招商纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金（QDII）2023年中期报告

2023年06月30日

基金管理人：招商基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2023年8月30日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年8月29日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2023年4月12日（基金合同生效日）起至6月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 1
1.1 重要提示 1
1.2 目录 2
§2 基金简介 4
2.1 基金基本情况 4
2.2 基金产品说明 4
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 5
2.5 信息披露方式 5
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 6
§4 管理人报告 7
4.1 基金管理人及基金经理情况 7
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 9
4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 9
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 9
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 10
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 10
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 10
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 11
4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明 11
§5 托管人报告 11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 12
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 12
6.1 资产负债表 12
6.2 利润表 13
6.3 净资产（基金净值）变动表 15
6.4 报表附注 16
§7 投资组合报告 38
7.1 期末基金资产组合情况 38
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布 39
7.3 期末按行业分类的权益投资组合 39
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细 40
7.5 报告期内股票投资组合的重大变动 50
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合 53
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 53
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 53

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..... 53
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..... 53
7.11 投资组合报告附注..... 53
§8 基金份额持有人信息..... 54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... 54
8.2 期末上市基金前十名持有人..... 54
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... 55
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情况..... 55
§9 开放式基金份额变动..... 55
§10 重大事件揭示..... 55
10.1 基金份额持有人大会决议..... 55
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..... 56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... 56
10.4 基金投资策略的改变..... 56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... 56
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..... 56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... 56
10.8 其他重大事件..... 60
§11 影响投资者决策的其他重要信息..... 62
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况..... 62
§12 备查文件目录..... 63
12.1 备查文件目录..... 63
12.2 存放地点..... 63
12.3 查阅方式..... 63

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	招商纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）
基金简称	招商纳斯达克 100ETF（QDII）
场内简称	纳斯达克 100ETF
基金主代码	159659
交易代码	159659
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 4 月 12 日
基金管理人	招商基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	55,744,064.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2023 年 4 月 25 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份券组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份券及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情形导致基金无法完全投资于标的指数成份券时，基金管理人可采取包括成份券替代策略在内的其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的。特殊情形包括但不限于：（1）法律法规的限制；（2）标的指数成份券流动性严重不足；（3）标的指数的成份券长期停牌；（4）标的指数成份券进行配股或增发；（5）标的指数成份券派发现金股息；（6）标的指数编制方法发生变化；（7）其他可能严重限制本基金跟踪标的指数的合理原因等。 本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35%以内，年化跟踪误差控制在 4%以内。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。 对于出现市场流动性不足、因法律法规原因个别成份券被限制投资等情况，导致本基金无法获得足够数量的成份券时，基金管理人将通过投资成份券、备选成份券、非成份券、成份券衍生品等进行替代，运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近标的指数的表现。 本基金其他主要投资策略包括：债券投资策略、资产支持证券投资策略、衍生品投资策略、存托凭证投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略。

业绩比较基准	纳斯达克 100 指数(Nasdaq-100 Index)收益率(经汇率调整后的总收益指数收益率)
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金。 本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要采用完全复制策略跟踪标的指数的表现，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。 本基金可以投资境外市场。本基金除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，还面临因投资境外市场所带来的汇率风险等特有风险。

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		招商基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	潘西里	许俊
	联系电话	0755－83196666	010-66596688
	电子邮箱	cmf@cmfchina.com	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		400-887-9555	95566
传真		0755－83196475	010－66594942
注册地址		深圳市福田区深南大道 7088 号	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		深圳市福田区深南大道 7088 号	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		518040	100818
法定代表人		王小青	葛海蛟

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	中文	-	摩根大通银行
	英文	-	JPMorgan Chase Bank, National Association
注册地址		-	1111 Polaris Parkway, Columbus, OH 43240, U.S.A.
办公地址		-	270 Park Avenue, New York, New York 10017
邮政编码		-	-

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	http://www.cmfchina.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023年4月12日 - 2023年6月30日)
本期已实现收益	-167,143.65
本期利润	9,768,117.82
加权平均基金份额本期利润	0.1019
本期加权平均净值利润率	9.78%
本期基金份额净值增长率	21.45%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)
期末可供分配利润	898,608.37
期末可供分配基金份额利润	0.0161
期末基金资产净值	67,703,447.63
期末基金份额净值	1.2145
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)
基金份额累计净值增长率	21.45%

注：1、基金业绩指标不包括持有人认（申）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，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；

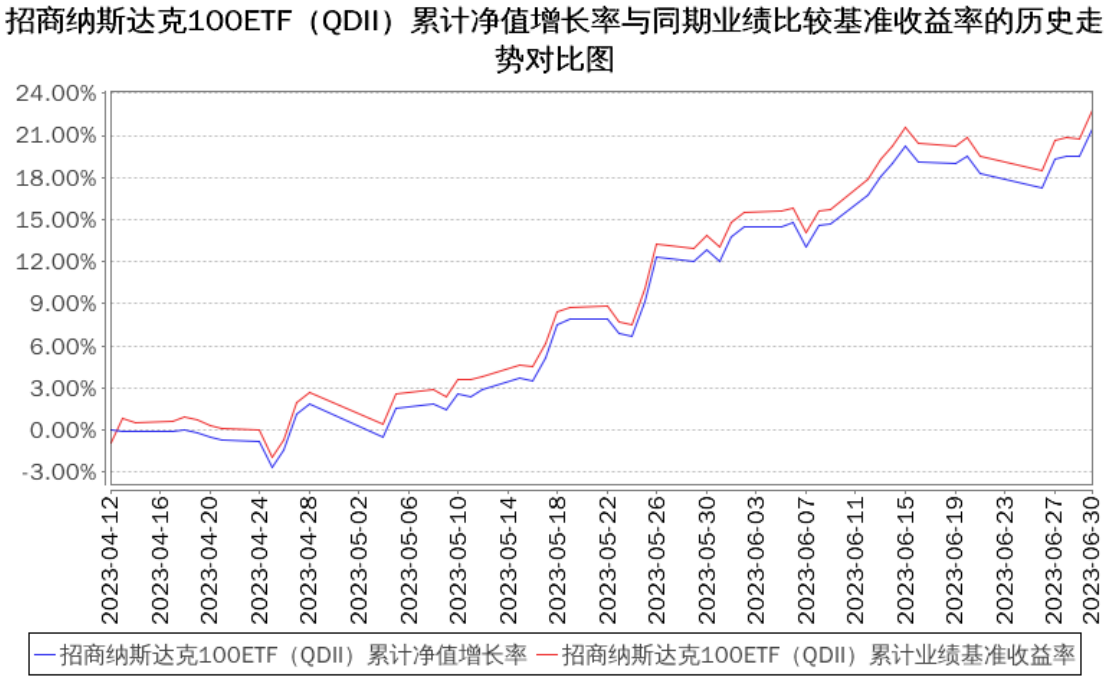
4、本基金合同于2023年4月12日生效，截至本报告期末成立未满半年。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	8.40%	0.99%	8.65%	1.02%	-0.25%	-0.03%
自基金合同生效起至今	21.45%	1.10%	22.82%	1.15%	-1.37%	-0.05%

3.2.2 自基金合同生效/自基金转型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



注：本基金合同于 2023 年 4 月 12 日生效，截至本报告期末基金成立未满一年；自基金成立日起 6 个月内为建仓期，截至报告期末基金建仓期尚未结束。

§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

招商基金管理有限公司于 2002 年 12 月 27 日经中国证监会【2002】100 号文批准设立。目前，公司注册资本金为人民币 13.1 亿元，招商银行股份有限公司持有公司全部股权的 55%，招商证券股份有限公司持有公司全部股权的 45%。

