

博时纳斯达克 100 交易型开放式指数证券
投资基金（QDII）
2024 年中期报告
2024 年 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：二〇二四年八月三十日

§ 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 2024 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	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
§3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
§4 管理人报告	6
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	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	8
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	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	9
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	10
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	10
§5 托管人报告	10
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	10
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	10
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	10
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	11
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	12
6.3 净资产变动表	13
6.4 报表附注	14
§7 投资组合报告	29
7.1 期末基金资产组合情况	29
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	29
7.3 期末按行业分类的权益投资组合	30
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	30
7.5 报告期内股票投资组合的重大变动	37
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	38
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	38
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	38
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	38
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	39
7.11 投资组合报告附注	39
§8 基金份额持有人信息	40
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	40
8.2 期末上市基金前十名持有人	40
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	41
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	41

§ 9 开放式基金份额变动	41
§ 10 重大事件揭示	41
10.1 基金份额持有人大会决议	41
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	41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	41
10.4 基金投资策略的改变	41
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	41
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	42
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	42
10.8 其他重大事件	42
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	44
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	44
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	44
§ 12 备查文件目录	44
12.1 备查文件目录	44
12.2 存放地点	44
12.3 查阅方式	45

§ 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	纳指 100ETF
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	1,007,379,100.00 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 5 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 负责人	姓名	孙麒清	滕菲菲
	联系电话	0755-83169999	4006800000
	电子邮箱	service@bosera.com	tengfeifei@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	北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30

	区益田路5999号基金大厦21层	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	方合英

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 (2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	5,180,591.89
本期利润	177,877,097.65
加权平均基金份额本期利润	0.2287
本期加权平均净值利润率	15.68%
本期基金份额净值增长率	17.49%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	159,543,716.51
期末可供分配基金份额利润	0.1584
期末基金资产净值	1,586,987,675.82
期末基金份额净值	1.5754
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	57.54%

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。

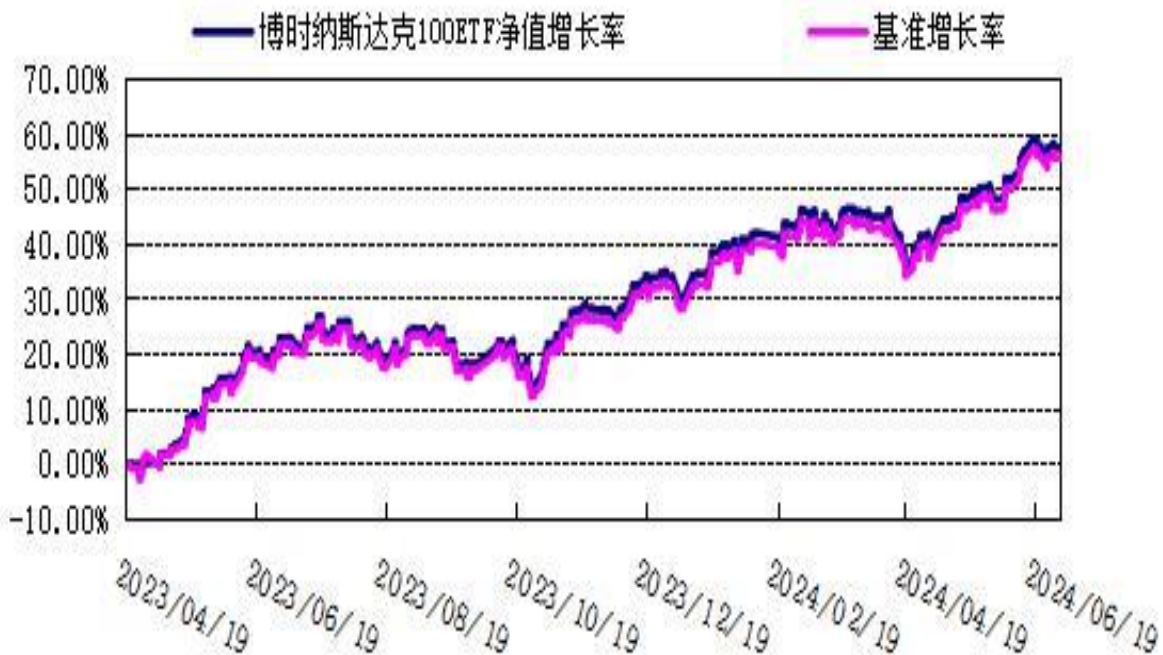
上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	6.35%	0.77%	6.45%	0.77%	-0.10%	0.00%
过去三个月	8.10%	0.99%	8.31%	0.99%	-0.21%	0.00%
过去六个月	17.49%	0.97%	17.71%	0.98%	-0.22%	-0.01%
过去一年	28.11%	0.98%	27.89%	0.98%	0.22%	0.00%
自基金合同生效起至今	57.54%	0.98%	55.71%	1.02%	1.83%	-0.04%

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。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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 2024 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理 385 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 16037 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 5965 亿元人民币，累计分红逾 2009 亿元人民币，是目前我国资产管理规模领先的基金公司之一。

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		
万琼	指数与量化投资部投资总监助理/基金经理	2023-04-19	-	17.3	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)、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-2023 年 9 月 25 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 日一至今)、博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (2015 年 10 月 8 日一至今)、博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 (2019 年 8 月 1 日一至今)、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(QDII)(2021年3月18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(2021年5月11日一至今)、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日一至今)、博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交易型开放式指数证券投资基金(QDII)(2023年4月19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发起式联接基金(QDII)(2023年9月26日一至今)的基金经理。
王萌	基金经理助理	2023-08-21	-	7.9	王萌先生, 博士。2016年毕业后加入博时基金管理有限公司。现任基金经理助理。

