

易方达纳斯达克 100 指数证券投资基金（LOF）

2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：二〇二二年八月三十日

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 2022 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 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
1.2	目录	3
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	6
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	10
4.1	基金管理人及基金经理情况	10
4.2	境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介	11
4.3	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	11
4.4	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.5	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.6	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.9	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	13
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
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	17
6.4	报表附注	18
7	投资组合报告	44
7.1	期末基金资产组合情况	44
7.2	期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	45
7.3	期末按行业分类的权益投资组合	45
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	46
7.5	报告期内权益投资组合的重大变动	53
7.6	期末按债券信用等级分类的债券投资组合	55
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	55
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	55
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	55

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	55
7.11	投资组合报告附注	55
8	基金份额持有人信息	57
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	57
8.2	期末上市基金前十名持有人	57
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58
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	58
9	开放式基金份额变动	58
10	重大事件揭示	59
10.1	基金份额持有人大会决议	59
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	59
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	59
10.4	基金投资策略的改变	59
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	59
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	59
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	59
10.8	其他重大事件	61
11	备查文件目录	62
11.1	备查文件目录	62
11.2	存放地点	62
11.3	查阅方式	63

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达纳斯达克 100 指数证券投资基金（LOF）	
基金简称	易方达纳斯达克 100 指数（QDII-LOF）	
场内简称	纳斯达克 100LOF	
基金主代码	161130	
基金运作方式	契约型、上市开放式（LOF）	
基金合同生效日	2017 年 6 月 23 日	
基金管理人	易方达基金管理有限公司	
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	430,782,094.93 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	2017 年 7 月 14 日	
下属分级基金的基金简称	易方达纳斯达克 100 指数 （QDII-LOF）A	易方达纳斯达克 100 指数 （QDII-LOF）C
下属分级基金的交易代码	161130	012870
报告期末下属分级基金的份额总额	422,863,259.02 份	7,918,835.91 份

注：本基金 A 类人民币份额及 A 类美元份额由原易方达纳斯达克 100 指数(QDII-LOF)变更而来，并于 2021 年 7 月 23 日起增设 C 类人民币份额及 C 类美元份额，份额首次确认日为 2021 年 7 月 26 日。易方达纳斯达克 100 指数(QDII-LOF)A 含 A 类人民币份额(份额代码:161130)及 A 类美元现汇份额(份额代码:003722)，交易代码仅列示 A 类人民币份额代码；易方达纳斯达克 100 指数(QDII-LOF)C 含 C 类人民币份额(份额代码:012870)及 C 类美元现汇份额(份额代码:012871)，交易代码仅列示 C 类人民币份额代码。

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法进行投资，即参考标的指数的成份股组成及权重构建股票投资组合，并根据标的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，力争将年化跟踪误差控制在 4% 以内，日跟踪偏离度绝对值的平均值控制在 0.35% 以内，主要投资策略包括资产配置策略、权益类品种投资策略、金融衍生品投资策略等。
业绩比较基准	纳斯达克 100 指数收益率(使用估值汇率折算) \times 95%+活期存款利率(税后) \times 5%
风险收益特征	本基金属股票指数基金，预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金主要采用组合复制策略和适当的替代性策略实现对标的指数的紧密跟踪，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金主要投资美国证券市场，需承担汇率风险以及境外市场的风险。

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		易方达基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王玉	李申
	联系电话	020-85102688	021-60637102
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		400 881 8088	021-60637111
传真		020-38798812	021-60635778
注册地址		广东省珠海市横琴新区荣粤道 188号6层	北京市西城区金融大街25号
办公地址		广州市天河区珠江新城珠江东 路30号广州银行大厦40-43楼	北京市西城区闹市口大街1号 院1号楼
邮政编码		510620	100033
法定代表人		刘晓艳	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	无	State Street Bank and Trust Company
	中文	无	道富银行
注册地址		无	One Lincoln Street, Boston, Massachusetts 02111, United States
办公地址		无	One Lincoln Street, Boston, Massachusetts 02111, United States
邮政编码		无	无

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.efunds.com.cn
基金中期报告备置地点	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州 银行大厦 43 楼

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
注册登记机构	易方达基金管理有限公司	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州 银行大厦 40-43 楼

注：本基金 A 类人民币份额的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，A 类美元份额、

C 类人民币份额、C 类美元份额的注册登记机构为易方达基金管理有限公司。

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（2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日）	
	易方达纳斯达克 100 指数（QDII-LOF）A	易方达纳斯达克 100 指数（QDII-LOF）C
本期已实现收益	-4,838,621.22	-101,575.09
本期利润	-241,632,036.03	-2,663,641.44
加权平均基金份额本期利润	-0.5964	-0.5009
本期加权平均净值利润率	-28.94%	-24.71%
本期基金份额净值增长率	-24.85%	-25.06%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)	
	易方达纳斯达克 100 指数（QDII-LOF）A	易方达纳斯达克 100 指数（QDII-LOF）C
期末可供分配利润	141,655,203.20	2,593,664.22
期末可供分配基金份额利润	0.3350	0.3275
期末基金资产净值	770,809,060.07	14,376,316.83
期末基金份额净值	1.8228	1.8155
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)	
	易方达纳斯达克 100 指数（QDII-LOF）A	易方达纳斯达克 100 指数（QDII-LOF）C
基金份额累计净值增长率	82.28%	-20.64%

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，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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.期末可供分配利润，为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。

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

易方达纳斯达克 100 指数（QDII-LOF）A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标	①—③	②—④
----	----------	------------	------------	------------	-----	-----

		②		准差④		
过去一个月	-7.80%	2.22%	-7.89%	2.26%	0.09%	-0.04%
过去三个月	-17.05%	2.16%	-17.15%	2.17%	0.10%	-0.01%
过去六个月	-24.85%	2.01%	-24.58%	2.02%	-0.27%	-0.01%
过去一年	-17.33%	1.56%	-16.93%	1.56%	-0.40%	0.00%
过去三年	40.83%	1.71%	44.51%	1.69%	-3.68%	0.02%
自基金合同生效起至今	82.28%	1.52%	90.95%	1.51%	-8.67%	0.01%

易方达纳斯达克 100 指数（QDII-LOF）C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-7.81%	2.22%	-7.89%	2.26%	0.08%	-0.04%
过去三个月	-17.14%	2.16%	-17.15%	2.17%	0.01%	-0.01%
过去六个月	-25.06%	2.01%	-24.58%	2.02%	-0.48%	-0.01%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-20.64%	1.61%	-19.90%	1.60%	-0.74%	0.01%

