

广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资 基金

2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年八月三十一日

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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 27 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 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人	6
2.5 信息披露方式	6
2.6 其他相关资料	6
3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
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	15
6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	19
7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	38
7.3 期末按行业分类的权益投资组合	39
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	39
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动	47
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	49
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	49
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	49
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	49
7.11 投资组合报告附注	49

8	基金份额持有人信息	50
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	51
9	开放式基金份额变动	51
10	重大事件揭示	51
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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	52
10.7	基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	52
10.8	其他重大事件	56
11	影响投资者决策的其他重要信息	58
12	备查文件目录	59
12.1	备查文件目录	59
12.2	存放地点	60
12.3	查阅方式	60

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	广发纳指 100ETF
场内简称	纳指 ETF 广发
基金主代码	159941
交易代码	159941
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015 年 6 月 10 日
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	22,485,110,164.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2015-07-13

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最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构成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进行相应调整。 正常情况下，本基金力求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。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。
业绩比较基准	汇率调整后的纳斯达克 100 指数（Nasdaq-100 Index）收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

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		广发基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	项军	许俊
	联系电话	020-83936666	010-66596688
	电子邮箱	xiangj@gffunds.com.cn	fxjd_hq@bank-of-china.com

客户服务电话	95105828	95566
传真	020-34281105	010-66594942
注册地址	广东省珠海市横琴新区环岛东路3018号2608室	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址	广东省广州市海珠区琶洲大道168号星河湾中心28-38层；广东省广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼；广东省珠海市横琴新区环岛东路3018号2603-2622室	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码	510308	100818
法定代表人	葛长伟	葛海蛟

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	-	BANK OF CHINA NEW YORK BRANCH
	中文	-	中国银行纽约分行
注册地址	-	-	1045 Avenue of Americas, New York, NY 10018
办公地址	-	-	1045 Avenue of Americas, New York, NY 10018
邮政编码	-	-	-

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.gffunds.com.cn
基金中期报告置备地点	广东省广州市海珠区琶洲大道168号星河湾中心28-38层；广东省广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

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（2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	605,902,098.47
本期利润	4,703,872,883.39
加权平均基金份额本期利润	0.2099
本期加权平均净值利润率	15.23%
本期基金份额净值增长率	15.72%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	11,030,843,954.18
期末可供分配基金份额利润	0.4906
期末基金资产净值	34,681,659,300.33
期末基金份额净值	1.5424
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	516.96%

注：（1）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

（2）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。

（3）期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

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
过去三个月	25.12%	1.52%	25.74%	1.52%	-0.62%	0.00%
过去六个月	15.72%	1.39%	16.58%	1.39%	-0.86%	0.00%
过去一年	26.22%	1.17%	27.86%	1.18%	-1.64%	-0.01%
过去三年	84.08%	1.29%	92.32%	1.29%	-8.24%	0.00%
过去五年	111.81%	1.43%	128.03%	1.44%	-16.22%	-0.01%
过去七年	261.66%	1.55%	313.80%	1.56%	-52.14%	-0.01%

过去十年	531.23%	1.44%	670.51%	1.43%	-139.28%	0.01%
自基金合同生效起至今	516.96%	1.42%	744.52%	1.42%	-227.56%	0.00%

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

广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2015 年 6 月 10 日至 2026 年 6 月 30 日)



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

经中国证监会证监基金字[2003]91 号文批准，本基金管理人于 2003 年 8 月 5 日成立。本基金管理人拥有公募基金管理、特定客户资产管理、基金投资顾问、社保基金境内投资管理人、基本养老保险基金证券投资管理机构、保险资金投资管理人、保险保障基金委托资产管理投资管理人、QDII、QDLP 等业务资格，旗下产品覆盖主动权益、固定收益、海外投资、被动投资、量化投资、FOF 投资、另类投资等类别，为境内外客户提供标准化和定制化的资产管理服务。

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		
刘杰	本基金的基金 经理；广发中 证 500 交易型 开放式指数证 券投资基金联 接基金(LOF) 的基金经理； 广发中证 500 交易型开放式 指数证券投资 基金的基金经 理；广发创业 板交易型开放 式指数证券投 资基金的基金 经理；广发创 业板交易型开 放式指数证券 投资基金发起 式联接基金的 基金经理；广 发纳斯达克 100 交易型开 放式指数证券 投资基金联接 基金（QDII） 的基金经理； 广发恒生科技 交易型开放式 指数证券投资 基金（QDII） 的基金经理； 广发中证香港 创新药交易型 开放式指数证 券投资基金 （QDII）的基 金经理；广发 全球医疗保健 指数证券投资	2018-08-06	-	22 年	刘杰先生，中国籍，工学 学士，持有中国证券投资 基金从业证书。曾任广 发基金管理有限公司信 息技术部系统开发专员、 数量投资部研究员、广发 沪深 300 指数证券投资基 金基金经理(自 2014 年 4 月 1 日至 2016 年 1 月 17 日)、广发中证环保产业指 数型发起式证券投资基 金基金经理(自 2016 年 1 月 25 日至 2018 年 4 月 25 日)、广发量化稳健混合型 证券投资基金基金经理 (自 2017 年 8 月 4 日至 2018 年 11 月 30 日)、广 发中小企业 300 交易型开 放式指数证券投资基金 联接基金基金经理(自 2016 年 1 月 25 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发中小 企业 300 交易型开放式指 数证券投资基金基金经 理(自 2016 年 1 月 25 日至 2019 年 11 月 14 日)、广 发中证养老产业指数型 发起式证券投资基金基 金经理(自 2016 年 1 月 25 日至 2019 年 11 月 14 日)、 广发中证军工交易型开 放式指数证券投资基金 基金经理(自 2016 年 8 月 30 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发中证军工交易型 开放式指数证券投资基 金发起式联接基金基 金经理(自 2016 年 9 月 26 日至 2019 年 11 月 14 日)、 广发中证环保产业交易

	基金的基金经理；广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金的基金经理；广发北证 50 成份指数型证券投资基金的基金经理；广发恒生消费交易型开放式指数证券投资基金(QDII)的基金经理；广发中证香港创新药交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(QDII)的基金经理；广发深证 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证红利交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发恒生消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(QDII)的基金经理；广发深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理；广发中证港股通汽车产业主题交易型开放式指数证券投资			型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2017 年 1 月 25 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发中证环保产业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(自 2018 年 4 月 26 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发标普全球农业指数证券投资基金基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2020 年 2 月 28 日)、广发粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(自 2020 年 5 月 21 日至 2021 年 7 月 2 日)、广发美国房地产指数证券投资基金基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2021 年 9 月 16 日)、广发全球医疗保健指数证券投资基金基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2021 年 9 月 16 日)、广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2021 年 9 月 16 日)、广发道琼斯美国石油开发与生产指数证券投资基金(QDII-LOF)基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2021 年 9 月 16 日)、广发粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2019 年 12 月 16 日至 2021 年 9 月 16 日)、广发中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2019 年 9 月 20 日至 2021 年 11 月 17 日)、广发中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金
--	--	--	--	---