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 81 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

2024 年上半年，美国通胀持续回落，经济仍然稳健，在龙头科技公司的带领下美股继续创下新高。从经济基本面上来看，一季度 GDP 环比折合年率 1.4%，二季度 GDP 环比折合年率初值 2.8%。7 月标普制造业 PMI 超预期萎缩，但服务业 PMI 创新高。7 月密歇根大学消费者信心指数 66.4，和预期及前值基本一致。整体来看，美国经济依然具有韧性，增长稳步放缓，软着陆概率提升。通胀方面，通胀和核心通胀持续下行，核心 PCE 物价指数同比增速从 1 月的 2.9% 稳步下降至 6 月的 2.6%，为 2021 年 3 月以来最低。货币政策方面，上半年美联储暂停加息，同时放缓了缩表进度。指数表现来看，上半年标普 500 指数上涨 14.48%，纳斯达克 100 指数上涨 16.98%，均创下历史新高。

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。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 06 月 30 日，本基金基金份额净值为 1.5754 元，份额累计净值为 1.5754 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为 17.49%，同期业绩基准增长率 17.71%。

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 2024 年下半年，美国经济软着陆概率提升。经济方面，消费仍具韧性，融资成本的下行将有助于总体投资小幅修复。通胀或将在三季度持续回落，为降息提供窗口。而降息传导的经济修复、四季度的大选和通胀翘尾都可能会给后续美联储的货币政策带来扰动。货币政策方面，从 CME 隐含利率预期看 9 月大概率将开始降息，同时 6 月美联储已经开始放缓缩表。整体来看，目前受到降息预期、大选预期、科技公司财报盈利指引等各种因素的干扰，市场会加大波动。投资者短期需警惕指数震荡回调风险。而长期在经济增长稳定、科技股盈利驱动上涨的背景下，美股仍具配置价值。

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 2024 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 2024 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：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
资产：			
货币资金	6.4.3.1	50,562,055.47	13,676,170.04
结算备付金		16,770,942.55	2,584,484.31
存出保证金		3,510,597.54	303,380.37
交易性金融资产	6.4.3.2	1,517,551,984.23	432,415,035.59
其中：股票投资		1,517,551,984.23	432,415,035.59
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	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资	6.4.3.5	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		208,666.29	342,297.05
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	75,409.12	-
资产总计		1,588,679,655.20	449,321,367.36
负债和净资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		683,762.63	11,336,585.53
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		622,188.48	169,212.59
应付托管费		186,656.55	50,763.79
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-

应交税费		97,816.74	67,586.09
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.7	101,554.98	51,041.10
负债合计		1,691,979.38	11,675,189.10
净资产：		-	-
实收基金	6.4.3.8	1,007,379,100.00	326,379,100.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.3.9	579,608,575.82	111,267,078.26
净资产合计		1,586,987,675.82	437,646,178.26
负债和净资产总计		1,588,679,655.20	449,321,367.36

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.5754 元，基金份额总额 1,007,379,100.00 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年1月1日至2024 年6月30日	上年度可比期间 2023年4月19日（基金合同生 效日）至2023年6月30日
一、营业总收入		181,705,189.40	22,280,561.75
1. 利息收入		49,390.62	12,224.24
其中：存款利息收入	6.4.3.10	49,390.62	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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		9,235,837.85	9,617,476.08
其中：股票投资收益	6.4.3.11	549,760.51	8,898,555.84
基金投资收益	6.4.3.12	-	-
债券投资收益	6.4.3.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.3.14	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.3.15	4,606,709.84	577,754.95
股利收益	6.4.3.16	4,079,367.50	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）	6.4.3.17	172,696,505.76	11,527,757.50
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-14,281,054.52	1,087,468.54
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.18	14,004,509.69	35,635.39
减：二、营业总支出		3,828,091.75	229,458.15

1. 管理人报酬		2,798,425.55	135,931.04
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费		839,527.67	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	6.4.3.19	-	-
7. 税金及附加		16,608.42	2,081.13
8. 其他费用	6.4.3.20	173,530.11	50,666.67
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		177,877,097.65	22,051,103.60
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		177,877,097.65	22,051,103.60
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		177,877,097.65	22,051,103.60

6.3 净资产变动表

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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	326,379,100.00	-	111,267,078.26	437,646,178.26
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	326,379,100.00	-	111,267,078.26	437,646,178.26
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	681,000,000.00	-	468,341,497.56	1,149,341,497.56
（一）、综合收益总额	-	-	177,877,097.65	177,877,097.65
（二）、本期基金份额 交易产生的净资产 变动数（净资产减少以“-”号填列）	681,000,000.00	-	290,464,399.91	971,464,399.91
其中：1. 基金申购款	732,000,000.00	-	311,259,830.47	1,043,259,830.47
2. 基金赎回款	-51,000,000.00	-	-20,795,430.56	-71,795,430.56
（三）、本期向基金份额 持有人分配利	-	-	-	-

润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）				
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	1,007,379,100.00	-	579,608,575.82	1,586,987,675.82
项目	上年度可比期间 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	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	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净资产变动数（净资产减少以“-”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净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	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：王德英，会计机构负责人：陈子成

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[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。

6.4.3 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
----	-------------------

