

宝盈纳斯达克 100 指数型发起式证券投资
基金（QDII）
2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：宝盈基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：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、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 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 3 月 22 日（基金合同生效日）起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人.....	6
2.5 信息披露方式.....	6
2.6 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	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.....	11
4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	11
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	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.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	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.....	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 净资产变动表.....	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.....	43
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所有权益投资明细	44
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动	52
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	54
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	54
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	54
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	54
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	54
7.11 投资组合报告附注	54
§8 基金份额持有人信息	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
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	56
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	56
§9 开放式基金份额变动	57
§10 重大事件揭示	57
10.1 基金份额持有人大会决议	57
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	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
10.4 基金投资策略的改变	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
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	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	58
10.8 其他重大事件	59
§11 影响投资者决策的其他重要信息	61
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	61
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	61
§12 备查文件目录	61
12.1 备查文件目录	61
12.2 存放地点	62
12.3 查阅方式	62

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	宝盈纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金（QDII）	
基金简称	宝盈纳斯达克 100 指数发起（QDII）	
基金主代码	019736	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2024 年 3 月 22 日	
基金管理人	宝盈基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	240,823,114.10 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	宝盈纳斯达克 100 指数发起（QDII）A 人民币	宝盈纳斯达克 100 指数发起（QDII）C 人民币
下属分级基金的交易代码	019736	019737
报告期末下属分级基金的份额总额	80,373,181.00 份	160,449,933.10 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动指数化投资，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	<p>本基金主要采用完全复制法跟踪标的指数，即原则上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>由于标的指数编制方法调整、成份股及其权重发生变化（包括配送股、增发、临时调入及调出成份股等）的原因，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，或因基金规模而投资受限，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，力求降低跟踪误差。</p> <p>本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照基金份额持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。</p> <p>本基金的投资策略主要包括资产配置策略、股票投资策略、衍生品投资策略、境外市场公募基金投资策略、债券投资策略、可转换债券（含可交换债券）投资策略、资产支持证券投资策略、存托凭证投资策略、融资和转融通证券出借、境外回购交易及证券借贷交易策略等。</p>
业绩比较基准	纳斯达克 100 指数收益率（使用估值汇率调整）×95%+人民币活期存款收益率（税后）×5%
风险收益特征	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、债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。本基金投资于境外证券，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		宝盈基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张磊	王小飞
	联系电话	0755-83276688	021-60637103
	电子邮箱	zhangl@byfunds.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400-8888-300	021-60637228
传真		0755-83515599	021-60635778
注册地址		深圳市深南路 6008 号特区报业大厦 1501	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		广东省深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 10 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		518034	100033
法定代表人		严震	张金良

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	-	JPMorgan Chase Bank, National Association
	中文	-	摩根大通银行
注册地址		-	1111 Polaris Parkway, Columbus, OH 43240, U.S.A.
办公地址		-	383 Madison Avenue, New York, NY 10179-0001, U.S.A.
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	www.byfunds.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	宝盈基金管理有限公司	广东省深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 10 层

§ 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	2024 年 3 月 22 日 (基金合同生效日) - 2024 年 6 月 30 日	
	宝盈纳斯达克 100 指数发起 (QDII) A 人民币	宝盈纳斯达克 100 指数发起 (QDII) C 人民币
本期已实现收益	-2,026,253.63	-2,112,399.43
本期利润	6,872,889.60	5,765,786.73
加权平均基金份额本期利润	0.0677	0.0594
本期加权平均净值利润率	6.69%	5.82%
本期基金份额净值增长率	7.64%	7.53%
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	-1,474,362.34	-3,051,502.10
期末可供分配基金份额利润	-0.0183	-0.0190
期末基金资产净值	86,511,718.35	172,533,844.64
期末基金份额净值	1.0764	1.0753
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	7.64%	7.53%

注：1、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。

2、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

4、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。

5、本基金合同生效日为 2024 年 3 月 22 日，自合同生效日起至披露时点未满一年。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

宝盈纳斯达克 100 指数发起 (QDII) A 人民币

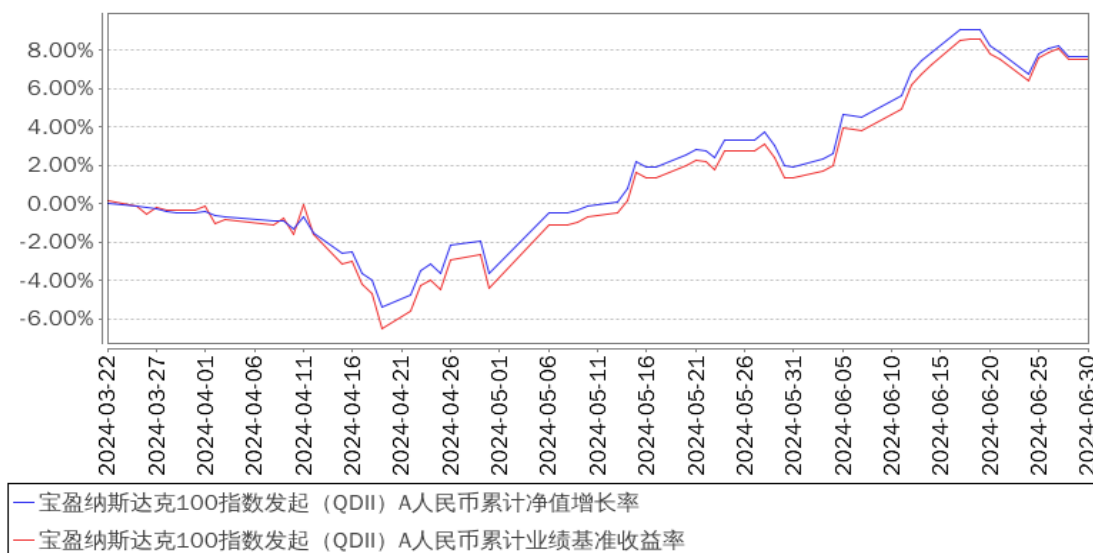
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	5.60%	0.74%	6.12%	0.73%	-0.52%	0.01%
过去三个月	8.14%	0.83%	7.90%	0.94%	0.24%	-0.11%
自基金合同生效起至今	7.64%	0.79%	7.54%	0.90%	0.10%	-0.11%

宝盈纳斯达克 100 指数发起 (QDII) C 人民币

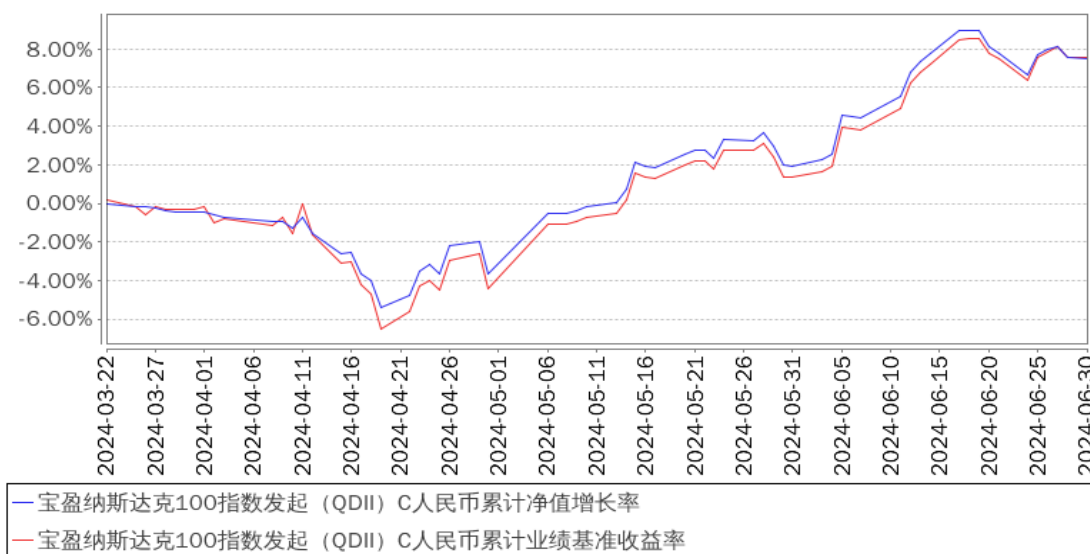
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	5.54%	0.73%	6.12%	0.73%	-0.58%	0.00%
过去三个月	8.04%	0.83%	7.90%	0.94%	0.14%	-0.11%
自基金合同生效起至今	7.53%	0.79%	7.54%	0.90%	-0.01%	-0.11%

