 | 美国 | 6,943 | 21,843,966.47 | 0.40 |
| 42 | CADENCE DESIGN SYSTEMS INC | Cadence 设计系统股份有限公司 | CDNS US | 美国 | 美国 | 12,464 | 21,121,427.29 | 0.39 |
| 43 | ASML HOLDING | 阿斯麦控股公司 | ASML US | 美国 | 美国 | 4,022 | 21,062,805.97 | 0.39 |

| | | | | | | | | |
|----|------------------------------------|-----------------------------|---------|----|----|--------|---------------|------|
| | G NV-NY REG SHS | | | | | | | |
| 44 | MONSTER BEVERAGE CORP | 怪兽饮料 公司 | MNST US | 美国 | 美国 | 48,078 | 19,954,771.59 | 0.37 |
| 45 | FORTINET INC | Fortinet 股 份有限公 司 | FTNT US | 美国 | 美国 | 36,006 | 19,666,413.18 | 0.36 |
| 46 | O'REILLY AUTOMOTIVE INC | O'Reilly 汽 车股份有 限公司 | ORLY US | 美国 | 美国 | 2,795 | 19,293,344.84 | 0.36 |
| 47 | MERCADOLIBRE INC | MercadoLibre 股 份有限公 司 | MELI US | 美国 | 美国 | 2,249 | 19,250,726.35 | 0.36 |
| 48 | MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A | 万豪国际 | MAR US | 美国 | 美国 | 13,962 | 18,531,863.15 | 0.34 |
| 49 | CHARTER COMMUNICATIONS INC-A | Charter 通 信公司 | CHTR US | 美国 | 美国 | 6,873 | 18,244,668.17 | 0.34 |
| 50 | NXP SEMICONDUCTORS NV | 恩智浦半 导体公司 | NXPI US | 美国 | 美国 | 11,897 | 17,595,386.32 | 0.33 |
| 51 | AIRBNB INC-CLASS A | 爱彼迎股 份有限公 司 | ABNB US | 美国 | 美国 | 18,893 | 17,496,023.77 | 0.32 |
| 52 | MARVEL TECHNOLOGY INC | 美满电子 科技公司 | MRVL US | 美国 | 美国 | 39,456 | 17,043,347.63 | 0.32 |
| 53 | DEXCOM INC | Dexcom 股 份有限公 司 | DXCM US | 美国 | 美国 | 17,817 | 16,544,644.52 | 0.31 |
| 54 | CINTAS CORP | CINTAS 公司 | CTAS US | 美国 | 美国 | 4,594 | 16,500,732.25 | 0.31 |

| | | | | | | | | |
|----|---------------------------|----------------------------|---------|----|----|--------|---------------|------|
| 55 | MICROCHIP TECHNOLOGY INC | 微芯科技股份有限公司 | MCHP US | 美国 | 美国 | 25,036 | 16,207,290.49 | 0.30 |
| 56 | MODERNA INC | 莫德纳公司 | MRNA US | 美国 | 美国 | 17,513 | 15,375,270.40 | 0.28 |
| 57 | WORKDAY INC-CLASS A | Workday 股份有限公司 | WDAY US | 美国 | 美国 | 9,392 | 15,329,960.16 | 0.28 |
| 58 | LULULEMON ATHLETICA INC | Lululemon Athletica 股份有限公司 | LULU US | 美国 | 美国 | 5,595 | 15,302,130.85 | 0.28 |
| 59 | KEURIG DR PEPPER INC | Keurig Dr Pepper 有限公司 | KDP US | 美国 | 美国 | 64,464 | 14,565,690.18 | 0.27 |
| 60 | PACCAR INC | 帕卡 | PCAR US | 美国 | 美国 | 23,978 | 14,493,218.44 | 0.27 |
| 61 | COPART INC | Copart 股份有限公司 | CPRT US | 美国 | 美国 | 21,955 | 14,469,776.86 | 0.27 |
| 62 | AUTODESK INC | 欧特克 | ADSK US | 美国 | 美国 | 9,772 | 14,447,618.01 | 0.27 |
| 63 | KRAFT HEINZ CO/THE | 卡夫亨氏公司 | KHC US | 美国 | 美国 | 56,322 | 14,447,488.52 | 0.27 |
| 64 | AMERICAN ELECTRIC POWER | 美国电力 | AEP US | 美国 | 美国 | 23,663 | 14,396,861.67 | 0.27 |
| 65 | ASTRAZENECA PLC-SPONS ADR | 阿斯利康公共有限公司 | AZN US | 美国 | 美国 | 27,236 | 14,085,111.18 | 0.26 |
| 66 | PDD HOLDINGS INC | 拼多多 | PDD US | 美国 | 美国 | 28,039 | 14,008,054.82 | 0.26 |
| 67 | IDEXX LABORATORIES INC | 爱德士股份有限公司 | IDXX US | 美国 | 美国 | 3,796 | 13,775,735.38 | 0.25 |