	基金的基金经理；广发中证港股通汽车产业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理；指数投资部总经理助理				联接基金基金经理(自 2019 年 11 月 6 日至 2021 年 11 月 17 日)、广发纳斯达克 100 指数证券投资基金基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2022 年 3 月 31 日)、广发恒生中国企业精明指数型发起式证券投资基金(QDII)基金经理(自 2019 年 5 月 9 日至 2022 年 4 月 28 日)、广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015 年 8 月 20 日至 2023 年 2 月 22 日)、广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(自 2016 年 1 月 18 日至 2023 年 2 月 22 日)、广发恒生科技指数证券投资基金(QDII)基金经理(自 2021 年 8 月 11 日至 2023 年 3 月 7 日)、广发港股通恒生综合中型股指数证券投资基金(LOF)基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2023 年 12 月 13 日)、广发美国房地产指数证券投资基金基金经理(自 2022 年 11 月 16 日至 2023 年 12 月 13 日)、广发恒生科技交易型开放式指数证券投资基金联接基金(QDII)基金经理(自 2023 年 3 月 8 日至 2024 年 3 月 30 日)。
--	--	--	--	--	---

注：1.对基金的首任基金经理，“任职日期”为基金合同生效日/转型生效日，“离任日期”为公司公告解聘日期。对此后的非首任基金经理/基金经理助理，“任职日期”和“离任日期”分别指公司公告聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从中国证监会及行业协会相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内基金运作合法合规，无损害基金持有人利益的行为，基金的投资管理符合有关法规及基金合同的规定。

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

公司建立科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，通过持续完善工作制度、流程和提高技术手段保证公平交易原则的实现。同时，公司还通过事后分析、监察稽核和信息披露等手段加强对公平交易过程和结果的监督。在投资决策的内部控制方面，公司建立了严格的投资备选库制度及投资授权制度，投资组合的投资标的必须来源于公司备选库，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易过程中，按照“时间优先、价格优先、比例分配、平等对待”的原则，公平分配投资指令。公司对投资交易实施全程动态监控，通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控及预警，实现投资风险的事中风险控制；通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核，实现投资风险的事后控制。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，不同的投资组合受到了公平对待，未发生任何不公平的交易事项。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本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% 的交易共有 77 次，其中 76 次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，其余 1 次为不同投资经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，有关投资经理按规定履行了审批程序。

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

2026 年上半年，美股市场整体呈现先抑后扬的特征。第一季度，美股市场遭遇了近几年较为坎坷的开局，三大股指悉数录得显著跌幅，纳斯达克指数领跌。中东冲突是主导市场走势的最大变量，

冲突引发的油价暴涨（季度内涨幅超过 50%）彻底扭转了市场对通胀和美联储政策的预期，从年初普遍预期年内降息两次，转变为降息概率骤降至不足 2%。这种“滞胀”交易逻辑导致股市估值承压。行业板块方面，同样也表现出极端分化：能源板块成为最大亮点，能源相关指数季度涨幅明显，成为表现最佳的板块；而此前领涨的科技股和成长股则因对利率高度敏感而遭遇大幅抛售，软件、半导体等行业跌幅居前。整体来看，华尔街投资者情绪从年初的极度乐观迅速转向谨慎和防御，市场波动性急剧上升，所有资产表现均与油价走势和冲突进展高度挂钩。

第二季度，全球股市呈现出显著的分化格局。美股在多重扰动下逆势走强，尤其是 AI 相关及偏硬件细分板块表现较好，美股创下近些年较好的季度表现；二季度 AI 算力硬件需求持续回暖，带动个股暴涨，而国际原油价格持续回落缓解了通胀压力，改善了市场对美联储政策的预期，市场因此受益，并且美股市场整体企业盈利支撑较好，基本面为行情提供了扎实支撑，因此二季度美股在 AI 与半导体产业周期的共振下走出了强势行情。

本基金主要采用完全复制法来跟踪纳斯达克 100 指数，按照个股在标的指数中的基准权重加上纳指 100 期货等构建组合，呈现出股票型指数基金的特征。作为 ETF，本基金秉承指数化被动投资策略，积极应对成份股调整、基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击，降低基金的跟踪误差。报告期内，本基金跟踪误差来源主要是汇率波动、成份股调整、申购赎回和停牌股票估值调整等因素。

总体上看，美股中存在众多优秀公司，尤其是科技类公司，近两年的人工智能热潮大多数由此类科技公司推动，同时竞争格局以及领先优势让美股相关公司占领了先机，体现了科技公司的护城河效应。根据纳斯达克统计，参照现有的纳斯达克主题指数与其他相关主题指数的重合情况，纳斯达克 100 在诸多热点主题前沿领域保持暴露，包括人工智能、自动化、5G、云计算、未来出行、半导体、绿色经济、清洁能源等，纳斯达克 100 指数中有六成以上的公司在 34 个颠覆性科技领域至少储备 1 个或更多的专利，具备极强的创新性，通过配置纳斯达克 100 指数可以在一定程度上实现对市场热点主题细分龙头的一键配置。

美国市场依然是全世界最重要的金融市场之一，是全球化资产配置的重要目的地，纳斯达克 100 指数作为纳斯达克的主要指数，呈现了高科技、高成长和非金融的特点，是美国科技股指数的代表。而科技又是美国的核心竞争力之一，加上 AI 热度的持续，纳斯达克 100 指数中长期依然是值得投资者关注的指数之一。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金的份额净值增长率为 15.72%，同期业绩比较基准收益率为 16.58%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望美股市场的未来走势，美联储加息预期、地缘政治冲突和 AI 浪潮演进依然是重要影响因素，在 AI 全球竞争白热化的背景下，科技巨头的资本开支持续高企，市场焦点正从前期的“算力狂热”转向对投资回报率的严苛审视与价值分配的重新定价，这种预期切换虽引发了板块内部的剧烈分化与估值回撤，但也为具备真实盈利支撑的环节提供了布局良机，总体而言，美股主要指数中相关资产皆有所涉及，对散户而言，风险和收益相对均衡。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、资产管理产品相关会计处理规定、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。

本基金管理人设有估值委员会，负责制订健全、有效的估值政策和程序，定期对估值政策和程序的执行情况进行评价，确保基金估值的公平、合理。估值委员会配备投资、研究、会计和风控等岗位资深人员。为保证基金估值的客观独立，基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。

本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本报告期内，参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按合同约定提供相关投资品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同中“基金收益与分配”之“基金收益分配原则”的相关规定，本基金本报告期内未进行利润分配，符合合同规定。

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

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《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有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《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，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等财务数据真实、准确和完整。

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：广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	1,366,341,848.67	1,909,156,834.19
结算备付金		553,380,089.10	465,806,628.55

存出保证金		86,331,431.05	110,293,381.66
交易性金融资产	6.4.7.2	32,710,036,028.08	27,312,908,480.96
其中：股票投资		31,808,565,842.69	26,891,977,185.88
基金投资		589,537,725.55	420,931,295.08
债券投资		311,932,459.84	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		3,483,329.50	6,518,668.10
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	242,750.48	242,750.48
资产总计		34,719,815,476.88	29,804,926,743.94
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		2,665.94	80,590.46
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		22,409,344.30	20,464,774.77
应付托管费		5,602,336.06	5,116,193.67
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		9,403,926.39	3,199,164.87
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	737,903.86	1,011,457.25
负债合计		38,156,176.55	29,872,181.02
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	5,621,277,522.75	5,584,552,522.75
未分配利润	6.4.7.9	29,060,381,777.58	24,190,502,040.17
净资产合计		34,681,659,300.33	29,775,054,562.92
负债和净资产总计		34,719,815,476.88	29,804,926,743.94

