

国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金
2026 年中期报告
2026 年 6 月 30 日

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年八月三十一日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 2026 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
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	6
2.4 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 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
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	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
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所有权益投资明细	36
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	36
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	43
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动	43
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	45
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	45
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	45
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	45
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	45
7.11 投资组合报告附注	46

8 基金份额持有人信息	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	46
8.2 盈利投资者数量占比	47
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	47
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	47
9 开放式基金份额变动	47
10 重大事件揭示	47
10.1 基金份额持有人大会决议	47
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	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	48
10.4 基金投资策略的改变	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	48
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	48
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	48
10.8 其他重大事件	51
11 影响投资者决策的其他重要信息	52
12 备查文件目录	52
12.1 备查文件目录	52
12.2 存放地点	52
12.3 查阅方式	52

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金
基金简称	国泰纳斯达克 100 指数（QDII）
基金主代码	160213
交易代码	160213
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 4 月 29 日
基金管理人	国泰基金管理有限公司
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	472,284,533.89 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，以低成本、低换手率实现本基金对纳斯达克 100 指数（Nasdaq-100 Index,以下简称“标的指数”）的有效跟踪，追求跟踪误差最小化。
投资策略	本基金原则上采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但因特殊情况导致基金无法及时获得足够数量的股票时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。 本基金的风险控制目标是追求日均跟踪误差不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 5%（注：以美元资产计价计算）。 开放式指数基金跟踪误差的来源主要包括现金拖累、成份股调整时的交易策略以及基金每日现金流入/流出的建仓/变现策略、成份股股息的再投资策略等。基金管理人将通过对这些因素的有效管理，追求跟踪误差最小化。 另外，本基金基于流动性管理的需要，将投资于与本基金有相近的投资目标、投资策略、且以 Nasdaq-100 指数为投资标的的指数型公募基金（包括 ETF）（以下简称“目标基金”）。同时，为更好地实现本基金的投资目标，本基金还将在条件允许的情况下，开展证券借贷业务以及投资于股指期货等金融衍生品，以期降低跟踪误差水平。本基金投资于金融衍生品的目标是替代跟踪标的指数的成份股，使基金的投资组合更紧密地跟踪标的指数。不得应用于投机交易目的，或用作杠杆工具放大基金的投资。
业绩比较基准	纳斯达克 100 指数（Nasdaq-100 Index）收益率（总收益指数收益率）
风险收益特征	本基金属于股票型基金，预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，跟踪标的指数市场表现，目标为获取市场平均收益，是股票基金中处于中等风险水平的基金产品。

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		国泰基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	倪莹	王小飞
	联系电话	021-31081600转	021-60637103
	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		(021) 31089000, 400-888-8688	021-60637228
传真		021-31081800	021-60635778
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区 浦东大道1200号2层225室	北京市西城区金融大街25号
办公地址		上海市虹口区公平路18号8号 楼嘉昱大厦15-20层	北京市西城区闹市口大街1号 院1号楼
邮政编码		200082	100033
法定代表人		周向勇	张金良

2.4 境外资产托管人

项目		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	《证券日报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.gtfund.com
基金中期报告置备地点	上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 15-20 层和本基金托管人住所

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 日至 2026 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	107,590,654.30
本期利润	280,517,071.81
加权平均基金份额本期利润	0.6144
本期加权平均净值利润率	14.94%
本期基金份额净值增长率	16.06%
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	236,864,101.83
期末可供分配基金份额利润	0.5015
期末基金资产净值	2,177,013,836.58
期末基金份额净值	4.610
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	1,337.28%

