

大成纳斯达克 100 指数证券投资基金

2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 30 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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 06 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	5
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	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
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合规守信情况的说明	9
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	17
§7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况	34
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	34
7.3 期末按行业分类的权益投资组合	35

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	35
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动	58
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	60
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	60
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	60
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	60
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	60
7.11 投资组合报告附注	60
§8 基金份额持有人信息	61
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	61
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	61
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	62
§9 开放式基金份额变动	62
§10 重大事件揭示	62
10.1 基金份额持有人大会决议	62
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	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	62
10.4 基金投资策略的改变	62
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	63
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	63
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	63
10.8 其他重大事件	64
§11 影响投资者决策的其他重要信息	65
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	65
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	65
§12 备查文件目录	65
12.1 备查文件目录	65
12.2 存放地点	65
12.3 查阅方式	65

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	大成纳斯达克 100 指数证券投资基金
基金简称	大成纳斯达克 100 指数 (QDII)
基金主代码	000834
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 11 月 13 日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	430,984,753.76 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段,实现基金投资组合对标指数的有效跟踪,追求跟踪误差最小化。
投资策略	本基金将按照标的指数的成份股及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况(如股票停牌、流动性不足)导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。本基金可能将一定比例的基金资产投资于以纳斯达克 100 指数为跟踪标的的公募基金、上市交易型基金以及股指期货等金融衍生品,以优化投资组合的建立,达到节约交易成本和有效追踪标的指数表现的目的。
业绩比较基准	纳斯达克 100 价格指数
风险收益特征	本基金为美国股票指数型证券投资基金,风险与预期收益高于混合型基金、债券基金以及货币市场基金,属于预期风险较高的产品。

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		大成基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	赵冰	秦一楠
	联系电话	0755-83183388	010-66060069
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008885558	95599
传真		0755-83199588	010-68121816
注册地址		深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		518040	100031
法定代表人		吴庆斌	谷澍

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	英文	The Bank of New York Mellon Corporation
	中文	纽约梅隆银行股份有限公司
注册地址		One Wall Street New York, NY 10286
办公地址		One Wall Street New York, NY 10286
邮政编码		NY10286

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.dcfund.com.cn
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	大成基金管理有限公司	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 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	报告期(2021 年 1 月 1 日-2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	22,340,467.00
本期利润	147,205,624.81
加权平均基金份额本期利润	0.3427
本期加权平均净值利润率	11.44%
本期基金份额净值增长率	11.47%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	270,732,360.67
期末可供分配基金份额利润	0.6282
期末基金资产净值	1,394,252,051.97
期末基金份额净值	3.235
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	223.50%

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。

2、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（为期末余额，不是当期发生数）。

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

3.2 基金净值表现

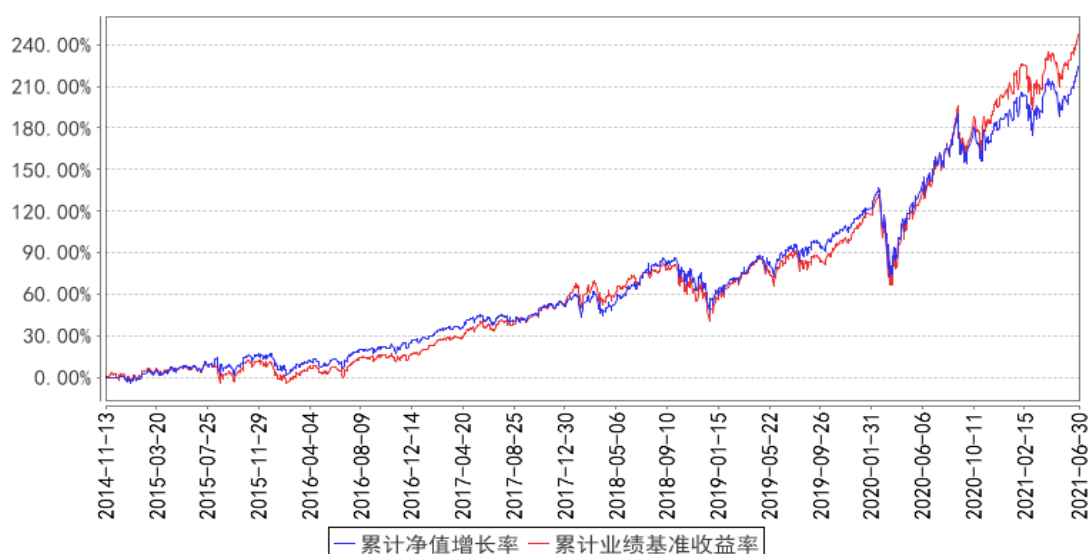
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	7.76%	0.78%	6.34%	0.70%	1.42%	0.08%
过去三个月	9.14%	1.08%	11.18%	1.02%	-2.04%	0.06%
过去六个月	11.47%	1.41%	12.93%	1.35%	-1.46%	0.06%
过去一年	31.40%	1.45%	43.30%	1.43%	-11.90%	0.02%
过去三年	93.83%	1.64%	106.72%	1.70%	-12.89%	-0.06%
自基金合同生效起至今	223.50%	1.32%	246.92%	1.37%	-23.42%	-0.05%

注：同期业绩比较基准以美元计价，不包含人民币汇率变动等因素产生的效应。

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

大成纳斯达克100指数（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：1、按本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

2、同期业绩比较基准以美元计价，不包含人民币汇率变动等因素产生的效应。

§ 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

大成基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1999]10号文批准，于1999年4月12日正式成立，是中国证监会批准成立的首批十家基金管理公司之一，注册资本2亿元人民币，注册地广东省深圳市。目前公司由三家股东组成，分别为中泰信托有限责任公司(50%)、光大证券股份有限公司(25%)、中国银河投资管理有限公司(25%)。主要业务是公募基金的募集、销售和管理，还具有全国社保基金投资管理、基本养老保险投资管理、受托管理保险资金、保险保障基金投资管理、特定客户资产管理和QDII业务资格。