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

易方达纳斯达克 100 指数证券投资基金（LOF）

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

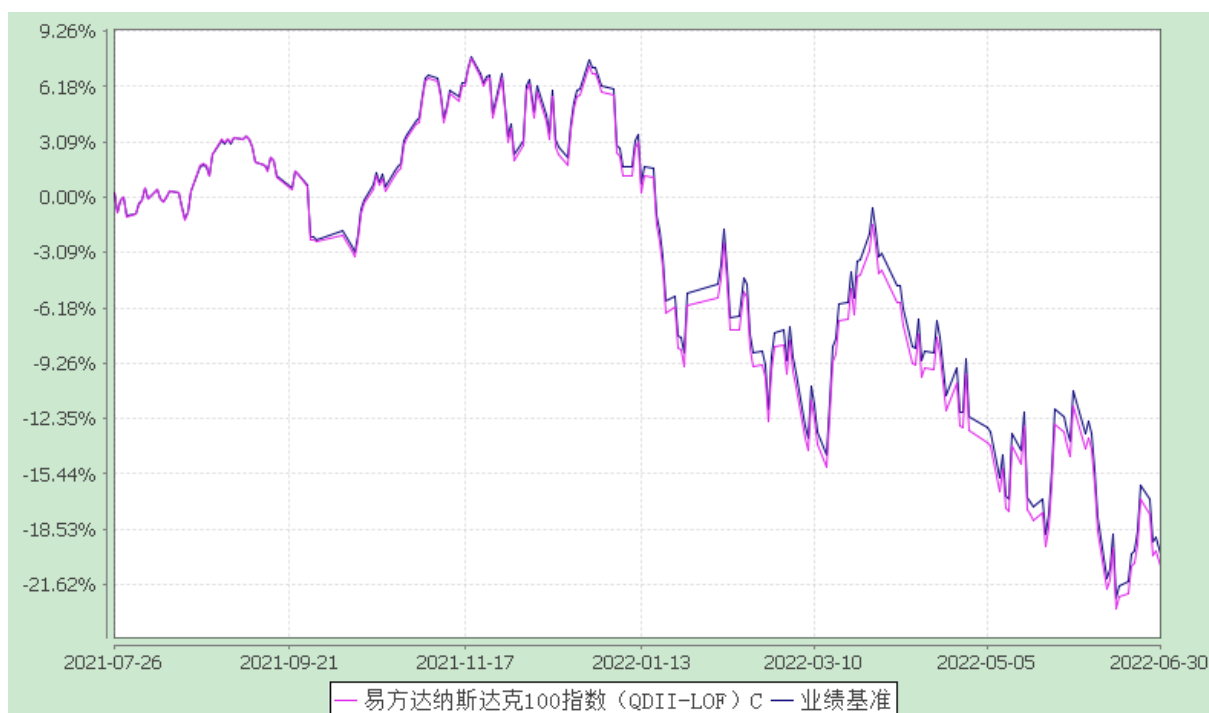
易方达纳斯达克 100 指数（QDII-LOF）A

（2017 年 6 月 23 日至 2022 年 6 月 30 日）



易方达纳斯达克 100 指数 (QDII-LOF) C

(2021 年 7 月 26 日至 2022 年 6 月 30 日)



注：1.自 2021 年 7 月 23 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2021 年 7 月 26 日，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

2.本基金的业绩比较基准已经转换为以人民币计价。

3.自基金合同生效至报告期末，A 类基金份额净值增长率为 82.28%，同期业绩比较基准收益率为 90.95%；C 类基金份额净值增长率为-20.64%，同期业绩比较基准收益率为-19.90%。

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

经中国证监会证监基金字[2001]4 号文批准，本基金管理人成立于 2001 年 4 月 17 日，注册资本 13,244.2 万元人民币。本基金管理人拥有公募、社保、年金、特定客户资产管理、QDII、基本养老保险基金投资等业务资格，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、多资产投资、海外投资、FOF 投资、另类投资等领域全面布局，为境内外客户提供资产管理解决方案。

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		
FAN BING (范 冰)	本基金的基金经理， 易方达黄金 ETF 联接、易方达黄金 ETF、 易方达标普 500 指数 (QDII-LOF)、易方 达标普信息科技指数 (QDII-LOF)、易方 达原油 (QDII-LOF-FOF)、 易方达中证海外中国 互联网 50 (QDII-ETF)、易方 达 MSCI 中国 A 股国 际通 ETF、易方达中 证海外中国互联网 50ETF 联接 (QDII)、 易方达 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 联接 发起式、易方达日兴 资管日经 225ETF (QDII)、易方达中 证香港证券投资主题 ETF、易方达恒生科 技 ETF (QDII)、易 方达中证龙头企业指 数、易方达恒生港股	2017-06-27	-	17 年	新加坡籍，硕士研究生， 具有基金从业资格。曾任 皇家加拿大银行托管部 核算专员，美国道富集团 中台交易支持专员，巴克 莱资产管理公司悉尼金 融数据部高级金融数据 分析员、悉尼金融数据部 主管、新加坡金融数据部 主管，贝莱德集团金融数 据运营部部门经理、风险 控制与咨询部客户经理、 亚太股票指数基金部基 金经理，易方达基金管理 有限公司易方达标普消 费品指数增强 (QDII)、 易方达标普医疗保健指 数 (QDII-LOF)、易方达 标普生物科技指数 (QDII-LOF) 的基金经 理。

	通新经济 ETF、易方达中证港股通消费主题 ETF 的基金经理，指数投资决策委员会委员，易方达资产管理（香港）有限公司国际指数部部门总监、投资决策委员会委员、基金经理				
--	---	--	--	--	--

注：1.对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理/基金经理助理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

3.为加强基金流动性管理，本基金安排了相关人员协助基金经理进行现金头寸与流动性管理。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金未聘请境外投资顾问。

4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，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。在本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人努力通过建立有纪律、规范化的投资研究、决策流程和交易流程，以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人制定了相应的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等，通过投资交易系统内的公平交易模块，同时依据境外市场的交易特点规范交易委托方式，以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的

单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 22 次，其中 14 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，8 次为不同基金经理管理的基金因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪纳斯达克 100 指数，该指数由在纳斯达克交易所上市的、总市值最大的 100 只非金融行业股票构成，并根据流通市值赋予指数权重，是美股科技成长类公司的代表性指数。报告期内本基金主要采用完全复制法进行投资，即主要按照标的指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据指数成份股组成及其权重的变动而进行相应调整。

2022 年上半年，欧洲地缘政治风险延续导致关键商品出现供应链挑战，原油价格高位运行，美国劳动力成本上涨，通胀水平居高不下。美国经济的景气程度从去年的高点回落，财政政策的支持力度边际减弱。在此背景下美联储加快了货币紧缩节奏，在 3 月议息会议上启动加息进程，在 5 月议息会议上加息 50 个基点，在 6 月议息会议上再次加息 75 个基点，并开启缩表。通胀水平上行和金融条件收紧对需求形成冲击，美国经济增长和企业盈利增速放缓，引发投资者对于美国经济衰退风险的担忧，金融市场的避险情绪提升，对美股尤其是科技成长类公司的估值形成压制。纳斯达克 100 指数在报告期内显著下行。

本报告期为本基金的正常运作期，本基金在投资运作过程中严格遵守基金合同，坚持既定的指数化投资策略，在指数权重调整和基金申赎变动时，应用指数复制和数量化技术降低冲击成本和减少跟踪误差，力求跟踪误差最小化。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 类基金份额净值为 1.8228 元，本报告期份额净值增长率为-24.85%，同期业绩比较基准收益率为-24.58%；C 类基金份额净值为 1.8155 元，本报告期份额净值增长率为-25.06%，同期业绩比较基准收益率为-24.58%，年化跟踪误差 0.49%，各项指标均在合同规定的目标控制范围之内。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2022 年下半年，美国经济增长预期下行，通胀压力恐怕难以快速回落，美联储仍然处于加速收紧货币政策的阶段，高通胀及加息环境下市场风险偏好可能继续收敛，并加剧股价的波动。短

