

华安纳斯达克 100 指数证券投资基金

2020 年中期报告

2020 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：二〇二〇年八月二十八日

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 2020 年 8 月 25 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 2020 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 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 6 |
| 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 | 9 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 9 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 | 11 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 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 |
| 5 托管人报告 | 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 | 13 |
| 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 | 13 |
| 6 半年度财务会计报告（未经审计） | 13 |
| 6.1 资产负债表 | 13 |
| 6.2 利润表 | 14 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表 | 15 |
| 6.4 报表附注 | 16 |
| 7 投资组合报告 | 35 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 35 |
| 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布 | 36 |
| 7.3 期末按行业分类的权益投资组合 | 36 |
| 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 | 37 |
| 7.5 报告期内股票投资组合的重大变动 | 44 |
| 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合 | 47 |
| 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 | 47 |
| 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 | 47 |
| 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 | 47 |
| 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 | 47 |
| 7.11 投资组合报告附注 | 47 |
| 8 基金份额持有人信息 | 48 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 48 |

| | |
|---|-----------|
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 48 |
| 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 | 49 |
| 9 开放式基金份额变动 | 49 |
| 10 重大事件揭示 | 49 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 49 |
| 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 | 49 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 49 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 49 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 49 |
| 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 | 49 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 49 |
| 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 | 51 |
| 10.8 其他重大事件 | 52 |
| 11 备查文件目录 | 54 |
| 11.1 备查文件目录 | 54 |
| 11.2 存放地点 | 54 |
| 11.3 查阅方式 | 54 |

2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|---------------------|
| 基金名称 | 华安纳斯达克 100 指数证券投资基金 |
| 基金简称 | 华安纳斯达克 100 指数 |
| 基金主代码 | 040046 |
| 交易代码 | 040046 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2013 年 8 月 2 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 | 330,261,501.92 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 本基金为股票指数基金，通过严格的指数化投资策略与风险控制，紧密跟踪标的指数，力争实现跟踪偏离度和跟踪误差最小化。 |
| 投资策略 | 本基金采用完全复制法，跟踪标的指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。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。 本基金的风险控制目标是追求年跟踪误差不超过 4%（以美元计价计算）。 |
| 业绩比较基准 | 纳斯达克 100 价格指数（Nasdaq 100 Price Index）收益率。 |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，属于较高风险、较高预期收益的基金品种，其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。 |

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 | 薛珍 | 李申 |
| | 联系电话 | 021-38969999 | 021-60637102 |
| | 电子邮箱 | service@huaan.com.cn | lishen.zh@ccb.com |
| 客户服务电话 | | 4008850099 | 021-60637111 |
| 传真 | | 021-68863414 | 021-60635778 |
| 注册地址 | | 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 | 北京市西城区闹市口大街1号 院1号楼 |

| | | |
|-------|--------|--------|
| | -32层 | |
| 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 层、32 层 |

2.6 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|------------|-----------------------------|
| 注册登记机构 | 华安基金管理有限公司 | 上海市世纪大道 8 号上海国金中心二期 31、32 层 |

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（2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日） |
|---------------|--------------------------------------|
| 本期已实现收益 | 59,775,301.22 |
| 本期利润 | 201,467,906.21 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.6747 |
| 本期加权平均净值利润率 | 24.25% |
| 本期基金份额净值增长率 | 19.23% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2020 年 6 月 30 日) |
| 期末可供分配利润 | 305,885,492.94 |

| | |
|---------------------|------------------------------|
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.9262 |
| 期末基金资产净值 | 1,066,738,017.80 |
| 期末基金份额净值 | 3.230 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2020 年 6 月 30 日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 223.00% |

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）。

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 | 5.38% | 1.58% | 5.52% | 1.59% | -0.14% | -0.01% |
| 过去三个月 | 29.20% | 1.85% | 29.89% | 1.89% | -0.69% | -0.04% |
| 过去六个月 | 19.23% | 2.68% | 18.03% | 2.93% | 1.20% | -0.25% |
| 过去一年 | 36.98% | 1.96% | 36.35% | 2.14% | 0.63% | -0.18% |
| 过去三年 | 85.74% | 1.48% | 87.97% | 1.59% | -2.23% | -0.11% |
| 自基金合同生效起至今 | 223.00% | 1.17% | 272.30% | 1.27% | -49.30% | -0.10% |

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 指数证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 (2013 年 8 月 2 日至 2020 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。公司在北京、西安、成都、广州等地设有分公司，在香港和上海设有子公司——华安（香港）资产管理有限公司、华安未来资产管理有限公司。截至 2020 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 138 只开放式基金，管理资产规模达到 4,157.70 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 | 2018-09-10 | - | 9 年 | 硕士研究生，9 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、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。 |
|----|----------|------------|---|-----|--|

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 1 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，新型冠状病毒在全球爆发蔓延，包括美国在内欧美等多国疫情严重，疫情扩散导致的经济活动停滞已经对美国经济产生实质性负面影响，包括失业申请人数、失业率等经济指标持续恶化，美联储大幅降低名义利率至零，并且快速重启回购和无限 QE，以解决流动性问题，同时在货币政策之外，美国国会通过规模达 2.4 万亿美元的经济救助方案，以有效应对疫情对经济的负面影响。5 月美国经济逐步从疫情封锁措施中解封复苏，景气指数触底回升，近期的零售和个人支出、就业等数据显示经济整体反弹明显。货币政策方面，美联储继续维持当前 0%-0.25% 的低利率区间，并承诺致力于使用所有工具实现最大就业和价格稳定目标。而总计 2.5 万亿美元的财政刺激法案为受疫情影响的个人和企业提供了重要财务支持。因而，尽管美国疫情仍在持续，得益于整体复苏的经济环境，叠加极度宽松的流动性及强力的财政救助计划。纳指 100 指数在经历大幅下挫后迅速企稳并大幅反弹，不仅收复失地并持续创出历史新高。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2020 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 3.230 元，本报告期份额净值增长率为 19.23%，同期业绩比较基准增长率为 18.03%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

美国当前仍是全球疫情最严重国家之一，多州被迫暂停推进经济重启计划。展望下半年，我们认为，尽管重启的美国经济复苏之路面临较大波折，但整体上美国经济仍将维持底部反弹态势，前期的失业金补贴即将到期，新一轮 1 万亿美元的刺激方案大概率将在三季度推出以进一步推动美国经济复苏，而美联储预计仍将维持当前极度宽松的货币政策，甚至不排除实施收益率曲线控制以引导长端利率下行，中短期内，我们认为美国通胀风险较低，大概率也不会对当前的货币政策构成掣肘。

当前美股估值处于历史较高分位，指数波动可能会有所加大，股指走势很大程度上依赖于美国财政刺激政策是否顺利推出及后续疫情的发展。美国经济在信息技术、半导体、生物医药等领域的领先优势仍然很大，即便疫情反复对上述领域的负面影响仍相对较小，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

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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