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

宝盈纳斯达克100指数发起 (QDII) A人民币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



宝盈纳斯达克100指数发起 (QDII) C人民币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：1、按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起的 6 个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项资产配置比例将符合基金合同中的相关约定。

2、本基金合同生效日为 2024 年 3 月 22 日，自合同生效日起至披露时点未满一年。

§ 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

基金管理人：宝盈基金管理有限公司是 2001 年按照证监会“新的治理结构、新的内控体系”标准设立的首批基金管理公司之一，2001 年 5 月 18 日成立，注册资本为人民币 1 亿元，注册地在深圳。公司目前管理宝盈鸿利收益混合、宝盈泛沿海混合、宝盈策略增长混合、宝盈增强收益债券、宝盈资源优选混合、宝盈核心优势混合、宝盈货币、宝盈中证 100 指数增强、宝盈新价值混合、宝盈祥瑞混合、宝盈科技 30 混合、宝盈睿丰创新混合、宝盈先进制造混合、宝盈新兴产业混合、宝盈转型动力混合、宝盈祥泰混合、宝盈优势产业混合、宝盈新锐混合、宝盈医疗健康沪港深股票、宝盈国家安全沪港深股票、宝盈互联网沪港深混合、宝盈消费主题混合（由原基金鸿阳转型而来）、宝盈盈泰纯债债券、宝盈人工智能股票、宝盈安泰短债债券、宝盈祥瑞定期开放混合、宝盈聚享定期开放债券、宝盈品牌消费股票、宝盈盈润纯债债券、宝盈融源可转债债券、宝盈聚丰两年定开债券、宝盈研究精选混合、宝盈祥利稳健配置混合、宝盈祥泽混合、宝盈鸿盛债券、宝盈龙头优选股票、宝盈祥明一年定开混合、宝盈盈旭纯债债券、宝盈现代服务业混合、宝盈创新驱动股票、宝盈聚福 39 个月定开债、宝盈发展新动能股票、宝盈祥裕增强回报混合、宝盈盈沛纯债债券、宝盈基础产业混合、宝盈智慧生活混合、宝盈祥乐一年持有期混合、宝盈祥庆 9

个月持有混合、宝盈优质成长混合、宝盈成长精选混合、宝盈品质甄选混合、宝盈祥和 9 个月定开混合、宝盈安盛中短债债券、宝盈祥琪混合、宝盈新能源产业混合发起式、宝盈国证证券龙头指数发起式、宝盈聚鑫一年定期开放债券发起式、宝盈中证沪港深科技龙头指数发起式、宝盈半导体产业混合发起式、宝盈中证同业存单 AAA 指数 7 天持有、宝盈华证龙头红利 50 指数发起式、宝盈中债 0-5 年政策性金融债指数、宝盈纳斯达克 100 指数发起（QDII）、宝盈盈悦纯债债券、宝盈价值成长混合六十五只基金，公司恪守价值投资的投资理念，并逐渐形成了稳健、规范的投资风格。公司拥有一支经验丰富的投资管理团队，在研究方面，公司汇聚着一批从事宏观经济、行业、上市公司、债券和金融工程研究的专业人才，为公司的投资决策提供科学的研究支持；在投资方面，公司的基金经理具有丰富的证券市场投资经验，以自己的专业知识致力于获得良好业绩，努力为投资者创造丰厚的回报。

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		
蔡丹	本基金、宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金、宝盈宝盈祥瑞混合型证券投资基金、宝盈国证证券龙头指数型发起式证券投资基金、宝盈中证沪港深科技龙头指数型发起式证券投资基金、宝盈祥和 9 个月定期开放混合型证券投资基金、宝盈祥庆 9 个月持有期混合型证券投资基金、宝盈祥裕增强回报混合型证券投资基金、宝盈祥颐定期开放混合型证券投资基金、宝盈华证龙头红利 50 指数型发起式证券投资基金、宝盈新锐灵活配置混合型证券投资基金基金经理；量化投资部总经理	2024 年 3 月 22 日	-	13 年	蔡丹女士，CFA，中山大学概率论与数理统计硕士。曾任职于网易互动娱乐有限公司、广发证券股份有限公司，2011 年 9 月至 2017 年 7 月任职于长城证券股份有限公司，先后担任金融研究所金融工程研究员、资产管理部量化投资经理、执行董事。2017 年 7 月加入宝盈基金管理有限公司，中国国籍，证券投资基金从业人员资格。
阳之璇	本基金、宝盈国证证券龙头指数型发起式证券投资基金、宝盈中证沪港深科技龙头指数型发起式证券投资基金基金经理助理	2024 年 4 月 11 日	-	6 年	阳之璇女士，数学与统计硕士。2018 年 7 月加入宝盈基金管理有限公司担任量化研究员。中国国籍，证券投资基金从业人员资格。

注：1、本基金基金经理为首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写；本基金经理助理为首任基金经理助理，其“任职日期”指根据公司决定确定的聘任日期；

2、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，证券从业年限的计算截至 2024 年 6 月 30 日。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

报告期内本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金无境外投资顾问。

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》等有关法律法规及基金合同等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，无损害基金持有人利益的行为。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《宝盈基金管理有限公司公平交易制度》对本基金的日常交易行为进行监控，并定期制作公平交易分析报告，对不同投资组合的收益率、同向交易价差、反向交易价差作专项分析。报告结果表明，本基金在本报告期内的同向交易价差均在可合理解释范围之内；在本报告期内基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，在投资活动中公平对待不同投资组合，公平交易制度执行情况良好，无损害基金持有人利益的行为。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。

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

今年一季度美国 GDP 同比增 1.6%，低于预期值 2.5%；4 月 ISM 制造业和非制造业 PMI 均低于预期；5 月 ISM 非制造业 PMI 反弹，但制造业 PMI 仍低于预期，宏观经济前景有一定不确定性。通胀方面，上半年美国通胀延续缓慢回落态势，从 1 月的 3.1%到 6 月的 3%。通胀回落和薪资粘性导致居民实际收入增速回升，带动消费修复。就业方面，今年 4 月就业数据强劲程度全面弱于预期。5 月非农数据和失业率出现背离，失业率超预期升高，非农数据表现较好或来自统计因素影响。6 月份美联储召开议息会议，维持 525-550bps 的政策利率不变，强调尽管 5 月通胀回落增强

