

博时纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资

基金发起式联接基金（QDII）

（原博时纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基

金（QDII））

2023 年第 3 季度报告

2023 年 9 月 30 日

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年十月二十五日

§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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

2.1 博时纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 (QDII) (转型后)

基金简称	博时纳斯达克 100ETF 发起式联接 (QDII)
基金主代码	016055
交易代码	016055
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 7 月 26 日
报告期末基金份额总额	266,449,372.99 份
投资目标	通过主要投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数即纳斯达克 100 指数的表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。在正常情况下，本基金力争控制投资组合的净值增长率与业绩比较基准之间的预期日均跟踪偏离度的绝对值小于 0.35%，预期年化跟踪误差不超过 4%。
投资策略	本基金主要投资于目标 ETF，方便特定的客户群通过本基金投资目标 ETF。本基金不参与目标 ETF 的投资管理。为实现投资目标，本基金将以不低于基金资产净值 90% 的资产投资于目标 ETF。为更好地实现投资目标，本基金还可投资于境外市场和境内市场依法发行的金融工具，其目的是为了本基金在保障日常申购赎回的前提下，更好地跟踪标的指数。 在正常情况下，本基金力争控制投资组合的净值增长率与业绩比较基

	准之间的预期日均跟踪偏离度的绝对值小于 0.35%，预期年化跟踪误差不超过 4%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金日均跟踪偏离度和跟踪误差变大，基金管理人应采取合理措施，避免日均跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。其他投资策略包括基金投资策略、股票及存托凭证投资策略、债券（除可转换债券）投资策略、资产支持证券投资策略、港股通标的股票投资策略、可转换债券投资策略、融资和转融通证券出借策略、存托凭证投资策略、金融衍生品投资策略等。	
业绩比较基准	经汇率调整的纳斯达克 100 指数收益率 x95%+活期存款利率（税后）x5%	
风险收益特征	本基金为 ETF 联接基金，通过投资于目标 ETF 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证券市场相似的风险收益特征。同时，本基金为被动式投资的股票指数基金，跟踪纳斯达克 100 指数，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金投资于境外证券，需承担汇率风险以及境外市场的风险。	
基金管理人	博时基金管理有限公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	博时纳斯达克 100ETF 发起式联接 (QDII) A	博时纳斯达克 100ETF 发起式联接 (QDII) C
下属分级基金的交易代码	016055	016057
报告期末下属分级基金的份额总额	133,464,226.23 份	132,985,146.76 份

2.1.1 目标基金基本情况（转型后）

基金名称	博时纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)
基金主代码	513390
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 4 月 19 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2023 年 5 月 8 日
基金管理人名称	博时基金管理有限公司
基金托管人名称	中信银行股份有限公司

2.1.2 目标基金产品概况（转型后）

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	本基金主要采用完全复制法进行投资，即按照成份股在标的指数中的基准权重来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。在正常情况下，本基金力争控制投资组合的净值增长率与业绩比较基准之间的预期日均跟踪偏离度的绝对值小于 0.20%，预期年化跟踪误差不超过 2%。本基金的其他投资策略包括债券和货币市场工具投资策略、金融衍生品投资策略、融资及转融通证

	券出借策略、流通受限证券投资策略、资产支持证券的投资策略、非成份股的股票投资策略、存托凭证投资策略。
业绩比较基准	纳斯达克 100 指数收益率 (经估值汇率调整)
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混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

2.2 博时纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金 (QDII) (转型前)