经过二十二年的稳健发展，公司形成了强大稳固的综合实力。公司旗下基金产品齐全、风格多样，构建了涵盖股票型基金、混合型基金、指数型基金、债券型基金和货币市场基金的完备产品线。截至2021年6月30日，本基金管理人共管理9只ETF及3只ETF联接基金，8只QDII基金及107只开放式证券投资基金。

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		
冉 凌 浩	本基金基 金经理	2014 年 11 月 13 日	-	18 年	金融学硕士。2003 年 4 月至 2004 年 6 月就职于国信证券研究部，任研究员。2004 年 6 月至 2005 年 9 月就职于华西证券研究部，任高级研究员。2005 年 9 月加入大成基金管理有限公司，曾担任金融工程师、境外市场研究员及基金经理助理。2011 年 8 月 26 日起任大成标普 500 等权重指数型证券投资基金基金经理。2014 年 11 月 13 日起任大成纳斯达克 100 指数证券投资基金基金经理。2016 年 12 月 2 日起任大成恒生综合中小型股指数基金(QDII-LOF)基金经理。2016 年 12 月 29 日至 2020 年 7 月 7 日任大成海外中国机会混合型证券投资基金(LOF)基金经理。2017 年 8 月 10 日起任大成恒生指数证券投资基金(LOF)基金经理。2019 年 3 月 20 日起任大成中华沪深港 300 指数证券投资基金(LOF)基金经理。2021 年 5 月 18 日起任大成恒生科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 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

无

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

无。

4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书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，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。基金管理人运用统计分析方法和工具，对旗下所有投资组合连续 4 个季度的日内、3 日内及 5 日内股票及债券交易同向交易价差进行分析。分析结果表明：债券交易同向交易频率较低；部分股票同向交易溢价率较大主要来源于市场因素（如个股当日价格振幅较高）及组合经理交易时机选择，即投资组合成交时间不一致以及成交价格的日内较大变动导致个别组合间的成交价格差异较大，但结合交易价差专项统计分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，基金管理人旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。主动投资组合间股票交易不存在同日反向交易。主动型投资组合与指数型投资组合之间或指数型投资组合之间存在股票同日反向交易，但不存在参与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股当日成交量 5% 的情形；主动投资组合间债券交易存在 2 笔同日反向交易，原因为流动性需要。投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响，无异常。

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

2021 年 1 季度，多种新冠疫苗在美国推广接种，且接种速度较快，同时新冠疫情也正在持续缓解过程中。这使市场认为 2021 年欧美的疫情会逐步消除，未来疫情将不再是经济增长的显著拖累。

为了推动经济的恢复，美国政府推出了多项经济刺激政策，这些经济刺激政策有望在较长的时间内对美国经济产生积极作用。

随着疫情状况的逐步好转及经济刺激政策的实施，美国的宏观经济也在继续走好。六月底公布的美国 2021 年 1 季度的 GDP 环比折年率为 6.4%，保持在高速复苏的区间。从分项数据来看，消费仍然保持强劲的增长，是宏观经济增长的主要推动力，六月底公布的美国 2021 年 1 季度的个人消费增速为 11.4%，保持在非常高的区间内。从生产及供给的角度来看，二季度制造业 PMI 保持在 60 以上的水平，这意味着制造业保持在非常繁荣的区间，同时，二季度服务业也保持在 60 以上的水平，这意味着美国的出行逐渐恢复正常，服务业也回到了繁荣的状态中。这些较好的宏观经济数据说明，经济解封后美国的潜能开始恢复，积压的需求得以释放，经济也在迅速改善。

在上半年，美联储保持了宽松的货币政策环境。但是，持续宽松的货币政策环境使得市场开

始产生对通胀的担心，通胀数据也有一定幅度的抬升。虽然通货膨胀水平，但美联储认为当前的通胀仅是短期现象而长期通胀预期不变，因此维持当前的货币政策不变，这意味着美联储不会过早缩减量化宽松政策，也不会过早加息。

在较好的宏观经济环境下，美国上市公司利润大幅增长，并促使市场不断上调 2021 年全年的盈利预期，这也是本基金标的指数上半年表现较好的根本原因。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 3.235 元；本报告期基金份额净值增长率为 11.47%，业绩比较基准收益率为 12.93%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年以来，美股持续保持较好的上涨势头，不断创出历史新高。展望下半年，预计美国宏观经济保持高速增长，上市公司盈利也随之保持高速增长。高速增长的指数成份股盈利预计会对指数起到强烈的支撑作用。

本基金为被动型指数基金，其投资目标就是要复制指数的收益率。本基金将坚持被动型的指数化投资理念，持续实施高效的组合管理策略、交易策略及风险控制方法，以期更好地跟踪指数，力争将跟踪误差控制在较低的水平。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人指导基金估值业务的领导小组为公司估值委员会，公司估值委员会主要负责估值政策和估值程序的制定、修订以及执行情况的监督。估值委员会由股票投资部、研究部、固定收益总部、数量与指数投资部、大类资产配置部、交易管理部、风险管理部、基金运营部、监察稽核部指定人员组成。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，估值委员会成员中包括五名投资组合经理。

股票投资部、研究部、固定收益总部、数量与指数投资部、大类资产配置部、风险管理部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；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；定期对估值政策和程序进行评价，以保证其持续适用；交易管理部负责关注相关投资品种的流动性状况，协助反馈其市场交易信息；基金运营部负责日常的基金资产的估值业务，执行基金估值政策，并负责与托管行沟通估值调整事项；监察稽核部负责审核估值政策和程序的一致性，监督估值委员会工作流程中的风险控制，并负责估值调整事项

的信息披露工作。

本基金的日常估值程序由基金运营部基金估值核算人员执行，并与托管银行的估值结果核对一致。基金估值政策的议定和修改采用集体讨论机制，投资组合经理作为估值小组成员，对持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的职业敏感，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，基金管理人及时启动特别估值程序，由估值委员会讨论议定特别估值方案并与托管行沟通后由基金运营部具体执行。

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及中证指数有限公司签署服务协议，由中央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人严格按照本基金基金合同的规定进行收益分配。本报告期内本基金无收益分配事项。

