华安纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金（QDII）
2026年中期报告

2026年6月30日

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2026年8月31日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年8月26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 6

3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7

§4 管理人报告 8

4.1 基金管理人及基金经理情况 8
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介 10
4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 10
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 11
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 12
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 13
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 13

§5 托管人报告 13

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 13
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 13
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 13

§6 半年度财务会计报告（未经审计） 13

6.1 资产负债表 13
6.2 利润表 15
6.3 净资产变动表 16
6.4 报表附注 18

§7 投资组合报告 39

7.1 期末基金资产组合情况 39
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布 40
7.3 期末按行业分类的权益投资组合 40
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细 40
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动 50
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合 52

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 52
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 52
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 52
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 53
7.11 投资组合报告附注 53

§8 基金份额持有人信息 54

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 54
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 54

§9 开放式基金份额变动 54

§10 重大事件揭示 54

10.1 基金份额持有人大会决议 54
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 54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 55
10.4 基金投资策略的改变 55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 55
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 55
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 55
10.8 其他重大事件 58

§11 影响投资者决策的其他重要信息 62

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 62

§12 备查文件目录 62

12.1 备查文件目录 62
12.2 存放地点 62
12.3 查阅方式 62

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金（QDII）
基金简称	华安纳斯达克100ETF（QDII）
场内简称	纳斯达克ETF华安
基金主代码	159632
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2022年7月21日
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	4,839,720,640.00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	2022年8月3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最小化。本基金力求日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.3%，年跟踪误差不超过4%。
投资策略	1、组合复制策略 2、替代性策略 3、股指期货投资策略 4、债券投资策略 5、资产支持证券投资策略 6、融资及转融通证券出借业务投资策略 7、存托凭证投资策略
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	本基金为股票型指数基金，因此本基金的预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金为主要投资于境外证券交易市场的证券投资基金，需要承担汇率风险、境外证券交易市场投资所面临的特别投资风险。

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		华安基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨牧云	王小飞
	联系电话	021-38969999	021-60637103
	电子邮箱	service@huaan.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		4008850099	021-60637228

传真	021-68863414	021-60635778
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区临港新片区环湖西二路888号B楼2118室	北京市西城区金融大街25号
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号国金中心二期31 - 32层	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码	200120	100033
法定代表人	徐勇	张金良

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	-	State Street Bank and Trust Company
	中文	-	美国道富银行
注册地址		-	One Lincoln Street, Boston, Massachusetts 02111, United States of America
办公地址		-	One Lincoln Street, Boston, Massachusetts 02111, United States of America
邮政编码		-	02111

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.huaan.com.cn
基金中期报告置备地点	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号国金中心二期31 - 32层

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-2026年6月30日)
本期已实现收益	279,362,943.38
本期利润	1,551,020,669.75
加权平均基金份额本期利润	0.3229
本期加权平均净值利润率	15.50%

本期基金份额净值增长率	16.00%
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	2,430,457,920.19
期末可供分配基金份额利润	0.5022
期末基金资产净值	11,300,321,355.22
期末基金份额净值	2.3349
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	133.49%

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。

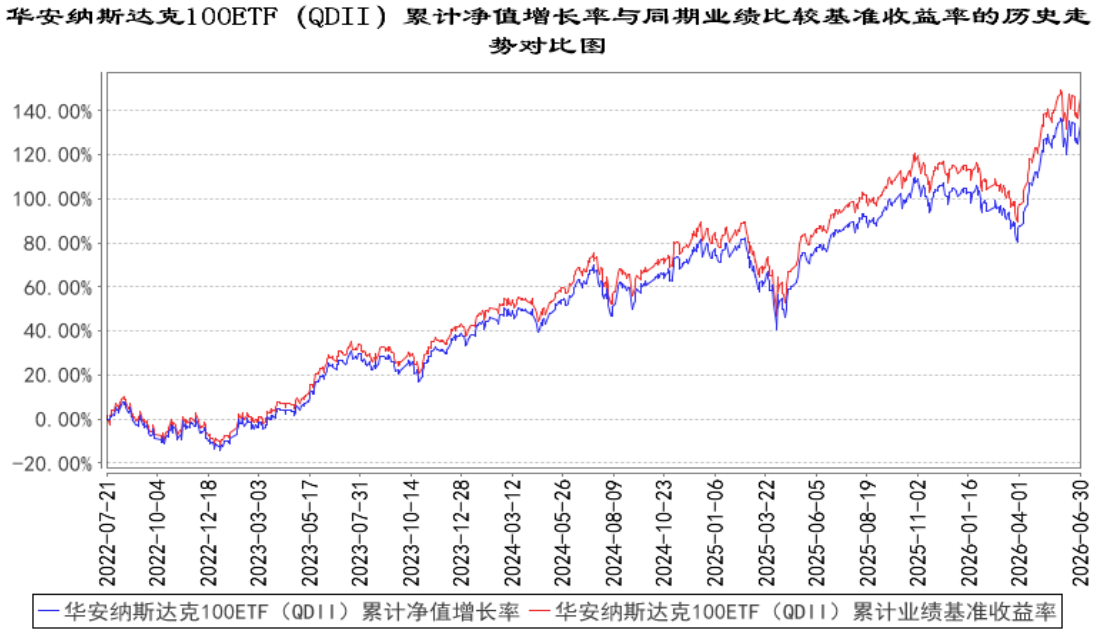
3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

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	25.40%	1.51%	25.53%	1.52%	-0.13%	-0.01%
过去六个月	16.00%	1.39%	16.19%	1.39%	-0.19%	0.00%
过去一年	26.54%	1.18%	27.02%	1.18%	-0.48%	0.00%
过去三年	84.24%	1.28%	88.01%	1.29%	-3.77%	-0.01%
过去五年	-	-	-	-	-	-
过去七年	-	-	-	-	-	-
过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	133.49%	1.36%	145.71%	1.38%	-12.22%	-0.02%

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



§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

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]20 号文批准于 1998 年 6 月设立，是国内首批基金管理公司之一，注册资本 1.5 亿元人民币，公司总部设在上海陆家嘴金融贸易区。目前的股东为国泰海通证券股份有限公司、上海国际集团投资有限公司、国泰君安投资管理股份有限公司、上海工业投资（集团）有限公司和上海锦江国际投资管理有限公司。公司在香港和上海设有子公司——华安资产管理（香港）有限公司、华安未来资产管理（上海）有限公司。截至 2026 年 6 月 30 日，公司旗下共管理华安创新混合、华安中国 A 股增强指数、华安现金富利货币、华安稳定收益债券、华安黄金 ETF、华安沪港深外延增长灵活配置混合、华安美元收益等 303 只证券投资基金，管理资产规模达到 8,198.27 亿元人民币。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
倪斌	指数投资部副总监、本基金的基金经理	2022 年 7 月 21 日	-	15 年	硕士研究生，15 年基金行业从业经历。曾任毕马威华振会计师事务所审计员。2010 年 7 月加入华安基金，历任基金运营部基金会计、指数与量化投资部分析师、基金经理助理。2018 年 9 月起，同时担任华安标普全球石油指数证券投资基金

