

大成纳斯达克 100 交易型开放式指数证券  
投资基金联接基金（QDII）（原大成纳斯达  
克 100 指数证券投资基金）  
2023 年第 3 季度报告

2023 年 9 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

报告送出日期：2023 年 10 月 25 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

原大成纳斯达克 100 指数证券投资基金本报告期自 2023 年 7 月 1 日起至 2023 年 8 月 31 日止，大成纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（QDII）本报告期自 2023 年 9 月 1 日（基金合同生效日）起至 9 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况（转型后）

### 2.1 基金基本情况

基金简称	大成纳斯达克 100ETF 联接（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	2023 年 9 月 1 日
报告期末基金份额总额	703,477,842.52 份
投资目标	本基金主要通过投资于目标 ETF，紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	在正常情况下，本基金力争控制净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 5%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。 一）目标 ETF 投资策略

	<p>本基金主要通过交易所买卖或申购赎回的方式投资于目标 ETF。</p> <p>根据投资者申购、赎回的现金流情况，本基金将综合目标 ETF 的流动性、折溢价率、标的指数成份股流动性等因素分析，对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数。</p> <p>在投资运作过程中，本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用一级市场申购赎回的方式或二级市场买卖的方式对目标 ETF 进行投资。</p> <p>二）股票投资策略</p> <p>根据投资者申购、赎回的现金流情况，本基金将综合目标 ETF 的流动性、折溢价率、标的指数成份股流动性等因素分析，对投资组合进行监控和调整，也可以通过买入标的指数成份股、备选成份股紧密跟踪标的指数。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致无法获得足够数量的个券时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代，包括通过投资其他股票进行替代，以降低跟踪误差，优化投资组合的配置结构。</p> <p>三）衍生品投资策略</p> <p>本基金在金融衍生品的投资中主要遵循有效管理投资策略，对冲某些成份股的特殊突发风险和某些特殊情况下的流动性风险，以及利用金融衍生产品的杠杆作用，达到对标的指数的有效跟踪，同时降低仓位频繁调整带来的交易成本。本基金投资境外股指期货将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数，实现投资目标。</p>
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为纳斯达克 100 指数
风险收益特征	本基金为 ETF 联接基金，主要通过投资于目标 ETF 来实现对标的指数的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现与标的指数及目标 ETF 的表现密切相关，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。
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

下属分级基金的基金简称	大成纳斯达克 100ETF 联接(QDII)A	大成纳斯达克 100ETF 联接(QDII)C
下属分级基金的交易代码	000834	008971
报告期末下属分级基金的份额总额	670,521,868.58 份	32,955,973.94 份
境外资产托管人	英文名称: The Bank of New York Mellon Corporation	
	中文名称: 纽约梅隆银行股份有限公司	

### 2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	大成纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）
基金主代码	159513
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 7 月 12 日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2023 年 7 月 28 日
基金管理人名称	大成基金管理有限公司
基金托管人名称	中国农业银行股份有限公司

### 2.1.2 目标基金产品说明

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	<p>1、股票投资策略</p> <p>本基金为完全被动式指数基金，采用完全复制法，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。但因特殊情况导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将通过投资其他成份股、非成份股以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具进行替代，或者对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。</p> <p>特殊情况包括但不限于以下情形：（1）法律法规的限制；（2）标的指数成份股流动性严重不足；（3）标的指数的成份股票长期停牌；（4）其它合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等。</p> <p>为有效管理投资组合，在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值争取不超过 0.35%，年跟踪误差争取不超过 4%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过了上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。</p> <p>2、金融衍生工具投资策略</p> <p>（1）境外金融衍生品投资策略</p> <p>为更好地实现本基金的投资目标，本基金还将在条件允许的情况下投资于远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品，以期降低跟踪误差水平。本基金将根据风</p>