期来看，需要关注美联储货币政策企稳和转向的迹象，以及市场对于美股科技成长类公司的悲观预期是否触底。中长期来看，需要关注在面临经济衰退风险和通胀水平高企的环境下，纳斯达克上市公司的盈利是否有韧性及利润率水平是否能够达到市场预期。

作为被动型投资基金，本基金将坚持既定的指数化投资策略，以严格控制基金相对目标指数的跟踪偏离为投资目标，追求跟踪误差的最小化，为看好美股纳斯达克市场投资机遇的投资者提供质地优良的指数投资工具。

4.7 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、中国证券投资基金业协会相关指引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，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、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直接的重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

易方达纳斯达克 100 指数（QDII-LOF）A:本报告期内未实施利润分配。

易方达纳斯达克 100 指数（QDII-LOF）C:本报告期内未实施利润分配。

4.9 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

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、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：易方达纳斯达克 100 指数证券投资基金（LOF）

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	98,844,953.38	62,146,713.29
结算备付金		3,076,109.79	13,133,533.96
存出保证金		4,651,000.20	1,144,565.66
交易性金融资产	6.4.7.2	679,386,146.08	904,351,478.25
其中：股票投资		679,386,146.08	904,351,478.25
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		112,042.14	199,116.57

应收申购款		3,459,836.62	3,082,661.24
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	2,268.90
资产总计		789,530,088.21	984,060,337.87
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 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		-	-
应付赎回款		2,942,978.05	8,822,790.82
应付管理人报酬		518,492.49	662,470.17
应付托管费		162,028.86	207,021.95
应付销售服务费		3,728.37	1,820.12
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	83,705.44
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	717,483.54	476,716.99
负债合计		4,344,711.31	10,254,525.49
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	430,782,094.93	401,456,800.61
未分配利润	6.4.7.8	354,403,281.97	572,349,011.77
净资产合计		785,185,376.90	973,805,812.38
负债和净资产总计		789,530,088.21	984,060,337.87

注：1.报告截止日 2022 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.8228 元，C 类基金份额净值 1.8155 元；基金份额总额 430,782,094.93 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 422,863,259.02 份，C 类基金份额总额 7,918,835.91 份。

2.上表中以下比较数据已根据本年《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>》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

6.2 利润表

会计主体：易方达纳斯达克 100 指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-239,494,101.21	98,858,556.90
1.利息收入		44,737.28	101,126.14
其中：存款利息收入	6.4.7.9	44,737.28	101,126.14
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）		-3,139,048.57	21,058,142.63
其中：股票投资收益	6.4.7.10	3,668,432.44	16,432,003.58
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-9,706,975.21	2,003,988.70
股利收益	6.4.7.15	2,899,494.20	2,622,150.35
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-239,355,481.16	77,578,562.00
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		2,799,116.53	-455,496.79
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	156,574.71	576,222.92
减：二、营业总支出		4,801,576.26	4,920,407.17
1. 管理人报酬		3,368,957.73	3,439,463.20
2. 托管费		1,052,799.23	1,074,832.25
3. 销售服务费		18,547.37	-
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	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		-	7,214.37
8. 其他费用	6.4.7.19	361,271.93	398,897.35
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-244,295,677.47	93,938,149.73
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-244,295,677.47	93,938,149.73
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-244,295,677.47	93,938,149.73

注：上表中以下比较数据已根据本年《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》中的利润表格式的要求进行列示：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：易方达纳斯达克 100 指数证券投资基金 (LOF)

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	401,456,800.61	-	572,349,011.77	973,805,812.38
二、本期期初净资产（基金净值）	401,456,800.61	-	572,349,011.77	973,805,812.38
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	29,325,294.32	-	-217,945,729.80	-188,620,435.48
（一）、综合收益总额	-	-	-244,295,677.47	-244,295,677.47
（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）	29,325,294.32	-	26,349,947.67	55,675,241.99
其中：1.基金申购款	106,921,628.27	-	111,598,645.35	218,520,273.62
2.基金赎回款	-77,596,333.95	-	-85,248,697.68	-162,845,031.63
（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）	430,782,094.93	-	354,403,281.97	785,185,376.90
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	370,763,013.25	-	365,115,467.54	735,878,480.79

产 (基金净值)				9
二、本期期初净资产 (基金净值)	370,763,013.25	-	365,115,467.54	735,878,480.79
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	62,072,489.85	-	156,456,690.35	218,529,180.20
(一)、综合收益总额	-	-	93,938,149.73	93,938,149.73
(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)	62,072,489.85	-	62,518,540.62	124,591,030.47
其中: 1.基金申购款	281,805,726.69	-	292,129,135.39	573,934,862.08
2.基金赎回款	-219,733,236.84	-	-229,610,594.77	-449,343,831.61
(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)	432,835,503.10	-	521,572,157.89	954,407,660.99

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: 刘晓艳, 主管会计工作负责人: 陈荣, 会计机构负责人: 王永铿

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

易方达纳斯达克 100 指数证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]2420 号《关于准予易方达纳斯达克 100 指数证券投资基金(LOF)注册的批复》,由易方达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《易方达纳斯达克 100 指数证券投资基金(LOF)基金合同》公开募集。经向中国证监会备案,《易方达纳斯达克 100 指数证券投资基金(LOF)基金合同》于 2017 年 6 月 23 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 333,099,865.38 份基金份额,其中认购资金利息折合 51,429.79 份基金份额。本基金为契约型、上市开放式基金,存续期限不定。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司,基金

托管人为中国建设银行股份有限公司，境外资产托管人为道富银行。自 2021 年 7 月 23 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2021 年 7 月 26 日。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《易方达纳斯达克 100 指数证券投资基金（LOF）基金合同》和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本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

除下述变更后的会计政策外，本基金报告期所采用的其他会计政策、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。

6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资、资产支持证券投资 and 基金投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

（2）金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

（3）衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发

生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.3 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值

变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.4 费用的确认和计量

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

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

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)，财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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>》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

(a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息、应收股利和应收申购款，金额分别为 62,146,713.29 元、13,133,533.96 元、1,144,565.66 元、2,268.90 元、199,116.57 元和 3,082,661.24 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息、应收股利和应收申购款，金额分别为 62,148,982.19 元、13,133,533.96 元、1,144,565.66 元、0.00 元、199,116.57 元和 3,082,661.24 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 904,351,478.25 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 904,351,478.25 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费和其他负债-其他应付款，金额分别为 8,822,790.82 元、662,470.17 元、207,021.95 元、1,820.12 元和 257,716.99 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费和其他负债-其他应付款，金额分别为 8,822,790.82 元、662,470.17 元、207,021.95 元、1,820.12 元和 257,716.99 元。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b)修订后的《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>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《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>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

6.4.5.2 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

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[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]12 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。对资管产品在 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，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(4) 基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 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 2022 年 6 月 30 日
活期存款	98,844,953.38
等于：本金	98,837,670.68
加：应计利息	7,282.70
定期存款	-

等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	98,844,953.38

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	654,305,209.54	-	679,386,146.08	25,080,936.54
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	654,305,209.54	-	679,386,146.08	25,080,936.54

注：“股票”包括普通股、存托凭证和优先股等。

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 2022 年 6 月 30 日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	

利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	54,310,140.20	-	-	-
NQU2	54,310,140.20	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	54,310,140.20	-	-	-

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
NQU2	NASDAQ 100 E-MINI Sep22	35	54,165,360.41	-144,779.79
合计	-	-	-	-144,779.79
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	-144,779.79
净额	-	-	-	-

