

**博时纳斯达克 100 交易型开放式指数证券  
投资基金（QDII）  
2023 年中期报告  
2023 年 6 月 30 日**

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年八月三十一日

## § 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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 4 月 19 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>1</b>
1.1 重要提示 .....	1
1.2 目录 .....	2
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>4</b>
2.1 基金基本情况 .....	4
2.2 基金产品说明 .....	4
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	4
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人 .....	5
2.5 信息披露方式 .....	5
2.6 其他相关资料 .....	5
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>5</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	5
3.2 基金净值表现 .....	6
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>7</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	11
4.8 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 .....	11
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 .....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	11
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 .....	12
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>12</b>
6.1 资产负债表 .....	12
6.2 利润表 .....	13
6.3 净资产（基金净值）变动表 .....	14
6.4 报表附注 .....	15
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>39</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	39
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布 .....	40
7.3 期末按行业分类的权益投资组合 .....	40
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 .....	40
7.5 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	46
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合 .....	48
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细 .....	48
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细 .....	48
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细 .....	48
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细 .....	48

7.11 投资组合报告附注 .....	48
<b>§8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>49</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	49
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	49
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	50
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	50
<b>§9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>51</b>
<b>§10 重大事件揭示 .....</b>	<b>51</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	51
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	51
10.4 基金投资策略的改变 .....	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	52
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.....	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	52
10.8 其他重大事件 .....	53
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>54</b>
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.....	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	55
<b>§12 备查文件目录 .....</b>	<b>55</b>
12.1 备查文件目录 .....	55
12.2 存放地点 .....	55
12.3 查阅方式 .....	56

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	博时纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)
基金简称	博时纳斯达克 100ETF
场内简称	纳斯达克指数 ETF
基金主代码	513390
交易代码	513390
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 4 月 19 日
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	58,379,100.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2023 年 6 月 8 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采用完全复制法进行投资，即按照成份股在标的指数中的基准权重来构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。在正常情况下，本基金力争控制投资组合的净值增长率与业绩比较基准之间的预期日均跟踪偏离度的绝对值小于 0.20%，预期年化跟踪误差不超过 2%。本基金的其他投资策略包括债券和货币市场工具投资策略、金融衍生品投资策略、融资及转融通证券出借策略、流通受限证券投资策略、资产支持证券的投资策略、非成份股的股票投资策略、存托凭证投资策略。未来，随着投资工具的发展和丰富，本基金可在不改变投资目标的前提下，相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明更新中公告。
业绩比较基准	纳斯达克 100 指数收益率（经估值汇率调整）
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为被动式投资的股票型指数基金，跟踪纳斯达克 100 指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。此外，本基金投资境外市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，还面临汇率风险以及境外市场的风险。

### 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		博时基金管理有限公司	中信银行股份有限公司
信息披露	姓名	孙麒清	姜敏

负责人	联系电话	0755-83169999	4006800000
	电子邮箱	service@bosera.com	jiangmin@citicbank.com
客户服务电话		95105568	95558
传真		0755-83195140	010-85230024
注册地址		深圳市福田区莲花街道福新社区益田路5999号基金大厦21层	北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层
办公地址		广东省深圳市福田区益田路5999号基金大厦21层	北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层
邮政编码		518040	100020
法定代表人		江向阳	朱鹤新

## 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	-	Brown Brothers Harriman Co.
	中文	-	布朗兄弟哈里曼银行
注册地址		-	-
办公地址		-	-
邮政编码		-	-

注：本基金未聘请境外投资顾问。

## 2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.bosera.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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

# § 3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2023 年 4 月 19 日 (基金合同生效日) 至 2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	10,523,346.10
本期利润	22,051,103.60
加权平均基金份额本期利润	0.1764

本期加权平均净值利润率	16.62%
本期基金份额净值增长率	22.97%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末(2023年6月30日)</b>
期末可供分配利润	5,909,607.99
期末可供分配基金份额利润	0.1012
期末基金资产净值	71,791,410.99
期末基金份额净值	1.2297
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2023年6月30日)</b>
基金份额累计净值增长率	22.97%

注：本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

期末可供分配利润是指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。

上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	8.71%	1.02%	8.65%	1.02%	0.06%	0.00%
自基金合同生效起至今	22.97%	0.98%	21.75%	1.17%	1.22%	-0.19%

### 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



注：本基金的基金合同于 2023 年 4 月 19 日生效。按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同“投资范围”、“投资禁止行为与限制”章节的有关约定。

## § 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

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。“为国民创造财富”是博时的使命。博时的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 2023 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理 355 只公募基金，并受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金，以及多个企业年金、职业年金及特定专户，管理资产总规模逾 14767 亿元人民币，剔除货币基金后，博时基金公募资产管理总规模逾 5220 亿元人民币，累计分红逾 1851 亿元人民币，是目前我国资产管理规模最大的基金公司之一。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓	职务	任本基金的基金经理（助理）期限	证券从	说明
---	----	-----------------	-----	----



名		任职日期	离任日期	业年限	
万琼	指数与量化 投资部投资 总监助理/ 基金经理	2023-04-19	-	16.3	<p>万琼女士，硕士。2004 年起先后在中企动力科技股份有限公司、华夏基金工作。2011 年加入博时基金管理有限公司。历任投资助理、基金经理助理、博时富时中国 A 股指数证券投资基金 (2017 年 9 月 29 日-2019 年 9 月 5 日)、上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金 (2015 年 6 月 8 日-2019 年 10 月 11 日)、博时上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (2015 年 6 月 8 日-2019 年 10 月 11 日)、博时恒生沪深港通大湾区综合交易型开放式指数证券投资基金 (2020 年 4 月 30 日-2022 年 5 月 27 日)、博时上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (2015 年 6 月 8 日-2022 年 7 月 7 日)、上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金 (2015 年 6 月 8 日-2022 年 7 月 7 日)、博时中证可持续发展 100 交易型开放式指数证券投资基金 (2020 年 1 月 19 日-2023 年 3 月 8 日)、博时中证红利交易型开放式指数证券投资基金 (2020 年 3 月 20 日-2023 年 3 月 8 日)、博时沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 (2020 年 4 月 3 日-2023 年 3 月 8 日)、博时创业板指数证券投资基金 (2021 年 4 月 2 日-2023 年 3 月 8 日) 的基金经理。现任指数与量化投资部投资总监助理兼博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (2015 年 10 月 8 日—至今)、博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (2015 年 10 月 8 日—至今)、博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 (2019 年 8 月 1 日—至今)、博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 (2019 年 12 月 30 日—至今)、博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) (2021 年 3 月 18 日—至今)、博时恒生港股通高股息率交易型开放式指数证券投资基金 (2021 年 5 月 11 日—至今)、博时恒生科技交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) (2021 年 5 月 17 日—至今)、博</p>

