

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

2026 年 06 月 30 日

基金管理人：招商基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

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及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。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 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 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	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人	5
2.5 信息披露方式	5
2.6 其他相关资料	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	6
§4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
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	9
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
§5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	11
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	16
§7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	36
7.3 期末按行业分类的权益投资组合	36
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细	37
7.5 报告期内股票投资组合的重大变动	42
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	44
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	44
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	44

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	44
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	44
7.11 投资组合报告附注	44
§8 基金份额持有人信息	45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	46
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	46
§9 开放式基金份额变动	46
§10 重大事件揭示	46
10.1 基金份额持有人大会决议	46
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	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	46
10.4 基金投资策略的改变	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	47
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	47
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	47
10.8 其他重大事件	52
§11 影响投资者决策的其他重要信息	55
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	55
§12 备查文件目录	56
12.1 备查文件目录	56
12.2 存放地点	56
12.3 查阅方式	56

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	招商纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）
基金简称	招商纳斯达克 100ETF（QDII）
场内简称	纳斯达克 100ETF 招商
基金主代码	159659
交易代码	159659
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 4 月 12 日
基金管理人	招商基金管理有限公司
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	4,475,744,064.00 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	2023 年 4 月 25 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份券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券及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情形导致基金无法完全投资于标的指数成份券时，基金管理人可采取包括成份券替代策略在内的其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的。特殊情形包括但不限于：（1）法律法规的限制；（2）标的指数成份券流动性严重不足；（3）标的指数的成份券长期停牌；（4）标的指数成份券进行配股或增发；（5）标的指数成份券派发现金股息；（6）标的指数编制方法发生变化；（7）其他可能严重限制本基金跟踪标的指数的合理原因等。 本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35% 以内，年化跟踪误差控制在 4% 以内。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致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误差进一步扩大。 对于出现市场流动性不足、因法律法规原因个别成份券被限制投资等情况，导致本基金无法获得足够数量的成份券时，基金管理人将通过投资成份券、备选成份券、非成份券、成份券衍生品等进行替代，运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近标的指数的表现。 本基金其他主要投资策略包括：债券投资策略、资产支持证券投资策略、衍生品投资策略、存托凭证投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略。

业绩比较基准	纳斯达克 100 指数收益率（经汇率调整后）
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金。 本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要采用完全复制策略跟踪标的指数的表现，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。 本基金可以投资境外市场。本基金除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，还面临因投资境外市场所带来的汇率风险等特有风险。

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	招商基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	潘西里
	联系电话	0755-83196666
	电子邮箱	cmf@cmfchina.com
客户服务电话	400-887-9555	95566
传真	0755-83196475	010-66594942
注册地址	深圳市福田区深南大道 7088 号	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	深圳市福田区深南大道 7088 号	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	518040	100818
法定代表人	王颖	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	中文	- 摩根大通银行
	英文	- JPMorgan Chase Bank, National Association
注册地址	-	1111 Polaris Parkway, Columbus, OH 43240, U.S.A.
办公地址	-	270 Park Avenue, New York, New York 10017
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	http://www.cmfcchina.com
基金中期报告置备地点	基金管理人及基金托管人住所

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	55,096,933.67
本期利润	1,337,678,475.96
加权平均基金份额本期利润	0.3125
本期加权平均净值利润率	15.81%
本期基金份额净值增长率	16.19%
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	611,884,447.28
期末可供分配基金份额利润	0.1367
期末基金资产净值	9,935,783,271.40
期末基金份额净值	2.2199
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	121.99%

注：1、基金业绩指标不包括持有人认（申）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。

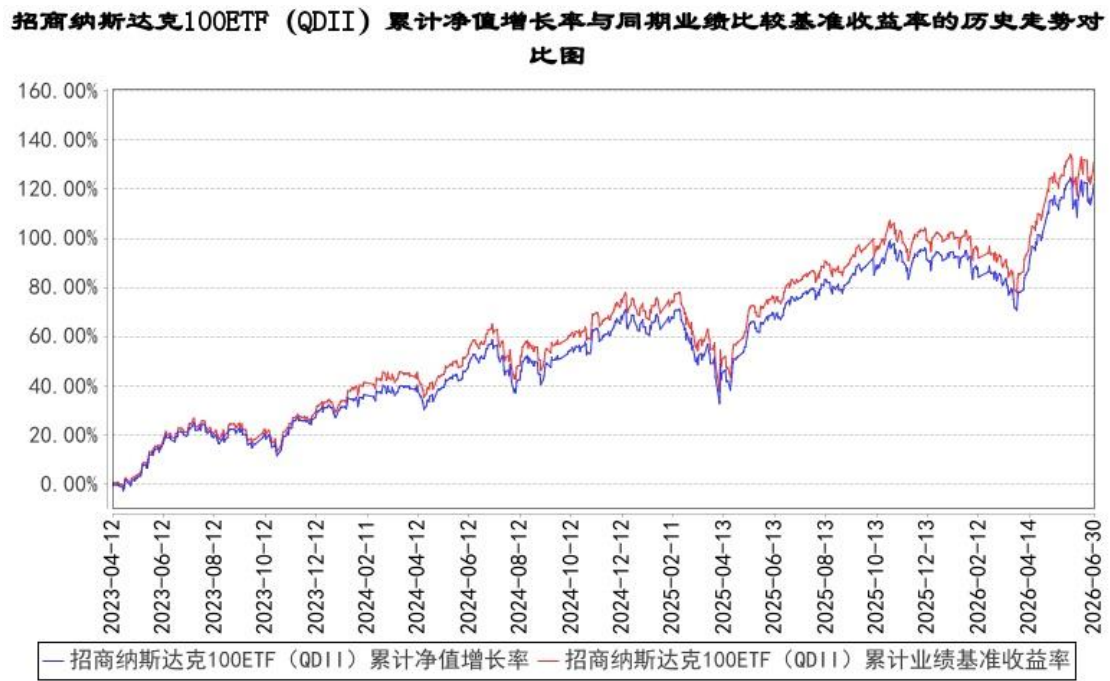
3.2 基金净值表现

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	①-③	②-④
----	--------------	---------------------	--------------------	----------------------	-----	-----

				④		
过去三个月	25.67%	1.51%	25.53%	1.52%	0.14%	-0.01%
过去六个月	16.19%	1.39%	16.19%	1.39%	0.00%	0.00%
过去一年	26.97%	1.18%	27.02%	1.18%	-0.05%	0.00%
过去三年	82.78%	1.28%	88.01%	1.29%	-5.23%	-0.01%
自基金合同生效起至今	121.99%	1.27%	130.92%	1.29%	-8.93%	-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

招商基金管理有限公司于 2002 年 12 月 27 日经中国证监会【2002】100 号文批准设立。目前，公司注册资本金为人民币 13.1 亿元，招商银行股份有限公司持有公司全部股权的 55%，招商证券股份有限公司持有公司全部股权的 45%。

