

# 南方纳斯达克 100 指数发起式证券投资 基金（QDII）2023 年中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 31 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。

基金托管人交通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 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

## 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	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
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	10
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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	11
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	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	13
§6 中期财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
§7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	44
7.3 期末按行业分类的权益投资组合	44
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细	45
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序的所有资产支持证券投资明细.....	56
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.....	56
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.....	56
7.11	投资组合报告附注.....	56
§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	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	57
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	58
§9	报告期末发起式基金发起资金持有份额情况.....	58
§10	开放式基金份额变动.....	59
§11	重大事件揭示.....	59
11.1	基金份额持有人大会决议.....	59
11.2	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
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	59
11.4	基金投资策略的改变.....	59
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	59
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	59
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	60
11.8	其他重大事件.....	61
§12	影响投资者决策的其他重要信息.....	61
12.1	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.....	61
§13	备查文件目录.....	62
13.1	备查文件目录.....	62
13.2	存放地点.....	62
13.3	查阅方式.....	62

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	南方纳斯达克 100 指数发起式证券投资基金（QDII）	
基金简称	南方纳斯达克 100 指数发起（QDII）	
基金主代码	016452	
交易代码	016452	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 11 月 29 日	
基金管理人	南方基金管理股份有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	57,451,091.42 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	南方纳斯达克 100 指数发起（QDII）A	南方纳斯达克 100 指数发起（QDII）C
下属分级基金的交易代码	016452	016453
报告期末下属分级基金的份额总额	25,684,704.22 份	31,766,387.20 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求与业绩比较基准相似的回报。
投资策略	<p>本基金为被动式指数基金，原则上采用完全复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。</p> <p>当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，并辅之以金融衍生产品投资管理等，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。主要投资策略包括：资产配置策略、股票投资策略、金融衍生品投资策略、债券投资策略、存托凭证投资策略、境外市场基金投资策略、境外回购交易及证券借贷交易策略等以更好地跟踪标的指数，实现基金投资目标。</p>
业绩比较基准	经汇率调整后的纳斯达克 100 指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，一般而言，其长期平均风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的市场相似的风险收益特征。本基金可投资于境外证券，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，本基金还面临汇率风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。
--	---

### 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	南方基金管理股份有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	常克川
	联系电话	0755-82763888
	电子邮箱	manager@southernfund.com
客户服务电话	400-889-8899	95559
传真	0755-82763889	021-62701216
注册地址	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号
办公地址	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码	518017	200336
法定代表人	周易	任德奇

### 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	-
	英文	HSBC Bank (China) Company Ltd.
注册地址	-	香港中环皇后大道中一号汇丰总行大厦
办公地址	-	香港九龙深旺道一号，汇丰中心一座六楼
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	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.nffund.com">http://www.nffund.com</a>
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址、基金上市交易的证券交易所（如有）

### 2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	南方基金管理股份有限公司	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼

### § 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

##### 1、南方纳斯达克 100 指数发起 (QDII) A

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日 - 2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-13,941.18
本期利润	5,917,731.97
加权平均基金份额本期利润	0.3937
本期加权平均净值利润率	34.10%
本期基金份额净值增长率	36.10%
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	-38,307.94
期末可供分配基金份额利润	-0.0015
期末基金资产净值	34,852,578.76
期末基金份额净值	1.3569
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	35.69%

##### 2、南方纳斯达克 100 指数发起 (QDII) C

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日 - 2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-59,810.31
本期利润	3,399,153.91
加权平均基金份额本期利润	0.5159
本期加权平均净值利润率	41.58%
本期基金份额净值增长率	36.23%
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	-105,854.92
期末可供分配基金份额利润	-0.0033
期末基金资产净值	43,132,278.56
期末基金份额净值	1.3578
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	35.78%

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、对期末可供分配利润，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。

### 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

南方纳斯达克 100 指数发起 (QDII) A

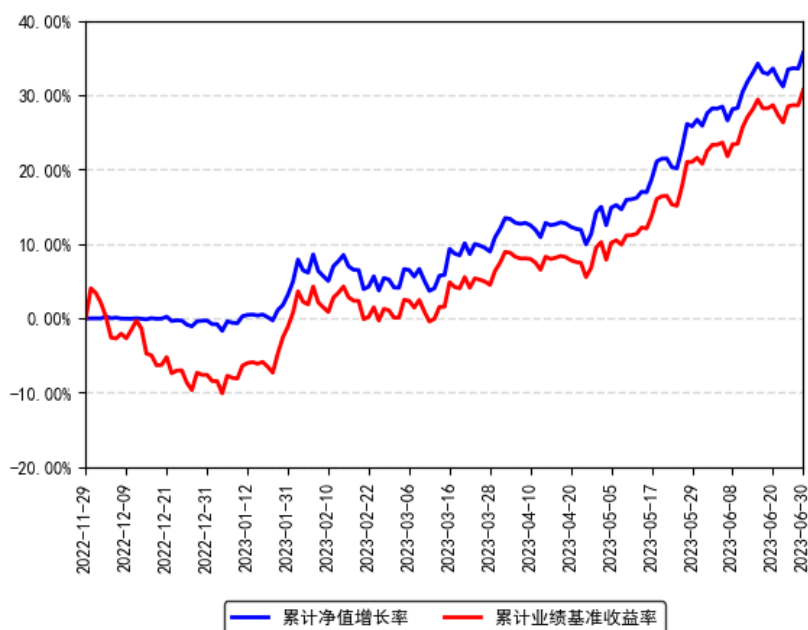
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	7.78%	0.94%	8.21%	0.96%	-0.43%	-0.02%
过去三个月	19.56%	1.04%	19.96%	1.04%	-0.40%	0.00%
过去六个月	36.10%	1.13%	41.44%	1.21%	-5.34%	-0.08%
自基金合同生效起至今	35.69%	1.03%	30.70%	1.31%	4.99%	-0.28%