					（LOF）、华安国际龙头（DAX）交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。2018年9月至2025年3月，同时担任华安CES港股通精选100交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。2018年9月至2022年12月，同时担任华安纳斯达克100指数证券投资基金的基金经理。2022年12月起，同时担任华安纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金联接基金（QDII）（由华安纳斯达克100指数证券投资基金转型而来）的基金经理。2019年6月起，同时担任华安三菱日联日经225交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2020年5月起，同时担任华安法国CAC40交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2021年1月至2022年7月，同时担任华安中证全指证券公司指数型证券投资基金的基金经理。2021年2月至2025年3月，同时担任华安中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021年3月至2022年7月，同时担任华安中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021年4月至2023年11月，同时担任华安中证申万食品饮料交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021年5月起，同时担任华安恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2021年6月至2025年3月，同时担任华安中证沪港深科技100交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021年10月至2025年3月，同时担任华安中证新能源汽车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。2022年4月起，同时担任华安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）的基金经理。2022年7月起，同时担任华安纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2023年1月起，同时担任华安恒生互联网科技业交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2023年12月起，同时担任华安恒生港股通中国央企红利交易型开放式指数证券投资基金的基金

					经理。2024 年 2 月起，同时担任华安恒生互联网科技业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）、华安三菱日联日经 225 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。2024 年 4 月起，同时担任华安恒生港股通中国央企红利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。2024 年 5 月至 2026 年 3 月，同时担任华安中证沪深港黄金产业股票交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 6 月起，同时担任华安法国 CAC40 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。2024 年 11 月至 2024 年 12 月，同时担任华安恒生香港上市生物科技指数型发起式证券投资基金（QDII）的基金经理。2024 年 12 月起，同时担任华安恒生生物科技指数型发起式证券投资基金（QDII）（由华安恒生香港上市生物科技指数型发起式证券投资基金（QDII）转型而来）的基金经理。2025 年 5 月起，同时担任华安恒指港股通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 9 月起，同时担任华安恒生生物科技交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2026 年 5 月至 2026 年 6 月，同时担任华安恒生生物科技指数型发起式证券投资基金的基金经理。2026 年 6 月起，同时担任华安恒生生物科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（由华安恒生生物科技指数型发起式证券投资基金转型而来）的基金经理。

注：此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日，即以公告日为准。证券从业的含义遵从行业协会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

无

4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、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，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，将各投资组合在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括：在研究环节，研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中，使用晨会发言、邮件发送、登录在研究报告管理系统中等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节，公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略，制定并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节，公司实行强制公平交易机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。（1） 交易所二级市场业务，遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则，实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。（2） 交易所一级市场业务，投资组合经理按意愿独立进行业务申报，由集中交易部对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签，则按实际中签情况以比例分配原则进行分配。（3） 银行间市场业务遵循指令时间优先原则，先到先询价的控制原则。交易监控、分析与评估环节，公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上市交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（日内、3日内、5日内）的本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司风险管理部会同基金投资、交易部门讨论制定了各类投资组合针对股票、债券、回购等投资品种在交易所及银行间的同日反向交易控制规则，并在投资系统中进行了设置，实现了完全的系统控制。同时加强了对各类投资组合间的同日反向交易的监控与隔日反向交易的检查；风险管理部开发了同向交易分析系统，对相关同向交易指标进行持续监控，并定期对组合间的同向交易行为进行了重点分析。

本报告期内，因组合流动性管理或投资策略调整需要，除指数基金以外的所有投资组合参与

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%的次数为0次，未出现异常交易。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年，指数走势先抑后扬，一季度，中东地缘冲突持续升级，导致油价暴涨，市场风险偏好大幅下行等，指数随之持续走弱。但二季度，随着地缘冲突的逐步缓和以及AI应用在企业端开始商业化落地，AI主题投资再次成为市场的核心主线。全球算力基础设施、存储芯片、大模型相关产业链景气度持续抬升，头部科技企业资本开支进一步扩张，产业链盈利预期不断上修，推动指数持续上行。整体看，在AI产业趋势推动下，指数在报告期内表现较好。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至2026年6月30日，本基金份额净值为2.3349元，本报告期份额净值增长率为16.00%，同期业绩比较基准增长率为16.19%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为，全球 AI 产业的中长期发展趋势并未发生改变，企业端 AI 智能化改造、算力基础设施建设仍然具备持续的产业驱动力。但经过上半年大幅上涨之后，部分细分板块估值已经处于历史相对高位，交易拥挤度正逐步抬升，市场波动预计将会有所加大。后续需要重点关注如下几方面因素对指数的影响，包括美联储货币政策路径、美国通胀数据变化以及大型科技公司的财报兑现情况等。作为基金管理人，我们继续坚持积极将基金回报与指数相拟合的原则，降低跟踪偏离和跟踪误差，勤勉尽责，为投资者获得长期稳定的回报。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定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。本基金管理人设有估值委员会，负责在证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时，评估重大事件对投资品种价值的影响程度、评估对基金估值的影响程度、确定采用的估值方法、确定该证券的公允价值；同时将采用的估值方法以及采用该方法对相关证券的估值与基金的托管银行进行沟通。估值委员会成员由首席投资官、公司分管运营、专户的领导、指数与量化投资部负责人、固定收益部门负责人、投资研究部负责人、基金组合投资部负责人、基金运营部负责人、产品部负责人、风险管理部负责人、全球投资部负责人等人员组成，具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，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央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期不进行收益分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金无需要说明的情形。

§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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

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，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§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：华安纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金（QDII）

报告截止日：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	496,612,324.25	418,433,340.28
结算备付金		359,053,337.62	285,831,054.10

存出保证金		45,622,173.43	45,519,802.10
交易性金融资产	6.4.7.2	10,409,825,708.27	9,035,994,303.10
其中：股票投资		10,409,825,708.27	9,035,994,303.10
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		1,169,503.54	2,283,820.47
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		11,312,283,047.11	9,788,062,320.05
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		765,222.18	1,010,354.75
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		5,466,253.49	5,037,844.08
应付托管费		1,822,084.47	1,679,281.37
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		3,808,952.80	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	99,178.95	200,000.00
负债合计		11,961,691.89	7,927,480.20
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	4,839,720,640.00	4,858,720,640.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	6,460,600,715.22	4,921,414,199.85