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

无。

§ 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人——大成基金管理有限公司 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，大成基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，大成基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§ 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：大成纳斯达克 100 指数证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.3.1	106,259,149.26	97,764,677.21
结算备付金		37,244,230.16	16,784,078.31
存出保证金		8,669,454.20	8,456,270.40
交易性金融资产	6.4.3.2	1,271,412,966.20	1,070,954,622.44
其中：股票投资		1,271,412,966.20	1,070,954,622.44
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.3.5	6,799.05	9,479.59
应收股利		156,975.06	205,850.04
应收申购款		9,780,862.66	13,223,980.95
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	182,694.65	-
资产总计		1,433,713,131.24	1,207,398,958.94
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-

应付证券清算款		-	694,423.51
应付赎回款		37,746,023.26	29,344,403.45
应付管理人报酬		900,810.42	740,632.49
应付托管费		281,503.26	231,447.67
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	-	-
应交税费		295,431.16	323,515.77
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	237,311.17	429,452.00
负债合计		39,461,079.27	31,763,874.89
所有者权益：			
实收基金	6.4.3.9	430,984,753.76	405,075,447.91
未分配利润	6.4.3.10	963,267,298.21	770,559,636.14
所有者权益合计		1,394,252,051.97	1,175,635,084.05
负债和所有者权益总计		1,433,713,131.24	1,207,398,958.94

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 3.235 元，基金份额总额 430,984,753.76 份。

6.2 利润表

会计主体：大成纳斯达克 100 指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		154,279,797.74	109,856,893.36
1. 利息收入		157,702.76	148,487.53
其中：存款利息收入	6.4.3.11	157,702.76	148,487.53
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		29,542,046.99	37,699,561.52
其中：股票投资收益	6.4.3.12	12,375,159.78	26,152,371.20
基金投资收益	6.4.3.13	-	-
债券投资收益	6.4.3.14	-	-

资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.3.15	-	-
衍生工具收益	6.4.3.16	13,399,091.71	8,662,471.65
股利收益	6.4.3.17	3,767,795.50	2,884,718.67
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.18	124,865,157.81	73,477,267.00
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-1,184,703.69	-2,843,968.76
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.19	899,593.87	1,375,546.07
减：二、费用		7,074,172.93	4,057,818.71
1. 管理人报酬	6.4.6.2.1	5,103,802.90	2,688,567.70
2. 托管费	6.4.6.2.2	1,594,938.39	840,177.35
3. 销售服务费	6.4.6.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.3.20	60,176.06	216,885.49
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		48,236.73	31,184.91
7. 其他费用	6.4.3.21	267,018.85	281,003.26
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		147,205,624.81	105,799,074.65
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		147,205,624.81	105,799,074.65

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成纳斯达克 100 指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	405,075,447.91	770,559,636.14	1,175,635,084.05
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	147,205,624.81	147,205,624.81
三、本期基金份额交易产生的基	25,909,305.85	45,502,037.26	71,411,343.11

金净值变动数 (净值减少以 “-”号填列)			
其中: 1. 基金申 购款	268,012,736.66	527,001,239.19	795,013,975.85
2. 基金赎 回款	-242,103,430.81	-481,499,201.93	-723,602,632.74
四、本期向基金 份额持有人分配 利润产生的基金 净值变动(净值 减少以“-”号填 列)	-	-	-
五、期末所有者 权益(基金净值)	430,984,753.76	963,267,298.21	1,394,252,051.97
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者 权益(基金净值)	249,626,546.36	286,130,121.42	535,756,667.78
二、本期经营活 动产生的基金净 值变动数(本期 净利润)	-	105,799,074.65	105,799,074.65
三、本期基金份 额交易产生的基 金净值变动数 (净值减少以 “-”号填列)	74,708,403.02	82,377,189.93	157,085,592.95
其中: 1. 基金申 购款	558,162,862.94	642,939,008.51	1,201,101,871.45
2. 基金赎 回款	-483,454,459.92	-560,561,818.58	-1,044,016,278.50
四、本期向基金 份额持有人分配 利润产生的基金 净值变动(净值 减少以“-”号填 列)	-	-	-
五、期末所有者 权益(基金净值)	324,334,949.38	474,306,386.00	798,641,335.38

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:

谭晓冈

周立新

刘亚林

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 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的说明

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。

6.4.2 税项

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

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

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

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

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

6.4.3 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	106,259,149.26
定期存款	—
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	—
合计	106,259,149.26

注：于本期末，活期存款中包括的外币余额为美元活期存款 12,154,379.49 美元，折合人民币 78,518,506.94 元。

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	897,608,041.42	1,271,412,966.20	373,804,924.78
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	897,608,041.42	1,271,412,966.20	373,804,924.78

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	—	—	—	—
货币衍生工具	—	—	—	—
权益衍生工具	110,155,667.01	—	—	—
其中：股指期货投资	110,155,667.01	—	—	—
其他衍生	—	—	—	—

工具				
合计	110,155,667.01	-	-	-

注：期货投资采用当日无负债结算制度，结算准备金已包括所持期货合约产生的持仓损益，因此衍生金融工具项下的期货投资与相关的期货暂收款结算所得的持仓损益之间按抵销后的净额列示，为人民币零元。本报告期末本基金投资的期货持仓和损益明细为：NASDAQ 100 E-MINI Sep21 买入持仓量 61 手，合约市值人民币 114,665,353.77 元，公允价值变动人民币 4,509,686.76 元。

6.4.3.4 买入返售金融资产

无。

6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	6,799.05
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	-
合计	6,799.05

6.4.3.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
其他应收款	-
待摊费用	182,694.65
合计	182,694.65

6.4.3.7 应付交易费用

无。

6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	133,172.82
应付证券出借违约金	-
预提费用	104,138.35
合计	237,311.17

6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	405,075,447.91	405,075,447.91
本期申购	268,012,736.66	268,012,736.66
本期赎回（以“-”号填列）	-242,103,430.81	-242,103,430.81
- 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	430,984,753.76	430,984,753.76

注：申购含红利再投份额(如有)、转换入份额(如有)；赎回含转换出份额(如有)。

6.4.3.10 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	233,459,473.47	537,100,162.67	770,559,636.14
本期利润	22,340,467.00	124,865,157.81	147,205,624.81
本期基金份额交易产生的变动数	14,932,420.20	30,569,617.06	45,502,037.26
其中：基金申购款	157,899,166.08	369,102,073.11	527,001,239.19
基金赎回款	-142,966,745.88	-338,532,456.05	-481,499,201.93
本期已分配利润	-	-	-
本期末	270,732,360.67	692,534,937.54	963,267,298.21