基金简称	博时纳斯达克 100 指数发起 (QDII)
基金主代码	016055
交易代码	016055
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 7 月 26 日
报告期末基金份额总额	261,539,728.30 份
投资目标	通过主要投资于目标 ETF, 紧密跟踪标的指数即纳斯达克 100 指数的表现, 追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。在正常情况下, 本基金力争控制投资组合的净值增长率与业绩比较基准之间的预期日均跟踪偏离度的绝对值小于 0.35%, 预期年化跟踪误差不超过 4%。
投资策略	<p>本基金主要投资于目标 ETF, 方便特定的客户群通过本基金投资目标 ETF。本基金不参与目标 ETF 的投资管理。为实现投资目标, 本基金将以不低于基金资产净值 90% 的资产投资于目标 ETF。为更好地实现投资目标, 本基金还可投资于境外市场和境内市场依法发行的金融工具, 其目的是为了本基金在保障日常申购赎回的前提下, 更好地跟踪标的指数。</p> <p>在正常情况下, 本基金力争控制投资组合的净值增长率与业绩比较基准之间的预期日均跟踪偏离度的绝对值小于 0.35%, 预期年化跟踪误差不超过 4%。如因标的指数编制规则调整等其他原因, 导致基金日均跟踪偏离度和跟踪误差变大, 基金管理人应采取合理措施, 避免日均跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。其他投资策略包括基金投资策略、股票及存托凭证投资策略、债券 (除可转换债券) 投资策略、资产支持证券投资策略、港股通标的股票投资策略、可转换债券投资策略、融资和转融通证券出借策略、存托凭证投资策略、金融衍生品投资策略等。</p>
业绩比较基准	经汇率调整的纳斯达克 100 指数收益率 x95%+活期存款利率 (税后) x5%
风险收益特征	本基金为 ETF 联接基金, 通过投资于目标 ETF 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证券市场相似的风险收益特征。同时, 本基金为被动式投资的股票指数基金, 跟踪纳斯达克 100 指数, 其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金投资于境外证券, 需承担汇率风险以及境外市场的风险。
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称	博时纳斯达克 100 指数发起 (QDII) A	博时纳斯达克 100 指数发起 (QDII) C
下属分级基金的交易代码	016055	016057
报告期末下属分级基金的份额总额	128,443,712.95 份	133,096,015.35 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

3.1.1 博时纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 (QDII) (转型后)

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2023 年 9 月 26 日-2023 年 9 月 30 日)	
	博时纳斯达克 100ETF 发起式联接 (QDII) A	博时纳斯达克 100ETF 发起式联接 (QDII) C
1.本期已实现收益	574,591.00	588,488.59
2.本期利润	-633,335.53	-721,275.87
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0049	-0.0054
4.期末基金资产净值	158,382,295.84	157,023,987.23
5.期末基金份额净值	1.1867	1.1808

注：本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不包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。

所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.1.2 博时纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金 (QDII) (转型前)

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2023 年 7 月 1 日-2023 年 9 月 25 日)	
	博时纳斯达克 100 指数发起 (QDII) A	博时纳斯达克 100 指数发起 (QDII) C
1.本期已实现收益	5,410,858.31	6,050,687.37
2.本期利润	-5,399,797.02	-6,561,592.46
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0504	-0.0556
4.期末基金资产净值	153,103,385.49	157,861,251.58
5.期末基金份额净值	1.1920	1.1861

注：本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不包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。

所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 博时纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 (QDII) (转型后) (报告期: 2023 年 9 月 26 日-2023 年 9 月 30 日)

3.2.1.1 本报告期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

1. 博时纳斯达克100ETF发起式联接 (QDII) A:

阶段	净值增长率 ①	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
自基金 合同生 效起至 今	-0.44%	0.92%	-0.25%	0.99%	-0.19%	-0.07%