净资产合计		11,300,321,355.22	9,780,134,839.85
负债和净资产总计		11,312,283,047.11	9,788,062,320.05

注：报告截止日2026年06月30日，基金份额净值2.3349元，基金份额总额4,839,720,640.00份。

6.2 利润表

会计主体：华安纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金（QDII）

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		1,591,145,948.63	601,100,553.45
1.利息收入		1,546,573.23	2,198,550.01
其中：存款利息收入	6.4.7.9	1,546,573.23	2,198,550.01
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）		335,351,549.75	-3,850,157.67
其中：股票投资收益	6.4.7.10	194,217,490.10	71,170,644.88
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	113,465,001.37	-104,854,429.06
股利收益	6.4.7.13	27,669,058.28	29,833,626.51
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）	6.4.7.14	1,271,657,726.37	606,067,614.64
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-19,144,746.70	-3,085,978.23
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	1,734,845.98	-229,475.30

减：二、营业总支出		40,125,278.88	37,020,496.48
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	29,691,514.10	27,685,610.73
其中：暂估管理人报酬		-	-
2．托管费	6.4.10.2.2	9,897,171.30	9,228,536.90
3．销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
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	6.4.7.16	-	-
7．税金及附加		431,489.51	-
8．其他费用	6.4.7.17	105,103.97	106,348.85
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,551,020,669.75	564,080,056.97
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,551,020,669.75	564,080,056.97
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1,551,020,669.75	564,080,056.97

6.3 净资产变动表

会计主体：华安纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金（QDII）

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	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	4,858,720,640.00	-	4,921,414,199.85	9,780,134,839.85
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	4,858,720,640.00	-	4,921,414,199.85	9,780,134,839.85
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-19,000,000.00	-	1,539,186,515.37	1,520,186,515.37
（一）、综合收益总额	-	-	1,551,020,669.75	1,551,020,669.75

（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）	-19,000,000.00	-	-11,834,154.38	-30,834,154.38
其中：1.基金申购款	113,000,000.00	-	122,697,905.91	235,697,905.91
2.基金赎回款	-132,000,000.00	-	-134,532,060.29	-266,532,060.29
（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	4,839,720,640.00	-	6,460,600,715.22	11,300,321,355.22

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	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	5,527,720,640.00	-	4,041,566,239.45	9,569,286,879.45
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	5,527,720,640.00	-	4,041,566,239.45	9,569,286,879.45
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-170,000,000.00	-	486,874,268.88	316,874,268.88
（一）、综合收益总额	-	-	564,080,056.97	564,080,056.97
（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	-170,000,000.00	-	-77,205,788.09	-247,205,788.09

填列）				
其中：1.基金申购款	168,000,000.00	-	127,928,902.74	295,928,902.74
2.基金赎回款	-338,000,000.00	-	-205,134,690.83	-543,134,690.83
（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	5,357,720,640.00	-	4,528,440,508.33	9,886,161,148.33

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：

徐勇	任志浩	童欣
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华安纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金（QDII）（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2022]628号《关于准予华安纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金（QDII）注册的批复》的核准，由华安基金管理有限公司向社会公开发行募集。基金合同于2022年7月21日生效，首次设立募集规模为269,720,640.00份基金份额。本基金为交易型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司，境外托管人为道富银行。

经深圳证券交易所（以下简称“深交所”）深证上[2022]713号文核准，本基金269,720,640.00份基金份额于2022年8月3日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《华安纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金合同》和《华安纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金（QDII）

更新的招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股（含存托凭证）及其备选成份股（含存托凭证）、其他股票（包括创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、股指期货、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。基金在境外可投资于已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金（包括开放式基金和交易型开放式指数基金（ETF））；已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等固定收益投资工具；银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品；远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品；以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。本基金将根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：本基金投资标的指数成份股、备选成份股的资产不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%。如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资比例会做相应调整。本基金的业绩比较基准为：纳斯达克100指数收益率（经汇率调整）。

本基金的基金管理人华安基金管理有限公司以本基金为目标 ETF，成立了华安纳斯达克 100交易型开放式指数证券投资基金联接基金（QDII）。华安纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金联接基金（QDII）为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部 （以下简称“财政部”） 颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)的要求，同时亦按照中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《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》、《证券投资基金会计核算业务指引》及中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 6 月 30 日的财务状况、自 2026 年 1 月 1 日起至 2026 年 6 月 30 日止期间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

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》财税[2016]140 号文《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 号文《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》、财税[2025]4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]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》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 目前税收政策法规未对合格境内机构投资者（“QDII”）产品的税收处理给予特别的说明。在法规未有明确说明的情况下，参考现有的针对证券投资基金的税收法规进行处理。

(b) 目前本基金取得的源自境外的差价收入和股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行。

(c) 本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照3%的规定征收率计算缴纳增值税。

本基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入，自2026年1月1日至2027年12月31日，免征增值税；对金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。自2025年8月8日起，对在该日期之后（含当日）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，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在2025年8月8日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。本基金管理人运营本基金提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(d) 对本基金从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。

对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

对内地个人投资者通过沪港通、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。内地个人投资者通过沪港通、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。对本基金通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的股息红利所得，按照上述规定计征个人所得税。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的转让差价所得和通过基金互认买卖香港基金份额取得的转让差价所得，继续暂免征收个人所得税，执行至2027年12月31日。

(e) 对本基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照本基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

(f) 对于本基金通过沪港通、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。

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	496,612,324.25
等于：本金	496,402,695.42
加：应计利息	209,628.83
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	496,612,324.25

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		6,105,309,627.09	-	10,409,825,708.27	4,304,516,081.18
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	6,105,309,627.09	-	10,409,825,708.27	4,304,516,081.18

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	860,905,536.72	-	-	-
其中：股指期货投资	860,905,536.72	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	860,905,536.72	-	-	-

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
NQ2609	NQ2609	211.00	877,306,375.95	16,400,839.23
合计				16,400,839.23
减:可抵销期货暂收款				16,400,839.23
净额				0.00

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.7.5 其他资产

无余额。

6.4.7.6 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	-
预提审计费	39,671.58
预提信息披露费	59,507.37
合计	99,178.95

6.4.7.7 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	4,858,720,640.00	4,858,720,640.00
本期申购	113,000,000.00	113,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-132,000,000.00	-132,000,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	4,839,720,640.00	4,839,720,640.00

注：投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购、赎回单位的整数倍。

6.4.7.8 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	2,158,764,291.57	2,762,649,908.28	4,921,414,199.85
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	2,158,764,291.57	2,762,649,908.28	4,921,414,199.85
本期利润	279,362,943.38	1,271,657,726.37	1,551,020,669.75
本期基金份额交易	-7,669,314.76	-4,164,839.62	-11,834,154.38