注：1. 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。

2. 买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

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

本基金本报告期末无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 2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	7,319.97
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-

银行间市场	
应付利息	
预提费用	228,600.00
其他应付款	481,563.57
合计	717,483.54

6.4.7.7 实收基金

易方达纳斯达克 100 指数（QDII-LOF）A

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	398,638,099.84	398,638,099.84
本期申购	99,022,931.77	99,022,931.77
本期赎回（以“-”号填列）	-74,797,772.59	-74,797,772.59
本期末	422,863,259.02	422,863,259.02

易方达纳斯达克 100 指数（QDII-LOF）C

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,818,700.77	2,818,700.77
本期申购	7,898,696.50	7,898,696.50
本期赎回（以“-”号填列）	-2,798,561.36	-2,798,561.36
本期末	7,918,835.91	7,918,835.91

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

易方达纳斯达克 100 指数（QDII-LOF）A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	138,089,969.04	430,249,564.59	568,339,533.63
本期利润	-4,838,621.22	-236,793,414.81	-241,632,036.03
本期基金份额交易产生的变动数	8,403,855.38	12,834,448.07	21,238,303.45

其中：基金申购款	34,054,130.84	69,412,151.88	103,466,282.72
基金赎回款	-25,650,275.46	-56,577,703.81	-82,227,979.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	141,655,203.20	206,290,597.85	347,945,801.05

单位：人民币元

易方达纳斯达克 100 指数 (QDII-LOF) C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	965,910.50	3,043,567.64	4,009,478.14
本期利润	-101,575.09	-2,562,066.35	-2,663,641.44
本期基金份额交易产生的变动数	1,729,328.81	3,382,315.41	5,111,644.22
其中：基金申购款	2,670,363.42	5,461,999.21	8,132,362.63
基金赎回款	-941,034.61	-2,079,683.80	-3,020,718.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,593,664.22	3,863,816.70	6,457,480.92

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	44,045.92
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	691.36
合计	44,737.28

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
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	3,668,432.44
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	3,668,432.44

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
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

卖出股票成交总额	18,434,563.38
减：卖出股票成本总额	14,763,519.45
减：交易费用	2,611.49
买卖股票差价收入	3,668,432.44

6.4.7.11 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.12 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
期货投资收益	-9,706,975.21
合计	-9,706,975.21

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,899,494.20
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,899,494.20

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
1.交易性金融资产	-238,841,154.33
——股票投资	-238,841,154.33
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-

——其他	-
2.衍生工具	-514,326.83
——权证投资	-
——期货投资	-514,326.83
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	-239,355,481.16

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	156,574.71
合计	156,574.71

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
审计费用	49,092.63
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
上市费	-
指数使用费	252,671.93
合计	361,271.93

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，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	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	基金托管人、基金销售机构
道富银行	境外资产托管人

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未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

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未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

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 2022年1月1日至2022年6月 30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6 月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,368,957.73	3,439,463.20
其中：支付销售机构的客户维护费	994,894.48	968,088.07

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.80% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

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	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年6月30日	2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,052,799.23	1,074,832.25

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2022年1月1日至2022年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达纳斯达克 100 指数 (QDII-LOF) A	易方达纳斯达克 100 指数 (QDII-LOF) C	合计
易方达基金管理有限公司	-	5,355.46	5,355.46
合计	-	5,355.46	5,355.46
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2021年1月1日至2021年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达纳斯达克100指数 (QDII-LOF) A	易方达纳斯达克100指数 (QDII-LOF) C	合计
合计	-	-	-

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.35%，按前一日 C 类基金资产净值的 0.35% 年费率计提。销售服务费计算方法如下：

$$H = E \times 0.35\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，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，由基金管理人代收，基金管理人收到后支付给基金销售机构。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

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内和上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

易方达纳斯达克 100 指数（QDII-LOF）A

无。

易方达纳斯达克 100 指数（QDII-LOF）C

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	
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		2021 年 1 月 1 日至 2021 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
道富银行-活期存款	33,996,687.37	4,646.81	55,616,310.10	-
中国建设银行-活期存款	64,848,266.01	39,399.11	26,602,257.19	97,745.07

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司和道富银行保管，按银行同业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

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

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

无。

6.4.11 利润分配情况

易方达纳斯达克 100 指数（QDII-LOF）A

本报告期内未发生利润分配。

易方达纳斯达克 100 指数（QDII-LOF）C

本报告期内未发生利润分配。

6.4.12 期末（2022 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

截至本报告期末 2022 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人按照“自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工”的思路，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。从投资决策的层次看，投资决策委员会、投资总监、基金投资部门总经理和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控，

并根据其不同权限实施风险控制；从岗位职能的分工上看，基金经理、监察合规管理部门、集中交易部门、核算部以及投资风险管理部从不同角度、不同环节对投资的全过程实行风险监控和管理；从投资管理的流程看，已经形成了一套贯穿“事前的风险定位、事中的风险管理和事后的风险评估”的健全的风险监控体系。

本基金属股票指数基金，预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金主要采用组合复制策略和适当的替代性策略实现对标的指数的紧密跟踪，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金主要投资美国证券市场，需承担汇率风险以及境外市场的风险。日常经营活动中本基金面临的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险，本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指包括债券发行人出现拒绝支付利息或到期时拒绝支付本息的违约风险，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下跌的风险，及因交易对手违约而产生的交割风险。本基金在境内交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险；在境外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，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。于 2022 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.00%(2021 年 12 月 31 日：0.00%)。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的短期融资券。

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债和央票。

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指包括因市场交易量不足，导致基金管理人不能以合理价格及时进行证券交易的风险，或投资组合无法应付客户赎回要求所引起的违约风险。本基金采用分散投资、控制流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时公司已经建立全覆盖、多维度以压力测试为核心的开放式基金流动性风险监测与预警制度，投资风险管理部独立于投资部门负责流动性压力测试的实施与评估。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人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 2022 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约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按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《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组合的流动性指标进行持续的监测和分析。

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。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在流动性良好的证券交易所或者银行间同业市场交易，期末除本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中所列示券种流通

暂时受限制不能自由转让外，其余均能及时变现。评估结果显示组合高流动性资产比重较高，组合变现比例能力较好。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指因受各种因素影响而引起的基金所持证券及其衍生品市场价格不利波动，使基金资产面临损失的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。本基金可投资境外市场，影响金融市场波动的因素比较复杂，包括经济发展、政策变化、资金供求、公司盈利的变化、利率汇率波动等。此外，境外证券市场的每日证券交易价格无涨跌幅限制或涨跌幅空间大于国内市场，这一因素可能会带来市场的急剧下跌，从而导致投资风险增加。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。投资管理人通过久期、凸度、VAR 等方法评估组合面临的利率风险敞口，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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022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	98,844,953.38	-	-	-	98,844,953.38
结算备付金	3,076,109.79	-	-	-	3,076,109.79
存出保证金	4,651,000.20	-	-	-	4,651,000.20
交易性金融资产	-	-	-	679,386,146.08	679,386,146.08
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	112,042.14	112,042.14
应收申购款	309,027.81	-	-	3,150,808.81	3,459,836.62
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	106,881,091.18	-	-	682,648,997.03	789,530,088.21