招商基金管理有限公司首批获得企业年金基金投资管理人资格、基本养老保险基金投资管理人资格；2004 年获得全国社保基金投资管理人资格；同时拥有合格境内机构投资者

（QDII）业务资格、专户理财（特定客户资产管理业务）资格、公募基金投顾业务资格，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、海外投资、FOF 投资等领域全面布局。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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		
刘重杰	本基金基金经理	2023 年 4 月 12 日	-	12	男，学士。曾任职于成都商报社、西南财经大学金融数据中心、南京大学金陵学院；2010 年 7 月加入华西期货有限责任公司，历任金融工程部高级研究员、部门负责人；2014 年 3 月加入西南证券股份有限公司，历任衍生品业务岗、平仓处置岗、策略研究岗、投资者教育及培训岗；2017 年 9 月加入招商基金管理有限公司，曾任深证电子信息传媒产业(TMT)50 交易型开放式指数证券投资基金、招商深证电子信息传媒产业(TMT)50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、招商深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、招商中证浙江 100 交易型开放式指数证券投资基金、招商中证生物科技主题交易型开放式指数证券投资基金、招商中证云计算与大数据主题交易型开放式指数证券投资基金、招商中证香港科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理，现任招商深证 100 交易型开放式指数证券投资基金、招商中证红利交易型开放式指数证券投资基金、招商国证食品饮料行业交易型开放式指数证券投资基金、招商中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金、招商沪深 300ESG 基准交易型开放式指数证券投资基金、招商中证新能源汽车指数型证券投资基金、招商中证物联网主题交易型开放式指数证券投资基金、招商中证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金、招商中证银行 AH 价格优选交易型开放式指数证券投资基金、招商中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金联接基金、招商中证 100 交易型开放式指数证券投资基金、招商中证银行 AH 价格优选交易型

					开放式指数证券投资基金发起式联接基金、招商纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）、招商中证国新央企股东回报交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告（生效）日期；

2、证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

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

本基金无境外投资顾问。

4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

基金管理人声明：在本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关法律法规及其各项实施准则的规定以及本基金的基金合同等基金法律文件的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围以及投资运作符合有关法律法规及基金合同的规定。

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

基金管理人已建立较完善的研究方法和投资决策流程，确保各投资组合享有公平的投资决策机会。基金管理人建立了所有组合适用的投资对象备选库，制定明确的备选库建立、维护程序。基金管理人拥有健全的投资授权制度，明确投资决策委员会、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。基金管理人的相关研究成果向内部所有投资组合开放，在投资研究层面不存在各投资组合间不公平的问题。

基金管理人按照法规要求，对连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合间的同向交易的交易价差进行分析，相关投资组合经理也对分析中发现的价格差异次数占比超过正常范围的情况进行了合理性解释。报告期内，公司旗下投资组合同向交易价差分析中未发现异常情形。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。确因投资组合的投资策略或流动性等需要而发生的同日反向交易，基金管理人要求相关投资组合经理提供决策依据，并留存记录备查，完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合等除外。

本报告期内，本基金各项交易均严格按照相关法律法规、基金合同的有关要求执行，公司所有投资组合参与的交易所公开竞价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%的交易共有18次，其中14次为旗下指数及量化组合因投资策略需要而发生反向交易，4 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。报告期内未发现有可能导致不公平交易和利益输送的重大异常交易行为。

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

报告期内，沪深300指数下跌0.75%。A股各行业中TMT板块相对收益明显，通信、传媒、计算机为涨幅前三的行业，分别为 50.66%、42.75%、27.57%。本基金基准指数纳斯达克100指数产品成立以来上涨17.09%。关于本基金的运作，仓位维持在98.9%左右的水平，基本完成了对基准的跟踪。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金份额净值增长率为21.45%，同期业绩基准增长率为22.82%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

主要海外股票市场指数，上半年均呈现不同程度涨幅，其中纳斯达克 100 指数上涨幅度 38.75%，相对于标普 500、日经 225、法国 CAC、德国 DAX 同期的 15.91%、27.19%、14.31%、15.98%，均有明显的收益优势。受到人工智能等主题的推动，纳斯达克 100 指数中由相关科技领域的成分股占比高，呈现出较明显的涨幅。在今年年中，纳斯达克 100 指数进行了一次权重特别调整，按照降低集中度的规则，一定程度上降低了头部权重股的指数权重，起到了一定分散持股集中度的风险。随着纳斯达克 100 指数成分股半年报业绩的预告和披露，有不少成分股的业绩披露和预告超过此前市场预期，为指数的走势形成了共振。随着美国市场加息的逐渐稳定，较长时间尺度看，利于科技类公司为主的纳斯达克100 指数的表现；但是，考虑到最近半年指数的表现，以及美国市场的一些基本面方面的不确定性，投资者也应注意相应风险。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金的估值业务严格按照相关的法律法规、基金合同以及《招商基金管理有限公司基金估值委员会管理制度》进行。基金核算部负责日常的基金资产的估值业务，执行基金估值政策。另外，公司设立由投资和研究部门、风险管理部、基金核算部、法律合规部负责人和基金经理代表组成的估值委员会。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历。公司估值委员会主要负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，定期评价现有估值政策和程序的适用性及对估值程序执行情况进行监督。

投资和研究部门以及基金核算部共同负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；投资和研究部门定期审核公允价值的确认和计量；研究部提出合理的数量分析模型对需要进行估值测算或者调整的投资品种进行公允价值定价与计量并定期对估值政策和程序进行评价，以保证其持续适用；基金核算部定期审核估值政策和程序的一致性，并负责与托管行沟通估值调整事项；风险管理部负责估值委员会工作流程中的风险控制；法律合规部负责日常的基金估值调整结果的事后复核监督工作；法律合规部与基金核算部共同负责估值调整事项的信息披露工作。

基金经理代表向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论；对需采用特别估值程序的证券，基金及时启动特别估值程序，由公司估值委员会集体讨论议定特别估值方案，咨询会计事务所的专业意见，并与托管行沟通后由基金核算部具体执行。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。截止报告期末本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供相关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规的规定和基金合同的约定，以及本基金的实际运作情况，本基金报告期未进行利润分配。在符合分红条件的前提下，本基金已实现尚未分配的可供分配收益部分，将严格按照基金合同的约定适时向投资者予以分配。

4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未发生连续二十个工作日出现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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在招商纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金（QDII）（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“ 关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§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：招商纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金（QDII）

报告截止日：2023年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末2023年6月30日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	2,444,640.89
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	66,842,297.73
其中：股票投资		66,842,297.73
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	-
债权投资		-
其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-
其他投资		-
其他债权投资		-
其他权益工具投资		-
应收清算款		-
应收股利		7,524.66
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.5	-
资产总计		69,294,463.28
负债和净资产	附注号	本期末2023年6月30日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		1,551,025.41
应付赎回款		-
应付管理人报酬		24,091.79
应付托管费		7,227.52
应付销售服务费		-
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	6.4.7.6	8,670.93
负债合计		1,591,015.65
净资产：		
实收基金	6.4.7.7	55,744,064.00
其他综合收益		-
未分配利润	6.4.7.8	11,959,383.63
净资产合计		67,703,447.63
负债和净资产总计		69,294,463.28