险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的金融衍生品进行交易。

为了更好地跟踪标的指数，本基金还可通过投资外汇期货、外汇远期、外汇互换等来管理基金投资以及应对申购赎回过程中的汇率风险。

## (2) 境内金融衍生品投资策略

为更好地实现投资目标，本基金可投资股指期货、股票期权、国债期货和其他经中国证监会允许的境内衍生金融产品，如与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具。本基金将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的衍生品合约进行交易。

### 1) 股指期货投资策略

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

### 2) 股票期权投资策略

本基金投资股票期权，将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，充分考虑股票期权的流动性和风险收益特征，在风险可控的前提下，采取备兑开仓、delta 中性等策略适度参与股票期权投资。

### 3) 国债期货投资策略

本基金投资国债期货将根据风险管理原则，以套期保值为目的，以回避市场风险，故国债期货空头的合约价值主要与债券组合的多头价值相对应。基金管理人通过对宏观经济和利率市场走势的分析与判断，并充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置，谨慎进行投资，以调整债券组合的久期，降低投资组合的整体风险。

## 3、债券投资策略

本基金将主要以降低跟踪误差和投资组合流动性管理为目的，综合考虑流动性和收益性，构建本基金债券投资组合。

## 4、资产支持证券投资策略

本基金将分析资产支持证券的资产特征，估计违约率和提前偿付比率，并利用收益率曲线和期权定价模型，对资产支持证券进行估值。本基金将通过对资产支持证券基础资产及结构设计的研究，结合多种定价模型，严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。

## 5、融资及转融通证券出借投资策略

为更好地实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与融资和转融通证券出借业务。参与融资业务时，本基金将力争利用融资的杠杆作用，降低因申购造成基金仓位较低带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。参与转融通证券出借业务时，本基金将在分析市场情况、投资者类型与结构、基金历史申赎情况、出借证券流动性情况等因素的基础上，合理确定出借证券的范围、期限和比例。

## 6、存托凭证投资策略

在控制风险的前提下，本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。

	随着证券市场投资工具的发展和丰富，基金管理人可在不改变投资目标的前提下，根据法律法规的有关规定，在履行适当程序后相应调整或更新投资策略，并公告。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为纳斯达克 100 指数收益率（经汇率调整）。
风险收益特征	本基金为股票型指数基金，因此本基金的预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金为主要投资于境外证券交易市场的证券投资基金，需要承担汇率风险、境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

## § 2 基金产品概况（转型前）

基金简称	大成纳斯达克 100 指数证券投资基金
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
报告期末基金份额总额	682,773,169.14 份
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的指数的有效跟踪，追求跟踪误差最小化。
投资策略	<p>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。</p> <p>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。</p>
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。

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	
下属分级基金的基金简称	大成纳斯达克 100 指数 A	大成纳斯达克 100 指数 C
下属分级基金的交易代码	000834	008971
报告期末下属分级基金的份 额总额	651,237,992.92 份	31,535,176.22 份
境外资产托管人	英文名称: The Bank of New York Mellon Corporation	
	中文名称: 纽约梅隆银行股份有限公司	

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标 (转型后)

单位: 人民币元

主要财务指标	报告期 (2023 年 9 月 1 日-2023 年 9 月 30 日)	
	大成纳斯达克 100ETF 联接 (QDII)A	大成纳斯达克 100ETF 联接 (QDII)C
1. 本期已实现收益	191,775,766.30	9,827,619.03
2. 本期利润	-120,775,535.49	-6,269,033.11
3. 加权平均基金份额本期利 润	-0.1822	-0.1864
4. 期末基金资产净值	2,405,284,309.69	118,157,377.51
5. 期末基金份额净值	3.587	3.585

注: 1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入 (不含公允价值变动收益) 扣除相关费用和信用减值损失后的余额, 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、所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 3.1 主要财务指标 (转型前)