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	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	2,942,978.05	2,942,978.05
应付管理人报酬	-	-	-	518,492.49	518,492.49
应付托管费	-	-	-	162,028.86	162,028.86
应付销售服务费	-	-	-	3,728.37	3,728.37
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	717,483.54	717,483.54
负债总计	-	-	-	4,344,711.31	4,344,711.31
利率敏感度缺口	106,881,091.18	-	-	678,304,285.72	785,185,376.90
上年度末 2021 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	62,146,713.29	-	-	-	62,146,713.29
结算备付金	13,133,533.96	-	-	-	13,133,533.96
存出保证金	1,144,565.66	-	-	-	1,144,565.66
交易性金融资产	-	-	-	904,351,478.25	904,351,478.25
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	2,268.90	2,268.90
应收股利	-	-	-	199,116.57	199,116.57
应收申购款	440,667.55	-	-	2,641,993.69	3,082,661.24
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	76,865,480.46	-	-	907,194,857.41	984,060,337.87

					7
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	-	-	-	8,822,790.82	8,822,790.82
应付管理人报酬	-	-	-	662,470.17	662,470.17
应付托管费	-	-	-	207,021.95	207,021.95
应付销售服务费	-	-	-	1,820.12	1,820.12
应付交易费用	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	83,705.44	83,705.44
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	476,716.99	476,716.99
负债总计	-	-	-	10,254,525.49	10,254,525.49
利率敏感度缺口	76,865,480.46	-	-	896,940,331.92	973,805,812.38

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本期末本基金未持有交易性债券投资(不包括可转债)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金投资于海外市场，海外市场金融品种以外币计价，如果所投资市场的货币相对于人民币贬值，将对基金收益产生不利影响；外币对人民币的汇率大幅波动也将加大基金净值波动的幅度。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日			
	美元 折合人民币	港币 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	47,357,870.08	-	-	47,357,870.08
结算备付金	3,076,109.79	-	-	3,076,109.79
存出保证金	4,651,000.20	-	-	4,651,000.20
交易性金融资产	679,386,146.08	-	-	679,386,146.08
衍生金融资产	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
应收股利	112,042.14	-	-	112,042.14
应收申购款	111,984.81	-	-	111,984.81
其他资产	-	-	-	-
资产合计	734,695,153.10	-	-	734,695,153.10
以外币计价的负债				
应付清算款	-	-	-	-
应付赎回款	68,142.66	-	-	68,142.66
其他负债	68.86	-	-	68.86
负债合计	68,211.52	-	-	68,211.52
资产负债表外汇风险敞口净额	734,626,941.58	-	-	734,626,941.58
项目	上年度末 2021年12月31日			
	美元 折合人民币	港币 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	56,162,034.91	-	-	56,162,034.91
结算备付金	13,133,533.96	-	-	13,133,533.96
存出保证金	1,144,565.66	-	-	1,144,565.66
交易性金融资产	904,351,478.25	-	-	904,351,478.25
衍生金融资产	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-

应收利息	45.91	-	-	45.91
应收股利	199,116.57	-	-	199,116.57
应收申购款	256,870.39	-	-	256,870.39
其他资产	-	-	-	-
资产合计	975,247,645.65	-	-	975,247,645.65
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	-	-	-
应付赎回款	375,384.20	-	-	375,384.20
其他负债	1,237.59	-	-	1,237.59
负债合计	376,621.79	-	-	376,621.79
资产负债表 外汇风险敞 口净额	974,871,023.86	-	-	974,871,023.86

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率外其他因素保持不变		
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 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
	假设人民币对一揽子货币平均升值5%	-36,731,347.08	-48,743,551.19
	假设人民币对一揽子货币平均贬值5%	36,731,347.08	48,743,551.19

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。

本基金的基金管理人采用 Barra 风险管理系统，通过标准差、跟踪误差、beta 值、VAR 等指标，监控投资组合面临的市场价格波动风险。

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 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 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	679,386,146.08	86.53	904,351,478.25	92.87
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	679,386,146.08	86.53	904,351,478.25	92.87

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	33,969,307.10	45,217,573.68
2.业绩比较基准下降 5%	-33,969,307.10	-45,217,573.68	

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 2022 年 6 月 30 日
第一层次	679,386,146.08
第二层次	-
第三层次	-
合计	679,386,146.08

6.4.14.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，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股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票、和债券和基金公允价值应属第二层次还是第三层次。

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

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括银行存款、买入返售金融资产、其他各类应收款项、卖出回购金融资产款和其他各类应付款项，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	679,386,146.08	86.05
	其中：普通股	667,338,076.91	84.52
	存托凭证	12,048,069.17	1.53
	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	101,921,063.17	12.91
8	其他各项资产	8,222,878.96	1.04
9	合计	789,530,088.21	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	679,386,146.08	86.53
合计	679,386,146.08	86.53

注：1.国家（地区）类别根据其所在的证券交易所确定。

2.ADR、GDR 按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

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（%）
能源	-	-
材料	-	-
工业	23,021,304.34	2.93
非必需消费品	101,764,267.98	12.96
必需消费品	45,339,198.87	5.77
保健	43,543,238.71	5.55
金融	-	-
信息技术	338,726,507.19	43.14
电信服务	117,319,245.61	14.94
公用事业	9,672,383.38	1.23
房地产	-	-
合计	679,386,146.08	86.53

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

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	-	AAPL US	纳斯达 克证券 交易所	美国	93,160	85,481,995.76	10.89
2	Microsoft Corp	-	MSFT US	纳斯达 克证券 交易所	美国	43,048	74,201,358.13	9.45
3	Alphabet Inc	-	GOOG US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,804	26,484,256.88	3.37
			GOOGL US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,731	25,317,407.91	3.22
4	Amazon.c om Inc	-	AMZN US	纳斯达 克证券 交易所	美国	58,562	41,744,035.65	5.32
5	Tesla Inc	-	TSLA US	纳斯达 克证券 交易所	美国	5,963	26,950,321.06	3.43
6	Meta Platforms Inc	-	META US	纳斯达 克证券 交易所	美国	19,768	21,393,191.53	2.72
7	NVIDIA Corp	-	NVDA US	纳斯达 克证券 交易所	美国	20,250	20,601,967.80	2.62
8	PepsiCo Inc	-	PEP US	纳斯达 克证券 交易所	美国	13,203	14,767,844.96	1.88
9	Costco Wholesale Corp	-	COST US	纳斯达 克证券 交易所	美国	4,232	13,612,819.60	1.73
10	Broadcom Inc	-	AVGO US	纳斯达 克证券 交易所	美国	3,897	12,706,033.02	1.62
11	Cisco Systems Inc	-	CSCO US	纳斯达 克证券 交易所	美国	39,589	11,329,346.29	1.44
12	Comcast Corp	-	CMCSA US	纳斯达 克证券 交易所	美国	42,692	11,243,166.00	1.43

