招商纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金（QDII）2024年中期报告

2024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：2024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2024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2024年1月1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 净资产变动表.....15
6.4 报表附注.....17
§7 投资组合报告.....36
7.1 期末基金资产组合情况.....36
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....36
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....36
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....37
7.5 报告期内股票投资组合的重大变动.....45
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....48
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.....48
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.....48
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.....48

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.....49
7.11 投资组合报告附注.....49
§8 基金份额持有人信息.....49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....49
8.2 期末上市基金前十名持有人.....50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....50
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.....50
§9 开放式基金份额变动.....51
§10 重大事件揭示.....51
10.1 基金份额持有人大会决议.....51
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.....51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....51
10.4 基金投资策略的改变.....51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....51
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.....51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....52
10.8 其他重大事件.....56
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....58
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.....58
§12 备查文件目录.....59
12.1 备查文件目录.....59
12.2 存放地点.....59
12.3 查阅方式.....59

§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	405,744,064.00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指数收益率（经汇率调整后）
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(2024年1月1日 - 2024年6月30日)
本期已实现收益	6,711,639.31
本期利润	56,260,887.68
加权平均基金份额本期利润	0.1779
本期加权平均净值利润率	12.74%
本期基金份额净值增长率	15.28%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)
期末可供分配利润	43,248,741.27
期末可供分配基金份额利润	0.1066
期末基金资产净值	613,736,866.16
期末基金份额净值	1.5126
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)
基金份额累计净值增长率	51.26%

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。

3.2 基金净值表现

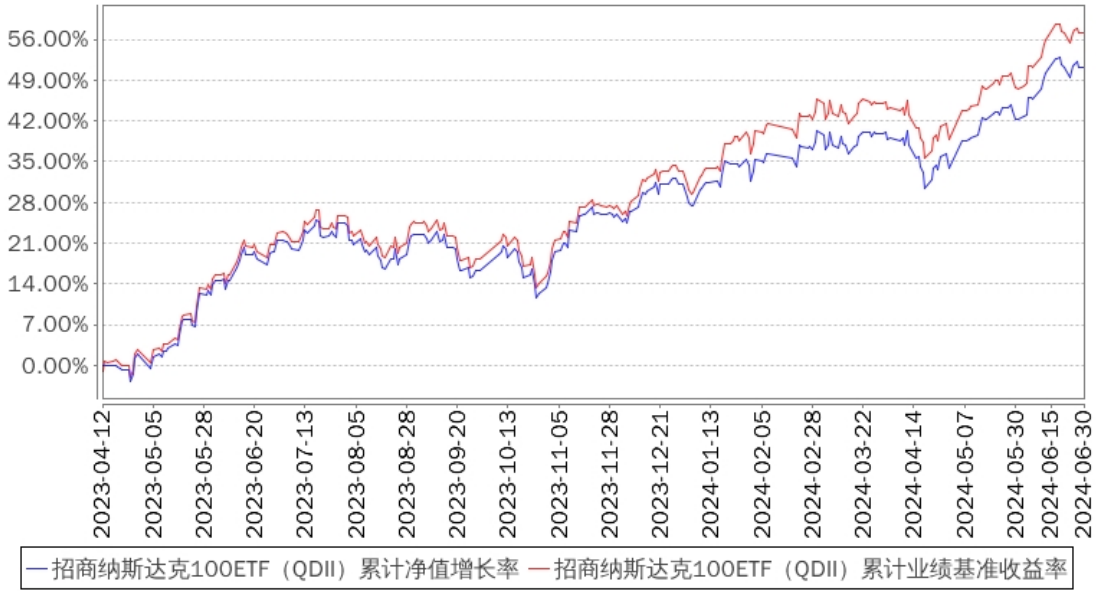
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	6.34%	0.76%	6.45%	0.77%	-0.11%	-0.01%
过去三个月	8.21%	0.99%	8.31%	0.99%	-0.10%	0.00%

过去六个月	15.28%	0.97%	17.71%	0.98%	-2.43%	-0.01%
过去一年	24.55%	0.97%	27.89%	0.98%	-3.34%	-0.01%
自基金合同生效起至今	51.26%	1.00%	57.08%	1.02%	-5.82%	-0.02%

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

招商纳斯达克100ETF（QDII）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：本基金建仓期为6个月，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

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拥有公开募集证券投资基金管理、基金销售、全国社会保障基金境内委托管理、企业年金和职业年金基金投资管理、合格境内机构投资者、特定客户资产管理、保险资金投资管理、基本养老保险基金投资管理、公募基金投资顾问业务试点资格。

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	说明

		任职日期	离任日期	年限	
刘重杰	本基金基金经理	2023年4月12日	-	13	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、招商中证物联网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）、招商中证100交易型开放式指数证券投资基金基金经理，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、招商纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）、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发起式联接基金基金经理。

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6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。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，美股整体上呈现较为明显的上涨态势，主要代表性指数在此期间创出历史新高。其中标普500指数、道琼斯指数、纳斯达克100指数分别上涨14.48%、3.79%、16.98%；其中科技板块依然维持了相对较为明显的涨幅。关于本基金的运作，仓位维持在99.1%左右的水平，基本完成了对基准指数的跟踪。

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15.28%，同期业绩基准增长率为17.71%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