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 1.5424 元，基金份额总额

22,485,110,164.00 份。

6.2 利润表

会计主体：广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		4,858,011,988.97	1,870,482,652.49
1. 利息收入		2,869,269.26	2,640,726.75
其中：存款利息收入	6.4.7.10	2,869,269.26	2,640,726.75
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）		777,846,797.45	91,933,920.94
其中：股票投资收益	6.4.7.11	355,888,501.85	39,000,972.77
基金投资收益	6.4.7.12	107,091,499.14	-10,089.60
债券投资收益	6.4.7.13	733,140.37	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	228,595,001.47	-23,608,924.91
股利收益	6.4.7.17	85,538,654.62	76,551,962.68
以摊余成本计量的金融资产 终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-” 号填列）	6.4.7.18	4,097,970,784.92	1,776,199,952.09
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-20,027,827.51	-14,870,035.29
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	-647,035.15	14,578,088.00
减：二、营业总支出		154,139,105.58	122,335,310.15
1. 管理人报酬		122,182,147.47	95,131,705.78
2. 托管费		30,545,536.82	25,010,387.25
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	6.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		1,299,085.77	-
8. 其他费用	6.4.7.21	112,335.52	2,193,217.12

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,703,872,883.39	1,748,147,342.34
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,703,872,883.39	1,748,147,342.34
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		4,703,872,883.39	1,748,147,342.34

6.3 净资产变动表

会计主体：广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	5,584,552,522.75	24,190,502,040.17	29,775,054,562.92
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	5,584,552,522.75	24,190,502,040.17	29,775,054,562.92
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	36,725,000.00	4,869,879,737.41	4,906,604,737.41
（一）、综合收益总额	-	4,703,872,883.39	4,703,872,883.39
（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）	36,725,000.00	166,006,854.02	202,731,854.02
其中：1.基金申购款	36,725,000.00	166,006,854.02	202,731,854.02
2.基金赎回款	-	-	-
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	5,621,277,522.75	29,060,381,777.58	34,681,659,300.33

项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	5,194,877,526.09	18,596,969,261.18	23,791,846,787.27
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	5,194,877,526.09	18,596,969,261.18	23,791,846,787.27
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	267,474,998.92	2,639,584,082.34	2,907,059,081.26
（一）、综合收益总额	-	1,748,147,342.34	1,748,147,342.34
（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）	267,474,998.92	891,436,740.00	1,158,911,738.92
其中：1.基金申购款	267,474,998.92	891,436,740.00	1,158,911,738.92
2.基金赎回款	-	-	-
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	5,462,352,525.01	21,236,553,343.52	26,698,905,868.53

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：葛长伟，主管会计工作负责人：窦刚，会计机构负责人：张晓章

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（“本基金”）经中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）证监许可[2015]275 号文核准，由广发基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》等有关规定和《广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（“基金合

同”)发起,于 2015 年 6 月 10 日募集成立。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司,境外资产托管人为中国银行纽约分行。

本基金募集期为 2015 年 5 月 20 日至 2015 年 6 月 2 日,本基金为交易型开放式基金,存续期限不定,募集资金总额为人民币 263,052,541.00 元,有效认购户数为 3,617 户。其中,认购资金在募集期间产生的利息共计人民币 10,541.00 元,折合基金份额 10,541.00 份,按照基金合同的有关约定计入基金份额持有人的基金账户。本基金募集资金经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验资。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)编制,同时,在信息披露和估值方面,也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号<会计报表附注的编制及披露>》、中国证券投资基金业协会发布的《公开募集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》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年上半年度的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 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

本基金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。

6.4.5 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

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据国务院令 第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》,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〔2008〕132 号文《关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》、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《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〔2015〕125 号《关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、财税〔2016〕36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税〔2016〕46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税〔2016〕70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税〔2016〕127 号《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》，财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、2025 年第 11 号《关于黄金有关税收政策的公告》（自 2025 年 11 月 1 日起施行）、2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》、2026 年第 12 号《关于明确增值税应税交易销售额计算口径的公告》，国税发明电〔2002〕47 号《黄金交易增值税征收管理办法》（自 2025 年 11 月 1 日起废止）及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

（1）增值税、城建税、教育费附加及地方教育附加

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

2027 年 12 月 31 日前，对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入及金融同业往来利息收入免征增值税，通过上海黄金交易所、上海期货交易所交易标准黄金，未发生实物交割的，免征增值税。但自 2025 年 8 月 8 日（含当日）起，新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，免征增值税直至债券到期。

本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3% 和 2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

（2）企业所得税、个人所得税

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。

对从境内公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，自 2015 年 9 月 8 日起暂免征收个人所得税。目前暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。前述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

对通过港股通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，由 H 股公司根据中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提供的投资者名册，按照 20% 的税率代扣个人所得税；通过港股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。

（3）印花税

境内证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳，自 2023 年 8 月 28 日起减半征收。基金通过港股通买卖、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。

（4）其他税收

对于香港市场投资者通过基金互认持有的基金份额或基金境外交易或收益涉及的税收，按照投资所在地或相关国家（地区）的法律法规、税收协定等执行。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	1,366,341,848.67
等于：本金	1,366,214,782.19
加：应计利息	127,066.48
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
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	-
合计	1,366,341,848.67

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		16,844,028,235.25	-	31,808,565,842.69	14,964,537,607.44
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	309,862,126.96	2,147,875.04	311,932,459.84	-77,542.16
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	309,862,126.96	2,147,875.04	311,932,459.84	-77,542.16
资产支持证券		-	-	-	-
基金		269,107,717.23	-	589,537,725.55	320,430,008.32
其他		-	-	-	-
合计		17,422,998,079.44	2,147,875.04	32,710,036,028.08	15,284,890,073.60

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 2026 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	1,218,266,053.75	-	-	-
其中：股指期货投资	1,218,266,053.75	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,218,266,053.75	-	-	-

注：期货投资采用当日无负债结算制度，相关价值已包含在结算备付金中。

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
NQU6	NASDAQ	294.00	1,222,137,171.	3,871,118.04

	100 E-MINI Sep26		79	
合计	-	-	-	3,871,118.04
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	3,871,118.04
净额	-	-	-	-

注：衍生金融资产项下的衍生工具为期货投资。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产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。

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

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	242,750.48
待摊费用	-
合计	242,750.48

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 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	95,211.43
应付替代款	526,252.23
可退替代款	116,440.20

合计	737,903.86
----	------------

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	22,338,210,164.00	5,584,552,522.75
本期申购	146,900,000.00	36,725,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	22,485,110,164.00	5,621,277,522.75

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
上年度末	10,354,806,826.26	13,835,695,213.91	24,190,502,040.17
本期期初	10,354,806,826.26	13,835,695,213.91	24,190,502,040.17
本期利润	605,902,098.47	4,097,970,784.92	4,703,872,883.39
本期基金份额交易产生的变动数	70,135,029.45	95,871,824.57	166,006,854.02
其中：基金申购款	70,135,029.45	95,871,824.57	166,006,854.02
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	11,030,843,954.18	18,029,537,823.40	29,060,381,777.58

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	2,868,858.34
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	374.66
其他	36.26
合计	2,869,269.26

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	355,888,501.85
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-

股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	355,888,501.85

6.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,541,171,440.65
减：卖出股票成本总额	1,184,717,972.94
减：交易费用	564,965.86
买卖股票差价收入	355,888,501.85

6.4.7.12 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	193,061,811.16
减：卖出/赎回基金成本总额	82,703,866.17
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	3,214,309.08
减：交易费用	52,136.77
基金投资收益	107,091,499.14

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**

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	733,140.37
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	733,140.37

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内无买卖债券差价收入。

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**

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

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

本基金本报告期内无买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股指期货投资收益	228,595,001.47

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	83,885,192.06
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	1,653,462.56
合计	85,538,654.62

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
1.交易性金融资产	4,075,195,610.88
——股票投资	3,954,077,052.54
——债券投资	-77,542.16
——资产支持证券投资	-
——基金投资	121,196,100.50
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	22,775,174.04
——权证投资	-
——股指期货投资	22,775,174.04
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	4,097,970,784.92