产生的变动数			
其中：基金申购款	53,439,637.89	69,258,268.02	122,697,905.91
基金赎回款	-61,108,952.65	-73,423,107.64	-134,532,060.29
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,430,457,920.19	4,030,142,795.03	6,460,600,715.22

6.4.7.9 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	1,546,573.23
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	1,546,573.23

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 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	194,217,490.10
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	194,217,490.10

6.4.7.10.2 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	801,812,049.35
减：卖出股票成本总额	607,495,958.13
减：交易费用	98,601.12
买卖股票差价收入	194,217,490.10

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
赎回基金份额对价总额	266,532,060.29
减：现金支付赎回款总额	266,532,060.29
减：赎回股票成本总额	-
减：交易费用	-
赎回差价收入	-

6.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.12 衍生工具收益

6.4.7.12.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.12.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股指期货投资收益	113,465,001.37

6.4.7.13 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	27,669,058.28
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	27,669,058.28

6.4.7.14 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	1,254,490,828.31

股票投资	1,254,490,828.31
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	17,166,898.06
权证投资	-
期货投资	17,166,898.06
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	1,271,657,726.37

6.4.7.15 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	1,734,845.98
合计	1,734,845.98

6.4.7.16 信用减值损失

无。

6.4.7.17 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	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	5,925.02
合计	105,103.97

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

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

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

无。

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
华安基金管理有限公司（“华安基金”）	基金管理人
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	基金托管人
道富银行（State Street Bank and Trust Company）	基金境外托管人
国泰海通证券股份有限公司（“国泰海通证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
华安纳斯达克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

注：（1）关联方国泰海通证券股份有限公司（以下简称“国泰海通”）是由原国泰君安证券股份有限公司与原海通证券股份有限公司于2025年3月14日合并组建而成。

（2）下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 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

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 基金交易

无。

6.4.10.1.5 权证交易

无。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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	29,691,514.10	27,685,610.73
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,175,576.16	1,616,921.00
应支付基金管理人的净管理费	27,515,937.94	26,068,689.73

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的0.60%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×基金管理费年费率/当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

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	9,897,171.30	9,228,536.90

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.20%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×基金托管费年费率/当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

基金管理人本报告期及上年度可比期间均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（%）
中国建设银行股份有限公司－华安纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金联接基金（QDII）	2,778,611,159.00	57.41	3,168,564,659.00	65.21

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
建设银行	283,901,355.42	486,235.55	98,022,809.56	736,641.94
道富银行	212,710,968.83	1,060,337.68	291,300,101.37	1,461,908.07

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

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

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为股票型指数基金，因此本基金的预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金为主要投资于境外证券交易市场的证券投资基金，需要承担汇率风险、境外证券交易市场投资所面临的特别投资风险。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。本基金完全按照标的指数的成份股组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,但因特殊情况(如流动性不足、成份股长期停牌、法律法规限制等)导致无法获得足够数量的股票时，本基金可以选择其他证券或证券组合对标的指数中的股票加以替换，从而能够紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人建立了董事会、审计委员会、管理层、合规与风险管理委员会、督察长、合规监察稽核部、风险管理部与部门风险合规员各负其责的多层次的风险管理体系，形成高效运转、有效制衡的监督约束机制，保证风险管理的贯彻执行。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，负责制订公司的风险管理政策，颁布统一的风险定义和风险评估标准；在管理层层面设立合规与风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由合规监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成风险管理各项工作。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。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，通过特定的风险量化指标、模型，形成常规的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款

存放在经中国人民银行和中国证券监督管理委员会所批准的具有基金托管资格和基金代销资格的银行及其委托的境外托管行，并根据本基金的基金管理人管理交易对手的经验进行筛选，因而与这些银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小；在场外交易市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

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》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》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。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的 10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的 3%。本基金持有非流动性资产市值不得超过基金净值的 10%，持有境外基金的市值合计不得超过基金净值的 10%（持有货币市场基金可以不受上述限制）。且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一只境外基金不得超过该境外基金总份额的 20%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上

市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%。

本基金所持证券在证券交易所上市，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金资产净值的 10%。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%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。

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。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因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的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对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及存出保证金等。

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	496,612,324.25	-	-	-	496,612,324.25
结算备付金	-	-	-	359,053,337.62	359,053,337.62
存出保证金	-	-	-	45,622,173.43	45,622,173.43
交易性金融资产	-	-	-	10,409,825,708.27	10,409,825,708.27
应收股利	-	-	-	1,169,503.54	1,169,503.54
资产总计	496,612,324.25	-	-	10,815,670,722.86	11,312,283,047.11
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	5,466,253.49	5,466,253.49
应付托管费	-	-	-	1,822,084.47	1,822,084.47
应付清算款	-	-	-	765,222.18	765,222.18
应交税费	-	-	-	3,808,952.80	3,808,952.80
其他负债	-	-	-	99,178.95	99,178.95
负债总计	-	-	-	11,961,691.89	11,961,691.89
利率敏感度缺口	496,612,324.25	-	-	10,803,709,030.97	11,300,321,355.22
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	418,433,340.28	-	-	-	418,433,340.28
结算备付金	-	-	-	285,831,054.10	285,831,054.10
存出保证金	-	-	-	45,519,802.10	45,519,802.10
交易性金融资产	-	-	-	9,035,994,303.10	9,035,994,303.10
应收股利	-	-	-	2,283,820.47	2,283,820.47
资产总计	418,433,340.28	-	-	9,369,628,979.77	9,788,062,320.05
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	5,037,844.08	5,037,844.08
应付托管费	-	-	-	1,679,281.37	1,679,281.37
应付清算款	-	-	-	1,010,354.75	1,010,354.75
其他负债	-	-	-	200,000.00	200,000.00
负债总计	-	-	-	7,927,480.20	7,927,480.20
利率敏感度缺口	418,433,340.28	-	-	9,361,701,499.57	9,780,134,839.85

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2026年06月30日，本基金未持有交易性债券投资(2025年12月31日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2025年12月31日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

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	212,722,673.57	-	-	212,722,673.57
结算备付金	359,053,337.62	-	-	359,053,337.62
存出保证金	45,622,173.43	-	-	45,622,173.43
交易性金融资产	10,409,825,708.27	-	-	10,409,825,708.27
应收股利	1,169,503.54	-	-	1,169,503.54
资产合计	11,028,393,396.43	-	-	11,028,393,396.43
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	11,028,393,396.43	-	-	11,028,393,396.43