了降息信心，但单月数据并不足以改变议息决策，美联储需要更多证据证明降通胀取得进展。

今年一季度由于 AI 算力高景气支撑、科技巨头 2023 年业绩超预期，美股上涨明显，4 月初，由于超微电脑未发布业绩预告带来对 AI 算力产业的恐慌，叠加美联储强调持续通胀风险，美股股价大幅回调，4 月下旬随着 2024 年一季度财报季到来、4 月份通胀和就业数据降温，ISM 非制造业 PMI 低于预期，叠加美国财政保持宽松以及对技术革命的预期助力美股成长权益资产持续走高。纳斯达克 100 指数上半年上涨 16.98%，同期上证指数下跌 0.25%，标普 500 指数上涨 14.48%。

当前美股投资者情绪整体乐观，市场流动性充裕，估值和杠杆率位于合理区间。纳斯达克 100 指数 6 月末市盈率为 32.33X，ROE 为 21.11%，24 年、25 年一致预期 ROE 分别为 21.59%和 23.50%，指数净利润单季度同比增速为 26.55%，2024 年、2025 年一致预期净利润同比增速分别为 18.48%和 22.48%，未来两年业绩有望保持高速增长。

本基金采取完全复制的被动式指数基金管理策略，用量化方法来跟踪和控制偏离度，力争跟踪指数的收益，并将基金跟踪误差控制在合理范围内。本基金 4 月 22 日开放申赎，开放申赎以来 A 份额年化跟踪误差为 1.15%，较好地跟踪了基准指数的表现。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末宝盈纳斯达克 100 指数发起 (QDII) A 人民币的基金份额净值为 1.0764 元，本报告期基金份额净值增长率为 7.64%；截至本报告期末宝盈纳斯达克 100 指数发起 (QDII) C 人民币的基金份额净值为 1.0753 元，本报告期基金份额净值增长率为 7.53%。同期业绩比较基准收益率为 7.54%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，中性情形下美国实际增长窄幅波动。其中消费是主要缓冲垫；住宅投资增速可能会较显著回落；非住宅投资增速略微放缓；降息带动居民部门杠杆率触底。预计全年实际 GDP 同比增速 2.3%。美国通胀和名义增长将继续放缓，但薪资以及租房价格粘性降低通胀下行斜率，预计其核心 CPI 同比年末回落到 3.1%左右水平。预计美联储 9 月启动降息，年内降息 2 次左右，政策利率年末回到 4.75%-5%。

下半年美股业绩复苏扩散，回购和货币基金有望提供增量资金。纳斯达克 100 指数 24 年、25 年一致预期 ROE 分别为 21.59%、23.50%，净利润同比增速分别为 18.48%、22.48%，业绩保持高速增长。且指数中除 7 巨头外的成分股盈利增速上行，若美联储未来的降息周期导致货币基金收益率持续下降，目前囤积在美国货币基金中的巨量资金有望成为美股的增量资金来源。

美国大选结果将影响宏观经济环境，目前来看若特朗普当选，其推行的关税壁垒政策、移民政策可能加大国内商品和劳动力成本，对通胀形成一定助推作用，但影响未必很显著。另外，美

联储降息时点临近也会导致海外股市波动加大，大型科技公司具备一定避险属性，降息预期升温可能会导致资金从中流出，流向高风险行业、降息受益行业。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金持有的投资品种进行估值。基金托管人根据法律法规要求对基金管理公司采用的估值政策和程序进行核查，并对估值结果及净值计算进行复核。

本基金管理人设立估值委员会，由公司投研、运营的分管领导、督察长及研究部、投资部门（权益投资部、固定收益部等）、风险管理部、基金运营部、监察稽核部总经理共同组成，以上人员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历。估值委员会负责制定、修订和完善公司估值政策和程序，定期评价估值政策和程序修订的适用性。日常基金资产的估值程序，由基金运营部负责执行。对需要进行估值调整的投资品种，管理人启动估值调整程序，并与基金托管人协商一致，必要时征求会计师事务所的专业意见，由估值委员会会议定估值方案，基金运营部具体执行。

截止报告期末，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司建立业务合作关系，由其按约定提供有关债券品种、流通受限股票等估值参考数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金为发起式基金，《公开募集证券投资基金运作管理办法》关于基金份额持有人数量及基金资产净值的限制性条款暂不适用于本基金。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：宝盈纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金 (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
资产：		
货币资金	6.4.7.1	27,095,094.31
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	239,391,455.13
其中：股票投资		239,391,455.13
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	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		27,215.75
应收申购款		20,804,581.63
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.8	-
资产总计		287,318,346.82
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-

衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		6,694,118.64
应付赎回款		21,424,600.88
应付管理人报酬		85,911.86
应付托管费		25,773.55
应付销售服务费		24,659.46
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	17,719.44
负债合计		28,272,783.83
净资产：		
实收基金	6.4.7.10	240,823,114.10
未分配利润	6.4.7.11	18,222,448.89
净资产合计		259,045,562.99
负债和净资产总计		287,318,346.82

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，宝盈纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金 (QDII) A 类基金份额净值人民币 1.0764 元，A 类基金份额 80,373,181.00 份；C 类基金份额净值人民币 1.0753 元，C 类基金份额 160,449,933.10 份；宝盈纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金 (QDII) 基金份额总额合计为 240,823,114.10 份。

6.2 利润表

会计主体：宝盈纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金 (QDII)

本报告期：2024 年 3 月 22 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2024 年 3 月 22 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		13,094,627.13
1. 利息收入		97,265.57
其中：存款利息收入	6.4.7.12	97,265.57
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）		828,696.11
其中：股票投资收益	6.4.7.13	521,614.17
基金投资收益	6.4.7.14	-
债券投资收益	6.4.7.15	-

资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-
股利收益	6.4.7.19	307,081.94
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益 (损失以“-”号填列)	6.4.7.20	16,777,329.39
4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列)		-4,611,087.56
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	6.4.7.21	2,423.62
减：二、营业总支出		455,950.80
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	274,648.20
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6.4.10.2.2	82,394.45
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	67,148.71
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	6.4.7.22	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	6.4.7.23	31,759.44
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)		12,638,676.33
减：所得税费用		-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)		12,638,676.33
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		12,638,676.33

注：本基金合同生效日为 2024 年 3 月 22 日，无上年可比期间数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：宝盈纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金 (QDII)

本报告期：2024 年 3 月 22 日 (基金合同生效日) 至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2024 年 3 月 22 日 (基金合同生效日) 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	-	-	-	-
二、本期期初净资产	212,707,735.36	-	-	212,707,735.36
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	28,115,378.74	-	18,222,448.89	46,337,827.63

(一)、综合收益总额	-	-	12,638,676.33	12,638,676.33
(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)	28,115,378.74	-	5,583,772.56	33,699,151.30
其中：1. 基金申购款	171,124,597.75	-	9,559,711.55	180,684,309.30
2. 基金赎回款	-143,009,219.01	-	-3,975,938.99	-146,985,158.00
(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、本期期末净资产	240,823,114.10	-	18,222,448.89	259,045,562.99

注：本基金合同生效日为 2024 年 3 月 22 日，无上年可比期间数据。

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：

杨凯

张献锦

何瑜

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

宝盈纳斯达克 100 指数型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[2023] 2165 号《关于准予宝盈纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金(QDII)注册的批复》准予注册，由宝盈基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《宝盈纳斯达克 100 指数型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 212,638,736.26 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(2024)第 0093 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《宝盈纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金(QDII)基金合同》于 2024 年 3 月 22 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为