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	-647,035.15
合计	-647,035.15

注：替代损益是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购（赎回）本基金时，补入（卖出）被替代成分证券的实际买入成本（实际卖出金额）与申购（赎回）确认日估值的差额或强

制退款的被替代成分证券在强制退款计算日与申购（赎回）确认日估值的差额。

6.4.7.20 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
审计费用	35,704.06
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	17,124.09
合计	112,335.52

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，本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本基金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
广发基金管理有限公司	基金管理人
中国银行股份有限公司	基金托管人
中国银行纽约分行	基金境外资产托管人
广发证券股份有限公司	基金管理人控股股东
广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（QDII）	本基金的联接基金

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
广发证券股份有限公司	311,254,867.13	100.00%	-	-

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间内无应支付关联方的佣金，本报告期末及上年度可比期间末无应付关联方佣金余额。

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 2026年1月1日至2026年6月30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	122,182,147.47	95,131,705.78
其中：应支付销售机构的客户维护费	4,345,592.63	1,293,014.67
应支付基金管理人的净管理费	117,836,554.84	93,838,691.11

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理费＝前一日的基金资产净值×约定年费率/当年天数。

约定年费率为 0.80%。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	30,545,536.82	25,010,387.25

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费＝前一日的基金资产净值×约定年费率/当年天数。

自 2025 年 2 月 6 日起，约定年费率由 0.25%调整为 0.20%。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间内无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间内无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。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间内无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。

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

本报告期内及上年度可比期间内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 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
广发纳斯达克 100 交易型开放 式指数证券投资 基金联接基金 (QDII)	12,100,201,592.00	53.81%	12,392,317,250.00	55.48%
广发证券股份有 限公司	66,885.00	0.00%	247,085.00	0.00%

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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
中国银行股份有限公司	1,275,832,877.48	2,868,858.34	1,403,774,713.91	2,640,726.75
中国银行纽约分行	90,508,971.19	-	278,181,586.25	-

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国银行股份有限公司、境外资产托管人中国银行纽约分行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2026 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

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要是信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人奉行全面风险管理的理念，建立了由董事会及其下设的合规及风险管理委员会、经营管理层及其下设的风险控制委员会、风险管理职能部门、各业务部门四个层级构成的风险管理组织架构。在职责分工中，董事会及其下设的合规及风险管理委员会负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；经营管理层及其下设的风险控制委员会负责讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；各业务部门、风险管理职能部门以及合规稽核部下设的稽核审计

组构成公司风险管理三道防线，共同发挥事前识别与防范、事中监测与控制、事后监督与评价功能，通过相互协作，分层次、多方面、持续性地监测和管理公司面临的各类风险。

6.4.13.2 信用风险

信用风险指由于在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或所投资证券之发行人出现违约、无法支付到期本息，或由于债券发行人信用等级降低导致债券价格下降，将对基金资产造成损失的风险。为了防范信用风险，本基金管理人建立了内部信用评级制度与交易对手库，对证券发行人的信用等级进行评估与控制，并分散化投资，对交易对手的资信情况进行充分评估。

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均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险小。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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	311,932,459.84	-
合计	311,932,459.84	-

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、以上未评级的债券为期限在一年以内的国债、政策性金融债、央行票据、超短期融资券以及未有境内评级的境外债券。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险指因市场交易不活跃，基金资产无法以适当价格及时变现的风险或基金无法应付基金赎回支付的要求所引起的风险。本基金坚持组合持有、分散投资的原则，基金管理人根据市场运行情况和基金运行情况制订本基金的风险控制目标和方法，具体计算与分析各类风险控制指标，从而对流动性风险进行监控和防范。

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，对组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间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，通过独立的风险管理部门对投资组合的流动性风险进行评估与监测。

在日常运作中，本基金的流动性安排能够与基金合同约定的申购赎回安排以及投资者的申购赎回需求相匹配。本基金主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具，基金管理人持续监测本基金持有资产的流动性水平。本期末，除在附注 6.4.12 中列示的流通暂时受限的证券外，本基金所持大部分投资标的为具有良好流动性的金融工具。同时，基金管理人持续监测本基金开放期内投资者的申购赎回情况，保持基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。

如遭遇极端市场情形或投资者非预期巨额赎回情形，基金管理人将采用本基金合同约定的赎回申请处理方式及其他各类流动性风险管理工具，控制极端情况下的潜在流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

基金的市场风险是指由于证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理等各种因素的影响，导致基金收益水平变化而产生的风险，反映了基金资产中金融工具或证券价值对市场参数变化的敏感性。一般来讲，市场风险是开放式基金面临的重大风险，也往往是众多风险中最基本和最常见的，也是最难防范的风险，其他如流动性风险最终是因为市场风险在起作用。市场风险包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金管理人通过久期、凸性等方法来评估投资组合面临的利率风险，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 2026 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	1,366,341,848.67	-	-	-	1,366,341,848.67
结算备付金	-	-	-	553,380,089.10	553,380,089.10
存出保证金	69,242.57	-	-	86,262,188.48	86,331,431.05
交易性金融资产	311,932,459.84	-	-	32,398,103,568.2	32,710,036,02

				4	8.08
应收股利	-	-	-	3,483,329.50	3,483,329.50
其他资产	-	-	-	242,750.48	242,750.48
资产总计	1,678,343,551.08	-	-	33,041,471,925.80	34,719,815,476.88
负债					
应付清算款	-	-	-	2,665.94	2,665.94
应付管理人报酬	-	-	-	22,409,344.30	22,409,344.30
应付托管费	-	-	-	5,602,336.06	5,602,336.06
应交税费	-	-	-	9,403,926.39	9,403,926.39
其他负债	-	-	-	737,903.86	737,903.86
负债总计	-	-	-	38,156,176.55	38,156,176.55
利率敏感度缺口	1,678,343,551.08	-	-	33,003,315,749.25	34,681,659,300.33
上年度末 2025 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	1,909,156,834.19	-	-	-	1,909,156,834.19
结算备付金	-	-	-	465,806,628.55	465,806,628.55
存出保证金	-	-	-	110,293,381.66	110,293,381.66
交易性金融资产	-	-	-	27,312,908,480.96	27,312,908,480.96
应收股利	-	-	-	6,518,668.10	6,518,668.10
其他资产	-	-	-	242,750.48	242,750.48
资产总计	1,909,156,834.19	-	-	27,895,769,909.75	29,804,926,743.94
负债					
应付清算款	-	-	-	80,590.46	80,590.46
应付管理人报酬	-	-	-	20,464,774.77	20,464,774.77
应付托管费	-	-	-	5,116,193.67	5,116,193.67
应交税费	-	-	-	3,199,164.87	3,199,164.87
其他负债	-	-	-	1,011,457.25	1,011,457.25
负债总计	-	-	-	29,872,181.02	29,872,181.02
利率敏感度缺口	1,909,156,834.19	-	-	27,865,897,728.73	29,775,054,562.92

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利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）

		元)	
		本期末	上年度末
		2026 年 6 月 30 日	2025 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25 个基点	-359,296.95	-
	市场利率下降 25 个基点	360,180.07	-