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	189,395,797.97	-	-	189,395,797.97
结算备付金	285,831,054.10	-	-	285,831,054.10
存出保证金	45,519,802.10	-	-	45,519,802.10
交易性金融资产	9,035,994,303.10	-	-	9,035,994,303.10
应收股利	2,283,820.47	-	-	2,283,820.47
资产合计	9,559,024,777.74	-	-	9,559,024,777.74
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	9,559,024,777.74	-	-	9,559,024,777.74

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%	551,419,669.82	477,951,238.89
	所有外币相对人民	-551,419,669.82	-477,951,238.89

	币贬值5%		

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组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。根据标的指数，结合研究报告，基金经理以完全复制标的指数成分股权重方法构建组合。基金经理将跟踪标的指数变动，结合成份股基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果，对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%。为有效控制指数的跟踪误差，本基金在注重风险管理的前提下，将适度运用股指期货。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 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	10,409,825,708.27	92.12	9,035,994,303.10	92.39
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
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	10,409,825,708.27	92.12	9,035,994,303.10	92.39

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注6.4.7.3)。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为0。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	基金的市场价格风险决定于业绩比较基准的变动		
	除上述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 ）
	业绩比较基准上升5%	563,468,258.22	481,382,182.14
	业绩比较基准下降5%	-563,468,258.22	-481,382,182.14

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	上年度末 2025年12月31日
第一层次	10,409,825,708.27	9,035,994,303.10
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	10,409,825,708.27	9,035,994,303.10

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，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投资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，确定相关投资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

本基金本报告期末及上年度末均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

6.4.15.1　承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.15.2　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。

6.4.15.3　财务报表的批准

本财务报表已于2026年08月26日经本基金的基金管理人批准。

§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	10,409,825,708.27	92.02
	其中：普通股	10,237,372,726.08	90.50
	存托凭证	172,452,982.19	1.52
	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	855,665,661.87	7.56
8	其他各项资产	46,791,676.97	0.41
9	合计	11,312,283,047.11	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	10,409,825,708.27	92.12
合计	10,409,825,708.27	92.12

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

7.3.1 期末指数投资按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
能源	47,192,126.33	0.42
原材料	108,511,101.74	0.96
工业	359,697,147.69	3.18
非日常生活消费品	1,110,359,403.70	9.83
日常消费品	649,034,149.96	5.74
医疗保健	370,552,833.93	3.28
金融	17,188,950.71	0.15
信息技术	6,370,008,164.93	56.37
通信服务	1,258,979,477.75	11.14
公用事业	118,302,351.53	1.05
房地产	-	-
合计	10,409,825,708.27	92.12

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

7.3.2 期末积极投资按行业分类的权益投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

7.4.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称	公司名称（中	证券代码	所在证券市场	所属国家（地	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比

	（英文）	文）			区）			例（%）
1	NVIDIA CORP	英伟达公司	NVDA US	美国	美国	580,341	790,884,641.39	7.00
2	APPLE INC	苹果公司	AAPL US	美国	美国	352,247	694,209,100.55	6.14
3	MICRON TECHNOLOGY INC	美光科技股份有限公司	MU US	美国	美国	74,661	586,966,397.55	5.19
4	MICROSOFT CORP	微软公司	MSFT US	美国	美国	178,181	452,686,990.35	4.01
5	ADVANCED MICRO DEVICES	AMD公司	AMD US	美国	美国	107,946	427,090,499.18	3.78
6	AMAZON.COM INC	亚马逊公司	AMZN US	美国	美国	258,029	418,861,031.74	3.71
7	TESLA INC	特斯拉公司	TSLA US	美国	美国	119,841	343,304,263.14	3.04
8	ALPHABET INC-CL A	Alphabet股份有限公司	GOOGL US	美国	美国	139,728	340,099,535.54	3.01
9	INTEL CORP	英特尔公司	INTC US	美国	美国	332,764	316,460,549.60	2.80
10	ALPHABET INC-CL C	Alphabet股份有限公司	GOOG US	美国	美国	130,897	315,003,014.89	2.79
11	BROADCOM INC	博通股份有限公司	AVGO US	美国	美国	113,736	292,621,968.34	2.59
12	META PLATFORMS INC-CLASS A	Meta平台股份有限公司	META US	美国	美国	71,030	272,507,437.49	2.41

13	APPLIED MATERIALS INC	应用材料公司	AMAT US	美国	美国	52,607	259,051,634.78	2.29
14	WALMART INC	沃尔玛股份有限公司	WMT US	美国	美国	323,000	249,163,018.48	2.20
15	LAM RESEARCH CORP	泛林集团	LRCX US	美国	美国	82,814	244,414,531.33	2.16
16	CISCO SYSTEMS INC	思科公司	CSCO US	美国	美国	261,009	208,809,370.03	1.85
17	COSTCO WHOLESALE CORP	开市客公司	COST US	美国	美国	29,434	187,535,570.47	1.66
18	KLA CORP	科磊公司	KLAC US	美国	美国	86,510	177,770,838.44	1.57
19	SANDISK CORP	闪迪公司/特拉华州	SNDK US	美国	美国	9,900	153,312,861.80	1.36
20	NETFLIX INC	奈飞公司	NFLX US	美国	美国	278,830	135,594,543.84	1.20
21	PALO ALTO NETWORKS INC	派拓网络公司	PANW US	美国	美国	54,038	125,511,529.19	1.11
22	TEXAS INSTRUMENTS INC	德州仪器公司	TXN US	美国	美国	60,324	122,465,258.27	1.08
23	PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	Palantir技术股份有限公司	PLTR US	美国	美国	152,037	120,812,812.08	1.07
24	MARVE		MRVL	美国	美国	57,929	117,532,090.23	1.04

	LL TECHNOLOGY INC	迈威迩电子科技股份有限公司	US					
25	LINDE PLC	林德公司	LIN US	美国	美国	30,701	108,511,101.74	0.96
26	WESTERN DIGITAL CORP	西部数据公司	WDC US	美国	美国	22,800	99,185,883.49	0.88
27	SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	Seagate Technology控股公共有限公司	STX US	美国	美国	14,800	97,273,273.80	0.86
28	AMGEN INC	安进公司	AMGN US	美国	美国	35,825	88,357,458.34	0.78
29	QUALCOMM INC	高通公司	QCOM US	美国	美国	69,809	87,860,644.80	0.78
30	CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	CrowdStrike控股股份有限公司	CRWD US	美国	美国	16,896	87,819,836.14	0.78
31	ANALOG DEVICES INC	亚德诺半导体公司	ADI US	美国	美国	32,263	87,274,162.29	0.77
32	PEPSICO INC	百事公司	PEP US	美国	美国	90,563	83,516,823.67	0.74
33	T-MOBILE US INC	T-Mobile US股份有限公司	TMUS US	美国	美国	71,695	81,903,812.87	0.72
34	ASML	阿斯麦	ASML	美国	美国	6,035	81,773,507.07	0.72