南方纳斯达克 100 指数发起 (QDII) C

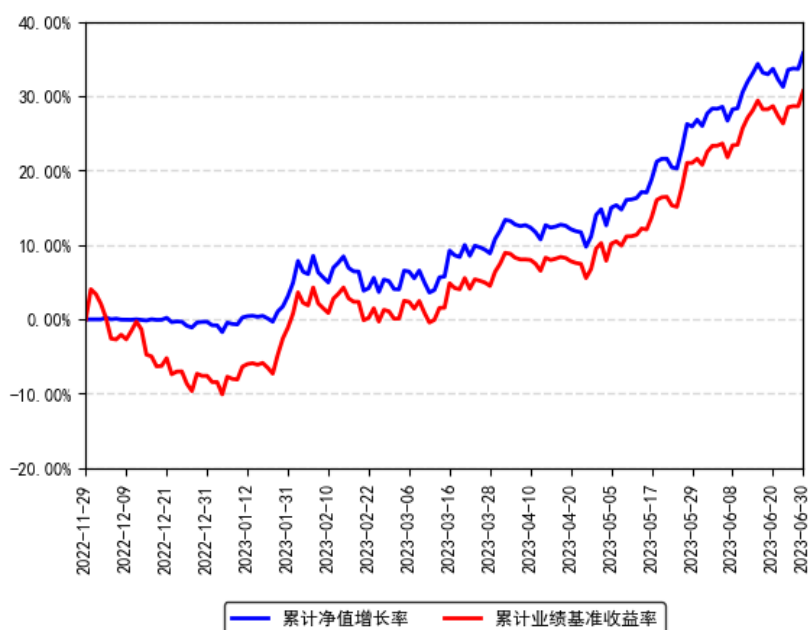
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	7.75%	0.94%	8.21%	0.96%	-0.46%	-0.02%
过去三个月	19.77%	1.03%	19.96%	1.04%	-0.19%	-0.01%
过去六个月	36.23%	1.12%	41.44%	1.21%	-5.21%	-0.09%
自基金合同生效起至今	35.78%	1.03%	30.70%	1.31%	5.08%	-0.28%

#### 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

南方纳斯达克100指数发起（QDII）A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



南方纳斯达克100指数发起（QDII）C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金合同于2022年11月29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，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

## § 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

1998 年 3 月 6 日，经中国证监会批准，南方基金管理有限公司作为国内首批规范的基金管理公司正式成立，成为我国“新基金时代”的起始标志。

2018 年 1 月，公司整体变更设立为南方基金管理股份有限公司。2019 年 7 月，根据南方基金管理股份有限公司股东大会决议，并经中国证监会核准，本公司原股东及新增股东共同认购了本公司新增的注册资本，认购完成后注册资本为 36172 万元人民币。目前，公司总部设在深圳，在北京、上海、深圳、南京、成都、合肥等地设有分公司，在香港和深圳前海设有子公司——南方东英资产管理有限公司（香港子公司）和南方资本管理有限公司（深圳子公司）。其中，南方东英是境内基金公司获批成立的第一家境外分支机构。

南方基金管理股份有限公司旗下管理公募基金、全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和专户组合，已发展成为产品种类丰富、业务领域全面、经营业绩优秀、资产管理规模位居前列的基金管理公司之一。

#### 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		
张其思	本基金基金经理	2022 年 11 月 29 日	-	9 年	波士顿大学数理金融硕士，特许金融分析师（CFA）、金融风险管理师（FRM），具有基金从业资格。曾就职于美国 Charles River Development、Citizens Financial Group，历任固定收益部分析员、资本管理部量化分析师。2017 年 4 月加入南方基金，历任数量化投资部研究员、指数投资部研究员、国际业务部研究员。2020 年 6 月 2 日至 2021 年 3 月 26 日，任南方原油基金经理助理；2021 年 3 月 26 日至今，任美国 REIT、南方原油基金经理；2022 年 11 月 29 日至今，任南方纳斯达克 100 指数发起（QDII）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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券投资基金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合规守信情况的说明

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》等有关法律法规、中国证监会和本基金基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合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

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。公司每季度对旗下组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析。

本报告期内，两两组合间单日、3 日、5 日时间窗口内同向交易买入溢价率均值或卖出溢价率均值显著不为 0 的情况不存在，并且交易占比也没有明显异常，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

#### 4.4.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的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% 的交易次数为 13 次，是由于指数投资组合的投资策略导致。

### 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

本基金的投资目标是通过指数化投资策略，力争获得与业绩比较基准相似的回报。在基金的管理中我们采用了全复制法跟踪标的指数，基金投资组合中的证券以贴近指数成分股的配比进行配置。

自基金建仓结束以来至 2023 年一季度末，纳斯达克 100 指数上涨 27.14%，人民币相对美元贬值 4.12%，基金业绩基准上涨 30.76%；同期基金净值上涨 30.27%，业绩表现良好保持了对业绩基准的跟踪。

未来，本基金投资团队将密切关注市场变化趋势，谨慎勤勉、恪尽职守，力争实现对标的指数的有效跟踪。

#### 4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末, 本基金 A 份额净值为 1.3569 元, 报告期内, 份额净值增长率为 36.10%, 同期业绩基准增长率为 41.44%; 本基金 C 份额净值为 1.3578 元, 报告期内, 份额净值增长率为 36.23%, 同期业绩基准增长率为 41.44%。

#### 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

美国经济当前继续处于紧缩周期中, 但加息周期已接近尾声。部分美联储官员认为 6 月会议上本可加息, 美联储整体态度支持继续加息, 但对于经济数据细节转弱进行了深入讨论。当前美联储最迫切的关注点仍是通胀, 因此利率政策方向上仍然延续加息趋势。与此同时, 美联储讨论了较多各类经济数据细节上的风险, 未来经济数据转弱也完全在美联储的预期中, 届时美联储应会有充分的准备将货币政策由抑制性转为刺激性。

反映美国经济现状的“硬指标”表现良好。无论是生产端还是消费端都还稳健, 就业总体也保持良好的状态, 尚未出现明显恶化势头。美国通胀绝对水平仍然显著高于美联储 2% 的目标值, 但已经确立回落趋势, 核心通胀也已出现见顶迹象, 预计此后通胀将继续快速下降。但另一方面, 领先指标以及一些反映市场参与者信心的“软指标”已经明显恶化, 经济领先指数同环比均已转负, 制造业 PMI 已经持续半年以上低于 50 荣枯线, 历史上这种情形出现后经济出现衰退的风险较高。

展望后市, 我们认为当前加息周期时间的拉长推后了加息终止这一利好的落地时间, 短期内可能出现一些震荡, 未来美联储的货币政策一旦转向, 市场上的增量流动性对于纳指这类风险资产预计将产生强有力的支持作用。整体我们对美国纳斯达克 100 指数表现短期内持中性偏乐观态度, 中长期保持乐观。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定, 本基金管理人应严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定, 对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度, 明确基金估值的程序和技术, 建立了估值委员会, 组成人员包括副总经理、督察长、权益研究部总经理、固定收益研究部总经理、指数投资部总经理、现金及债券指数投资部总经理、风险管理部总经理及运作保障部总经理等。本基金管理人使用可靠的估值业务系统, 估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。基金管理人改变估值技术, 导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上的, 对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。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。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。基金经理可参与估值原则和方法的讨论, 但不参与估值价格的最终决策。本报告期内, 参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 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，本基金报告期末未进行利润分配。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

不适用。

### § 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，基金托管人在南方纳斯达克 100 指数发起式证券投资基金（QDII）的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

#### 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，南方基金管理股份有限公司在南方纳斯达克 100 指数发起式证券投资基金（QDII）投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