注：本基金上年度末未持有债券资产（不含可转债、可交换债）。

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。持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债会存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026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				
货币资金	97,698,529.17	-	-	97,698,529.17
结算备付金	553,380,089.10	-	-	553,380,089.10
存出保证金	86,262,188.48	-	-	86,262,188.48
交易性金融资产	32,398,103,568.24	-	-	32,398,103,568.24
应收股利	3,483,329.50	-	-	3,483,329.50
资产合计	33,138,927,704.49	-	-	33,138,927,704.49
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	33,138,927,704.49	-	-	33,138,927,704.49
项目	上年度末 2025年12月31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				
货币资金	97,556,701.17	-	-	97,556,701.17
结算备付金	465,806,628.55	-	-	465,806,628.55
存出保证金	110,293,381.66	-	-	110,293,381.66
交易性金融资产	27,312,908,480.96	-	-	27,312,908,480.96
应收股利	6,518,668.10	-	-	6,518,668.10
资产合计	27,993,083,860.44	-	-	27,993,083,860.44
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-

资产负债表外汇风险敞口净额	27,993,083,860.44	-	-	27,993,083,860.44
---------------	-------------------	---	---	-------------------

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：人民币元）	
		本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	所有外币相对人民币升值 5%	1,656,946,385.22	1,399,654,193.02
	所有外币相对人民币贬值 5%	-1,656,946,385.22	-1,399,654,193.02

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金管理人通过采用 Barra 风险管理系统，以及标准差、跟踪误差、beta 值等指标监控投资组合面临的市场价格波动风险。

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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 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	31,808,565,842.69	91.72	26,891,977,185.88	90.32
交易性金融资产—基金投资	589,537,725.55	1.70	420,931,295.08	1.41
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	32,398,103,568.24	93.42	27,312,908,480.96	91.73

注：其他包含在期货交易所的期货投资（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。

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：人民币元）	
		本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	上升 5%	1,722,227,750.76	1,474,579,638.41
	下降 5%	-1,722,227,750.76	-1,474,579,638.41

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 2026 年 6 月 30 日
第一层次	32,398,103,568.24
第二层次	311,932,459.84
第三层次	-
合计	32,710,036,028.08

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的金融工具，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，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金融工具的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关金融工具的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

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	31,808,565,842.69	91.62
	其中：普通股	31,531,930,361.01	90.82
	存托凭证	276,635,481.68	0.80
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	589,537,725.55	1.70
3	固定收益投资	311,932,459.84	0.90
	其中：债券	311,932,459.84	0.90
	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	1,919,721,937.77	5.53
8	其他各项资产	90,057,511.03	0.26
9	合计	34,719,815,476.88	100.00

注：上表中的权益投资项含可退替代款估值增值，而 7.2 的合计项不含可退替代款估值增值。

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	31,808,565,842.69	91.72
合计	31,808,565,842.69	91.72

注：（1）国家（地区）类别根据股票及存托凭证所在的证券交易所确定。

（2）存托凭证按照本身挂牌的证券交易所确定。

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	143,628,027.08	0.41
原材料	329,739,298.87	0.95
工业	1,094,084,949.74	3.15
非日常生活消费品	3,380,351,766.34	9.75
日常消费品	1,976,256,208.92	5.70
医疗保健	1,127,315,110.51	3.25
金融	52,346,497.08	0.15
信息技术	19,509,472,517.02	56.25
通讯业务	3,835,332,000.28	11.06
公用事业	360,039,466.85	1.04
房地产	-	-
合计	31,808,565,842.69	91.72

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	NVIDIA Corp	英伟达公司	NVDA US	纳斯达克 证券交易所	美国	1,768,795.00	2,410,501,410.83	6.95
2	Apple Inc	苹果公司	AAPL US	纳斯达克 证券交易所	美国	1,073,509.00	2,115,673,709.98	6.10
3	Alphabet Inc	谷歌公司	GOOGL US	纳斯达克 证券交易所	美国	425,680.00	1,036,109,944.23	2.99
			GOOG US	纳斯达克 证券交易所	美国	398,783.00	959,669,414.02	2.77
4	Micron Technology Inc	美光科技股份有限公司	MU US	纳斯达克 证券交易所	美国	229,142.00	1,801,457,980.30	5.19
5	Microsoft Corp	微软公司	MSFT US	纳斯达克 证券交易所	美国	542,950.00	1,379,419,811.38	3.98
6	Advanced Micro	AMD 公司	AMD US	纳斯达克 证券交易所	美国	331,737.00	1,312,524,048.37	3.78

	Devices Inc			交易所				
7	Amazon.com Inc	亚马逊公司	AMZN US	纳斯达克证券交易所	美国	786,245.00	1,276,319,297.04	3.68
8	Tesla Inc	特斯拉公司	TSLA US	纳斯达克证券交易所	美国	365,122.00	1,045,952,046.17	3.02
9	Intel Corp	英特尔公司	INTC US	纳斯达克证券交易所	美国	1,018,835.00	968,918,164.39	2.79
10	Broadcom Inc	博通股份有限公司	AVGO US	纳斯达克证券交易所	美国	349,431.00	899,022,183.11	2.59
11	Meta Platforms Inc	Meta 平台股份有限公司	META US	纳斯达克证券交易所	美国	216,445.00	830,393,809.75	2.39
12	Applied Materials Inc	应用材料公司	AMAT US	纳斯达克证券交易所	美国	163,254.00	803,908,521.40	2.32
13	Walmart Inc	沃尔玛股份有限公司	WMT US	纳斯达克证券交易所	美国	984,323.00	759,309,256.47	2.19
14	Lam Research Corp	泛林集团	LRCX US	纳斯达克证券交易所	美国	252,341.00	744,750,975.09	2.15
15	Cisco Systems Inc	思科公司	CSCO US	纳斯达克证券交易所	美国	795,305.00	636,250,612.17	1.83
16	Costco Wholesale Corp	开市客公司	COST US	纳斯达克证券交易所	美国	89,521.00	570,373,439.00	1.64
17	KLA Corp	科磊公司	KLAC US	纳斯达克证券交易所	美国	269,260.00	553,306,854.22	1.60
18	Sandisk Corp	闪迪公司/特拉华州	SNDK US	纳斯达克证券交易所	美国	30,882.00	478,243,211.94	1.38
19	Netflix Inc	奈飞公司	NFLX US	纳斯达克证券交易所	美国	849,658.00	413,187,207.00	1.19
20	Palo Alto Networks Inc	派拓网络公司	PANW US	纳斯达克证券交易所	美国	164,653.00	382,431,803.84	1.10

21	Texas Instruments Inc	德州仪器公司	TXN US	纳斯达克证券交易所	美国	183,639.00	372,810,118.08	1.07
22	Palantir Technologies Inc	Palantir 技术股份有限公司	PLTR US	纳斯达克证券交易所	美国	463,303.00	368,153,398.68	1.06
23	Marvell Technology Inc	美满电子科技公司	MRVL US	纳斯达克证券交易所	美国	176,518.00	358,137,193.86	1.03
24	Linde PLC	林德公司	LIN US	纳斯达克证券交易所	美国	93,293.00	329,739,298.87	0.95
25	Western Digital Corp	西部数据公司	WDC US	纳斯达克证券交易所	美国	71,550.00	311,260,963.33	0.90
26	Seagate Technology Holdings PLC	Seagate Technology 控股公共有限公司	STX US	纳斯达克证券交易所	美国	46,245.00	303,946,118.03	0.88
27	QUALCOMM Inc	高通公司	QCOM US	纳斯达克证券交易所	美国	219,478.00	276,231,984.42	0.80
28	Amgen Inc	安进公司	AMGN US	纳斯达克证券交易所	美国	108,903.00	268,594,341.55	0.77
29	CrowdStrike Holdings Inc	CrowdStrike 控股股份有限公司	CRWD US	纳斯达克证券交易所	美国	51,369.00	266,999,121.84	0.77
30	Analog Devices Inc	亚德诺半导体公司	ADI US	纳斯达克证券交易所	美国	98,285.00	265,869,294.26	0.77
31	PepsiCo Inc	百事公司	PEP US	纳斯达克证券交易所	美国	275,787.00	254,329,629.64	0.73
32	ASML Holding NV	阿斯麦控股公司	ASML US	纳斯达克证券交易所	美国	18,490.00	250,537,223.81	0.72
33	T-Mobile US Inc	T-Mobile US 股份有限公司	TMUS US	纳斯达克证券交易所	美国	218,368.00	249,461,912.38	0.72
34	AppLovin Corp	AppLovin 公司	APP US	纳斯达克证券交易所	美国	61,691.00	216,484,823.81	0.62