单位: 人民币元

主要财务指标	报告期 (2023 年 7 月 1 日-2023 年 8 月 31 日)	
	大成纳斯达克 100 指数 A	大成纳斯达克 100 指数 C
1. 本期已实现收益	91,365,901.17	2,281,198.68
2. 本期利润	31,745,916.24	389,030.33
3. 加权平均基金份额本期利 润	0.0537	0.0270
4. 期末基金资产净值	2,454,285,814.30	118,811,243.93
5. 期末基金份额净值	3.769	3.768

注: 1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入 (不含公允价值变动收益) 扣

除相关费用和信用减值损失后的余额，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、所述基金业绩指标不包括持有人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（转型后）

#### 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

大成纳斯达克 100ETF 联接 (QDII) A

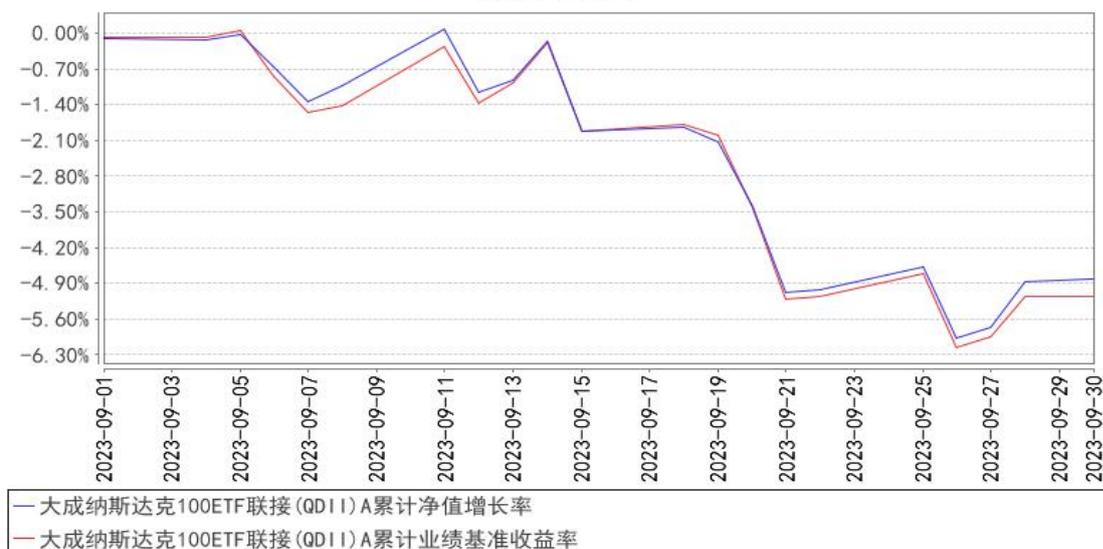
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效起至今	-4.83%	0.85%	-5.15%	0.88%	0.32%	-0.03%