本基金本报告期内未实施利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华安纳斯达克 100 指数证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2020 年 6 月 30 日 | 上年度末 2019 年 12 月 31 日 |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | - | - |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 81,726,656.85 | 26,146,134.58 |
| 结算备付金 | | 20,575,801.46 | - |
| 存出保证金 | | 7,289,053.20 | - |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 987,179,638.77 | 264,612,502.72 |
| 其中：股票投资 | | 987,179,638.77 | 264,612,502.72 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - | - |
| 应收证券清算款 | | 283,690.36 | - |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 12,932.81 | 4,961.86 |
| 应收股利 | | 202,075.83 | 86,606.02 |
| 应收申购款 | | 19,792,113.88 | 7,532,485.12 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 1,117,061,963.16 | 298,382,690.30 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2020 年 6 月 30 日 | 上年度末 2019 年 12 月 31 日 |

| | | | |
|-------------------|----------|-------------------------|-----------------------|
| 负债： | | - | - |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | - | 3,257,675.63 |
| 应付赎回款 | | 48,760,543.91 | 6,861,936.43 |
| 应付管理人报酬 | | 649,097.79 | 182,400.09 |
| 应付托管费 | | 202,843.04 | 57,000.02 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | - | - |
| 应交税费 | | 160,966.73 | - |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 550,493.89 | 260,055.60 |
| 负债合计 | | 50,323,945.36 | 10,619,067.77 |
| 所有者权益： | | - | - |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 330,261,501.92 | 106,241,563.26 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 736,476,515.88 | 181,522,059.27 |
| 所有者权益合计 | | 1,066,738,017.80 | 287,763,622.53 |
| 负债和所有者权益总计 | | 1,117,061,963.16 | 298,382,690.30 |

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 3.230 元，基金份额总额 330,261,501.92 份。

6.2 利润表

会计主体：华安纳斯达克 100 指数证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |
|------------------|----------|--|---|
| 一、收入 | | 206,232,295.73 | 38,730,778.82 |
| 1.利息收入 | | 192,174.26 | 55,734.81 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 192,174.26 | 55,734.81 |
| 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） | | 62,060,939.26 | 5,989,944.61 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | 53,820,374.52 | 5,006,343.35 |
| 基金投资收益 | | - | - |

| | | | |
|----------------------------|-----------------|-----------------------|----------------------|
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | - | - |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.15 | 4,790,676.26 | - |
| 股利收益 | 6.4.7.16 | 3,449,888.48 | 983,601.26 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | 141,692,604.99 | 32,390,621.04 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | 532,188.80 | 34,784.73 |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.18 | 1,754,388.42 | 259,693.63 |
| 减：二、费用 | | 4,764,389.52 | 1,249,491.20 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2 | 3,246,449.76 | 827,410.29 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2 | 1,014,515.54 | 258,565.74 |
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.19 | 140,674.39 | 7,100.95 |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6.税金及附加 | | 17,246.44 | - |
| 7. 其他费用 | 6.4.7.20 | 345,503.39 | 156,414.22 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 201,467,906.21 | 37,481,287.62 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 201,467,906.21 | 37,481,287.62 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安纳斯达克 100 指数证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 | | |
|--|---------------------------------------|------------------|-------------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 106,241,563.26 | 181,522,059.27 | 287,763,622.53 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 201,467,906.21 | 201,467,906.21 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | 224,019,938.66 | 353,486,550.40 | 577,506,489.06 |
| 其中：1.基金申购款 | 640,689,200.10 | 1,081,293,997.00 | 1,721,983,197.10 |
| 2.基金赎回款 | -416,669,261.44 | -727,807,446.60 | -1,144,476,708.04 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | - | - | - |
| 五、期末所有者权益（基金 | 330,261,501.92 | 736,476,515.88 | 1,066,738,017.80 |

| 项目 | 上年度可比期间 | | |
|--|---------------------------------|----------------|-----------------|
| | 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 净值) | | | |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 98,448,631.47 | 94,258,434.02 | 192,707,065.49 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 37,481,287.62 | 37,481,287.62 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | -10,961,776.45 | -12,912,922.37 | -23,874,698.82 |
| 其中：1.基金申购款 | 68,307,448.72 | 83,324,271.96 | 151,631,720.68 |
| 2.基金赎回款 | -79,269,225.17 | -96,237,194.33 | -175,506,419.50 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | - | - | - |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 87,486,855.02 | 118,826,799.27 | 206,313,654.29 |

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：赵敏，会计机构负责人：陈林

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华安纳斯达克 100 指数证券投资基金(以下简称“本基金”)，系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2013]10 号文《关于核准华安纳斯达克 100 指数证券投资基金募集的批复》的核准，由华安基金管理有限公司作为管理人向社会公开募集，基金合同于 2013 年 8 月 2 日正式生效，首次设立募集规模为 273,039,419.53 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构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，境外资产托管人为美国道富银行(State Street Bank and Trust Company)。

本基金主要投资于纳斯达克 100 指数成份股、备选成份股，与纳斯达克 100 指数相关的公募基金、上市交易型基金等，固定收益类证券、银行存款、现金等货币市场工具、股指期货以及中国证监会允许本基金投资的其他产品或金融工具。本基金投资于纳斯达克 100 指数成份股、备选成份股以及与纳斯达克 100 指数相关的公募基金、上市交易型基金的比例不低于基金资产的 85%，其中投资于与纳斯达克 100 指数相关的公募基金、上市交易型基金的比例不超过基金资产的 10%；投资于

现金或者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%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或变更投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以相应调整本基金的投资范围、投资比例规定。

本基金的业绩比较基准为：纳斯达克 100 价格指数（Nasdaq 100 Price Index）收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本会计期间不存在会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，本基金的基金管理人运营本基金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。对本基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从本基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂免征营业税或增值税和企业所得税；

基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂未征收个人所得税和企业所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2020 年 6 月 30 日 |
|------|------------------------|
| 活期存款 | 81,726,656.85 |
| 定期存款 | - |
| 其他存款 | - |
| 合计 | 81,726,656.85 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | | 本期末 2020 年 6 月 30 日 | | |
|--------|-------|------------------------|----------------|----------------|
| | | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | 787,894,782.88 | 987,179,638.77 | 199,284,855.89 |
| 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 | | 787,894,782.88 | 987,179,638.77 | 199,284,855.89 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2020 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 | 68,963,958.12 | - | - | - |
| 其中：股指期货投资 | 68,963,958.12 | - | - | - |
| 其他衍生工具 | - | - | - | - |
| 合计 | 68,963,958.12 | - | - | - |

注：按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《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-股指期货投资”与“证券清算款-股指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-股指期货”

货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报,净额为零。

本报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细为: NASDAQ 100 E-MINI SEP20 买入持仓量 48 手, 合约市值人民币 68,963,958.12 元, 公允价值变动人民币 3,763,779.83 元。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位: 人民币元

| 项目 | 本期末 2020 年 6 月 30 日 |
|------------|------------------------|
| 应收活期存款利息 | 12,932.81 |
| 应收定期存款利息 | - |
| 应收其他存款利息 | - |
| 应收结算备付金利息 | - |
| 应收债券利息 | - |
| 应收资产支持证券利息 | - |
| 应收买入返售证券利息 | - |
| 应收申购款利息 | - |
| 应收出借证券利息 | - |
| 其他 | - |
| 合计 | 12,932.81 |

6.4.7.6 其他资产

无余额。

6.4.7.7 应付交易费用

无余额。

6.4.7.8 其他负债

单位: 人民币元

| 项目 | 本期末 |
|----|-----|
|----|-----|

| | 2020 年 6 月 30 日 |
|-------------|-----------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 179,967.22 |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 预提审计费 | 29,835.26 |
| 预提信息披露费 | 59,672.34 |
| 预提指数使用费 | 281,019.07 |
| 合计 | 550,493.89 |