招商基金管理有限公司拥有公开募集证券投资基金管理、基金销售、全国社会保障基金境内委托管理、企业年金和职业年金基金投资管理、合格境内机构投资者、特定客户资产管理、保险资金投资管理、基本养老保险基金投资管理、公募基金投资顾问业务试点资格。

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		
刘重杰	本基金 基金经 理	2023 年 4 月 12 日	-	15	男，学士。曾任职于成都商报社、西南财经大学金融数据中心、南京大学金陵学院；2010 年 7 月加入华西期货有限责任公司，历任金融工程部高级研究员、部门负责人；2014 年 3 月加入西南证券股份有限公司，历任衍生品业务岗、平仓处置岗、策略研究岗、投资者教育及培训岗；2017 年 9 月加入招商基金管理有限公司，曾任深证电子信息传媒产业(TMT)50 交易型开放式指数证券投资基金、招商深证电子信息传媒产业(TMT)50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、招商深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、招商中证浙江 100 交易型开放式指数证券投资基金、招商中证生物科技主题交易型开放式指数证券投资基金、招商中证云计算与大数据主题交易型开放式指数证券投资基金、招商沪深 300ESG 基准交易型开放式指数证券投资基金、招商中证新能源汽车指数型证券投资基金、招商中证物联网主题交易型开放式指数证券投资基金、招商中证香港科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）、招商中证 A100 交易型开放式指数证券投资基金、招商中证国新央企股东回报交易型开放式指数证券投资基金、招商中证国新央企股东回报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，现任招商深证 100 交易型开放式指数证券投资基金、招商中证红利交易型开放式指数证券投资基金、招商国证食品饮料行业交易型开放式指数证券投资基金、招商中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金、招商中证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金、招商中证银行 AH 价格优选交易型开放式指数证券投资基金、招商中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金联接基金、招商中证银行 AH 价格优选交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、招商纳斯达

					克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）、招商纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）、招商中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金、招商中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、招商利安新兴亚洲精选交易型开放式指数证券投资基金（QDII）、招商中证全指红利质量交易型开放式指数证券投资基金、招商中证香港科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）、招商中证香港科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）、招商中证全指红利质量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。
--	--	--	--	--	--

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告（生效）日期；

2、证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

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

本基金无境外投资顾问。

4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

基金管理人声明：在本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关法律法规及其各项实施准则的规定以及本基金的基金合同等基金法律文件的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围以及投资运作符合有关法律法规及基金合同的规定。

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

基金管理人已建立较完善的研究方法和投资决策流程，确保各投资组合享有公平的投资决策机会。基金管理人建立了所有组合适用的投资对象备选库，制定明确的备选库建立、维护程序。基金管理人拥有健全的投资授权制度，明确投资决策委员会、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分，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。基金管理人的相关研究成果向内部所有投资组合开放，在投资研究层面不存在各投资组合间不公平的问题。

基金管理人按照法规要求，对连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合间的同向交易的交易价差进行分析，相关投资组合经理也对分析中发现的价格差异次数占比超过正常范围的情况进行了合理性解释。报告期内，公司旗下投资组合同向交易价差分析中未发现异常情形。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。确因投资组合的投资策略或流动性等需要而发生的同日反向交易，基金管理人要求相关投资组合经理提供决策依据，并留存记录备查，完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合等除外。

本报告期内，本基金各项交易均严格按照相关法律法规、基金合同的有关要求执行，公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 15 次，为旗下指数及量化等组合因投资策略需要而发生反向交易。报告期内未发现有可能导致不公平交易和利益输送的重大异常交易行为。

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

报告期内，美股出现持续上涨态势，其中标普 500 指数、道琼斯指数、纳斯达克 100 指数分别上涨 9.55%、8.85%、19.91%；均在期间创出了历史新高。本基金的基准指数纳斯达克 100 指数报告期内上涨 19.91%。关于本基金的运作，仓位维持在 99.2% 左右的水平，基本上完成了对基准的跟踪。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金份额净值增长率为 16.19%，同期业绩基准增长率为 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

本报告期内，市场的核心变化是货币政策预期的“鹰派重定价”——沃什首场 FOMC 会议删除前瞻指引、点阵图转向年内可能加息，叠加 5 月非农强劲与通胀预测上修，市场已将首次加息预期提前至 10 月。美股市场 AI 算力主线长期逻辑强化，存储、先进制程、光互连等环节产业催化密集，半导体板块指数创出新高；同时需要警惕利率上行，沃什转鹰使年内加息重回桌面，成长股估值对利率敏感，需关注 10 月会议前的边际变化与油价二次上行风险。

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、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，估值委员会成员均具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备相应的专业胜任能力和相关工作经历。估值委员会负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，评价现有估值政策和程序的适用性及对估值程序执行情况进行监督。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与第三方定价服务机构签署服务协议，由其按合同约定提供相关投资品种的估值数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配，符合相关法规及基金合同的约定。

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，本基金未发生连续二十个工作日出现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，本托管人在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，完全尽职尽责的履行了应尽的义务。

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的复核，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：招商纳斯达克 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	220,965,400.93	213,022,893.95
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	9,873,170,187.29	7,866,442,773.04
其中：股票投资		9,873,170,187.29	7,866,442,773.04
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		1,073,939.23	1,758,431.03
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		10,095,209,527.45	8,081,224,098.02
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		154,180,934.57	151,123,017.56
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		3,881,340.31	3,075,200.54
应付托管费		1,164,402.10	922,560.15
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	199,579.07	120,000.00
负债合计		159,426,256.05	155,240,778.25
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	4,475,744,064.00	4,148,744,064.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	5,460,039,207.40	3,777,239,255.77
净资产合计		9,935,783,271.40	7,925,983,319.77
负债和净资产总计		10,095,209,527.45	8,081,224,098.02

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.2199 元，基金份额总额 4,475,744,064.00 份。

6.2 利润表

会计主体：招商纳斯达克 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		1,365,164,779.12	402,290,371.62
1.利息收入		178,311.59	373,807.43
其中：存款利息收入	6.4.7.9	178,311.59	373,807.43
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“-”		84,502,753.44	47,739,302.91

填列)			
其中：股票投资收益	6.4.7.10	27,548,815.65	31,180,845.67
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	-	-
资产支持证券投资 收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	56,953,937.79	16,558,457.24
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）	6.4.7.17	1,282,581,542.29	356,502,800.68
4.汇兑收益（损失以“-” 号填列）		979,389.52	-11,104,629.72
5.其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.18	-3,077,217.72	8,779,090.32
减：二、营业总支出		27,486,303.16	15,626,318.40
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	20,911,999.46	11,823,721.31
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	6.4.10.2.2	6,273,599.80	3,547,116.37
3.销售服务费		-	-
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6.信用减值损失	6.4.7.19	-	-
7.税金及附加		12,429.53	-
8.其他费用	6.4.7.20	288,274.37	255,480.72
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		1,337,678,475.96	386,664,053.22
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		1,337,678,475.96	386,664,053.22
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		1,337,678,475.96	386,664,053.22