6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	157,702.76
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	157,702.76

6.4.3.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	46,695,755.13
减：卖出股票成本总额	34,320,595.35
买卖股票差价收入	12,375,159.78

6.4.3.13 基金投资收益

无。

6.4.3.14 债券投资收益

无。

6.4.3.15 贵金属投资收益

无。

6.4.3.16 衍生工具收益

6.4.3.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.3.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	13,399,091.71

6.4.3.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	3,767,795.50
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	3,767,795.50

6.4.3.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	124,304,950.28
股票投资	124,304,950.28
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	560,207.53
权证投资	-
期货投资	560,207.53
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	124,865,157.81

6.4.3.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	899,593.87
合计	899,593.87

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

6.4.3.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	60,176.06
银行间市场交易费用	-
合计	60,176.06

6.4.3.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	44,630.98
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	8,561.43
指数使用费	154,319.07
合计	267,018.85

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值不高于 0.06% 的年费率计提，逐日累计，按季支付，标的指数许可使用费的收取下限为每年 40,000.00 美元。

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.4.1 或有事项

无。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.5 关联方关系

6.4.5.1 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

本基金本报告期存在控制关系或者其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.5.2 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
大成基金管理有限公司（“大成基金”）	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
中国农业银行股份有限公司（“农业银行”）	基金托管人、基金销售机构
纽约梅隆银行股份有限公司（“纽约梅隆银行”）	境外资产托管人

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。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.6.1.1 股票交易

无。

6.4.6.1.2 债券交易

无。

6.4.6.1.3 债券回购交易

无。

6.4.6.1.4 基金交易

无。

6.4.6.1.5 权证交易

无。

6.4.6.1.6 应支付关联方的佣金

无。

6.4.6.2 关联方报酬

6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	5,103,802.90	2,688,567.70
其中：支付销售机构的客户维护费	1,869,870.22	1,005,247.05

注：支付基金管理人 大成基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.80% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.80% / 当年天数。

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,594,938.39	840,177.35

注：支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.6.4 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

6.4.6.4.1 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。

6.4.6.4.2 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。

6.4.6.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.6.5.2 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。

6.4.6.6 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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
纽约梅隆银行	78,517,582.18	3,284.40	37,232,141.24	15,416.61
中国农业银行	27,741,567.08	154,418.36	32,122,417.25	133,070.92
-	-	-	-	-

注：本基金由基金托管人和境外资产托管人保管的银行存款，按银行约定利率计息。

6.4.6.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.7 利润分配情况

无。

6.4.8 期末(2021 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.8.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.9 金融工具风险及管理

6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数型基金，跟踪标的指数市场表现，目标为获取市场平均收益，属于中高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资等。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奉行全面风险管理体系的建设，建立了以由高层监控(合规与风险管理委员会、公司投资风险控制委员会)、专业监控(监察稽核部、风险管理部)、部门互控、岗位自控构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规与风险管理委员会，对公司整体运营风险进行监督，监督风险控制措施的执行；在管理层层面设立投资风险控制委员会，通过定期会议讨论涉及投资风险的重大议题，形成正式决议提交投委会；在业务操作层面，监察稽核部履行合规控制职责，通过定期、不定期检查内控制度的执行情况、对重大风险点以专项稽核的方式确保公司内控制度、流程得到贯彻执行。风险管理部履行风险量化评估分析职责。

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。

6.4.9.2 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同责任，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存放在本基金的托管行中国农业银行及境外次托管行纽约梅隆银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小；在场外交易市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交

割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于本期末，本基金无债券投资(上年度末：同)。

6.4.9.3 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。

6.4.9.3.1 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》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。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。于本期末，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例未超过 15%，且本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产未超过最近工作日确认的净赎回金额。

本基金主要投资于交易所及银行间市场内交易的证券，除在附注“期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制外(如有)，其余均能及时变现。此外，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资产的公允价值。除附注“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”中列示的卖出回购金融资产款余额(如有)将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即

为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.9.4 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。

6.4.9.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金等。

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	27,741,567.08	-	-	78,517,582.18	106,259,149.26
结算备付金	37,244,230.16	-	-	-	37,244,230.16
存出保证金	-	-	-	8,669,454.20	8,669,454.20
交易性金融资产	-	-	-	1,271,412,966.20	1,271,412,966.20
应收利息	-	-	-	6,799.05	6,799.05
应收股利	-	-	-	156,975.06	156,975.06
应收申购款	47,307.55	-	-	9,733,555.11	9,780,862.66
其他资产	-	-	-	182,694.65	182,694.65
资产总计	65,033,104.79	-	-	1,368,680,026.45	1,433,713,131.24
负债					
应付赎回款	-	-	-	37,746,023.26	37,746,023.26
应付管理人报酬	-	-	-	900,810.42	900,810.42
应付托管费	-	-	-	281,503.26	281,503.26
应交税费	-	-	-	295,431.16	295,431.16
其他负债	-	-	-	237,311.17	237,311.17
负债总计	-	-	-	39,461,079.27	39,461,079.27
利率敏感度缺口	65,033,104.79	-	-	1,329,218,947.18	1,394,252,051.97

上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	97,764,677.21	-	-	-	97,764,677.21
结算备付金	-	-	-	16,784,078.31	16,784,078.31
存出保证金	-	-	-	8,456,270.40	8,456,270.40
交易性金融资产	-	-	-	1,070,954,622.44	1,070,954,622.44
应收利息	-	-	-	9,479.59	9,479.59
应收股利	-	-	-	205,850.04	205,850.04
应收申购款	-	-	-	13,223,980.95	13,223,980.95
资产总计	97,764,677.21	-	-	1,109,634,281.73	1,207,398,958.94
负债					
应付赎回款	-	-	-	29,344,403.45	29,344,403.45
应付管理人报酬	-	-	-	740,632.49	740,632.49
应付托管费	-	-	-	231,447.67	231,447.67
应付证券清算款	-	-	-	694,423.51	694,423.51
应交税费	-	-	-	323,515.77	323,515.77
其他负债	-	-	-	429,452.00	429,452.00
负债总计	-	-	-	31,763,874.89	31,763,874.89
利率敏感度缺口	97,764,677.21	-	-	1,077,870,406.84	1,175,635,084.05