注：1.报告截止日2023年6月30日，基金份额净值1.2145元，基金份额总额55,744,064.00份；

2.本财务报表的实际编制期间为2023年4月12日(基金合同生效日)至2023年6月30日止期间。

6.2 利润表

会计主体：招商纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金（QDII）

本报告期：2023年4月12日(基金合同生效日)至2023年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2023年4月12日(基金合同生效日）至2023年6月30日
一、营业总收入		9,934,642.98
1.利息收入		78,197.15
其中：存款利息收入	6.4.7.9	78,197.15
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）		412,600.63
其中：股票投资收益	6.4.7.10	317,810.26
基金投资收益	6.4.7.11	-
债券投资收益		-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	94,790.37
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	9,935,261.47
4.汇兑收益（损失以“－”号填列）		-511,442.91
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	20,026.64
减：二、营业总支出		166,525.16
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	106,319.76
2.托管费	6.4.10.2.2	31,895.90
3.销售服务费		-
4.投资顾问费		-
5.利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6.信用减值损失	6.4.7.19	-
7.税金及附加		-

8.其他费用	6.4.7.20	28,309.50
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		9,768,117.82
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		9,768,117.82
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		9,768,117.82

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：招商纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）

本报告期：2023 年 4 月 12 日(基金合同生效日)至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 4 月 12 日（基金合同生效日）至 2023 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）	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	239,744,064.00	-	-	239,744,064.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-184,000,000.00	-	11,959,383.63	-172,040,616.37
（一）、综合收益总额	-	-	9,768,117.82	9,768,117.82
（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）	-184,000,000.00	-	2,191,265.81	-181,808,734.19
其中：1.基金申购款	29,000,000.00	-	2,303,143.87	31,303,143.87
2.基金赎回款	-213,000,000.00	-	-111,878.06	-213,111,878.06
（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）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	55,744,064.00	-	11,959,383.63	67,703,447.63

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：

____徐勇___	____欧志明_____	____何剑萍____
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

招商纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)(以下简称“本基金”)系由基金管理人招商基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《招商纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金合同》及其他有关法律法规的规定，经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2022]1776 号文准予公开募集注册。本基金为交易型开放式基金，存续期限为不定期。本基金首次设立募集基金份额为 239,744,064.00 份，经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证，并出具了编号为德师报(验)字(23)第 00108 号验资报告。《招商纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金合同》(以下简称“基金合同”)于 2023 年 4 月 12 日正式生效。本基金的基金管理人为招商基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及截至报告期末最新公告的基金招募说明书的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份券(含存托凭证、美国存托凭证、全球存托凭证，下同)和备选成份券(含存托凭证、美国存托凭证、全球存托凭证，下同)。此外，为更好地实现投资目标，本基金可参与其他境外市场投资工具和境内市场投资工具投资。境外市场投资工具包括已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金(包括交易型开放式基金(ETF))；已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券以及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品；远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品；以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。境内市场投资工具包括依法发行上市的其他股票(包括主板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票和存托凭证)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券(含可分离交易可转债)、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、货币市场工具、同业存单、债券回购、资产支持证券、银行存款、股指期货、国债期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相

关规定)。本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定，参与融资业务和转融通证券出借业务。基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份券和备选成份券的资产比例不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%。每个交易日日终在扣除国债期货合约、股指期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货、国债期货和股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。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品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围或调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准：纳斯达克100指数收益率(经汇率调整后)。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《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《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)编制，同时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发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金2023年6月30日的财务状况以及自2023年4月12日(基金合同生效日)至2023年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为自2023年4月12日(基金合同生效日)至2023年6月30日止期间。

6.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1)金融资产的分类

根据本基金的金融资产业务模式和金融资产的合同现金流量特征，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产，暂无金融资产划分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。

金融资产的合同条款规定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，且本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标，则本基金将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。此类金融资产主要包括货币资金、各类应收款项、买入返售金融资产等。

不符合分类为以摊余成本计量的金融资产以及公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产条件的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产计入“衍生金融资产”外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产计入“交易性金融资产”。

2)金融负债的分类

本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无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。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。对于以常规方式购买或出售金融资产的，在交易日确认将收到的资产和为此将承担的负债，或者在交易日终止确认已出售的资产。金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。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，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券已到付息期但尚未领取的利息，单独确认为应收项目。

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，公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。以摊余成本计量的金融资产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，发生减值或终止确认产生的利得或损失，计入当期损益。

本基金对分类为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。除购买或源生的已发生信用减值的金融资产外，本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后的变动情况。若该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本基金按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；若该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加，本基金按照相当于该金融工具未来12个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。信用损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。

本基金在前一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形的，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来12个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产已转移且其所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然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，但是未保留对该金融资产的控制，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。若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风险和报酬，且保留了对该金融资产控制的，则按照其继续涉入被转移金融资产的程度继续确认该被转移金融资产，并相应确认相关负债。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价(包括转出的非现金资产或承担的新金融负债)之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，将其公允价值划分为三个层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是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；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值原则如下：

(1)对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市价不能真实反映公允价值的，应对市价进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)当投资品种不存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

(3)经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整，确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

1)利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

转融通证券出借业务利息收入在转融通证券实际出借期间内，按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时计入转融通证券出借业务利息收入。

2)投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本与相关交易费用的差额确认。

基金投资收益于卖出基金成交日确认，并按卖出基金成交金额扣除应结转的基金投资成本、相关交易费用与税费后的差额入账。

债券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖债券价差收入。除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。买卖债券价差收入为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

资产支持证券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖资产支持证券价差收入。资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息收入。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息(若有)后的差额，确认资产支持证券利息收入。买卖资产支持证券价差收入为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本、相关交易费用与税费后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认，由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

3)公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

4)信用减值损失

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信用损失准备。本基金所计提的信用减值损失计入当期损益。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬和基金托管费按基金合同及相关公告约定的费率和计算方法逐日计提。

卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率逐日计提。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

1)每一基金份额享有同等分配权；

2)本基金的收益分配方式为现金分红；

3)当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，可进行收益分配。在收益评价日，基金管理人对基金份额净值增长率和标的指数同期增长率进行计算；

4)本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；

5)若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

6)法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。证券交易所或基金登记机构对收益分配另有规定的，从其规定。

在对基金份额持有人利益无实质不利影响的情况下，基金管理人可在不违反法律法规规定的前提下酌情调整以上基金收益分配原则，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在规定媒介公告。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，与所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策与计量基础一致。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和基金投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

1)对于基金投资，根据中基协发[2017]3 号《关于发布<基金中基金估值业务指引(试行)>的通知》之附件《基金中基金估值业务指引(试行)》的规定在估值日对非上市基金和上市基金进行估值。

2)对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据《关于发布<证券投资基金

投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》(中基协发[2017]6 号)，在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。

3)对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》(中国证监会公告[2017]13 号)及《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》(中基协发[2013]13 号)相关规定，本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

4)对于中国证券投资基金业协会《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》(中基协字[2022]566 号)所规定的固定收益品种，本基金按照相关规定,对以公允价值计量的固定收益品种选取第三方估值基准服务机构提供估值全价进行估值；对以摊余成本计量的固定收益品种用第三方估值基准服务机构提供的预期信用损失减值计量结果。

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

本基金在本报告期间未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期间未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、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]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)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、债券免征增值税；2018年1月1日起，公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