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 | |
|---------------|---------------------------------------|-----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 106,241,563.26 | 106,241,563.26 |
| 本期申购 | 640,689,200.10 | 640,689,200.10 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -416,669,261.44 | -416,669,261.44 |
| 本期末 | 330,261,501.92 | 330,261,501.92 |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|-----------------|-----------------|------------------|
| 上年度末 | 77,187,746.26 | 104,334,313.01 | 181,522,059.27 |
| 本期利润 | 59,775,301.22 | 141,692,604.99 | 201,467,906.21 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 168,922,445.46 | 184,564,104.94 | 353,486,550.40 |
| 其中：基金申购款 | 502,094,260.63 | 579,199,736.37 | 1,081,293,997.00 |
| 基金赎回款 | -333,171,815.17 | -394,635,631.43 | -727,807,446.60 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 305,885,492.94 | 430,591,022.94 | 736,476,515.88 |

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入 | 191,033.80 |
| 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 | 1,140.46 |

| | |
|----|------------|
| 合计 | 192,174.26 |
|----|------------|

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年1月1日至2020年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 458,382,111.07 |
| 减：卖出股票成本总额 | 404,561,736.55 |
| 买卖股票差价收入 | 53,820,374.52 |

6.4.7.13 债券投资收益

无。

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年1月1日至2020年6月30日 |
|-------------------|----------------------------|
| 卖出权证成交总额 | 23,787.12 |
| 减：卖出权证成本总额 | - |
| 减：买卖权证差价收入应缴纳增值税额 | 692.83 |
| 买卖权证差价收入 | 23,094.29 |

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年1月1日至2020年6月30日 |
|--------|----------------------------|
| 期权投资收益 | - |
| 远期投资收益 | - |
| 期货投资收益 | 4,767,581.97 |
| 合计 | 4,767,581.97 |

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年1月1日至2020年6月30日 |
|---------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 3,449,888.48 |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | - |
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | 3,449,888.48 |

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2020年1月1日至2020年6月30日 |
|----------------------------|----------------------------|
| 1.交易性金融资产 | 137,928,825.16 |
| ——股票投资 | 137,928,825.16 |
| ——债券投资 | - |
| ——资产支持证券投资 | - |
| ——基金投资 | - |
| ——其他 | - |
| 2.衍生工具 | 3,763,779.83 |
| ——权证投资 | - |
| ——期货投资 | 3,763,779.83 |
| 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 | 141,692,604.99 |

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年1月1日至2020年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 1,754,388.42 |
| 合计 | 1,754,388.42 |

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年1月1日至2020年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 140,674.39 |
| 银行间市场交易费用 | - |
| 合计 | 140,674.39 |

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年1月1日至2020年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 审计费用 | 29,835.26 |
| 信息披露费 | 59,672.34 |
| 证券出借违约金 | - |
| 指数许可费 | 223,154.86 |
| 银行汇划费 | 32,008.72 |
| 其他费用 | 832.21 |
| 合计 | 345,503.39 |

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系**6.4.9.1 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|------------------------|---------------------|
| 华安基金管理有限公司(“华安基金公司”) | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”) | 基金托管人、基金代销机构 |
| 美国道富银行 | 基金境外托管行 |

注：以下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**

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

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 2020年1月1日至2020年6月 30日 | 上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6 月30日 |
|-----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 3,246,449.76 | 827,410.29 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 1,252,164.95 | 328,400.99 |

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.80% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年1月1日至2020年6月 30日 | 上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6 月30日 |
|----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,014,515.54 | 258,565.74 |

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、

休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

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

本基金本报告期末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

份额单位：份

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|-------------------|----------------------|----------------------|
| | 2020年1月1日至2020年6月30日 | 2019年1月1日至2019年6月30日 |
| 期初持有的基金份额 | - | - |
| 期间申购/买入总份额 | 4,278,562.26 | - |
| 期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减：期间赎回/卖出总份额 | - | - |
| 期末持有的基金份额 | 4,278,562.26 | - |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 1.30% | - |

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

无。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 | | 上年度可比期间 | |
|-------|----------------------|----------------------|----------------------|----------------------|
| | 2020年1月1日至2020年6月30日 | 2019年1月1日至2019年6月30日 | 2019年1月1日至2019年6月30日 | 2019年1月1日至2019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 |
| 建设银行 | 57,185,440.62 | 184,272.06 | 12,463,211.06 | 37,083.75 |
| 道富银行 | 24,541,216.23 | 6,761.74 | 6,261,351.23 | 18,604.46 |

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。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2020 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

本基金无因认购新发/增发证券而于期末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

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为股票型基金，属于较高风险、较高预期收益的基金品种，其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。本基金投资的金融工具主要包括纳斯达克 100 指数成分股、备选成分股以及与纳斯达克 100 指数相关的公募基金、上市交易型基金等、固定收益类证券、银行存款、现金等货币市场工具、股指期货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。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。本基金通过被动的指数化投资管理，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奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部等相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立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监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理和投资风险、绩效评估等。监察稽核部和风险管理部对公司执行总

裁负责，并由督察长分管。

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。本基金的银行存款存放在经中国人民银行和中国证券监督管理委员会所批准的具有基金托管资格和基金代销资格的银行，并根据本基金的基金管理人管理交易对手的经验进行筛选，因而与这些银行存款相关的信用风险不重大。本基金在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险；在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

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。

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。

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》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)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%。

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 10%。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。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施,本基金在本报告期内流动性情况良好。

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。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金等，其余金融资产和金融负债均不计息，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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2020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 | 81,726,656.85 | - | - | - | 81,726,656.85 |
| 结算备付金 | 20,575,801.46 | - | - | - | 20,575,801.46 |
| 存出保证金 | 7,289,053.20 | - | - | - | 7,289,053.20 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 987,179,638.77 | 987,179,638.77 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 283,690.36 | 283,690.36 |
| 应收股利 | - | - | - | 202,075.83 | 202,075.83 |
| 应收利息 | - | - | - | 12,932.81 | 12,932.81 |
| 应收申购款 | - | - | - | 19,792,113.88 | 19,792,113.88 |
| 资产总计 | 109,591,511.51 | - | - | 1,007,470,451.65 | 1,117,061,963.16 |
| 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 | - | - | - | - | - |

| | | | | | |
|-----------------------------|----------------|-------|-------|----------------|------------------|
| 应付赎回款 | - | - | - | 48,760,543.91 | 48,760,543.91 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 649,097.79 | 649,097.79 |
| 应付托管费 | - | - | - | 202,843.04 | 202,843.04 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - |
| 应交税费 | - | - | - | 160,966.73 | 160,966.73 |
| 应付利息 | - | - | - | - | - |
| 应付利润 | - | - | - | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | 550,493.89 | 550,493.89 |
| 负债总计 | - | - | - | 50,323,945.36 | 50,323,945.36 |
| 利率敏感度缺口 | 109,591,511.51 | - | - | 957,146,506.29 | 1,066,738,017.80 |
| 上年度末 2019 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 | 26,146,134.58 | - | - | - | 26,146,134.58 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 264,612,502.72 | 264,612,502.72 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - |
| 应收股利 | - | - | - | 86,606.02 | 86,606.02 |
| 应收利息 | - | - | - | 4,961.86 | 4,961.86 |
| 应收申购款 | - | - | - | 7,532,485.12 | 7,532,485.12 |
| 资产总计 | 26,146,134.58 | - | - | 272,236,555.72 | 298,382,690.30 |
| 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 | - | - | - | 3,257,675.63 | 3,257,675.63 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 6,861,936.43 | 6,861,936.43 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 182,400.09 | 182,400.09 |
| 应付托管费 | - | - | - | 57,000.02 | 57,000.02 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - |

| | | | | | |
|---------|---------------|---|---|----------------|----------------|
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - |
| 应交税费 | - | - | - | - | - |
| 应付利息 | - | - | - | - | - |
| 应付利润 | - | - | - | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | 260,055.60 | 260,055.60 |
| 负债总计 | - | - | - | 10,619,067.77 | 10,619,067.77 |
| 利率敏感度缺口 | 26,146,134.58 | - | - | 261,617,487.95 | 287,763,622.53 |