	HOLDING NV-NY REG SHS	控股公司	US					
35	APPLOVIN CORP-CLASS A	AppLovin公司	APP US	美国	美国	20,245	71,043,349.24	0.63
36	GILEAD SCIENCES INC	吉利德科学公司	GILD US	美国	美国	82,285	70,805,346.09	0.63
37	ARM HOLDINGS PLC-ADR	ARM控股公共有限公司	ARM US	美国	美国	28,037	67,707,695.57	0.60
38	INTUITIVE SURGICAL INC	直觉外科手术公司	ISRG US	美国	美国	23,447	63,507,576.12	0.56
39	SHOPIFY INC - CLASS A	Shopify股份有限公司	SHOP US	美国	美国	80,804	62,838,730.48	0.56
40	BOOKING HOLDINGS INC	缤客控股公司	BKNG US	美国	美国	51,375	62,367,956.17	0.55
41	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	福泰制药公司	VRTX US	美国	美国	16,830	56,938,891.75	0.50
42	STARBUCKS CORP	星巴克公司	SBUX US	美国	美国	75,460	52,520,603.03	0.46
43	FORTI	飞塔信	FTNT	美国	美国	48,547	50,794,262.86	0.45

	NET INC	息	US					
44	CADENCE DESIGN SYS INC	铿腾电子科技有限公司	CDNS US	美国	美国	18,352	46,912,611.76	0.42
45	MARRIOTT INTERNATIONAL - CL A	万豪国际集团	MAR US	美国	美国	17,511	44,198,664.61	0.39
46	MONSTER BEVERAGE CORP	怪兽饮料公司	MNST US	美国	美国	64,834	42,444,466.84	0.38
47	CONSTELLATION ENERGY	美国联合能源公司	CEG US	美国	美国	23,940	40,497,460.20	0.36
48	AUTOMATIC DATA PROCESSING	自动数据处理公司	ADP US	美国	美国	26,526	40,460,135.78	0.36
49	CSX CORP	CSX公司	CSX US	美国	美国	123,100	39,850,187.68	0.35
50	COMCAST CORP-CLASS A	康卡斯特公司	CMCSA US	美国	美国	235,933	39,449,789.51	0.35
51	MERCADOLIBRE INC	自由市场公司	MELI US	美国	美国	3,401	39,318,122.83	0.35
52	DATADOG INC - CLASS A	数据狗	DDOG US	美国	美国	21,959	38,939,585.61	0.34
53	SYNOP	新思科	SNPS	美国	美国	12,676	38,511,439.35	0.34

	SYS INC	技公司	US					
54	ADOBE INC	奥多比公司	ADBE US	美国	美国	26,826	37,459,040.88	0.33
55	ASTERA LABS INC	Astera Labs股份有限公司	ALAB US	美国	美国	11,300	37,174,750.37	0.33
56	O'REILLY AUTOMOTIVE INC	奥莱利汽车公司	ORLY US	美国	美国	54,921	34,447,317.91	0.30
57	DOORDASH INC - A	DoorDash股份有限公司	DASH US	美国	美国	27,326	34,343,736.99	0.30
58	TERADYNE INC	泰瑞达	TER US	美国	美国	10,300	33,942,474.32	0.30
59	AMERICAN ELECTRIC POWER	美国电力公司	AEP US	美国	美国	36,083	33,622,111.58	0.30
60	MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	亿滋国际公司	MDLZ US	美国	美国	84,998	33,484,320.88	0.30
61	INTUIT INC	财捷集团	INTU US	美国	美国	18,160	32,282,031.38	0.29
62	NXP SEMICONDUCTORS NV	恩智浦半导体公司	NXPI US	美国	美国	16,743	32,047,227.58	0.28
63	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	霍尼韦尔国际公司	HON US	美国	美国	20,986	32,002,821.26	0.28
64	HONEY		HONA	美国	美国	20,986	31,599,748.66	0.28

	WELL AEROSPACE INC	霍尼韦尔航空航天股份有限公司	US					
65	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	芯源系统有限公司	MPWR US	美国	美国	3,300	31,069,881.89	0.27
66	ROSS STORES INC	罗斯百货股份有限公司	ROST US	美国	美国	21,404	31,029,380.19	0.27
67	CINTAS CORP	信达思公司	CTAS US	美国	美国	26,579	30,789,057.04	0.27
68	WARNER BROS DISCOVERY INC	华纳兄弟探索股份有限公司	WBD US	美国	美国	166,017	30,145,133.44	0.27
69	LUMENTUM HOLDINGS INC	Lumentum控股股份有限公司	LITE US	美国	美国	5,100	29,805,220.36	0.26
70	REGENERON PHARMACEUTICALS	再生元制药股份有限公司	REGN US	美国	美国	6,829	29,001,865.57	0.26
71	PACCAR INC	帕卡公司	PCAR US	美国	美国	34,845	28,507,576.36	0.25
72	NEBIUS GROUP NV	Nebius集团股份有限公司	NBIS US	美国	美国	14,500	27,274,010.67	0.24
73	AIRBNB INC-CLASS A	爱彼迎股份有限公司	ABNB US	美国	美国	27,699	26,996,547.54	0.24

74	ROCKET LAB CORP	Rocket Lab公司	RKLB US	美国	美国	38,300	26,516,161.83	0.23
75	FASTENAL CO	法思诺公司	FAST US	美国	美国	76,009	24,864,636.20	0.22
76	BAKER HUGHES CO	贝克休斯公司	BKR US	美国	美国	65,704	24,836,437.23	0.22
77	ELECTRONIC ARTS INC	艺电公司	EA US	美国	美国	16,614	23,201,566.23	0.21
78	PDD HOLDINGS INC	拼多多控股公司	PDD US	美国	美国	44,216	22,971,779.55	0.20
79	XCEL ENERGY INC	Xcel能源股份有限公司	XEL US	美国	美国	41,422	22,654,324.31	0.20
80	FERROVIAL NV	Ferrovial股份有限公司	FER US	美国	美国	48,165	22,507,304.57	0.20
81	DIAMONDBACK ENERGY INC	戴蒙德巴克能源	FANG US	美国	美国	18,673	22,355,689.10	0.20
82	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	微芯科技股份有限公司	MCHP US	美国	美国	35,942	22,325,519.94	0.20
83	EXELON CORP	爱克斯龙公司	EXC US	美国	美国	67,801	21,528,455.44	0.19
84	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	Take-Two互动软件股份有限公司	TTWO US	美国	美国	12,378	21,074,643.94	0.19