6.3 净资产变动表

会计主体：招商纳斯达克 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	4,148,744,064.00	-	3,777,239,255.77	7,925,983,319.77
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	4,148,744,064.00	-	3,777,239,255.77	7,925,983,319.77
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	327,000,000.00	-	1,682,799,951.63	2,009,799,951.63
（一）、综合收益总额	-	-	1,337,678,475.96	1,337,678,475.96
（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）	327,000,000.00	-	345,121,475.67	672,121,475.67
其中：1.基金申购款	327,000,000.00	-	345,121,475.67	672,121,475.67
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）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	4,475,744,064.00	-	5,460,039,207.40	9,935,783,271.40
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	2,740,744,064.00	-	1,718,822,632.36	4,459,566,696.36
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	2,740,744,064.00	-	1,718,822,632.36	4,459,566,696.36

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	115,000,000.00	-	418,304,832.78	533,304,832.78
（一）、综合收益总额	-	-	386,664,053.22	386,664,053.22
（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）	115,000,000.00	-	31,640,779.56	146,640,779.56
其中：1.基金申购款	546,000,000.00	-	317,151,467.75	863,151,467.75
2.基金赎回款	-431,000,000.00	-	-285,510,688.19	-716,510,688.19
（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	2,855,744,064.00	-	2,137,127,465.14	4,992,871,529.14

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：

_____ 钟文岳 _____ 欧志明 _____ 何剑萍 _____
 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

招商纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）（以下简称“本基金”）系由基金管理人招商基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《招商纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金合同》及其他有关法律法规的规定，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]1776 号文准予公开募集注册。本基金为交易型开放式基金，存续期限为不定期。本基金首次设立募集基金份额为 239,744,064.00 份，经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证，并出具了编号为德师报(验)字(23)第 00108 号验资报告。《招商纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金合同》（以下简称“基金合同”）于 2023 年 4 月 12 日正式生效。本基金的基金管理人为招商基金管理有限公司，基金境内托管人为中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”），境外托管人为摩根大通银行。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及截至报告期末最新公告的《招商纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)招募说明书》的有关规定,本基金主要投资于标的指数成份券(含存托凭证、美国存托凭证、全球存托凭证,下同)和备选成份券(含存托凭证、美国存托凭证、全球存托凭证,下同)。此外,为更好地实现投资目标,本基金可参与其他境外市场投资工具和境内市场投资工具投资。

境外市场投资工具包括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(包括交易型开放式基金(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、资产支持证券以及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券;银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具;与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品;远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、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。境内市场投资工具包括依法发行上市的其他股票(包括主板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票和存托凭证)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券(含可分离交易可转债)、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、货币市场工具、同业存单、债券回购、资产支持证券、银行存款、股指期货、国债期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定,参与融资业务和转融通证券出借业务。

基金的投资组合比例为:本基金投资于标的指数成份券和备选成份券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%。每个交易日日终在扣除国债期货合约、股指期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货、国债期货和股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围或调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准:纳斯达克 100 指数收益率(经汇率调整后)。

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、应用指南、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”)、中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,同时在

具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2026 年 1 月 1 日至 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 重要会计政策和会计估计

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

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2021]33 号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》、财税[2024]8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[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[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财税[2025]4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令第 826 号《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》、财税[2026]12 号《关于明确增值税应税交易销售额计算口径的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日, 公开募集证券投资基金管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为, 以基金管理人为增值税纳税人, 可以选择适用简易计税方法, 按照 3% 的征收率缴纳增值税。对公募证券投资基金(封闭式证券投资基金, 开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入以及金融同业往来利息收入免征增值税。

(2) 对证券投资基金取得的自 2025 年 8 月 8 日之后(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; 取得的在 2025 年 8 月 8 日之前已发行的国债、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, 继续免征增值税直至债券到期。

(3) 对证券投资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, 股权的股息、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。

(4) 对证券投资基金取得的股票股息红利所得, 由上市公司代扣代缴个人所得税; 从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, 暂减按 50% 计入应纳税所得额; 持股期限超过 1 年的, 股息红利所得暂免征收个人所得税。其中, 对基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所挂牌交易的上市公司限售股, 解禁后取得的股息红利收入, 按照上述规定计算纳税, 持股时间自解禁日起计算; 解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。对基金通过港股通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利, H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请, 由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册, H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过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。

(5) 对于基金从事 A 股买卖, 出让方按 0.10% 的税率缴纳证券(股票)交易印花税, 受让方不再缴纳印花税; 自 2023 年 8 月 28 日起, 出让方减按 0.05% 的税率缴纳证券(股票)交易印花税。对于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。

(6) 基金在境外证券交易所进行交易或取得的源自境外证券市场的收益, 其涉及的税收政策, 按照相关国家或地区税收法律和法规执行。

(7) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 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	220,965,400.93
等于：本金	220,964,952.85
加：应计利息	448.08
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	220,965,400.93

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		7,644,855,989.63	-	9,873,170,187.29	2,228,314,197.66
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		7,644,855,989.63	-	9,873,170,187.29	2,228,314,197.66

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

本基金本报告期末无衍生金融工具。

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各项买入返售金融资产。

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 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

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	-
预提费用	189,424.36
其他	10,154.71
合计	199,579.07

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	4,148,744,064.00	4,148,744,064.00
本期申购	327,000,000.00	327,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	4,475,744,064.00	4,475,744,064.00

注：本期申购含红利再投、转换入份（金）额，本期赎回含转换出份（金）额。

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	513,346,834.44	3,263,892,421.33	3,777,239,255.77
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	513,346,834.44	3,263,892,421.33	3,777,239,255.77
本期利润	55,096,933.67	1,282,581,542.29	1,337,678,475.96
本期基金份额交易产生的变动数	43,440,679.17	301,680,796.50	345,121,475.67

其中：基金申购款	43,440,679.17	301,680,796.50	345,121,475.67
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	611,884,447.28	4,848,154,760.12	5,460,039,207.40

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	178,311.59
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	178,311.59

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	27,548,815.65
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	27,548,815.65

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	499,751,416.60
减：卖出股票成本总额	472,013,166.05
减：交易费用	189,434.90
买卖股票差价收入	27,548,815.65

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无股票赎回差价收入。

6.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无股票申购差价收入。

6.4.7.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内无证券出借差价收入。

6.4.7.11 基金投资收益

本基金本报告期内无基金投资收益。

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.12.2 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。

6.4.7.12.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

6.4.7.12.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券申购差价收入。

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

6.4.7.13.1 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。

6.4.7.13.2 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。

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券赎回差价收入。

6.4.7.13.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券申购差价收入。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属赎回差价收入。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属申购差价收入。

6.4.7.15 衍生工具收益**6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期内无衍生工具买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具其他投资收益。

6.4.7.16 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	56,953,937.79
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	56,953,937.79