美国通胀边际降温，美股市场上行。美联储6月FOMC决议将基准利率维持在5.25%-5.5%不变，点阵图将2024年降息次数下调2次至1次，但2025-2026年累计降息次数上调2次至8次，2024-2026年累计降息次数不变，长期名义均衡利率预测也小幅上调；经济预测方面，美联储上调2024-2025年通胀预测。降息确定性不断提高，美股仍有向上催化；但是值得注意的是，经过一段时间的持续上行，美股科技股的估值情况已处于超过历史中位数的水平；另外，对于领涨科技股的预期业绩的不确定性，也可能会导致市场波动有所增加。

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办法》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

本基金本报告期内未实施利润分配。

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，本托管人在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：2024年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末2024年6月30日	上年度末2023年12月31日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	13,226,345.49	2,005,151.50
结算备付金		23.44	0.03
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	608,443,775.43	125,672,409.49
其中：股票投资		608,443,775.43	125,672,409.49
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		-	2,027,850.67
应收股利		72,718.31	99,738.87
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		621,742,862.67	129,805,150.56
负债和净资产	附注号	本期末2024年6月30日	上年度末2023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		7,639,048.44	2,774,238.99
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		209,623.11	45,889.21
应付托管费		62,886.94	13,766.75
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	94,438.02	28,753.42
负债合计		8,005,996.51	2,862,648.37
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	405,744,064.00	96,744,064.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	207,992,802.16	30,198,438.19
净资产合计		613,736,866.16	126,942,502.19
负债和净资产总计		621,742,862.67	129,805,150.56

注：报告截止日2024年6月30日，基金份额净值1.5126元，基金份额总额405,744,064.00份。

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：2024年1月1日至2024年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2024年1月1日至2024年6月30日	上年度可比期间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		57,835,812.18	9,934,642.98
1.利息收入		111,398.49	78,197.15
其中：存款利息收入	6.4.7.9	111,398.49	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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		13,885,165.01	412,600.63
其中：股票投资收益	6.4.7.10	12,093,466.61	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	1,791,698.40	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	49,549,248.37	9,935,261.47
4.汇兑收益（损失以“－”号填列）		-6,006,258.85	-511,442.91
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	296,259.16	20,026.64
减：二、营业总支出		1,574,924.50	166,525.16
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	1,106,779.93	106,319.76
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	6.4.10.2.2	332,033.99	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	136,110.58	28,309.50
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		56,260,887.68	9,768,117.82
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		56,260,887.68	9,768,117.82
五、其他综合收益的税后		-	-

净额			
六、综合收益总额		56,260,887.68	9,768,117.82

注：根据最新《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》中的利润表格式的要求：上年度可比期间“证券出借利息收入”项目的“本期”金额列示于本期“其他利息收入”项目的“上年度可比期间”金额中。

6.3 净资产变动表

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：2024年1月1日至2024年6月30日

单位：人民币元

项目	本期2024年1月1日至2024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	96,744,064.00	-	30,198,438.19	126,942,502.19
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	96,744,064.00	-	30,198,438.19	126,942,502.19
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	309,000,000.00	-	177,794,363.97	486,794,363.97
（一）、综合收益总额	-	-	56,260,887.68	56,260,887.68
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	309,000,000.00	-	121,533,476.29	430,533,476.29
其中：1.基金申购款	592,000,000.00	-	228,244,483.18	820,244,483.18
2.基金赎回款	-283,000,000.00	-	-106,711,006.89	-389,711,006.89
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	405,744,064.00	-	207,992,802.16	613,736,866.16

项目	上年度可比期间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	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	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净资产变动数（净资产减少以“-”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净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	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”)、中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，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2024年6月30日的财务状况以及自2024年1月1日至2024年6月30日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策，会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金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》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》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管理人运营公开募集证券投资基金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所得，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；自2023年8月28日起，出让方减按0.05%的税率缴纳证券(股票)交易印花税。

(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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末2024年6月30日
活期存款	13,226,345.49
等于：本金	13,225,807.86
加：应计利息	537.63
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	13,226,345.49

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末2024年6月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		548,011,561.96	-	608,443,775.43	60,432,213.47
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		548,011,561.96	-	608,443,775.43	60,432,213.47

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2024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	94,438.02
合计	94,438.02

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	96,744,064.00	96,744,064.00
本期申购	592,000,000.00	592,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-283,000,000.00	-283,000,000.00
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期末	405,744,064.00	405,744,064.00

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。

6.4.7.8 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
上年度末	9,683,532.91	20,514,905.28	30,198,438.19
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	9,683,532.91	20,514,905.28	30,198,438.19
本期利润	6,711,639.31	49,549,248.37	56,260,887.68
本期基金份额交易产生的变动数	26,853,569.05	94,679,907.24	121,533,476.29
其中：基金申购款	52,305,652.02	175,938,831.16	228,244,483.18
基金赎回款	-25,452,082.97	-81,258,923.92	-106,711,006.89
本期已分配利润	-	-	-
本期末	43,248,741.27	164,744,060.89	207,992,802.16

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	111,118.13

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	280.36
其他	-
合计	111,398.49

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2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	12,093,466.61
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	12,093,466.61

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2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	256,699,000.79
减：卖出股票成本总额	244,453,778.89
减：交易费用	151,755.29
买卖股票差价收入	12,093,466.61

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2024年1月1日至2024年6月30日
赎回基金份额对价总额	389,711,006.89
减：现金支付赎回款总额	389,711,006.89
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2024年1月1日至2024年6月30日

股票投资产生的股利收益	1,791,698.40
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	1,791,698.40

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期2024年1月1日至2024年6月30日
1.交易性金融资产	49,549,248.37
——股票投资	49,549,248.37
——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	49,549,248.37