212,707,735.36 份基金份额,其中认购资金利息折合 68,999.10 份基金份额。本基金的基金管理人为宝盈基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金为发起式基金。发起资金认购部分为 10,004,950.50 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。

根据《宝盈纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金(QDII)基金合同》和《宝盈纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金(QDII)招募说明书》的有关规定,本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购基金份额时收取认购、申购费用,在赎回时根据持有期限收取赎回费用,而不再从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 A 类基金份额;在投资者认购、申购基金份额时不收取认购、申购费用,在赎回时根据持有期限收取赎回费用,且从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 C 类基金份额。在每一份额类别内,根据认购、申购、赎回计价币种的不同,分为人民币份额和美元份额。以人民币计价并进行认购、申购、赎回的份额类别,称为人民币份额;以美元计价并进行认购、申购、赎回的份额类别,称为美元份额(特指美元现汇份额,下同)。本基金对 A 类人民币份额、A 类美元份额、C 类人民币份额、C 类美元份额分别设置基金代码,分别披露基金份额净值和基金份额累计净值。所有类别的人民币份额和美元份额合并投资运作,共同承担投资换汇产生的费用。投资者可自行选择认购、申购的基金份额类别,并交付相应币种的款项。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《宝盈纳斯达克 100 指数型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及备选成份股。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,其中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跟踪同一标的指数的公募基金(包括开放式基金和交易型开放式指数基金(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、资产支持证券等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。其中在投资香港市场时,本基金可通过合格境内机构投资者(QDII)境外投资额度或内地与香港股票市场交易互联互通机制进行投资。境内市场投资工具包括国内依法发行或上市的股票(包括创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存

托凭证)、债券(包括国债、金融债、地方政府债、公开发行的次级债券、政府支持债券、政府支持机构债券、企业债、公司债、可转换债券(含分离交易可转债的纯债部分)、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、国债期货、股指期货、股票期权、银行存款、同业存单、货币市场工具、债券回购、资产支持证券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)。本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。本基金资产中投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%;投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不得低于基金资产净值的 80%;每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后,本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值 5%的现金(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:纳斯达克 100 指数收益率(使用估值汇率调整)×95%+人民币活期存款收益率(税后)×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》、《宝盈纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金(QDII)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

本基金 2024 年中期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 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2024 年 3 月 22 日(基金合同生效日)至 2024 年 6 月 30 日止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 2024 年 3 月 22 日(基金合同生效日)至 2024 年 6 月 30 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、金融负债或权益工具。

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，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。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

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

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

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

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、债券投资和资产支持证券投资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。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具

有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征,并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同);(4)除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外,该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征;(5)该工具在存续期内的预计现金流量总额,应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具,是指根据合同约定,持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利,或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时,自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同:(1)现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响);(2)实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具,列报于净资产。

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。

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及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税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。

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

本基金本报告期末发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末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[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》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[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]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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

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

(3) 目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家

或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 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	27,095,094.31
等于：本金	27,093,152.83
加：应计利息	1,941.48
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	27,095,094.31

注：货币资金中包括以下外币余额：活期存款 1,048,626.45 美元(折合人民币 7,473,350.98 元)。

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	222,614,125.74	-	239,391,455.13	16,777,329.39

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	222,614,125.74	-	239,391,455.13	16,777,329.39

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

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

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

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

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

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 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	17,719.44
合计	17,719.44

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

宝盈纳斯达克 100 指数发起 (QDII) A 人民币

项目	本期 2024年3月22日（基金合同生效日）至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	114,537,759.83	114,537,759.83
本期申购	27,767,676.19	27,767,676.19
本期赎回（以“-”号填列）	-61,932,255.02	-61,932,255.02
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	80,373,181.00	80,373,181.00

宝盈纳斯达克 100 指数发起 (QDII) C 人民币

项目	本期 2024年3月22日（基金合同生效日）至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	98,169,975.53	98,169,975.53
本期申购	143,356,921.56	143,356,921.56

本期赎回 (以“-”号填列)	-81,076,963.99	-81,076,963.99
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	160,449,933.10	160,449,933.10

6.4.7.11 未分配利润

单位: 人民币元

宝盈纳斯达克 100 指数发起 (QDII) A 人民币

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	-2,026,253.63	8,899,143.23	6,872,889.60
本期基金份额交易产生的变动数	551,891.29	-1,286,243.54	-734,352.25
其中: 基金申购款	-420,813.21	2,146,914.12	1,726,100.91
基金赎回款	972,704.50	-3,433,157.66	-2,460,453.16
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,474,362.34	7,612,899.69	6,138,537.35

宝盈纳斯达克 100 指数发起 (QDII) C 人民币

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	-2,112,399.43	7,878,186.16	5,765,786.73
本期基金份额交易产生的变动数	-939,102.67	7,257,227.48	6,318,124.81
其中: 基金申购款	-2,286,737.25	10,120,347.89	7,833,610.64
基金赎回款	1,347,634.58	-2,863,120.41	-1,515,485.83
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,051,502.10	15,135,413.64	12,083,911.54

6.4.7.12 存款利息收入

单位: 人民币元

项目	本期
	2024 年 3 月 22 日 (基金合同生效日) 至 2024 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	97,265.57
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	-
合计	97,265.57

6.4.7.13 股票投资收益

6.4.7.13.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2024年3月22日（基金合同生效日）至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	521,614.17
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	521,614.17

6.4.7.13.2 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3月22日（基金合同生效日）至2024年6月30日
卖出股票成交总额	8,945,537.81
减：卖出股票成本总额	8,351,006.68
减：交易费用	72,916.96
买卖股票差价收入	521,614.17

6.4.7.13.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.14 基金投资收益

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 3 月 22 日 (基金合同生效日) 至 2024 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	307,081.94
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	307,081.94

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024 年 3 月 22 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	16,777,329.39
股票投资	16,777,329.39
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	16,777,329.39

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 3 月 22 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	2,423.62
合计	2,423.62

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 3 月 22 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	17,719.44
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行汇划费用	14,040.00
合计	31,759.44

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无须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以及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
宝盈基金管理有限公司（“宝盈基金”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	基金托管人、基金销售机构
摩根大通银行（“摩根大通”）	境外资产托管人
中国对外经济贸易信托有限公司（“中国外贸信托”）	基金管理人的股东
中铁信托有限责任公司（“中铁信托”）	基金管理人的股东
中铁宝盈资产管理有限公司（“中铁宝盈”）	基金管理人的子公司

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

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 基金交易

无。

6.4.10.1.5 权证交易

无。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

无。

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 3 月 22 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日	
当期发生的基金应支付的管理费	274,648.20	
其中：应支付销售机构的客户维护费	117,789.59	
应支付基金管理人的净管理费	156,858.61	

注：1、支付基金管理人宝盈基金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：日基金管理报酬=前一日基金资产净值×0.50%/当年天数。2、本基金合同生效日为 2024 年 3 月 22 日，无上年可比期间数据。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	
	2024 年 3 月 22 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日	
当期发生的基金应支付的托管费	82,394.45	

注：1、支付基金托管人建设银行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。2、本基金合同生效日为 2024 年 3 月 22 日，无上年可比期间数据。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2024 年 3 月 22 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	宝盈纳斯达克 100 指数发起 (QDII) A 人民币	宝盈纳斯达克 100 指数发起 (QDII) C 人民币	合计
宝盈基金	-	91.65	91.65
中国建设银行	-	16,105.50	16,105.50
合计	-	16,197.15	16,197.15