				时中证全球中国教育主题交易型开放式指数证券投资基金(QDII)(2021年6月8日一至今)、博时恒生科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(QDII)(2021年12月21日一至今)、博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(QDII)(2021年12月28日一至今)、博时恒生港股通高股息率交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(2022年1月10日一至今)、博时中证港股通消费主题交易型开放式指数证券投资基金(2022年3月3日一至今)、博时纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金(QDII)(2022年7月26日一至今)、博时纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)(2023年4月19日一至今)的基金经理。
--	--	--	--	---

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 89 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年上半年, 美国通胀持续下行, 经济指标改善, 在龙头科技公司的带领下美股大幅反弹。从经济基本面上来看, 一季度 GDP 环比折合年率 2.0%, 较此前公布数据上修 0.7%, 超出市场预期的 1.4%, 主要来自消费项尤其是汽车和零部件销售的拉动。一季度的银行风波对信贷投放造成负面影响, 对经济形成冲击, 同时也使得美联储转宽预期。2 月, 3 月美联储分别加息 25bps。二季度 GDP 环比折合年率初值 2.4%, 优于预期 1.8% 及前值 2.0%, 其中消费与固定资产投资为主要拉动。5 月美联储加息 25bps, 6 月暂停加息。从最新的经济数据来看, 通胀和经济数据均有所好转, 美国经济实现软着陆的概率有所提升。6 月 CPI 环比上涨 0.2%, 同比上涨 3.0%, 均低于市场预期, 核心 CPI 也略低于市场预期。从货币政策上来看, 美联储 7 月如期加息 25bps 至 5.25%-5.50% 区间。从市场情绪上来看, 7 月会议的加息已经被市场充分计入, 美股与主要资产对会议的反应也较为平淡。上半年整体来看, 标普 500 指数和纳斯达克 100 指数分别上涨了 15.91% 和 38.75%。本基金为被动跟踪指数的基金。其投资目的是尽量减少和标的指数的跟踪误差, 取得标的指数所代表的市场平均回报。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 06 月 30 日, 本基金基金份额净值为 1.2297 元, 份额累计净值为 1.2297 元。报告期内, 本基金基金份额净值增长率为 22.97%, 同期业绩基准增长率 21.75%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2023 年下半年, 美国经济仍然具有较强韧性。经济方面, 超额储蓄依然能支撑消费继续韧性放缓, 政府支持下的赛道投资或能减缓整体私人投资的下行压力。由于去年高基数效应, 6 月美国的 CPI 可能会是第三季度的一个阶段性低点。货币政策方面, 目前已经接近加息周期尾声, 9 月加息概率下降但还需继续观察核心通胀情况, 年内降息概率不大。流动性方面, 美联储借款逐步到期、继续缩表, 以及新发国债都会使得金融流动性重新收缩。下半年盈利韧性交易可能仍是主逻辑, 而软着陆的前景将缓解分子端的压力, 对美股偏利好。

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

## 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定, 确保基金资产估值的公平、合理, 有效维护投资人的利益, 设立了博时基金管理有限公司估值委员会 (以下简称“估值委员会”),

制定了估值政策和估值程序。估值委员会成员由主管运营的公司领导、督察长、投资总监、研究部负责人、运作部负责人等成员组成，基金经理原则上不参与估值委员会的工作，其估值建议经估值委员会成员评估后审慎采用。估值委员会成员均具有 5 年以上专业工作经历，具备良好的专业经验和专业胜任能力，具有绝对的独立性。估值委员会的职责主要包括有：保证基金估值的公平、合理；制订健全、有效的估值政策和程序；确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性；定期对估值政策和程序进行评价等。

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管银行有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未进行收益分配。

#### 4.8 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

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对博时纳斯达克 100ETF 基金 2023 年上半年的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在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，博时基金管理有限公司在博时纳斯达克 100ETF 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，博时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 2023 年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：博时纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2023年6月30日
<b>资产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	3,583,214.58
结算备付金		771,961.12
存出保证金		293,772.12
交易性金融资产	6.4.7.2	67,320,174.36
其中：股票投资		67,320,174.36
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	-
其他债权投资		-
其他权益工具投资	6.4.7.5	-
应收清算款		-
应收股利		10,113.16
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	80,544.98
资产总计		72,059,780.32

负债和净资产	附注号	本期末 2023年6月30日
<b>负债：</b>		
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		187,420.83
应付赎回款		-
应付管理人报酬		34,706.92
应付托管费		10,412.07
应付销售服务费		-
应付投资顾问费		-
应交税费		18,840.86
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.7	16,988.65
负债合计		268,369.33
<b>净资产：</b>		
实收基金	6.4.7.8	58,379,100.00
其他综合收益		-
未分配利润	6.4.7.9	13,412,310.99
净资产合计		71,791,410.99
<b>负债和净资产总计</b>		<b>72,059,780.32</b>

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.2297 元，基金份额总额 58,379,100.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：博时纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)

本报告期：2023 年 4 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年4月19日（基金合同生效日）至2023年6月30日
<b>一、营业总收入</b>		<b>22,280,561.75</b>
1. 利息收入		12,224.24
其中：存款利息收入	6.4.7.10	12,224.24
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)		9,617,476.08
其中: 股票投资收益	6.4.7.11	8,898,555.84
基金投资收益	6.4.7.12	-
债券投资收益	6.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.15	577,754.95
股利收益	6.4.7.16	141,165.29
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益 (若有)		-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益 (损失以“-”号填列)	6.4.7.17	11,527,757.50
4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列)		1,087,468.54
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	6.4.7.18	35,635.39
<b>减: 二、营业总支出</b>		229,458.15
1. 管理人报酬		135,931.04
2. 托管费		40,779.31
3. 销售服务费		-
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中: 卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	6.4.7.19	-
7. 税金及附加		2,081.13
8. 其他费用	6.4.7.20	50,666.67
<b>三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)</b>		22,051,103.60
减: 所得税费用		-
<b>四、净利润 (净亏损以“-”号填列)</b>		22,051,103.60
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-
<b>六、综合收益总额</b>		22,051,103.60