#### 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

本报告期内，由南方基金管理股份有限公司编制并经托管人复核审查的有关南方纳斯达克 100 指数发起式证券投资基金（QDII）的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

### § 6 中期财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：南方纳斯达克 100 指数发起式证券投资基金（QDII）

报告截止日: 2023 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产:			
银行存款	6.4.7.1	7,791,221.19	9,031,134.75
结算备付金		335,999.70	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	73,819,747.54	-
其中: 股票投资		66,513,722.81	-
基金投资		7,306,024.73	-
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	6.4.7.5	-	-
其中: 债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		9,249.53	216.18
应收申购款		3,827,589.99	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	5,637,496.32
资产总计		85,783,807.95	14,668,847.25
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		3,321,401.76	2,792,380.87
应付赎回款		4,352,366.25	-
应付管理人报酬		29,946.00	6,058.67
应付托管费		9,982.02	2,019.57
应付销售服务费		7,746.78	321.88
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	6.4.7.9	77,507.82	-
负债合计		7,798,950.63	2,800,780.99
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	57,451,091.42	11,904,378.75
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	20,533,765.90	-36,312.49
净资产合计		77,984,857.32	11,868,066.26
负债和净资产总计		85,783,807.95	14,668,847.25

注 1. 报告截止日 2023 年 6 月 30 日，南方纳斯达克 100 指数发起 (QDII) A 份额净值 1.3569 元，基金份额总额 25,684,704.22 份；南方纳斯达克 100 指数发起 (QDII) C 份额净值 1.3578 元，基金份额总额 31,766,387.20 份；总份额合计 57,451,091.42 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2023 年度和 2022 年 11 月 29 日 (基金合同生效日) 至 2022 年 12 月 31 日止期间。

## 6.2 利润表

会计主体：南方纳斯达克 100 指数发起式证券投资基金 (QDII)

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		9,507,271.41
1.利息收入		20,576.65
其中：存款利息收入	6.4.7.13	20,576.65
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)		240,293.32
其中：股票投资收益	6.4.7.14	161,229.20
基金投资收益	6.4.7.15	-586.95
债券投资收益	6.4.7.16	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.17	-
贵金属投资收益	6.4.7.18	-
衍生工具收益	6.4.7.19	-

股利收益	6.4.7.20	79,651.07
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)	6.4.7.21	9,390,637.37
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-145,984.03
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.22	1,748.10
减:二、营业总支出		190,385.53
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	75,396.99
2.托管费	6.4.10.2.2	25,132.35
3.销售服务费	6.4.10.2.3	12,026.11
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	6.4.7.23	-
7.税金及附加		-
8.其他费用	6.4.7.24	77,830.08
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		9,316,885.88
减:所得税费用		-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		9,316,885.88
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		9,316,885.88

### 6.3 净资产(基金净值)变动表

会计主体:南方纳斯达克 100 指数发起式证券投资基金(QDII)

本报告期:2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位:人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	11,904,378.75	-	-36,312.49	11,868,066.26
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净	11,904,378.75	-	-36,312.49	11,868,066.26

资产(基金净值)				
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	45,546,712.67	-	20,570,078.39	66,116,791.06
(一)、综合收益总额	-	-	9,316,885.88	9,316,885.88
(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)	45,546,712.67	-	11,253,192.51	56,799,905.18
其中: 1.基金申购款	60,423,304.40	-	14,703,958.64	75,127,263.04
2.基金赎回款	-14,876,591.73	-	-3,450,766.13	-18,327,357.86
(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)	57,451,091.42	-	20,533,765.90	77,984,857.32

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:

\_\_\_\_杨小松\_\_\_\_                      \_\_\_\_徐超\_\_\_\_                      \_\_\_\_徐超\_\_\_\_  
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

南方纳斯达克 100 指数发起式证券投资基金(QDII)(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2022]1510号《关于准予南方纳斯达克 100 指数发起式证券投资基金(QDII)注册的批复》注册,由南方基金管理股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方纳斯达克 100 指数发起式证券投资基金(QDII)基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 11,895,366.60 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2022)第 0960 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《南方纳斯达

克 100 指数发起式证券投资基金(QDII)基金合同》于 2022 年 11 月 29 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 11,904,378.75 份基金份额,其中认购资金利息折合 9,012.15 份基金份额。本基金的基金管理人为南方基金管理股份有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司,境外资产托管人为香港上海汇丰银行有限公司。

本基金为发起式基金,发起资金认购部分为 10,000,000.00 份基金份额,发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取前端认购/申购费用,在赎回时根据持有期限收取赎回费用,不从本类别基金资产净值中计提销售服务费的基金份额,称为 A 类基金份额;从本类别基金资产净值中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额、在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额,称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方纳斯达克 100 指数发起式证券投资基金(QDII)基金合同》的有关规定,本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股(含存托凭证)。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在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金(含 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;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;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;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银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金可以进行境外证券借贷交易、境外正回购交易、逆回购交易。有关证券借贷交易的内容以专门签署的三方或多方协议约定为准。本基金的投资组合比例为:股票资产投资比例不低于基金资产的 80%,投资于纳斯达克 100 指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%;现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购

款等。本基金的业绩比较基准为：经汇率调整后的纳斯达克 100 指数收益率 $\times$ 95%+银行人民币活期存款利率(税后) $\times$ 5%。

## 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、本基金基金合同和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

## 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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净资产变动情况等有关信息。

## 6.4.4 重要会计政策和会计估计

### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日和 2022 年 11 月 29 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日。

### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 6.4.4.3 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商业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、资产支持证券投资和基金投资，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。

#### 6.4.4.4 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。

本基金考虑在资产负债表日无须付出不必要的额外成本和努力即可获得的有关过去事项、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。

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。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值; 估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的, 按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的, 应对市场交易价格进行调整, 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) 当金融工具不存在活跃市场, 采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时, 优先使用可观察输入值, 只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下, 才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件, 应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的; 且 2) 交易双方准备按净额结算时, 金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时, 申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时, 申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列, 并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 6.4.4.9 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扣除按票面利率(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后的净额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。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

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。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 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，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

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

无。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关境内外财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收企业所得税。

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

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

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	7,791,221.19
等于：本金	7,790,899.16
加：应计利息	322.03
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	7,791,221.19

注：货币资金中包括以下外币余额：

项目	本期末		
	2023 年 6 月 30 日		
	外币金额	汇率	折合人民币
美元	982,306.21	7.2258	7,097,948.21
合计			7,097,948.21

#### 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	57,277,997.32	-	66,513,722.81	9,235,725.49
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	7,174,734.48	-	7,306,024.73	131,290.25
其他	-	-	-	-
合计	64,452,731.80	-	73,819,747.54	9,367,015.74