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	296,259.16
合计	296,259.16

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2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	11,067.78
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
其他	65,370.46
合计	136,110.58

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
招商证券股份有限公司(以下简称“招商证券”)	基金管理人的股东
招商纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）(以下简称“招商纳斯达克100ETF发起式联接（QDII）”)	本基金的联接基金
摩根大通银行	基金境外托管人

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

本基金本报告期内及上年度可比期间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

本基金本报告期内及上年度可比期间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

本基金本报告期内及上年度可比期间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

本基金本报告期内及上年度可比期间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

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期2024年1月1日至2024年6月30日	上年度可比期间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	1,106,779.93	106,319.76
其中：应支付销售机构的客户维护费	36,396.98	54.09
应支付基金管理人的净管理费	1,070,382.95	106,265.67
应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2024年1月1日至2024年6月30日	上年度可比期间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	332,033.99	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

本基金本报告期内及上年度可比期间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

本基金本报告期内及上年度可比期间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

本基金本报告期内及上年度可比期间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

本报告期内及上年度可比期间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

份额单位：份

关联方名称	本期末2024年6月30日		上年度末2023年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
招商纳斯达克100ETF发起式联接（QDII）	142,348,300.00	35.08%	25,120,500.00	25.97%
招商证券股份有限公司	819,609.00	0.20%	-	-

注：表格中的比例为四舍五入的结果。

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2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间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	期末余额	当期利息收入
摩根大通-活期	7,928,520.89	86,257.32	1,596,880.85	57,953.47
中国银行-活期	5,297,824.60	24,860.81	847,760.04	20,197.78

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和摩根大通银行保管，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

本基金本报告期内及上年度可比期间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（2024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

本基金本报告期末及上年度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

本基金本报告期末及上年度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

本基金本报告期末及上年度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

本基金本报告期末及上年度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

本基金本报告期末及上年度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

本基金本报告期末及上年度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2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	13,226,345.49	-	-	-	13,226,345.49
结算备付金	23.44	-	-	-	23.44
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	608,443,775.43	608,443,775.43
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	72,718.31	72,718.31
应收申购款	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	13,226,368.93	-	-	608,516,493.74	621,742,862.67
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	209,623.11	209,623.11
应付托管费	-	-	-	62,886.94	62,886.94

应付清算款	-	-	-	7,639,048.44	7,639,048.44
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	-	-	-	94,438.02	94,438.02
负债总计	-	-	-	8,005,996.51	8,005,996.51
利率敏感度缺口	13,226,368.93	-	-	600,510,497.23	613,736,866.16
上年度末2023年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	2,005,151.50	-	-	-	2,005,151.50
结算备付金	0.03	-	-	-	0.03
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	125,672,409.49	125,672,409.49
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	99,738.87	99,738.87
应收申购款	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	2,027,850.67	2,027,850.67
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	2,005,151.53	-	-	127,799,999.03	129,805,150.56
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	45,889.21	45,889.21
应付托管费	-	-	-	13,766.75	13,766.75
应付清算款	-	-	-	2,774,238.99	2,774,238.99
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	-	-	-	28,753.42	28,753.42
负债总计	-	-	-	2,862,648.37	2,862,648.37
利率敏感度缺口	2,005,151.53	-	-	124,937,350.66	126,942,502.19

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2024年6月30日					
	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	合计
以外币计价的资产						
货币资金	7,930,976.64	-	-	-	-	7,930,976.64
结算备付金	-	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	608,443,775.43	-	-	-	-	608,443,775.43
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-
应收股利	72,718.31	-	-	-	-	72,718.31
应收申购款	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产合计	616,447,470.38	-	-	-	-	616,447,470.38
以外币计价的负债						
应付清算款	4,449,489.58	-	-	-	-	4,449,489.58
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	4,449,489.58	-	-	-	-	4,449,489.58
资产负债表外汇风险敞口净额	611,997,980.80	-	-	-	-	611,997,980.80

项目	上年度末2023年12月31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						
货币资金	191,056.33	-	-	-	-	191,056.33
结算备付金	-	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	125,672,409.49	-	-	-	-	125,672,409.49
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-
应收股利	99,738.87	-	-	-	-	99,738.87
应收申购款	-	-	-	-	-	-
应收清算款	2,027,850.67	-	-	-	-	2,027,850.67
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产合计	127,991,055.36	-	-	-	-	127,991,055.36
以外币计价的负债						
应付清算款	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	127,991,055.36	-	-	-	-	127,991,055.36

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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	30,599,899.04	6,399,552.77
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-30,599,899.04	-6,399,552.77

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2024年6月30日		上年度末2023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	608,443,775.43	99.14	125,672,409.49	99.00
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	608,443,775.43	99.14	125,672,409.49	99.00

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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	1. 权益性投资的市场价格上升 5%	30,422,188.77	6,283,620.47
	2. 权益性投资的市场价格下降 5%	-30,422,188.77	-6,283,620.47

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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	608,443,775.43	125,672,409.49
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	608,443,775.43	125,672,409.49

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

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	608,443,775.43	97.86
	其中：普通股	602,955,932.82	96.98
	存托凭证	5,487,842.61	0.88
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	13,226,368.93	2.13
8	其他各项资产	72,718.31	0.01
9	合计	621,742,862.67	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	608,443,775.43	99.14
合计	608,443,775.43	99.14