### 6.3 净资产 (基金净值) 变动表

会计主体: 博时纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)

本报告期: 2023 年 4 月 19 日 (基金合同生效日) 至 2023 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2023年4月19日（基金合同生效日）至2023年6月30日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 （基金净值）	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 （基金净值）	273,379,100.00	-	-	273,379,100.00
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填 列）	-215,000,000.00	-	13,412,310.99	-201,587,689.01
（一）、综合收益总 额	-	-	22,051,103.60	22,051,103.60
（二）、本期基金份 额交易产生的基金 净值变动数（净值减 少以“-”号填列）	-215,000,000.00	-	-8,638,792.61	-223,638,792.61
其中：1. 基金申购款	11,000,000.00	-	1,215,621.02	12,215,621.02
2. 基金赎回款	-226,000,000.00	-	-9,854,413.63	-235,854,413.63
（三）、本期向基金 份额持有人分配利 润产生的基金净值 变动（净值减少以 “-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收 益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产 （基金净值）	58,379,100.00	-	13,412,310.99	71,791,410.99

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：

基金管理人负责人：江向阳，主管会计工作负责人：徐卫，会计机构负责人：佘方方

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

博时纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) (以下简称“本基金”) 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]569号核准,由博时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《博时纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式,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 273,377,800.00 元(含所募集股票市值),业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2023)验字第 60669135\_A15 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《博时纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金合同》于 2023 年 4 月 19 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 273,379,100.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 1,300.00 份基金份额。本基金的基金管理人为博时基金管理有限公司,基金托管人为中信银行股份有限公司,境外托管人为布朗兄弟哈里曼银行。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2023]94 号核准,本基金于 2023 年 5 月 8 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金(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和备选成份股(含存托凭证)。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);依法发行上市的内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许投资的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”);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、存托凭证(包括全球存托凭证、美国存托凭证等)、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;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、中国存托凭证)、债券(包括国债、金融债、地方政府债、政府支持机构债券、企业债、公司债、可转换债券、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、货币市场工具(包括银行存款、同业存单等)、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。未来在法律法规允许的前提下,本基金可根据相关法律法规规定参与融券业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,本基金管理人可以将其纳入投资范围,其投

资原则及投资比例按法律法规或监管机构的相关规定执行。本基金投资标的指数成份股、备选成份股(含存托凭证)的资产不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。如果法律法规对该比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，本基金的投资比例会做相应调整。本基金的业绩比较基准为：纳斯达克 100 指数收益率(经估值汇率调整)。

#### 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》、《博时纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金合同》和在财务报表附注“重要会计政策和会计估计”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

本基金本报告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本期末的财务状况以及本报告期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。本财务报表的实际编制期间为 2023 年 4 月 19 日(基金合同生效日)至 2023 年 6 月 30 日止期间。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

###### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

## 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产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、资产支持证券投资和基金投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

## 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具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、基金投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中

考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

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

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 6.4.4.7 实收基金

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

#### 6.4.4.8 损益平准金

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

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息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和托管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

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。当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 0.01% 以上时，可进行收益分配。本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 6.4.4.13 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票, 若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况, 本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》, 根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票, 根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”), 按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券和可分离债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种, 根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券和可分离债券除外), 按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[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。

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

(2) 对基金从境内证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

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) 对基金取得的境内企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从境内上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的境内上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

对基金通过沪港通/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/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) 基金卖出境内股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
活期存款	3,583,214.58
等于：本金	3,582,702.20
加：应计利息	512.38
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	3,583,214.58

注：于 2023 年 06 月 30 日，银行存款中包含的外币余额为：美元 72,055.98 (折合人民币 520,662.10)。

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	55,894,965.41	-	67,320,174.36	11,425,208.95
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	55,894,965.41	-	67,320,174.36	11,425,208.95

#### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	4,330,335.23	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	4,330,335.23	-	-	-

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
NQU3	NASDAQ 100 E-MINI Sep23	2.00	4,432,883.78	102,548.55
合计	-	-	-	102,548.55
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	102,548.55
净额	-	-	-	-

#### 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

无余额。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

#### 6.4.7.5 其他权益工具投资

##### 6.4.7.5.1 其他权益工具投资情况

无。

##### 6.4.7.5.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

#### 6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	80,544.98
合计	80,544.98

#### 6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	16,988.65
合计	16,988.65

#### 6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年4月19日（基金合同生效日）至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	273,379,100.00	273,379,100.00
本期申购	11,000,000.00	11,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-226,000,000.00	-226,000,000.00
本期末	58,379,100.00	58,379,100.00

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

2. 基金合同于2023年3月1日生效,基金合同生效日的基金份额总额为273,379,100.00份基金份额,认购资金利息折合1,300.00份基金份额。

#### 6.4.7.9 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	10,523,346.10	11,527,757.50	22,051,103.60
本期基金份额交易产生的变动数	-4,613,738.11	-4,025,054.50	-8,638,792.61
其中：基金申购款	451,063.88	764,557.14	1,215,621.02
基金赎回款	-5,064,801.99	-4,789,611.64	-9,854,413.63
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,909,607.99	7,502,703.00	13,412,310.99

#### 6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年4月19日（基金合同生效日）至2023年6月30日
活期存款利息收入	12,224.24
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	12,224.24

#### 6.4.7.11 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年4月19日（基金合同生效日）至2023年6月30日
卖出股票成交总额	207,495,160.73
减：卖出股票成本总额	198,459,839.45
减：交易费用	136,765.44
买卖股票差价收入	8,898,555.84

#### 6.4.7.12 基金投资收益

无发生额。

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

无发生额。

##### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无发生额。

#### 6.4.7.14 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

无发生额。

##### 6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无发生额。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

##### 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无发生额。

##### 6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年4月19日（基金合同生效日）至2023年6月30日
期货投资收益	595,097.77
减：增值税抵减	-17,342.82
合计	577,754.95

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年4月19日（基金合同生效日）至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	141,165.29
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	141,165.29