大成纳斯达克 100ETF 联接 (QDII) C

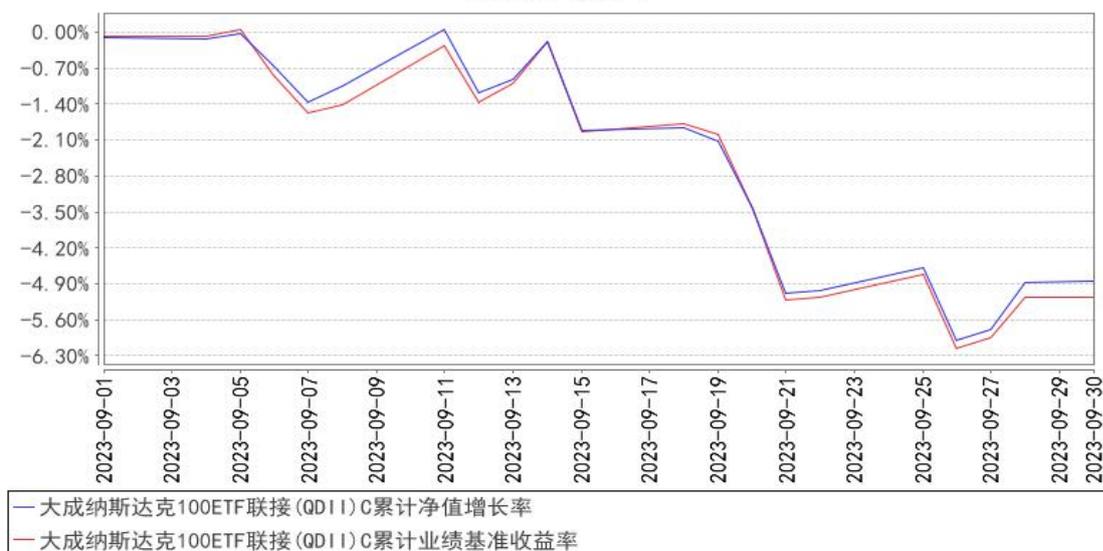
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效起至今	-4.86%	0.85%	-5.15%	0.88%	0.29%	-0.03%

#### 3.2.2 自基金转型以来基金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100ETF联接(QDII)A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



大成纳斯达克100ETF联接(QDII)C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、本基金合同生效日（暨基金转型日）为 2023 年 9 月 1 日，截止报告期末本基金合同生效未满一年。

2、本基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起六个月内为建仓期。截至报告期末，本基金处于建仓期。

3、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 基金净值表现（转型前）

#### 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

大成纳斯达克 100 指数 A

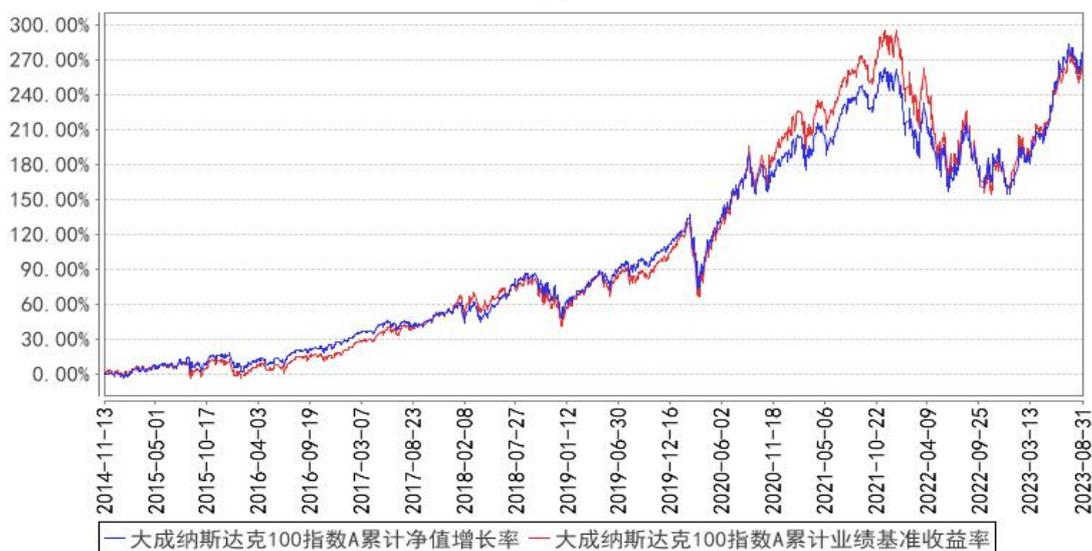
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	9.92%	1.00%	8.75%	1.03%	1.17%	-0.03%
过去六个月	32.06%	1.10%	28.72%	1.10%	3.34%	0.00%
过去一年	30.42%	1.46%	26.31%	1.47%	4.11%	-0.01%
过去三年	32.57%	1.54%	27.99%	1.53%	4.58%	0.01%
过去五年	102.74%	1.61%	102.51%	1.65%	0.23%	-0.04%
自基金合同生效起至今	276.90%	1.37%	269.48%	1.41%	7.42%	-0.04%