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2020 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2019 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（2019 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 2020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 | 25,018,633.14 | 25,018,633.14 |
| 结算备付金 | 20,575,801.46 | 20,575,801.46 |
| 存出保证金 | 7,289,053.20 | 7,289,053.20 |
| 交易性金融资产 | 987,179,638.77 | 987,179,638.77 |
| 应收股利 | 202,075.83 | 202,075.83 |

| | | |
|-------------------|---------------------|------------------|
| 应收利息 | 6.37 | 6.37 |
| 应收证券清算款 | 283,690.36 | 283,690.36 |
| 资产合计 | 1,040,548,899.13 | 1,040,548,899.13 |
| 以外币计价的负债 | | |
| 应付赎回款 | - | - |
| 应付赎回费 | - | - |
| 应付证券清算款 | - | - |
| 负债合计 | - | - |
| 资产负债表外 汇风险敞口净额 | 1,040,548,899.13 | 1,040,548,899.13 |
| 项目 | 上年度末 2019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 | 5,319,103.31 | 5,319,103.31 |
| 交易性金融资产 | 264,612,502.72 | 264,612,502.72 |
| 应收利息 | 543.94 | 543.94 |
| 应收股利 | 86,606.02 | 86,606.02 |
| 应收申购款 | - | - |
| 应收证券清算款 | - | - |
| 资产合计 | 270,018,755.99 | 270,018,755.99 |
| 以外币计价的负债 | | |
| 应付赎回款 | - | - |
| 应付赎回费 | - | - |
| 应付证券清算款 | 3,257,675.63 | 3,257,675.63 |
| 负债合计 | 3,257,675.63 | 3,257,675.63 |

| | | |
|-----------------------|----------------|----------------|
| 资产负债表外 汇风险敞口净 额 | 266,761,080.36 | 266,761,080.36 |
|-----------------------|----------------|----------------|

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

| 假设 | 除市场利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 2020 年 6 月 30 日 | 上年度末 2019 年 12 月 31 日 |
| | 美元相对人民币升值 5% | 增加约 5,203 | 增加约 1,334 |
| | 美元相对人民币贬值 5% | 减少约 5,203 | 减少约 1,334 |

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或银行间同业市场交易的股票和债券，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。

本基金采用完全复制法，跟踪标的指数，以完全按照标的指数成分股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成分股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况（如成分股流动性不足等）导致无法获得足够数量的股票，或因其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代，如采用优化方法计算最优化投资组合的个股权重比例，对投资组合管理进行适当变通和调整，以此构建本基金实际的投资组合，追求尽可能贴近标的指数的表现。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中纳斯达克 100 指数成分股、备选成分股，与纳斯达克 100 指数相关的公募基金、上市交易型基金的投资比例不低于基金资产的 85%，其中投资于与纳斯达克 100 指数相关的公募基金、上市交易型基金的比例不超过基金资产的 10%；投资于现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%。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 2020 年 6 月 30 日 | | 上年度末 2019 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 | 987,179,638.77 | 92.54 | 264,612,502.72 | 91.95 |
| 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 | 987,179,638.77 | 92.54 | 264,612,502.72 | 91.95 |

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：人民币万元） | |
| | | 本期末 2020 年 6 月 30 日 | 上年度末 2019 年 12 月 31 日 |
| | 业绩比较基准上升 5% | 增加约 5,004 | 增加约 1,386 |
| | 业绩比较基准下降 5% | 减少约 5,004 | 减少约 1,386 |

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本财务报表已于 2020 年 8 月 25 日经本基金的基金管理人批准。

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 | 987,179,638.77 | 88.37 |
| | 其中：普通股 | 971,638,069.05 | 86.98 |
| | 存托凭证 | 15,541,569.72 | 1.39 |
| | 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 | 102,302,458.31 | 9.16 |
| 8 | 其他各项资产 | 27,579,866.08 | 2.47 |
| 9 | 合计 | 1,117,061,963.16 | 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 | 987,179,638.77 | 92.54 |
| 合计 | 987,179,638.77 | 92.54 |

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 | 476,509,864.84 | 44.67 |
| 通信服务 | 196,340,979.20 | 18.41 |
| 非日常生活消费品 | 168,587,248.48 | 15.80 |
| 医疗保健 | 71,226,615.88 | 6.68 |
| 日常消费品 | 48,298,380.83 | 4.53 |
| 工业 | 19,683,742.68 | 1.85 |

| | | |
|------|----------------|-------|
| 公用事业 | 6,532,806.86 | 0.61 |
| 房地产 | - | - |
| 能源 | - | - |
| 原材料 | - | - |
| 金融 | - | - |
| 合计 | 987,179,638.77 | 92.54 |

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名称 (英文) | 公司名称 (中文) | 证券代码 | 所在证 券市场 | 所属国家 (地区) | 数量 (股) | 公允价值 | 占基金资 产净值比 例 (%) |
|----|---------------------------------|------------------|----------|------------|--------------|--------|----------------|-----------------------|
| 1 | APPLE INC | 苹果公司 | AAPL US | 纳斯达 克市场 | 美国 | 45,980 | 118,748,021.57 | 11.13 |
| 2 | MICROS OFT CORP | 微软 | MSFT US | 纳斯达 克市场 | 美国 | 80,430 | 115,879,445.69 | 10.86 |
| 3 | AMAZO N.COM INC | 亚马逊公 司 | AMZN US | 纳斯达 克市场 | 美国 | 5,300 | 103,514,650.81 | 9.70 |
| 4 | FACEBO OK INC-CLA SS A | Facebook 公司 | FB US | 纳斯达 克市场 | 美国 | 25,530 | 41,040,548.92 | 3.85 |
| 5 | ALPHAB ET INC-CLA | Alphabet 公司 | GOOGL US | 纳斯达 克市场 | 美国 | 3,733 | 37,475,904.21 | 3.51 |
| 6 | ALPHAB ET INC-CL C | Alphabet 公司 | GOOG US | 纳斯达 克市场 | 美国 | 3,633 | 36,357,799.70 | 3.41 |
| 7 | INTEL CORP | 英特尔 | INTC US | 纳斯达 克市场 | 美国 | 57,330 | 24,283,066.59 | 2.28 |
| 8 | NVIDIA CORP | 英伟达 | NVDA US | 纳斯达 克市场 | 美国 | 8,400 | 22,592,411.90 | 2.12 |
| 9 | ADOBE INC | 奥多比 | ADBE US | 纳斯达 克市场 | 美国 | 6,500 | 20,031,551.44 | 1.88 |
| 10 | PAYPAL HOLDIN | Paypal 控 股股份有 | PYPL US | 纳斯达 克市场 | 美国 | 15,900 | 19,612,034.43 | 1.84 |