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023年4月19日（基金合同生效日）至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	11,425,208.95
——股票投资	11,425,208.95
——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	102,548.55
——权证投资	-
——期货投资	102,548.55
4. 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	11,527,757.50

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年4月19日（基金合同生效日）至2023年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	-4,780.55
其他	40,415.94
合计	35,635.39

#### 6.4.7.19 信用减值损失

无发生额。

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023年4月19日（基金合同生效日）至2023年6月30日
审计费用	14,202.15
信息披露费	-
证券出借违约金	-
IOPV 计算与发布费	2,786.50
银行汇划费用	1,323.00
中登结算服务费	31,955.02
其他费用	400.00
合计	50,666.67

#### 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

截至财务报表批准报出日，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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
-------	---------

博时基金管理有限公司(“博时基金”)	基金管理人、注册登记机构
中信银行股份有限公司(“中信银行”)	基金托管人
布朗兄弟哈里曼银行(“BBH”)	境外资产托管人
招商证券股份有限公司(“招商证券”)	基金管理人的股东
中国长城资产管理股份有限公司	基金管理人的股东
广厦建设集团有限责任公司	基金管理人的股东
天津港(集团)有限公司	基金管理人的股东
上海汇华实业有限公司	基金管理人的股东
上海盛业股权投资基金有限公司	基金管理人的股东
博时资本管理有限公司	基金管理人的子公司
博时财富基金销售有限公司	基金管理人的子公司
博时基金(国际)有限公司	基金管理人的子公司

#### 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

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 2023年4月19日(基金合同生效日)至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	135,931.04
其中：支付销售机构的客户维护费	4,698.71

注：支付基金管理人博时基金的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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.50% / 当年天数。

###### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年4月19日(基金合同生效日)至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	40,779.31

注：支付基金托管人的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：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.15% / 当年天数。

##### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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**

无。

**6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023 年 6 月 30 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
招商证券	5,704,100.00	9.77%

注：1. 除基金管理人之外的其他关联方投资本基金适用的交易费率与本基金法律文件规定一致。

2. 持有的基金份额占基金总份额的比例为四舍五入后的结果。



**6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 4 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中信银行	3,062,552.48	12,224.24
布朗兄弟哈里曼银行	520,662.10	-

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行活期利率/银行同业利率/约定利率计息。

**6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

无。

**6.4.10.8 其他关联交易事项的说明**
**6.4.10.8.1 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（2023 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**

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**

本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为被动式投资的股票型指数基金，跟踪纳斯达克 100 指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。此外，本基金投资境外市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，还面临汇率风险以及境外市场的风险。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。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紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

本基金的基金管理人建立了董事会领导，以风险管理委员会为核心的，由总经理、督察长、监察法律部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，董事会负责制定公司的风险管理政策，对风险管理负完全的和最终的责任；在董事会下设立风险管理委员会，负责批准公司风险管理系统文件和批准每一个部门的风险级别，以及负责解决重大的突发的风险；督察长独立行使督察权利，直接对董事会负责，向风险管理委员会提交独立的风险管理报告和风险管理建议；监察法律部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；风险管理部负责建立和完善公司投资风险管理制度与流程，组织实施公司投资风险管理与绩效分析工作，确保公司各类投资风险得到良好监督与控制。

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存放在本基金的托管人，定期存款存放在具有证券投资基金托管资格、基金销售业务资格或合格境外机构投资者托管人资格的银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在境外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，在境内交易所进行的交易主要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，本基金的基金管理人管理的基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，违约风险可能性很小；在场外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。

#### **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来自调整基金投资组合时，由于组合资产流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

于本期末，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息。本基金赎回基金份额采用组合证券形式，流动性风险相对较低。

#### **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。

除附注“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不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。在本基金开放日，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%。于本期末，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

同时，本基金的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本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手

风险。此外，本基金的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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	3,062,552.48	-	-	520,662.10	3,583,214.58
结算备付金	-	-	-	771,961.12	771,961.12
存出保证金	-	-	-	293,772.12	293,772.12
交易性金融资产	-	-	-	67,320,174.36	67,320,174.36
应收清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	10,113.16	10,113.16
其他资产	-	-	-	80,544.98	80,544.98
<b>资产总计</b>	<b>3,062,552.48</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>68,997,227.84</b>	<b>72,059,780.32</b>
<b>负债</b>					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	187,420.83	187,420.83
应付管理人报酬	-	-	-	34,706.92	34,706.92
应付托管费	-	-	-	10,412.07	10,412.07
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	18,840.86	18,840.86

应付利润	-	-	-	-
其他负债	-	-	16,988.65	16,988.65
<b>负债总计</b>	-	-	<b>268,369.33</b>	<b>268,369.33</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>3,062,552.48</b>	-	<b>68,728,858.51</b>	<b>71,791,410.99</b>

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约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

本期末本基金未持有交易性债券投资和资产支持证券投资（不包括可转债和可交换债），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇风险进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	520,662.10			520,662.10
结算备付金	771,961.12			771,961.12
存出保证金	293,772.12			293,772.12
交易性金融资产	67,320,174.36			67,320,174.36
应收股利	10,113.16			10,113.16
应收证券清算款	-			-
应收申购款	-			-
应收利息	-			-
其他资产	-			-
<b>资产合计</b>	<b>68,916,682.86</b>			<b>68,916,682.86</b>
以外币计价的负债				
应付赎回款	-			-
应付证券清算款	66,663.21			66,663.21
应付利息	-			-
其他负债	-			-
<b>负债合计</b>	<b>66,663.21</b>			<b>66,663.21</b>
<b>资产负债表外汇风险敞口净额</b>	<b>68,850,019.65</b>			<b>68,850,019.65</b>

##### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的

		影响金额 (单位: 人民币万元)	
		本期末 2023 年 6 月 30 日	
	所有外币均相对人民币升值 5%		增加约 344
	所有外币均相对人民币贬值 5%		减少约 344

#### 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。本基金主要投资于上市交易的证券, 所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响, 也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险, 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。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 2023 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	67,320,174.36	93.77
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
其他	-	-
合计	67,320,174.36	93.77

注: 1、债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

2、其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注“衍生金融资产/负债”)。在当日无负债结算制度下, 期货投资于相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵扣后的净额为 0。