注：(1)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

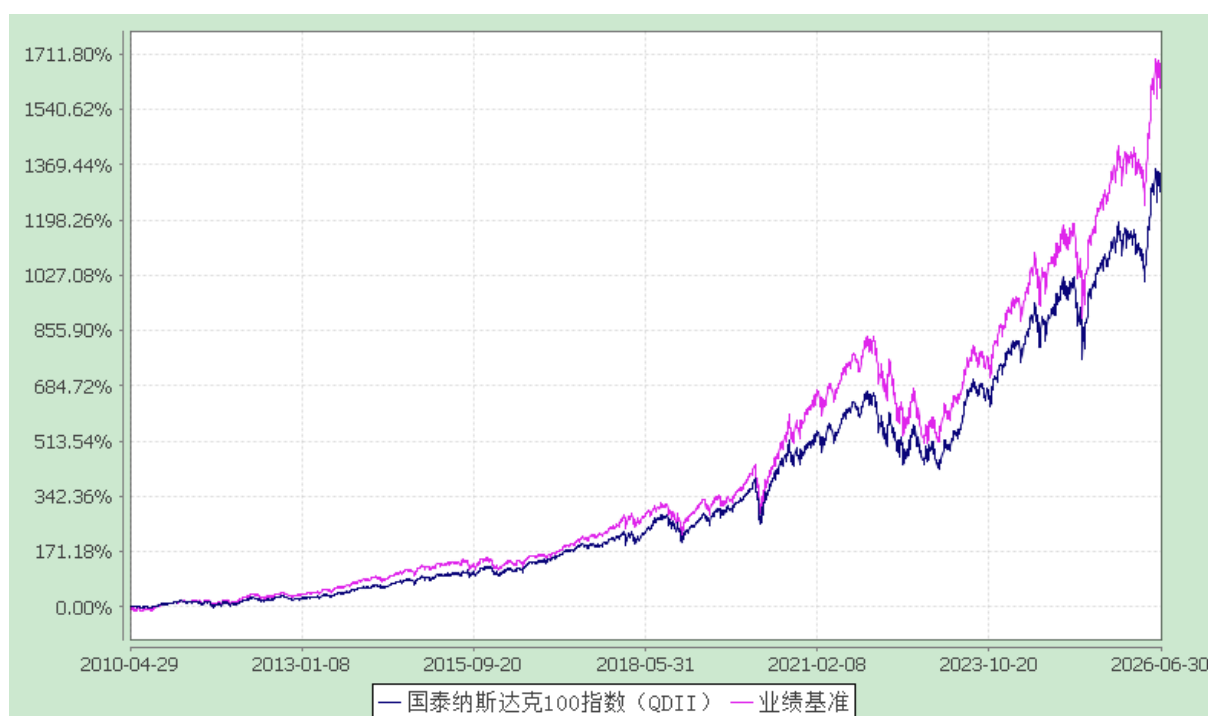
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	25.58%	1.52%	27.74%	1.52%	-2.16%	0.00%
过去六个月	16.06%	1.40%	20.31%	1.39%	-4.25%	0.01%
过去一年	26.02%	1.19%	34.38%	1.18%	-8.36%	0.01%
过去三年	84.61%	1.29%	104.04%	1.29%	-19.43%	0.00%
过去五年	110.26%	1.43%	116.28%	1.42%	-6.02%	0.01%
过去七年	271.03%	1.56%	317.68%	1.54%	-46.65%	0.02%
过去十年	558.93%	1.43%	650.18%	1.42%	-91.25%	0.01%
自基金合同生效起至今	1,337.28%	1.30%	1,676.58%	1.32%	-339.30%	-0.02%

注：同期业绩比较基准以美元计价，不包含人民币汇率变动等因素产生的效应。

3.2.2 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

国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2010 年 4 月 29 日至 2026 年 6 月 30 日)



注：（1）本基金合同生效日为 2010 年 4 月 29 日。本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

（2）同期业绩比较基准以美元计价，不包含人民币汇率变动等因素产生的效应。

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

国泰基金管理有限公司成立于 1998 年 3 月 5 日，是经中国证监会证监基字[1998]5 号文批准的首批规范的全国性基金管理公司之一。公司注册资本为 1.1 亿元人民币，公司注册地为上海，并在北京和深圳设有分公司。