活期存款	50,562,055.47
等于：本金	50,559,948.01
加：应计利息	2,107.46
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	50,562,055.47

注：于 2024 年 06 月 30 日，银行存款中包含的外币余额为：美元 1,376,458.37 (折合人民币 9,809,743.51)。

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	1,302,891,814.80	-	1,517,551,984.23	214,660,169.43
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	1,302,891,814.80	-	1,517,551,984.23	214,660,169.43

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

6.4.3.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024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	65,727,625.68	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	65,727,625.68	-	-	-

6.4.3.3.2 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
NQU4	NASDAQ 100 E-MINI Sep24	23.00	65,328,061.64	-399,564.04
合计	-	-	-	-399,564.04
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	-399,564.04
净额	-	-	-	-

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

6.4.3.4 买入返售金融资产

6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.3.5 其他权益工具投资

6.4.3.5.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.3.5.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.3.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	75,409.12
合计	75,409.12

6.4.3.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-

应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	101,554.98
合计	101,554.98

6.4.3.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	326,379,100.00	326,379,100.00
本期申购	732,000,000.00	732,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-51,000,000.00	-51,000,000.00
本期末	1,007,379,100.00	1,007,379,100.00

注：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）。

6.4.3.9 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
上年度末	49,596,620.31	61,670,457.95	111,267,078.26
本期期初	49,596,620.31	61,670,457.95	111,267,078.26
本期利润	5,180,591.89	172,696,505.76	177,877,097.65
本期基金份额交易产生的变动数	104,766,504.31	185,697,895.60	290,464,399.91
其中：基金申购款	112,613,053.47	198,646,777.00	311,259,830.47
基金赎回款	-7,846,549.16	-12,948,881.40	-20,795,430.56
本期已分配利润	-	-	-
本期末	159,543,716.51	420,064,859.31	579,608,575.82

6.4.3.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	活期存款利息收入	49,390.62
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	49,390.62	

6.4.3.11 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	卖出股票成交总额	14,081,603.08
减：卖出股票成本总额	13,344,482.13	

减：交易费用	187,360.44
买卖股票差价收入	549,760.51

6.4.3.12 基金投资收益

无发生额。

6.4.3.13 债券投资收益

6.4.3.13.1 债券投资收益项目构成

无发生额。

6.4.3.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无发生额。

6.4.3.14 资产支持证券投资收益

6.4.3.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

无发生额。

6.4.3.14.2 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。

6.4.3.15 衍生工具收益

6.4.3.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无发生额。

6.4.3.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
期货投资收益	4,745,113.27
减：增值税抵减	-138,403.43
合计	4,606,709.84

6.4.3.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	4,079,367.50
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	4,079,367.50

6.4.3.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	173,258,515.07
——股票投资	173,258,515.07
——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	-562,009.31
——权证投资	-
——期货投资	-562,009.31
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	172,696,505.76

6.4.3.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	14,004,548.74
其它收入	-39.05
合计	14,004,509.69

6.4.3.19 信用减值损失

无发生额。

6.4.3.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	18,897.06
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
中登结算服务费	74,590.88
银行汇划费用	10,425.35
IOPV 计算与发布费	9,944.48
合计	173,530.11

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

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

6.4.4.2 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。

6.4.5 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。

6.4.5.2 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
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

6.4.6 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

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 2024年1月1日至2024年6月 30日	上年度可比期间 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	2,798,425.55	135,931.04
其中：应支付销售机构的客户维护费	29,808.88	4,698.71
应支付基金管理人的净管理费	2,768,616.67	131,232.33

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。

由于基金管理人不得对基金财产中持有的自身管理的基金部分收取管理费，但客户维护费的收取标准并不调减，可能出现净管理费为负值的情况。

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月 30日	上年度可比期间 2023年4月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	839,527.67	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。

6.4.6.3 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金 份额占基金 总份额的比 例	持有的 基金份额	持有的基金份额占基 金总份额的比例
招商证券	1,737,590.00	0.17%	3,473,090.00	1.06%
中信银行股份有限公司—博时纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接	756,320,529.00	75.08%	256,700,000.00	78.65%

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。

6.4.6.6 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 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	期末余额	当期利息收入
中信银行	40,752,311.96	49,390.62	3,062,552.48	12,224.24
布朗兄弟哈里曼银行	9,809,743.51	-	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。

6.4.6.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.7 利润分配情况

无。

6.4.8 期末（2024 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。

6.4.9.2 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。

6.4.9.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.9.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.9.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.9.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.9.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.9.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

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。

6.4.9.3.1 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。

6.4.9.4 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。

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	40,752,311.96	-	-	9,809,743.51	50,562,055.47
结算备付金	-	-	-	16,770,942.55	16,770,942.55
存出保证金	-	-	-	3,510,597.54	3,510,597.54
交易性金融资产	-	-	-	1,517,551,984.23	1,517,551,984.23
应收清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	208,666.29	208,666.29
其他资产	-	-	-	75,409.12	75,409.12
资产总计	40,752,311.96	-	-	1,547,927,343.24	1,588,679,655.20
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	683,762.63	683,762.63
应付管理人报酬	-	-	-	622,188.48	622,188.48
应付托管费	-	-	-	186,656.55	186,656.55
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	97,816.74	97,816.74
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	101,554.98	101,554.98
负债总计	-	-	-	1,691,979.38	1,691,979.38
利率敏感度缺口	40,752,311.96	-	-	1,546,235,363.86	1,586,987,675.82
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					