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	94,583,251.23	15.41
非日常生活消费品	76,342,346.81	12.44
日常消费品	36,599,729.66	5.96
能源	2,894,747.88	0.47
金融	2,482,649.93	0.40
医疗保健	37,146,557.90	6.05
工业	25,951,331.54	4.23
信息技术	315,479,771.66	51.40
原材料	8,625,124.04	1.41
房地产	1,237,996.57	0.20
公用事业	7,100,268.21	1.16
合计	608,443,775.43	99.14

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

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	16,513	52,599,242.99	8.57
2	APPLE INC	苹果公司	AAPL US	纳斯达克证券交易所	美国	34,071	51,142,159.25	8.33
3	NVIDIA CORP	英伟达公司	NVDA US	纳斯达克证券交易所	美国	54,656	48,121,594.92	7.84
4	AMAZON.COM INC	亚马逊公司	AMZN US	纳斯达克证券交易所	美国	23,122	31,844,869.30	5.19
5	BROADCOM INC	博通公司	AVGO US	纳斯达克证券交易所	美国	2,659	30,425,052.31	4.96
6	META PLATFORMS INC-CLASS A	-	META US	纳斯达克证券交易所	美国	7,746	27,835,058.09	4.54
7	ALPHABET INC-CL A	谷歌(Alphabet)	GOOGL US	纳斯达克证券交易所	美国	13,051	16,942,111.54	2.76
8	ALPHABET INC-CL C	谷歌(Alphabet)	GOOG US	纳斯达克证券交易所	美国	12,480	16,313,826.75	2.66
9	COSTCO WHOLESALE CORP	好市多公司	COST US	纳斯达克证券交易所	美国	2,544	15,410,811.01	2.51
10	TESLA INC	特斯拉公司	TSLA US	纳斯达克证券交易所	美国	10,725	15,124,943.95	2.46
11	NETFLIX INC	奈飞公司	NFLX US	纳斯达克证券交易所	美国	2,472	11,889,664.39	1.94
12	ADVANCE	美国超	AMD	纳斯达	美国	9,275	10,722,254.56	1.75

	D MICRO DEVICES	威半导体公司	US	克证券交易所				
13	ADOBE INC	奥多比公司	ADBE US	纳斯达克证券交易所	美国	2,570	10,175,201.75	1.66
14	PEPSICO INC	百事公司	PEP US	纳斯达克证券交易所	美国	7,889	9,272,913.03	1.51
15	QUALCOMM INC	高通公司	QCOM US	纳斯达克证券交易所	美国	6,404	9,090,580.62	1.48
16	Linde PLC	-	LIN US	纳斯达克证券交易所	美国	2,758	8,625,124.04	1.41
17	T-MOBILE US INC	-	TMUS US	纳斯达克证券交易所	美国	6,725	8,443,907.47	1.38
18	APPLIED MATERIALS INC	应用材料	AMAT US	纳斯达克证券交易所	美国	4,750	7,988,804.28	1.30
19	CISCO SYSTEMS INC	思科	CSCO US	纳斯达克证券交易所	美国	23,120	7,828,299.48	1.28
20	INTUIT INC	财捷公司	INTU US	纳斯达克证券交易所	美国	1,604	7,512,821.98	1.22
21	TEXAS INSTRUMENTS INC	德州仪器公司	TXN US	纳斯达克证券交易所	美国	5,224	7,242,430.33	1.18
22	AMGEN INC	安进公司	AMGN US	纳斯达克证券交易所	美国	3,078	6,853,993.94	1.12
23	INTUITIVE SURGICAL INC	直觉外科手术公司	ISRG US	纳斯达克证券交易所	美国	2,035	6,451,676.45	1.05
24	COMCAST CORP-CLASS A	康卡斯特公司	CMCSA US	纳斯达克证券交易所	美国	22,462	6,268,818.23	1.02
25	MICRON TECHNOLOGY INC	美光科技公司	MU US	纳斯达克证券交易所	美国	6,355	5,957,100.77	0.97
26	LAM RESEARCH CORP	拉姆研究公司	LRCX US	纳斯达克证券交易所	美国	750	5,691,729.74	0.93

27	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	霍尼韦尔国际公司	HON US	纳斯达克证券交易所	美国	3,736	5,685,657.27	0.93
28	BOOKING HOLDINGS INC	-	BKNG US	纳斯达克证券交易所	美国	194	5,477,166.73	0.89
29	INTEL CORP	英特尔公司	INTC US	纳斯达克证券交易所	美国	24,430	5,392,116.21	0.88
30	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	福泰制药公司	VRTX US	纳斯达克证券交易所	美国	1,480	4,943,901.07	0.81
31	REGENERON PHARMACEUTICALS	再生元制药股份有限公司	REGN US	纳斯达克证券交易所	美国	621	4,651,588.46	0.76
32	ANALOG DEVICES INC	亚德诺公司	ADI US	纳斯达克证券交易所	美国	2,847	4,631,395.31	0.75
33	KLA CORP	科天半导体公司	KLAC US	纳斯达克证券交易所	美国	772	4,536,362.99	0.74
34	PALO ALTO NETWORKS INC	-	PANW US	纳斯达克证券交易所	美国	1,857	4,486,616.86	0.73
35	AUTOMATIC DATA PROCESSING	自动数据处理公司	ADP US	纳斯达克证券交易所	美国	2,348	3,994,173.15	0.65
36	ASML HOLDING NV-NY REG SHS	阿斯麦公司	ASML US	纳斯达克证券交易所	美国	522	3,804,749.51	0.62
37	SYNOPSYS INC	新思科技公司	SNPS US	纳斯达克证券交易所	美国	879	3,727,727.90	0.61
38	PDD HOLDINGS INC	拼多多	PDD US	纳斯达克证券交易所	美国	3,832	3,630,850.89	0.59
39	CROWDSTRIKE	-	CRWD US	纳斯达克证券	美国	1,323	3,613,005.16	0.59