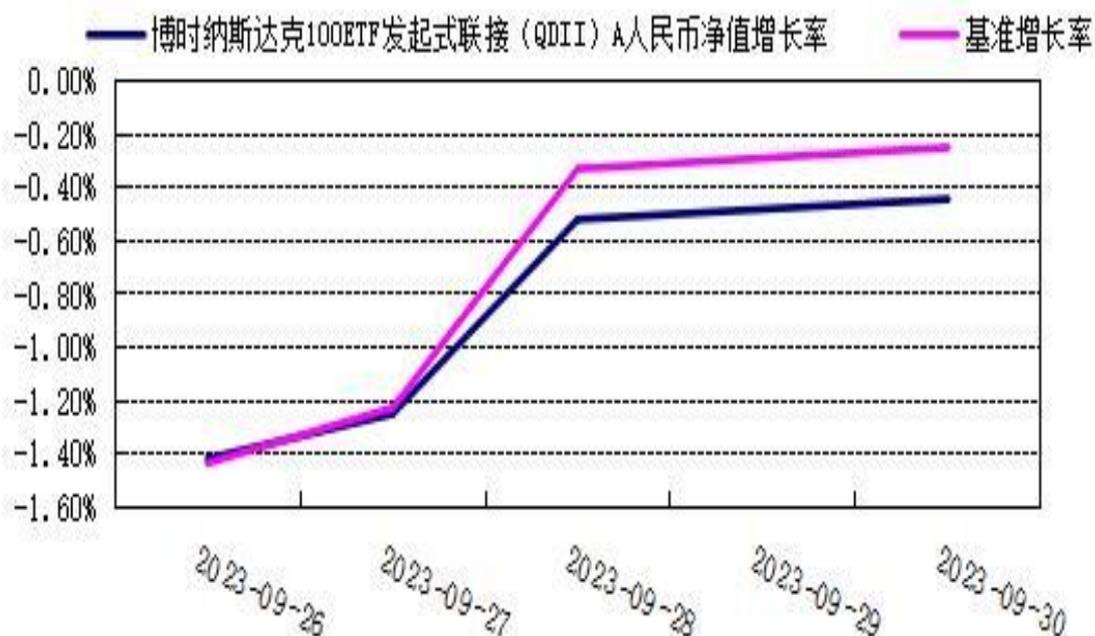
2. 博时纳斯达克100ETF发起式联接 (QDII) C:

阶段	净值增长率 ①	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
自基金 合同生 效起至 今	-0.45%	0.93%	-0.25%	0.99%	-0.20%	-0.06%

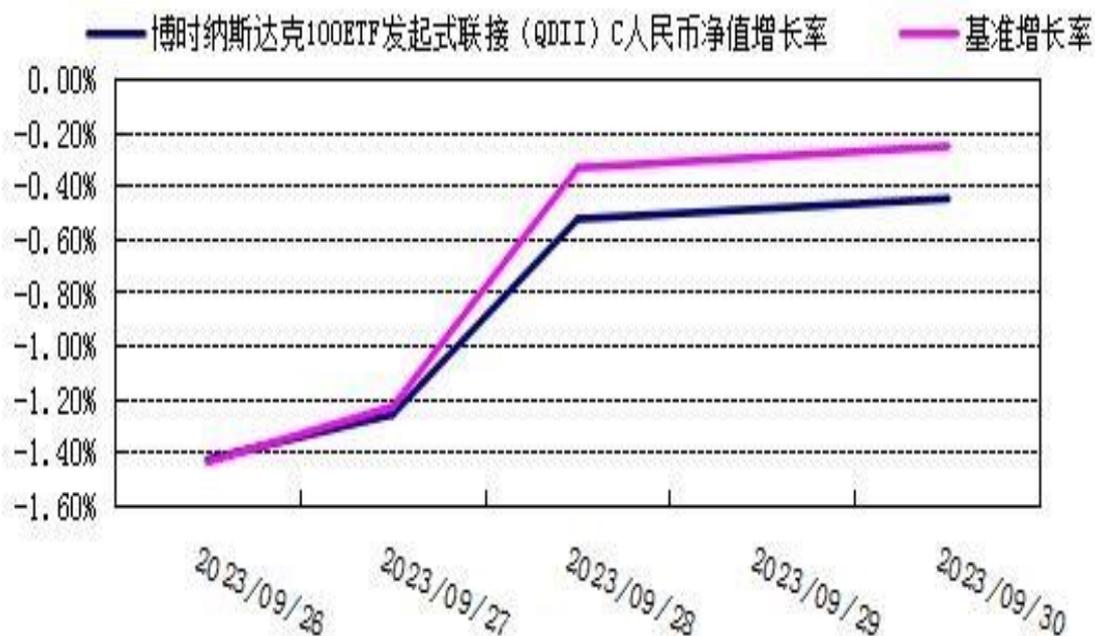
3.2.1.2 自基金转型以来 基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