注：1、支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金 C 类份额的基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给宝盈基金公司，再由宝盈基金公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日基金销售服务费=前一日基金 C 类份额的基金资产净值×0.25%/当年天数。

2、本基金合同生效日为 2024 年 03 月 22 日，无上年可比期间数据。

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

无。

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

无。

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

无。

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	本期
	2024年3月22日(基金合同生效日)至2024年6月30日	2024年3月22日(基金合同生效日)至2024年6月30日
	宝盈纳斯达克100指数发起(QDII)A人民币	宝盈纳斯达克100指数发起(QDII)C人民币
基金合同生效日(2024年3月22日)持有的基金份额	10,004,950.50	-
报告期初持有的基金份额	-	-
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	10,004,950.50	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	12.45%	-

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	
	2024年3月22日(基金合同生效日)至2024年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
摩根大通	7,473,343.57	45,067.91
中国建设银行	19,621,750.74	52,197.66

注：1、本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行和境外托管人摩根大通保管，按银行约定利率计息。2、本基金合同生效日为 2024 年 3 月 22 日，无上年可比期间数据。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

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

无。

6.4.12 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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

无。

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

无。

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

本基金为指数型基金，主要投资于标的指数成份股、备选成份股。本基金的风险与收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括基金投资、股票投资及债券投资。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人建立的风险管理体系由“组织、制度、流程和报告”等四个方面构成。

组织是指公司的风险管理组织架构包括董事会下设的风险管理与审计委员会、公司管理层的风险控制委员会、风险管理部和合规法律部以及公司各业务部门，董事会对建立基金风险管理内部控制系统和维持其有效性承担最终责任；制度是指风险管理相关的规章制度，是对组织职能及其工作流程等的具体规定；流程是风险管理的工作流程，它详细规定了各部门之间风险管理工作的内容和程序；报告是对流程的必要反映和记录，既是风险管理工作的重要环节，也是对风险管理工作的总结和披露。

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。本基金的活期银行存款和定期存款存放在本基金的托管人中国建设银行股份有限公司，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以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业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，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《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、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期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 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	27,095,094.31	-	-	-	27,095,094.31
交易性金融资产	-	-	-	-239,391,455.13	239,391,455.13
应收股利	-	-	-	27,215.75	27,215.75
应收申购款	-	-	-	-20,804,581.63	20,804,581.63
资产总计	27,095,094.31	-	-	-260,223,252.51	287,318,346.82
负债					
应付赎回款	-	-	-	-21,424,600.88	21,424,600.88
应付管理人报酬	-	-	-	85,911.86	85,911.86
应付托管费	-	-	-	25,773.55	25,773.55
应付清算款	-	-	-	6,694,118.64	6,694,118.64
应付销售服务费	-	-	-	24,659.46	24,659.46
其他负债	-	-	-	17,719.44	17,719.44
负债总计	-	-	-	-28,272,783.83	28,272,783.83
利率敏感度缺口	27,095,094.31	-	-	-231,950,468.68	259,045,562.99

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

于 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金净资产

产无重大影响。

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，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 2024年6月30日			合计
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	
以外币计价的资产				
货币资金	7,473,350.98	-	-	7,473,350.98
交易性金融资产	239,391,455.13	-	-	239,391,455.13
应收股利	27,215.75	-	-	27,215.75
资产合计	246,892,021.86	-	-	246,892,021.86
以外币计价的负债				
应付清算款	6,694,118.64	-	-	6,694,118.64
负债合计	6,694,118.64	-	-	6,694,118.64
资产负债表外汇 风险敞口净额	240,197,903.22	-	-	240,197,903.22

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	
	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)
分析	1. 所有外币相对人民币升值 5%	11,969,572.76
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-11,969,572.76

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。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股，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。

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。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，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

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	239,391,455.13	92.41
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	239,391,455.13	92.41

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除纳斯达克 100 指数收益率(使用估值汇率调整)以外的其他市场变量保持不变	
	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)
分析	1. 纳斯达克 100 指数收益率(使用估值汇率调整)收益	12,814,754.20

	率上升 5%	
	2. 纳斯达克 100 指数收益率 (使用估值汇率调整) 下降 5%	-12,814,754.20

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
第一层次	239,391,455.13
第二层次	-
第三层次	-
合计	239,391,455.13

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、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 2024 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

无。

§ 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	239,391,455.13	83.32
	其中: 普通股	235,581,659.34	81.99
	存托凭证	3,809,795.79	1.33
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中: 债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中: 远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中: 买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	27,095,094.31	9.43
8	其他各项资产	20,831,797.38	7.25
9	合计	287,318,346.82	100.00

7.2 期末在各个国家(地区)证券市场的权益投资分布

金额单位: 人民币元

国家(地区)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
美国	239,391,455.13	92.41
合计	239,391,455.13	92.41

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

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
能源	1,129,807.61	0.44
原材料	3,443,169.53	1.33
工业	8,624,389.76	3.33
非必需消费品	26,968,433.16	10.41
必需消费品	14,202,645.58	5.48
医疗保健	14,404,062.87	5.56
金融	1,522,805.09	0.59
信息技术	124,630,986.26	48.11
通讯	41,301,417.88	15.94
公用事业	2,678,683.68	1.03
房地产	485,053.71	0.19
合计	239,391,455.13	92.41

注：以上分类采用国际通用的行业分类标准。

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家 (地区)	数量 (股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	Microsoft Corp	微软	MSFT US	纳斯达克 证券交易 所	美国	6,605	21,039,060.13	8.12
2	Apple Inc	苹果公司	AAPL US	纳斯达克 证券交易 所	美国	13,626	20,453,261.19	7.90
3	NVIDIA Corp	英伟达	NVDA US	纳斯达克 证券交易 所	美国	21,858	19,244,764.01	7.43
4	Amazon.com Inc	亚马逊公司	AMZN US	纳斯达克 证券交易 所	美国	9,248	12,736,845.92	4.92
5	Broadcom Inc	博通股份有限公司	AVGO US	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,064	12,174,597.84	4.70
6	Meta Platform	Meta 平台股份有	META US	纳斯达克 证券交易 所	美国	3,098	11,132,585.85	4.30

	ms Inc	有限公司		所				
7	Alphabet Inc	Alphabet 公司	GOOGL US	纳斯达克 证券交易 所	美国	5,220	6,776,325.36	2.62
8	Alphabet Inc	Alphabet 公司	GOOG US	纳斯达克 证券交易 所	美国	4,991	6,524,223.50	2.52
9	Costco Wholesale Corp	开市客	COST US	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,018	6,166,747.49	2.38
10	Tesla Inc	特斯拉公司	TSLA US	纳斯达克 证券交易 所	美国	4,290	6,049,977.58	2.34
11	Netflix Inc	奈飞公司	NFLX US	纳斯达克 证券交易 所	美国	987	4,747,208.23	1.83
12	Advanced Micro Devices Inc	AMD 公司	AMD US	纳斯达克 证券交易 所	美国	3,703	4,280,809.56	1.65
13	Adobe Inc	奥多比	ADBE US	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,026	4,062,162.26	1.57
14	PepsiCo Inc	百事可乐	PEP US	纳斯达克 证券交易 所	美国	3,150	3,702,582.84	1.43
15	QUALCOMM Inc	高通公司	QCOM US	纳斯达克 证券交易 所	美国	2,556	3,628,282.96	1.40
16	Linde PLC	Linde PLC	LIN US	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,101	3,443,169.53	1.33
17	T-Mobile US Inc	T-Mobile US 股份有限公司	TMUS US	纳斯达克 证券交易 所	美国	2,684	3,370,029.39	1.30
18	Applied Materials Inc	应用材料	AMAT US	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,893	3,183,748.74	1.23
19	Cisco Systems Inc	思科	CSCO US	纳斯达克 证券交易 所	美国	9,231	3,125,563.69	1.21
20	Intuit Inc	Intuit 股份有限公司	INTU US	纳斯达克 证券交易 所	美国	640	2,997,634.71	1.16