	HOLDINGS INC - A			交易所				
40	STARBUCKS CORP	星巴克	SBUX US	纳斯达克证券交易所	美国	6,500	3,606,338.97	0.59
41	MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	亿滋国际有限公司	MDLZ US	纳斯达克证券交易所	美国	7,697	3,589,709.87	0.58
42	GILEAD SCIENCES INC	吉利德科学公司	GILD US	纳斯达克证券交易所	美国	7,149	3,495,644.73	0.57
43	CADENCE DESIGN SYS INC	铿腾电子公司	CDNS US	纳斯达克证券交易所	美国	1,561	3,423,698.68	0.56
44	MERCADO LIBRE INC	-	MELI US	纳斯达克证券交易所	美国	290	3,396,533.10	0.55
45	CINTAS CORP	信达思公司	CTAS US	纳斯达克证券交易所	美国	582	2,904,536.75	0.47
46	MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	万豪国际	MAR US	纳斯达克证券交易所	美国	1,638	2,822,350.06	0.46
47	NXP SEMICONDUCTORS NV	恩智浦半导体公司	NXPI US	纳斯达克证券交易所	美国	1,467	2,813,340.15	0.46
48	AIRBNB INC-CLASS A	爱彼迎	ABNB US	纳斯达克证券交易所	美国	2,533	2,737,252.72	0.45
49	CSX CORP	CSX运输公司	CSX US	纳斯达克证券交易所	美国	11,218	2,674,275.40	0.44
50	CONSTELLATION ENERGY	-	CEG US	纳斯达克证券交易所	美国	1,808	2,580,529.90	0.42
51	O'REILLY AUTOMOTIVE INC	奥莱利汽车股份有限公司	ORLY US	纳斯达克证券交易所	美国	337	2,536,372.67	0.41
52	PAYPAL	-	PYPL	纳斯达	美国	6,003	2,482,649.93	0.40

	HOLDINGS INC		US	克证券交易所				
53	MARVELL TECHNOLOGY INC	-	MRVL US	纳斯达克证券交易所	美国	4,966	2,473,879.05	0.40
54	ROPER TECHNOLOGIES INC	儒博科技公司	ROP US	纳斯达克证券交易所	美国	614	2,466,494.54	0.40
55	PACCAR INC	帕卡公司	PCAR US	纳斯达克证券交易所	美国	3,007	2,206,033.81	0.36
56	AUTODESK INC	欧特克有限公司	ADSK US	纳斯达克证券交易所	美国	1,236	2,179,718.95	0.36
57	COPART INC	科帕特公司	CPRT US	纳斯达克证券交易所	美国	5,521	2,131,036.92	0.35
58	MONSTER BEVERAGE CORP	怪物饮料公司	MNST US	纳斯达克证券交易所	美国	5,978	2,128,070.32	0.35
59	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	微芯科技公司	MCHP US	纳斯达克证券交易所	美国	3,080	2,008,474.78	0.33
60	ROSS STORES INC	罗斯百货公司	ROST US	纳斯达克证券交易所	美国	1,924	1,992,622.49	0.32
61	WORKDAY INC-CLASS A	-	WDAY US	纳斯达克证券交易所	美国	1,216	1,937,413.17	0.32
62	AMERICAN ELECTRIC POWER	美国电力公司	AEP US	纳斯达克证券交易所	美国	3,024	1,890,923.63	0.31
63	FORTINET INC	飞塔公司	FTNT US	纳斯达克证券交易所	美国	4,383	1,882,639.79	0.31
64	MODERNA INC	-	MRNA US	纳斯达克证券交易所	美国	2,199	1,861,030.19	0.30
65	ASTRAZENECA PLC-SPONS ADR	阿斯利康制药公司	AZN US	纳斯达克证券交易所	美国	3,341	1,856,991.72	0.30
66	KEURIG DR	-	KDP	纳斯达	美国	7,779	1,851,675.20	0.30

	PEPPER INC		US	克证券交易所				
67	DEXCOM INC	德康医疗公司	DXCM US	纳斯达克证券交易所	美国	2,281	1,843,131.45	0.30
68	TRADE DESK INC/THE -CLASS A	-	TTD US	纳斯达克证券交易所	美国	2,554	1,777,774.42	0.29
69	CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	特许通讯公司	CHTR US	纳斯达克证券交易所	美国	826	1,759,898.83	0.29
70	PAYCHEX INC	沛齐公司	PAYX US	纳斯达克证券交易所	美国	2,065	1,744,828.79	0.28
71	DOORDASH INC - A	-	DASH US	纳斯达克证券交易所	美国	2,190	1,697,804.74	0.28
72	IDEXX LABORATORIES INC	IDEXX实验室公司	IDXX US	纳斯达克证券交易所	美国	473	1,642,339.70	0.27
73	DATADOG INC - CLASS A	-	DDOG US	纳斯达克证券交易所	美国	1,769	1,635,041.93	0.27
74	KRAFT HEINZ CO/THE	卡夫亨氏公司	KHC US	纳斯达克证券交易所	美国	6,968	1,600,030.46	0.26
75	VERISK ANALYTICS INC	-	VRSK US	纳斯达克证券交易所	美国	818	1,571,401.67	0.26
76	OLD DOMINION FREIGHT LINE	统领货运线公司	ODFL US	纳斯达克证券交易所	美国	1,246	1,568,206.73	0.26
77	ELECTRONIC ARTS INC	艺电公司	EA US	纳斯达克证券交易所	美国	1,528	1,517,268.92	0.25
78	LULULEMON ATHLETICA INC	露露乐蒙公司	LULU US	纳斯达克证券交易所	美国	693	1,475,241.19	0.24
79	FASTENAL CO	快扣	FAST US	纳斯达克证券	美国	3,285	1,471,181.05	0.24