博时纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 (QDII)
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2022 年 7 月 26 日至 2023 年 9 月 30 日)

1. 博时纳斯达克100ETF发起式联接 (QDII) A:



2. 博时纳斯达克100ETF发起式联接(QDII)C:



注：本基金的基金合同于2023年9月26日生效。按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同“投资范围”、“投资禁止行为与限制”章节的有关约定。

3.2.2 博时纳斯达克100指数型发起式证券投资基金(QDII)(转型前)

(报告期: 2023年7月1日-2023年9月25日)

3.2.2.1 本报告期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

1. 博时纳斯达克100指数发起(QDII)A:

阶段	净值增长率 ①	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
过去三 个月	-0.83%	0.95%	-0.70%	0.95%	-0.13%	0.00%
过去六 个月	19.92%	1.00%	20.24%	1.01%	-0.32%	-0.01%
过去一 年	31.70%	1.37%	32.18%	1.38%	-0.48%	-0.01%
自基金 合同生 效起至 今	19.20%	1.38%	25.91%	1.43%	-6.71%	-0.05%

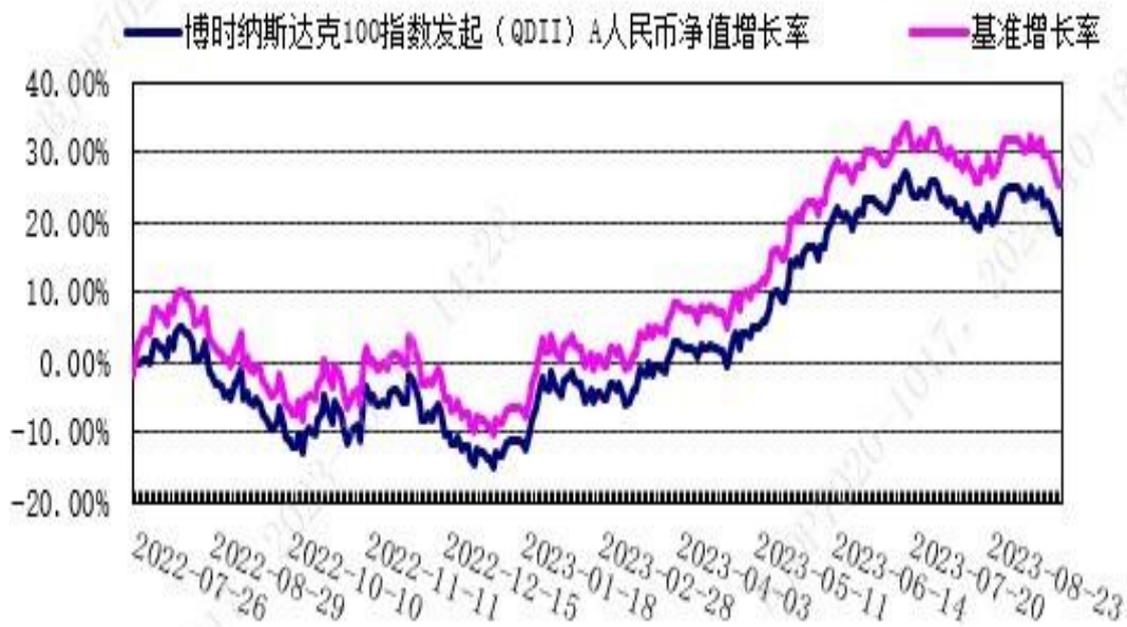
2. 博时纳斯达克100指数发起 (QDII) C:

阶段	净值增长率 ①	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
过去三 个月	-0.91%	0.95%	-0.70%	0.95%	-0.21%	0.00%
过去六 个月	19.72%	1.00%	20.24%	1.01%	-0.52%	-0.01%
过去一 年	31.15%	1.37%	32.18%	1.38%	-1.03%	-0.01%
自基金 合同生 效起至 今	18.61%	1.38%	25.91%	1.43%	-7.30%	-0.05%

3.2.2.2 自基金转型以来 基金累计份额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

博时纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金 (QDII)
 累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 (2022 年 7 月 26 日至 2023 年 9 月 25 日)

1. 博时纳斯达克100指数发起 (QDII) A:



2. 博时纳斯达克100指数发起(QDII)C:



注：本基金的基金合同于2022年7月26日生效。按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同“投资范围”、“投资禁止行为与限制”章节的有关约定。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理 (或基金经理小组) 简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
万琼	指数与量化投资部投资总监助理/基金经理	2023-09-26	-	16.5	<p>万琼女士，硕士。2004 年起先后在中企动力科技股份有限公司、华夏基金工作。2011 年加入博时基金管理有限公司。历任投资助理、基金经理助理、博时富时中国 A 股指数证券投资基金(2017 年 9 月 29 日-2019 年 9 月 5 日)、上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金(2015 年 6 月 8 日-2019 年 10 月 11 日)、博时上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2015 年 6 月 8 日-2019 年 10 月 11 日)、博时恒生沪深港通大湾区综合交易型开放式指数证券投资基金(2020 年 4 月 30 日-2022 年 5 月 27 日)、博时上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2015 年 6 月 8 日-2022 年 7 月 7 日)、上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金(2015 年 6 月 8 日-2022 年 7 月 7 日)、博时中证可持续发展 100 交易型开放式指数证券投资基金(2020 年 1 月 19 日-2023 年 3 月 8 日)、博时中证红利交易型开放式指数证券投资基金(2020 年 3 月 20 日-2023 年 3 月 8 日)、博时沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(2020 年 4 月 3 日-2023 年 3 月 8 日)、博时创业板指数证券投资基金(2021 年 4 月 2 日-2023 年 3 月 8 日)、博时纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金 (QDII) (2022 年 7 月 26 日-2023 年 9 月 25 日) 的基金经理。现任指数与量化投资部投资总监助理兼博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2015 年 10 月 8 日—至今)、博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金(2015 年 10 月 8 日—至今)、博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(2019 年 8 月 1 日—至今)、博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(2019 年 12 月 30 日—至今)、博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基</p>

				<p>金(QDII)(2021年3月18日—至今)、博时恒生港股通高股息率交易型开放式指数证券投资基金(2021年5月11日—至今)、博时恒生科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)(2021年5月17日—至今)、博时中证全球中国教育主题交易型开放式指数证券投资基金(QDII)(2021年6月8日—至今)、博时恒生科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(QDII)(2021年12月21日—至今)、博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(QDII)(2021年12月28日—至今)、博时恒生港股通高股息率交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(2022年1月10日—至今)、博时中证港股通消费主题交易型开放式指数证券投资基金(2022年3月3日—至今)、博时纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)(2023年4月19日—至今)、博时纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(QDII)(2023年9月26日—至今)的基金经理。</p>
--	--	--	--	--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

注：上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 报告期内本基金运作合规守信情况说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，由于证券市场波动等原因，本基金曾出现个别投资监控指标超标的情况，基金管理人在规定期限内进行了调整，对基金份额持有人利益未造成损害。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 61 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

2023 年 3 季度，美国核心通胀持续下行，经济指标向好。经济基本面方面，消费和固定资产投资带动经济增长，2023 年美国 2 季度 GDP 环比折合年率 2.4%，远超预期。基数影响下，通胀在 3 季度小幅上行，但核心通胀持续下行。货币政策方面，美联储 7 月加息 25bps，9 月暂停加息。3 季度，标普 500 指数下跌 3.65%，纳斯达克 100 指数下跌 3.06%。