| | | | | | | | | |
|----|--|-------------------------|----------|-------------|----|--------|---------------|------|
| | GS INC | 限公司 | | | | | | |
| 11 | NETFLIX INC | 奈飞公司 | NFLX US | 纳斯达克 克市场 | 美国 | 6,000 | 19,328,734.08 | 1.81 |
| 12 | TESLA INC | 特斯拉公 司 | TSLA US | 纳斯达克 克市场 | 美国 | 2,500 | 19,111,287.24 | 1.79 |
| 13 | CISCO SYSTEM S INC | 思科-T | CSCO US | 纳斯达克 克市场 | 美国 | 57,100 | 18,853,727.95 | 1.77 |
| 14 | PEPSICO INC | 百事可乐 | PEP US | 纳斯达克 克市场 | 美国 | 18,800 | 17,603,091.80 | 1.65 |
| 15 | COMCAS T CORP-CL ASS A | 康卡斯特 | CMCSA US | 纳斯达克 克市场 | 美国 | 61,600 | 16,999,068.86 | 1.59 |
| 16 | AMGEN INC | AMGEN-T | AMGN US | 纳斯达克 克市场 | 美国 | 8,000 | 13,358,166.96 | 1.25 |
| 17 | COSTCO WHOLESA LE CORP | 好市多批 发 | COST US | 纳斯达克 克市场 | 美国 | 6,000 | 12,879,451.17 | 1.21 |
| 18 | T-MOBIL E US INC | T-Mobile US 有限公 司 | TMUS US | 纳斯达克 克市场 | 美国 | 16,800 | 12,387,142.74 | 1.16 |
| 19 | BROADC OM INC | 博通股份 有限公司 | AVGO US | 纳斯达克 克市场 | 美国 | 5,500 | 12,288,985.47 | 1.15 |
| 20 | TEXAS INSTRU MENTS INC | 德州仪器 | TXN US | 纳斯达克 克市场 | 美国 | 12,500 | 11,236,051.44 | 1.05 |
| 21 | CHARTE R COMMUN ICATION S INC-A | 查特通信 公司 | CHTR US | 纳斯达克 克市场 | 美国 | 2,890 | 10,435,293.44 | 0.98 |
| 22 | QUALCO MM INC | 高通公司 | QCOM US | 纳斯达克 克市场 | 美国 | 15,300 | 9,879,534.28 | 0.93 |
| 23 | GILEAD SCIENCE S INC | 吉利德科 学 | GILD US | 纳斯达克 克市场 | 美国 | 17,000 | 9,259,844.41 | 0.87 |
| 24 | STARBU CKS CORP | 星巴克 | SBUX US | 纳斯达克 克市场 | 美国 | 15,800 | 8,231,490.40 | 0.77 |
| 25 | INTUIT | Intuit 公司 | INTU US | 纳斯达 | 美国 | 3,600 | 7,548,757.58 | 0.71 |

| | | | | | | | | |
|----|---|--------------------------|---------|------------|----|--------|--------------|------|
| | INC | | | 克市场 | | | | |
| 26 | VERTEX PHARM ACEUTI CALS INC | 福泰制药 | VRTX US | 纳斯达 克市场 | 美国 | 3,600 | 7,398,898.72 | 0.69 |
| 27 | MONDE LEZ INTERN ATIONA L INC-A | 亿滋国际 | MDLZ US | 纳斯达 克市场 | 美国 | 19,300 | 6,986,114.32 | 0.65 |
| 28 | FISERV INC | Fiserv 公司 | FISV US | 纳斯达 克市场 | 美国 | 9,100 | 6,289,017.19 | 0.59 |
| 29 | AUTOMA TIC DATA PROCES SING | ADP 公司 | ADP US | 纳斯达 克市场 | 美国 | 5,900 | 6,218,993.85 | 0.58 |
| 30 | BOOKIN G HOLDIN GS INC | Booking 控 股股份有 限公司 | BKNG US | 纳斯达 克市场 | 美国 | 550 | 6,200,134.07 | 0.58 |
| 31 | REGENE RON PHARM ACEUTI CALS | 再生元制 药股份有 限公司 | REGN US | 纳斯达 克市场 | 美国 | 1,400 | 6,181,182.25 | 0.58 |
| 32 | INTUITI VE SURGIC AL INC | 直觉外科 手术公司 | ISRG US | 纳斯达 克市场 | 美国 | 1,500 | 6,051,167.23 | 0.57 |
| 33 | ADVANC ED MICRO DEVICES | AMD 公司 | AMD US | 纳斯达 克市场 | 美国 | 15,900 | 5,921,994.67 | 0.56 |
| 34 | ACTIVIS ION BLIZZAR D INC | 动视暴雪 股份有限 公司 | ATVI US | 纳斯达 克市场 | 美国 | 10,400 | 5,588,274.12 | 0.52 |
| 35 | MICRON TECHNO LOGY INC | 美光科技 股份有限 公司 | MU US | 纳斯达 克市场 | 美国 | 15,100 | 5,507,511.18 | 0.52 |
| 36 | JD.COM INC-ADR | 京东集团 | JD US | 纳斯达 克市场 | 美国 | 12,600 | 5,368,158.31 | 0.50 |

| | | | | | | | | |
|----|--|--|---------|------------|----|--------|--------------|------|
| 37 | APPLIED MATERI ALS INC | 应用材料 | AMAT US | 纳斯达 克市场 | 美国 | 12,400 | 5,306,651.61 | 0.50 |
| 38 | ILLUMIN A INC | Illumina 公 司 | ILMN US | 纳斯达 克市场 | 美国 | 2,000 | 5,243,785.65 | 0.49 |
| 39 | CSX CORP | CSX 公司 | CSX US | 纳斯达 克市场 | 美国 | 10,400 | 5,134,733.03 | 0.48 |
| 40 | AUTODE SK INC | 欧特克 | ADSK US | 纳斯达 克市场 | 美国 | 3,000 | 5,080,036.82 | 0.48 |
| 41 | MERCA DOLIBR E INC | Mercadolib re 股份有 限公司 | MELI US | 纳斯达 克市场 | 美国 | 700 | 4,885,131.10 | 0.46 |
| 42 | LAM RESEAR CH CORP | 泛林集团 | LRCX US | 纳斯达 克市场 | 美国 | 2,000 | 4,579,870.14 | 0.43 |
| 43 | ANALOG DEVICES INC | 模拟器件 | ADI US | 纳斯达 克市场 | 美国 | 5,046 | 4,381,087.97 | 0.41 |
| 44 | BIOGEN INC | 百健 | BIIB US | 纳斯达 克市场 | 美国 | 2,300 | 4,356,476.52 | 0.41 |
| 45 | ZOOM VIDEO COMMU NICATIO NS-A | Zoom Video Communic ations In | ZM US | 纳斯达 克市场 | 美国 | 2,200 | 3,948,860.15 | 0.37 |
| 46 | ELECTR ONIC ARTS INC | 电子艺界 | EA US | 纳斯达 克市场 | 美国 | 4,000 | 3,739,391.90 | 0.35 |
| 47 | KRAFT HEINZ CO/THE | 卡夫亨氏 公司 | KHC US | 纳斯达 克市场 | 美国 | 16,500 | 3,725,126.71 | 0.35 |
| 48 | WALGRE ENS BOOTS ALLIAN CE INC | Walgreens Boots Alliance 公 司 | WBA US | 纳斯达 克市场 | 美国 | 11,900 | 3,571,190.06 | 0.33 |
| 49 | LULULE MON ATHLETI CA INC | Lululemon Athletica 股份有限 | LULU US | 纳斯达 克市场 | 美国 | 1,600 | 3,534,199.67 | 0.33 |
| 50 | MONSTE R BEVERA GE CORP | 怪兽饮料 公司 | MNST US | 纳斯达 克市场 | 美国 | 7,200 | 3,533,406.77 | 0.33 |