大成纳斯达克 100 指数 C

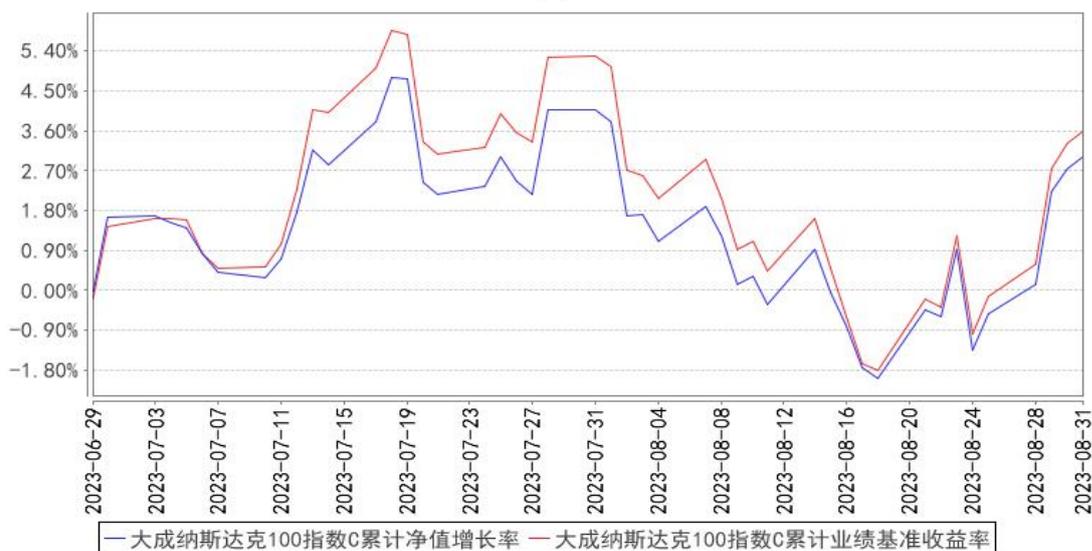
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效起至今	3.01%	0.98%	3.59%	1.03%	-0.58%	-0.05%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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A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



大成纳斯达克100指数C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、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。

3、本基金自2023年6月28日起增设C类基金份额类别，C类的净值增长率和业绩比较基准收益率自2023年6月29日有份额之日开始计算。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型后）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
冉凌浩	本基金基金经理	2014年11月13日	-	20年	英国曼彻斯特大学商学院金融学硕士。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，现任国际业务部基金经理。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日至2023年3月14日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。2021 年 9 月 9 日起任大成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基金经理。2023 年 7 月 12 日起任大成纳斯达克 100 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。

#### 4.1.1 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（转型后）

无。

#### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型前）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
冉凌浩	本基金基金经理	2014 年 11 月 13 日	-	20 年	英国曼彻斯特大学商学院金融学硕士。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，现任国际业务部基金经理。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 日至 2023 年 3 月 14 日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。2021 年 9 月 9 日起任大成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基金经理。2023 年 7 月 12 日起任大成纳斯达克 100 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。

**4.1.1 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（转型前）**  
无。

#### 4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行了公平交易的原则和制度。公司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、5 日内及 10 日内股票及债券交易同向交易价差进行分析，针对同一基金经理管理的多个投资组合及公私募兼任基金经理管理的多个投资组合的投资交易行为加强了公平交易监测与分析，包括对不同时间窗下（同日、3 日、5 日、10 日）反向交易和同向交易价差监控的分析。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投资策略差异、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，同时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。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。公司旗下投资组合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不存在同日反向交易。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。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