展望 4 季度，在紧信用压力下，海外经济仍处于放缓通道，服务业的繁荣继续支撑美国的经济韧性。通胀方面，4 季度美国通胀预期会继续改善，房租通胀预计持续下行趋势，二手车通胀可能维持低位，压低商品通胀，劳动力市场降温、工资增速下降有助于其他核心通胀改善。流动性方面，9 月议息会议美联储对经济预测的调整更受关注，尤其是点阵图对明年降息次数的下调和经济数据预测的大幅上调引发市场波动，4 季度海外流动性或将继续承受压力。在经济韧性的支持下，降息时点不会那么快到来且仍存在较大变数，美股 4 季度可能仍在盈利支撑和流动性压力下震荡。

本基金作为一只被动策略的指数基金，会以最小化跟踪误差为目标，紧密跟踪标的指数。

截至 2023 年 09 月 30 日，本基金 A 基金份额净值为 1.1867 元，份额累计净值为 1.1867 元，本基金 C 基金份额净值为 1.1808 元，份额累计净值为 1.1808 元，报告期内，本基金由博时纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金（QDII）转型为博时纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）。转型前，自 2023 年 6 月 26 日至 2023 年 9 月 25 日，博时纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金（QDII）A 类基金份额净值增长率为-0.83%，C 类基金份额净值增长率为-0.91%，同期业绩基准增长率-0.70%；转型后，自 2023 年 9 月 26 日至报告期末，博时纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）A 类基金份额净值增长率为-0.44%，C 类基金份额净值增长率为-0.45%，同期业绩基准增长率-0.25%。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 博时纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(QDII)(转型后)

(报告期: 2023年9月26日-2023年9月30日)

5.1.1 报告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	248,804,592.83	75.93
	其中: 普通股	245,187,780.71	74.82
	存托凭证	3,616,812.12	1.10
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	24,859,800.00	7.59
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	42,150,045.56	12.86
8	其他各项资产	11,878,523.02	3.62
9	合计	327,692,961.41	100.00

5.1.2 期末投资目标基金明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
1	博时纳斯达克100ETF	ETF	开放式	博时基金管理有限公司	24,859,800.00	7.88

5.1.3 报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家(地区)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)

美国	248,804,592.83	78.88
合计	248,804,592.83	78.88

5.1.4 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值 (人民币元)	占基金资产净值比例 (%)
能源	1,366,034.50	0.43
公用事业	3,083,345.37	0.98
房地产	676,819.21	0.21
工业	12,290,334.48	3.90
非日常生活消费品	35,184,547.58	11.16
日常消费品	16,425,343.27	5.21
医疗保健	17,724,302.63	5.62
金融	1,384,273.19	0.44
信息技术	120,849,619.95	38.32
电信业务	39,819,972.65	12.62
合计	248,804,592.83	78.88

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

5.1.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证投资明

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	APPLE INC	A	AAPL US	纳斯达克交易所	美国	21,896.00	26,915,735.91	8.53
2	MICROSOFT CORP		MSFT US	纳斯达克交易所	美国	10,405.00	23,588,362.35	7.48
3	ALPHABET INC		GOOGL US	纳斯达克交易所	美国	8,309.00	7,806,709.55	2.48
3	ALPHABET INC		GOOG US	纳斯达克交易所	美国	8,124.00	7,690,638.46	2.44
4	AMAZON.COM INC		AMZN US	纳斯达克交易所	美国	14,450.00	13,188,459.74	4.18
5	NVIDIA CORP		NVDA US	纳斯达克交易所	美国	3,459.00	10,802,945.42	3.43
6	META PLATFORMS INC-CLASS A		META US	纳斯达克交易所	美国	4,363.00	9,404,218.57	2.98
7	TESLA INC		TSLA	纳斯达克	美国	4,445.00	7,985,573.88	2.53

			US	交易所				
8	BROADCO M INC		AVGO US	纳斯达克 交易所	美国	1,240.00	7,394,613.87	2.34
9	COSTCO WHOLESA L E CORP		COST US	纳斯达克 交易所	美国	1,332.00	5,402,991.34	1.71
10	PEPSICO INC		PEP US	纳斯达克 交易所	美国	4,134.00	5,029,198.32	1.59