货币资金	1,516,721.78	-	-	12,159,448.26	13,676,170.04
结算备付金	-	-	-	2,584,484.31	2,584,484.31
存出保证金	-	-	-	303,380.37	303,380.37
交易性金融资产	-	-	-	432,415,035.59	432,415,035.59
应收清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	342,297.05	342,297.05
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,516,721.78	-	-	447,804,645.58	449,321,367.36
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	11,336,585.53	11,336,585.53
应付管理人报酬	-	-	-	169,212.59	169,212.59
应付托管费	-	-	-	50,763.79	50,763.79
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	67,586.09	67,586.09
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	51,041.10	51,041.10
负债总计	-	-	-	11,675,189.10	11,675,189.10
利率敏感度缺口	1,516,721.78	0.00	0.00	436,129,456.48	437,646,178.26

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。

6.4.9.4.1.2 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（上期：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，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 2024年6月30日	
	美元 折合人民币	合计
以外币计价的资产		
货币资金	9,809,743.51	9,809,743.51
结算备付金	16,770,942.55	16,770,942.55
存出保证金	3,510,597.54	3,510,597.54
交易性金融资产	1,517,551,984.23	1,517,551,984.23
应收股利	208,666.29	208,666.29
应收证券清算款	-	-
应收申购款	-	-
应收利息	-	-
其他资产	-	-
资产合计	1,547,851,934.12	1,547,851,934.12

以外币计价的负债		
应付赎回款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付利息	-	-
其他负债	-	-
负债合计	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	1,547,851,934.12	1,547,851,934.12
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	美元 折合人民币	合计
以外币计价的资产		
货币资金	12,159,448.26	12,159,448.26
结算备付金	2,584,484.31	2,584,484.31
存出保证金	303,380.37	303,380.37
交易性金融资产	432,415,035.59	432,415,035.59
应收股利	342,297.05	342,297.05
应收证券清算款	-	-
应收申购款	-	-
应收利息	-	-
其他资产	-	-
资产合计	447,804,645.58	447,804,645.58
以外币计价的负债		
应付赎回款	-	-
应付证券清算款	10,044,714.53	10,044,714.53
应付利息	-	-
其他负债	-	-
负债合计	10,044,714.53	10,044,714.53
资产负债表外汇风险敞口净额	437,759,931.05	437,759,931.05

6.4.9.4.2.2 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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	所有外币均相对人民币升值 5%	增加约 7,739	增加约 2,189
	所有外币均相对人民币贬值 5%	减少约 7,739	减少约 2,189

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。

6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,517,551,984.23	95.62	432,415,035.59	98.80
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	1,517,551,984.23	95.62	432,415,035.59	98.80

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		
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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 7,818	增加约 2,156
业绩比较基准下降 5%	减少约 7,818	减少约 2,156	

6.4.10 公允价值

6.4.10.1 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。

6.4.10.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.10.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年6月30日
第一层次	1,517,551,984.23
第二层次	-
第三层次	-
合计	1,517,551,984.23

6.4.10.2.2 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。

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 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。

6.4.11 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	1,517,551,984.23	95.52
	其中：普通股	1,492,393,745.94	93.94
	存托凭证	25,158,238.29	1.58
	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	67,332,998.02	4.24
8	其他各项资产	3,794,672.95	0.24
9	合计	1,588,679,655.20	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	1,517,551,984.23	95.62
合计	1,517,551,984.23	95.62

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	7,222,178.04	0.46
公用事业	17,712,582.12	1.12
房地产	3,088,915.05	0.19
原材料	21,512,773.11	1.36
工业	64,739,119.57	4.08
非日常生活消费品	190,500,337.90	12.00
日常消费品	91,291,855.38	5.75
医疗保健	92,593,184.34	5.83
金融	6,190,702.45	0.39
信息技术	786,820,950.85	49.58
电信业务	235,879,385.42	14.86
合计	1,517,551,984.23	95.62

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	MICROSOFT CORP	MSFT US	纳斯达克交易所	美国	41,178.00	131,165,241.20	8.27
2	APPLE INC	APPLE INC	AAPL US	纳斯达克交易所	美国	84,956.00	127,522,916.31	8.04
3	NVIDIA CORP	NVIDIA CORP	NVDA US	纳斯达克交易所	美国	136,283.00	119,989,668.49	7.56
4	ALPHABET INC	ALPHABET INC-CL A	GOOGL US	纳斯达克交易所	美国	32,544.00	42,246,883.60	2.66
4	ALPHABET INC	ALPHABET INC-CL C	GOOG US	纳斯达克交易所	美国	31,120.00	40,679,991.05	2.56
5	AMAZON.COM INC	AMAZON.COM INC	AMZN US	纳斯达克交易所	美国	57,656.00	79,406,962.39	5.00
6	BROADCOM INC	BROADCOM INC	AVGO US	纳斯达克交易所	美国	6,632.00	75,885,275.26	4.78
7	META PLATFORMS INC-CLASS A	META PLATFORMS INC-CLASS A	META US	纳斯达克交易所	美国	19,316.00	69,411,564.95	4.37