(2)对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不计缴企业所得税。

(3)对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司代扣代缴个人所得税；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4)对于基金从事A股买卖，出让方按0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。

(5)基金在境外证券交易所进行交易或取得的源自境外证券市场的收益，其涉及的税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行。

(6)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末2023年6月30日
活期存款	2,444,640.89
等于：本金	2,444,549.62
加：应计利息	91.27
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	-
减：坏账准备	-
合计	2,444,640.89

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末2023年6月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		56,907,036.26	-	66,842,297.73	9,935,261.47
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		56,907,036.26	-	66,842,297.73	9,935,261.47

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

本基金本报告期末无衍生金融工具。

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各项买入返售金融资产。

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2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-

预提费用	8,670.93
合计	8,670.93

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 4 月 12 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	239,744,064.00	239,744,064.00
本期申购	29,000,000.00	29,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-213,000,000.00	-213,000,000.00
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	55,744,064.00	55,744,064.00

注：1、本期申购含红利再投、转换入份（金）额，本期赎回含转换出份（金）额。

2、本基金自 2023 年 2 月 9 日至 2023 年 4 月 7 日止期间公开发售，有效净认购金额人民币 239,727,000.00 元，折算为 239,727,000.00 份基金份额。根据《招商纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金合同》的规定，经本基金注册登记人计算并确认，本基金认购资金在募集期内产生的利息人民币 17,064.00 元，折算为 17,064.00 份基金份额，划入基金持有人账户，两者合计 239,744,064.00 份基金份额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-167,143.65	9,935,261.47	9,768,117.82
本期基金份额交易产生的变动数	1,065,752.02	1,125,513.79	2,191,265.81
其中：基金申购款	100,441.68	2,202,702.19	2,303,143.87
基金赎回款	965,310.34	-1,077,188.40	-111,878.06
本期已分配利润	-	-	-
本期末	898,608.37	11,060,775.26	11,959,383.63

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 4 月 12 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	78,151.25
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	45.90
其他	-

合计	78,197.15

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 4 月 12 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	317,810.26
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	317,810.26

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 4 月 12 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	191,302,733.04
减：卖出股票成本总额	190,894,094.87
减：交易费用	90,827.91
买卖股票差价收入	317,810.26

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 4 月 12 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	213,111,878.06
减：现金支付赎回款总额	213,111,878.06
减：赎回股票成本总额	-
减：交易费用	-
赎回差价收入	-

6.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无股票申购差价收入。

6.4.7.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内无证券出借差价收入。

6.4.7.11 基金投资收益

本基金本报告期内无基金投资收益。

6.4.7.12 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内无买卖债券差价收入。

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内无买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券赎回差价收入。

6.4.7.13.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券申购差价收入。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属赎回差价收入。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属申购差价收入。

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

本基金本报告期内无衍生工具买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具其他投资收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期2023年4月12日（基金合同生效日）至2023年6月30日

股票投资产生的股利收益	94,790.37
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	94,790.37

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 4 月 12 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	9,935,261.47
——股票投资	9,935,261.47
——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	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	9,935,261.47

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 4 月 12 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	19,508.09
其他	518.55
合计	20,026.64

6.4.7.19 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 4 月 12 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	5,000.00
信息披露费	-
证券出借违约金	-
IOPV 服务费	3,670.93

银行费用	19,238.57
其他	400.00
合计	28,309.50

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

截至财务报告批准报出日，本基金无需要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
招商基金管理有限公司	基金管理人
中国银行股份有限公司	基金托管人

注：基金的主要关联方包含基金管理人、基金管理人的股东及子公司、基金托管人等。

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

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内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2023年4月12日（基金合同生效日）至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	106,319.76
其中：支付销售机构的客户维护费	54.09
支付投资顾问的投资顾问费	-

注：支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值×0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金管理人报酬＝前一日基金资产净值×0.50%÷当年天数

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期2023年4月12日(基金合同生效日）至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	31,895.90

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值×0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金托管费＝前一日基金资产净值×0.15%÷当年天数

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期内无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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期内无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

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

本基金本报告期内无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期2023年4月12日（基金合同生效日）至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行-活期	847,760.04	20,197.78
摩根大通-活期	1,596,880.85	57,953.47

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行股份有限公司保管，按银行约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2023年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/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

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为股票型基金，本基金的运作涉及的金融工具主要包括股票投资、债券投资等。与这些金融工具有关的风险，以及本基金的基金管理人管理这些风险所采取的风险管理政策如下所述。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是提升本基金风险调整后收益水平，保证本基金的基金资产安全，维护基金份额持有人利益。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人风险管理的基本策略是识别和分析本基金运作时本基金面临各种类型的风险，确定适当的风险容忍度，并及时可靠地对各种风险进行监督，将风险控制在限定的范围之内。本基金目前面临的主要风险包括：市场风险、信用风险和流动性风险。

本基金的基金管理人建立了以全面、独立、互相制约以及定性和定量相结合为原则的，监事会、董事会及下设风险控制委员会、督察长、风险管理委员会、法律合规部和风险管理部等多层次的风险管理组织架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指金融工具的一方到期无法履行约定义务致使本基金遭受损失的风险。本基金的信用风险主要存在于银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资、资产支持证券投资及其他。

本基金的银行存款存放于本基金的基金托管人，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在证券交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并采用券款对付交割方式，以控制相应的信用风险。

对于与债券投资、资产支持证券投资等投资品种相关的信用风险，本基金的基金管理人通过对投资品种的信用等级评估来选择适当的投资对象，并限制单个投资品种的持有比例来管理信用风险。附注6.4.13.2.1至6.4.13.2.6列示了本基金所持有的债券投资及资产支持证券投资的信用评级，该信用评级不包括本基金所持有的国债、央行票据、政策性金融债。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金流动性风险来源于基金约定开放日兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险以及因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。本基金所持有的金融资产主要在证券交易所和银行间同业市场交易。除附注6.4.12所披露的流通受限不能自由转让的基金资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。除卖出回购金融资产外，本基金所持有的金融负债的合约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，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人在基金合同约定巨额赎回条款，设计了非常情况下赎回资金的处理模式，控制因开放模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

日常流动性风险管理中，本基金的基金管理人每日监控和预测本基金的流动性指标，通过对投资品种的流动性指标来持续地评估、选择、跟踪和控制基金投资的流动性风险。同时，本基金通过预留一定的现金头寸，并且在需要时可通过卖出回购金融资产方式融入短期资金，以缓解流动性风险。

本基金按合同约定申购赎回可采用一篮子股票的形式或现金替代方式，流动性风险相对较低。

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

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的基金管理人日常通过对利率水平的预测、分析收益率曲线及优化利率重新定价日组合等方法对上述利率风险进行管理。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,444,640.89	-	-	-	2,444,640.89
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	66,842,297.73	66,842,297.73
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	7,524.66	7,524.66
应收申购款	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	2,444,640.89	-	-	66,849,822.39	69,294,463.28
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	24,091.79	24,091.79
应付托管费	-	-	-	7,227.52	7,227.52
应付清算款	-	-	-	1,551,025.41	1,551,025.41
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	8,670.93	8,670.93
负债总计	-	-	-	1,591,015.65	1,591,015.65
利率敏感度缺口	2,444,640.89	-	-	65,258,806.74	67,703,447.63

注：上表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

本基金本报告期末及上年度末无利率风险的敏感性分析。

6.4.13.4.2 外汇风险

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日					
	美元折合人民币	港币折合人民币	欧元折	日元折	其他币种折	合计