6.4.7.17 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	1,282,581,542.29
——股票投资	1,282,581,542.29
——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	-
——权证投资	-
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	1,282,581,542.29

6.4.7.18 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	-3,077,217.72
合计	-3,077,217.72

6.4.7.19 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.20 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	100,000.00
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
其他	128,767.00
合计	288,274.37

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，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告批准报出日，本基金无需要说明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

本报告期内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
招商基金管理有限公司	基金管理人
中国银行股份有限公司	基金托管人
摩根大通银行	基金境外托管人
招商证券股份有限公司(以下简称“招商证券”)	基金管理人的股东
招商纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）(以下简称“招商纳斯达克 100ETF 发起式联接（QDII）”)	本基金的联接基金

注：基金的主要关联方包含基金管理人、基金管理人的股东及子公司、基金托管人等。

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无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 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无应支付关联方的佣金。

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	20,911,999.46	11,823,721.31
其中：应支付销售机构的客户维护费	3,541,593.97	1,935,074.99
应支付基金管理人的净管理费	17,370,405.49	9,888,646.32

注：支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值×0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.50%÷当年天数

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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	6,273,599.80	3,547,116.37

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值×0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.15%÷当年天数

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期内及上年度可比期间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的情况。

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的情况。

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基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

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
招商纳斯达克 100ETF 发起式联接（QDII）	1,569,464,059.00	35.07%	1,509,679,459.00	36.39%
招商证券股份有限公司	440,691.00	0.01%	330,817.00	0.01%

注：表格中的比例为四舍五入的结果。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 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
摩根大通-活期	182,999,750.95	167,679.69	75,016,417.87	334,793.19
中国银行-活期	37,965,649.98	10,631.90	97,095,424.43	39,014.24

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行股份有限公司和摩根大通银行保管，按银行约定利率计息。

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无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

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

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末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

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是提升本基金风险调整后收益水平，保证本基金的基金资产安全，维护基金份额持有人利益。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人风险管理的基本策略是识别和分析本基金运作时本基金面临各种类型的风险，确定适当的风险容忍度，并及时可靠地对各种风险进行监督，将风险控制在限定的范围之内。本基金目前面临的主要风险包括：市场风险、信用风险和流动性风险。

本基金的基金管理人建立了以全面、独立、互相制约以及定性和定量相结合为原则的，董事会及下设审计委员会、风险控制委员会、督察长、风险管理委员会、监察稽核部门和风险管理部门等多层次的风险管理组织架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指金融工具的一方到期无法履行约定义务致使本基金遭受损失的风险。本基金的信用风险主要存在于银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资、资产支持证券投资及其他。

本基金的银行存款存放于本基金的基金托管人，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在证券交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并采用券款对付交割方式，以控制相应的信用风险。

对于与债券投资、资产支持证券投资等投资品种相关的信用风险，本基金的基金管理人通过对投资品种的信用等级评估来选择适当的投资对象，并限制单个投资品种的持有比例来管理信用风险。附注 6.4.13.2.1 至 6.4.13.2.6 列示了本基金所持有的债券投资及资产支持证券投资的信用评级，该信用评级不包括本基金所持有的国债、央行票据、政策性金融债。

6.4.13.2.1 按短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短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 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。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金流动性风险来源于基金约定开放日兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险以及因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。本基金所持有的金融资产分别在证券交易所和银行间同业市场交易，除附注 6.4.12 所披露的流通受限不能自由转让的基金资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。除卖出回购金融资产外，本基金所持有的金融负债的合约约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

此外，针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人在基金合同中约定了非常情况下赎回资金的处理模式，控制因开放模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

日常流动性风险管理中，本基金的基金管理人每日监控和预测本基金的流动性指标，通过对投资品种的流动性指标来持续地评估、选择、跟踪和控制基金投资的流动性风险。同时，本基金通过预留一定的现金头寸，并且在需要时可通过卖出回购金融资产方式融入短期资金，以缓解流动性风险。

本基金按合同约定申购赎回可采用一篮子证券的形式或现金替代方式，流动性风险相对较低。

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。本基金的基金管理人日常通过对利率水平的预测、分析收益率曲线及优化利率重新定价日组合等方法对上述利率风险进行管理。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

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	220,965,400.93	-	-	-	220,965,400.93
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	9,873,170,187.29	9,873,170,187.29
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	1,073,939.23	1,073,939.23
应收申购款	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	220,965,400.93	-	-	9,874,244,126.52	10,095,209,527.45
负债					

应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	3,881,340.31	3,881,340.31
应付托管费	-	-	-	1,164,402.10	1,164,402.10
应付清算款	-	-	-	154,180,934.57	154,180,934.57
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	199,579.07	199,579.07
负债总计	-	-	-	159,426,256.05	159,426,256.05
利率敏感度缺口	220,965,400.93	-	-	9,714,817,870.47	9,935,783,271.40
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	213,022,893.95	-	-	-	213,022,893.95
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	7,866,442,773.04	7,866,442,773.04
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	1,758,431.03	1,758,431.03
应收申购款	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	213,022,893.95	-	-	7,868,201,204.07	8,081,224,098.02
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	3,075,200.54	3,075,200.54
应付托管费	-	-	-	922,560.15	922,560.15
应付清算款	-	-	-	151,123,017.56	151,123,017.56
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	120,000.00	120,000.00
负债总计	-	-	-	155,240,778.25	155,240,778.25
利率敏感度缺口	213,022,893.95	-	-	7,712,960,425.82	7,925,983,319.77

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

本基金本报告期末及上年度末无利率风险的敏感性分析。

6.4.13.4.2 外汇风险

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	182,999,889.14	-	-	182,999,889.14
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	9,873,170,187.29	-	-	9,873,170,187.29
衍生金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收股利	1,073,939.23	-	-	1,073,939.23
应收申购款	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	10,057,244,015.66	-	-	10,057,244,015.66
以外币计价的负债				
应付清算款	131,086,218.76	-	-	131,086,218.76
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-
其他负债	10,154.71	-	-	10,154.71
负债合计	131,096,373.47	-	-	131,096,373.47
资产负债表外汇风险敞口净额	9,926,147,642.19	-	-	9,926,147,642.19

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	168,421,260.83	-	-	168,421,260.83
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-

交易性金融资产	7,866,442,773.04	-	-	7,866,442,773.04
衍生金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收股利	1,758,431.03	-	-	1,758,431.03
应收申购款	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	8,036,622,464.90	-	-	8,036,622,464.90
以外币计价的负债				
应付清算款	114,103,761.97	-	-	114,103,761.97
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	114,103,761.97	-	-	114,103,761.97
资产负债表外汇风险敞口净额	7,922,518,702.93	-	-	7,922,518,702.93

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）
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	496,307,382.11	396,125,935.15
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-496,307,382.11	-396,125,935.15

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，该风险可能与特定投资品种相关，也有可能与整体投资品种相关。

本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的债券和股票，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。本基金在构建资产配置和基金资产投资组合的基础上，通过建立事前和事后跟踪误差的方式，对基金资产的市场价格风险进行管理。