**6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析**

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额 (单位: 人民币万元)
		本期末 2023 年 6 月 30 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 357
	业绩比较基准下降 5%	减少约 357

**6.4.14 公允价值**
**6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法**

公允价值计量结果所属的层次, 由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

第一层次: 相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次: 除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次: 相关资产或负债的不可观察输入值。

**6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具**
**6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值**

单位: 人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年6月30日
第一层次	67,320,174.36
第二层次	-
第三层次	-
合计	67,320,174.36

**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证券, 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证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, 确定相关证券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**

于本期末, 本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

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	67,320,174.36	93.42
	其中：普通股	66,589,442.65	92.41
	存托凭证	730,731.71	1.01
	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	4,355,175.70	6.04
8	其他各项资产	384,430.26	0.53
9	合计	72,059,780.32	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	67,320,174.36	93.77
合计	67,320,174.36	93.77

## 7.3 期末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	249,519.81	0.35
公用事业	661,573.72	0.92
工业	2,774,365.27	3.86
非日常生活消费品	10,224,905.93	14.24
日常消费品	3,569,656.13	4.97
医疗保健	3,812,477.68	5.31
金融	333,184.75	0.46
信息技术	34,584,412.19	48.17
电信业务	11,110,078.88	15.48
合计	67,320,174.36	93.77

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

## 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

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	-	MSFT US	纳斯达克交易所	美国	3,537.00	8,703,403.70	12.12
2	APPLE INC	-	AAPL US	纳斯达克交易所	美国	6,044.00	8,471,200.45	11.80
3	ALPHABET INC	-	GOOGL US	纳斯达克	美国	2,893.00	2,502,237.46	3.49

				交易所				
			GOOG US	纳斯达克交易所	美国	2,806.00	2,452,738.70	3.42
4	NVIDIA CORP	-	NVDA US	纳斯达克交易所	美国	1,530.00	4,676,686.61	6.51
5	AMAZON.COM INC	-	AMZN US	纳斯达克交易所	美国	4,902.00	4,617,464.82	6.43
6	TESLA INC	-	TSLA US	纳斯达克交易所	美国	1,514.00	2,863,727.47	3.99
7	META PLATFORMS INC-CLASS A	-	META US	纳斯达克交易所	美国	1,371.00	2,842,987.98	3.96
8	BROADCOM INC	-	AVGO US	纳斯达克交易所	美国	258.00	1,617,111.93	2.25
9	PEPSICO INC	-	PEP US	纳斯达克交易所	美国	854.00	1,142,961.73	1.59
10	COSTCO WHOLESALE CORP	-	COST US	纳斯达克交易所	美国	275.00	1,069,812.21	1.49
11	ADOBE INC	-	ADBE US	纳斯达克交易所	美国	284.00	1,003,469.68	1.40
12	CISCO SYSTEMS INC	-	CSCO US	纳斯达克交易所	美国	2,525.00	944,003.80	1.31
13	NETFLIX INC	-	NFLX US	纳斯达克交易所	美国	275.00	875,295.48	1.22
14	ADVANCED MICRO DEVICES	-	AMD US	纳斯达克交易所	美国	998.00	821,444.70	1.14
15	COMCAST CORP-CLASS A	-	CMCSA US	纳斯达克交易所	美国	2,578.00	773,998.07	1.08
16	T-MOBILE US INC	-	TMUS US	纳斯达克交易所	美国	743.00	745,722.07	1.04
17	TEXAS INSTRUMENTS INC	-	TXN US	纳斯达克交易所	美国	563.00	732,343.93	1.02
18	INTEL CORP	-	INTC US	纳斯达克交易所	美国	2,585.00	624,615.49	0.87
19	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	-	HON US	纳斯达克交易所	美国	413.00	619,233.00	0.86
20	QUALCOMM INC	-	QCOM US	纳斯达克交易所	美国	690.00	593,509.87	0.83
21	INTUIT INC	-	INTU US	纳斯达克交易所	美国	173.00	572,766.55	0.80
22	APPLIED	-	AMAT US	纳斯达克交易所	美国	520.00	543,096.91	0.76

	MATERIALS INC			交易所				
23	INTUITIVE SURGICAL INC	-	ISRG US	纳斯达克交易所	美国	217.00	536,161.44	0.75
24	AMGEN INC	-	AMGN US	纳斯达克交易所	美国	331.00	531,014.07	0.74
25	STARBUCKS CORP	-	SBUX US	纳斯达克交易所	美国	710.00	508,209.30	0.71
26	MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	-	MDLZ US	纳斯达克交易所	美国	844.00	444,830.08	0.62
27	ANALOG DEVICES INC	-	ADI US	纳斯达克交易所	美国	311.00	437,781.67	0.61
28	GILEAD SCIENCES INC	-	GILD US	纳斯达克交易所	美国	773.00	430,477.83	0.60
29	BOOKING HOLDINGS INC	-	BKNG US	纳斯达克交易所	美国	22.00	429,264.98	0.60
30	AUTOMATIC DATA PROCESSING	-	ADP US	纳斯达克交易所	美国	256.00	406,568.60	0.57
31	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	-	VRTX US	纳斯达克交易所	美国	159.00	404,310.17	0.56
32	LAM RESEARCH CORP	-	LRCX US	纳斯达克交易所	美国	83.00	385,549.76	0.54
33	PALO ALTO NETWORKS INC	-	PANW US	纳斯达克交易所	美国	189.00	348,943.93	0.49
34	REGENERON PHARMACEUTICALS	-	REGN US	纳斯达克交易所	美国	66.00	342,673.74	0.48
35	PAYPAL HOLDINGS INC	-	PYPL US	纳斯达克交易所	美国	691.00	333,184.75	0.46
36	CSX CORP	-	CSX US	纳斯达克交易所	美国	1,260.00	310,463.72	0.43
37	MICRON TECHNOLOGY INC	-	MU US	纳斯达克交易所	美国	678.00	309,181.72	0.43
38	KLA CORP	-	KLAC US	纳斯达克交易所	美国	85.00	297,895.89	0.41
39	ACTIVISION BLIZZARD INC	-	ATVI US	纳斯达克交易所	美国	487.00	296,648.72	0.41
40	SYNOPSYS INC	-	SNPS US	纳斯达克交易所	美国	94.00	295,741.44	0.41
41	CADENCE DESIGN SYS	-	CDNS US	纳斯达克交易所	美国	169.00	286,386.49	0.40