21	Texas Instruments Inc	德州仪器	TXN US	纳斯达克 证券交易 所	美国	2,069	2,868,412.78	1.11
22	Amgen Inc	安进公司	AMGN US	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,218	2,712,204.23	1.05
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	806	2,555,307.73	0.99
24	Comcast Corp	康卡斯特 公司	CMCSA US	纳斯达克 证券交易 所	美国	8,891	2,481,349.07	0.96
25	Micron Technology Inc	美光科技 股份有限 公司	MU US	纳斯达克 证券交易 所	美国	2,517	2,359,405.61	0.91
26	Honeywell International Inc	霍尼韦尔	HON US	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,478	2,249,304.46	0.87
27	Lam Research Corp	泛林集团	LRCX US	纳斯达克 证券交易 所	美国	287	2,178,035.25	0.84
28	Intel Corp	英特尔	INTC US	纳斯达克 证券交易 所	美国	9,668	2,133,891.92	0.82
29	Booking Holdings Inc	Booking 控股股份 有限公司	BKNG US	纳斯达克 证券交易 所	美国	75	2,117,461.37	0.82
30	Vertex Pharmaceuticals Inc	福泰制药	VRTX US	纳斯达克 证券交易 所	美国	585	1,954,177.11	0.75
31	Regeneron Pharmaceuticals Inc	再生元制 药股份有 限公司	REGN US	纳斯达克 证券交易 所	美国	245	1,835,167.75	0.71
32	KLA Corp	KLA 公司	KLAC US	纳斯达克 证券交易 所	美国	304	1,786,339.83	0.69
33	Analog Devices	亚德诺半 导体	ADI US	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,090	1,773,172.07	0.68

	Inc			所				
34	Palo Alto Networks Inc	Palo Alto Networks 股份有限公司	PANW US	纳斯达克 证券交易 所	美国	712	1,720,232.21	0.66
35	Automatic Data Processing Inc	ADP 公司	ADP US	纳斯达克 证券交易 所	美国	928	1,578,616.99	0.61
36	ASML Holding NV	阿斯麦控 股公司	ASML US	纳斯达克 证券交易 所	美国	206	1,501,491.19	0.58
37	Synopsys Inc	新思科技 公司	SNPS US	纳斯达克 证券交易 所	美国	326	1,382,524.80	0.53
38	Gilead Sciences Inc	吉利德科 学	GILD US	纳斯达克 证券交易 所	美国	2,752	1,345,644.75	0.52
39	PDD Holdings Inc	拼多多	PDD US	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,419	1,344,513.94	0.52
40	CrowdStrike Holdings Inc	CrowdStrike 控 股有限公 司	CRWD US	纳斯达克 证券交易 所	美国	490	1,338,150.06	0.52
41	Starbucks Corp	星巴克	SBUX US	纳斯达克 证券交易 所	美国	2,406	1,334,900.24	0.52
42	Mondelez International Inc	亿滋国际	MDLZ US	纳斯达克 证券交易 所	美国	2,851	1,329,643.08	0.51
43	Mercado Libre Inc	MercadoLibre 股 份有限公 司	MELI US	纳斯达克 证券交易 所	美国	112	1,311,764.51	0.51
44	Cadence Design Systems Inc	Cadence 设计系统 股份有限 公司	CDNS US	纳斯达克 证券交易 所	美国	578	1,267,711.62	0.49
45	Cintas Corp	Cintas 公 司	CTAS US	纳斯达克 证券交易 所	美国	227	1,132,869.14	0.44

				所				
46	Marriott International Inc/MD	万豪国际	MAR US	纳斯达克 证券交易 所	美国	630	1,085,519.25	0.42
47	Airbnb Inc	爱彼迎股 份有限公 司	ABNB US	纳斯达克 证券交易 所	美国	974	1,052,540.13	0.41
48	CSX Corp	CSX 公司	CSX US	纳斯达克 证券交易 所	美国	4,315	1,028,659.15	0.40
49	NXP Semiconductors NV	恩智浦半 导体公司	NXPI US	纳斯达克 证券交易 所	美国	528	1,012,572.32	0.39
50	Roper Technologies Inc	儒博技术 公司	ROP US	纳斯达克 证券交易 所	美国	240	964,102.10	0.37
51	Marvell Technology Inc	美满电子 科技公司	MRVL US	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,935	963,946.02	0.37
52	Constellation Energy Corp	美国联合 能源公司	CEG US	纳斯达克 证券交易 所	美国	669	954,853.15	0.37
53	O'Reilly Automotive Inc	O'Reilly 汽车股份 有限公司	ORLY US	纳斯达克 证券交易 所	美国	124	933,264.72	0.36
54	PayPal Holdings Inc	Paypal 控股股份 有限公司	PYPL US	纳斯达克 证券交易 所	美国	2,205	911,917.89	0.35
55	Autodesk Inc	欧特克	ADSK US	纳斯达克 证券交易 所	美国	480	846,492.80	0.33
56	Copart Inc	Copart 股份有限 公司	CPRT US	纳斯达克 证券交易 所	美国	2,141	826,399.21	0.32
57	Microchip Technology Inc	微芯科技 股份有限 公司	MCHP US	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,194	778,610.03	0.30
58	PACCAR	帕卡	PCAR US	纳斯达克	美国	1,057	775,449.86	0.30

	Inc			证券交易 所				
59	Ross Stores Inc	罗斯百货 股份有限 公司	ROST US	纳斯达克 证券交易 所	美国	746	772,607.27	0.30
60	Monster Beverag e Corp	怪兽饮料 公司	MNST US	纳斯达克 证券交易 所	美国	2,080	740,446.01	0.29
61	America n Electri c Power Co Inc	美国电力	AEP US	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,172	732,857.97	0.28
62	Fortine t Inc	Fortinet 股份有限 公司	FTNT US	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,699	729,775.27	0.28
63	Moderna Inc	莫德纳公 司	MRNA US	纳斯达克 证券交易 所	美国	852	721,053.99	0.28
64	Keurig Dr Pepper Inc	Keurig Dr Pepper 有限公司	KDP US	纳斯达克 证券交易 所	美国	3,017	718,151.96	0.28
65	Dexcom Inc	Dexcom 股份有限 公司	DXCM US	纳斯达克 证券交易 所	美国	885	715,112.38	0.28
66	Workday Inc	Workday 股份有限 公司	WDAY US	纳斯达克 证券交易 所	美国	442	704,224.19	0.27
67	AstraZe neca PLC	阿斯利康 公共有限 公司	AZN US	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,220	678,099.34	0.26
68	Paychex Inc	Paychex 公司	PAYX US	纳斯达克 证券交易 所	美国	801	676,807.68	0.26
69	DoorDas h Inc	DoorDash 股份有限 公司	DASH US	纳斯达克 证券交易 所	美国	849	658,190.06	0.25
70	IDEXX Laborat ories Inc	爱德士股 份有限公 司	IDXX US	纳斯达克 证券交易 所	美国	184	638,880.56	0.25
71	Trade Desk	Trade Desk 股	TTD US	纳斯达克 证券交易 所	美国	911	634,123.92	0.24