2023 年 3 季度，国际经济形势相对较为稳定，但美股出现了小幅调整。

从整体来看，3 季度美国宏观经济韧性较强，并未陷入经济衰退，最新公布的美国 2023 年 2 季度 GDP 环比增速折年率为 2.1%，不仅没有出现负增长，而且还位于正常增长水平区间。

分项来看，个人消费仍然是经济增长的重要支柱，国内私人投资总额也逐步出现回暖迹象。最新公布的美国 2 季度个人消费保持在较好的水平区间，仍然是 GDP 增长的重要支柱，同时按月公布的零售销售月环比数据也保持在正常的增长水平区间。较好的消费是由强劲的劳动力市场导致的，美国 9 月份失业率为 3.8%，持续保持在低位水平区间，同时工资增速也保持在较高的水平上。

受到相关政策法案的影响，美国制造业及建筑投资增速出现高增长，其主要贡献行业分别为计算机、电子电力设备和化工行业，显示出制造业回流美国的速度不断增大。

3 季度，受能源价格上涨的影响，美国 CPI 增速略有反弹，美国 9 月份 CPI 同比为 3.7%，较本轮高点有大幅下降，但较 6 月份有所反弹。美国工资增速虽然有限下降，但仍然保持在高位，这对核心通胀的进一步下降形成了阻碍。

3 季度，美联储采取了一次加息行为，将联邦基金目标利率区间上调到 5.25%至 5.5%区间。本轮加息周期已经接近尾声，当前市场预计今年还有一次加息就会停止加息进程，但由于核心通胀居高不下，降息可能要等至明年下半年。

今年上半年美股出现了大幅上涨，因此虽然 3 季度美国宏观经济状况较好，但是美股仍然出现了小幅调整。当前，指数成份股中多数核心企业经营情况稳定，盈利水平持续提升，但纳斯达克 100 指数估值水平略高于历史平均水平。如果美国经济能实现软着陆，则美股中长期前景依然可期。

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。

截至转型后报告期末，本报告期（2023 年 9 月 1 日-2023 年 9 月 31 日）本基金 A 类份额净值增长率为-4.83%，同期业绩基准增长率为-5.15%；C 类份额净值增长率为-4.86%，同期业绩基准增长率为-5.15%。

截至转型前报告期末，本报告期（2023 年 07 月 01 日-2023 年 08 月 31 日）本基金 A 类份额净值增长率为 1.37%，同期业绩基准增长率为 2.12%；C 类份额净值增长率为 1.34%，同期业绩基准增长率为 2.12%。

#### 4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

### § 5 投资组合报告 (转型后)

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额 (人民币元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,187,387,129.07	46.03
	其中: 普通股	1,187,387,129.07	46.03
	优先股	-	-
	存托凭证	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	847,956,600.00	32.87
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	465,400,529.03	18.04
8	其他资产	79,097,897.96	3.07
9	合计	2,579,842,156.06	100.00

#### 5.2 报告期末在各个国家 (地区) 证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家 (地区)	公允价值 (人民币元)	占基金资产净值比例 (%)
美国	1,187,387,129.07	47.05
合计	1,187,387,129.07	47.05

#### 5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

##### 5.3.1 报告期末指数投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值 (人民币元)	占基金资产净值比例 (%)
通讯	207,406,193.07	8.22
非必需消费品	154,706,810.22	6.13
必需消费品	78,408,157.54	3.11

能源	8,206,421.94	0.33
金融	-	-
房地产	-	-
医疗保健	84,583,658.75	3.35
工业	36,400,658.15	1.44
材料	-	-
科技	602,956,208.76	23.89
公用事业	14,719,020.64	0.58
政府	-	-
合计	1,187,387,129.07	47.05