85	AXON ENTERPRISE INC	Axon Enterprise股份有限公司	AXON US	美国	美国	5,376	20,526,958.50	0.18
86	OLD DOMINION FREIGHT LINE	奥多明尼昂货运	ODFL US	美国	美国	13,791	20,345,047.80	0.18
87	COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS	可口可乐欧洲合伙公开股份公司	CCEP US	美国	美国	29,608	20,179,828.72	0.18
88	KEURIG DR PEPPER INC	克里格胡椒博士	KDP US	美国	美国	90,073	20,079,141.35	0.18
89	COREWEAVE INC-CL A	CoreWeave股份有限公司	CRWV US	美国	美国	29,600	20,067,526.79	0.18
90	IDEXX LABORATORIES INC	爱德士股份有限公司	IDXX US	美国	美国	5,253	18,834,790.12	0.17
91	AUTODESK INC	欧特克公司	ADSK US	美国	美国	13,976	18,506,672.29	0.16
92	ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	艾拉伦制药股份有限公司	ALNY US	美国	美国	8,900	18,247,538.52	0.16
93	PAYPAL HOLDINGS INC	贝宝	PYPL US	美国	美国	58,447	17,188,950.71	0.15

94	PAYCHEX INC	沛齐公司	PAYX US	美国	美国	23,769	15,918,474.78	0.14
95	ROPER TECHNOLOGIES INC	儒博技术公司	ROP US	美国	美国	6,724	15,497,074.79	0.14
96	THOMSON REUTERS CORP	汤森路透公司	TRI US	美国	美国	25,239	14,039,097.92	0.12
97	GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	GE医疗技术公司	GEHC US	美国	美国	30,114	13,128,671.36	0.12
98	STRATEGY INC	Strategy股份有限公司	MSTR US	美国	美国	21,821	12,919,593.01	0.11
99	KRAFT HEINZ CO/THE	卡夫亨氏公司	KHC US	美国	美国	78,515	12,630,979.55	0.11
100	COPART INC	科帕特公司	CPRT US	美国	美国	61,302	11,769,939.31	0.10
101	DEXCOM INC	德康医疗	DXCM US	美国	美国	25,573	11,730,696.06	0.10
102	WORKDAY INC-CLASS A	Workday股份有限公司	WDAY US	美国	美国	13,314	11,101,085.09	0.10

7.4.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	WALMART INC	WMT US	281,285,320.22	2.88

2	SANDISK CORP	SNDK US	63,807,584.56	0.65
3	ARM HOLDINGS PLC-ADR	ARM US	52,062,747.63	0.53
4	TESLA INC	TSLA US	39,343,697.96	0.40
5	ASTERA LABS INC	ALAB US	33,857,996.77	0.35
6	TERADYNE INC	TER US	32,078,886.50	0.33
7	LUMENTUM HOLDINGS INC	LITE US	30,342,343.56	0.31
8	NEBIUS GROUP NV	NBIS US	28,025,631.18	0.29
9	ROCKET LAB CORP	RKLB US	26,177,144.21	0.27
10	COREWEAVE INC-CL A	CRWV US	22,449,863.96	0.23
11	NVIDIA CORP	NVDA US	13,606,444.88	0.14
12	INTEL CORP	INTC US	9,270,246.70	0.09
13	PALO ALTO NETWORKS INC	PANW US	9,107,870.62	0.09
14	AMAZON.COM INC	AMZN US	7,397,458.85	0.08
15	MICROSOFT CORP	MSFT US	7,308,566.46	0.07
16	CONSTELLATION ENERGY	CEG US	6,229,154.88	0.06
17	ALPHABET INC-CL C	GOOG US	6,217,274.83	0.06
18	APPLE INC	AAPL US	5,975,580.77	0.06
19	ALPHABET INC-CL A	GOOGL US	5,304,704.98	0.05
20	BROADCOM INC	AVGO US	3,894,276.25	0.04

注：本项“买入金额”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	NVIDIA CORP	NVDA US	70,184,118.10	0.72
2	APPLE INC	AAPL US	54,683,672.45	0.56
3	MICROSOFT CORP	MSFT US	44,468,518.98	0.45
4	AMAZON.COM INC	AMZN US	33,680,750.88	0.34
5	ALPHABET INC-CL A	GOOGL US	27,327,174.15	0.28
6	CISCO SYSTEMS INC	CSCO US	26,630,811.88	0.27
7	ASTRAZENECA PLC-SPONS ADR	AZN US	26,217,949.78	0.27
8	ALPHABET INC-CL C	GOOG US	24,466,362.78	0.25
9	TESLA INC	TSLA US	22,875,153.29	0.23
10	META PLATFORMS INC-CLASS A	META US	22,404,409.67	0.23

11	MICRON TECHNOLOGY INC	MU US	21,982,110.07	0.22
12	BROADCOM INC	AVGO US	21,743,826.41	0.22
13	ADVANCED MICRO DEVICES	AMD US	17,510,506.48	0.18
14	TEXAS INSTRUMENTS INC	TXN US	14,543,310.33	0.15
15	NETFLIX INC	NFLX US	13,943,196.60	0.14
16	WALMART INC	WMT US	13,060,133.16	0.13
17	COSTCO WHOLESALE CORP	COST US	12,856,579.93	0.13
18	LAM RESEARCH CORP	LRCX US	12,555,344.74	0.13
19	INTEL CORP	INTC US	12,440,681.20	0.13
20	PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	PLTR US	12,333,795.43	0.13

注：本项“卖出金额”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。

7.5.3 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	726,646,838.82
卖出收入（成交）总额	801,812,049.35

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（成交）总额”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。

7.6 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	期货品种_股指	NQ2609	-	-

注：按照期货每日无负债结算的结算规则，根据《基金股指期货投资会计业务核算细则(试行)》

及《企业会计准则-金融工具列报》的相关规定，“其他衍生工具-期货投资”与“证券清算款-期货每日无负债结算暂收暂付款”，符合金融资产与金融负债相抵销的条件，故将“其他衍生工具-期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。期货投资的公允价值变动金额为人民币16,400,839.23元，已包含在结算备付金中。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同约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	45,622,173.43
2	应收清算款	-
3	应收股利	1,169,503.54
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	46,791,676.97

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

7.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前五名积极投资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

8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
54,120	89,425.73	3,267,699,473.00	67.52	1,572,021,167.00	32.48

8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额（份）	占总份额比例（%）
中国建设银行股份有限公司－华安纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金联接基金（QDII）	2,778,611,159.00	57.41