			合人民币	合人民币	合人民币	
以外币计价的资产						
银行存款	1,597,125.95	-	-	-	-	1,597,125.95
结算备付金	-	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	66,842,297.73	-	-	-	-	66,842,297.73
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-
应收股利	7,524.66	-	-	-	-	7,524.66
应收申购款	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产合计	68,446,948.34	-	-	-	-	68,446,948.34
以外币计价的负债						
应付清算款	1,326,334.83	-	-	-	-	1,326,334.83
应付赎回款	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	-
负债合计	1,326,334.83	-	-	-	-	1,326,334.83
资产负债表外汇风险敞口净额	67,120,613.51	-	-	-	-	67,120,613.51

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（ 2023 年 6 月 30 日 ）
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	3,356,030.68
	2. 所有外币相对人民币贬值	-3,356,030.68

	5%	

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险，该风险可能与特定投资品种相关，也有可能与整体投资品种相关。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债券和股票，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金在构建资产配置和基金资产投资组合的基础上，通过建立事前和事后跟踪误差的方式，对基金资产的市场价格风险进行管理。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	66,842,297.73	98.73
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	66,842,297.73	98.73

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1.若对市场价格敏感的权益性投资的市场价格上升或下降 5%	
	2.其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（ 2023 年 6 月 30 日 ）
	1. 权益性投资的市场价格上升 5%	3,342,114.89
	2. 权益性投资的市场价格下降 5%	-3,342,114.89

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日
第一层次	66,842,297.73
第二层次	-
第三层次	-
合计	66,842,297.73

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，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和债券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工具主要包括应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无需要说明有助于理解和分析会计报表的其他事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	66,842,297.73	96.46
	其中：普通股	66,585,766.08	96.09
	存托凭证	256,531.65	0.37
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	2,444,640.89	3.53
8	其他资产	7,524.66	0.01
9	合计	69,294,463.28	100.00

注：此处的股票投资项含可退替代款估值增值。

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

国家（地区）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
美国	66,842,297.73	98.73
合计	66,842,297.73	98.73

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权益投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
通信服务	11,022,940.20	16.28
非日常生活消费品	10,145,014.97	14.98
日常消费品	3,535,158.92	5.22
能源	247,428.59	0.37
金融	330,291.68	0.49
医疗保健	3,784,035.76	5.59
工业	2,585,060.29	3.82
信息技术	34,311,541.92	50.68
原材料	-	-
房地产	161,417.15	0.24
公用事业	655,605.88	0.97
合计	66,778,495.36	98.63

7.3.2 期末积极投资按行业分类的权益投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
通信服务	-	-
非日常生活消费品	63,802.37	0.09

日常消费品	-	-
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	-	-
工业	-	-
信息技术	-	-
原材料	-	-
房地产	-	-
公用事业	-	-
合计	63,802.37	0.09

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

7.4.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	MICROSOFT CORP	微软公司	MSFT US	纳斯达克证券交易所	美国	3,510	8,636,965.50	12.76
2	APPLE INC	苹果公司	AAPL US	纳斯达克证券交易所	美国	5,999	8,408,128.97	12.42
3	NVIDIA CORP	英伟达	NVDA US	纳斯达克证券交易所	美国	1,519	4,643,063.37	6.86
4	AMAZON.COM INC	亚马逊公司	AMZN US	纳斯达克证券交易所	美国	4,865	4,582,612.48	6.77
5	TESLA INC	特斯拉公司	TSLA US	纳斯达克证券交易所	美国	1,502	2,841,029.49	4.20
6	META PLATFORMS INC-CLASS A	Meta 平台股份有限公司	META US	纳斯达克证券交易所	美国	1,360	2,820,177.71	4.17
7	ALPHABET INC-CLA	Alphabet 公司	GOOGL US	纳斯达克证券交易所	美国	2,871	2,483,209.03	3.67
8	ALPHABET	Alphabet 公司	GOOG US	纳斯达克证券	美国	2,785	2,434,382.50	3.60

	INC-CL C			交易所				
9	BROA DCOM INC	博通股份有限公司	AVGO US	纳斯达克证券交易所	美国	256	1,604,576.18	2.37
10	PEPSIC O INC	百事可乐	PEP US	纳斯达克证券交易所	美国	846	1,132,254.82	1.67
11	COSTC O WHOL ESALE CORP	开市客	COST US	纳斯达克证券交易所	美国	272	1,058,141.53	1.56
12	ADOBE INC	奥多比	ADBE US	纳斯达克证券交易所	美国	281	992,869.65	1.47
13	CISCO SYSTE MS INC	思科系统股份有限公司	CSCO US	纳斯达克证券交易所	美国	2,506	936,900.41	1.38
14	NETFLI X INC	奈飞公司	NFLX US	纳斯达克证券交易所	美国	273	868,929.69	1.28
15	ADVA NCED MICRO DEVIC ES	AMD公司	AMD US	纳斯达克证券交易所	美国	990	814,859.97	1.20
16	COMC AST CORP-CLASS A	康卡斯特公司	CMCSA US	纳斯达克证券交易所	美国	2,558	767,993.43	1.13
17	T-MOB ILE US INC	T-Mobil e US股份有限公司	TMUS US	纳斯达克证券交易所	美国	737	739,700.09	1.09
18	TEXAS INSTR UMEN TS INC	德州仪器	TXN US	纳斯达克证券交易所	美国	557	724,539.20	1.07
19	INTEL CORP	英特尔	INTC US	纳斯达克证券交易所	美国	2,565	619,782.88	0.92

20	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	霍尼韦尔	HON US	纳斯达克证券交易所	美国	409	613,235.58	0.91
21	QUALCOMM INC	高通公司	QCOM US	纳斯达克证券交易所	美国	684	588,348.91	0.87
22	INTUIT INC	Intuit股份有限公司	INTU US	纳斯达克证券交易所	美国	172	569,455.76	0.84
23	APPLIED MATERIALS INC	应用材料	AMAT US	纳斯达克证券交易所	美国	516	538,919.24	0.80
24	INTUITIVE SURGICAL INC	直觉外科手术公司	ISRG US	纳斯达克证券交易所	美国	215	531,219.86	0.78
25	AMGEN INC	安进公司	AMGN US	纳斯达克证券交易所	美国	328	526,201.25	0.78
26	STARBUCKS CORP	星巴克公司	SBUX US	纳斯达克证券交易所	美国	704	503,914.57	0.74
27	MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	亿滋国际	MDLZ US	纳斯达克证券交易所	美国	836	440,613.68	0.65
28	ANALOG DEVICES INC	亚德诺半导体	ADI US	纳斯达克证券交易所	美国	308	433,558.69	0.64
29	BOOKING HOLDINGS INC	Booking控股股份有限公司	BKNG US	纳斯达克证券交易所	美国	22	429,264.98	0.63
30	GILEA	吉利德	GILD	纳斯达	美国	766	426,579.58	0.63