	INC							
42	ASML HOLDING NV-NY REG SHS	-	ASML US	纳斯达克 交易所	美国	54.00	282,792.52	0.39
43	MONSTER BEVERAGE CORP	-	MNST US	纳斯达克 交易所	美国	649.00	269,367.42	0.38
44	FORTINET INC	-	FTNT US	纳斯达克 交易所	美国	487.00	265,998.53	0.37
45	MERCADOLIBRE INC	-	MELI US	纳斯达克 交易所	美国	31.00	265,350.16	0.37
46	O'REILLY AUTOMOTIVE INC	-	ORLY US	纳斯达克 交易所	美国	37.00	255,403.85	0.36
47	MARRIOTT INTERNATIONA L -CL A	-	MAR US	纳斯达克 交易所	美国	189.00	250,861.06	0.35
48	CHARTER COMMUNICATIO NS INC-A	-	CHTR US	纳斯达克 交易所	美国	93.00	246,872.42	0.34
49	NXP SEMICONDUCTO RS NV	-	NXPI US	纳斯达克 交易所	美国	161.00	238,115.26	0.33
50	AIRBNB INC-CLASS A	-	ABNB US	纳斯达克 交易所	美国	255.00	236,144.92	0.33
51	MARVELL TECHNOLOGY INC	-	MRVL US	纳斯达克 交易所	美国	533.00	230,233.79	0.32
52	CINTAS CORP	-	CTAS US	纳斯达克 交易所	美国	63.00	226,283.44	0.32
53	DEXCOM INC	-	DXCM US	纳斯达克 交易所	美国	240.00	222,861.01	0.31
54	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	-	MCHP US	纳斯达克 交易所	美国	338.00	218,807.48	0.30
55	WORKDAY INC-CLASS A	-	WDAY US	纳斯达克 交易所	美国	127.00	207,293.97	0.29
56	MODERNA INC	-	MRNA US	纳斯达克 交易所	美国	236.00	207,192.59	0.29
57	LULULEMON ATHLETICA INC	-	LULU US	纳斯达克 交易所	美国	75.00	205,122.40	0.29
58	KEURIG DR PEPPER INC	-	KDP US	纳斯达克 交易所	美国	870.00	196,577.17	0.27
59	PACCAR INC	-	PCAR US	纳斯达克 交易所	美国	324.00	195,837.97	0.27
60	AUTODESK INC	-	ADSK US	纳斯达克	美国	132.00	195,158.16	0.27

				交易所				
61	COPART INC	-	CPRT US	纳斯达克交易所	美国	296.00	195,083.30	0.27
62	KRAFT HEINZ CO/THE	-	KHC US	纳斯达克交易所	美国	760.00	194,952.08	0.27
63	AMERICAN ELECTRIC POWER	-	AEP US	纳斯达克交易所	美国	319.00	194,083.54	0.27
64	ASTRAZENECA PLC-SPONS ADR	-	AZN US	纳斯达克交易所	美国	367.00	189,794.24	0.26
65	PDD HOLDINGS INC	-	PDD US	纳斯达克交易所	美国	378.00	188,845.70	0.26
66	IDEXX LABORATORIES INC	-	IDXX US	纳斯达克交易所	美国	51.00	185,079.69	0.26
67	BIOGEN INC	-	BIIB US	纳斯达克交易所	美国	89.00	183,185.95	0.26
68	ON SEMICONDUCTOR	-	ON US	纳斯达克交易所	美国	267.00	182,472.12	0.25
69	OLD DOMINION FREIGHT LINE	-	ODFL US	纳斯达克交易所	美国	68.00	181,678.29	0.25
70	EXELON CORP	-	EXC US	纳斯达克交易所	美国	616.00	181,337.52	0.25
71	PAYCHEX INC	-	PAYX US	纳斯达克交易所	美国	223.00	180,262.10	0.25
72	ROSS STORES INC	-	ROST US	纳斯达克交易所	美国	212.00	171,768.54	0.24
73	GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	-	GEHC US	纳斯达克交易所	美国	282.00	165,540.77	0.23
74	COSTAR GROUP INC	-	CSGP US	纳斯达克交易所	美国	253.00	162,703.34	0.23
75	SEAGEN INC	-	SGEN US	纳斯达克交易所	美国	116.00	161,318.59	0.22
76	ELECTRONIC ARTS INC	-	EA US	纳斯达克交易所	美国	169.00	158,384.48	0.22
77	GLOBALFOUNDRIES INC	-	GFS US	纳斯达克交易所	美国	339.00	158,191.69	0.22
78	XCEL ENERGY INC	-	XEL US	纳斯达克交易所	美国	341.00	153,186.74	0.21
79	FASTENAL CO	-	FAST US	纳斯达克交易所	美国	354.00	150,892.48	0.21
80	COGNIZANT TECH	-	CTSH US	纳斯达克交易所	美国	314.00	148,113.87	0.21