	Inc/The	份有限公司		所				
72	Old Dominion Freight Line Inc	Old Dominion Freight Line 股份有限公司	ODFL US	纳斯达克 证券交易 所	美国	486	611,676.14	0.24
73	Verisk Analytics Inc	Verisk 分析公司	VRSK US	纳斯达克 证券交易 所	美国	318	610,887.20	0.24
74	Charter Communications Inc	Charter 通信公司	CHTR US	纳斯达克 证券交易 所	美国	281	598,706.50	0.23
75	Datadog Inc	Datadog 股份有限公司	DDOG US	纳斯达克 证券交易 所	美国	646	597,081.45	0.23
76	Lululemon Athletica Inc	Lululemon Athletica 股份有限公司	LULU US	纳斯达克 证券交易 所	美国	269	572,640.52	0.22
77	Diamondback Energy Inc	Diamondback 能源股份有限公司	FANG US	纳斯达克 证券交易 所	美国	401	572,112.35	0.22
78	Fastenal Co	法思诺公司	FAST US	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,275	571,006.34	0.22
79	Baker Hughes Co	贝克休斯公司	BKR US	纳斯达克 证券交易 所	美国	2,225	557,695.26	0.22
80	Kraft Heinz Co/The	卡夫亨氏公司	KHC US	纳斯达克 证券交易 所	美国	2,423	556,382.58	0.21
81	Electronic Arts Inc	电子艺界	EA US	纳斯达克 证券交易 所	美国	559	555,074.17	0.21
82	Exelon Corp	Exelon 公司	EXC US	纳斯达克 证券交易 所	美国	2,246	553,995.10	0.21
83	Cognizant	高知特科技公司	CTSH US	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,117	541,323.22	0.21

	Technol ogy Solutio ns			所				
84	GE HealthC are Technol ogies Inc	GE HealthCa re Technolo gies Inc	GEHC US	纳斯达克 证券交易 所	美国	898	498,677.59	0.19
85	CoStar Group Inc	CoStar 集团股份 有限公司	CSGP US	纳斯达克 证券交易 所	美国	918	485,053.71	0.19
86	Biogen Inc	渤健公司	BIIB US	纳斯达克 证券交易 所	美国	287	474,162.68	0.18
87	Coca-Co la Europac ific Partner s	可口可乐 欧洲合伙 公开股份 公司	CCEP US	纳斯达克 证券交易 所	美国	911	473,109.55	0.18
88	Xcel Energy Inc	Xcel 能 源	XEL US	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,148	436,977.46	0.17
89	ON Semicon ductor Corp	安森美半 导体公司	ON US	纳斯达克 证券交易 所	美国	892	435,779.59	0.17
90	Zscaler Inc	Zscaler 股份有限 公司	ZS US	纳斯达克 证券交易 所	美国	309	423,237.20	0.16
91	Atlassi an Corp	Atlassia n Corp	TEAM US	纳斯达克 证券交易 所	美国	329	414,733.58	0.16
92	GLOBALF OUNDRIE S Inc	格罗方德 半导体股 份有限公 司	GFS US	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,138	410,056.69	0.16
93	ANSYS Inc	ANSYS 股 份有限公 司	ANSS US	纳斯达克 证券交易 所	美国	174	398,680.32	0.15
94	CDW Corp/DE	特拉华 CDW 公司	CDW US	纳斯达克 证券交易 所	美国	248	395,625.20	0.15

95	Dollar Tree Inc	美元树公司	DLTR US	纳斯达克 证券交易 所	美国	497	378,181.43	0.15
96	Take-Two Interactive Software	Take-Two 互动软件股份有限公司	TTWO US	纳斯达克 证券交易 所	美国	321	355,714.91	0.14
97	Warner Bros Discovery Inc	华纳兄弟探索股份有限公司	WBD US	纳斯达克 证券交易 所	美国	5,618	297,885.42	0.11
98	ARM Holdings PLC	ARM Holdings PLC	ARM US	纳斯达克 证券交易 所	美国	245	285,691.32	0.11
99	Illumina Inc	Illumina 公司	ILMN US	纳斯达克 证券交易 所	美国	365	271,521.82	0.10
100	MongoDB Inc	MongoDB 股份有限公司	MDB US	纳斯达克 证券交易 所	美国	129	229,802.53	0.09
101	Walgreens Boots Alliance Inc	沃博联股份有限公司	WBA US	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,594	137,400.64	0.05
102	GRAIL Inc	GRAIL Inc	GRAL US	纳斯达克 证券交易 所	美国	37	4,052.94	0.00

注：本基金对以上证券代码采用当地市场代码。

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所有权益投资明细无。

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末基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	Microsoft Corp	MSFT US	21,226,977.34	8.19
2	Apple Inc	AAPL US	18,621,605.15	7.19
3	NVIDIA Corp	NVDA US	16,010,628.22	6.18
4	Amazon.com Inc	AMZN US	12,859,635.53	4.96
5	Meta Platforms Inc	META US	11,776,367.87	4.55

6	Broadcom Inc	AVGO US	11,237,672.64	4.34
7	Alphabet Inc	GOOGL US	6,385,317.92	2.46
8	Alphabet Inc	GOOG US	6,156,995.92	2.38
9	Costco Wholesale Corp	COST US	5,828,262.45	2.25
10	Tesla Inc	TSLA US	5,570,162.55	2.15
11	Netflix Inc	NFLX US	4,689,559.24	1.81
12	Advanced Micro Devices Inc	AMD US	4,631,734.22	1.79
13	PepsiCo Inc	PEP US	3,902,627.16	1.51
14	Adobe Inc	ADBE US	3,722,589.48	1.44
15	Linde PLC	LIN US	3,627,118.25	1.40
16	QUALCOMM Inc	QCOM US	3,390,642.89	1.31
17	Cisco Systems Inc	CSCO US	3,262,102.38	1.26
18	T-Mobile US Inc	TMUS US	3,236,947.78	1.25
19	Applied Materials Inc	AMAT US	2,974,861.23	1.15
20	Intuit Inc	INTU US	2,935,488.35	1.13

注：1、本基金对以上证券代码采用当地市场代码。

2、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末基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	Microsoft Corp	MSFT US	1,285,537.32	0.50
2	Apple Inc	AAPL US	1,217,861.91	0.47
3	NVIDIA Corp	NVDA US	1,167,731.04	0.45
4	Amazon.com Inc	AMZN US	769,288.01	0.30
5	Meta Platforms Inc	META US	689,055.91	0.27
6	Broadcom Inc	AVGO US	676,672.13	0.26
7	Alphabet Inc	GOOGL US	423,568.09	0.16
8	Alphabet Inc	GOOG US	409,605.93	0.16
9	Costco Wholesale Corp	COST US	388,792.09	0.15
10	Tesla Inc	TSLA US	349,237.44	0.13
11	Netflix Inc	NFLX US	298,021.82	0.12
12	Advanced Micro Devices Inc	AMD US	286,123.98	0.11
13	PepsiCo Inc	PEP US	108,412.39	0.04
14	QUALCOMM Inc	QCOM US	107,883.97	0.04
15	Adobe Inc	ADBE US	97,687.44	0.04
16	Linde PLC	LIN US	94,609.62	0.04