#### 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。

#### **6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况**

本基金本报告期末未持有期货合约。

#### **6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况**

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

#### **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 债权投资**

##### **6.4.7.5.1 债权投资情况**

本基金本报告期末无债权投资。

##### **6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况**

本基金本报告期末无债权投资减值准备计提。

#### **6.4.7.6 其他债权投资**

##### **6.4.7.6.1 其他债权投资情况**

本基金本报告期末无其他债权投资。

##### **6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况**

本基金本报告期末无其他债权投资减值准备计提。

#### **6.4.7.7 其他权益工具投资**

##### **6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况**

本基金本报告期末无其他权益工具投资。

##### **6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况**

本基金本报告期末无其他权益工具投资。

#### **6.4.7.8 其他资产**

本基金本报告期末无其他资产。

## 6.4.7.9 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	77,507.82
其他	-
合计	77,507.82

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

南方纳斯达克 100 指数发起 (QDII) A		
项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	10,639,538.63	10,639,538.63
本期申购	18,877,552.56	18,877,552.56
本期赎回 (以“-”号填列)	-3,832,386.97	-3,832,386.97
基金拆分/份额折算前	-	-
基金份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	25,684,704.22	25,684,704.22

南方纳斯达克 100 指数发起 (QDII) C		
项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	1,264,840.12	1,264,840.12
本期申购	41,545,751.84	41,545,751.84
本期赎回 (以“-”号填列)	-11,044,204.76	-11,044,204.76
基金拆分/份额折算前	-	-
基金份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	31,766,387.20	31,766,387.20

注：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。

## 6.4.7.11 其他综合收益

无。

**6.4.7.12 未分配利润**

单位：人民币元

南方纳斯达克 100 指数发起 (QDII) A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-11,045.73	-21,112.08	-32,157.81
本期利润	-13,941.18	5,931,673.15	5,917,731.97
本期基金份额交易产生的变动数	-13,321.03	3,295,621.41	3,282,300.38
其中：基金申购款	-16,802.51	4,115,985.61	4,099,183.10
基金赎回款	3,481.48	-820,364.20	-816,882.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-38,307.94	9,206,182.48	9,167,874.54

南方纳斯达克 100 指数发起 (QDII) C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,645.13	-2,509.55	-4,154.68
本期利润	-59,810.31	3,458,964.22	3,399,153.91
本期基金份额交易产生的变动数	-44,399.48	8,015,291.61	7,970,892.13
其中：基金申购款	-69,398.27	10,674,173.81	10,604,775.54
基金赎回款	24,998.79	-2,658,882.20	-2,633,883.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-105,854.92	11,471,746.28	11,365,891.36

**6.4.7.13 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	20,370.17
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	206.48
合计	20,576.65

**6.4.7.14 股票投资收益****6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	161,229.20
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	161,229.20

#### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,517,330.41
减：卖出股票成本总额	1,345,738.01
减：交易费用	10,363.20
买卖股票差价收入	161,229.20

注：上述交易费用（如有）包含股票买卖产生的交易费用。

#### 6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无股票赎回差价收入。

#### 6.4.7.14.4 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。

#### 6.4.7.14.5 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。

#### 6.4.7.15 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	-
减：卖出/赎回基金成本总额	-
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	-
减：交易费用	586.95
基金投资收益	-586.95

注：上述交易费用（如有）包含基金买卖或申赎产生的交易费用。

#### 6.4.7.16 债券投资收益

##### 6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期内无债券投资收益。

##### 6.4.7.16.2 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。

#### 6.4.7.17 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.17.1 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。

#### 6.4.7.18 贵金属投资收益

##### 6.4.7.18.1 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。

#### 6.4.7.19 衍生工具收益

##### 6.4.7.19.1 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。

##### 6.4.7.19.2 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。

#### 6.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	75,040.00
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	4,611.07
合计	79,651.07

#### 6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	9,390,637.37
——股票投资	9,259,347.12
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	131,290.25
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
——期货投资	-
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	9,390,637.37

#### 6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	1,748.10
合计	1,748.10

#### 6.4.7.23 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

#### 6.4.7.24 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	18,000.45
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	315.00
其他	7.26
合计	77,830.08

#### 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

无。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理股份有限公司(“南方基金”)	基金管理人、登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司(“交通银行”)	基金托管人、基金销售机构
香港上海汇丰银行有限公司(“香港上海汇丰银行”)	境外资产托管人
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 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 基金交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的基金交易。

#### 6.4.10.1.5 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。

#### 6.4.10.1.6 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 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	75,396.99
其中：支付销售机构的客户维护费	14,431.32

注：支付基金管理人南方基金的管理人报酬按前一日基金资产净值的 0.60% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.60% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	25,132.35

注：支付基金托管人交通银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
----------	------------------------------------

各关联方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方纳斯达克 100 指数发起（QDII）A	南方纳斯达克 100 指数发起（QDII）C	合计
华泰证券	-	231.42	231.42
交通银行	-	943.67	943.67
南方基金	-	746.55	746.55
合计	-	1,921.64	1,921.64

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.30% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给南方基金，再由南方基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额的基金资产净值 X 0.30% / 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

份额单位：份

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	南方纳斯达克 100 指数发起（QDII）A	南方纳斯达克 100 指数发起（QDII）C
报告期初持有的基金份额	10,008,550.85	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,008,550.85	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	17.42%	-

基金管理人南方基金投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

#### 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

无。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行	693,272.98	5,260.42
香港上海汇丰银行	7,097,948.21	15,109.75

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行股份有限公司和境外托管人香港上海汇丰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。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 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

无。

#### 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

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金、货币市场基金。本基金为指数型基金，通过跟踪纳斯达克 100 指数表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金原则上通过指数复制法进行被动式指数化投资，根据标的指数成份股的基准权重构建股票投资组合，并根据成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在特殊情况下，本基金将配合使用优化方法作为补充，以保证对标的指数的有效跟踪。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规与风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估，督察长负责组织指导监察稽核工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型、日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在此可承受的范围内。

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的境内托管人及境外资产托管人，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小；在场外交易市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程,通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险。信用等级评估以内部信用评级为主,外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险,以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外,本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级,通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制,通过分散化投资以分散信用风险。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额,另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为目的投资股指期货,以对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等,主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差,达到有效跟踪标的指数的目的。

于本期末,本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息,可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息,因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

本基金本报告期末无金融资产和金融负债的到期期限分析。

#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理,通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持部分证券在证券交易所上市,其余亦可在银行间同业市场交易,部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注“期末本基金持有的流通受限证券”。此外,如根据基金合同的规定,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,

其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

同时, 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逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外, 基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度, 根据质押品的资质确定质押率水平, 持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额, 并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时, 可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险, 包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险, 其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控, 并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息, 因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。

##### 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	7,791,221.19	-	-	-	7,791,221.19
结算备付金	335,999.70	-	-	-	335,999.70
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	73,819,747.54	73,819,747.54
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-