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

无。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

无。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2022年7月21日）基金份额总额	269,720,640.00
本报告期期初基金份额总额	4,858,720,640.00
本报告期基金总申购份额	113,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	132,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	4,839,720,640.00

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

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

1、本报告期内本基金管理人重大人事变动如下：

2026年4月30日，基金管理人发布了《华安基金管理有限公司关于总经理变更的公告》，张霄岭先生离任本基金管理人的总经理，方一天先生新任本基金管理人的总经理。

2026年4月30日，基金管理人发布了《华安基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，严涛先生新任本基金管理人的首席市场官。

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

无。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金财产、基金托管业务的诉讼。报告期内基金管理人无涉及本基金财产的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

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为基金审计的会计师事务所。

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

本报告期内无管理人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

本报告期内无管理人相关从业人员受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内无托管人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

本报告期内无托管人相关从业人员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(%)	
Goldman Sachs	-	945,930,792.07	61.89	61,442.29	66.20	-
Morgan	-	499,562,751.0	32.68	27,267.07	29.38	-

Stanley		6				
Instinet	-	82,965,345.01	5.43	4,109.50	4.43	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
诚通证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	3	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰海通	3	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	4	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

注：1、选择证券公司参与证券交易的标准：

基金管理人负责选择证券公司，租用证券公司交易单元进行证券投资，或委托证券公司办理证券投资，选择标准为：

（1）财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力较强，内部管理规范，具备健全的内控制度；

（2）提供研究服务的证券公司应当具备较好的研究能力和行业分析能力，有专门的研究服务团队，提供高质量的研究报告和较为全面的投研服务与支持；

（3）交易服务能力较强，具备证券交易所需的高效、安全的通讯条件，满足基金进行证券交易或结算的需要。

2、选择证券公司参与证券交易的程序：

（1）证券公司的尽职调查

根据证券公司选择标准及相关内控制度要求，对证券公司进行甄选并对其开展尽职调查。

（2）证券公司的准入评估

对证券公司的财务状况、经营行为、合规风控能力、交易、研究等服务能力进行综合评估，并经公司相关内部审批程序后完成证券公司准入。

（3）证券公司的审批程序

公司领导对证券公司综合评估的结果进行审核，并签署审批意见。

（4）协议签署及通知托管人

基金管理人与证券公司签订相关协议，并通知基金托管人。

3、报告期内基金使用证券公司交易单元的变更情况：

新增交易单元的证券公司：中信建投（002059）。

撤销交易单元的证券公司：无。

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(%)
Goldman Sachs	-	-	-	-	-	-	-	-
Morgan Stanley	-	-	-	-	-	-	-	-
Instinet	-	-	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-

国泰海通	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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	华安基金管理有限公司关于华安纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金(QDII)二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026年1月6日
2	华安基金管理有限公司关于华安纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金(QDII)二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026年1月7日
3	关于华安纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金（QDII）2026年境外主要市场节假日暂停申购、赎回的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026年1月14日
4	华安基金管理有限公司关于华安纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金(QDII)二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026年1月16日
5	华安纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金（QDII）2025年第4季度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026年1月22日
6	华安基金管理有限公司旗下部分基	中国证监会基金电子披	2026年1月22日

	金2025年第4季度报告的提示性公告	露网站和公司网站等规定媒介	
7	华安基金管理有限公司关于调整旗下部分基金风险等级的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026年1月30日
8	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加光大证券股份有限公司为一级交易商的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026年2月4日
9	华安纳斯达克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	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026年2月27日
10	华安纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金（QDII）更新的招募说明书（2026年第1号）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026年2月27日
11	华安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	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026年3月5日
12	华安纳斯达克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	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026年3月6日
13	华安基金管理有限公司旗下部分基金2025年年度报告的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026年3月31日
14	华安基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025年度）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026年3月31日
15	华安纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金（QDII）2025年年度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026年3月31日
16	华安基金管理有限公司关于华安纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金(QDII)二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026年4月9日
17	华安基金管理有限公司旗下部分基金2026年第1季度报告的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026年4月22日
18	华安纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金（QDII）2026年第1季度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026年4月22日
19	华安基金管理有限公司关于总经理变更的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026年4月30日
20	华安基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规	2026年4月30日

		定媒介	
21	2025年度华安基金管理有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026年4月30日
22	华安基金管理有限公司关于华安纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金（QDII）二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026年5月26日
23	华安基金管理有限公司关于华安纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金（QDII）二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026年5月27日
24	华安基金管理有限公司关于华安纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金（QDII）二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026年5月28日
25	华安基金管理有限公司关于华安纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金（QDII）二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026年5月29日
26	华安基金管理有限公司关于华安纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金（QDII）二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026年6月1日
27	华安基金管理有限公司关于华安纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金（QDII）二级市场交易价格溢价风险提示及停复牌公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026年6月2日
28	华安基金管理有限公司关于华安纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金（QDII）二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026年6月3日
29	华安基金管理有限公司关于华安纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金（QDII）二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026年6月4日
30	华安基金管理有限公司关于华安纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金（QDII）二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026年6月10日
31	华安基金管理有限公司关于华安纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金（QDII）二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026年6月11日

32	华安基金管理有限公司关于华安纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金（QDII）二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026年6月12日
33	华安基金管理有限公司关于华安纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金（QDII）二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026年6月16日
34	华安基金管理有限公司关于华安纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金（QDII）二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026年6月17日
35	华安基金管理有限公司关于华安纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金（QDII）二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026年6月18日
36	华安基金管理有限公司关于华安纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金（QDII）二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026年6月22日
37	华安基金管理有限公司关于华安纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金（QDII）二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026年6月23日
38	华安基金管理有限公司关于华安纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金（QDII）二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026年6月25日
39	华安基金管理有限公司关于华安纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金（QDII）二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026年6月26日
40	华安基金管理有限公司关于华安纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金（QDII）二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026年6月29日
41	华安基金管理有限公司关于华安纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金（QDII）二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026年6月30日

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在规定媒介上披露。

§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（%）
联接基金	1	20260101~20260630	3,168,564,659.00	5,000,000.00	394,953,500.00	2,778,611,159.00	57.41
产品特有风险							
本基金报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%的情形。如该单一投资者大额赎回将可能导致基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。							

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、《华安纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金合同》

2、《华安纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金（QDII）招募说明书》

3、《华安纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金（QDII）托管协议》

4、中国证监会批准华安纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金（QDII）设立的文件；

5、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件；

6、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；

7、基金托管人业务资格批件和营业执照；

8、华安基金管理有限公司开放式基金业务规则；

12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所，并登载于基金管理人互联网站http://www.huaan.com.cn。

12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的住所免费查阅。

华安基金管理有限公司

2026年8月31日