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	公允价值	占基金资产

		净值比例 (%)		净值比例(%)
交易性金融资产-股票投资	9,873,170,187.29	99.37	7,866,442,773.04	99.25
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
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	9,873,170,187.29	99.37	7,866,442,773.04	99.25

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1.若对市场价格敏感的权益性投资的市场价格上升或下降 5%		
	2.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 ）
	1. 权益性投资的市场价格上升 5%	493,658,509.36	393,322,138.65
	2. 权益性投资的市场价格下降 5%	-493,658,509.36	-393,322,138.65

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	9,873,170,187.29	7,866,442,773.04
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	9,873,170,187.29	7,866,442,773.04

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度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

不以公允价值计量的金融工具主要包括应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

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需要说明有助于理解和分析会计报表的其他事项。

§ 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	9,873,170,187.29	97.80
	其中：普通股	9,709,714,326.16	96.18
	存托凭证	163,455,861.13	1.62
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	220,965,400.93	2.19
8	其他各项资产	1,073,939.23	0.01
9	合计	10,095,209,527.45	100.00

注：此处的股票投资项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

国家（地区）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
美国	9,873,170,187.29	99.37
合计	9,873,170,187.29	99.37

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

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
通信服务	1,189,211,116.99	11.97
非日常生活消费品	1,048,126,039.35	10.55
日常消费品	613,035,210.28	6.17
能源	44,533,461.28	0.45
金融	16,230,790.30	0.16
医疗保健	349,534,901.70	3.52
工业	339,230,657.24	3.41
信息技术	6,017,929,758.14	60.57
原材料	102,240,990.20	1.03
房地产	-	-
公用事业	111,635,424.89	1.12
合计	9,831,708,350.37	98.95

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

7.3.2 期末积极投资按行业分类的权益投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
通信服务	41,461,836.92	0.42
非日常生活消费品	-	-
日常消费品	-	-
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	-	-
工业	-	-
信息技术	-	-
原材料	-	-
房地产	-	-

公用事业	-	-
合计	41,461,836.92	0.42

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细

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

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	NVIDIA Corp	英伟达公司	NVDA	纳斯达克证券交易所	美国	548,452	747,426,536.02	7.52
2	Apple Inc	苹果公司	AAPL	纳斯达克证券交易所	美国	332,863	656,007,074.11	6.60
3	Alphabet Inc	谷歌 (Alphabet)	GOOGL	纳斯达克证券交易所	美国	131,990	321,265,155.84	3.23
			GOOG	纳斯达克证券交易所	美国	123,650	297,563,143.47	2.99
4	Micron Technology Inc	美光科技股份有限公司	MU	纳斯达克证券交易所	美国	70,557	554,701,760.11	5.58
5	Microsoft Corp	微软公司	MSFT	纳斯达克证券交易所	美国	168,352	427,715,414.10	4.30
6	Advanced Micro Devices Inc	-	AMD	纳斯达克证券交易所	美国	102,020	403,644,162.14	4.06
7	Amazon.com Inc	亚马逊公司	AMZN	纳斯达克证券交易所	美国	243,791	395,748,345.29	3.98
8	Tesla Inc	特斯拉公司	TSLA	纳斯达克证券交易所	美国	113,213	324,317,266.57	3.26
9	Intel Corp	英特尔公司	INTC	纳斯达克证券交易所	美国	314,458	299,051,434.37	3.01
10	Broadcom Inc	博通股份有限公司	AVGO	纳斯达克证券交易所	美国	107,452	276,454,383.32	2.78
11	Meta Platforms Inc	-	META	纳斯达克证券交易所	美国	67,112	257,475,984.02	2.59
12	Applied Materials Inc	应用材料公司	AMAT	纳斯达克证券交易所	美国	49,674	244,608,719.49	2.46
13	Walmart Inc	沃尔玛股份有限公司	WMT	纳斯达克证券交易所	美国	305,209	235,438,996.00	2.37
14	Lam Research Corp	泛林集团	LRCX	纳斯达克证券交易所	美国	78,242	230,920,880.05	2.32
15	Cisco Systems Inc	思科公司	CSCO	纳斯达克证券交易所	美国	246,600	197,282,050.23	1.99

16	Costco Wholesale Corp	开市客公司	COST	纳斯达克证券交易所	美国	27,757	176,850,745.04	1.78
17	KLA Corp	科磊公司	KLAC	纳斯达克证券交易所	美国	81,728	167,944,227.07	1.69
18	Sandisk Corp	闪迪公司/ 特拉华州	SNDK	纳斯达克证券交易所	美国	9,265	143,479,158.04	1.44
19	Netflix Inc	奈飞公司	NFLX	纳斯达克证券交易所	美国	263,454	128,117,221.79	1.29
20	Palo Alto Networks Inc	派拓网络公司	PANW	纳斯达克证券交易所	美国	51,053	118,578,409.63	1.19
21	Texas Instruments Inc	德州仪器公司	TXN	纳斯达克证券交易所	美国	56,940	115,595,315.39	1.16
22	Palantir Technologies Inc	帕兰提尔技术公司	PLTR	纳斯达克证券交易所	美国	143,656	114,153,037.30	1.15
23	Marvell Technology Inc	美满电子科技公司	MRVL	纳斯达克证券交易所	美国	54,732	111,045,700.12	1.12
24	Linde PLC	林德公司	LIN	纳斯达克证券交易所	美国	28,927	102,240,990.20	1.03
25	Western Digital Corp	西部数据公司	WDC	纳斯达克证券交易所	美国	21,565	93,813,314.81	0.94
26	Seagate Technology Holdings PLC	-	STX	纳斯达克证券交易所	美国	14,029	92,205,862.04	0.93
27	Amgen Inc	安进公司	AMGN	纳斯达克证券交易所	美国	33,767	83,281,683.07	0.84
28	QUALCOMM Inc	高通公司	QCOM	纳斯达克证券交易所	美国	65,944	82,996,209.10	0.84
29	CrowdStrike Holdings Inc	-	CRWD	纳斯达克证券交易所	美国	15,928	82,788,491.36	0.83
30	Analog Devices Inc	亚德诺半导体公司	ADI	纳斯达克证券交易所	美国	30,474	82,434,764.95	0.83
31	PepsiCo Inc	百事公司	PEP	纳斯达克证券交易所	美国	85,512	78,858,812.38	0.79
32	ASML Holding NV	阿斯麦控股公司	ASML	纳斯达克证券交易所	美国	5,733	77,681,444.24	0.78
33	T-Mobile US Inc	-	TMUS	纳斯达克证券交易所	美国	67,708	77,349,094.94	0.78
34	AppLovin Corp	-	APP	纳斯达克证券交易所	美国	19,128	67,123,595.17	0.68
35	Gilead Sciences Inc	吉利德科学公司	GILD	纳斯达克证券交易所	美国	77,679	66,841,933.26	0.67
36	ARM Holdings PLC	-	ARM	纳斯达克证券交易所	美国	26,528	64,063,549.89	0.64