其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	9,249.53	9,249.53
应收申购款	1,023,737.67	-	-	2,803,852.32	3,827,589.99
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	9,150,958.56	-	-	76,632,849.39	85,783,807.95
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	-	-	-	3,321,401.76	3,321,401.76
应付赎回款	-	-	-	4,352,366.25	4,352,366.25
应付管理人报酬	-	-	-	29,946.00	29,946.00
应付托管费	-	-	-	9,982.02	9,982.02
应付销售服务费	-	-	-	7,746.78	7,746.78
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	-	-	-	77,507.82	77,507.82
负债总计	-	-	-	7,798,950.63	7,798,950.63
利率敏感度缺口	9,150,958.56	-	-	68,833,898.76	77,984,857.32
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	9,031,134.75	-	-	-	9,031,134.75
结算备付金	-	-	-	-	-

存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	5,637,496.32	5,637,496.32
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	216.18	216.18
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	9,031,134.75	-	-	5,637,712.50	14,668,847.25
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	-	-	-	2,792,380.87	2,792,380.87
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	6,058.67	6,058.67
应付托管费	-	-	-	2,019.57	2,019.57
应付销售服务费	-	-	-	321.88	321.88
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	-	-	-	-	-
负债总计	-	-	-	2,800,780.99	2,800,780.99

利率敏感度缺口	9,031,134.75	-	-	2,836,931.51	11,868,066.26
---------	--------------	---	---	--------------	---------------

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币元)	
		本期末(2023年6月30日)	上年度末(2022年12月31日)
	1.市场利率平行上升25个基点	0.00	0.00
2.市场利率平行下降25个基点	0.00	0.00	

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有不以记账本位币计价的资产和负债,因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位:人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日					合计
	美元折合人民币	港币折合人民币	欧元折合人民币	日元折合人民币	其他币种折合人民币	
以外币计价的资产						
银行存款	7,097,948.21	-	-	-	-	7,097,948.21
结算备付金	335,999.70	-	-	-	-	335,999.70
交易性金融资产	73,819,747.54	-	-	-	-	73,819,747.54
应收股利	9,249.53	-	-	-	-	9,249.53
资产合计	81,262,944.98	-	-	-	-	81,262,944.98
以外币计价的负债						
应付清算款	3,321,401.76	-	-	-	-	3,321,401.76
负债合计	3,321,401.76	-	-	-	-	3,321,401.76
资产负债表外汇风险敞口净额	77,941,543.22	-	-	-	-	77,941,543.22

项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日					合计
	美元折合人民币	港币折合人民币	欧元折合人民币	日元折合人民币	其他币种折合人民币	
以外币计价的资产						
银行存款	2,919,505.44	-	-	-	-	2,919,505.44
交易性金融资产	5,637,496.32	-	-	-	-	5,637,496.32
应收股利	216.18	-	-	-	-	216.18
资产合计	8,557,217.94	-	-	-	-	8,557,217.94
以外币计价的负债						
应付清算款	2,792,380.87	-	-	-	-	2,792,380.87
负债合计	2,792,380.87	-	-	-	-	2,792,380.87
资产负债表外汇风险敞口净额	5,764,837.07	-	-	-	-	5,764,837.07

#### 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）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	3,897,077.16	288,241.85
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-3,897,077.16	-288,241.85

#### 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。

本基金原则上通过指数复制法进行被动式指数化投资，根据标的指数成份股的基准权重构建股票投资组合，并根据成份股及其权重的变动而进行相应调整，通过指数化分散投资降低其他价格风险。

本基金股票资产投资比例不低于基金资产的 80%，投资于纳斯达克 100 指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所

持有的证券价格实施监控, 定期运用多种定量方法对基金进行风险度量, 来测试本基金面临的潜在价格风险, 及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位: 人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产-股票投资	66,513,722.81	85.29	5,637,496.32	47.50
交易性金融资产-基金投资	7,306,024.73	9.37	-	-
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	73,819,747.54	94.66	5,637,496.32	47.50

#### 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( 2023 年 6 月 30 日 )	上年度末( 2022 年 12 月 31 日 )
	1.组合自身基准上升 5%	3,063,988.18	10,352.05
	2.组合自身基准下降 5%	-3,063,988.18	-10,352.05

#### 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	73,819,747.54
第二层次	-
第三层次	-
合计	73,819,747.54

#### 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；对于定期开放的基金投资，本基金不会于封闭期将相关基金列入第一层次；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、债券和基金的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

于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

序号	项目	金额 (人民币元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	66,513,722.81	77.54
	其中：普通股	-	-
	存托凭证	66,513,722.81	77.54
2	基金投资	7,306,024.73	8.52
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	8,127,220.89	9.47
8	其他资产	3,836,839.52	4.47
9	合计	85,783,807.95	100.00

## 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	66,513,722.81	85.29
合计	66,513,722.81	85.29

## 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（%）
能源	79,613.58	0.10
材料	-	-
工业	1,135,649.37	1.46
非必需消费品	9,991,286.43	12.81
必需消费品	2,870,278.68	3.68
医疗保健	2,291,506.82	2.94
金融	-	-
科技	37,814,671.37	48.49
通讯	12,116,394.63	15.54
公用事业	214,321.93	0.27
房地产	-	-
政府	-	-
合计	66,513,722.81	85.29

本基金对以上行业分类采用彭博行业分类标准。

### 7.3.2 期末积极投资按行业分类的权益投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的权益投资。

## 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细

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

## 7.4.1.1 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 UW	纳斯达克证券交易所	美国	4,389	10,799,897.89	13.85
2	Apple Inc	苹果公司	AAPL UW	纳斯达克证券交易所	美国	7,550	10,581,992.62	13.57
3	Amazon.com Inc	亚马逊公司	AMZN UW	纳斯达克证券交易所	美国	5,830	5,491,599.33	7.04
4	NVIDIA Corp	英伟达	NVDA UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,762	5,385,831.25	6.91
5	Tesla Inc	特斯拉公司	TSLA UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,800	3,404,695.80	4.37
6	Meta Platforms Inc	Meta 平台股份有限公司	META UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,630	3,380,065.94	4.33
7	Alphabet Inc	Alphabet 公司	GOOGL UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,440	2,975,353.21	3.82
8	Alphabet Inc	Alphabet 公司	GOOG UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,258	2,847,834.17	3.65
9	Broadcom Inc	博通股份有限公司	AVGO UW	纳斯达克证券交易所	美国	244	1,529,361.67	1.96
10	PepsiCo Inc	百事可乐	PEP UW	纳斯达克证券交易所	美国	862	1,153,668.63	1.48
11	Costco Wholesale Corp	开市客	COST UW	纳斯达克证券交易所	美国	291	1,132,055.83	1.45
12	Adobe Inc	奥多比	ADBE UW	纳斯达克证券交易所	美国	295	1,042,336.46	1.34