8	COSTCO WHOLESALE CORP	COSTCO WHOLESALE CORP	COST US	纳斯达 克交易 所	美国	6,347.00	38,448,277.32	2.42
9	TESLA INC	TESLA INC	TSLA US	纳斯达 克交易 所	美国	26,746.00	37,718,578.17	2.38
10	NETFLIX INC	NETFLIX INC	NFLX US	纳斯达 克交易 所	美国	6,167.00	29,661,634.41	1.87
11	ADVANCED MICRO DEVICES	ADVANCED MICRO DEVICES	AMD US	纳斯达 克交易 所	美国	23,130.00	26,739,164.21	1.68
12	ADOBE INC	ADOBE INC	ADBE US	纳斯达 克交易 所	美国	6,411.00	25,382,575.27	1.60
13	PEPSICO INC	PEPSICO INC	PEP US	纳斯达 克交易 所	美国	19,673.00	23,124,099.12	1.46
14	QUALCOMM INC	QUALCOMM INC	QCOM US	纳斯达 克交易 所	美国	15,970.00	22,669,670.90	1.43
15	LINDE PLC	LINDE PLC	LIN US	纳斯达 克交易 所	美国	6,879.00	21,512,773.11	1.36
16	T-MOBILE US INC	T-MOBILE US INC	TMUS US	纳斯达 克交易 所	美国	16,770.00	21,056,405.69	1.33
17	APPLIED MATERIALS INC	APPLIED MATERIALS INC	AMAT US	纳斯达 克交易 所	美国	11,849.00	19,928,282.50	1.26
18	CISCO SYSTEMS INC	CISCO SYSTEMS INC	CSCO US	纳斯达 克交易 所	美国	57,652.00	19,520,636.74	1.23
19	INTUIT INC	INTUIT INC	INTU US	纳斯达 克交易 所	美国	4,001.00	18,739,900.72	1.18
20	TEXAS INSTRUMENTS INC	TEXAS INSTRUMENTS INC	TXN US	纳斯达 克交易 所	美国	13,029.00	18,063,098.17	1.14
21	AMGEN INC	AMGEN INC	AMGN US	纳斯达 克交易 所	美国	7,677.00	17,094,903.00	1.08
22	INTUITIVE SURGICAL INC	INTUITIVE SURGICAL INC	ISRG US	纳斯达 克交易 所	美国	5,076.00	16,092,732.03	1.01
23	COMCAST CORP-CLASS A	COMCAST CORP-CLASS A	CMCSA US	纳斯达 克交易 所	美国	56,012.00	15,632,136.35	0.99
24	MICRON	MICRON	MU US	纳斯达	美国	15,847.00	14,854,787.70	0.94

	TECHNOLOGY INC	TECHNOLOGY INC		克交易所				
25	LAM RESEARCH CORP	LAM RESEARCH CORP	LRCX US	纳斯达克交易所	美国	1,871.00	14,198,968.45	0.89
26	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	HON US	纳斯达克交易所	美国	9,319.00	14,182,184.19	0.89
27	BOOKING HOLDINGS INC	BOOKING HOLDINGS INC	BKNG US	纳斯达克交易所	美国	486.00	13,721,149.65	0.86
28	INTEL CORP	INTEL CORP	INTC US	纳斯达克交易所	美国	60,917.00	13,445,417.25	0.85
29	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	VRTX US	纳斯达克交易所	美国	3,693.00	12,336,369.36	0.78
30	REGENERON PHARMACEUTICALS	REGENERON PHARMACEUTICALS	REGN US	纳斯达克交易所	美国	1,551.00	11,617,735.42	0.73
31	ANALOG DEVICES INC	ANALOG DEVICES INC	ADI US	纳斯达克交易所	美国	7,101.00	11,551,646.68	0.73
32	KLA CORP	KLA CORP	KLAC US	纳斯达克交易所	美国	1,927.00	11,323,279.13	0.71
33	PALO ALTO NETWORKS INC	PALO ALTO NETWORKS INC	PANW US	纳斯达克交易所	美国	4,634.00	11,196,005.67	0.71
34	AUTOMATIC DATA PROCESSING	AUTOMATIC DATA PROCESSING	ADP US	纳斯达克交易所	美国	5,857.00	9,963,318.64	0.63
35	ASML HOLDING NV-NY REG SHS	ASML HOLDING NV-NY REG SHS	ASML US	纳斯达克交易所	美国	1,303.00	9,497,296.19	0.60
36	SYNOPSYS INC	SYNOPSYS INC	SNPS US	纳斯达克交易所	美国	2,193.00	9,300,235.82	0.59
37	PDD HOLDINGS INC	PDD HOLDINGS INC	PDD US	纳斯达克交易所	美国	9,558.00	9,056,282.04	0.57
38	CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	CRWD US	纳斯达克交易所	美国	3,301.00	9,014,761.94	0.57