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。

6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，本基金未持有交易性债券投资（上年度末：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年度末：同）。

6.4.9.4.2 外汇风险

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

6.4.9.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日			
	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	合计

以外币计价的资产				
银行存款	78,518,506.94	-	-	78,518,506.94
结算备付金	37,244,230.16	-	-	37,244,230.16
存出保证金	8,669,454.20	-	-	8,669,454.20
交易性金融资产	1,271,412,966.20	-	-	1,271,412,966.20
应收股利	156,975.06	-	-	156,975.06
资产合计	1,396,002,132.56	-	-	1,396,002,132.56
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	1,396,002,132.56	-	-	1,396,002,132.56
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日			
	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	合计
以外币计价的资产				
银行存款	55,983,707.84	-	-	55,983,707.84
结算备付金	16,784,078.31	-	-	16,784,078.31
存出保证金	8,456,270.40	-	-	8,456,270.40
交易性金融资产	1,070,954	-	-	1,070,954,622.44

	, 622. 44			
应收股利	205, 850. 0 4	—	—	205, 850. 04
资产合计	1, 152, 384 , 529. 03	—	—	1, 152, 384, 529. 03
以外币计价的 负债				
应付证券清算 款	694, 423. 5 1	—	—	694, 423. 51
其他负债	127, 835. 5 1	—	—	127, 835. 51
负债合计	822, 259. 0 2	—	—	822, 259. 02
资产负债表外 汇风险敞口净 额	1, 151, 562 , 270. 01	—	—	1, 151, 562, 270. 01

6.4.9.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除美元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（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
分析	美元相对人民币升值 5%	69, 806, 619. 74	57, 578, 113. 50
	美元相对人民币贬值 5%	-69, 806, 619. 80	-57, 578, 113. 50

6.4.9.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市交易的股票，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。

本基金的基金管理人通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，实现基金投资组合对标的指数的有效跟踪，追求跟踪误差最小化。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于纳斯达克 100 指数成份股、备选成份股以及以纳斯达克 100 指数为跟踪标的的公募基金、上市交易型基金、结构性产品的比例占基金资产的 80%-95%，其中投资于以纳斯达克 100 指数为跟踪标的的公募基金、上市交易型基金、结构性产品的比例不超过 10%；投资于现金、银行存款、固定收益类证券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具的比例为基金资产的 5%-20%，其中投资于现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。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，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	1,271,412,966.20	91.19	1,070,954,622.44	91.10
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	1,271,412,966.20	91.19	1,070,954,622.44	91.10

6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
	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（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
分析	1. 业绩比较基准上	69,006,225.50	55,741,588.70

	升 5%		
	2. 业绩比较基准下 降 5%	-69,006,225.50	-55,741,588.70

6.4.10 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	1,271,412,966.20	88.68
	其中：普通股	1,271,412,966.20	88.68
	存托凭证	-	-
	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	143,503,379.42	10.01
8	其他各项资产	18,796,785.62	1.31
9	合计	1,433,713,131.24	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	1,271,412,966.20	91.19
合计	1,271,412,966.20	91.19

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(%)
金融	-	-
通信服务	248,510,343.70	17.82
房地产	-	-
能源	-	-
公用事业	11,265,876.85	0.81
非日常生活消费品	221,671,515.45	15.90
工业	21,770,593.20	1.56
日常消费品	61,537,221.79	4.41
信息技术	621,337,532.80	44.56
医疗保健	85,319,882.41	6.12
原材料	-	-
合计	1,271,412,966.20	91.19

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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股票及存托凭证。

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	APPLE INC	苹果公司	AAPL UQ	纳斯达克 证券交易所	美国	158,016	139,808,653.17	10.03
2	MICROSOFT CORP	微软	MSFT UQ	纳斯达克	美国	71,316	124,805,930.37	8.95

				克 证 券 交 易 所				
3	AMAZON.COM INC	亚马逊公司	AMZN UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	4,775	106,118,538.1 2	7.61
4	FACEBOOK INC-CLASS A	Facebook 公 司	FB UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	22,688	50,962,724.23	3.66
5	ALPHABET INC-CL C	Alphabet 公 司	GOOG UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	3,063	49,593,271.40	3.56
6	TESLA INC	特斯拉公司	TSLA UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易	美 国	11,288	49,564,817.50	3.55

				所				
7	NVIDIA CORP	英伟达	NVDA UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	8,976	46,394,484.67	3.33
8	ALPHABET INC-CL A	Alphabet 公 司	GOOG L UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	2,847	44,909,168.98	3.22
9	PAYPAL HOLDINGS INC	Paypal 控股 股份有限公司	PYPL UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	16,926	31,871,487.86	2.29
10	ADOBE INC	奥多比	ADBE UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	6,887	26,055,538.64	1.87
11	COMCAST CORP-CLASS A	康卡斯特	CMCS A UQ	纳斯达	美国	66,064	24,334,998.25	1.75

				克 证 券 交 易 所				
12	NETFLIX INC	奈飞公司	NFLX UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	6,389	21,801,117.11	1.56
13	INTEL CORP	英特尔	INTC UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	58,184	21,101,592.09	1.51
14	CISCO SYSTEMS INC	思科-T	CSCO UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	60,723	20,790,662.57	1.49
15	PEPSICO INC	百事可乐	PEP UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易	美 国	19,908	19,055,798.58	1.37

				所				
16	BROADCOM INC	博通股份有限公司	AVGO UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	5,883	18,122,193.72	1.30
17	T-MOBILE US INC	T-Mobile US 有限公司	TMUS UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	17,966	16,809,282.14	1.21
18	TEXAS INSTRUMENTS INC	德州仪器	TXN UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	13,307	16,530,983.10	1.19
19	COSTCO WHOLESALE CORP	好市多批发	COST UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	6,376	16,297,488.08	1.17
20	QUALCOMM INC	高通公司	QCOM UQ	纳 斯 达	美国	16,253	15,007,079.04	1.08