				交易所				
13	Cisco Systems Inc	思科系统股份有限公司	CSCO UW	纳斯达克 证券 交易所	美国	2,116	791,093 .88	1.01
14	Netflix Inc	奈飞公司	NFLX UW	纳斯达克 证券 交易所	美国	246	782,991 .59	1.00
15	Texas Instruments Inc	德州仪器	TXN UW	纳斯达克 证券 交易所	美国	567	737,547 .09	0.95
16	Advanced Micro Devices Inc	AMD 公司	AMD UW	纳斯达克 证券 交易所	美国	891	733,373 .97	0.94
17	Intel Corp	英特尔	INTC UW	纳斯达克 证券 交易所	美国	2,713	655,544 .23	0.84
18	Honeywell International Inc	霍尼韦尔	HON UW	纳斯达克 证券 交易所	美国	437	655,217 .48	0.84
19	QUALCOMM Inc	高通公司	QCOM UW	纳斯达克 证券 交易所	美国	755	649,420 .22	0.83
20	T-Mobile US Inc	T-Mobile US 股份有限公司	TMUS UW	纳斯达克 证券 交易所	美国	630	632,308 .08	0.81
21	Comcast Corp	康卡斯特公司	CMCS A UW	纳斯达克 证券 交易所	美国	2,052	616,076 .04	0.79
22	Intuitive Surgical Inc	直觉外科手术公司	ISRG UW	纳斯达克 证券 交易所	美国	229	565,810 .92	0.73
23	Applied Materials Inc	应用材料	AMAT UW	纳斯达克 证券 交易所	美国	535	558,763 .17	0.72
24	Analog Devices Inc	亚德诺半导体	ADI UW	纳斯达克 证券 交易所	美国	326	458,896 .54	0.59
25	Starbucks Corp	星巴克公司	SBUX UW	纳斯达克 证券	美国	635	454,525 .22	0.58

				交易所				
26	Amgen Inc	安进公司	AMGN UW	纳斯达克 证券 交易所	美国	275	441,174 .83	0.57
27	Intuit Inc	Intuit 股 份有限 公司	INTU UW	纳斯达克 证券 交易所	美国	133	440,334 .98	0.56
28	Palo Alto Networks Inc	Palo Alto Networks 股 份有限 公司	PANW UW	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美国	201	371,099 .10	0.48
29	PayPal Holdings Inc	Paypal 控 股股 份有 限公 司	PYPL UW	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美国	734	353,918 .38	0.45
30	Vertex Pharmaceuticals Inc	福泰制 药	VRTX UW	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美国	132	335,653 .73	0.43
31	Lam Research Corp	泛林集 团	LRCX UW	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美国	69	320,517 .27	0.41
32	Activision Blizzard Inc	动视暴 雪股 份有 限公 司	ATVI UW	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美国	517	314,922 .76	0.40
33	KLA Corp	KLA 公 司	KLAC UW	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美国	87	304,905 .20	0.39
34	Automatic Data Processing Inc	ADP 公 司	ADP UW	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美国	175	277,927 .75	0.36
35	Micron Technology Inc	美光科 技股 份有 限公 司	MU UW	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美国	603	274,980 .20	0.35
36	Booking Holdings Inc	Booking 控 股股 份有 限公 司	BKNG UW	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美国	14	273,168 .62	0.35
37	Mondel	亿滋国	MDLZ	纳斯 达	美国	502	264,579	0.34

	ez Internati onal Inc	际	UW	克证券 交易所			.03	
38	Gilead Science s Inc	吉利德 科学	GILD UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	470	261,739 .43	0.34
39	Regener on Pharma ceutical s Inc	再生元 制药股 份有限 公司	REGN UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	45	233,641 .18	0.30
40	CSX Corp	CSX 公 司	CSX UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	872	214,860 .61	0.28
41	Synopsy s Inc	新思科 技公司	SNPS UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	64	201,355 .88	0.26
42	ON Semico nductor Corp	安森美 半导体 公司	ON UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	203	138,733 .48	0.18
43	Fiserv Inc	Fiserv 公司	FI UN	纽约证 券交易 所	美国	147	133,995 .60	0.17
44	ASML Holding NV	阿斯麦 控股公 司	ASML UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	23	120,448 .67	0.15
45	Mercad oLibre Inc	Mercad oLibre 股份有 限公司	MELI UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	13	111,275 .87	0.14
46	O'Reilly Automo tive Inc	O'Reilly 汽车股 份有限 公司	ORLY UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	16	110,444 .91	0.14
47	Monster Beverag e Corp	怪兽饮 料公司	MNST UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	266	110,403 .29	0.14
48	Cadence Design Systems Inc	Cadence 设计系 统股份 有限公 司	CDNS UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	58	98,286. 49	0.13
49	Marvell	美满电	MRVL	纳斯达	美国	216	93,303.	0.12

	Technology Inc	子科技公司	UW	克证券交易所			00	
50	Fortinet Inc	Fortinet 股份有限公司	FTNT UW	纳斯达克证券交易所	美国	160	87,391.72	0.11
51	Cintas Corp	CINTAS 公司	CTAS UW	纳斯达克证券交易所	美国	24	86,203.22	0.11
52	Marriott International Inc/MD	万豪国际	MAR UW	纳斯达克证券交易所	美国	62	82,293.05	0.11
53	Charter Communications Inc	Charter 通信公司	CHTR UW	纳斯达克证券交易所	美国	31	82,290.81	0.11
54	NXP Semiconductors NV	恩智浦半导体公司	NXPI UW	纳斯达克证券交易所	美国	53	78,385.77	0.10
55	Airbnb Inc	爱彼迎股份有限公司	ABNB UW	纳斯达克证券交易所	美国	83	76,862.86	0.10
56	Biogen Inc	渤健公司	BIIB UW	纳斯达克证券交易所	美国	37	76,155.96	0.10
57	PACCAR Inc	帕卡	PCAR UW	纳斯达克证券交易所	美国	124	74,950.33	0.10
58	Copart Inc	Copart 股份有限公司	CPRT UW	纳斯达克证券交易所	美国	113	74,474.37	0.10
59	Microchip Technology Inc	微芯科技股份有限公司	MCHP UW	纳斯达克证券交易所	美国	112	72,504.26	0.09
60	Dexcom Inc	Dexcom 股份有限公司	DXCM UW	纳斯达克证券交易所	美国	78	72,429.83	0.09
61	Old Dominion Freight Line Inc	Old Dominion Freight Line 股	ODFL UW	纳斯达克证券交易所	美国	26	69,465.23	0.09