	SOLUTIONS-A							
81	CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	-	CRWD US	纳斯达克 交易所	美国	139.00	147,514.20	0.21
82	VERISK ANALYTICS INC	-	VRSK US	纳斯达克 交易所	美国	89.00	145,359.03	0.20
83	BAKER HUGHES CO	-	BKR US	纳斯达克 交易所	美国	627.00	143,211.53	0.20
84	DOLLAR TREE INC	-	DLTR US	纳斯达克 交易所	美国	136.00	141,018.71	0.20
85	WARNER BROS DISCOVERY INC	-	WBD US	纳斯达克 交易所	美国	1,509.00	136,732.80	0.19
86	CONSTELLATIO N ENERGY	-	CEG US	纳斯达克 交易所	美国	201.00	132,965.92	0.19
87	ILLUMINA INC	-	ILMN US	纳斯达克 交易所	美国	98.00	132,766.99	0.18
88	DATADOG INC - CLASS A	-	DDOG US	纳斯达克 交易所	美国	183.00	130,089.98	0.18
89	ANSYS INC	-	ANSS US	纳斯达克 交易所	美国	53.00	126,482.64	0.18
90	ALIGN TECHNOLOGY INC	-	ALGN US	纳斯达克 交易所	美国	47.00	120,100.60	0.17
91	ATLASSIAN CORP-CL A	-	TEAM US	纳斯达克 交易所	美国	94.00	113,980.78	0.16
92	WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	-	WBA US	纳斯达克 交易所	美国	535.00	110,136.73	0.15
93	EBAY INC	-	EBAY US	纳斯达克 交易所	美国	331.00	106,886.85	0.15
94	DIAMONDBACK ENERGY INC	-	FANG US	纳斯达克 交易所	美国	112.00	106,308.28	0.15
95	ENPHASE ENERGY INC	-	ENPH US	纳斯达克 交易所	美国	85.00	102,865.04	0.14
96	ZSCALER INC	-	ZS US	纳斯达克 交易所	美国	90.00	95,142.11	0.13
97	SIRIUS XM HOLDINGS INC	-	SIRI US	纳斯达克 交易所	美国	2,397.00	78,460.70	0.11
98	ZOOM VIDEO COMMUNICATIO NS-A	-	ZM US	纳斯达克 交易所	美国	155.00	76,025.53	0.11
99	JD.COM INC-ADR	-	JD US	纳斯达克 交易所	美国	281.00	69,299.25	0.10
100	LUCID GROUP	-	LCID US	纳斯达克	美国	1,136.00	56,556.63	0.08

	INC			交易所			
--	-----	--	--	-----	--	--	--

注：所用证券代码采用当地市场代码。

## 7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.5.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	34,188,949.61	47.62
2	APPLE INC	AAPL US	31,942,290.52	44.49
3	ALPHABET INC	GOOGL US	9,656,888.67	13.45
		GOOG US	9,497,993.23	13.23
4	AMAZON.COM INC	AMZN US	16,236,921.35	22.62
5	NVIDIA CORP	NVDA US	13,522,888.96	18.84
6	META PLATFORMS INC-CLASS A	META US	10,177,473.97	14.18
7	TESLA INC	TSLA US	7,823,469.99	10.90
8	PEPSICO INC	PEP US	5,208,474.87	7.26
9	BROADCOM INC	AVGO US	5,043,964.88	7.03
10	COSTCO WHOLESALE CORP	COST US	4,285,081.13	5.97
11	CISCO SYSTEMS INC	CSCO US	3,684,810.66	5.13
12	T-MOBILE US INC	TMUS US	3,366,327.42	4.69
13	COMCAST CORP-CLASS A	CMCSA US	3,296,657.73	4.59
14	ADOBE INC	ADBE US	3,065,310.73	4.27
15	TEXAS INSTRUMENTS INC	TXN US	2,906,139.66	4.05
16	NETFLIX INC	NFLX US	2,823,399.07	3.93
17	ADVANCED MICRO DEVICES	AMD US	2,766,711.53	3.85
18	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	HON US	2,572,150.14	3.58
19	INTEL CORP	INTC US	2,540,136.86	3.54
20	AMGEN INC	AMGN US	2,434,918.39	3.39
21	STARBUCKS CORP	SBUX US	2,361,855.91	3.29
22	QUALCOMM INC	QCOM US	2,349,437.46	3.27
23	INTUIT INC	INTU US	2,328,652.27	3.24
24	INTUITIVE SURGICAL INC	ISRG US	2,084,710.22	2.90
25	MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	MDLZ US	2,057,193.13	2.87
26	GILEAD SCIENCES INC	GILD US	1,930,768.61	2.69
27	BOOKING HOLDINGS INC	BKNG US	1,891,138.87	2.63
28	APPLIED MATERIALS INC	AMAT US	1,872,614.38	2.61
29	ANALOG DEVICES INC	ADI US	1,797,658.62	2.50
30	VERTEX PHARMACEUTICALS	VRTX US	1,743,977.59	2.43

	INC			
31	AUTOMATIC DATA PROCESSING	ADP US	1,738,413.66	2.42
32	REGENERON PHARMACEUTICALS	REGN US	1,593,590.21	2.22
33	PAYPAL HOLDINGS INC	PYPL US	1,586,012.68	2.21

注：“买入金额”按买入成交金额（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	27,531,861.46	38.35
2	APPLE INC	AAPL US	26,395,137.99	36.77
3	ALPHABET INC	GOOGL US	8,032,240.49	11.19
		GOOG US	7,922,916.44	11.04
4	AMAZON.COM INC	AMZN US	13,386,267.07	18.65
5	NVIDIA CORP	NVDA US	11,676,278.72	16.26
6	META PLATFORMS INC-CLASS A	META US	8,233,064.28	11.47
7	TESLA INC	TSLA US	6,832,034.25	9.52
8	BROADCOM INC	AVGO US	4,207,865.08	5.86
9	PEPSICO INC	PEP US	4,092,553.27	5.70
10	COSTCO WHOLESALE CORP	COST US	3,433,792.60	4.78
11	CISCO SYSTEMS INC	CSCO US	2,972,920.29	4.14
12	T-MOBILE US INC	TMUS US	2,671,010.66	3.72
13	COMCAST CORP-CLASS A	CMCSA US	2,615,795.55	3.64
14	ADOBE INC	ADBE US	2,540,315.80	3.54
15	ADVANCED MICRO DEVICES	AMD US	2,438,723.05	3.40
16	NETFLIX INC	NFLX US	2,370,406.08	3.30
17	TEXAS INSTRUMENTS INC	TXN US	2,301,783.39	3.21
18	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	HON US	2,032,061.13	2.83
19	INTEL CORP	INTC US	1,953,735.01	2.72
20	AMGEN INC	AMGN US	1,920,355.53	2.67
21	STARBUCKS CORP	SBUX US	1,880,521.48	2.62
22	INTUIT INC	INTU US	1,858,367.27	2.59
23	QUALCOMM INC	QCOM US	1,857,730.20	2.59
24	INTUITIVE SURGICAL INC	ISRG US	1,649,306.16	2.30
25	MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	MDLZ US	1,629,026.74	2.27
26	APPLIED MATERIALS INC	AMAT US	1,540,491.10	2.15
27	BOOKING HOLDINGS INC	BKNG US	1,524,143.13	2.12
28	GILEAD SCIENCES INC	GILD US	1,510,753.05	2.10
29	FISERV INC	FISV US	1,026,256.34	1.43
		FI US	427,210.04	0.60