39	STARBUCK S CORP	STARBUCKS CORP	SBUX US	纳斯达 克交易 所	美国	16,209.00	8,993,099.75	0.57
40	MONDELEZ INTERNAT IONAL INC-A	MONDELEZ INTERNATI ONAL INC-A	MDLZ US	纳斯达 克交易 所	美国	19,195.00	8,952,121.72	0.56
41	GILEAD SCIENCES INC	GILEAD SCIENCES INC	GILD US	纳斯达 克交易 所	美国	17,828.00	8,717,352.67	0.55
42	CADENCE DESIGN SYS INC	CADENCE DESIGN SYS INC	CDNS US	纳斯达 克交易 所	美国	3,895.00	8,542,797.17	0.54
43	MERCADOL IBRE INC	MERCADOLI BRE INC	MELI US	纳斯达 克交易 所	美国	726.00	8,503,044.95	0.54
44	CINTAS CORP	CINTAS CORP	CTAS US	纳斯达 克交易 所	美国	1,452.00	7,246,370.03	0.46
45	MARRIOTT INTERNAT IONAL -CL A	MARRIOTT INTERNATI ONAL -CL A	MAR US	纳斯达 克交易 所	美国	4,088.00	7,043,813.83	0.44
46	NXP SEMICONDU CTORS NV	NXP SEMICONDU CTORS NV	NXPI US	纳斯达 克交易 所	美国	3,659.00	7,017,049.49	0.44
47	AIRBNB INC-CLAS S A	AIRBNB INC-CLASS A	ABNB US	纳斯达 克交易 所	美国	6,318.00	6,827,462.57	0.43
48	CSX CORP	CSX CORP	CSX US	纳斯达 克交易 所	美国	27,975.00	6,669,001.09	0.42
49	CONSTELL ATION ENERGY	CONSTELLA TION ENERGY	CEG US	纳斯达 克交易 所	美国	4,511.00	6,438,479.19	0.41
50	O' REILLY AUTOMOTI VE INC	O' REILLY AUTOMOTIV E INC	ORLY US	纳斯达 克交易 所	美国	843.00	6,344,694.85	0.40
51	PAYPAL HOLDINGS INC	PAYPAL HOLDINGS INC	PYPL US	纳斯达 克交易 所	美国	14,969.00	6,190,702.45	0.39
52	MARVELL TECHNOLO GY INC	MARVELL TECHNOLOG Y INC	MRVL US	纳斯达 克交易 所	美国	12,387.00	6,170,749.04	0.39
53	ROPER TECHNOLO GIES INC	ROPER TECHNOLOG IES INC	ROP US	纳斯达 克交易 所	美国	1,532.00	6,154,185.08	0.39
54	PACCAR INC	PACCAR INC	PCAR US	纳斯达 克交易 所	美国	7,501.00	5,502,979.57	0.35

55	AUTODESK INC	AUTODESK INC	ADSK US	纳斯达 克交易 所	美国	3,084.00	5,438,716.22	0.34
56	COPART INC	COPART INC	CPRT US	纳斯达 克交易 所	美国	13,771.00	5,315,433.70	0.33
57	MONSTER BEVERAGE CORP	MONSTER BEVERAGE CORP	MNST US	纳斯达 克交易 所	美国	14,907.00	5,306,648.42	0.33
58	MICROCHI P TECHNOLO GY INC	MICROCHIP TECHNOLOG Y INC	MCHP US	纳斯达 克交易 所	美国	7,683.00	5,010,101.20	0.32
59	ROSS STORES INC	ROSS STORES INC	ROST US	纳斯达 克交易 所	美国	4,799.00	4,970,163.90	0.31
60	WORKDAY INC-CLAS S A	WORKDAY INC-CLASS A	WDAY US	纳斯达 克交易 所	美国	3,034.00	4,833,973.32	0.30
61	AMERICAN ELECTRIC POWER	AMERICAN ELECTRIC POWER	AEP US	纳斯达 克交易 所	美国	7,544.00	4,717,304.18	0.30
62	FORTINET INC	FORTINET INC	FTNT US	纳斯达 克交易 所	美国	10,932.00	4,695,646.40	0.30
63	MODERNA INC	MODERNA INC	MRNA US	纳斯达 克交易 所	美国	5,485.00	4,641,996.64	0.29
64	ASTRAZEN ECA PLC-SPON S ADR	ASTRAZENE CA PLC-SPONS ADR	AZN US	纳斯达 克交易 所	美国	8,333.00	4,631,640.83	0.29
65	KEURIG DR PEPPER INC	KEURIG DR PEPPER INC	KDP US	纳斯达 克交易 所	美国	19,399.00	4,617,643.29	0.29
66	DEXCOM INC	DEXCOM INC	DXCM US	纳斯达 克交易 所	美国	5,691.00	4,598,536.20	0.29
67	TRADE DESK INC/THE -CLASS A	TRADE DESK INC/THE -CLASS A	TTD US	纳斯达 克交易 所	美国	6,371.00	4,434,691.00	0.28
68	CHARTER COMMUNIC ATIONS INC-A	CHARTER COMMUNICA TIONS INC-A	CHTR US	纳斯达 克交易 所	美国	2,062.00	4,393,355.20	0.28
69	PAYCHEX INC	PAYCHEX INC	PAYX US	纳斯达 克交易 所	美国	5,152.00	4,353,199.96	0.27
70	DOORDASH	DOORDASH	DASH US	纳斯达	美国	5,462.00	4,234,433.55	0.27