注：所用证券代码采用当地市场代码。

5.1.6 报告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。

5.1.7 报告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。

5.1.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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。

5.1.9 报告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

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值 (人民币元)	占基金资产 净值比例(%)
1	期货投资	NASDAQ 100 E-MINI Dec23	-945,133.94	-0.30

注：金融衍生品投资项下的期货投资,在当日无负债结算制度下，结算备付金已包括所持期货合约产生的持仓损益，则金融衍生品投资项下的期货投资与相关的期货结算暂收款（结算所得的持仓损益）相抵消后的净额为0，因此此处公允价值实为公允价值变动金。

5.1.10 报告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

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值 (人民币元)	占基金资产 净值比例(%)
1	博时纳 斯达 克 100ETF	ETF	开放式	博时基金管理 有限公司	24,859,800.00	7.88

5.1.11 投资组合报告附注

5.1.11.1 基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的投资决策程序说明

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

5.1.11.2 报告期内基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.1.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	1,605,460.72

2	应收证券清算款	1,507,015.05
3	应收股利	118,250.31
4	应收利息	-
5	应收申购款	8,647,796.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,878,523.02

5.1.11.4 报告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。

5.1.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.1.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

5.2 博时纳斯达克100指数型发起式证券投资基金(QDII)(转型前)

(报告期: 2023年7月1日-2023年9月25日)

5.3.1 报告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	268,261,856.13	83.60
	其中: 普通股	264,450,334.70	82.41
	存托凭证	3,811,521.43	1.19
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
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	42,897,501.26	13.37

8	其他各项资产	9,734,071.77	3.03
9	合计	320,893,429.16	100.00

5.3.2 期末投资目标基金明细

本基金本报告期末未持有基金。

5.3.3 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家（地区）	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
美国	268,261,856.13	86.27
合计	268,261,856.13	86.27

5.3.4 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例(%)
能源	1,479,609.37	0.48
工业	13,414,032.23	4.31
非日常生活消费品	37,947,097.62	12.20
日常消费品	17,786,567.31	5.72
医疗保健	18,913,593.36	6.08
金融	1,518,177.70	0.49
信息技术	130,007,993.19	41.81
电信业务	42,994,441.04	13.83
公用事业	3,462,387.96	1.11
房地产	737,956.35	0.24
合计	268,261,856.13	86.27

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

5.3.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证投资明细

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	APPLE INC		AAPL US	纳斯达克交易所	美国	23,638.00	29,854,061.60	9.60
2	MICROSOFT CORP		MSFT US	纳斯达克交易所	美国	11,175.00	25,452,394.09	8.18
3	ALPHABET INC		GOOGL US	纳斯达克交易所	美国	8,929.00	8,396,944.97	2.70
3	ALPHABET INC		GOOG US	纳斯达克交易所	美国	8,828.00	8,369,083.12	2.69
4	AMAZON.COM INC		AMZN US	纳斯达克交易所	美国	15,420.00	14,518,860.27	4.67

5	NVIDIA CORP		NVDA US	纳斯达克 交易所	美国	3,713.00	11,244,662.30	3.62
6	META PLATFORM S INC-CLASS A		META US	纳斯达克 交易所	美国	4,661.00	10,057,334.93	3.23
7	TESLA INC		TSLA US	纳斯达克 交易所	美国	4,764.00	8,439,831.76	2.71
8	BROADCO M INC		AVGO US	纳斯达克 交易所	美国	1,344.00	8,038,790.33	2.59
9	COSTCO WHOLESA LE CORP		COST US	纳斯达克 交易所	美国	1,430.00	5,729,743.55	1.84
10	PEPSICO INC		PEP US	纳斯达克 交易所	美国	4,441.00	5,553,100.97	1.79

注：所用证券代码采用当地市场代码。

5.3.6 报告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。

5.3.7 报告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。

5.3.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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。