注：以上分类采用彭博行业分类标准。

### 5.3.2 报告期末积极投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

无。

### 5.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细

#### 5.4.1 报告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前十名股票及存托凭证投资明细

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代 码	所在证 券市场	所属 国家 (地 区)	数量 (股)	公允价值 (人 民币元)	占基金 资产净 值比例 (%)
1	APPLE INC	苹果公司	AAPL US	纳斯达 克证 券交 易所	美国	104,518	128,479,123.38	5.09
2	MICROSOFT CORP	微软公司	MSFT US	纳斯达 克证 券交 易所	美国	49,669	112,600,708.27	4.46
3	AMAZON.COM INC	亚马逊公 司	AMZN US	纳斯达 克证 券交 易所	美国	68,976	62,954,131.44	2.49
4	NVIDIA CORP	英伟达	NVDA US	纳斯达 克证 券交 易所	美国	16,512	51,569,307.53	2.04
5	META PLATFORMS INC-CLASS A	Meta 平台 股份有限 公司	META US	纳斯达 克证 券交 易所	美国	20,827	44,891,510.46	1.78
6	TESLA INC	特斯拉公 司	TSLA US	纳斯达 克证 券交 易所	美国	21,218	38,118,764.12	1.51
7	ALPHABET	Alphabet	GOOGL	纳斯达	美国	39,66	37,265,317.2	1.48

	INC-CL A	公司	US	克证券 交易所		3	3	
8	ALPHABET INC-CL C	Alphabet 公司	GOOG US	纳斯 达克 证券 交易所	美国	38,78 1	36,712,290.7 7	1.45
9	BROADCOM INC	博通股份 有限公司	AVGO US	纳斯 达克 证券 交易所	美国	5,916	35,279,464.2 5	1.40
10	COSTCO WHOLESALE CORP	开市客	COST US	纳斯 达克 证券 交易所	美国	6,358	25,789,954.1 8	1.02

#### 5.4.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票及存托凭证投资明细

无。

#### 5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

无。

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

无。

#### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

无。

#### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	期货品种_股指	NQ2312	-	-

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：NQ2312 买入持仓量 200.00 手，合约市值人民币 426,953,986.80 元。公允价值变动人民币-20,953,025.73 元。

#### 5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值 (人民币元)	占基金资产净值比例 (%)
1	大成纳斯达克 100ETF (QDII)	QDII 类	交易型开放式 (ETF)	大成基金管理有限公司	847,956,600.00	33.60

## 5.10 投资组合报告附注

### 5.10.1 本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。

### 5.10.2 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。

### 5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额 (人民币元)
1	存出保证金	33,170,676.00
2	应收证券清算款	20,430,015.15
3	应收股利	274,109.91
4	应收利息	-
5	应收申购款	25,100,160.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	122,936.87
8	其他	-
9	合计	79,097,897.96

### 5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

### 5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 5.10.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

#### 5.10.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

### 5.10.6 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。

## § 5 投资组合报告（转型前）

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	2,041,094,863.99	78.62
	其中：普通股	2,041,094,863.99	78.62
	优先股	-	-
	存托凭证	-	-
	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	471,145,164.88	18.15
8	其他资产	83,881,246.97	3.23
9	合计	2,596,121,275.84	100.00

### 5.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家（地区）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
美国	2,041,094,863.99	79.32
合计	2,041,094,863.99	79.32

### 5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

#### 5.3.1 报告期末指数投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
非必需消费品	265,875,969.54	10.33
通讯	349,331,749.44	13.58
必需消费品	131,158,731.96	5.10

能源	13,653,606.82	0.53
金融	-	-
医疗保健	142,378,675.47	5.53
工业	60,424,251.23	2.35
材料	-	-
科技	1,053,885,262.13	40.96
公用事业	24,386,617.40	0.95
政府	-	-
合计	2,041,094,863.99	79.32