| | | | | | | | | |
|----|-------------------------------------|-------------------|---------|--------|----|--------|--------------|------|
| 51 | EBAY INC | eBay 公司 | EBAY US | 纳斯达克市场 | 美国 | 9,500 | 3,527,537.86 | 0.33 |
| 52 | DEXCOM INC | DexCom 股份有限公司 | DXCM US | 纳斯达克市场 | 美国 | 1,200 | 3,444,035.16 | 0.32 |
| 53 | EXELON CORP | Exelon 公司 | EXC US | 纳斯达克市场 | 美国 | 13,200 | 3,391,278.73 | 0.32 |
| 54 | BAIDU INC - SPON ADR | 百度 | BIDU US | 纳斯达克市场 | 美国 | 3,800 | 3,225,292.77 | 0.30 |
| 55 | XCEL ENERGY INC | Xcel 能源 | XEL US | 纳斯达克市场 | 美国 | 7,100 | 3,141,528.13 | 0.29 |
| 56 | NXP SEMICONDUCTORS NV | 恩智浦半导体公司 | NXPI US | 纳斯达克市场 | 美国 | 3,800 | 3,067,915.48 | 0.29 |
| 57 | WORKDAY INC-CLASS A | Workday 股份有限公司 | WDAY US | 纳斯达克市场 | 美国 | 2,300 | 3,050,754.78 | 0.29 |
| 58 | NETEASE INC-ADR | 网易 | NTES US | 纳斯达克市场 | 美国 | 1,000 | 3,039,795.71 | 0.28 |
| 59 | O'REILLY AUTOMOTIVE INC | O'Reilly 汽车股份有限公司 | ORLY US | 纳斯达克市场 | 美国 | 1,000 | 2,985,212.77 | 0.28 |
| 60 | COGNIZANT TECHNOLOGICAL SOLUTIONS-A | 高知特科技公司 | CTSH US | 纳斯达克市场 | 美国 | 7,400 | 2,976,703.21 | 0.28 |
| 61 | ROSS STORES INC | Ross 商店有限公司 | ROST US | 纳斯达克市场 | 美国 | 4,900 | 2,956,937.24 | 0.28 |
| 62 | SPLUNK INC | Splunk 公司 | SPLK US | 纳斯达克市场 | 美国 | 2,100 | 2,954,062.97 | 0.28 |
| 63 | DOCUSIGN INC | DocuSign 股份有限公司 | DOCU US | 纳斯达克市场 | 美国 | 2,400 | 2,925,985.67 | 0.27 |
| 64 | KLA CORP | KLA 公司 | KLAC US | 纳斯达克市场 | 美国 | 2,100 | 2,891,324.44 | 0.27 |

| | | | | | | | | |
|----|------------------------------------|--------------------|---------|--------|----|--------|--------------|------|
| 65 | SEATTLE GENETICS INC | 西雅图遗传学股份有限公司 | SGEN US | 纳斯达克市场 | 美国 | 2,300 | 2,766,781.87 | 0.26 |
| 66 | SYNOPOS YS INC | 新思科技公司 | SNPS US | 纳斯达克市场 | 美国 | 2,000 | 2,761,005.00 | 0.26 |
| 67 | MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A | 万豪国际 | MAR US | 纳斯达克市场 | 美国 | 4,400 | 2,670,472.35 | 0.25 |
| 68 | VERISK ANALYTICS INC | Verisk 分析公司 | VRSK US | 纳斯达克市场 | 美国 | 2,200 | 2,650,847.98 | 0.25 |
| 69 | CINTAS CORP | CINTAS 公司 | CTAS US | 纳斯达克市场 | 美国 | 1,400 | 2,639,973.87 | 0.25 |
| 70 | PAYCHEX INC | Paychex 公司 | PAYX US | 纳斯达克市场 | 美国 | 4,900 | 2,627,733.41 | 0.25 |
| 71 | ASML HOLDING NV-NY REG SHS | 阿斯麦控股公司 | ASML US | 纳斯达克市场 | 美国 | 1,000 | 2,605,468.39 | 0.24 |
| 72 | CADENCE DESIGN SYS INC | Cadence 设计系统股份有限公司 | CDNS US | 纳斯达克市场 | 美国 | 3,800 | 2,581,525.52 | 0.24 |
| 73 | IDEXX LABORATORIES INC | 爱德士股份有限公司 | IDXX US | 纳斯达克市场 | 美国 | 1,100 | 2,571,104.49 | 0.24 |
| 74 | COSTAR GROUP INC | CoStar 集团股份有限公司 | CSGP US | 纳斯达克市场 | 美国 | 500 | 2,515,594.13 | 0.24 |
| 75 | PACCAR INC | 帕卡 | PCAR US | 纳斯达克市场 | 美国 | 4,700 | 2,490,532.70 | 0.23 |
| 76 | MICROCHIP TECHNOLOGY INC | 微芯科技股份有限公司 | MCHP US | 纳斯达克市场 | 美国 | 3,300 | 2,460,289.08 | 0.23 |
| 77 | SIRIUS XM HOLDINGS INC | Sirius XM 控股公司 | SIRI US | 纳斯达克市场 | 美国 | 59,200 | 2,460,154.57 | 0.23 |
| 78 | ALEXION | 亚力兄制药公司 | ALXN US | 纳斯达克市场 | 美国 | 3,000 | 2,383,809.24 | 0.22 |

| | | | | | | | | |
|----|-----------------------------|----------------|---------|--------|----|-------|--------------|------|
| | PHARMACEUTICALS INC | | | | | | | |
| 79 | FASTENAL CO | 快扣公司 | FAST US | 纳斯达克市场 | 美国 | 7,800 | 2,365,629.08 | 0.22 |
| 80 | XILINX INC | 赛灵思 | XLNX US | 纳斯达克市场 | 美国 | 3,300 | 2,298,621.62 | 0.22 |
| 81 | ANSYS INC | ANSYS 股份有限公司 | ANSS US | 纳斯达克市场 | 美国 | 1,100 | 2,271,832.79 | 0.21 |
| 82 | VERISIGN INC | 威瑞信股份有限公司 | VRSN US | 纳斯达克市场 | 美国 | 1,500 | 2,196,379.48 | 0.21 |
| 83 | INCYTE CORP | 因赛特公司 | INCY US | 纳斯达克市场 | 美国 | 2,900 | 2,134,561.28 | 0.20 |
| 84 | DOLLAR TREE INC | Dollar Tree 公司 | DLTR US | 纳斯达克市场 | 美国 | 3,200 | 2,099,609.79 | 0.20 |
| 85 | BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC | 拜玛林制药 | BMRN US | 纳斯达克市场 | 美国 | 2,400 | 2,095,645.27 | 0.20 |
| 86 | SKYWORKS SOLUTIONS INC | 思佳讯解决方案公司 | SWKS US | 纳斯达克市场 | 美国 | 2,300 | 2,081,925.20 | 0.20 |
| 87 | CERNER CORP | 塞纳公司 | CERN US | 纳斯达克市场 | 美国 | 4,200 | 2,038,258.85 | 0.19 |
| 88 | ALIGN TECHNOLOGY INC | Align 科技股份有限公司 | ALGN US | 纳斯达克市场 | 美国 | 1,000 | 1,942,897.98 | 0.18 |
| 89 | COPART INC | Copart 股份有限公司 | CPRT US | 纳斯达克市场 | 美国 | 3,200 | 1,886,431.89 | 0.18 |
| 90 | CITRIX SYSTEMS INC | 思杰系统 | CTXS US | 纳斯达克市场 | 美国 | 1,600 | 1,675,406.15 | 0.16 |
| 91 | MAXIM INTEGRATED PRODUCTS | 美信 | MXIM US | 纳斯达克市场 | 美国 | 3,700 | 1,587,627.43 | 0.15 |