	INC - A	INC - A		克交易所				
71	IDEXX LABORATORIES INC	IDEXX LABORATORIES INC	IDXX US	纳斯达克交易所	美国	1,182.00	4,104,113.17	0.26
72	DATADOG INC - CLASS A	DATADOG INC - CLASS A	DDOG US	纳斯达克交易所	美国	4,414.00	4,079,748.49	0.26
73	KRAFT HEINZ CO/THE	KRAFT HEINZ CO/THE	KHC US	纳斯达克交易所	美国	17,377.00	3,990,202.24	0.25
74	VERISK ANALYTICS INC	VERISK ANALYTICS INC	VRSK US	纳斯达克交易所	美国	2,042.00	3,922,741.10	0.25
75	OLD DOMINION FREIGHT LINE	OLD DOMINION FREIGHT LINE	ODFL US	纳斯达克交易所	美国	3,110.00	3,914,223.86	0.25
76	ELECTRONIC ARTS INC	ELECTRONIC ARTS INC	EA US	纳斯达克交易所	美国	3,812.00	3,785,228.49	0.24
77	LULULEMON ATHLETICA INC	LULULEMON ATHLETICA INC	LULU US	纳斯达克交易所	美国	1,729.00	3,680,652.25	0.23
78	FASTENAL CO	FASTENAL CO	FAST US	纳斯达克交易所	美国	8,194.00	3,669,667.43	0.23
79	DIAMONDBACK ENERGY INC	DIAMONDBACK ENERGY INC	FANG US	纳斯达克交易所	美国	2,553.00	3,642,401.08	0.23
80	GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	GEHC US	纳斯达克交易所	美国	6,532.00	3,627,351.91	0.23
81	BAKER HUGHES CO	BAKER HUGHES CO	BKR US	纳斯达克交易所	美国	14,282.00	3,579,776.96	0.23
82	EXELON CORP	EXELON CORP	EXC US	纳斯达克交易所	美国	14,311.00	3,529,930.48	0.22
83	COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	CTSH US	纳斯达克交易所	美国	7,115.00	3,448,088.38	0.22
84	BIOGEN INC	BIOGEN INC	BIIB US	纳斯达克交易所	美国	2,084.00	3,443,048.87	0.22

85	COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNER	COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNER	CCEP US	纳斯达克 交易所	美国	6,572.00	3,413,036.21	0.22
86	COSTAR GROUP INC	COSTAR GROUP INC	CSGP US	纳斯达克 交易所	美国	5,846.00	3,088,915.05	0.19
87	CDW CORP/DE	CDW CORP/DE	CDW US	纳斯达克 交易所	美国	1,924.00	3,069,285.84	0.19
88	XCEL ENERGY INC	XCEL ENERGY INC	XEL US	纳斯达克 交易所	美国	7,952.00	3,026,868.27	0.19
89	ON SEMICONDUCTOR	ON SEMICONDUCTOR	ON US	纳斯达克 交易所	美国	6,157.00	3,007,953.96	0.19
90	ZSCALER INC	ZSCALER INC	ZS US	纳斯达克 交易所	美国	2,145.00	2,938,005.84	0.19
91	ATLASSIAN CORP-CLASS A	ATLASSIAN CORP-CLASS A	TEAM US	纳斯达克 交易所	美国	2,280.00	2,874,141.52	0.18
92	ANSYS INC	ANSYS INC	ANSS US	纳斯达克 交易所	美国	1,250.00	2,864,082.75	0.18
93	GLOBALFOUNDRIES INC	GLOBALFOUNDRIES INC	GFS US	纳斯达克 交易所	美国	7,893.00	2,844,092.65	0.18
94	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	TTWO US	纳斯达克 交易所	美国	2,453.00	2,718,282.46	0.17
95	DOLLAR TREE INC	DOLLAR TREE INC	DLTR US	纳斯达克 交易所	美国	3,122.00	2,375,618.58	0.15
96	ARM HOLDINGS PLC-ADR	ARM HOLDINGS PLC-ADR	ARM US	纳斯达克 交易所	美国	1,692.00	1,973,019.23	0.12
97	MONGODB INC	MONGODB INC	MDB US	纳斯达克 交易所	美国	1,050.00	1,870,485.67	0.12
98	WARNER BROS DISCOVERY INC	WARNER BROS DISCOVERY INC	WBD US	纳斯达克 交易所	美国	35,064.00	1,859,212.22	0.12
99	ILLUMINA INC	ILLUMINA INC	ILMN US	纳斯达克 交易所	美国	2,214.00	1,646,984.38	0.10
100	WALGREEN	WALGREENS	WBA US	纳斯达	美国	12,346.00	1,064,208.48	0.07

	S BOOTS ALLIANCE INC	BOOTS ALLIANCE INC		克交易所				
101	GRAIL INC	GRAIL INC	GRAL US	纳斯达克交易所	美国	369.00	40,419.86	0.00

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	MICROSOFT CORP	MSFT US	79,819,928.20	18.24
2	APPLE INC	AAPL US	73,733,214.86	16.85
3	NVIDIA CORP	NVDA US	51,592,012.37	11.79
4	AMAZON.COM INC	AMZN US	46,637,673.34	10.66
5	ALPHABET INC	GOOGL US	22,998,763.28	5.26
		GOOG US	22,399,883.04	5.12
6	META PLATFORMS INC-CLASS A	META US	42,401,025.33	9.69
7	BROADCOM INC	AVGO US	40,256,229.48	9.20
8	TESLA INC	TSLA US	24,002,289.05	5.48
9	LINDE PLC	LIN US	22,586,725.42	5.16
10	COSTCO WHOLESALE CORP	COST US	21,788,455.91	4.98
11	ADVANCED MICRO DEVICES	AMD US	18,614,813.43	4.25
12	NETFLIX INC	NFLX US	16,927,861.26	3.87
13	ADOBE INC	ADBE US	16,639,709.31	3.80
14	PEPSICO INC	PEP US	15,700,312.12	3.59
15	CISCO SYSTEMS INC	CSCO US	13,470,429.83	3.08
16	T-MOBILE US INC	TMUS US	13,216,307.57	3.02
17	QUALCOMM INC	QCOM US	12,228,712.87	2.79
18	INTEL CORP	INTC US	12,138,555.76	2.77
19	INTUIT INC	INTU US	11,941,505.13	2.73
20	COMCAST CORP-CLASS A	CMCSA US	11,264,536.84	2.57
21	APPLIED MATERIALS INC	AMAT US	10,773,581.49	2.46
22	AMGEN INC	AMGN US	10,526,993.45	2.41
23	TEXAS INSTRUMENTS INC	TXN US	10,460,500.79	2.39
24	INTUITIVE SURGICAL INC	ISRG US	9,266,833.98	2.12
25	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	HON US	8,870,290.70	2.03