				克 证 券 交 易 所				
21	AMGEN INC	AMGEN 公司	AMGN UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	8,278	13,034,947.53	0.93
22	CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	查特通信公 司	CHTR UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	2,718	12,667,617.20	0.91
23	INTUIT INC	Intuit 公司	INTU UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	3,937	12,466,696.39	0.89
24	STARBUCKS CORP	星巴克	SBUX UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	16,978	12,263,273.59	0.88

				所				
25	APPLIED MATERIALS INC	应用材料	AMAT UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	13,169	12,114,403.30	0.87
26	ADVANCED MICRO DEVICES	AMD 公司	AMD UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	17,507	10,623,198.46	0.76
27	INTUITIVE SURGICAL INC	直觉外科手 术公司	ISRG UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,706	10,135,288.62	0.73
28	MICRON TECHNOLOGY INC	美光科技股 份有限公司	MU UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	16,158	8,870,407.50	0.64
29	MODERNA INC	Moderna 股 份有限公司	MRNA UQ	纳 斯 达	美国	5,785	8,781,597.01	0.63

				克 证 券 交 易 所				
30	LAM RESEARCH CORP	泛林集团	LRCX UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	2,055	8,638,371.43	0.62
31	ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	Zoom 视频通 讯有限公司	ZM UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	3,404	8,510,859.52	0.61
32	BOOKING HOLDINGS INC	Booking 控股 股份有限公 司	BKNG UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	591	8,353,950.60	0.60
33	MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	亿滋国际	MDLZ UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	20,240	8,164,181.35	0.59

				所				
34	GILEAD SCIENCES INC	吉利德科学	GILD UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	18,071	8,038,748.56	0.58
35	AUTOMATIC DATA PROCESSING	ADP 公司	ADP UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	6,131	7,866,717.14	0.56
36	MERCADOLIBRE INC	Mercadolibr e 股份有限公 司	MELI UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	718	7,225,578.05	0.52
37	ACTIVISION BLIZZARD INC	动视暴雪股 份有限公司	ATVI UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	11,196	6,902,915.57	0.50
38	CSX CORP	CSX 公司	CSX UQ	纳斯达	美国	32,739	6,784,830.62	0.49

				克 证 券 交 易 所				
39	FISERV INC	Fiserv 公司	FISV UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	9,607	6,633,826.50	0.48
40	ILLUMINA INC	Illumina 公 司	ILMN UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	2,103	6,428,837.19	0.46
41	JD.COM INC-ADR	京东集团	JD UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	11,611	5,986,406.13	0.43
42	AUTODESK INC	欧特克	ADSK UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易	美 国	3,170	5,977,679.11	0.43

				所				
43	ANALOG DEVICES INC	模拟器件	ADI UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	5,314	5,910,075.72	0.42
44	REGENERON PHARMACEUTICALS	再生元制药 股份有限公司	REGN UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,508	5,441,202.18	0.39
45	NXP SEMICONDUCTORS NV	恩智浦半导 体公司	NXPI UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	3,973	5,280,004.85	0.38
46	ASML HOLDING NV-NY REG SHS	阿斯麦控股 公司	ASML UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,144	5,105,552.43	0.37
47	DOCUSIGN INC	DocuSign 股 份有限公司	DOCU UQ	纳斯达	美国	2,803	5,062,358.59	0.36

				克 证 券 交 易 所				
48	IDEXX LABORATORIES INC	爱德士股份 有限公司	IDXX UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,228	5,010,087.92	0.36
49	BAIDU INC – SPON ADR	百度	BIDU UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	3,733	4,917,161.32	0.35
50	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	福泰制药	VRTX UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	3,730	4,858,511.36	0.35
51	BIOGEN INC	百健	BIIB UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	2,169	4,851,920.32	0.35

				所				
52	KEURIG DR PEPPER	KEURIG DR PEPPER 公司	KDP UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	20,423	4,649,376.09	0.33
53	KRAFT HEINZ CO/THE	卡夫亨氏公 司	KHC UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	17,624	4,642,917.28	0.33
54	KLA CORP	KLA 公司	KLAC UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	2,208	4,624,499.28	0.33
55	ALIGN TECHNOLOGY INC	Align 科技股 份有限公司	ALGN UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,140	4,499,718.05	0.32
56	MONSTER BEVERAGE CORP	怪兽饮料公 司	MNST UQ	纳 斯 达 克	美国	7,616	4,494,431.11	0.32

				克 证 券 交 易 所				
57	Pinduoduo INC	拼多多	PDD UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	5,451	4,472,882.93	0.32
58	EBAY INC	eBay 公司	EBAY UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	9,816	4,452,180.50	0.32
59	MARVELL TECHNOLOGY GROUP INC	迈威尔科技 集团	MRVL UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	11,805	4,448,332.16	0.32
60	LULULEMON ATHLETICA INC	Lululemon Athletica 股 份有限	LULU UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,802	4,248,652.34	0.30

				所				
61	WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	Walgreens Boots Alliance 公 司	WBA UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	12,455	4,233,029.30	0.30
62	WORKDAY INC-CLASS A	Workday 股 份 有 限 公 司	WDAY UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	2,723	4,199,640.08	0.30
63	MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	万豪国际	MAR UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	4,692	4,138,028.94	0.30
64	ROSS STORES INC	Ross 商店有 限公司	ROST UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	5,138	4,115,807.23	0.30
65	MATCH GROUP INC	MATCH 公司	MTCH UQ	纳 斯 达	美 国	3,894	4,056,345.24	0.29

				克 证 券 交 易 所				
66	EXELON CORP	Exelon 公司	EXC UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	14,080	4,030,358.20	0.29
67	AMERICAN ELECTRIC POWER	美国电力	AEP UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	7,201	3,935,057.44	0.28
68	SYNOPSYS INC	新思科技公 司	SNPS UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	2,198	3,916,024.89	0.28
69	DEXCOM INC	DexCom 股份 有限公司	DXCM UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,393	3,842,538.54	0.28