				交易所				
80	DIAMOND BACK ENERGY INC	DIAMONDBACK 能源公司	FANG US	纳斯达克证券交易所	美国	1,023	1,459,528.52	0.24
81	GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	-	GEHC US	纳斯达克证券交易所	美国	2,619	1,454,383.75	0.24
82	BAKER HUGHES CO	贝克休斯公司	BKR US	纳斯达克证券交易所	美国	5,726	1,435,219.36	0.23
83	EXELON CORP	爱克斯龙电力公司	EXC US	纳斯达克证券交易所	美国	5,738	1,415,326.75	0.23
84	COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	高知特科技公司	CTSH US	纳斯达克证券交易所	美国	2,852	1,382,143.08	0.23
85	BIOGEN INC	生物基因公司	BIIB US	纳斯达克证券交易所	美国	835	1,379,532.54	0.22
86	COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	可口可乐欧洲合伙公司	CCEP US	纳斯达克证券交易所	美国	2,634	1,367,915.00	0.22
87	COSTAR GROUP INC	科斯塔集团	CSGP US	纳斯达克证券交易所	美国	2,343	1,237,996.57	0.20
88	CDW CORP/DE	-	CDW US	纳斯达克证券交易所	美国	771	1,229,947.71	0.20
89	XCEL ENERGY INC	埃克西尔能源公司	XEL US	纳斯达克证券交易所	美国	3,188	1,213,487.93	0.20
90	ON SEMICONDUCTOR	安森美半导体	ON US	纳斯达克证券交易所	美国	2,468	1,205,722.00	0.20
91	ZSCALER INC	-	ZS US	纳斯达克证券交易所	美国	859	1,176,572.04	0.19
92	ATLASSIA	-	TEAM	纳斯达	美国	913	1,150,917.19	0.19

	N CORP-CL A		US	克证券交易所				
93	ANSYS INC	安西斯公司	ANSS US	纳斯达克证券交易所	美国	500	1,145,633.10	0.19
94	GLOBALFOUNDRIES INC	格芯股份有限公司	GFS US	纳斯达克证券交易所	美国	3,164	1,140,087.31	0.19
95	TAKE-TWO INTERAC	TAKE-TWO互动软件公司	TTWO US	纳斯达克证券交易所	美国	983	1,089,307.65	0.18
96	DOLLAR TREE INC	美元树	DLTR US	纳斯达克证券交易所	美国	1,251	951,921.47	0.16
97	ARM Holdings PLC	-	ARM US	纳斯达克证券交易所	美国	678	790,607.00	0.13
98	MONGODB INC	-	MDB US	纳斯达克证券交易所	美国	420	748,194.27	0.12
99	WARNER BROS DISCOVERY INC	-	WBD US	纳斯达克证券交易所	美国	14,062	745,614.94	0.12
100	ILLUMINA INC	-	ILMN US	纳斯达克证券交易所	美国	914	679,920.38	0.11
101	WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	沃尔格林联合博姿集团	WBA US	纳斯达克证券交易所	美国	4,950	426,683.30	0.07
102	GRAIL INC	-	GRAL US	纳斯达克证券交易所	美国	296	32,423.52	0.01

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

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	58,970,855.05	46.45
2	APPLE INC	AAPL US	57,370,147.85	45.19
3	NVIDIA CORP	NVDA US	37,141,565.43	29.26
4	AMAZON.COM INC	AMZN US	33,359,679.74	26.28
5	BROADCOM INC	AVGO US	30,844,224.68	24.30
6	META PLATFORMS INC-CLASS A	META US	29,383,137.37	23.15
7	TESLA INC	TSLA US	18,242,452.86	14.37
8	ALPHABET INC-CL A	GOOGL US	17,389,697.92	13.70
9	ALPHABET INC-CL C	GOOG US	16,861,846.91	13.28
10	COSTCO WHOLESALE CORP	COST US	16,182,713.55	12.75
11	ADVANCED MICRO DEVICES	AMD US	13,751,041.48	10.83
12	ADOBE INC	ADBE US	12,895,907.77	10.16
13	NETFLIX INC	NFLX US	12,318,533.30	9.70
14	PEPSICO INC	PEP US	11,477,676.79	9.04
15	LINDE PLC	LIN US	10,387,986.15	8.18
16	CISCO SYSTEMS INC	CSCO US	9,987,134.01	7.87
17	T-MOBILE US INC	TMUS US	9,483,574.00	7.47
18	QUALCOMM INC	QCOM US	9,207,745.77	7.25
19	INTEL CORP	INTC US	8,973,002.66	7.07
20	INTUIT INC	INTU US	8,820,322.15	6.95
21	COMCAST CORP-CLASS A	CMCSA US	8,341,749.73	6.57
22	AMGEN INC	AMGN US	8,133,766.63	6.41
23	TEXAS INSTRUMENTS INC	TXN US	7,899,972.93	6.22
24	APPLIED MATERIALS INC	AMAT US	7,816,726.32	6.16
25	INTUITIVE SURGICAL INC	ISRG US	6,833,625.22	5.38
26	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	HON US	6,607,527.72	5.21
27	BOOKING HOLDINGS INC	BKNG US	6,241,085.11	4.92
28	LAM RESEARCH CORP	LRCX US	5,867,935.86	4.62
29	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	VRTX US	5,631,765.94	4.44
30	MICRON TECHNOLOGY	MU US	5,559,154.28	4.38