17	T-Mobile US Inc	TMUS US	90,359.42	0.03
18	Cisco Systems Inc	CSCO US	85,138.26	0.03
19	Applied Materials Inc	AMAT US	83,550.93	0.03
20	Texas Instruments Inc	TXN US	82,412.53	0.03

注：1、本基金对以上证券代码采用当地市场代码。

2、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

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	230,965,132.42
卖出收入（成交）总额	8,945,537.81

注：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

无。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

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 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

本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内没有被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

7.11.2 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

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
----	----	----

1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	27,215.75
4	应收利息	-
5	应收申购款	20,804,581.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,831,797.38

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 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股票。

7.11.5.2 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股票。

7.11.6 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，分项与合计项之间可能存在尾差。

§ 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 (%)
宝盈纳斯达克 100 指数发起 (QDII) A 人民币	2,146	37,452.55	12,461,504.58	15.50	67,911,676.42	84.50
宝盈纳斯达克 100 指数发起 (QDII) C 人民币	21,299	7,533.21	-	-	160,449,933.10	100.00
合计	23,445	10,271.83	12,461,504.58	5.17	228,361,609.52	94.83

注：1、本基金采用分级模式核算，机构/个人投资者持有基金份额占总份额比例的计算中分母采用各自级别的基金份额来计算。

2、户均持有的基金份额合计数=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	宝盈纳斯达克 100 指数发起 (QDII) A 人民币	9,651.31	0.0120
	宝盈纳斯达克 100 指数发起 (QDII) C 人民币	14,710.60	0.0092
	合计	24,361.91	0.0101

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，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	宝盈纳斯达克 100 指数发起 (QDII) A 人民币	0~10
	宝盈纳斯达克 100 指数发起 (QDII) C 人民币	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	宝盈纳斯达克 100 指数发起 (QDII) A 人民币	0~10
	宝盈纳斯达克 100 指数发起 (QDII) C 人民币	0
	合计	0~10

8.4 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	10,004,950.50	4.15	10,004,950.50	4.15	自合同生效之日起不少于 3 年
基金管理人高级管理人员	3,649.94	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-

其他	-	-	-	-	-
合计	10,008,600.44	4.16	10,004,950.50	4.15	-

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	宝盈纳斯达克 100 指数发起 (QDII) A 人民币	宝盈纳斯达克 100 指数发起 (QDII) C 人民币
基金合同生效日 (2024 年 3 月 22 日) 基金份额总额	114,537,759.83	98,169,975.53
基金合同生效日起至 报告期期末基金总申 购份额	27,767,676.19	143,356,921.56
减：基金合同生效日 起至报告期期末基金 总赎回份额	61,932,255.02	81,076,963.99
基金合同生效日起至 报告期期末基金拆分 变动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	80,373,181.00	160,449,933.10

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

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

1、报告期内，本基金管理人重大人事变动情况如下：

根据 2024 年第 1 次股东会决议，聘任王伦刚、伍利娜为宝盈基金管理有限公司董事，张苏彤、廖振中不再担任宝盈基金管理有限公司董事。聘任颜志华、邹明睿为宝盈基金管理有限公司监事，魏玲玲、汪兀不再担任宝盈基金管理有限公司监事。

根据第七届董事会第一次会议决议，聘任汪浪为宝盈基金管理有限公司总经理助理。

根据宝盈基金管理有限公司第七届董事会第二次会议决议，同意彭玫雯不再担任宝盈基金管理有限公司财务负责人，公司按照法规要求聘任新的财务负责人之前，由总经理杨凯暂时履行财务负责人职责。

以上变更事项已按规定向中国证券监督管理委员会深圳证监局报告以及向中国证券投资基

金业协会报备，并发布基金行业高级管理人员变更公告。

2、报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金管理人的基金投资策略遵循本基金《基金合同》中规定的投资策略，未发生显著改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内未发生改聘会计师事务所情况。

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。

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，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
China International Capital Corporation Limited	1	239,910,670.23	100.00	72,666.34	100.00	-

注：1、本基金管理人选择使用基金专用交易单元的选择标准和程序：

- (1) 经营行为规范，财务状况良好，内控制度健全，在业内有良好的信誉。
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要。
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析

能力，能及时、全面的向公司提供高质量的信息服务；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

(4) 本基金管理人根据以上标准进行评估后确定证券经营机构的选择，并与被选择的券商签订证券交易单元租用协议。

2、本基金本报告期交易单元变更情况：无。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
China International Capital Corporation Limited	-	-	-	-	-	-	-	-

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	宝盈纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金（QDII）（宝盈纳斯达克 100 指数发起 A 人民币份额）基金产品资料概要（更新）	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024-06-29
2	宝盈纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金（QDII）（宝盈纳斯达克 100 指数发起 C 人民币份额）基金产品资料概要（更新）	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024-06-29
3	宝盈基金管理有限公司关于新增云湾基金为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024-06-28
4	宝盈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本公司旗下基金相关销售业务的公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024-05-31

5	宝盈基金管理有限公司关于增加华宝证券有限责任公司为旗下部分基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告	证券日报, 证券时报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024-05-17
6	宝盈基金管理有限公司关于增加国金证券股份有限公司为旗下部分基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024-05-08
7	宝盈基金管理有限公司关于高级管理人员（财务负责人）变更的公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024-04-30
8	宝盈基金管理有限公司旗下 62 只基金 2024 年第一季度报告提示性公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2024-04-22
9	宝盈纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金（QDII）2024 年境外主要市场节假日暂停申购、赎回等交易类业务的公告	证券日报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024-04-19
10	宝盈纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金（QDII）开放日常申购、赎回和定期定额投资业务的公告	证券日报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024-04-19
11	宝盈基金管理有限公司关于聘任基金经理助理的公告	上海证券报, 证券日报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024-04-11
12	宝盈纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金（QDII）基金合同生效公告	证券日报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024-03-23
13	宝盈基金管理有限公司关于新增财信证券股份有限公司为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告	证券日报, 证券时报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024-03-18
14	宝盈基金管理有限公司关于宝盈纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金（QDII）增加代销机构的公告	证券日报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024-03-05
15	宝盈基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024-03-01
16	关于增加京东肯特瑞财富投资管理有限公司为旗下部分基金代销机构的公	证券日报, 本基金管理人网站, 中国证监会基	2024-03-01

	告	金电子披露网站	
17	宝盈纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金（QDII）基金合同及招募说明书提示性公告	证券日报	2024-02-23
18	宝盈纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金（QDII）招募说明书	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024-02-23
19	宝盈纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金（QDII）基金份额发售公告	证券日报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024-02-23
20	宝盈纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金（QDII）（宝盈纳斯达克 100 指数发起 A 人民币份额）基金产品资料概要	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024-02-23
21	宝盈纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金（QDII）（宝盈纳斯达克 100 指数发起 C 人民币份额）基金产品资料概要	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024-02-23
22	宝盈纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金（QDII）基金合同	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024-02-23
23	宝盈纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金（QDII）托管协议	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024-02-23

§ 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

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

中国证监会准予宝盈纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金（QDII）注册的文件。

《宝盈纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金（QDII）基金合同》。

《宝盈纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金（QDII）托管协议》。

法律意见书。

基金管理人业务资格批件、营业执照。

基金托管人业务资格批件、营业执照。

中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

基金管理人办公地址：广东省深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 10 层

基金托管人办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

12.3 查阅方式

上述备查文件文本分别存放在基金管理人和基金托管人的办公场所，在办公时间内基金持有人可免费查阅。

宝盈基金管理有限公司

2024 年 8 月 30 日