截至 2026 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 319 只公开募集证券投资基金。另外，本基金管理人于 2004 年获得全国社会保障基金理事会社保基金资产管理人资格，目前受托管理全国社保基金多个投资组合。2007 年 11 月 19 日，本基金管理人获得企业年金投资管理人资格。2008 年 2 月 14 日，本基金管理人成为首批获准开展特定客户资产管理业务（专户理财）的基金公司之一，并于 3 月 24 日经中国证监会批准获得合格境内机构投资者（QDII）资格，囊括了公募基金、社保、年金、专户理财和 QDII 等管理业务资格。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
朱丹	国泰大宗商品(QDII-LOF)、国泰纳斯达克100指数(QDII)、国泰中证港股通高股息投资ETF、国泰中国企业境外高收益债券(QDII)、国泰中证香港内地国有企业ETF(QDII)、国泰中证港股通高股息投资ETF发起联接、国泰中证港股通汽车产业主题ETF的基金经理、国际业务部副总监	2022-01-27	-	10 年	硕士研究生。2016 年 1 月加入国泰基金，历任研究员、基金经理助理。2020 年 11 月至 2023 年 5 月任国泰恒生港股通指数证券投资基金(LOF)的基金经理，2022 年 1 月起兼任国泰大宗商品配置证券投资基金(LOF)和国泰纳斯达克100 指数证券投资基金的基金经理，2022 年 12 月至 2024 年 2 月任国泰蓝筹精选混合型证券投资基金的基金经理，2024 年 7 月起兼任国泰中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2024 年 8 月起兼任国泰中国企业境外高收益债券型证券投资基金和国泰中证香港内地国有企业交易型开放式指数证券投资基金(QDII)的基金经理，2024 年 10 月起兼任国泰中证港股通高股息投资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，2025 年 9 月起兼任国泰中证港股通汽车产业主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 6 月起任国际业务部副总监。

注：1、此处的任职日期和离任日期均指公司决定生效之日，首任基金经理，任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从法律法规及行业协会的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等有关法律法规的规定，严格遵守基金合同和招募说明书约定，本着诚实信用、勤勉尽责、最大限度保护投资人合法权益等原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合法合规，未发生损害基金份额持有人利益的行为，未发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为，信息披露及时、准确、完整，本基金与本基金管理人管理的其他基金资产、投资组合与公司资产之间严格分开、公平对待，基金管理团队保持独立运作，并通过科学决策、规范运作、精心管理和健全内控体系，有效保障投资人的合法权益。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定，通过严格的内部风险控制制度和流程，对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制，确保公平对待所管理的所有基金和投资组合，切实防范利益输送行为。

本报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（1 日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合向交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 10 次，为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年美股震荡上行，不同指数表现有所分化。大盘指数标普 500 上涨 9.6%，周期股为主的道琼斯工业指数上涨 8.9%，龙头科技股为主的纳斯达克 100 指数（本基金跟踪的指数）上涨 19.9%。上半年美元兑人民币中间价贬值幅度较大，对本基金人民币计价净值产生拖累。剔除汇率因素后，本基金净值和纳斯达克 100 指数走势高度吻合。

回顾上半年，1 月公布的美国 GDP 数据超预期，特朗普正式提名更为理性的沃什出任下届美联

储主席，但是其夺取格陵兰岛的威胁使得欧美关系的裂痕加深，部分欧洲资金因此出售美国资产，美股高位震荡。2 月，中美领导人恢复通话，美国最高法院裁定特朗普关税政策违法，市场风险偏好得到提振，但随着资金对 AI 资本支出的回收担忧再起，叠加月末美国突袭伊朗，美股月末下跌。3 月，美伊冲突持续升级，伊朗反抗幅度超预期、彻底封锁霍尔木兹海峡，油价飙升，同时美国就业数据超预期走弱，“滞胀”成为市场交易的主线，美股大幅回调。4 月，美国核心 PCE 等通胀数据创三年新高，美联储 FOMC 维持联邦基准利率不变，多名委员释放偏鹰信号；但以存储为代表的半导体产业维持高景气度，市场对分子端信心较强，美股强势上涨；5 月，中美领导人会晤、中东地缘冲突缓和，国际油价震荡回落，缓解市场滞胀担忧，新任美联储主席沃什偏鹰表态引发美债收益率持续冲高；但 2026 年一季报美股科技龙头维持较高的 AI 资本开支，市场对分子端口的信心强劲，美股持续上涨。6 月，原油价格走弱压低通胀上行压力，美联储新任主席的首场 FOMC 维持联邦基准利率不变，点阵图显示全年加息概率上调，市场对分母端有所担忧；SpaceX 完成史上最大 IPO，美股高位震荡。