	D SCIEN CES INC	科学	US	克证券交易所				
31	AUTO MATIC DATA PROCE SSING	ADP 公司	ADP US	纳斯达克证券交易所	美国	253	401,804.12	0.59
32	VERTE X PHAR MACE UTICA LS INC	福泰制药	VRTX US	纳斯达克证券交易所	美国	158	401,767.34	0.59
33	LAM RESEA RCH CORP	泛林集团	LRCX US	纳斯达克证券交易所	美国	82	380,904.58	0.56
34	PALO ALTO NETW ORKS INC	Palo Alto Networks 股份有限公司	PANW US	纳斯达克证券交易所	美国	187	345,251.40	0.51
35	REGEN ERON PHAR MACE UTICA LS	再生元制药股份有限公司	REGN US	纳斯达克证券交易所	美国	66	342,673.74	0.51
36	PAYPA L HOLDI NGS INC	Paypal 控股股份有限公司	PYPL US	纳斯达克证券交易所	美国	685	330,291.68	0.49
37	CSX CORP	CSX 公司	CSX US	纳斯达克证券交易所	美国	1,250	307,999.73	0.45
38	MICRO N TECHN OLOGY INC	美光科技股份有限公司	MU US	纳斯达克证券交易所	美国	672	306,445.60	0.45

39	KLA CORP	KLA公司	KLAC US	纳斯达克证券交易所	美国	84	294,391.23	0.43
40	ACTIVISION BLIZZARD INC	动视暴雪股份有限公司	ATVI US	纳斯达克证券交易所	美国	483	294,212.18	0.43
41	SYNOPSYS INC	新思科技公司	SNPS US	纳斯达克证券交易所	美国	93	292,595.26	0.43
42	CADENCE DESIGN SYS INC	Cadence设计系统股份有限公司	CDNS US	纳斯达克证券交易所	美国	167	282,997.30	0.42
43	ASML HOLDING NV-NY REG SHS	阿斯麦控股公司	ASML US	纳斯达克证券交易所	美国	53	277,555.62	0.41
44	MONSTER BEVERAGE CORP	怪兽饮料公司	MNST US	纳斯达克证券交易所	美国	643	266,877.12	0.39
45	FORTINET INC	Fortinet股份有限公司	FTNT US	纳斯达克证券交易所	美国	482	263,267.54	0.39
46	MERCADOLIBRE INC	MercadoLibre股份有限公司	MELI US	纳斯达克证券交易所	美国	30	256,790.48	0.38
47	O'REILLY AUTOMOTIVE INC	O'Reilly汽车股份有限公司	ORLY US	纳斯达克证券交易所	美国	37	255,403.85	0.38
48	MARRIOTT INTERNATIONAL	万豪国际	MAR US	纳斯达克证券交易所	美国	187	248,206.45	0.37

	-CL A							
49	CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	Charter通信公司	CHTR US	纳斯达克证券交易所	美国	92	244,217.88	0.36
50	NXP SEMICONDUCTORS NV	恩智浦半导体公司	NXPI US	纳斯达克证券交易所	美国	159	235,157.30	0.35
51	AIRBNB INC-CLASS A	爱彼迎股份有限公司	ABNB US	纳斯达克证券交易所	美国	253	234,292.81	0.35
52	MARVELL TECHNOLOGY INC	美满电子科技公司	MRVL US	纳斯达克证券交易所	美国	528	228,074.00	0.34
53	CINTAS CORP	CINTAS 公司	CTAS US	纳斯达克证券交易所	美国	62	222,691.64	0.33
54	DEXCOM INC	Dexcom股份有限公司	DXCM US	纳斯达克证券交易所	美国	238	221,003.84	0.33
55	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	微芯科技股份有限公司	MCHP US	纳斯达克证券交易所	美国	335	216,865.41	0.32
56	WORKDAY INC-CLASS A	Workday股份有限公司	WDAY US	纳斯达克证券交易所	美国	126	205,661.73	0.30
57	MODERNA INC	莫德纳公司	MRNA US	纳斯达克证券交易所	美国	234	205,436.72	0.30
58	LULULEMON ATHLETICA INC	Lululemon Athletica股份有限公	LULU US	纳斯达克证券交易所	美国	75	205,122.40	0.30

		司						
59	KEURIG DR PEPPER INC	Keurig Dr Pepper有限公司	KDP US	纳斯达克证券交易所	美国	862	194,769.56	0.29
60	PACCAR INC	帕卡	PCAR US	纳斯达克证券交易所	美国	321	194,024.65	0.29
61	AUTODESK INC	欧特克	ADSK US	纳斯达克证券交易所	美国	131	193,679.69	0.29
62	KRAFT HEINZ CO/THE	卡夫亨氏公司	KHC US	纳斯达克证券交易所	美国	754	193,412.99	0.29
63	COPART INC	Copart股份有限公司	CPRT US	纳斯达克证券交易所	美国	293	193,106.11	0.29
64	AMERICAN ELECTRIC POWER	美国电力	AEP US	纳斯达克证券交易所	美国	316	192,258.31	0.28
65	ON SEMICONDUCTOR	安森美半导体公司	ON US	纳斯达克证券交易所	美国	275	187,939.45	0.28
66	ASTRAZENECA PLC-SPONS ADR	阿斯利康公共有限公司	AZN US	纳斯达克证券交易所	美国	363	187,725.63	0.28
67	PDD HOLDINGS INC	拼多多	PDD US	纳斯达克证券交易所	美国	375	187,346.93	0.28
68	IDEXX LABORATORIES INC	爱德士股份有限公司	IDXX US	纳斯达克证券交易所	美国	51	185,079.69	0.27
69	BIOGE	渤健公	BIIB	纳斯达	美国	88	181,127.68	0.27

	N INC	司	US	克证券交易所				
70	EXELON CORP	Exelon 公司	EXC US	纳斯达克证券交易所	美国	611	179,865.63	0.27
71	OLD DOMINION FREIGHT LINE	Old Dominion Freight Line 股份有限公司	ODFL US	纳斯达克证券交易所	美国	67	179,006.55	0.26
72	PAYCHEX INC	Paychex 公司	PAYX US	纳斯达克证券交易所	美国	221	178,645.40	0.26
73	ROSS STORES INC	罗斯百货股份有限公司	ROST US	纳斯达克证券交易所	美国	210	170,148.08	0.25
74	GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	GE HealthCare Technologies Inc	GEHC US	纳斯达克证券交易所	美国	279	163,779.69	0.24
75	COSTAR GROUP INC	CoStar 集团股份有限公司	CSGP US	纳斯达克证券交易所	美国	251	161,417.15	0.24
76	SEAGEN INC	Seagen 股份有限公司	SGEN US	纳斯达克证券交易所	美国	115	159,927.91	0.24
77	GLOBALFOUNDRIES INC	格罗方德半导体股份有限公司	GFS US	纳斯达克证券交易所	美国	336	156,791.77	0.23
78	ELECTRONIC ARTS INC	电子艺界	EA US	纳斯达克证券交易所	美国	167	156,510.11	0.23
79	XCEL ENERGY INC	Xcel 能源	XEL US	纳斯达克证券交易所	美国	338	151,839.06	0.22

80	FASTENAL CO	法思诺公司	FAST US	纳斯达克证券交易所	美国	350	149,187.48	0.22
81	COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	高知特科技公司	CTSH US	纳斯达克证券交易所	美国	311	146,698.77	0.22
82	CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	CrowdStrike控股股份有限公司	CRWD US	纳斯达克证券交易所	美国	137	145,391.69	0.21
83	VERISK ANALYTICS INC	Verisk分析公司	VRSK US	纳斯达克证券交易所	美国	89	145,359.03	0.21
84	BAKER HUGHES CO	贝克休斯公司	BKR US	纳斯达克证券交易所	美国	622	142,069.49	0.21
85	DOLLAR TREE INC	美元树公司	DLTR US	纳斯达克证券交易所	美国	135	139,981.81	0.21
86	WARNER BROS DISCOVERY INC	华纳兄弟探索股份有限公司	WBD US	纳斯达克证券交易所	美国	1,498	135,736.07	0.20
87	CONSTELLATION ENERGY	美国联合能源公司	CEG US	纳斯达克证券交易所	美国	199	131,642.88	0.19
88	ILLUMINA INC	Illumina公司	ILMN US	纳斯达克证券交易所	美国	97	131,412.23	0.19
89	DATADOG INC - CLASS A	Datadog股份有限公司	DDOG US	纳斯达克证券交易所	美国	182	129,379.11	0.19