				所				
70	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	微芯科技股 份有限公司	MCHP UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	3,965	3,835,484.76	0.28
71	ELECTRONIC ARTS INC	电子艺界	EA UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	4,123	3,830,910.94	0.27
72	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	亚力兄制药 公司	ALXN UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	3,184	3,778,723.35	0.27
73	CINTAS CORP	CINTAS 公司	CTAS UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,513	3,733,718.16	0.27
74	O'REILLY AUTOMOTIVE INC	O'Reilly 汽 车股份有限 公司	ORLY UQ	纳 斯 达	美 国	1,014	3,708,982.05	0.27

				克 证 券 交 易 所				
75	PAYCHEX INC	Paychex 公 司	PAYX UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	5,192	3,598,932.05	0.26
76	CADENCE DESIGN SYS INC	Cadence 设 计系统股份 有限公司	CDNS UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	4,009	3,543,438.37	0.25
77	COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	高知特科技 公司	CTSH UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	7,599	3,399,994.17	0.24
78	XILINX INC	赛灵思	XLNX UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易	美 国	3,567	3,332,965.08	0.24

				所				
79	XCEL ENERGY INC	Xcel 能源	XEL UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	7,755	3,300,461.21	0.24
80	ATLASSIAN INC	ATLASSIAN 公 司	TEAM UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,958	3,248,990.24	0.23
81	NETEASE INC-ADR	网易	NTES UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	4,341	3,231,989.65	0.23
82	PELOTON INTERACTIVE INC	PELOTON INTERACTIVE 公司	PTON UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	3,882	3,110,186.98	0.22
83	SKYWORKS SOLUTIONS INC	思佳讯解决 方案公司	SWKS UQ	纳 斯 达	美国	2,378	2,945,686.09	0.21

				克 证 券 交 易 所				
84	COPART INC	Copart 股份 有限公司	CPRT UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	3,436	2,926,217.80	0.21
85	PACCAR INC	帕卡	PCAR UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	5,002	2,883,972.75	0.21
86	OKTA INC	OKTA 公司	OKTA UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,801	2,846,763.74	0.20
87	ANSYS INC	ANSYS 股份有 限公司	ANSS UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易	美 国	1,255	2,813,763.09	0.20

				所				
88	FASTENAL CO	快扣公司	FAST UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	8,354	2,806,319.12	0.20
89	SEAGEN INC	Seagen 股份 有限公司	SGEN UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	2,614	2,666,072.42	0.19
90	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	美信	MXIM UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	3,890	2,647,674.57	0.19
91	VERISK ANALYTICS INC	Verisk 分析 公司	VRSK UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	2,335	2,635,534.75	0.19
92	SIRIUS XM HOLDINGS INC	Sirius XM 控 股公司	SIRI UQ	纳 斯 达	美国	59,512	2,514,325.70	0.18

				克 证 券 交 易 所				
93	VERISIGN INC	威瑞信股份 有限公司	VRSN UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,622	2,385,800.07	0.17
94	CDW CORP/DE	特拉华 CDW 公司	CDW UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	2,039	2,300,514.93	0.16
95	SPLUNK INC	Splunk 公司	SPLK UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	2,381	2,223,857.00	0.16
96	CERNER CORP	塞纳公司	CERN UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	4,383	2,213,070.57	0.16

				所				
97	DOLLAR TREE INC	Dollar Tree 公司	DLTR UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	3,374	2,168,739.55	0.16
98	TripcomGroupLimited	携程集团有 限公司	TCOM UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	7,611	1,743,490.94	0.13
99	INCYTE CORP	因赛特公司	INCY UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	3,199	1,738,618.79	0.12
100	CHECK POINT SOFTWARE TECH	Check Point 软件技术有 限公司	CHKP UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,968	1,476,416.06	0.11
101	FOX CORP - CLASS A	福克斯公司	FOXA UQ	纳 斯 达	美国	4,756	1,140,790.87	0.08

				克 证 券 交 易 所				
10 2	FOX CORP - CLASS B	福克斯公司	FOX UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	3,684	837,725.10	0.06

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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

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

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	占期初基金资产净值比例（%）
1	APPLE INC	AAPL UQ	10,892,020.22	0.93
2	MICROSOFT CORP	MSFT UQ	10,246,353.84	0.87
3	AMAZON.COM INC	AMZN UQ	8,803,786.88	0.75
4	TESLA INC	TSLA UQ	4,924,350.56	0.42
5	FACEBOOK INC-CLASS A	FB UQ	3,900,944.57	0.33
6	ALPHABET INC-CL A	GOOGL UQ	3,704,351.36	0.32
7	ALPHABET INC-CL C	GOOG UQ	3,520,043.61	0.30
8	NVIDIA CORP	NVDA UQ	3,076,198.88	0.26
9	PAYPAL HOLDINGS INC	PYPL UQ	2,680,433.34	0.23
10	COMCAST CORP-CLASS A	CMCSA UQ	2,288,737.05	0.19
11	NETFLIX INC	NFLX UQ	2,171,435.38	0.18
12	INTEL CORP	INTC UQ	2,016,060.75	0.17
13	ADOBE INC	ADBE UQ	1,952,875.66	0.17
14	ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	ZM UQ	1,763,870.36	0.15
15	BROADCOM INC	AVGO UQ	1,734,600.28	0.15

16	PEPSICO INC	PEP UQ	1,626,660.21	0.14
17	CISCO SYSTEMS INC	CSCO UQ	1,489,504.18	0.13
18	TEXAS INSTRUMENTS INC	TXN UQ	1,488,927.37	0.13
19	QUALCOMM INC	QCOM UQ	1,434,841.94	0.12
20	T-MOBILE US INC	TMUS UQ	1,422,640.81	0.12

注：本期累计买入金额指买入成交金额（成交单价乘以成交数量），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