聚焦到美股科技股层面，以美股五大科技龙头为例，一季度公布的 2025 年四季度业绩普遍维持韧性，大多好于市场预期，指引也较为积极。回顾一季度，海外 AI 应用调用量增长继续加速，科技巨头对 AI 资本支出的投入均显著加码，但是市场不再认可高额的资本支出，反而更担忧其对盈利的拖累。一季度 AI 创新继续演绎，通过继续扩展和强化学习，头部模型基础能力再度进化，复杂任务处理能力大幅进步，代理式 AI 工具开始具备超长任务规划能力。科技龙头二季度公布的业绩普遍维持韧性，符合市场预期，指引较为积极。回顾二季度，中美持续加码算力基建投资，但市场对投入产出比、现金流情况等因素的忧虑持续。本季度 AI 创新逐渐规模化落地，全市场 Token 调用量显著抬升，需求端逐渐从 Token 最大化向 Token 预算管控转变。长期维度，我们仍然看好美股科技龙头在 AI 时代获取业绩增量的能力，认为以纳斯达克 100 指数为代表的美国科技板块具备充足的投资价值。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内的净值增长率为 16.06%，同期业绩比较基准收益率为 20.31%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2026 年下半年，我们认为需关注美国宏观、业绩兑现度以及 AI 商业化进展。

美国宏观经济方面，虽然油价高位回落，但就业数据边际走弱，市场对滞胀的担忧并未完全消解。新任美联储主席上台后，年内降息空间与时点存在较大不确定性，我们将持续关注美国增长韧性和降息路径的变化。

业绩兑现度方面，基本面坚韧的龙头公司股价仍然处于相对高位，业绩的持续兑现成为估值处于合理水平的必要条件，因此需继续跟踪传统业务利润增速和指引，同时随着前期 AI 资本开支折摊压力逐渐增加，AI 对盈利能力的净增量值得重点观察。

AI 技术方面，头部大模型公司迭代加速，在上市前竞争持续升温。AI 应用方面，我们将继续观察订阅、广告、电商等变现路径实际创造的价值量是否和巨额投资匹配。另外，我们认为目前 AI 基建对融资的依赖度偏高，因此行业杠杆水平和债务风险值得重点关注。

总体来看，我们看好中长期美股科技龙头利用 AI 技术实现业绩持续增长的潜力，不过短期需警惕情绪回调带来的股价波动。

接下来我们仍将继续利用国泰纳斯达克 100 指数基金，为投资者跟踪美股表现创造便利。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。报告期内相关基金估值政策由托管人进行复核。公司估值委员会由主管运营的公司领导负责，成员包括基金核算、风险管理、行业研究方面业务骨干，均具有丰富的行业分析、会计核算等证券投资基金行业从业经验及专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

截至本报告期末，根据本基金基金合同和相关法律法规的规定，本基金无应分配但尚未实施的利润。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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合规守信、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关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：国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	209,439,526.81	190,953,973.53
结算备付金		184,621,664.62	136,641,799.30
存出保证金		35,209,056.52	31,141,660.70
交易性金融资产	6.4.7.2	1,762,610,109.26	1,503,051,992.21
其中：股票投资		1,762,610,109.26	1,503,051,992.21
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	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		198,151.97	381,247.32
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		2,192,078,509.18	1,862,170,673.06

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		-	-
应付赎回款		11,752,836.18	5,007,085.98
应付管理人报酬		1,420,733.11	1,280,401.39
应付托管费		355,183.27	320,100.36
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,417,431.02	252,795.05
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	118,489.02	189,817.37
负债合计		15,064,672.60	7,050,200.15
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	472,284,533.89	467,078,133.08
未分配利润	6.4.7.8	1,704,729,302.69	1,388,042,339.83
净资产合计		2,177,013,836.58	1,855,120,472.91
负债和净资产总计		2,192,078,509.18	1,862,170,673.06

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值 4.610 元，基金份额总额 472,284,533.89 份。