| | | | | | | | | |
|-----|--|---------------------------------|----------|------------|----|-------|--------------|------|
| 92 | CDW CORP/DE | 特拉华 CDW 公司 | CDW US | 纳斯达 克市场 | 美国 | 1,900 | 1,562,742.99 | 0.15 |
| 93 | CHECK POINT SOFTWA RE TECH | Check Point 软件 技术有限 公司 | CHKP US | 纳斯达 克市场 | 美国 | 2,000 | 1,521,101.37 | 0.14 |
| 94 | TAKE-T WO INTERA CTIVE SOFTWR E | Take-Two 互动软件 股份有限 公司 | TTWO US | 纳斯达 克市场 | 美国 | 1,500 | 1,482,128.72 | 0.14 |
| 95 | TRIP.CO M GROUP LTD-AD R | 携程集团 有限公司 | TCOM US | 纳斯达 克市场 | 美国 | 7,100 | 1,302,854.54 | 0.12 |
| 96 | WESTER N DIGITAL CORP | 西部数据 公司 | WDC US | 纳斯达 克市场 | 美国 | 4,100 | 1,281,495.69 | 0.12 |
| 97 | ULTA BEAUTY INC | Ulta 美容 产品公司 | ULTA US | 纳斯达 克市场 | 美国 | 800 | 1,152,089.51 | 0.11 |
| 98 | EXPEDIA GROUP INC | 亿客行集 团股份有 限公司 | EXPE US | 纳斯达 克市场 | 美国 | 1,800 | 1,047,482.82 | 0.10 |
| 99 | NETAPP INC | 网域存储 技术 | NTAP US | 纳斯达 克市场 | 美国 | 3,000 | 942,352.25 | 0.09 |
| 100 | FOX CORP-CL ASS A | 福克斯公 司 | FOXA US | 纳斯达 克市场 | 美国 | 4,666 | 885,943.64 | 0.08 |
| 101 | LIBERTY GLOBAL PLC- C | 自由全球 公司 | LBTYK US | 纳斯达 克市场 | 美国 | 5,600 | 852,768.25 | 0.08 |
| 102 | FOX CORP-CL ASS B | 福克斯公 司 | FOX US | 纳斯达 克市场 | 美国 | 3,533 | 671,318.68 | 0.06 |
| 103 | LIBERTY GLOBAL PLC-A | 自由全球 公司 | LBTYA US | 纳斯达 克市场 | 美国 | 2,400 | 371,418.89 | 0.03 |

7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名称（英文） | 证券代码 | 本期累计买入金额 | 占期初基金 资产净值比例 （%） |
|----|------------------------------------|----------|----------------|------------------------|
| 1 | APPLE INC | AAPL US | 109,980,320.30 | 38.22 |
| 2 | MICROSOFT CORP | MSFT US | 109,289,891.66 | 37.98 |
| 3 | AMAZON.COM INC | AMZN US | 90,169,710.68 | 31.33 |
| 4 | ALPHABET INC-CL A | GOOGL US | 41,541,464.11 | 14.44 |
| 5 | ALPHABET INC-CL C | GOOG US | 40,613,765.89 | 14.11 |
| 6 | FACEBOOK INC-A | FB US | 39,252,284.89 | 13.64 |
| 7 | INTEL CORP | INTC US | 27,207,235.77 | 9.45 |
| 8 | PEPSICO INC | PEP US | 20,639,982.87 | 7.17 |
| 9 | COMCAST CORP-CLASS A | CMCSA US | 20,584,009.46 | 7.15 |
| 10 | CISCO SYSTEMS INC | CSCO US | 19,507,119.36 | 6.78 |
| 11 | ADOBE SYSTEMS INC | ADBE US | 19,159,806.29 | 6.66 |
| 12 | NVIDIA CORP | NVDA US | 18,843,998.86 | 6.55 |
| 13 | NETFLIX INC | NFLX US | 18,438,747.50 | 6.41 |
| 14 | COSTCO WHOLESALE CORP | COST US | 15,759,930.21 | 5.48 |
| 15 | AMGEN INC | AMGN US | 14,957,487.28 | 5.20 |
| 16 | PAYPAL HOLDINGS INC | PYPL US | 14,521,009.45 | 5.05 |
| 17 | TESLA INC | TSLA US | 14,039,839.35 | 4.88 |
| 18 | BROADCOM INC | AVGO US | 12,611,408.12 | 4.38 |
| 19 | T-MOBILE US INC | TMUS US | 12,405,698.47 | 4.31 |
| 20 | TEXAS INSTRUMENTS INC | TXN US | 12,295,287.51 | 4.27 |
| 21 | CHARTER COMMUNICATIONS INC-A | CHTR US | 11,692,795.13 | 4.06 |
| 22 | GILEAD SCIENCES INC | GILD US | 10,211,757.40 | 3.55 |
| 23 | QUALCOMM INC | QCOM US | 9,984,763.19 | 3.47 |
| 24 | STARBUCKS CORP | SBUX US | 9,846,081.30 | 3.42 |
| 25 | MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A | MDLZ US | 8,510,071.57 | 2.96 |
| 26 | FISERV INC | FISV US | 8,279,801.10 | 2.88 |
| 27 | INTUIT INC | INTU US | 8,158,971.36 | 2.84 |
| 28 | AUTOMATIC DATA PROCESSING | ADP US | 7,684,033.94 | 2.67 |
| 29 | VERTEX PHARMACEUTICALS INC | VRTX US | 7,066,030.07 | 2.46 |
| 30 | BOOKING HOLDINGS INC | BKNG US | 6,796,366.68 | 2.36 |

| | | | | |
|----|------------------------|---------|--------------|------|
| 31 | ADVANCED MICRO DEVICES | AMD US | 6,334,086.91 | 2.20 |
| 32 | INTUITIVE SURGICAL INC | ISRG US | 6,235,567.84 | 2.17 |
| 33 | BIOGEN INC | BIIB US | 6,012,194.63 | 2.09 |
| 34 | MICRON TECHNOLOGY INC | MU US | 6,003,095.19 | 2.09 |
| 35 | EXELON CORP | EXC US | 5,885,485.28 | 2.05 |
| 36 | CSX CORP | CSX US | 5,865,506.48 | 2.04 |