| | | | | | | | | |
|----|--|--|---------|----|----|--------|---------------|------|
| 68 | BIOGEN INC | 渤健公司 | BIIB US | 美国 | 美国 | 6,592 | 13,568,110.10 | 0.25 |
| 69 | ON SEMICO DUCTO R | 安森美半 导体公司 | ON US | 美国 | 美国 | 19,800 | 13,531,640.05 | 0.25 |
| 70 | OLD DOMINI ON FREIGHT LINE | Old Dominion Freight Line 股份 | ODFL US | 美国 | 美国 | 5,045 | 13,478,926.03 | 0.25 |
| 71 | EXELON CORP | Exelon 公 司 | EXC US | 美国 | 美国 | 45,648 | 13,437,816.79 | 0.25 |
| 72 | PAYCHE X INC | Paychex 公司 | PAYX US | 美国 | 美国 | 16,586 | 13,407,297.18 | 0.25 |
| 73 | ROSS STORES INC | 罗斯百货 股份有限 公司 | ROST US | 美国 | 美国 | 15,719 | 12,735,988.93 | 0.24 |
| 74 | GE HEALTH CARE TECHNO LOGY | GE HealthCare Technologi es I | GEHC US | 美国 | 美国 | 20,900 | 12,268,801.43 | 0.23 |
| 75 | COSTAR GROUP INC | CoStar 集 团股份有 限公司 | CSGP US | 美国 | 美国 | 18,753 | 12,059,983.04 | 0.22 |
| 76 | SEAGEN INC | Seagen 股 份有限公 司 | SGEN US | 美国 | 美国 | 8,616 | 11,982,077.06 | 0.22 |
| 77 | GLOBAL FOUNDRI ES INC | 格罗方德 半导体股 份有限公 司 | GFS US | 美国 | 美国 | 25,163 | 11,742,116.77 | 0.22 |
| 78 | ELECTR ONIC ARTS INC | 电子艺界 | EA US | 美国 | 美国 | 12,464 | 11,681,089.54 | 0.22 |
| 79 | XCEL ENERGY INC | Xcel 能源 | XEL US | 美国 | 美国 | 25,336 | 11,381,640.25 | 0.21 |
| 80 | FASTEN AL CO | 法思诺公 司 | FAST US | 美国 | 美国 | 26,259 | 11,192,897.23 | 0.21 |
| 81 | COGNIZ ANT TECH | 高知特科 技公司 | CTSH US | 美国 | 美国 | 23,363 | 11,020,332.33 | 0.20 |

| | | | | | | | | |
|----|-------------------------------|----------------------|---------|----|----|---------|---------------|------|
| | SOLUTIONS-A | | | | | | | |
| 82 | CROWD STRIKE HOLDINGS INC - A | CrowdStrike 控股股份有限公司 | CRWD US | 美国 | 美国 | 10,272 | 10,901,193.34 | 0.20 |
| 83 | VERISK ANALYTICS INC | Verisk 分析公司 | VRSK US | 美国 | 美国 | 6,568 | 10,727,170.07 | 0.20 |
| 84 | BAKER HUGHES CO | 贝克休斯公司 | BKR US | 美国 | 美国 | 46,470 | 10,614,098.29 | 0.20 |
| 85 | DOLLAR TREE INC | 美元树公司 | DLTR US | 美国 | 美国 | 10,089 | 10,461,307.30 | 0.19 |
| 86 | WARNER BROS DISCOVERY INC | 华纳兄弟探索股份有限公司 | WBD US | 美国 | 美国 | 111,721 | 10,123,210.97 | 0.19 |
| 87 | CONSTELLATION ENERGY | 美国联合能源公司 | CEG US | 美国 | 美国 | 14,912 | 9,864,615.91 | 0.18 |
| 88 | ILLUMINA A INC | Illumina 公司 | ILMN US | 美国 | 美国 | 7,268 | 9,846,433.78 | 0.18 |
| 89 | DATADOG INC - CLASS A | Datadog 股份有限公司 | DDOG US | 美国 | 美国 | 13,640 | 9,696,324.14 | 0.18 |
| 90 | ANSYS INC | ANSYS 股份有限公司 | ANSS US | 美国 | 美国 | 3,922 | 9,359,715.60 | 0.17 |
| 91 | ALIGN TECHNOLOGY INC | Align 科技股份有限公司 | ALGN US | 美国 | 美国 | 3,471 | 8,869,557.07 | 0.16 |
| 92 | ATLASSIAN CORP-CLASS A | Atlassian Corp | TEAM US | 美国 | 美国 | 6,917 | 8,387,287.88 | 0.16 |
| 93 | WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC | 沃博联股份有限公司 | WBA US | 美国 | 美国 | 39,603 | 8,152,794.05 | 0.15 |
| 94 | EBAY | eBay 公司 | EBAY US | 美国 | 美国 | 24,610 | 7,947,085.86 | 0.15 |