37	Intuitive Surgical Inc	直觉外科手术公司	ISRG	纳斯达克证券交易所	美国	22,158	60,016,243.94	0.60
38	Shopify Inc	-	SHOP	纳斯达克证券交易所	美国	76,303	59,338,444.29	0.60
39	Booking Holdings Inc	缤客控股公司	BKNG	纳斯达克证券交易所	美国	48,480	58,853,499.08	0.59
40	Vertex Pharmaceuticals Inc	福泰制药公司	VRTX	纳斯达克证券交易所	美国	15,879	53,721,489.13	0.54
41	Starbucks Corp	星巴克公司	SBUX	纳斯达克证券交易所	美国	71,306	49,629,394.64	0.50
42	Fortinet Inc	飞塔信息	FTNT	纳斯达克证券交易所	美国	45,838	47,959,862.01	0.48
43	Cadence Design Systems Inc	铿腾电子科技有限公司	CDNS	纳斯达克证券交易所	美国	17,256	44,110,943.14	0.44
44	Marriott International Inc/MD	万豪国际集团	MAR	纳斯达克证券交易所	美国	16,497	41,639,276.46	0.42
45	Monster Beverage Corp	怪兽饮料公司	MNST	纳斯达克证券交易所	美国	61,189	40,058,217.63	0.40
46	Constellation Energy Corp	美国联合能源公司	CEG	纳斯达克证券交易所	美国	22,598	38,227,301.82	0.38
47	Automatic Data Processing Inc	自动数据处理公司	ADP	纳斯达克证券交易所	美国	25,009	38,146,254.08	0.38
48	CSX Corp	CSX 运输公司	CSX	纳斯达克证券交易所	美国	116,256	37,634,633.78	0.38
49	Comcast Corp	康卡斯特公司	CMCSA	纳斯达克证券交易所	美国	222,910	37,272,245.00	0.38
50	Datadog Inc	数据狗	DDOG	纳斯达克证券交易所	美国	20,698	36,703,472.05	0.37
51	MercadoLibre Inc	自由市场公司	MELI	纳斯达克证券交易所	美国	3,171	36,659,149.51	0.37
52	Synopsys Inc	新思科技公司	SNPS	纳斯达克证券交易所	美国	11,980	36,396,895.19	0.37
53	Adobe Inc	奥多比公司	ADBE	纳斯达克证券交易所	美国	25,289	35,312,819.09	0.36
54	Astera Labs Inc	-	ALAB	纳斯达克证券交易所	美国	10,724	35,279,825.04	0.36
55	O'Reilly Automotive Inc	奥莱利汽车公司	ORLY	纳斯达克证券交易所	美国	51,849	32,520,511.03	0.33
56	DoorDash Inc	-	DASH	纳斯达克证券交易所	美国	25,735	32,344,143.73	0.33
57	Teradyne Inc	泰瑞达	TER	纳斯达克证券交易所	美国	9,794	32,275,009.07	0.32

58	Mondelez International Inc	亿滋国际公司	MDLZ	纳斯达克证券交易所	美国	80,986	31,903,823.74	0.32
59	American Electric Power Co Inc	美国电力公司	AEP	纳斯达克证券交易所	美国	34,042	31,720,309.35	0.32
60	Intuit Inc	财捷集团	INTU	纳斯达克证券交易所	美国	17,114	30,422,614.82	0.31
61	NXP Semiconductors NV	恩智浦半导体公司	NXPI	纳斯达克证券交易所	美国	15,796	30,234,605.92	0.30
62	Honeywell International Inc	霍尼韦尔国际公司	HON	纳斯达克证券交易所	美国	19,822	30,227,767.23	0.30
63	Honeywell Aerospace Inc	-	HONA	纳斯达克证券交易所	美国	19,822	29,847,051.27	0.30
64	Ross Stores Inc	罗斯百货股份有限公司	ROST	纳斯达克证券交易所	美国	20,155	29,218,704.81	0.29
65	Cintas Corp	信达思公司	CTAS	纳斯达克证券交易所	美国	25,031	28,995,857.13	0.29
66	Monolithic Power Systems Inc	芯源系统有限公司	MPWR	纳斯达克证券交易所	美国	3,078	28,979,726.20	0.29
67	Warner Bros Discovery Inc	华纳兄弟探索股份有限公司	WBD	纳斯达克证券交易所	美国	156,861	28,482,599.83	0.29
68	Lumentum Holdings Inc	-	LITE	纳斯达克证券交易所	美国	4,867	28,443,530.88	0.29
69	Regeneron Pharmaceuticals Inc	再生元制药股份有限公司	REGN	纳斯达克证券交易所	美国	6,445	27,371,068.04	0.28
70	PACCAR Inc	帕卡公司	PCAR	纳斯达克证券交易所	美国	32,927	26,938,412.02	0.27
71	Nebius Group NV	-	NBIS	纳斯达克证券交易所	美国	13,789	25,936,643.66	0.26
72	Airbnb Inc	爱彼迎股份有限公司	ABNB	纳斯达克证券交易所	美国	26,148	25,484,881.23	0.26
73	Rocket Lab Corp	-	RKLB	纳斯达克证券交易所	美国	36,209	25,068,504.01	0.25
74	Fastenal Co	法思诺公司	FAST	纳斯达克证券交易所	美国	71,827	23,496,588.88	0.24
75	Baker Hughes Co	贝克休斯公司	BKR	纳斯达克证券交易所	美国	62,069	23,462,389.24	0.24
76	Electronic Arts	艺电公司	EA	纳斯达克证券交易所	美国	15,688	21,908,400.81	0.22