35	Gilead Sciences Inc	吉利德科学公司	GILD US	纳斯达克证券交易所	美国	250,525.00	215,574,033.28	0.62
36	ARM Holdings PLC	ARM 控股公共有限公司	ARM US	纳斯达克证券交易所	美国	85,557.00	206,615,091.14	0.60
37	Intuitive Surgical Inc	直觉外科手术公司	ISRG US	纳斯达克证券交易所	美国	71,463.00	193,561,731.24	0.56
38	Shopify Inc	Shopify 股份有限公司	SHOP US	纳斯达克证券交易所	美国	246,088.00	191,374,901.09	0.55
39	Booking Holdings Inc	缤客控股公司	BKNG US	纳斯达克证券交易所	美国	156,356.00	189,812,246.33	0.55
40	Vertex Pharmaceuticals Inc	福泰制药公司	VRTX US	纳斯达克证券交易所	美国	51,213.00	173,262,713.20	0.50
41	Starbucks Corp	星巴克公司	SBUX US	纳斯达克证券交易所	美国	229,969.00	160,059,774.15	0.46
42	Fortinet Inc	飞塔信息	FTNT US	纳斯达克证券交易所	美国	147,834.00	154,677,303.57	0.45
43	Cadence Design Systems Inc	铿腾电子科技有限公司	CDNS US	纳斯达克证券交易所	美国	55,654.00	142,266,482.95	0.41
44	Marriott International Inc/MD	万豪国际集团	MAR US	纳斯达克证券交易所	美国	53,207.00	134,297,204.49	0.39
45	Monster Beverage Corp	怪兽饮料公司	MNST US	纳斯达克证券交易所	美国	197,343.00	129,193,300.13	0.37
46	Constellation Energy Corp	美国联合能源公司	CEG US	纳斯达克证券交易所	美国	72,881.00	123,287,192.84	0.36
47	Automatic Data Processing Inc	自动数据处理公司	ADP US	纳斯达克证券交易所	美国	80,659.00	123,029,257.80	0.35
48	CSX Corp	CSX 公司	CSX US	纳斯达克证券交易所	美国	374,937.00	121,375,384.38	0.35

				交易所				
49	Comcast Corp	康卡斯特公司	CMCSA US	纳斯达克证券交易所	美国	718,901.00	120,205,707.25	0.35
50	Datadog Inc	数据狗	DDOG US	纳斯达克证券交易所	美国	66,754.00	118,373,928.57	0.34
51	MercadoLibre Inc	自由市场公司	MELI US	纳斯达克证券交易所	美国	10,230.00	118,266,508.83	0.34
52	Synopsys Inc	新思科技公司	SNPS US	纳斯达克证券交易所	美国	38,637.00	117,384,544.20	0.34
53	Adobe Inc	奥多比公司	ADBE US	纳斯达克证券交易所	美国	81,560.00	113,887,995.76	0.33
54	Astera Labs Inc	Astera Labs 股份有限公司	ALAB US	纳斯达克证券交易所	美国	34,587.00	113,784,344.35	0.33
55	O'Reilly Automotive Inc	奥莱利汽车公司	ORLY US	纳斯达克证券交易所	美国	167,219.00	104,882,395.68	0.30
56	DoorDash Inc	DoorDash 股份有限公司	DASH US	纳斯达克证券交易所	美国	83,000.00	104,315,676.29	0.30
57	Teradyne Inc	泰瑞达	TER US	纳斯达克证券交易所	美国	31,587.00	104,091,353.03	0.30
58	American Electric Power Co Inc	美国电力公司	AEP US	纳斯达克证券交易所	美国	109,790.00	102,302,237.35	0.29
59	Mondelez International Inc	亿滋国际公司	MDLZ US	纳斯达克证券交易所	美国	259,016.00	102,037,399.18	0.29
60	Intuit Inc	财捷集团	INTU US	纳斯达克证券交易所	美国	55,194.00	98,115,332.61	0.28
61	NXP Semiconductors NV	恩智浦半导体公司	NXPI US	纳斯达克证券交易所	美国	50,944.00	97,510,240.81	0.28
62	Honeywell International	霍尼韦尔国际公司	HON US	纳斯达克证券交易所	美国	63,929.00	97,489,200.44	0.28

	nal Inc							
63	Honeywell Aerospace Inc	-	HONA US	纳斯达克证券交易所	美国	63,929.00	96,261,332.89	0.28
64	Ross Stores Inc	罗斯百货股份有限公司	ROST US	纳斯达克证券交易所	美国	65,003.00	94,234,853.33	0.27
65	Cintas Corp	信达思公司	CTAS US	纳斯达克证券交易所	美国	80,730.00	93,517,460.21	0.27
66	Monolithic Power Systems Inc	芯源系统有限公司	MPWR US	纳斯达克证券交易所	美国	9,913.00	93,332,042.17	0.27
67	Warner Bros Discovery Inc	华纳兄弟探索股份有限公司	WBD US	纳斯达克证券交易所	美国	505,892.00	91,859,158.08	0.26
68	Lumentum Holdings Inc	Lumentum 控股股份有限公司	LITE US	纳斯达克证券交易所	美国	15,699.00	91,747,481.25	0.26
69	Regeneron Pharmaceuticals Inc	再生元制药股份有限公司	REGN US	纳斯达克证券交易所	美国	20,788.00	88,283,904.17	0.25
70	PACCAR Inc	帕卡公司	PCAR US	纳斯达克证券交易所	美国	106,194.00	86,879,998.96	0.25
71	Nebius Group NV	Nebius 集团股份有限公司	NBIS US	纳斯达克证券交易所	美国	44,474.00	83,654,093.14	0.24
72	Airbnb Inc	爱彼迎股份有限公司	ABNB US	纳斯达克证券交易所	美国	84,330.00	82,191,373.49	0.24
73	Rocket Lab Corp	Rocket Lab 公司	RKLB US	纳斯达克证券交易所	美国	116,781.00	80,850,754.42	0.23
74	Fastenal Co	法思诺公司	FAST US	纳斯达克证券交易所	美国	231,651.00	75,779,418.76	0.22
75	Baker Hughes Co	贝克休斯公司	BKR US	纳斯达克证券交易所	美国	200,180.00	75,669,030.89	0.22