		份有限公司						
62	Workday Inc	Workday 股份有限公司	WDAY UW	纳斯达克 证券交易所	美国	42	68,553. 91	0.09
63	Lululemon Athletica Inc	Lululemon Athletica 股份有限公司	LULU UW	纳斯达克 证券交易所	美国	25	68,374. 13	0.09
64	Moderna Inc	莫德纳 公司	MRNA UW	纳斯达克 证券交易所	美国	75	65,845. 10	0.08
65	Ross Stores Inc	罗斯百 货股份 有限公司	ROST UW	纳斯达克 证券交易所	美国	81	65,628. 55	0.08
66	Verisk Analytics Inc	Verisk 分析公 司	VRSK UW	纳斯达克 证券交易所	美国	40	65,329. 90	0.08
67	Autodesk Inc	欧特克	ADSK UW	纳斯达克 证券交易所	美国	44	65,052. 72	0.08
68	AstraZeneca PLC	阿斯利 康公共 有限公司	AZN UW	纳斯达克 证券交易所	美国	124	64,126. 66	0.08
69	Kraft Heinz Co/The	卡夫亨 氏公司	KHC UW	纳斯达克 证券交易所	美国	248	63,615. 94	0.08
70	American Electric Power Co Inc	美国电 力	AEP UW	纳斯达克 证券交易所	美国	104	63,274. 89	0.08
71	Seagen Inc	Seagen 股份有 限公司	SGEN UW	纳斯达克 证券交易所	美国	45	62,580. 49	0.08
72	Keurig Dr Pepper Inc	Keurig Dr Pepper 有限公	KDP UW	纳斯达克 证券交易所	美国	276	62,362. 41	0.08

		司						
73	Electronic Arts Inc	电子艺界	EA UW	纳斯达克证券交易所	美国	65	60,917.11	0.08
74	Xcel Energy Inc	Xcel 能源	XEL UW	纳斯达克证券交易所	美国	134	60,196.55	0.08
75	Paychex Inc	Paychex 公司	PAYX UW	纳斯达克证券交易所	美国	74	59,817.92	0.08
76	Exelon Corp	Exelon 公司	EXC UW	纳斯达克证券交易所	美国	203	59,758.96	0.08
77	Dollar Tree Inc	美元树公司	DLTR UW	纳斯达克证券交易所	美国	56	58,066.53	0.07
78	PDD Holdings Inc	拼多多	PDD UW	纳斯达克证券交易所	美国	116	57,952.65	0.07
79	Warner Bros Discovery Inc	华纳兄弟探索股份有限公司	WBD UW	纳斯达克证券交易所	美国	610	55,273.03	0.07
80	IDEXX Laboratories Inc	爱德士股份有限公司	IDXX UW	纳斯达克证券交易所	美国	15	54,435.20	0.07
81	CoStar Group Inc	CoStar 集团股份有限公司	CSGP UW	纳斯达克证券交易所	美国	58	37,299.58	0.05
82	GLOBALFOUNDRIES Inc	格罗方德半导体股份有限公司	GFS UW	纳斯达克证券交易所	美国	78	36,398.09	0.05
83	Fastenal Co	法思诺公司	FAST UW	纳斯达克证券交易所	美国	82	34,952.50	0.04
84	Cognizant Technology Solutions Corp	高知特科技公司	CTSH UW	纳斯达克证券交易所	美国	74	34,905.82	0.04

85	Crowdstrike Holdings Inc	CrowdStrike 控股股份有限公司	CRWD UW	纳斯达克证券交易所	美国	31	32,898.85	0.04
86	Baker Hughes Co	贝克休斯公司	BKR UW	纳斯达克证券交易所	美国	144	32,890.69	0.04
87	Constellation Energy Corp	美国联合能源公司	CEG UW	纳斯达克证券交易所	美国	47	31,091.53	0.04
88	Datadog Inc	Datadog 股份有限公司	DDOG UW	纳斯达克证券交易所	美国	42	29,856.72	0.04
89	Illumina Inc	Illumina 公司	ILMN UW	纳斯达克证券交易所	美国	22	29,804.84	0.04
90	ANSYS Inc	ANSYS 股份有限公司	ANSS UW	纳斯达克证券交易所	美国	12	28,637.58	0.04
91	Align Technology Inc	Align 科技股份有限公司	ALGN UW	纳斯达克证券交易所	美国	11	28,108.65	0.04
92	Walgreens Boots Alliance Inc	沃博联股份有限公司	WBA UW	纳斯达克证券交易所	美国	124	25,527.02	0.03
93	Atlassian Corp	Atlassian Corp	TEAM UW	纳斯达克证券交易所	美国	21	25,463.79	0.03
94	eBay Inc	eBay 公司	EBAY UW	纳斯达克证券交易所	美国	78	25,187.84	0.03
95	Diamondback Energy Inc	Diamondback 能源股份有限公司	FANG UW	纳斯达克证券交易所	美国	25	23,729.53	0.03
96	Enphase Energy Inc	Enphase 能源股份有限公司	ENPH UQ	纳斯达克证券交易所	美国	19	22,993.36	0.03

97	Zscaler Inc	Zscaler 股份有限公司	ZS UW	纳斯达克证券交易所	美国	20	21,142.69	0.03
98	Sirius XM Holdings Inc	Sirius XM 控股公司	SIRI UW	纳斯达克证券交易所	美国	560	18,330.41	0.02
99	Zoom Video Communications Inc	Zoom 视频通信股份有限公司	ZM UW	纳斯达克证券交易所	美国	35	17,167.06	0.02
100	JD.com Inc	京东集团	JD UW	纳斯达克证券交易所	美国	69	17,016.54	0.02
101	Rivian Automotive Inc	Rivian Automotive 股份有限公司	RIVN UW	纳斯达克证券交易所	美国	131	15,770.02	0.02
102	Lucid Group Inc	Lucid 集团股份有限公司	LCID UW	纳斯达克证券交易所	美国	242	12,048.15	0.02

注：本基金对以上证券代码采用当地市场代码。

#### 7.4.1.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的权益投资。

### 7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

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

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 UW	9,252,210.93	77.96
2	Apple Inc	AAPL UW	8,813,665.38	74.26
3	Amazon.com Inc	AMZN UW	4,490,538.89	37.84
4	NVIDIA Corp	NVDA UW	3,825,590.13	32.23
5	Meta Platforms Inc	META UW	2,595,008.03	21.87
6	Alphabet Inc	GOOGL UW	2,553,462.78	21.52
7	Tesla Inc	TSLA UW	2,472,947.58	20.84