	Inc			交易所				
77	PDD Holdings Inc	拼多多控股公司	PDD	纳斯达克证券交易所	美国	41,789	21,710,867.00	0.22
78	Xcel Energy Inc	-	XEL	纳斯达克证券交易所	美国	39,057	21,360,869.70	0.21
79	Diamondback Energy Inc	戴蒙德巴克能源	FANG	纳斯达克证券交易所	美国	17,600	21,071,072.04	0.21
80	Microchip Technology Inc	微芯科技股份有限公司	MCHP	纳斯达克证券交易所	美国	33,915	21,066,440.62	0.21
81	Ferrovial NV	-	FER	纳斯达克证券交易所	美国	45,013	21,034,388.05	0.21
82	Exelon Corp	爱克斯龙公司	EXC	纳斯达克证券交易所	美国	64,017	20,326,944.02	0.20
83	Take-Two Interactive Software Inc	TAKE-TWO 互动软件公司	TTWO	纳斯达克证券交易所	美国	11,616	19,777,271.29	0.20
84	Axon Enterprise Inc	-	AXON	纳斯达克证券交易所	美国	5,042	19,251,660.11	0.19
85	Old Dominion Freight Line Inc	奥多明尼昂货运	ODFL	纳斯达克证券交易所	美国	13,011	19,194,359.87	0.19
86	Coca-Cola Europacific Partners PLC	可口可乐欧洲合伙公开股份公司	CCEP	纳斯达克证券交易所	美国	27,897	19,013,667.99	0.19
87	CoreWeave Inc	-	CRWV	纳斯达克证券交易所	美国	28,002	18,984,151.52	0.19
88	Keurig Dr Pepper Inc	克里格胡椒博士	KDP	纳斯达克证券交易所	美国	85,124	18,975,906.52	0.19
89	IDEXX Laboratories Inc	爱德士股份有限公司	IDXX	纳斯达克证券交易所	美国	4,935	17,694,591.52	0.18
90	Autodesk Inc	欧特克公司	ADSK	纳斯达克证券交易所	美国	13,201	17,480,436.52	0.18
91	Alnylam Pharmaceuticals Inc	艾拉伦制药股份有限公司	ALNY	纳斯达克证券交易所	美国	8,353	17,126,032.50	0.17
92	PayPal Holdings Inc	贝宝	PYPL	纳斯达克证券交易所	美国	55,189	16,230,790.30	0.16
93	Paychex Inc	沛齐公司	PAYX	纳斯达克证券交易所	美国	22,416	15,012,349.31	0.15
94	Roper Technologies Inc	儒博技术公司	ROP	纳斯达克证券交易所	美国	6,313	14,549,826.47	0.15
95	Thomson Reuters Corp	汤森路透公司	TRI	纳斯达克证券交易所	美国	23,841	13,261,465.73	0.13

96	GE HealthCare Technologies Inc	-	GEHC	纳斯达克证券交易所	美国	28,460	12,407,584.08	0.12
97	Strategy Inc	-	MSTR	纳斯达克证券交易所	美国	20,697	12,254,104.60	0.12
98	Kraft Heinz Co/The	卡夫亨氏公司	KHC	纳斯达克证券交易所	美国	74,189	11,935,040.98	0.12
99	Copart Inc	科帕特公司	CPRT	纳斯达克证券交易所	美国	57,924	11,121,365.77	0.11
100	Dexcom Inc	德康医疗	DXCM	纳斯达克证券交易所	美国	24,142	11,074,276.16	0.11
101	Workday Inc	-	WDAY	纳斯达克证券交易所	美国	12,575	10,484,914.00	0.11

7.4.2 积极投资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

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	Space Exploration Technologies Corp	太空探索技术公司	SPCX	纳斯达克证券交易所	美国	35,629	41,461,836.92	0.42

7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	Walmart Inc	WMT	259,325,606.05	3.27
2	Sandisk Corp	SNDK	63,276,849.15	0.80
3	Tesla Inc	TSLA	55,936,882.94	0.71
4	ARM Holdings PLC	ARM	45,628,620.59	0.58
5	NVIDIA Corp	NVDA	43,978,004.17	0.55
6	Space Exploration Technologies Corp	SPCX	41,413,473.67	0.52
7	Apple Inc	AAPL	37,556,243.98	0.47
8	Alphabet Inc	GOOGL	18,528,510.08	0.23
		GOOG	18,443,530.59	0.23
9	Honeywell Aerospace Inc	HONA	29,755,864.94	0.38
10	Lumentum Holdings Inc	LITE	29,253,213.56	0.37

11	Astera Labs Inc	ALAB	28,974,990.67	0.37
12	Teradyne Inc	TER	28,818,587.91	0.36
13	Microsoft Corp	MSFT	28,425,313.09	0.36
14	Amazon.com Inc	AMZN	25,123,156.09	0.32
15	Nebius Group NV	NBIS	25,022,368.32	0.32
16	Rocket Lab Corp	RKLB	22,902,554.90	0.29
17	Micron Technology Inc	MU	22,111,940.04	0.28
18	CoreWeave Inc	CRWV	20,212,554.81	0.26
19	Meta Platforms Inc	META	19,558,417.30	0.25
20	Advanced Micro Devices Inc	AMD	16,890,589.92	0.21

注：1、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；

2、基金持有的股票分类为交易性金融资产的，本项的“累计买入金额”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	Broadcom Inc	AVGO	149,563,668.21	1.89
2	NVIDIA Corp	NVDA	26,141,115.46	0.33
3	Apple Inc	AAPL	22,922,495.01	0.29
4	AstraZeneca PLC	AZN	22,589,659.43	0.29
5	Alphabet Inc	GOOGL	9,249,830.25	0.12
		GOOG	7,953,209.62	0.10
6	Microsoft Corp	MSFT	14,747,678.53	0.19
7	Amazon.com Inc	AMZN	11,266,071.91	0.14
8	Verisk Analytics Inc	VRSK	10,751,962.39	0.14
9	Cognizant Technology Solutions Corp	CTSH	10,553,372.19	0.13
10	Micron Technology Inc	MU	9,753,194.23	0.12
11	Zscaler Inc	ZS	8,915,903.33	0.11
12	Insmid Inc	INSM	8,836,989.52	0.11
13	Charter Communications Inc	CHTR	8,010,799.36	0.10
14	Advanced Micro Devices Inc	AMD	7,987,426.49	0.10
15	Tesla Inc	TSLA	7,875,034.72	0.10
16	Meta Platforms Inc	META	6,030,689.22	0.08
17	CoStar Group Inc	CSGP	6,019,628.68	0.08
18	Cisco Systems Inc	CSCO	5,708,224.76	0.07

19	T-Mobile US Inc	TMUS	5,436,382.81	0.07
20	Walmart Inc	WMT	5,424,174.43	0.07

注：1、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；

2、基金持有的股票分类为交易性金融资产的，本项“累计卖出金额”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

买入成本（成交）总额	1,195,962,435.61
卖出收入（成交）总额	499,751,416.60

注：1、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；

2、“买入股票成本（成交）总额”、“卖出股票收入（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

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

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

报告期基金投资的前十名证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.11.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

7.11.3 期末其他各项资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	1,073,939.23
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	1,073,939.23

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 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

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的情况。

7.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

§ 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		招商纳斯达克 100ETF 发起式联接（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

77,988	57,390.16	1,940,748,883.00	43.36%	2,534,995,181.00	56.64%	1,569,464,059.00	35.07%
--------	-----------	------------------	--------	------------------	--------	------------------	--------

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	265,600.00	0.0059%

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

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(2023 年 4 月 12 日)基金份额总额	239,744,064.00
本报告期期初基金份额总额	4,148,744,064.00
本报告期基金总申购份额	327,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	-
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	4,475,744,064.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末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

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、公募基金托管业务的重大诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

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，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，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 MERCHANTS SECURITIES(HK) CO.,LTD.	2	915,257,649.51	55.00%	106,305.05	57.65%	本报告期新增 1 个
CLSA LIMITED	2	748,986,768.54	45.00%	78,077.65	42.35%	-
CHINA GALAXY INTERNATIONAL SECURITIES (HONG KONG) CO., LIMITED	2	-	-	-	-	-
HUATAI	1	-	-	-	-	-