| | | | | | | | | |
|-----|-----------------------------|----------------------|---------|----|----|---------|--------------|------|
| | INC | | | | | | | |
| 95 | DIAMONDBACK ENERGY INC | Diamondback 能源股份有限公司 | FANG US | 美国 | 美国 | 8,287 | 7,865,863.68 | 0.15 |
| 96 | ENPHASE ENERGY INC | Enphase 能源股份有限公司 | ENPH US | 美国 | 美国 | 6,284 | 7,604,752.17 | 0.14 |
| 97 | ZSCALER INC | Zscaler 股份有限公司 | ZS US | 美国 | 美国 | 6,617 | 6,995,059.25 | 0.13 |
| 98 | SIRIUS XM HOLDINGS INC | Sirius XM 控股公司 | SIRI US | 美国 | 美国 | 177,448 | 5,808,383.03 | 0.11 |
| 99 | ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A | Zoom 视频通信股份有限公司 | ZM US | 美国 | 美国 | 11,520 | 5,650,413.74 | 0.10 |
| 100 | JD.COM INC-ADR | 京东集团 | JD US | 美国 | 美国 | 20,811 | 5,132,337.11 | 0.09 |
| 101 | LUCID GROUP INC | Lucid 集团股份有限公司 | LCID US | 美国 | 美国 | 84,185 | 4,191,214.37 | 0.08 |

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

无。

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 | MICROSOFT CORP | MSFT US | 248,716,006.93 | 8.18 |
| 2 | APPLE INC | AAPL US | 238,420,663.30 | 7.84 |
| 3 | AMAZON.COM INC | AMZN US | 128,540,065.41 | 4.23 |
| 4 | NVIDIA CORP | NVDA US | 92,105,324.92 | 3.03 |
| 5 | ALPHABET INC-CL A | GOOGL US | 77,412,690.85 | 2.55 |
| 6 | ALPHABET INC-CL C | GOOG US | 75,184,210.90 | 2.47 |

| | | | | |
|----|-----------------------------|----------|---------------|------|
| 7 | TESLA INC | TSLA US | 64,374,318.37 | 2.12 |
| 8 | META PLATFORMS INC-CLASS A | META US | 63,007,231.79 | 2.07 |
| 9 | BROADCOM INC | AVGO US | 45,767,671.99 | 1.51 |
| 10 | PEPSICO INC | PEP US | 42,059,732.41 | 1.38 |
| 11 | COSTCO WHOLESALE CORP | COST US | 37,384,549.86 | 1.23 |
| 12 | CISCO SYSTEMS INC | CSCO US | 33,814,169.15 | 1.11 |
| 13 | ADOBE INC | ADBE US | 29,332,947.26 | 0.97 |
| 14 | T-MOBILE US INC | TMUS US | 29,248,707.41 | 0.96 |
| 15 | COMCAST CORP-CLASS A | CMCSA US | 27,235,961.91 | 0.90 |
| 16 | TEXAS INSTRUMENTS INC | TXN US | 26,852,439.77 | 0.88 |
| 17 | NETFLIX INC | NFLX US | 25,005,275.20 | 0.82 |
| 18 | AMGEN INC | AMGN US | 23,273,997.20 | 0.77 |
| 19 | HONEYWELL INTERNATIONAL INC | HON US | 23,064,529.32 | 0.76 |
| 20 | QUALCOMM INC | QCOM US | 22,386,211.95 | 0.74 |