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	占期初基金资产净值比例(%)
1	APPLE INC	AAPL UQ	6,417,748.72	0.55
2	MICROSOFT CORP	MSFT UQ	4,683,003.79	0.40
3	AMAZON.COM INC	AMZN UQ	3,014,701.42	0.26
4	ALPHABET INC-CL C	GOOG UQ	2,112,369.00	0.18
5	FACEBOOK INC-CLASS A	FB UQ	1,960,553.91	0.17
6	TESLA INC	TSLA UQ	1,566,965.95	0.13
7	ALPHABET INC-CL A	GOOGL UQ	1,549,795.54	0.13
8	NVIDIA CORP	NVDA UQ	1,268,316.31	0.11
9	CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	CHTR UQ	1,052,514.84	0.09
10	PAYPAL HOLDINGS INC	PYPL UQ	1,017,381.09	0.09
11	ADOBE INC	ADBE UQ	950,238.64	0.08
12	INTEL CORP	INTC UQ	873,984.80	0.07
13	NETFLIX INC	NFLX UQ	812,524.75	0.07
14	COMCAST CORP-CLASS A	CMCSA UQ	811,648.30	0.07
15	QUALCOMM INC	QCOM UQ	692,648.13	0.06
16	PEPSICO INC	PEP UQ	686,697.10	0.06
17	JD.COM INC-ADR	JD UQ	627,121.66	0.05
18	COSTCO WHOLESALE CORP	COST UQ	618,456.23	0.05
19	T-MOBILE US INC	TMUS UQ	559,867.55	0.05
20	TEXAS INSTRUMENTS INC	TXN UQ	536,036.61	0.05

注：本期累计卖出金额指卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），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	110,473,988.83
卖出收入（成交）总额	46,695,755.13

注：上述金额均指成交金额（成交单价乘以成交数量），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

金额单位：人民币元

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	股指期货	NASDAQ 100 E-MINI Sep21	-	-

注：期货投资采用当日无负债结算制度，结算准备金已包括所持期货合约产生的持仓损益，因此衍生金融工具项下的期货投资与相关的期货暂收款结算所得的持仓损益之间按抵销后的净额列示，为人民币零元。本报告期末本基金投资的期货持仓和损益明细为：NASDAQ 100 E-MINI Sep21 买入持仓量 61 手，合约市值人民币 114,665,353.77 元，公允价值变动人民币 4,509,686.76 元。

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本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.11.2 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未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	8,669,454.20

2	应收证券清算款	-
3	应收股利	156,975.06
4	应收利息	6,799.05
5	应收申购款	9,780,862.66
6	其他应收款	-
7	待摊费用	182,694.65
8	其他	-
9	合计	18,796,785.62

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

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

无。

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

无。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 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

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 (%)
212,865	2,024.69	36,131,973.69	8.38	394,852,780.07	91.62

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

8.2 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	26,046.40	0.0060
------------------	-----------	--------

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	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	0~10
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（2014 年 11 月 13 日） 基金份额总额	474,326,755.60
本报告期期初基金份额总额	405,075,447.91
本报告期基金总申购份额	268,012,736.66
减：本报告期基金总赎回份额	242,103,430.81
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	430,984,753.76

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

无。

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

一、基金管理人的重大人事变动

基金管理人报告期内无重大人事变动。

二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

2021 年 5 月，中国农业银行总行决定谭敦宇任托管业务部总裁。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

无。

10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)，该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

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

本报告期内，基金管理人、托管人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	
摩根士丹利	1	157,169,743.91	100.00%	-	-	-

注：公司作为管理人负责选择代理各投资组合证券买卖的境外券商，具体选择标准如下：

- (一) 具备该机构所在国家或地区政府、监管机构核发的营业执照、业务许可证明文件；
- (二) 资历雄厚，信誉良好；
- (三) 财务状况良好，经营行为规范；
- (四) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度(包括但不限于公平交易制度及保密制度)，能满足各投资组合运作高度保密的要求；
- (五) 证券研究或市场研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时、定期、全面地为各投资组合提供宏观经济、行业情况、个股分析、市场研究等各方面研究报告及周到的信息服务，并能根据各投资组合投资的特定要求，提供专题研究报告；
- (六) 具备各投资组合运作所需的交易执行能力。能够准确、及时、高质量完成各投资组合下达的交易指令。
- (七) 具备各投资组合运作所需的后台清算执行能力。能及时、高效处理交易清算、证券交收等后台清算业务。
- (八) 能提供各投资组合运作、管理所需的其他服务。
- (九) 相关基金合同、资产管理合同以及法律法规规定的其他条件。

交易管理部在每半年 15 个交易日内，汇总上半年境外券商综合服务评价结果，作为当次境外券商交易量分配依据。并依此制作交易量分配计划，报部门及公司分管领导批准；交易量分配

计划获批后，作为选择交易券商的依据，供交易员在交易时进行券商选择。 券商服务出现重大失误或其他异常情况时，及时报公司监察稽核部及相关领导。可暂停与该券商的合作，并对其失误所造成的损失进行追偿。本报告期内本基金无新增或退租交易单元。

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

无。

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	关于提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 6 月 30 日
2	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加海银基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 5 月 27 日
3	大成纳斯达克 100 指数证券投资基金第一季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 4 月 22 日
4	大成纳斯达克 100 指数证券投资基金更新招募说明书	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 3 月 30 日
5	大成纳斯达克 100 指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 3 月 30 日
6	大成纳斯达克 100 指数证券投资基金 2020 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 3 月 30 日
7	大成纳斯达克 100 指数证券投资基金基金合同	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 3 月 30 日
8	大成基金管理有限公司提醒投资者谨防金融诈骗的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 3 月 23 日
9	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加鼎信汇金（北京）投资管理有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 3 月 11 日
10	大成基金管理有限公司关于大成纳斯达克 100 指数证券投资基金开展赎回费率优惠活动的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 2 月 5 日
11	大成纳斯达克 100 指数证券投资基金第四季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 1 月 22 日
12	大成基金管理有限公司关于旗下部分	中国证监会基金电子披	2021 年 1 月 16 日

	基金增加江苏银行股份有限公司为销售机构的公告	露网站、规定报刊及本公司网站	
--	------------------------	----------------	--

§ 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

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立大成纳斯达克 100 指数证券投资基金的文件；
- 2、《大成纳斯达克 100 指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成纳斯达克 100 指数证券投资基金托管协议》；
- 4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；
- 5、本报告期内在指定报刊上披露的各种公告原稿。

12.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，或登录本基金管理人网站 <http://www.dcfund.com.cn> 进行查阅。

大成基金管理有限公司

2021 年 8 月 31 日