FINANCIAL HOLDINGS (HONG KONG) LIMITED						
北京证券	2	-	-	-	-	-
财通证券	3	-	-	-	-	-
诚通证券	1	-	-	-	-	-
大通证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	4	-	-	-	-	-
第一创业	3	-	-	-	-	-
东北证券	3	-	-	-	-	-
东方财富	3	-	-	-	-	-
东方证券	3	-	-	-	-	-
东海证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	本报告期减少 4 个
东兴证券	2	-	-	-	-	本报告期减少 1 个
方正证券	3	-	-	-	-	本报告期减少 1 个
光大证券	3	-	-	-	-	-
广发证券	6	-	-	-	-	-
国海证券	4	-	-	-	-	本报告期新增 1 个
国金证券	1	-	-	-	-	-
国联民生	4	-	-	-	-	本报告期减少 5 个
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰海通证券	7	-	-	-	-	-
国投证券	2	-	-	-	-	本报告期减少 2 个
国新证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	3	-	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
华宝证券	2	-	-	-	-	本报告期减少 2 个

华创证券	4	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	4	-	-	-	-	-
华泰证券	4	-	-	-	-	-
华西证券	3	-	-	-	-	-
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
华源证券	2	-	-	-	-	-
汇丰前海证券	2	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	本报告 期新增
南京证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	本报告 期减少 1 个
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	6	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	本报告 期减少 1 个
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
天府证券	2	-	-	-	-	-
万和证券	1	-	-	-	-	-
五矿证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
甬兴证券	2	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	本报告 期减少 2 个
长江证券	4	-	-	-	-	-
招商证券	4	-	-	-	-	本报告

						期减少 1 个
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中航证券	2	-	-	-	-	-
中金财富证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	5	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	7	-	-	-	-	本报告 期减少 1 个
中银国际证券	2	-	-	-	-	本报告 期减少 1 个
中邮证券	2	-	-	-	-	-

注：（一）选择标准

- 1、证券公司应财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强，并通过基金管理人的尽职调查。
- 2、被动股票型基金选择佣金费率相对较低，能够提供优质证券交易服务的证券公司。
- 3、被动股票型基金以外类型基金选择能够提供优质研究服务的证券公司。

（二）选择程序

- 1、基金管理人根据上述标准进行评估并确定选用的证券公司。
- 2、基金管理人与被选择的证券公司签订交易单元租用协议/证券经纪服务协议。

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	
	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
CHINA MERCHANTS SECURITIES(HK) CO.,LTD.	-	-	-	-	-	-
CLSA LIMITED	-	-	-	-	-	-
CHINA GALAXY INTERNATIONAL SECURITIES (HONG KONG) CO., LIMITED	-	-	-	-	-	-

HUATAI FINANCIAL HOLDINGS (HONG KONG) LIMITED	-	-	-	-	-	-
北京证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国联民生	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
国新证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
华源证券	-	-	-	-	-	-
汇丰前海证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-

南京证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
天府证券	-	-	-	-	-	-
万和证券	-	-	-	-	-	-
五矿证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
甬兴证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-
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	招商纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）溢价风险提示公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-01-06
2	招商纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）溢价风险提示公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会	2026-01-07

		基金电子披露网站	
3	关于旗下部分基金 2026 年 1 月 19 日因境外主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-01-16
4	招商基金管理有限公司旗下基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告	证券时报及基金管理人网站	2026-01-21
5	招商纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）2025 年第 4 季度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-01-21
6	招商纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）溢价风险提示公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-02-24
7	招商基金管理有限公司旗下部分基金增加国联民生证券股份有限公司为场内申购赎回代办券商的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-02
8	招商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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-20
9	招商纳斯达克 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	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-20
10	招商基金管理有限公司旗下基金 2025 年年度报告提示性公告	证券时报及基金管理人网站	2026-03-31
11	招商纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）2025 年年度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-31
12	关于旗下部分基金 2026 年 4 月 3 日因境外主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-04-02
13	招商纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）溢价风险提示公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-04-09
14	招商纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）更新的招募说明书（二零二六年第一号）	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-04-10
15	招商纳斯达克 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	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-04-10
16	招商基金管理有限公司旗下基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告	证券时报及基金管理人网站	2026-04-22
17	招商纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）2026 年第 1 季度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-04-22
18	招商基金管理有限公司关于提醒投资者持续完	证券时报、基金管理	2026-05-14

	善客户身份信息的公告	人网站及中国证监会 基金电子披露网站	
19	关于旗下部分基金 2026 年 5 月 25 日因港股通非交易日及境外主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-21
20	招商纳斯达克 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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-26
21	招商纳斯达克 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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-27
22	招商纳斯达克 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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-28
23	招商纳斯达克 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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-29
24	招商纳斯达克 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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-06-01
25	招商纳斯达克 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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-06-02
26	招商纳斯达克 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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-06-03
27	招商纳斯达克 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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-06-04
28	招商纳斯达克 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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-06-05
29	招商纳斯达克 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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-06-09
30	招商纳斯达克 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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-06-10
31	招商纳斯达克 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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-06-11
32	招商纳斯达克 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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-06-12

33	招商纳斯达克 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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-06-15
34	招商纳斯达克 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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-06-16
35	招商纳斯达克 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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-06-17
36	招商纳斯达克 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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-06-18
37	招商纳斯达克 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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-06-22
38	招商纳斯达克 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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-06-23
39	招商纳斯达克 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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-06-25
40	招商基金管理有限公司旗下部分基金增加金融街证券股份有限公司为场内申购赎回代办券商的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-06-26
41	招商纳斯达克 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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-06-26
42	招商纳斯达克 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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-06-29
43	招商纳斯达克 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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	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%	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

		的时间区 间					
招商纳 斯达克 100ETF 发起式 联接 （QDII）	1	20260101- 20260630	1,509,679,459.00	198,319,200.00	138,534,600.00	1,569,464,059.00	35.07%
产品特有风险							
本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况，可能会出现集中赎回甚至巨额赎回从而引发基金净值剧烈波动，甚至引发基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

注：1、报告期末持有份额占比按照四舍五入方法保留至小数点后第 2 位；

2、申购份额包含申购、定期定额投资、转换转入、红利再投资或者买入等业务增加的份额，赎回份额包含赎回、转换转出或者卖出等业务减少的份额。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准设立招商基金管理有限公司的文件；
- 2、中国证券监督管理委员会批准招商纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）设立的文件；
- 3、《招商纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金合同》；
- 4、《招商纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）托管协议》；
- 5、《招商纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）招募说明书》；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

招商基金管理有限公司
地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

12.3 查阅方式

上述文件可在招商基金管理有限公司互联网站上查阅，或者在营业时间内到招商基金管理有限公司查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人招商基金管理有限公司。

客户服务电话：400-887-9555

网址：<http://www.cmfcchina.com>

招商基金管理有限公司

2026 年 8 月 31 日