6.2 利润表

会计主体：国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		290,063,891.95	127,035,010.38
1.利息收入		487,829.70	744,291.41
其中：存款利息收入	6.4.7.9	487,829.70	744,291.41
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）		123,517,754.51	125,632,913.84
其中：股票投资收益	6.4.7.10	76,742,874.13	135,870,927.64
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		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	42,188,172.67	-16,486,230.05
股利收益	6.4.7.14	4,586,707.71	6,248,216.25
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	172,926,417.51	-4,604,038.77
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-6,997,539.75	4,996,744.10
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	129,429.98	265,099.80
减：二、营业总支出		9,546,820.14	11,276,705.46
1. 管理人报酬		7,429,922.75	8,628,611.91
2. 托管费		1,857,480.59	2,245,362.55
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		-	-
7. 税金及附加		170,568.93	-
8. 其他费用	6.4.7.17	88,847.87	402,731.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		280,517,071.81	115,758,304.92
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		280,517,071.81	115,758,304.92
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		280,517,071.81	115,758,304.92

6.3 净资产变动表

会计主体：国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	467,078,133.08	1,388,042,339.83	1,855,120,472.91
二、本期期初净资产	467,078,133.08	1,388,042,339.83	1,855,120,472.91
三、本期增减变动额（减少以	5,206,400.81	316,686,962.86	321,893,363.67

“-”号填列)			
(一)、综合收益总额	-	280,517,071.81	280,517,071.81
(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)	5,206,400.81	36,169,891.05	41,376,291.86
其中: 1.基金申购款	47,119,163.53	166,783,321.85	213,902,485.38
2.基金赎回款	-41,912,762.72	-130,613,430.80	-172,526,193.52
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	472,284,533.89	1,704,729,302.69	2,177,013,836.58
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	288,287,166.05	2,265,468,668.04	2,553,755,834.09
二、本期期初净资产	288,287,166.05	2,265,468,668.04	2,553,755,834.09
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	4,706,398.39	-442,031,134.62	-437,324,736.23
(一)、综合收益总额	-	115,758,304.92	115,758,304.92
(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)	4,706,398.39	27,215,790.25	31,922,188.64
其中: 1.基金申购款	49,596,414.90	309,100,032.73	358,696,447.63
2.基金赎回款	-44,890,016.51	-281,884,242.48	-326,774,258.99
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净	-	-585,005,229.79	-585,005,229.79

资产变动数（净资产减少以“-”号填列）			
四、本期期末净资产	292,993,564.44	1,823,437,533.42	2,116,431,097.86

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：李昇，主管会计工作负责人：吴洪涛，会计机构负责人：张洁清

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金(以下简称“本基金”)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[2010]第 208 号《关于核准国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金募集的批复》核准，由国泰基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 555,798,507.70 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2010)第 098 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金基金合同》于 2010 年 4 月 29 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 555,982,545.46 份基金份额，其中认购资金利息折合 184,037.76 份基金份额。本基金的基金管理人为国泰基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司，境外资产托管人为美国道富银行。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金基金合同》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 Nasdaq-100 指数成份股、在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、以 Nasdaq-100 指数为投资标的的指数型公募基金(包括 ETF)(以下简称“目标基金”)、货币市场工具以及中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等；本基金至少 80%的资产投资于 Nasdaq-100 指数的成份股和目标基金，其中，本基金持有的目标基金的市值合计不超过本基金资产净值的 10%。本基金的业绩比较基准为：纳斯达克 100 指数(Nasdaq-100 Index)收益率(总收益指数收益率)。

本财务报表由本基金的基金管理人国泰基金管理有限公司于 2026 年 8 月 27 日批准报出。

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附注 6.4.2 中所列示的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要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 6 月 30 日的财务状况、2026 年半年度的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本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 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

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	209,439,526.81
等于：本金	209,436,779.60
加：应计利息	2,747.21
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	209,439,526.81

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	1,128,230,167.65	-	1,762,610,109.26	634,379,941.61
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-

债券	交易所 市场	-	-	-	-
	银行间 市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,128,230,167.65	-	1,762,610,109.26	634,379,941.61

注：股票包括普通股、存托凭证、优先股和房地产信托凭证等。

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	400,527,056.23	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	400,527,056.23	-	-	-

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指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。

6.4.7.3.2 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 US	NASDAQ 100 E-MINI Sep26	100.00	415,785,012.30	15,257,956.07
合计	-	-	-	15,257,956.07
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	15,257,956.07
净额	-	-	-	-

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

6.4.7.4 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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有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	35,178.34
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	83,310.68
合计	118,489.02