注：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	SPLUNK INC	SPLK US	2,054,970.41	0.47

2	NVIDIA CORP	NVDA US	1,522,969.53	0.35
3	APPLE INC	AAPL US	1,516,500.78	0.35
4	SIRIUS XM HOLDINGS INC	SIRI US	1,025,058.25	0.23
5	ALPHABET INC	GOOG US	636,890.86	0.15
		GOOGL US	264,165.37	0.06
6	META PLATFORMS INC-CLASS A	META US	808,055.18	0.18
7	BROADCOM INC	AVGO US	570,527.86	0.13
8	MICROSOFT CORP	MSFT US	482,576.70	0.11
9	COMCAST CORP-CLASS A	CMCSA US	388,227.42	0.09
10	NETFLIX INC	NFLX US	381,050.26	0.09
11	ADOBE INC	ADBE US	360,636.71	0.08
12	BOOKING HOLDINGS INC	BKNG US	277,030.49	0.06
13	T-MOBILE US INC	TMUS US	209,058.59	0.05
14	PAYPAL HOLDINGS INC	PYPL US	192,990.04	0.04
15	MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	MAR US	182,759.92	0.04
16	CISCO SYSTEMS INC	CSCO US	176,871.77	0.04
17	APPLIED MATERIALS INC	AMAT US	168,949.44	0.04
18	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	HON US	156,337.95	0.04
19	KEURIG DR PEPPER INC	KDP US	137,703.01	0.03
20	MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	MDLZ US	127,073.20	0.03

注：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	925,222,915.70
卖出收入（成交）总额	14,081,603.08

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 Sep24	-399,564.04	-0.03

注：金融衍生品投资项下的期货投资，在当日无负债结算制度下，结算备付金已包括所持期货合约产生的持仓损益，则金融衍生品投资项下的期货投资与相关的期货结算暂收款（结算所得的持仓损益）相抵消后的净额为 0，因此此处公允价值实为公允价值变动金。

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	3,510,597.54
2	应收清算款	-
3	应收股利	208,666.29
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	75,409.12
8	其他	-
9	合计	3,794,672.95

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		博时纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 (QDII)	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
4,922	204,668.65	91,541,453.00	9.09%	159,517,118.00	15.83%	756,320,529.00	75.08%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例
1	香港上海汇丰银行有限公司	30,100,000.00	2.99%
2	UBS AG	22,830,240.00	2.27%
3	陈健辉	13,525,300.00	1.34%
4	华润深国投信托有限公司—华润信托·东方港湾远见集合资金信托计划	8,166,700.00	0.81%
5	王翔	5,700,000.00	0.57%
6	杭州复投私募基金管理合伙企业 (有限合伙)—复投新享 1 号私募证券投资基金	5,000,000.00	0.50%
7	BARCLAYS BANK PLC	4,142,915.00	0.41%
8	上海卓恒私募基金管理有限公司—卓恒成长私募证券投资基金	4,000,000.00	0.40%
9	五矿国际信托有限公司—五矿信托—恒信日鑫 37 号—东方港湾 1 号集合资金信托计划	3,672,500.00	0.36%
10	张茸茸	2,942,800.00	0.29%
99	中信银行股份有限公司—博时纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接	756,320,529.00	75.08%

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
本报告期期初基金份额总额	326,379,100.00
本报告期基金总申购份额	732,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	51,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,007,379,100.00

§ 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 2024 年 4 月 13 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》，徐卫先生离任公司副总经理。

基金管理人于 2024 年 5 月 25 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》，张东先生任公司总经理。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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，托管人及其高级管理人员未受到稽查或处罚等情况。

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	-	937,249,548.69	100.00%	186,896.66	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；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

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期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) 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	2024-06-26

2	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	2024-06-18
3	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增民生证券为申购、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	2024-06-11
4	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增财通证券为申购、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	2024-06-06
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	2024-05-25
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	2024-05-24
7	博时基金管理有限公司关于终止北京中期时代基金销售有限公司办理旗下基金销售业务的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-05-15
8	博时基金管理有限公司关于与通联支付网络服务股份有限公司合作开通北京银行借记卡直销网上交易和费率优惠的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-04-29
9	博时基金管理有限公司关于与上海富友支付服务有限公司合作开通上海银行借记卡直销网上交易和费率优惠的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-04-29
10	博时纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 2024 年第 1 季度报告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-04-22
11	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	2024-04-13
12	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增信达证券为申购、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	2024-04-10
13	博时纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 2023 年年度报告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-03-29
14	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	2024-03-28
15	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增东海证券为申购、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	2024-02-23
16	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	2024-02-08
17	博时纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 2023 年第 4 季度报告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-01-22
18	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	2024-01-12

		网站	
19	博时纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 2024 年境外主要市场节假日暂停申购、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	2024-01-11

§ 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	2024-01-01~2024-06-30	256,700,000.00	562,620,529.00	63,000,000.00	756,320,529.00	75.08%
产品特有风险							
本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额20%的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。 在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，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。							

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、博时纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 各年度审计报告正本
- 6、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

二〇二四年八月三十日