注：本项“买入金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名称（英文） | 证券代码 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|----------------------------|----------|----------------|----------------|
| 1 | APPLE INC | AAPL US | 155,338,040.48 | 5.11 |
| 2 | MICROSOFT CORP | MSFT US | 153,789,933.64 | 5.06 |
| 3 | AMAZON.COM INC | AMZN US | 73,402,036.30 | 2.42 |
| 4 | NVIDIA CORP | NVDA US | 61,055,892.51 | 2.01 |
| 5 | ALPHABET INC-CL C | GOOG US | 49,415,679.54 | 1.63 |
| 6 | ALPHABET INC-CL A | GOOGL US | 46,855,611.30 | 1.54 |
| 7 | META PLATFORMS INC-CLASS A | META US | 45,305,565.58 | 1.49 |
| 8 | TESLA INC | TSLA US | 43,309,245.75 | 1.42 |
| 9 | FISERV INC | FISV US | 29,667,160.55 | 0.98 |
| 10 | BROADCOM INC | AVGO US | 24,310,070.81 | 0.80 |
| 11 | PEPSICO INC | PEP US | 24,305,103.07 | 0.80 |
| 12 | COSTCO WHOLESALE CORP | COST US | 21,484,129.63 | 0.71 |
| 13 | CISCO SYSTEMS INC | CSCO US | 19,862,193.57 | 0.65 |
| 14 | T-MOBILE US INC | TMUS US | 18,424,595.98 | 0.61 |
| 15 | ADOBE INC | ADBE US | 17,204,407.78 | 0.57 |
| 16 | COMCAST CORP-CLASS A | CMCSA | 17,013,688.98 | 0.56 |

| | | US | | |
|----|------------------------|---------|---------------|------|
| 17 | TEXAS INSTRUMENTS INC | TXN US | 15,272,107.30 | 0.50 |
| 18 | ADVANCED MICRO DEVICES | AMD US | 14,083,445.58 | 0.46 |
| 19 | NETFLIX INC | NFLX US | 13,532,825.82 | 0.45 |
| 20 | QUALCOMM INC | QCOM US | 13,314,435.53 | 0.44 |

注：本项“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5.3 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 | 2,036,771,573.88 |
| 卖出收入（成交）总额 | 1,239,936,698.49 |

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（成交）总额”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

金额单位：人民币元

| 序号 | 衍生品类别 | 衍生品名称 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-------|-------------------------|------|--------------|
| 1 | 股指期货 | NASDAQ 100 E-MINI SEP23 | - | - |

注：按照期货每日无负债结算的结算规则，根据《基金股指期货投资会计业务核算细则(试行)》及《企业会计准则-金融工具列报》的相关规定，“其他衍生工具-期货投资”与“证券清算款-期货每日无负债结算暂收暂付款”，符合金融资产与金融负债相抵销的条件，故将“其他衍生工具-期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。期货投资的公允价值变动金额为人民币 9,816,719.29 元，已包含在结算备付金中。

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

本基金本报告期末未持有基金。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 本报告期内，本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的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.11.2 本基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

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 | 31,246,671.46 |
| 2 | 应收清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | 603,847.82 |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 31,850,519.28 |

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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

本基金本报告期末前五名积极投资中不存在流通受限情况。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数(户) | 户均持有的 基金份额 | 持有人结构 | | | |
|----------|---------------|------------------|------------|------------------|------------|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份额 比例 | 持有份额 | 占总份额 比例 |
| 11,053 | 385,933.29 | 3,103,347,534.00 | 72.75% | 1,162,373,106.00 | 27.25% |

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 | 郭栋梓 | 160,543,500.00 | 3.76% |
| 2 | BARCLAYS BANK PLC | 135,307,502.00 | 3.17% |
| 3 | 黄泽丰 | 126,888,000.00 | 2.97% |
| 4 | 中信证券—中信银行—中信证券星云 52 号集合资产管理计划 | 44,567,400.00 | 1.04% |
| 5 | 齐伟 | 28,000,000.00 | 0.66% |
| 6 | 魏红 | 27,223,261.00 | 0.64% |
| 7 | 周玲 | 26,000,000.00 | 0.61% |
| 8 | 青岛凡益资产管理有限公司—凡益多策略与时偕行 1 号私募证券投资基金 | 25,000,000.00 | 0.59% |
| 9 | 黄志霖 | 21,642,100.00 | 0.51% |
| 10 | 郑勇 | 21,144,000.00 | 0.50% |
| 11 | 中国建设银行股份有限公司—华安纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (QDII) | 2,667,987,812.00 | 62.54% |

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

本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 0。

本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|--------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2022 年 7 月 21 日）基金份额总额 | 269,720,640.00 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 3,442,720,640.00 |
| 本报告期基金总申购份额 | 2,364,000,000.00 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 1,541,000,000.00 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 4,265,720,640.00 |

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

1、本报告期内本基金管理人重大人事变动如下：

无。

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

无。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金财产、基金托管业务的诉讼。报告期内基金管理人无涉及本基金财产的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