90	ANSYS INC	ANSYS 股份有限公司	ANSS US	纳斯达克证券交易所	美国	53	126,482.64	0.19
91	ALIGN TECHNOLOGY INC	Align 科技股份有限公司	ALGN US	纳斯达克证券交易所	美国	47	120,100.60	0.18
92	ATLASSIAN CORP-CL A	Atlassian Corp	TEAM US	纳斯达克证券交易所	美国	93	112,768.22	0.17
93	WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	沃博联股份有限公司	WBA US	纳斯达克证券交易所	美国	530	109,107.41	0.16
94	EBAY INC	eBay 公司	EBAY US	纳斯达克证券交易所	美国	328	105,918.09	0.16
95	DIAMONDBACK ENERGY INC	Diamondback 能源股份有限公司	FANG US	纳斯达克证券交易所	美国	111	105,359.10	0.16
96	ENPHASE ENERGY INC	Enphase 能源股份有限公司	ENPH US	纳斯达克证券交易所	美国	84	101,654.87	0.15
97	ZSCALER INC	Zscaler 股份有限公司	ZS US	纳斯达克证券交易所	美国	89	94,084.97	0.14
98	SIRIUS XM HOLDINGS INC	Sirius XM 控股公司	SIRI US	纳斯达克证券交易所	美国	2,379	77,871.51	0.12
99	ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	Zoom 视频通信股份有限公司	ZM US	纳斯达克证券交易所	美国	154	75,535.04	0.11
100	JD.CO	京东集	JD US	纳斯达	美国	279	68,806.02	0.10

	M INC-A DR	团		克证券交易所				
101	LUCID GROUP INC	Lucid集团股份有限公司	LCID US	纳斯达克证券交易所	美国	1,128	56,158.34	0.08

7.4.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权益投资明细

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	Rivian Automotive股份有限公司	RIVN US	纳斯达克证券交易所	美国	530	63,802.37	0.09

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

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	31,387,315.68	46.36
2	APPLE INC	AAPL US	30,976,868.63	45.75
3	AMAZON.COM INC	AMZN US	15,630,256.45	23.09
4	NVIDIA CORP	NVDA US	13,023,441.20	19.24
5	ALPHABET INC-CL A	GOOGL US	9,466,349.12	13.98
6	ALPHABET INC-CL C	GOOG US	9,330,936.70	13.78
7	META PLATFORMS INC-CLASS A	META US	9,281,405.74	13.71
8	TESLA INC	TSLA US	8,465,810.54	12.50
9	BROADCOM INC	AVGO US	5,054,816.34	7.47
10	PEPSICO INC	PEP US	4,814,895.39	7.11
11	COSTCO WHOLESALE CORP	COST US	4,190,855.34	6.19
12	CISCO SYSTEMS INC	CSCO US	3,819,578.32	5.64
13	T-MOBILE US INC	TMUS US	3,407,594.29	5.03
14	ADOBE INC	ADBE US	3,321,181.78	4.91
15	TEXAS INSTRUMENTS INC	TXN US	3,057,438.51	4.52

16	COMCAST CORP-CLASS A	CMCSA US	3,033,743.76	4.48
17	NETFLIX INC	NFLX US	2,840,109.61	4.19
18	ADVANCED MICRO DEVICES	AMD US	2,804,339.49	4.14
19	QUALCOMM INC	QCOM US	2,512,499.23	3.71
20	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	HON US	2,492,326.19	3.68
21	AMGEN INC	AMGN US	2,483,170.84	3.67
22	INTEL CORP	INTC US	2,482,752.81	3.67
23	INTUIT INC	INTU US	2,353,377.01	3.48
24	STARBUCKS CORP	SBUX US	2,331,474.30	3.44
25	GILEAD SCIENCES INC	GILD US	1,972,287.79	2.91
26	BOOKING HOLDINGS INC	BKNG US	1,872,388.33	2.77
27	INTUITIVE SURGICAL INC	ISRG US	1,870,510.95	2.76
28	MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	MDLZ US	1,824,915.85	2.70
29	APPLIED MATERIALS INC	AMAT US	1,817,932.49	2.69
30	ANALOG DEVICES INC	ADI US	1,802,893.79	2.66
31	AUTOMATIC DATA PROCESSING	ADP US	1,697,726.47	2.51
32	REGENERON PHARMACEUTICALS	REGN US	1,651,592.50	2.44
33	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	VRTX US	1,609,243.10	2.38
34	PAYPAL HOLDINGS INC	PYPL US	1,602,767.76	2.37

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票；

2、基金持有的股票分类为交易性金融资产的，本项的“累计买入金额”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。

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

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	25,385,305.19	37.49
2	APPLE INC	AAPL US	24,250,417.73	35.82
3	AMAZON.COM INC	AMZN US	12,344,033.99	18.23
4	NVIDIA CORP	NVDA US	10,069,991.95	14.87
5	ALPHABET INC-CL A	GOOGL US	7,334,662.94	10.83
6	META PLATFORMS INC-CLASS A	META US	7,330,488.04	10.83
7	ALPHABET INC-CL C	GOOG US	7,254,237.36	10.71
8	TESLA INC	TSLA US	5,795,974.45	8.56
9	PEPSICO INC	PEP US	3,890,929.36	5.75
10	BROADCOM INC	AVGO US	3,818,441.69	5.64
11	COSTCO WHOLESALE CORP	COST US	3,255,108.91	4.81
12	CISCO SYSTEMS INC	CSCO US	2,807,442.74	4.15
13	T-MOBILE US INC	TMUS US	2,623,707.92	3.88
14	COMCAST CORP-CLASS A	CMCSA US	2,396,268.97	3.54
15	ADOBE INC	ADBE US	2,390,022.70	3.53
16	TEXAS INSTRUMENTS INC	TXN US	2,198,392.23	3.25
17	NETFLIX INC	NFLX US	2,134,756.97	3.15
18	ADVANCED MICRO DEVICES	AMD US	2,104,910.44	3.11
19	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	HON US	1,918,944.49	2.83
20	AMGEN INC	AMGN US	1,866,156.13	2.76
21	STARBUCKS CORP	SBUX US	1,847,482.09	2.73
22	QUALCOMM INC	QCOM US	1,821,523.57	2.69
23	INTEL CORP	INTC US	1,819,958.99	2.69
24	INTUIT INC	INTU US	1,744,379.19	2.58
25	INTUITIVE SURGICAL INC	ISRG US	1,548,230.16	2.29
26	MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	MDLZ US	1,509,993.44	2.23
27	GILEAD SCIENCES INC	GILD US	1,500,184.35	2.22
28	BOOKING HOLDINGS INC	BKNG US	1,445,144.42	2.13
29	APPLIED MATERIALS INC	AMAT US	1,404,388.48	2.07