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	467,078,133.08	467,078,133.08
本期申购	47,119,163.53	47,119,163.53
本期赎回（以“-”号填列）	-41,912,762.72	-41,912,762.72
本期末	472,284,533.89	472,284,533.89

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	127,003,248.78	1,261,039,091.05	1,388,042,339.83
本期期初	127,003,248.78	1,261,039,091.05	1,388,042,339.83
本期利润	107,590,654.30	172,926,417.51	280,517,071.81

本期基金份额交易产生的变动数	2,270,198.75	33,899,692.30	36,169,891.05
其中：基金申购款	18,564,670.00	148,218,651.85	166,783,321.85
基金赎回款	-16,294,471.25	-114,318,959.55	-130,613,430.80
本期已分配利润	-	-	-
本期末	236,864,101.83	1,467,865,200.86	1,704,729,302.69

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	487,823.81
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	5.89
合计	487,829.70

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	317,081,562.64
减：卖出股票成本总额	240,267,894.89
减：交易费用	70,793.62
买卖股票差价收入	76,742,874.13

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

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.7.13.2 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	42,188,172.67
----------	---------------

6.4.7.14 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	4,586,707.71
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	4,586,707.71

6.4.7.15 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	157,794,563.22
——股票投资	157,794,563.22
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——其他	-
2.衍生工具	15,131,854.29
——权证投资	-
——股指期货	15,131,854.29
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	172,926,417.51

6.4.7.16 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	129,429.98
合计	129,429.98

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25%归入基金资产。

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	23,803.31
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费用	5,537.19
合计	88,847.87

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，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国泰基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
美国道富银行（State Street Bank and Trust Company）	境外资产托管人
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金销售机构

注：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

本基金本报告期内及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

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	7,429,922.75	8,628,611.91
其中：应支付销售机构的客户维护费	3,317,890.49	3,582,453.09
应支付基金管理人的净管理费	4,112,032.26	5,046,158.82

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.80%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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.80\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2026年1月1日至2026年6月30日	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	1,857,480.59	2,245,362.55

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.20%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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

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均未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 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间内均无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.4.2 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

本基金本报告期末及上年度末均无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	15,627,724.25	192,991.66	180,465,795.71	516,613.93
美国道富银行	193,811,802.56	294,832.15	64,534,230.08	227,677.48

注：本基金的银行存款分别由基金托管人中国建设银行和境外资产托管人美国道富银行保管，按适用利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期及上年度可比期间未有在承销期间参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

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

本基金投资的金融工具主要包括股票投资及基金投资等。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。本基金属于股票型基金，预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，跟踪标的指数市场表现，目标为获取市场平均收益，是股票基金中处于中等风险水平的基金产品。

本基金的基金管理人奉行全员与全程结合、风控与发展并重的风险管理理念。董事会主要负责公司的风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。在公司经营管理层下设风险管理委员会，制定公司日常经营过程中各类风险的防范和管理措施；在业务操作层面，一线业务部门负责对各自业务领域风险的管控，公司具体的风险管理职责由风险管理部、审计部和稽核监察部负责，组织、协调并与各业务部门一道，共同完成对法律风险、投资风险、操作风险、合规风险等风险类别的管理，并定期向公司专门的风险管理委员会报告公司风险状况。风险管理部和稽核监察部由督察

长分管，配置有法律、风控、信息披露等方面专业人员。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 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本基金的托管人中国建设银行及境外资产托管人美国道富银行，因而与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，因此信用风险不重大。

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

于 2026 年 6 月 30 日，本基金持有信用类债券比例为 0.00%(2025 年 12 月 31 日：0.00%)。

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，有效保障基金份额持有人利益。

于 2026 年 06 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内，可赎回基金份额净值(净资产)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。

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期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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%。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%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持证券在证券交易所上市，均能以合理价格适时变现。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。

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现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。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、存出保证金及结算备付金等。