8	Alphabet Inc	GOOG UW	2,445,826.63	20.61
9	Broadcom Inc	AVGO UW	1,070,672.12	9.02
10	PepsiCo Inc	PEP UW	987,378.29	8.32
11	Costco Wholesale Corp	COST UW	924,592.46	7.79
12	Adobe Inc	ADBE UW	766,785.20	6.46
13	Cisco Systems Inc	CSCO UW	643,204.87	5.42
14	Texas Instruments Inc	TXN UW	606,690.84	5.11
15	Advanced Micro Devices Inc	AMD UW	581,204.46	4.90
16	QUALCOMM Inc	QCOM UW	566,004.90	4.77
17	Netflix Inc	NFLX UW	561,735.81	4.73
18	Honeywell International Inc	HON UW	551,429.13	4.65
19	Intel Corp	INTC UW	538,651.54	4.54
20	T-Mobile US Inc	TMUS UW	512,247.18	4.32
21	Comcast Corp	CMCSA UW	487,433.14	4.11
22	Applied Materials Inc	AMAT UW	435,821.98	3.67
23	Intuitive Surgical Inc	ISRG UW	434,222.82	3.66
24	Starbucks Corp	SBUX UW	390,829.75	3.29
25	Analog Devices Inc	ADI UW	381,784.25	3.22
26	Amgen Inc	AMGN UW	378,989.45	3.19
27	Intuit Inc	INTU UW	328,485.87	2.77
28	PayPal Holdings Inc	PYPL UW	319,301.51	2.69
29	Palo Alto Networks Inc	PANW UW	293,407.38	2.47
30	Activision Blizzard Inc	ATVI UW	268,217.00	2.26
31	Vertex Pharmaceuticals Inc	VRTX UW	254,900.79	2.15
32	KLA Corp	KLAC UW	250,789.49	2.11

注:1、本基金对以上证券代码采用当地市场代码。

2、买入包括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，买入金额按成交金额（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 UW	559,492.74	4.71
2	Apple Inc	AAPL UW	513,365.50	4.33
3	Amazon.com Inc	AMZN UW	164,342.11	1.38
4	Meta Platforms Inc	META UW	70,917.34	0.60
5	NVIDIA Corp	NVDA UW	53,452.29	0.45
6	Alphabet Inc	GOOG UW	50,366.80	0.42
7	PepsiCo Inc	PEP UW	26,849.26	0.23
8	Monster Beverage Corp	MNST UW	19,706.83	0.17
9	Cisco Systems Inc	CSCO UW	18,267.71	0.15
10	Comcast Corp	CMCSA UW	16,688.33	0.14
11	Alphabet Inc	GOOGL UW	14,361.14	0.12
12	Advanced Micro Devices Inc	AMD UW	9,520.36	0.08

注:1、本基金对以上证券代码采用当地市场代码。

2、卖出包括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,卖出金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

## 7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位:人民币元

买入成本(成交)总额	52,962,616.41
卖出收入(成交)总额	1,517,330.41

买入成本和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

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值 (元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	Invesco QQQ Trust Series 1	ETF	交易型开放 式	Invesco Capital Management LLC	7,306,024.73	9.37

## 7.11 投资组合报告附注

**7.11.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现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。如是，还应对相关证券的投资决策程序做出说明**

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现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 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。如是，还应对相关股票的投资决策程序做出说明**

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

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	9,249.53
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,827,589.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	3,836,839.52
---	----	--------------

#### 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情况。

##### 7.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
南方纳斯达克 100 指数发起(QDII) A	1,149	22,353.96	10,126,952.54	39.43%	15,557,751.68	60.57%
南方纳斯达克 100 指数发起(QDII) C	3,132	10,142.52	-	-	31,766,387.20	100.00%
合计	4,281	13,420.02	10,126,952.54	17.63%	47,324,138.88	82.37%

注：机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额），户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

### 8.2 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	南方纳斯达克 100 指数发起（QDII）A	625,356.19	2.4347%
	南方纳斯达克 100 指	61,047.33	0.1922%

	数发起（QDII）C		
	合计	686,403.52	1.1948%

注：分级基金管理人的从业人员持有份额占总份额比例计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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	南方纳斯达克 100 指数发起（QDII）A	0
	南方纳斯达克 100 指数发起（QDII）C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	南方纳斯达克 100 指数发起（QDII）A	0~10
	南方纳斯达克 100 指数发起（QDII）C	0
	合计	0~10

## § 9 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例（%）	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例（%）	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,008,550.85	17.42	10,000,000.00	17.41	自合同生效之日起不少于 3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	28,387.59	0.05	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,036,938.44	17.47	10,000,000.00	17.41	-

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	南方纳斯达克 100 指数发起 (QDII) A	南方纳斯达克 100 指数发起 (QDII) C
基金合同生效日(2022 年 11 月 29 日)基金份额总额	10,639,538.63	1,264,840.12
本报告期期初基金份额总额	10,639,538.63	1,264,840.12
本报告期基金总申购份额	18,877,552.56	41,545,751.84
减：报告期基金总赎回份额	3,832,386.97	11,044,204.76
本报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-	-
本报告期末基金份额总额	25,684,704.22	31,766,387.20

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末召开基金份额持有人大会。

### 11.2 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

本报告期内，本基金的基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 11.3 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，无涉及基金管理人主营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

### 11.5 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。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

## 11.7.1 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	
China Merchants Securities(HK)Co Ltd	-	54,479,946.82	100.00%	10,937.26	100.00%	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-

注：交易单元的选择标准和程序根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，我公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序：

## A：选择标准

- 1、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；
- 2、公司具有较强的研究能力，能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告；
- 3、公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；
- 4、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。

B：选择流程 公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比，并根据评比的结果选择席位：

- 1、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座；
- 2、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实，投资建议是否准确
- 3、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

## C：报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

新增交易单元：

无

退租交易单元：

无

## 11.7.2 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
China Merchants Securities (HK)Co Ltd	-	-	-	-	-	-	7,174,734.48	100.00%
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-

## 11.8 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	南方纳斯达克 100 指数发起式证券投资基金（QDII）开放日常申购、赎回和定投业务的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-01-18
2	关于南方纳斯达克 100 指数发起式证券投资基金（QDII）2023 年境外主要市场节假日申购赎回安排的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-01-18
3	南方基金关于旗下部分基金增加招商银行为销售机构及开通相关业务的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-05-19

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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	20230101-20230615	10,008,550.85	-	-	10,008,550.85	17.42%

#### 产品特有风险

本基金存在持有基金份额超过 20%的基金份额持有人，在特定赎回比例及市场条件下，若基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产，将会导致流动性风险和基金净值波动风险。

注：申购份额包含红利再投资和份额折算。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立南方纳斯达克 100 指数发起式证券投资基金（QDII）的文件；
- 2、《南方纳斯达克 100 指数发起式证券投资基金（QDII）基金合同》；
- 3、《南方纳斯达克 100 指数发起式证券投资基金（QDII）托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告；
- 6、《南方纳斯达克 100 指数发起式证券投资基金（QDII）2023 年中期报告》原文。

### 13.2 存放地点

深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼。

### 13.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>