76	Electronic Arts Inc	艺电公司	EA US	纳斯达克证券交易所	美国	50,597.00	70,659,061.44	0.20
77	PDD Holdings Inc	拼多多控股公司	PDD US	纳斯达克证券交易所	美国	134,775.00	70,020,390.54	0.20
78	Xcel Energy Inc	Xcel 能源股份有限公司	XEL US	纳斯达克证券交易所	美国	125,966.00	68,892,728.90	0.20
79	Diamondback Energy Inc	戴蒙德巴克能源	FANG US	纳斯达克证券交易所	美国	56,764.00	67,958,996.19	0.20
80	Microchip Technology Inc	微芯科技股份有限公司	MCHP US	纳斯达克证券交易所	美国	109,381.00	67,942,454.42	0.20
81	Ferrovial NV	Ferrovial 股份有限公司	FER US	纳斯达克证券交易所	美国	145,173.00	67,838,740.29	0.20
82	Exelon Corp	爱克斯龙公司	EXC US	纳斯达克证券交易所	美国	206,464.00	65,557,307.76	0.19
83	Take-Two Interactive Software Inc	Take-Two 互动软件股份有限公司	TTWO US	纳斯达克证券交易所	美国	37,464.00	63,785,786.13	0.18
84	Axon Enterprise Inc	Axon Enterprise 股份有限公司	AXON US	纳斯达克证券交易所	美国	16,264.00	62,100,158.67	0.18
85	Old Dominion Freight Line Inc	奥多明尼昂货运公司	ODFL US	纳斯达克证券交易所	美国	41,964.00	61,907,010.81	0.18
86	Coca-Cola Europacific Partners PLC	可口可乐欧洲合伙公开股份公司	CCEP US	纳斯达克证券交易所	美国	89,972.00	61,321,924.80	0.18
87	CoreWeave Inc	CoreWeave 股份有限公司	CRWV US	纳斯达克证券交易所	美国	90,312.00	61,227,651.32	0.18
88	Keurig Dr Pepper	克里格胡椒博士	KDP US	纳斯达克证券交易所	美国	274,535.00	61,199,550.02	0.18

	Inc			交易所				
89	IDEXX Laboratories Inc	爱德士股份有限公司	IDXX US	纳斯达克证券交易所	美国	15,917.00	57,070,884.13	0.16
90	Autodesk Inc	欧特克公司	ADSK US	纳斯达克证券交易所	美国	42,576.00	56,378,082.38	0.16
91	Alnylam Pharmaceuticals Inc	艾拉伦制药股份有限公司	ALNY US	纳斯达克证券交易所	美国	26,940.00	55,234,684.02	0.16
92	PayPal Holdings Inc	贝宝	PYPL US	纳斯达克证券交易所	美国	177,992.00	52,346,497.08	0.15
93	Paychex Inc	沛齐公司	PAYX US	纳斯达克证券交易所	美国	72,296.00	48,417,773.26	0.14
94	Roper Technologies Inc	儒博技术公司	ROP US	纳斯达克证券交易所	美国	20,363.00	46,931,429.80	0.14
95	Thomson Reuters Corp	汤森路透公司	TRI US	纳斯达克证券交易所	美国	76,892.00	42,770,883.04	0.12
96	GE Healthcare Technologies Inc	GE 医疗技术公司	GEHC US	纳斯达克证券交易所	美国	91,788.00	40,016,420.50	0.12
97	Strategy Inc	Strategy 股份有限公司	MSTR US	纳斯达克证券交易所	美国	66,751.00	39,521,367.17	0.11
98	Kraft Heinz Co/The	卡夫亨氏公司	KHC US	纳斯达克证券交易所	美国	239,267.00	38,491,709.68	0.11
99	Copart Inc	科帕特公司	CPRT US	纳斯达克证券交易所	美国	186,811.00	35,867,575.81	0.10
100	Dexcom Inc	德康医疗	DXCM US	纳斯达克证券交易所	美国	77,862.00	35,716,398.42	0.10
101	Workday Inc	Workday 股份有限公司	WDAY US	纳斯达克证券交易所	美国	40,558.00	33,816,870.15	0.10

注：此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	Walmart Inc	WMT US	814,470,476.52	2.74
2	Sandisk Corp	SNDK US	247,111,415.08	0.83
3	ARM Holdings PLC	ARM US	171,670,594.41	0.58
4	Lumentum Holdings Inc	LITE US	102,233,029.75	0.34
5	Tesla Inc	TSLA US	97,297,453.09	0.33
6	Astera Labs Inc	ALAB US	92,370,051.65	0.31
7	Teradyne Inc	TER US	91,803,264.39	0.31
8	Rocket Lab Corp	RKLB US	84,914,713.10	0.29
9	Nebius Group NV	NBIS US	84,824,235.23	0.28
10	CoreWeave Inc	CRWV US	72,112,339.64	0.24
11	Palo Alto Networks Inc	PANW US	43,142,026.21	0.14
12	Seagate Technology Holdings PLC	STX US	36,817,434.15	0.12
13	Intel Corp	INTC US	34,544,478.94	0.12
14	Western Digital Corp	WDC US	28,330,182.91	0.10
15	Micron Technology Inc	MU US	23,933,396.99	0.08
16	Apple Inc	AAPL US	19,079,708.08	0.06
17	Constellation Energy Corp	CEG US	18,006,150.45	0.06
18	Microsoft Corp	MSFT US	17,986,046.49	0.06
19	Strategy Inc	MSTR US	12,548,823.67	0.04
20	Advanced Micro Devices Inc	AMD US	12,518,651.42	0.04

注：本项及下项 7.5.2、7.5.3 的买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，此外，“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	Apple Inc	AAPL US	134,492,170.31	0.45
2	NVIDIA Corp	NVDA US	122,292,503.11	0.41

3	Microsoft Corp	MSFT US	94,738,727.81	0.32
4	Alphabet Inc	GOOGL US	55,386,211.44	0.19
		GOOG US	35,046,024.05	0.12
5	AstraZeneca PLC	AZN US	78,799,293.54	0.26
6	Amazon.com Inc	AMZN US	50,293,346.92	0.17
7	Meta Platforms Inc	META US	46,714,553.70	0.16
8	Micron Technology Inc	MU US	38,894,827.42	0.13
9	Verisk Analytics Inc	VRSK US	35,238,564.95	0.12
10	Broadcom Inc	AVGO US	35,075,810.16	0.12
11	Tesla Inc	TSLA US	34,884,646.21	0.12
12	Cognizant Technology Solutions Corp	CTSH US	32,834,117.84	0.11
13	Advanced Micro Devices Inc	AMD US	30,731,978.60	0.10
14	Zscaler Inc	ZS US	29,109,294.67	0.10
15	Insmmed Inc	INSM US	28,858,793.62	0.10
16	Costco Wholesale Corp	COST US	26,976,628.69	0.09
17	Netflix Inc	NFLX US	26,661,838.15	0.09
18	Charter Communications Inc	CHTR US	24,377,450.88	0.08
19	Cisco Systems Inc	CSCO US	24,029,509.78	0.08
20	T-Mobile US Inc	TMUS US	23,460,775.38	0.08

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	2,147,229,577.21
卖出收入（成交）总额	1,541,171,440.65

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

债券信用等级	公允价值	占基金资产净值比例（%）
AAA	-	-
AA+至 AA-	-	-
A+至 A-	-	-
BBB+至 BBB-	-	-
BB+至 BB-	-	-
B+至 B-	-	-
CCC+至 CCC-	-	-
未评级	311,932,459.84	0.90
合计	311,932,459.84	0.90

注：本基金债券投资组合主要采用标准普尔、穆迪等机构提供的债券信用评级信息，其中境内债券取自境内第三方评级机构的债项评级。

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019827.SH	26 国债 01	209,720,000	211,079,387.80	0.61
2	019792.SH	25 国债 19	99,796,000	100,853,072.04	0.29

注：（1）债券代码为 ISIN 码或当地市场代码。

（2）数量列示债券面值，外币按照期末估值汇率折为人民币，四舍五入保留整数。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

金额单位：人民币元

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	股指期货	NASDAQ 100 E-MINI Sep26	0.00	0.00