注：以上分类采用彭博行业分类标准。

### 5.3.2 报告期末积极投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

无。

### 5.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细

#### 5.4.1 报告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前十名股票及存托凭证投资明细

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代 码	所在证 券市场	所属 国家 (地 区)	数量 (股)	公允价值 (人 民币元)	占基金 资产净 值比例 (%)
1	APPLE INC	苹果公司	AAPL US	纳斯达 克证券 交易所	美国	171,1 90	230,954,698. 47	8.98
2	MICROSOFT CORP	微软公司	MSFT US	纳斯达 克证券 交易所	美国	80,92 6	190,473,692. 09	7.40
3	AMAZON.CO M INC	亚马逊公 司	AMZN US	纳斯达 克证券 交易所	美国	111,6 73	110,675,046. 63	4.30
4	NVIDIA CORP	英伟达	NVDA US	纳斯达 克证券 交易所	美国	26,88 3	95,279,586.3 0	3.70
5	META PLATFORMS INC-CLASS A	Meta 平台 股份有限 公司	META US	纳斯达 克证券 交易所	美国	33,74 9	71,710,404.3 5	2.79
6	BROADCOM INC	博通股份 有限公司	AVGO US	纳斯达 克证券 交易所	美国	9,731	64,490,892.5 0	2.51
7	TESLA INC	特斯拉公 司	TSLA US	纳斯达 克证券 交易所	美国	34,49 6	63,931,377.7 4	2.48

				交易所				
8	ALPHABET INC-CL A	Alphabet 公司	GOOGL US	纳斯达克 证券 交易所	美国	64,66 1	63,228,783.8 7	2.46
9	ALPHABET INC-CL C	Alphabet 公司	GOOG US	纳斯达克 证券 交易所	美国	63,93 3	63,058,657.7 3	2.45
10	ADOBE INC	奥多比	ADBE US	纳斯达克 证券 交易所	美国	10,70 6	43,002,538.3 3	1.67

#### 5.4.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票及存托凭证投资明细

无。

#### 5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

无。

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

无。

#### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

无。

#### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	期货品种_股指	NQ2309	-	-

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：NQ2312 买入持仓量 205.00 手，合约市值人民币 457,492,441.63 元。公允价值变动人民币 4,484,691.38 元。

#### 5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

无。

## 5.10 投资组合报告附注

### 5.10.1 本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。

### 5.10.2 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。

### 5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（人民币元）
1	存出保证金	34,006,099.05
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	1,690,115.47
4	应收利息	-
5	应收申购款	48,021,989.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	163,043.08
8	其他	-
9	合计	83,881,246.97

### 5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

### 5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 5.10.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

#### 5.10.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

### 5.10.6 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。

## § 6 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

项目	大成纳斯达克 100ETF 联接 (QDII)A	大成纳斯达克 100ETF 联接 (QDII)C

基金合同生效日(2023年9月1日)基金份额总额	651,237,992.92	31,535,176.22
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	55,987,247.54	14,502,659.95
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	36,703,371.88	13,081,862.23
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	670,521,868.58	32,955,973.94

## § 6 开放式基金份额变动(转型前)

单位:份

项目	大成纳斯达克 100 指数 A	大成纳斯达克 100 指数 C
报告期期初基金份额总额	532,080,655.83	2,741.93
报告期期间基金总申购份额	237,924,915.36	43,222,146.68
减:报告期期间基金总赎回份额	118,767,578.27	11,689,712.39
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	651,237,992.92	31,535,176.22

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细(转型后)

无。

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细(转型前)

无。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 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。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 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、中国证监会批准设立大成纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (QDII)

的文件；

- 3、《大成纳斯达克 100 指数证券投资基金基金合同》；
- 4、《大成纳斯达克 100 指数证券投资基金托管协议》；
- 5、《大成纳斯达克 100 指数证券投资基金招募说明书》；
- 6、《大成纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（QDII）基金合同》；
- 7、《大成纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（QDII）托管协议》；
- 8、《大成纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（QDII）招募说明书》；
- 9、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；
- 10、本报告期内在规定报刊上披露的各种公告原稿。

## 9.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

## 9.3 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

2023 年 10 月 25 日