13	Adobe Inc	-	ADBE US	纳斯达克 交易所	美国	4,512	11,084,969.18	1.41
14	T-Mobile US Inc	-	TMUS US	纳斯达克 交易所	美国	11,970	10,808,332.52	1.38
15	Intel Corp	-	INTC US	纳斯达克 交易所	美国	39,047	9,803,665.94	1.25
16	QUALCO MM Inc	-	QCOM US	纳斯达克 交易所	美国	10,696	9,169,833.07	1.17
17	Texas Instrumen ts Inc	-	TXN US	纳斯达克 交易所	美国	8,805	9,079,774.20	1.16
18	Amgen Inc	-	AMGN US	纳斯达克 交易所	美国	5,102	8,330,972.23	1.06
19	Advanced Micro Devices Inc	-	AMD US	纳斯达克 交易所	美国	15,493	7,951,329.20	1.01
20	Honeywel l Internatio nal Inc	-	HON US	纳斯达克 交易所	美国	6,500	7,582,304.82	0.97
21	Intuit Inc	-	INTU US	纳斯达克 交易所	美国	2,694	6,968,952.39	0.89
22	Automatic Data Processin g Inc	-	ADP US	纳斯达克 交易所	美国	3,989	5,623,143.54	0.72
23	Starbucks Corp	-	SBUX US	纳斯达克 交易所	美国	10,945	5,611,324.69	0.71
24	Mondelez Internatio nal Inc	-	MDLZ US	纳斯达克 交易所	美国	13,215	5,506,833.57	0.70
25	PayPal Holdings Inc	-	PYPL US	纳斯达克 交易所	美国	11,058	5,183,151.94	0.66
26	Applied Materials	-	AMAT US	纳斯达克 交易所	美国	8,308	5,072,891.15	0.65

	Inc			交易所				
27	Charter Communications Inc	-	CHTR US	纳斯达克证券交易所	美国	1,603	5,040,621.06	0.64
28	Netflix Inc	-	NFLX US	纳斯达克证券交易所	美国	4,242	4,978,506.72	0.63
29	Gilead Sciences Inc	-	GILD US	纳斯达克证券交易所	美国	11,977	4,968,438.48	0.63
30	Analog Devices Inc	-	ADI US	纳斯达克证券交易所	美国	4,964	4,867,045.27	0.62
31	Vertex Pharmaceuticals Inc	-	VRTX US	纳斯达克证券交易所	美国	2,442	4,618,323.60	0.59
32	Intuitive Surgical Inc	-	ISRG US	纳斯达克证券交易所	美国	3,427	4,616,323.54	0.59
33	Booking Holdings Inc	-	BKNG US	纳斯达克证券交易所	美国	389	4,566,148.71	0.58
34	Regeneron Pharmaceuticals Inc	-	REGN US	纳斯达克证券交易所	美国	1,031	4,090,296.49	0.52
35	CSX Corp	-	CSX US	纳斯达克证券交易所	美国	20,763	4,049,476.08	0.52
36	Micron Technology Inc	-	MU US	纳斯达克证券交易所	美国	10,654	3,952,699.97	0.50
37	Activision Blizzard Inc	-	ATVI US	纳斯达克证券交易所	美国	7,466	3,901,355.34	0.50
38	Lam Research Corp	-	LRCX US	纳斯达克证券交易所	美国	1,327	3,795,303.75	0.48
39	Fiserv Inc	-	FISV US	纳斯达克证券交易所	美国	6,173	3,685,980.14	0.47
40	Moderna Inc	-	MRNA US	纳斯达克证券交易所	美国	3,792	3,635,479.47	0.46

				交易所				
41	Keurig Dr Pepper Inc	-	KDP US	纳斯达克证券交易所	美国	13,546	3,217,397.78	0.41
42	American Electric Power Co Inc	-	AEP US	纳斯达克证券交易所	美国	4,904	3,157,644.98	0.40
43	Palo Alto Networks Inc	-	PANW US	纳斯达克证券交易所	美国	951	3,152,592.50	0.40
44	Monster Beverage Corp	-	MNST US	纳斯达克证券交易所	美国	5,058	3,146,818.41	0.40
45	KLA Corp	-	KLAC US	纳斯达克证券交易所	美国	1,426	3,053,741.23	0.39
46	Kraft Heinz Co/The	-	KHC US	纳斯达克证券交易所	美国	11,679	2,989,506.28	0.38
47	Synopsys Inc	-	SNPS US	纳斯达克证券交易所	美国	1,460	2,975,848.18	0.38
48	Fortinet Inc	-	FTNT US	纳斯达克证券交易所	美国	7,685	2,918,232.83	0.37
49	Marriott International Inc/MD	-	MAR US	纳斯达克证券交易所	美国	3,125	2,852,554.73	0.36
50	Exelon Corp	-	EXC US	纳斯达克证券交易所	美国	9,360	2,846,943.67	0.36
51	O'Reilly Automotive Inc	-	ORLY US	纳斯达克证券交易所	美国	628	2,662,716.27	0.34
52	Cadence Design Systems Inc	-	CDNS US	纳斯达克证券交易所	美国	2,638	2,656,232.12	0.34
53	Paychex Inc	-	PAYX US	纳斯达克证券交易所	美国	3,447	2,634,290.88	0.34
54	ASML	-	ASML US	纳斯达	美国	818	2,612,545.60	0.33

	Holding NV			克证券 交易所				
55	NXP Semiconductors NV	-	NXPI US	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,501	2,484,714.84	0.32
56	Xcel Energy Inc	-	XEL US	纳斯达 克证券 交易所	美国	5,201	2,469,947.95	0.31
57	AstraZeneca PLC	-	AZN US	纳斯达 克证券 交易所	美国	5,518	2,446,803.69	0.31
58	Cintas Corp	-	CTAS US	纳斯达 克证券 交易所	美国	975	2,444,236.51	0.31
59	Autodesk Inc	-	ADSK US	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,077	2,397,049.80	0.31
60	Marvell Technology Ltd	-	MRVL US	纳斯达 克证券 交易所	美国	8,115	2,370,774.87	0.30
61	CrowdStrike Holdings Inc	-	CRWD US	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,037	2,304,404.29	0.29
62	Cognizant Technology Solutions Corp	-	CTSH US	纳斯达 克证券 交易所	美国	4,976	2,253,891.07	0.29
63	Dollar Tree Inc	-	DLTR US	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,144	2,242,563.30	0.29
64	Electronic Arts Inc	-	EA US	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,673	2,182,348.96	0.28
65	Airbnb Inc	-	ABNB US	纳斯达 克证券 交易所	美国	3,650	2,182,158.02	0.28
66	Lululemon Athletica Inc	-	LULU US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,172	2,144,285.05	0.27
67	Walgreens Boots	-	WBA US	纳斯达 克证券	美国	8,248	2,097,978.27	0.27

	Alliance Inc			交易所				
68	Seagen Inc	-	SGEN US	纳斯达克证券交易所	美国	1,757	2,086,464.06	0.27
69	JD.com, Inc.	京东集团 股份有限 公司	JD US	纳斯达克证券交易所	美国	4,840	2,086,069.56	0.27
70	Microchip Technology Inc	-	MCHP US	纳斯达克证券交易所	美国	5,290	2,062,032.01	0.26
71	Baidu, Inc.	百度集团 股份有限 公司	BIDU US	纳斯达克证券交易所	美国	2,064	2,060,256.98	0.26
72	MercadoLibre Inc	-	MELI US	纳斯达克证券交易所	美国	481	2,055,933.16	0.26
73	Biogen Inc	-	BIIB US	纳斯达克证券交易所	美国	1,398	1,913,474.64	0.24
74	IDEXX Laboratories Inc	-	IDXX US	纳斯达克证券交易所	美国	808	1,901,942.57	0.24
75	DexCom Inc	-	DXCM US	纳斯达克证券交易所	美国	3,748	1,874,752.01	0.24
76	Old Dominion Freight Line Inc	-	ODFL US	纳斯达克证券交易所	美国	1,083	1,862,757.39	0.24
77	Illumina Inc	-	ILMN US	纳斯达克证券交易所	美国	1,500	1,855,970.56	0.24
78	Fastenal Co	-	FAST US	纳斯达克证券交易所	美国	5,496	1,841,341.85	0.23
79	PACCAR Inc	-	PCAR US	纳斯达克证券交易所	美国	3,320	1,834,687.36	0.23
80	Lucid Group Inc	-	LCID US	纳斯达克证券交易所	美国	15,926	1,834,159.58	0.23
81	Workday Inc	-	WDAY US	纳斯达克证券交易所	美国	1,900	1,779,876.70	0.23