注：期货投资采用当日无负债结算制度，结算准备金已包括所持期货合约产生的持仓损益，因此衍生金融工具项下的期货投资与相关的期货暂收款结算所得的持仓损益之间按抵销后的净额列示，为人民币零元。本报告期末本基金投资的期货持仓和损益明细为：NASDAQ 100 E-MINI Sep26 买入持仓量 294 手，合约市值人民币 1,222,137,171.79 元，公允价值变动人民币 3,871,118.04 元。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	ProShares UltraPro QQQ	股票型	交易型开放式	ProShare Advisors LLC	589,537,725.55	1.70

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，谷歌公司在报告编制日前一年内曾受到欧盟的处罚。亚马逊公司在报告编制日前一年内曾受到美国联邦贸易委员会（FTC）的处罚。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

7.11.2 本报告期内，本基金不存在投资的前十名股票超出基金合同约定的备选股票库的情况。

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	86,331,431.05
2	应收清算款	-
3	应收股利	3,483,329.50
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	242,750.48
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	90,057,511.03

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。

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		广发纳斯达克 100 交易型 开放式指数证券投资基 金联接基金（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
227,962	98,635.34	14,055,689,814.00	62.51%	8,429,420,350.00	37.49%	12,100,201,592.00	53.81%

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“广发纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金联接基金（QDII）”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	0.0000%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015 年 6 月 10 日）基金份额总额	263,052,541.00
本报告期期初基金份额总额	22,338,210,164.00
本报告期基金总申购份额	146,900,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	-
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	22,485,110,164.00

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

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

本基金管理人于 2026 年 2 月 14 日发布公告，自 2026 年 2 月 13 日起，傅友兴先生离任公司副总经理。

本报告期内，本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、基金财产的诉讼事项。

本报告期内，无涉及本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发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易 单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股 票成交总 额的比例	佣金	占当期佣 金总量的 比例	
China International Capital Corporation Limited	-	-	-	-	-	-
Citigroup	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs Group Inc.	-	3,689,131,663.10	100.00%	601,846.35	100.00%	-
State Street Global Markets International Ltd.	-	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	减少 1 个

东兴证券	1	-	-	-	-	减少 1 个
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	5	-	-	-	-	-
国金证券	4	-	-	-	-	-
国联民生	3	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰海通	4	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
华源证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
联储证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
摩根大通证券 (中国)	2	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券	3	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	减少 1 个
天风证券	2	-	-	-	-	-
万和证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
银泰证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
粤开证券	3	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	减少 1 个
中国银河	2	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
中邮证券	1	-	-	-	-	-

注：一、境内合作券商的选择标准和程序

1、选择标准

- (1) 财务状况良好，经营行为稳健规范，在业内具有良好声誉；
- (2) 内控与合规体系健全，相关制度和流程持续完善，风险控制能力较强；
- (3) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金证券交易需要；

(4) 具有较强的综合研究能力，有完善的研究报告质量保障机制，能及时提供宏观、行业及市场走向、个股分析报告；

(5) 具有广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务；

(6) 中国证监会要求的或公司认为应当具备的其他条件。

2、选择流程

(1) 对拟合作券商进行准入评估。本基金管理人根据上述标准对拟合作券商是否符合准入条件进行评估并确定合作券商。

(2) 协议签署及通知托管人。本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议并通知基金托管人。

二、境外合作券商的选择标准和程序

1、选择标准

(1) 具有较强的研究和行业分析能力，能及时、全面、准确地向公司提供关于宏观、行业、市场及个股的高质量报告，并能根据境外投资组合投资的特殊要求，提供专门的研究报告；

(2) 具备投资运作所需的高效、安全、合规的交易执行能力，满足投资组合进行证券交易执行的需要；

(3) 券商中后台系统能提供良好的交收结算服务。开展股票交易的境外券商，原则上需要支持 DTCC 系统进行交易匹配与交收；

(4) 需要配合完成境外券商尽职调查问卷；

(5) 最近3年未因反洗钱、交易业务内控问题受到经营地监管机构的处罚。

2、选择流程

对拟合作券商进行准入评估。本基金管理人根据上述准入标准，对拟合作券商是否符合准入条件进行评估，确定选用符合条件的合作券商，并办理开立交易账户事宜。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

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

International Capital Corporation Limited								
Citigroup	-	-	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs Group Inc.	-	-	-	-	-	-	323,176,007.30	100.00%
State Street Global Markets International Ltd.	-	-	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	311,254,867.13	100.00%	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联民生	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
联储证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-
摩根大通证券(中国)	-	-	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
万和证券	-	-	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-

英大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中国银河	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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	广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-01-05
2	广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-01-06
3	广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-01-07
4	广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-01-08
5	广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-01-09
6	广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-01-12
7	关于广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金暂停申购与赎回业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-01-15
8	广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-01-16
9	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-01-22
10	广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-01-22
11	广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-01-23
12	广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-02-06
13	广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-02-24
14	广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-02-25
15	广发基金管理有限公司关于旗下部分深交所 ETF 变更场内简称的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-03-20
16	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2025 年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-03-30

17	关于广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金暂停申购与赎回业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-04-01
18	广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-04-02
19	广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-04-09
20	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-04-22
21	广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-05-11
22	广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-05-12
23	广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-05-14
24	关于广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金暂停申购与赎回业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-05-21
25	广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-05-25
26	广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-05-26
27	广发基金管理有限公司关于增加世纪证券为旗下部分 ETF 一级交易商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-05-27
28	广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-05-27
29	广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-05-28
30	广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-05-29
31	广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-06-01
32	广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示及停复牌公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-06-02
33	广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示及停复牌公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-06-03
34	广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-06-04
35	广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-06-05
36	广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-06-08
37	广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-06-09

38	广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-06-10
39	广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-06-11
40	广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-06-12
41	广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-06-15
42	广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示及停复牌公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-06-16
43	广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-06-17
44	广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示及停复牌公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-06-18
45	广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示及停复牌公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-06-22
46	广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-06-23
47	广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-06-24
48	广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-06-25
49	广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示及停复牌公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-06-26
50	广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-06-29
51	广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-06-30

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
广 发 纳 斯 达 克	1	20260101-20260630	12,392,317,25	46,000,000.00	338,115,658.0	12,100,201,592.00	53.81%

100 交易 型 开 放 式 指 数 证 券 投 资 基 金 联 接 基 金 (QDII)			0.00		0		
产品特有风险							
报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括： 1、当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响； 2、在极端情况下，基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险； 3、当个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理； 4、在特定情况下，当个别投资者大额赎回，可能导致本基金资产规模和基金份额持有人数量未能满足合同约定，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； 5、在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时，持有基金份额占比较高的投资者可能拥有较大话语权。 本基金管理人将对基金的大额申赎进行审慎评估并合理应对，完善流动性风险管控机制，切实保护持有人利益。							

注：申购份额含二级市场买入份额，赎回份额含二级市场卖出份额。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

经向深圳证券交易所申请并获得同意，本基金管理人自 2026 年 3 月 20 日起变更本基金的场内简称。详情可见本基金管理人网站（www.gffunds.com.cn）刊登的《广发基金管理有限公司关于旗下部分深交所 ETF 变更场内简称的公告》。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1.中国证监会批准广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件
- 2.《广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 3.《广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- 4.法律意见书

12.2 存放地点

广东省广州市海珠区琶洲大道 168 号星河湾中心 28-38 层；广东省广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

12.3 查阅方式

- 1.书面查阅：投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件；
- 2.网站查阅：基金管理人网址 www.gffunds.com.cn。

广发基金管理有限公司
二〇二六年八月三十一日