5.3.9 报告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

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值 (人民币元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	期货投资	NASDAQ 100 E-MINI Dec23	-911,686.03	-0.29

注：金融衍生品投资项下的期货投资,在当日无负债结算制度下, 结算备付金已包括所持期货合约产生的持仓损益, 则金融衍生品投资项下的期货投资与相关的期货结算暂收款 (结算所得的持仓损益) 相抵消后的净额为 0, 因此此处公允价值实为公允价值变动金。

5.3.10 报告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。

5.3.11 投资组合报告附注

5.3.11.1 基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的投资决策程序说明

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

5.3.11.2 报告期内基金投资的前十名股票中, 没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.3.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	1,749,679.75
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	137,225.80
4	应收利息	-
5	应收申购款	7,847,166.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,734,071.77

5.3.11.4 报告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。

5.3.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.3.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因, 分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

6.1 博时纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 (QDII) (转型后)

单位: 份

项目	博时纳斯达克 100ETF 发起式联接 (QDII) A	博时纳斯达克 100ETF 发起式联接 (QDII) C
本报告期期初基金份额总额	128,443,712.95	133,096,015.35
报告期期间基金总申购份额	5,811,502.82	3,689,171.32
减: 报告期期间基金总赎回份额	790,989.54	3,800,039.91
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	133,464,226.23	132,985,146.76

注: 本基金合同于2023年9月26日生效。

6.2 博时纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金 (QDII) (转型前)

单位：份

项目	博时纳斯达克 100 指数发起 (QDII) A	博时纳斯达克 100 指数发起 (QDII) C
本报告期期初基金份额总额	92,859,653.22	86,813,373.93
报告期期间基金总申购份额	62,032,412.27	137,362,815.48
减：报告期期间基金总赎回份额	26,448,352.54	91,080,174.06
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	128,443,712.95	133,096,015.35

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 博时纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 (QDII) (转型后)

7.1.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	10,000,658.90
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,000,658.90
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	3.75

注：1. 申购含红利再投、转换入、级别调整入份额，赎回含转换出、级别调整出份额（如适用）。

2. 基金管理人博时基金投资本基金适用的交易费率与本基金法律文件规定一致。

7.1.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内基金管理人未发生运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的情况。

7.2 博时纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金 (QDII) (转型前)

7.3.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	10,000,658.90
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-

报告期期末管理人持有的本基金份额	10,000,658.90
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	3.82

注：1. 申购含红利再投、转换入、级别调整入份额，赎回含转换出、级别调整出份额（如适用）。
2. 基金管理人博时基金投资本基金适用的交易费率与本基金法律文件规定一致。

7.3.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内基金管理人未发生运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的情况。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

8.1 博时纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 (QDII) (转型后)

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	10,000,658.90	3.75%	10,000,658.90	3.75%	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,658.90	3.75%	10,000,658.90	3.75%	-

8.2 博时纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金 (QDII) (转型前)

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	10,000,658.90	3.82%	10,000,658.90	3.82%	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-

其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,658.90	3.82%	10,000,658.90	3.82%	-

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 博时纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 (QDII) (转型后)

9.1.1 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

无。

9.2 博时纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金 (QDII) (转型前)

9.2.1 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

无。

9.3 影响投资者决策的其他重要信息

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。“为国民创造财富”是博时的使命。博时的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 2023 年 9 月 30 日，博时基金公司共管理 356 只公募基金，并受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金，以及多个企业年金、职业年金及特定专户，管理资产总规模逾 14570 亿元人民币，剔除货币基金后，博时基金公募资产管理总规模逾 5106 亿元人民币，累计分红逾 1884 亿元人民币，是目前我国资产管理规模最大的基金公司之一。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准博时纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 (QDII) 设立的文件
- 2、《博时纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 (QDII) 基金合同》
- 3、《博时纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 (QDII) 托管协议》
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

5、报告期内博时纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）在指定报刊上各项公告的原稿

10.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

10.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查询，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

博时一线通：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司
二〇二三年十月二十五日