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 | 59,106,849.17 | 20.54 |
| 2 | MICROSOFT CORP | MSFT US | 58,353,065.85 | 20.28 |
| 3 | AMAZON.COM INC | AMZN US | 45,218,955.43 | 15.71 |
| 4 | FACEBOOK INC-A | FB US | 20,755,084.38 | 7.21 |
| 5 | ALPHABET INC-CL C | GOOG US | 17,872,427.95 | 6.21 |
| 6 | ALPHABET INC-CL A | GOOGL US | 16,897,824.63 | 5.87 |
| 7 | INTEL CORP | INTC US | 13,614,590.36 | 4.73 |
| 8 | CISCO SYSTEMS INC | CSCO US | 9,292,244.77 | 3.23 |
| 9 | NVIDIA CORP | NVDA US | 9,182,908.88 | 3.19 |
| 10 | PEPSICO INC | PEP US | 9,149,966.03 | 3.18 |
| 11 | NETFLIX INC | NFLX US | 8,747,098.23 | 3.04 |
| 12 | COMCAST CORP-CLASS A | CMCSA US | 8,414,518.54 | 2.92 |
| 13 | ADOBE SYSTEMS INC | ADBE US | 8,319,618.57 | 2.89 |
| 14 | PAYPAL HOLDINGS INC | PYPL US | 7,506,957.34 | 2.61 |
| 15 | AMGEN INC | AMGN US | 6,976,987.34 | 2.42 |
| 16 | COSTCO WHOLESALE CORP | COST US | 6,526,075.31 | 2.27 |
| 17 | TESLA INC | TSLA US | 6,214,430.49 | 2.16 |
| 18 | TEXAS INSTRUMENTS INC | TXN US | 5,352,144.50 | 1.86 |
| 19 | BROADCOM INC | AVGO US | 5,130,721.63 | 1.78 |
| 20 | CHARTER COMMUNICATIONS INC-A | CHTR US | 5,003,488.68 | 1.74 |

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 | 989,200,047.44 |
| 卖出收入（成交）总额 | 458,382,111.07 |

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 SEP20 | - | - |

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 3,763,779.83 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 | 7,289,053.20 |
| 2 | 应收证券清算款 | 283,690.36 |
| 3 | 应收股利 | 202,075.83 |
| 4 | 应收利息 | 12,932.81 |
| 5 | 应收申购款 | 19,792,113.88 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 27,579,866.08 |

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 |
| 176,879 | 1,867.16 | 44,399,998.13 | 13.44% | 285,861,503.79 | 86.56% |

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 | 158,330.47 | 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

本公司高级管理人员、基金投资和研究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（2013 年 8 月 2 日）基金份额总额 | 273,039,419.53 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 106,241,563.26 |
| 本报告期基金总申购份额 | 640,689,200.10 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 416,669,261.44 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 330,261,501.92 |

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

本报告期内无管理人、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 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|------|------|------|-----------|------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股 | 佣金 | 占当期佣 | |

| | 数量 | | 票成交总 额的比例 | | 金总量的 比例 | |
|--|----|----------------|--------------|-----------|------------|---|
| Instinet Pacific Services Ltd | 1 | 903,955,767.79 | 62.45% | 71,875.80 | 62.85% | - |
| Goldman Sachs (Asia) Limited Liability Company | 1 | 367,177,989.20 | 25.36% | 29,174.21 | 25.51% | - |
| Morgan Stanley & Co. International PLC | 1 | 176,448,401.39 | 12.19% | 13,307.90 | 11.64% | - |
| BMO Capital Markets Ltd | 1 | - | - | - | - | - |
| Merrill Lynch Pierce Fenner & Smith Incorporated | 1 | - | - | - | - | - |
| Barclays Capital Asia Limited | 1 | - | - | - | - | - |

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) 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；

(2) 具备高效、安全的通讯条件；可靠、诚信，能够公平对待所有客户，有效执行投资指令，取得较高质量的交易成交结果，交易差错少，并能满足基金运作高度保密的要求；

(3) 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，最大限度地调动物体资源，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。

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 |
| Instinet Pacific Services Ltd | - | - | - | - | 23,787.12 | 100.00% | - | - |
| Goldman Sachs (Asia) Limited Liability Company | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Morgan Stanley & | - | - | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Co. Inter natio nal PLC | | | | | | | | |
| BMO Capit al Mark ets Ltd | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Merri ll Lync h Pierc e Fenn er & Smit h Incor porat ed | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Barcl ays Capit al Asia Limit ed | - | - | - | - | - | - | - | - |

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 指数证券投资基金 2020 年境外主要市场节假日暂停申购、赎回及定投的公告 | 《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站 | 2020-01-15 |
| 2 | 华安基金管理有限公司关于调整旗下基金 2020 年春节假期清算交收安排及申购赎回等交易业务的提示性公告 | 《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站 | 2020-01-28 |
| 3 | 华安基金管理有限公司关于公司自有资金投资旗下偏股型公募基金相关事宜的公告 | 《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站和 | 2020-02-04 |

| | | | |
|----|--|---------------------------|------------|
| | | 公司网站 | |
| 4 | 关于华安纳斯达克 100 指数证券投资基金暂停大额申购及大额定期定额投资的公告 | 《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站 | 2020-02-13 |
| 5 | 华安基金管理有限公司关于根据信息披露管理办法修订旗下公募基金基金合同等法律文件的公告 | 《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站 | 2020-03-07 |
| 6 | 华安纳斯达克 100 指数证券投资基金基金合同（更新） | 《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站 | 2020-03-07 |
| 7 | 华安纳斯达克 100 指数证券投资基金托管协议（更新） | 《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站 | 2020-03-07 |
| 8 | 华安基金管理有限公司关于基金电子直销平台调整“微钱宝”账户交易费率优惠活动的公告 | 《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站 | 2020-03-14 |
| 9 | 关于华安纳斯达克 100 指数证券投资基金暂停大额申购及大额定期定额投资的公告 | 《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站 | 2020-03-16 |
| 10 | 华安纳斯达克 100 指数证券投资基金暂停大额申购及大额定期定额投资的公告 | 《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站 | 2020-03-20 |
| 11 | 关于华安纳斯达克 100 指数证券投资基金暂停申购及定期定额投资的公告 | 《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站 | 2020-03-25 |
| 12 | 华安基金管理有限公司关于推迟披露旗下公募基金 2019 年年度报告的公告 | 《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站 | 2020-03-25 |
| 13 | 华安基金关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告 | 《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站 | 2020-03-30 |
| 14 | 关于华安纳斯达克 100 指数证券投资基金恢复申购及限制大额申购、定期定额投资业务的公告 | 《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站 | 2020-05-12 |
| 15 | 华安基金关于旗下基金参加中信证券股份有限公司费率优惠活动的公告 | 《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站 | 2020-05-21 |
| 16 | 关于华安纳斯达克 100 指数证券投资基金暂停大额申购及大额定期定额投资的公告 | 《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站 | 2020-06-03 |
| 17 | 关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告 | 《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站 | 2020-06-29 |
| 18 | 关于基金电子直销平台延长“微钱宝”账户交 | 《证券时报》、中国证监会 | 2020-06-29 |

| | | | |
|----|---------------------------------|---------------------------|------------|
| | 易费率优惠活动的公告 | 会基金电子披露网站和公司网站 | |
| 19 | 关于华安基金管理有限公司旗下基金参加交通银行费率优惠活动的公告 | 《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站 | 2020-06-30 |

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在规定媒介上披露。

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、《华安纳斯达克 100 指数证券投资基金基金合同》
- 2、《华安纳斯达克 100 指数证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安纳斯达克 100 指数证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会批准华安纳斯达克 100 指数证券投资基金设立的文件；
- 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；

11.2 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>。

11.3 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
二〇二〇年八月二十八日