注：1、卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票；

2、基金持有的股票分类为交易性金融资产的，本项“累计卖出金额”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。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

买入成本（成交）总额	247,801,131.13
卖出收入（成交）总额	191,302,733.04

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票；

2、“买入股票成本（成交）总额”、“卖出股票收入（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序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

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

报告期基金投资的前十名证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存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，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

7.11.3 期末其他各项资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	7,524.66
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,524.66

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 报告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的情况。

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

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

§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
1,418	39,311.75	14,309,115.00	25.67%	41,434,949.00	74.33%

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	BARCLAYS BANK PLC	6,446,878.00	11.57%
2	上海琛晟资产管理有限公司-琛晟天	2,198,500.00	3.94%

	泰6号私募证券投资基金		
3	瞿洪桂	1,999,900.00	3.59%
4	丁慧娟	1,500,000.00	2.69%
5	王英捷	1,454,402.00	2.61%
6	许健辉	1,300,000.00	2.33%
7	方正证券股份有限公司	1,269,837.00	2.28%
8	罗雄强	1,200,000.00	2.15%
9	曾庆芳	1,175,200.00	2.11%
10	上海琛晟资产管理有限公司-琛晟天泰1号证券投资基金	1,134,900.00	2.04%

注：以上数据由中国证券登记结算公司提供，持有人为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	-	-

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情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2023年4月12日)基金份额总额	239,744,064.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	29,000,000.00
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	213,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-
本报告期期末基金份额总额	55,744,064.00

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期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

根据本基金管理人2023年6月22日的公告，经招商基金管理有限公司第六届董事会2023年第四次会议审议通过，钟文岳先生离任公司常务副总经理、财务负责人职务。

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的重大诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人没有受到监管部门的稽查或处罚，亦未收到关于基金管理人的高级管理人员受到监管部门的稽查或处罚的书面通知或文件。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
银河国际证券（香港）	1	412,585,768.16	93.96%	83,722.57	94.06%	-

HUATAI	2	26,518,095.23	6.04%	5,290.44	5.94%	-
安信证券	6	-	-	-	-	-
财通证券	3	-	-	-	-	-
长城证券	3	-	-	-	-	-
长江证券	6	-	-	-	-	-
诚通证券	1	-	-	-	-	-
大通证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	4	-	-	-	-	-
第一创业	3	-	-	-	-	-
东北证券	3	-	-	-	-	-
东方财富	3	-	-	-	-	-
东方证券	3	-	-	-	-	-
东海证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	6	-	-	-	-	-
东兴证券	3	-	-	-	-	-
方正证券	7	-	-	-	-	-
光大证券	3	-	-	-	-	-
广发证券	7	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	4	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	3	-	-	-	-	-
国信证券	3	-	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	4	-	-	-	-	-
宏信证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	5	-	-	-	-	-
华宝证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	4	-	-	-	-	-
华金证券	4	-	-	-	-	-
华泰证券	4	-	-	-	-	-
华西证券	3	-	-	-	-	-
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
九州证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	5	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	3	-	-	-	-	-
瑞信方正	2	-	-	-	-	-
山西证券	6	-	-	-	-	-

上海证券	2	-	-	-	-	-
申港证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	7	-	-	-	-	-
万和证券	1	-	-	-	-	-
五矿证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	5	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	5	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中航证券	2	-	-	-	-	-
中金财富证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	3	-	-	-	-	-
中泰证券	3	-	-	-	-	-
中信建投证券	5	-	-	-	-	-
中信证券	6	-	-	-	-	-
中银国际证券	4	-	-	-	-	-
甬兴证券	2	-	-	-	-	-

注：基金交易佣金根据券商季度综合评分结果给与分配，券商综合评分根据研究报告质量、路演质量、联合调研质量等维度进行打分，从多家服务券商中选取符合法律规范经营的综合能力靠前的券商给与佣金分配，季度评分和佣金分配分别由专人负责。

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	
	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
银河国际	-	-	-	-	-	-

证券（香港）						
HUATAI	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
九州证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-

瑞信方正	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
万和证券	-	-	-	-	-	-
五矿证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-
甬兴证券	-	-	-	-	-	-

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	招商纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金份额发售公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-02-06
2	招商纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金合同	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-02-06

3	招商纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金产品资料概要	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-02-06
4	招商纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金合同及招募说明书提示性公告	证券时报及基金管理人网站	2023-02-06
5	招商纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）托管协议	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-02-06
6	招商纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）招募说明书	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-02-06
7	关于招商纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）延长募集期的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-29
8	招商纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金合同生效公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-04-13
9	关于开放招商纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）日常申购赎回业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-04-20
10	招商纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）上市交易公告书提示性公告	证券时报及基金管理人网站	2023-04-20
11	招商纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）上市交易公告书	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-04-20
12	关于招商纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）增加广发证券股份有限公司、方正证券股份有限公司为场内申购赎回代办券商的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-04-25
13	招商纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）上市交易提示性公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-04-25
14	关于招商纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）流动性服务商的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-04-25
15	招商基金管理有限公司旗下部分基金增加华泰证券股份有限公司为场内申购赎回代办券商的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-04-28
16	招商基金管理有限公司旗下部分基金增加海通证券股份有限公司为场内申购赎回代办券商的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-05-05
17	招商基金管理有限公司关于提醒投资者持续完善身份信息资料的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会	2023-05-12

		基金电子披露网站	
18	关于招商纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）增加西南证券股份有限公司为场内申购赎回代办券商的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-05-15
19	关于招商纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）增加浙商证券股份有限公司为场内申购赎回代办券商的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-05-16
20	关于招商纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）2023 年境外主要市场节假日暂停申购和赎回业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-05-23
21	关于招商纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）增加东北证券股份有限公司为场内申购赎回代办券商的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-06-09
22	招商基金管理有限公司旗下部分基金增加国盛证券有限责任公司为场内申购赎回代办券商的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-06-14
23	关于招商纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）2023 年境外主要市场节假日暂停申购和赎回业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-06-15
24	招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-06-22
25	招商基金管理有限公司旗下部分基金增加华福证券有限责任公司为场内申购赎回代办券商的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-06-27
26	关于招商纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）2023 年境外主要市场节假日暂停申购和赎回业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-06-29

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20230424-20230503	-	152,579,924.00	152,579,900.00	24.00	0.00%
机构	2	20230504-	-	28,700,473.00	22,253,595.00	6,446,878.00	11.57%

		20230613					
产品特有风险							
本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况，可能会出现集中赎回甚至巨额赎回从而引发基金净值剧烈波动，甚至引发基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

注：1、报告期末持有份额占比按照四舍五入方法保留至小数点后第 2 位；

2、申购份额包含申购、定期定额投资、转换转入、红利再投资、买入等业务增加的份额，赎回份额包含赎回、转换转出、卖出等业务减少的份额。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、中国证券监督管理委员会批准设立招商基金管理有限公司的文件；

2、中国证券监督管理委员会批准招商纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）设立的文件；

3、《招商纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金合同》；

4、《招商纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）托管协议》；

5、《招商纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）招募说明书》；

6、基金管理人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

招商基金管理有限公司

地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

12.3 查阅方式

上述文件可在招商基金管理有限公司互联网站上查阅，或者在营业时间内到招商基金管理有限公司查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人招商基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-887-9555

网址：http://www.cmfchina.com

招商基金管理有限公司

2023 年 8 月 30 日