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	209,439,526.81	-	-	-	209,439,526.81
结算备付金	-	-	-	184,621,664.62	184,621,664.62
存出保证金	-	-	-	35,209,056.52	35,209,056.52
交易性金融资产	-	-	-	1,762,610,109.26	1,762,610,109.26
应收股利	-	-	-	198,151.97	198,151.97
资产总计	209,439,526.81	-	-	1,982,638,982.37	2,192,078,509.18
负债					
应付赎回款	-	-	-	11,752,836.18	11,752,836.18
应付管理人报酬	-	-	-	1,420,733.11	1,420,733.11
应付托管费	-	-	-	355,183.27	355,183.27
应交税费	-	-	-	1,417,431.02	1,417,431.02
其他负债	-	-	-	118,489.02	118,489.02
负债总计	-	-	-	15,064,672.60	15,064,672.60
利率敏感度缺口	209,439,526.81	-	-	1,967,574,309.77	2,177,013,836.58

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	190,953,973.53	-	-	-	190,953,973.53
结算备付金	-	-	-	136,641,799.30	136,641,799.30
存出保证金	-	-	-	31,141,660.70	31,141,660.70
交易性金融资产	-	-	-	1,503,051,992.21	1,503,051,992.21
应收股利	-	-	-	381,247.32	381,247.32
资产总计	190,953,973.53	-	-	1,671,216,699.53	1,862,170,673.06
负债					
应付赎回款	-	-	-	5,007,085.98	5,007,085.98
应付管理人报酬	-	-	-	1,280,401.39	1,280,401.39
应付托管费	-	-	-	320,100.36	320,100.36
应交税费	-	-	-	252,795.05	252,795.05
其他负债	-	-	-	189,817.37	189,817.37
负债总计	-	-	-	7,050,200.15	7,050,200.15
利率敏感度缺口	190,953,973.53	-	-	1,664,166,499.38	1,855,120,472.91

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 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金净资产的比例为 0.00%（2025 年 12 月 31 日：0.00%），因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响（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计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 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	合计
以外币计价的资产		
货币资金	194,062,696.57	194,062,696.57
存出保证金	35,209,056.52	35,209,056.52
结算备付金	184,621,664.62	184,621,664.62
交易性金融资产	1,762,610,109.26	1,762,610,109.26
应收股利	198,151.97	198,151.97
资产合计	2,176,701,678.94	2,176,701,678.94
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	2,176,701,678.94	2,176,701,678.94
项目	上年度末	
	2025年12月31日	
	美元 折合人民币	合计
以外币计价的资产		
货币资金	2,598,524.94	2,598,524.94
存出保证金	31,141,660.70	31,141,660.70
结算备付金	136,641,799.30	136,641,799.30
交易性金融资产	1,503,051,992.21	1,503,051,992.21
应收股利	381,247.32	381,247.32

资产合计	1,673,815,224.47	1,673,815,224.47
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	1,673,815,224.47	1,673,815,224.47

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	上年度末
		2026 年 6 月 30 日	2025 年 12 月 31 日
	美元相对人民币升值 5%	增加约 108,835,083.95	增加约 83,690,761.22
	美元相对人民币贬值 5%	减少约 108,835,083.95	减少约 83,690,761.22

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。本基金主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 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	1,762,610,109.26	80.96	1,503,051,992.21	81.02
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,762,610,109.26	80.96	1,503,051,992.21	81.02

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准外的其他市场变量不变		
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%	增加约 109,400,232.37	增加约 92,595,909.50
	业绩比较基准下降 5%	减少约 109,400,232.37	减少约 92,595,909.50

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	1,762,610,109.26	1,503,051,992.21
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	1,762,610,109.26	1,503,051,992.21

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。

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2026 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2025 年 12 月 31 日：同)。

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以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，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

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,762,610,109.26	80.41
	其中：普通股	1,733,475,244.24	79.08
	存托凭证	29,134,865.02	1.33
	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	394,061,191.43	17.98

8	其他各项资产	35,407,208.49	1.62
9	合计	2,192,078,509.18	100.00

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
美国	1,762,610,109.26	80.96
合计	1,762,610,109.26	80.96

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（%）
信息技术	1,074,671,755.92	49.36
通讯业务	213,916,043.64	9.83
非日常生活消费品	188,281,934.90	8.65
日常消费品	111,430,324.04	5.12
医疗保健	63,230,891.08	2.90
工业	61,304,607.94	2.82
公用事业	20,206,070.09	0.93
原材料	18,555,854.34	0.85
能源	8,106,972.05	0.37
金融	2,905,655.26	0.13
房地产	-	-
合计	1,762,610,109.26	80.96