注：“卖出金额”按卖出成交金额（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	254,354,804.86
卖出收入（成交）总额	207,495,160.73

### 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

### 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排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	期货投资	NASDAQ 100 E-MINI Sep23	102,548.55	0.14

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

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

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

#### 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	293,772.12
2	应收清算款	-

3	应收股利	10,113.16
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	80,544.98
8	其他	-
9	合计	384,430.26

#### 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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 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，分项之和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

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
1,054	55,388.14	27,251,300.00	46.68%	31,127,800.00	53.32%

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	BARCLAYS BANK PLC	19,049,300.00	32.63%
2	招商证券股份有限公司	5,704,100.00	9.77%
3	张静德	1,420,300.00	2.43%
4	王辉	1,418,400.00	2.43%
5	中信证券股份有限公司	1,179,300.00	2.02%

6	胡平	1,000,000.00	1.71%
6	华泰证券股份有限公司	1,000,000.00	1.71%
6	王红兵	1,000,000.00	1.71%
9	狄睿	700,000.00	1.20%
10	张茸茸	596,200.00	1.02%

注：以上数据由中国证券登记结算公司提供，由于系统字数限制可能有持有人名称显示不全的情况，持有人为场内持有人。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

基金管理人从业人员未持有本基金。

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

- 1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。
- 2、本基金的基金经理未持有本基金。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2023 年 4 月 19 日）基金份额总额	273,379,100.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	11,000,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	226,000,000.00
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	58,379,100.00

注：本基金合同于 2023 年 4 月 19 日生效。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人于 2023 年 2 月 18 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，邵凯先生离任公司副总经理，继续担任公司投资决策委员会委员。

基金管理人于 2023 年 5 月 27 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，孙献离任公司财务负责人；吴慧峰任公司副总经理、财务负责人。

本报告期内，基金托管人中信银行股份有限公司董事会于 2023 年 4 月 17 日收到董事长、非执行董事朱鹤新先生的辞呈。董事会选举本行党委书记、副董事长、董事方合英先生为本行董事长，将自中国银行业监管机构核准其董事长任职资格之日起正式就任。

本报告期内，基金托管人中信银行股份有限公司董事会于 2023 年 4 月 17 日收到本行行长方合英先生的辞呈。董事会聘任本行党委副书记、董事、常务副行长刘成先生为本行行长，将自中国银行业监管机构核准其行长任职资格之日起正式就任。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

## 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起,聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务。

## 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没有受到监管部门的稽查或处罚。

### 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,本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
摩根士丹利	-	461,849,965.59	100.00%	135,041.37	100.00%	-

注:本基金根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》(证监基字[2007]48号)的有关规定要求,本公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后,向多家券商租用了基金专用交易席位。

1、基金专用交易席位的选择标准如下:

- (1) 经营行为稳健规范,内控制度健全,在业内有良好的声誉;
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施满足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、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息服务;能根据公司所管理基金的特定要求,提供专门研究报告,具有开发量化投资组合模型的能力;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。

2、基金专用交易席位的选择程序如下

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构
- (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议

### 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	债券交易	回购交易	权证交易	基金交易
----	------	------	------	------

名称	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期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
摩根士丹利	-	-	-	-	-	-	-	-

## 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	博时纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 暂停申购、赎回业务的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-06-16
2	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增开源证券为申购、赎回代办券商的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-06-16
3	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20230601	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-06-01
4	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增华福证券为申购、赎回代办券商的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-05-30
5	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-05-27
6	博时纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 暂停申购、赎回业务的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-05-26
7	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增德邦证券股份有限公司为申购、赎回代办券商的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-05-22
8	博时纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 2023 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	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-05-19
9	博时纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 基金产品资料概要更新	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-05-09
10	博时纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 上市交易提示公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-05-08
11	关于博时纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 新增浙商证券为申购、赎回代办券商的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-05-05
12	博时纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资	证券时报、基金管理人网	2023-04-28

	资基金 (QDII) 上市交易公告书	站、证监会基金电子披露网站	
13	博时纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 开放日常申购、赎回业务的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-04-28
14	博时纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 基金产品资料概要更新	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-04-21
15	博时纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 合同生效公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-04-20
16	博时纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 基金产品资料概要	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-03-31
17	博时纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 发售公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-03-31
18	博时纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 基金合同	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-03-31
19	博时纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 招募说明书	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-03-31
20	博时纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 托管协议	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-03-31

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2023-05-08~ 2023-06-30	-	105,514,500.00	86,465,200.00	19,049,300.00	32.63%
	2	2023-05-11~ 2023-06-11	-	24,143,600.00	18,439,500.00	5,704,100.00	9.77%

#### 产品特有风险

本报告期内，本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过 20% 的情况，当该基金份额持有人选择大比例赎回时，可能引发巨额赎回。若发生巨额赎回而本基金没有足够现金时，存在一定的流动性风险；

为应对巨额赎回而进行投资标的变现时，可能存在仓位调整困难，甚至对基金份额净值造成不利影响。基金经理会对可能出现的巨额赎回情况进行充分准备并做好流动性管理，但当基金出现巨额赎回并被全部确认时，申请赎回的基金份额持有人有可能面临赎回款项被延缓支付的风险，未赎回的基金份额持有人有可能承担短期内基金资产变现冲击成本对基金份额净值产生的不利影响。

本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过20%的情况，根据基金合同相关约定，该份额持有人可以独立向基金管理人申请召开基金份额持有人大会，并有权自行召集基金份额持有人大会。该基金份额持有人可以根据自身需要独立提出持有人大会议案并就相关事项进行表决。基金管理人会对该议案的合理性进行评估，充分向所有基金份额持有人揭示议案的相关风险。

在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模连续六十个工作日低于5000万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

此外，当单一基金份额持有人所持有的基金份额已经达到或超过本基金规模的50%或者接受某笔或者某些申购或转换转入申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%时，本基金管理人可拒绝该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。

注：1. 申购份额包含红利再投资份额。

2. 份额占比为四舍五入后的结果。

## 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、中国证券监督管理委员会批准博时纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 设立的文件

2、《博时纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 基金合同》

3、《博时纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 托管协议》

4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

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

### 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处



### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查询，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

博时一线通：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司  
二〇二三年八月三十一日