	INC			
31	PALO ALTO NETWORKS INC	PANW US	5,192,394.15	4.09
32	REGENERON PHARMACEUTICALS	REGN US	5,184,770.46	4.08
33	STARBUCKS CORP	SBUX US	5,059,834.76	3.99
34	ANALOG DEVICES INC	ADI US	5,039,634.96	3.97
35	AUTOMATIC DATA PROCESSING	ADP US	4,950,946.08	3.90
36	MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	MDLZ US	4,860,541.32	3.83
37	GILEAD SCIENCES INC	GILD US	4,669,690.97	3.68
38	PINDUODUO INC-ADR	PDD US	4,582,977.81	3.61
39	KLA CORP	KLAC US	4,536,912.23	3.57
40	MERCADOLIBRE INC	MELI US	4,274,084.43	3.37
41	SYNOPSYS INC	SNPS US	4,254,087.90	3.35
42	ASML HOLDING NV-NY REG SHS	ASML US	4,057,482.02	3.20
43	CADENCE DESIGN SYS INC	CDNS US	4,050,809.50	3.19
44	CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	CRWD US	3,661,129.52	2.88
45	MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	MAR US	3,459,601.44	2.73
46	CSX CORP	CSX US	3,419,201.07	2.69
47	PAYPAL HOLDINGS INC	PYPL US	3,247,373.66	2.56
48	CINTAS CORP	CTAS US	3,186,605.55	2.51
49	AIRBNB INC-CLASS A	ABNB US	3,173,918.56	2.50
50	MARVELL TECHNOLOGY INC	MRVL US	3,037,855.14	2.39
51	O'REILLY AUTOMOTIVE INC	ORLY US	3,021,321.61	2.38
52	NXP SEMICONDUCTORS NV	NXPI US	3,003,024.90	2.37
53	ROPER TECHNOLOGIES INC	ROP US	2,920,829.39	2.30
54	WORKDAY INC-CLASS A	WDAY US	2,883,425.53	2.27
55	MONSTER BEVERAGE CORP	MNST US	2,816,072.12	2.22
56	PACCAR INC	PCAR US	2,700,624.47	2.13
57	AUTODESK INC	ADSK US	2,653,045.29	2.09
58	LULULEMON	LULU US	2,591,313.10	2.04

	ATHLETICA INC			

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	22,707,009.93	17.89
2	APPLE INC	AAPL US	20,071,695.00	15.81
3	NVIDIA CORP	NVDA US	15,488,302.45	12.20
4	AMAZON.COM INC	AMZN US	13,336,768.32	10.51
5	META PLATFORMS INC-CLASS A	META US	12,881,490.43	10.15
6	BROADCOM INC	AVGO US	11,368,370.72	8.96
7	ALPHABET INC-CL A	GOOGL US	6,571,850.99	5.18
8	ALPHABET INC-CL C	GOOG US	6,456,456.79	5.09
9	COSTCO WHOLESALE CORP	COST US	6,095,594.22	4.80
10	TESLA INC	TSLA US	5,932,663.99	4.67
11	ADVANCED MICRO DEVICES	AMD US	5,400,852.74	4.25
12	NETFLIX INC	NFLX US	5,138,102.92	4.05
13	PEPSICO INC	PEP US	4,460,712.62	3.51
14	ADOBE INC	ADBE US	4,453,918.41	3.51
15	CISCO SYSTEMS INC	CSCO US	3,796,659.25	2.99
16	QUALCOMM INC	QCOM US	3,498,592.26	2.76
17	T-MOBILE US INC	TMUS US	3,395,919.03	2.68
18	INTUIT INC	INTU US	3,363,831.25	2.65
19	COMCAST CORP-CLASS A	CMCSA US	3,250,584.69	2.56
20	APPLIED MATERIALS INC	AMAT US	3,211,185.56	2.53
21	INTEL CORP	INTC US	3,173,306.64	2.50
22	TEXAS INSTRUMENTS INC	TXN US	2,908,393.57	2.29
23	AMGEN INC	AMGN US	2,787,894.77	2.20
24	INTUITIVE SURGICAL INC	ISRG US	2,567,109.97	2.02

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	677,658,339.50
卖出收入（成交）总额	256,697,661.16

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	72,718.31
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	72,718.31

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		招商纳斯达克100ETF发起式联接（QDII）	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
5,926	68,468.45	189,092,502.00	46.60%	216,651,562.00	53.40%	142,348,300.00	35.08%