				交易所				
82	Pinduoduo Inc.	拼多多	PDD US	纳斯达克证券交易所	美国	4,232	1,755,283.45	0.22
83	Verisk Analytics Inc	-	VRSK US	纳斯达克证券交易所	美国	1,508	1,751,807.75	0.22
84	Zoom Video Communications Inc	-	ZM US	纳斯达克证券交易所	美国	2,403	1,741,285.55	0.22
85	Datadog Inc	-	DDOG US	纳斯达克证券交易所	美国	2,703	1,727,740.67	0.22
86	Atlassian Corp PLC	-	TEAM US	纳斯达克证券交易所	美国	1,365	1,716,782.83	0.22
87	Copart Inc	-	CPRT US	纳斯达克证券交易所	美国	2,269	1,654,692.58	0.21
88	Ross Stores Inc	-	ROST US	纳斯达克证券交易所	美国	3,355	1,581,351.14	0.20
89	Sirius XM Holdings Inc	-	SIRI US	纳斯达克证券交易所	美国	37,608	1,547,226.29	0.20
90	eBay Inc	-	EBAY US	纳斯达克证券交易所	美国	5,347	1,495,363.61	0.19
91	Zscaler Inc	-	ZS US	纳斯达克证券交易所	美国	1,347	1,351,608.64	0.17
92	ANSYS Inc	-	ANSS US	纳斯达克证券交易所	美国	829	1,331,349.88	0.17
93	Match Group Inc	-	MTCH US	纳斯达克证券交易所	美国	2,727	1,275,465.53	0.16
94	Align Technology Inc	-	ALGN US	纳斯达克证券交易所	美国	758	1,203,997.37	0.15
95	Constellation	-	CEG US	纳斯达克证券交易所	美国	3,117	1,197,846.78	0.15

	Energy Corporation			交易所				
96	VeriSign Inc	-	VRSN US	纳斯达克证券交易所	美国	1,045	1,173,554.40	0.15
97	NetEase, Inc	网易公司	NTES US	纳斯达克证券交易所	美国	1,735	1,087,109.89	0.14
98	Skyworks Solutions Inc	-	SWKS US	纳斯达克证券交易所	美国	1,526	948,781.49	0.12
99	Splunk Inc	-	SPLK US	纳斯达克证券交易所	美国	1,536	911,908.52	0.12
100	Okta Inc	-	OKTA US	纳斯达克证券交易所	美国	1,439	873,056.50	0.11
101	DocuSign Inc	-	DOCU US	纳斯达克证券交易所	美国	1,908	734,771.05	0.09

注：此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	Microsoft Corp	MSFT US	4,276,345.00	0.44
2	Tesla Inc	TSLA US	2,580,344.31	0.26
3	Alphabet Inc	GOOGL US	1,352,167.34	0.14
		GOOG US	1,181,703.74	0.12
4	AstraZeneca PLC	AZN US	2,124,930.77	0.22
5	Old Dominion Freight Line Inc	ODFL US	2,093,916.08	0.22
6	Apple Inc	AAPL US	2,023,826.98	0.21
7	NVIDIA Corp	NVDA US	1,507,553.29	0.15
8	Amazon.com Inc	AMZN US	1,396,885.99	0.14
9	Broadcom Inc	AVGO US	882,760.98	0.09
10	Costco Wholesale Corp	COST US	634,425.52	0.07
11	Intel Corp	INTC US	547,153.92	0.06

12	Texas Instruments Inc	TXN US	487,989.08	0.05
13	QUALCOMM Inc	QCOM US	447,249.92	0.05
14	Automatic Data Processing Inc	ADP US	442,137.85	0.05
15	Airbnb Inc	ABNB US	365,215.54	0.04
16	Adobe Inc	ADBE US	238,977.97	0.02
17	Applied Materials Inc	AMAT US	235,394.97	0.02
18	Micron Technology Inc	MU US	224,631.43	0.02
19	PepsiCo Inc	PEP US	208,294.09	0.02
20	Booking Holdings Inc	BKNG US	208,000.07	0.02

注：1. 买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

2. 此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

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	Microsoft Corp	MSFT US	3,384,694.13	0.35
2	Alphabet Inc	GOOG US	1,068,697.86	0.11
		GOOGL US	883,072.25	0.09
3	Apple Inc	AAPL US	1,692,525.77	0.17
4	Tesla Inc	TSLA US	1,029,980.31	0.11
5	NVIDIA Corp	NVDA US	941,608.57	0.10
6	JD.com, Inc.	JD US	901,109.89	0.09
7	Broadcom Inc	AVGO US	680,579.31	0.07
8	NetEase, Inc	NTES US	545,281.71	0.06
9	Peloton Interactive Inc	PTON US	442,155.63	0.05
10	Automatic Data Processing Inc	ADP US	424,365.92	0.04
11	Meta Platforms Inc	META US	414,234.85	0.04
12	Texas Instruments Inc	TXN US	376,713.45	0.04
13	Applied Materials Inc	AMAT US	355,161.64	0.04
14	Costco Wholesale Corp	COST US	339,472.22	0.03
15	Amazon.com Inc	AMZN US	336,319.15	0.03
16	Amgen Inc	AMGN US	320,446.59	0.03
17	Analog Devices Inc	ADI US	285,978.35	0.03
18	Intel Corp	INTC US	282,927.42	0.03
19	QUALCOMM Inc	QCOM US	276,481.70	0.03
20	Charter Communications Inc	CHTR US	275,056.27	0.03

注：1. 卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

2. 此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

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	27,164,692.44
卖出收入（成交）总额	18,434,563.38

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

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

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 Sep22	-	-

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-144,779.79 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 本基金投资的前十名证券的发行主体中，META（Facebook）在报告编制日前一年内曾受到法
第 55 页，共 63 页

国监管机构国家信息与自由委员会、意大利竞争与市场管理局部门、英国竞争与市场管理局和俄罗斯法院的处罚。META（Facebook）在本报告期内受到英国竞争与市场管理局和俄罗斯联邦侦查委员会的调查。谷歌在报告编制日前一年内曾受到西班牙数据保护局、俄罗斯联邦法警局、法国国家信息自由委员会、法国巴黎商业法院、俄罗斯莫斯科法院、韩国公平贸易委员会和法国竞争管理局的处罚。谷歌在本报告期内受到英国竞争主管机关竞争与市场委员会调查。苹果在报告编制日前一年内曾受到意大利监管机构和荷兰消费者和市场监管局的处罚。苹果在本报告期内受到英国竞争和市场管理局和欧盟委员会调查。特斯拉在报告编制日前一年内曾受到美国环保署的处罚。特斯拉在本报告期内受到德国联邦汽车运输管理局的调查。亚马逊在报告编制日前一年内曾受到卢森堡数据保护委员会、美国华盛顿州总检察长办公室和意大利反垄断机构的处罚。亚马逊在本报告期内受到美国证监会和美国联邦贸易委员会调查。