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**

本报告期内无管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无托管人及其高级管理人员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 | |
| Morgan Stanley | - | 1,667,743,832.19 | 50.90% | 141,610.11 | 49.08% | - |
| Instinet | - | 986,132,729.45 | 30.10% | 89,638.93 | 31.07% | - |
| Goldman Sachs | - | 622,478,255.40 | 19.00% | 57,010.00 | 19.76% | - |
| CMB International Global Markets Limited | - | 353,455.57 | 0.01% | 268.18 | 0.09% | - |

注：1、券商专用交易单元选择标准：

选择能够提供高质量的研究服务、交易服务和清算支持，具有良好声誉和财务状况的国内外经纪商。具体标准如下：

(1) 内部管理规范、严谨，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；可靠、诚信，能够公平对待所有客户；

(2) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能够针对本基金业务需要，提供高质量的研究报告和较为全面的服务；

(3) 具备高效、安全的通讯条件；交易差错少，能够有效执行投资指令，取得较高质量的交易成交结果，交易和清算支持多种方案，软件再开发的能力强，系统稳定安全等；

(4) 具有战略规划和定位，能够积极推动多边业务合作，最大限度地调动整体资源，为基金投资赢取机会；

(5) 其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

2、QDII 券商选择程序：

(1) 对候选券商的综合服务进行评估

由相关部门牵头并组织有关人员依据券商选择标准和《券商服务评价办法》，对候选券商研究服务质量和综合实力进行评估。

(2) 填写《新增券商申请审核表》

牵头部门汇总对各候选券商的综合评估结果，择优选出拟新增券商，填写《新增券商申请审核

表》，对拟新增券商的必要性和合规性进行阐述。

(3) 候选券商名单提交分管领导审批

公司分管领导对相关部门提交的《新增券商申请审核表》及其对券商综合评估的结果进行审核，并签署审批意见。

(4) 与相关券商进行开户工作

集中交易部与对应选择券商进行开户工作，完成后，通知信息技术部以及运营部门完成后续相关设置。

3、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

无

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 |
| Morgan Stanley | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Instinet | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Goldman Sachs | - | - | - | - | - | - | - | - |
| CMB International Global Markets Limited | - | - | - | - | - | - | - | - |

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|---|-------------------------|------------|
| 1 | 关于华安纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 因境外主要市场节假日暂停申购、赎回的公告 | 中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介 | 2023-01-11 |
| 2 | 华安纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 2022 年第 4 季度报告 | 中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介 | 2023-01-20 |
| 3 | 关于华安纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 因境外主要市场节假日 | 中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指 | 2023-02-15 |

| | | | |
|----|---|-------------------------|------------|
| | 暂停申购、赎回的公告 | 定媒介 | |
| 4 | 华安纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 基金产品资料概要更新 | 中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介 | 2023-03-03 |
| 5 | 华安纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 更新的招募说明书(2023 年第 1 号) | 中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介 | 2023-03-03 |
| 6 | 华安基金管理有限公司关于华安纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)新增一级交易商的公告 | 中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介 | 2023-03-14 |
| 7 | 华安纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 2022 年年度报告 | 中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介 | 2023-03-30 |
| 8 | 关于华安纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 因境外主要市场节假日暂停申购、赎回的公告 | 中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介 | 2023-04-04 |
| 9 | 华安纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 2023 年第 1 季度报告 | 中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介 | 2023-04-21 |
| 10 | 关于华安纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 因境外主要市场节假日暂停申购、赎回的公告 | 中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介 | 2023-05-23 |
| 11 | 华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华福证券有限责任公司为一级交易商的公告 | 中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介 | 2023-06-01 |
| 12 | 关于华安纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 因境外主要市场节假日暂停申购、赎回的公告 | 中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介 | 2023-06-14 |
| 13 | 关于华安纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 因境外主要市场节假日暂停申购、赎回的公告 | 中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介 | 2023-06-29 |

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在指定媒介上披露。

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|-------|----------------|-------------------------|--------------|----------------|----------------|------------------|---------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份 额 | 申购份 额 | 赎回份 额 | 持有份 额 | 份 额 占 比 |
| 联接基金 | 1 | 20230101-20230630 | 2,602,963.01 | 736,474,800.00 | 671,450,000.00 | 2,667,987,812.00 | 62.54% |

产品特有风险

本基金报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%的情形。如该单一投资者大额赎回将可能导致基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、《华安纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金合同》
- 2、《华安纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）招募说明书》
- 3、《华安纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）托管协议》
- 4、中国证监会批准华安纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）设立的文件；
- 5、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 8、华安基金管理有限公司开放式基金业务规则；

12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网站 <http://www.huaan.com.cn>。

12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

华安基金管理有限公司

二〇二三年八月三十日