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	邱丕云	41,501,400.00	10.23%
2	BARCLAYS BANK PLC	4,829,396.00	1.19%
3	深圳东方港湾投资管理股份有限公司-东方港湾湘财精选1号私募证券投资基金	4,376,500.00	1.08%
4	五矿国际信托有限公司-五矿信托-恒信日鑫37号-东方港湾1号集合资金信托计划	3,898,600.00	0.96%
5	招银理财有限责任公司-招银理财招智泓瑞混合策略FOF日开一号混合类理财计划	3,880,200.00	0.96%
6	陈青	3,104,100.00	0.77%
7	上海常春藤资产管理有限公司-常春藤春竹证券投资基金	3,059,200.00	0.75%
8	陆杏娟	3,022,500.00	0.74%
9	杨媛	2,743,100.00	0.68%
10	刘法正	2,660,800.00	0.66%
-	招商纳斯达克100ETF发起式联接（QDII）	142,348,300.00	35.08%

注：以上数据由中国证券登记结算公司提供，前十名持有人均为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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
本报告期期初基金份额总额	96,744,064.00
本报告期基金总申购份额	592,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	283,000,000.00

本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-
本报告期期末基金份额总额	405,744,064.00

§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

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，经中国银行股份有限公司研究决定，郭德秋先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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	
HUATAI	1	658,869,551.63	70.85%	104,761.01	70.36%	-
银河国际证券（香港）	1	258,054,957.75	27.75%	39,555.55	26.56%	-
银河证券	2	12,332,559.73	1.33%	1,986.05	1.33%	-
里昂证券	1	650,114.03	0.07%	2,599.78	1.75%	-
财通证券	3	-	-	-	-	-
长城证券	3	-	-	-	-	-
长江证券	4	-	-	-	-	-
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	3	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	4	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	3	-	-	-	-	-
国投证券	6	-	-	-	-	-
国新证券	2	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	4	-	-	-	-	-

华泰证券	4	-	-	-	-	-
华西证券	3	-	-	-	-	-
华源证券	2	-	-	-	-	-
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
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	5	-	-	-	-	-
万和证券	1	-	-	-	-	-
五矿证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	3	-	-	-	-	-
信达证券	7	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	6	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中航证券	2	-	-	-	-	-
中金财富证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	5	-	-	-	-	-
中泰证券	3	-	-	-	-	-
中信建投证券	5	-	-	-	-	-
中信证券	11	-	-	-	-	-
中银国际证券	3	-	-	-	-	-
中邮证券	2	-	-	-	-	-
甬兴证券	2	-	-	-	-	-

注：本报告期内，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
HUATAI	-	-	-	-	-	-
银河国际证券（香港）	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
里昂证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
国新证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
华源证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-
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	关于招商纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金（QDII）2024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	2024-01-10
2	招商基金管理有限公司旗下部分基金增加民生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	2024-01-15
3	招商基金管理有限公司关于指定旗下部分证券投资基金主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	2024-01-15
4	招商基金管理有限公司关于终止北京中期时代基金销售有限公司办理旗下基金销售业务的公告	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	2024-01-18
5	招商基金管理有限公司旗下基金2023年第4季度报告提示性公告	证券时报及基金管理人网站	2024-01-19
6	招商纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金（QDII）2023年第4季度报告	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	2024-01-19
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）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	2024-01-26
8	关于招商纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金（QDII）2024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	2024-02-07
9	招商基金管理有限公司旗下部分基金增加申万宏源证券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	2024-02-28
10	招商基金管理有限公司旗下部分基金增加申万宏源西部证券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	2024-02-28
11	关于招商纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金（QDII）增加东海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	2024-03-01
12	招商纳斯达克100交易型开放式指数证券投资	证券时报、基金管理	2024-03-12

	基金（QDII）基金产品资料概要更新	人网站及中国证监会基金电子披露网站	
13	招商纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金（QDII）更新的招募说明书（二零二四年第一号）	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	2024-03-12
14	招商基金管理有限公司关于招商纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金（QDII）调整申购赎回折算汇率的公告	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	2024-03-12
15	关于招商纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金（QDII）增加华安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	2024-03-15
16	关于招商纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金（QDII）增加湘财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	2024-03-26
17	招商基金管理有限公司关于调整旗下部分证券投资基金主流动性服务商为一般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	2024-03-27
18	关于旗下部分基金2024年3月29日因境外主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	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	2024-03-27
19	招商基金管理有限公司旗下基金2023年年度报告提示性公告	证券时报及基金管理人网站	2024-03-29
20	招商纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金（QDII）2023年年度报告	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	2024-03-29
21	招商纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金产品资料概要更新	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	2024-04-11
22	招商纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金（QDII）更新的招募说明书（二零二四年第二号）	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	2024-04-11
23	招商纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金（QDII）2024年第1季度报告	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	2024-04-19
24	招商基金管理有限公司旗下基金2024年第1季度报告提示性公告	证券时报及基金管理人网站	2024-04-19
25	招商基金管理有限公司旗下部分基金增加华宝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	2024-04-22
26	招商基金管理有限公司旗下部分基金增加东兴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	2024-04-24
27	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	2024-05-18

		基金电子披露网站	
28	关于旗下部分基金2024年5月27日因境外主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	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	2024-05-23
29	关于旗下部分基金2024年6月19日因境外主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	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	2024-06-14
30	招商纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金产品资料概要更新	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	2024-06-28

§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
招商纳斯达克100ETF发起式联接（QDII）	1	20240101-20240121, 20240320-20240630	25,120,500.00	183,329,500.00	66,101,700.00	142,348,300.00	35.08%
机构	1	20240117-20240121	14,620,668.00	118,981,100.00	128,772,372.00	4,829,396.00	1.19%
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、红利再投资或者买入等业务增加的份额，赎回份额包含赎回、转换转出或者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

2024年8月30日