本基金为指数型基金，上述主体所发行的证券系标的指数成份股，上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.11.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

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	4,651,000.20
2	应收清算款	-
3	应收股利	112,042.14
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,459,836.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,222,878.96

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

本基金本报告期末前十名股票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

份额级别	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
易方达纳斯达克 100 指数 (QDII-LOF) A	88,950	4,753.94	11,329,467.29	2.68%	411,533,791.73	97.32%
易方达纳斯达克 100 指数 (QDII-LOF) C	5,590	1,416.61	0.00	0.00%	7,918,835.91	100.00%
合计	94,540	4,556.61	11,329,467.29	2.63%	419,452,627.64	97.37%

注：易方达纳斯达克 100 指数（QDII-LOF）A 包含 A 类人民币份额及 A 类美元份额；易方达纳斯达克 100 指数（QDII-LOF）C 包含 C 类人民币份额及 C 类美元份额。下同。

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	上海威海储运中心	3,983,442.00	5.83%
2	常州投资集团有限公司	3,370,655.00	4.93%
3	张艳	1,725,234.00	2.52%
4	罗干	1,361,102.00	1.99%
5	贾巧丽	900,000.00	1.32%
6	孙文立	806,498.00	1.18%
7	黄玉光	742,988.00	1.09%
8	潘震宇	700,000.00	1.02%
9	刘翠玲	667,400.00	0.98%

10	袁达能	617,400.00	0.90%
----	-----	------------	-------

注：本表统计的上市基金前十名持有人均为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	易方达纳斯达克 100 指数 (QDII-LOF) A	647,365.98	0.1531%
	易方达纳斯达克 100 指数 (QDII-LOF) C	282.65	0.0036%
	合计	647,648.63	0.1503%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	易方达纳斯达克 100 指数 (QDII-LOF) A	0~10
	易方达纳斯达克 100 指数 (QDII-LOF) C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	易方达纳斯达克 100 指数 (QDII-LOF) A	0
	易方达纳斯达克 100 指数 (QDII-LOF) C	0
	合计	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达纳斯达克 100 指数 (QDII-LOF) A	易方达纳斯达克 100 指数 (QDII-LOF) C
基金合同生效日 (2017 年 6 月 23 日) 基金份额总额	333,099,865.38	-
本报告期期初基金份额总额	398,638,099.84	2,818,700.77
本报告期基金总申购份额	99,022,931.77	7,898,696.50
减：本报告期基金总赎回份额	74,797,772.59	2,798,561.36
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	422,863,259.02	7,918,835.91

注：易方达纳斯达克 100 指数 (QDII-LOF) A 份额变动含 A 类人民币份额及 A 类美元份额；易方达纳斯达克 100 指数 (QDII-LOF) C 份额变动含 C 类人民币份额及 C 类美元份额。

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

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

本基金管理人于 2022 年 4 月 21 日发布公告，自 2022 年 4 月 21 日起聘任刘世军先生为副总经理级高级管理人员（首席数据与风险监测官）；本基金管理人于 2022 年 5 月 13 日发布公告，自 2022 年 5 月 11 日起张南女士不再担任督察长和信息披露负责人，公司聘任其为副总经理级高级管理人员；自 2022 年 5 月 11 日起聘任王玉女士为督察长，并担任信息披露负责人。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

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，基金管理人和托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
Citigroup Global Markets Limited	1	44,124,230.34	100.00%	2,485.10	100.00%	-
Goldman Sachs	1	-	-	-	-	-

State Street Securities Hong Kong Limited	1	-	-	-	-	-
---	---	---	---	---	---	---

注：a) 本报告期内本基金无新增交易账户，如下证券经营机构 GF Futures (Hong Kong) Co. Ltd. 的期货账户不再列示。

b) 本基金管理人负责选择证券经营机构，并在该机构开立交易账户。基金交易账户的开立标准如下：

1) 交易执行能力。主要指证券经营机构能否对投资指令进行有效地执行，以及能否取得较高质量的成交结果；

2) 研究报告质量。主要指证券经营机构能否提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专题研究报告等；

3) 提供研究服务的质量。主要包括协助安排上市公司调研、研究资料共享、路演服务、日常沟通交流、接受委托研究的服务质量等方面；

4) 法规监管资讯服务。主要包括境外投资法律规定、交易监管规则、信息披露、个人利益冲突、税收等资讯的提供与培训；

5) 价值贡献。主要是指证券经营机构对公司研究团队、投资团队在业务能力提升上所做的培训服务、对公司投资提升所作出的贡献；

6) 其他因素。主要是证券经营机构的财务状况、经营行为规范、风险管理机制、近年内有无重大违规行为等。

c) 基金交易账户的选择程序如下：

1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易账户的证券经营机构。

2) 基金管理人与所选定的证券经营机构办理开立交易账户事宜。

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		债券回购交易		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	占当期债券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
Citigroup Global	-	-	-	-	-	-	-	-

Mark ets Limit ed								
Gold man Sachs	-	-	-	-	-	-	-	-
State Street Secur ities Hong Kong 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	易方达基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-01-01
2	易方达基金管理有限公司关于公司住所变更的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-01-07
3	易方达纳斯达克 100 指数证券投资基金 (LOF) 2022 年 1 月 17 日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-01-12
4	易方达纳斯达克 100 指数证券投资基金 (LOF) 恢复大额申购业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-01-19
5	易方达基金管理有限公司旗下基金 2021 年第 4 季度报告提示性公告	上海证券报	2022-01-21
6	易方达纳斯达克 100 指数证券投资基金 (LOF) 2022 年 2 月 21 日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-02-16
7	易方达纳斯达克 100 指数证券投资基金 (LOF) 暂停大额申购业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-03-09
8	易方达基金管理有限公司旗下基金 2021 年年度报告提示性公告	上海证券报	2022-03-30
9	易方达基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金	2022-04-11

		电子披露网站	
10	易方达纳斯达克 100 指数证券投资基金（LOF）2022 年 4 月 15 日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-04-12
11	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-04-21
12	易方达基金管理有限公司旗下基金 2022 年第 1 季度报告提示性公告	上海证券报	2022-04-22
13	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-05-13
14	易方达基金管理有限公司关于子公司住所变更的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-05-14
15	易方达纳斯达克 100 指数证券投资基金（LOF）2022 年 5 月 30 日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-05-25
16	易方达纳斯达克 100 指数证券投资基金（LOF）2022 年 6 月 20 日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-06-15
17	关于易方达纳斯达克 100 指数证券投资基金（LOF）2022 年下半年境外主要市场节假日暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-06-27
18	关于旗下部分基金 2022 年 7 月 4 日因境外主要市场节假日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的提示性公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-06-28

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予易方达纳斯达克 100 指数证券投资基金（LOF）注册的文件；
2. 《易方达纳斯达克 100 指数证券投资基金（LOF）基金合同》；
3. 《易方达纳斯达克 100 指数证券投资基金（LOF）托管协议》；
4. 《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
5. 基金管理人业务资格批件和营业执照。

11.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

11.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇二二年八月三十日