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权益投资。

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 (英文)	公司名称 (中文)	证券代码	所在证 券市场	所属国家 (地区)	数量（股）	公允价值	占基金资 产净值比 例（%）
----	--------------	--------------	------	------------	--------------	-------	------	----------------------

1	NVIDIA Corp	英伟达公司	NVDA US	纳斯达克	美国	98,880	134,752,969.96	6.19
2	Apple Inc	苹果公司	AAPL US	纳斯达克	美国	59,790	117,834,253.01	5.41
3	Alphabet Inc	Alphabet 股份有限公司	GOOGL US	纳斯达克	美国	23,720	57,734,748.82	2.65
			GOOG US	纳斯达克	美国	22,220	53,472,325.50	2.46
4	Micron Technology Inc	美光科技股份有限公司	MU US	纳斯达克	美国	12,210	95,992,013.42	4.41
5	Microsoft Corp	微软公司	MSFT US	纳斯达克	美国	30,350	77,107,268.21	3.54
6	Advanced Micro Devices Inc	AMD 公司	AMD US	纳斯达克	美国	18,210	72,048,227.72	3.31
7	Amazon.com Inc	亚马逊公司	AMZN US	纳斯达克	美国	43,600	70,776,311.90	3.25
8	Tesla Inc	特斯拉公司	TSLA US	纳斯达克	美国	20,230	57,952,163.64	2.66
9	Intel Corp	英特尔公司	INTC US	纳斯达克	美国	55,880	53,142,213.44	2.44
10	Broadcom Inc	博通股份有限公司	AVGO US	纳斯达克	美国	19,300	49,655,377.27	2.28
11	Meta Platforms Inc	Meta 平台股份有限公司	META US	纳斯达克	美国	12,010	46,076,507.45	2.12
12	Applied Materials Inc	应用材料公司	AMAT US	纳斯达克	美国	8,790	43,284,427.35	1.99
13	Walmart Inc	沃尔玛股份有限公司	WMT US	纳斯达克	美国	55,520	42,828,268.69	1.97
14	Lam Research Corp	泛林集团	LRCX US	纳斯达克	美国	13,890	40,994,491.76	1.88
15	Cisco Systems Inc	思科公司	CSCO US	纳斯达克	美国	44,400	35,520,369.14	1.63
16	Costco Wholesale Corp	开市客公司	COST US	纳斯达克	美国	5,050	32,175,532.75	1.48
17	KLA Corp	科磊公司	KLAC US	纳斯达	美国	14,600	30,001,782.93	1.38

				克				
18	Sandisk Corp	闪迪公司/特拉华州	SNDK US	纳斯达克	美国	1,610	24,932,697.73	1.15
19	Netflix Inc	奈飞公司	NFLX US	纳斯达克	美国	47,400	23,050,537.52	1.06
20	Palo Alto Networks Inc	派拓网络公司	PANW US	纳斯达克	美国	9,120	21,182,596.44	0.97
21	Texas Instruments Inc	德州仪器公司	TXN US	纳斯达克	美国	10,320	20,950,889.62	0.96
22	Palantir Technologies Inc	Palantir 技术股份有限公司	PLTR US	纳斯达克	美国	25,720	20,437,824.52	0.94
23	Marvell Technology Inc	美满电子科技公司	MRVL US	纳斯达克	美国	9,740	19,761,476.27	0.91
24	Linde PLC	林德公司	LIN US	纳斯达克	美国	5,250	18,555,854.34	0.85
25	Western Digital Corp	西部数据公司	WDC US	纳斯达克	美国	3,860	16,791,996.07	0.77
26	Seagate Technology Holdings PLC	Seagate Technology 控股公共有限公司	STX US	纳斯达克	美国	2,500	16,431,296.25	0.75
27	Amgen Inc	安进公司	AMGN US	纳斯达克	美国	6,100	15,044,814.96	0.69
28	Analog Devices Inc	亚德诺半导体公司	ADI US	纳斯达克	美国	5,550	15,013,222.60	0.69
29	QUALCOMM Inc	高通公司	QCOM US	纳斯达克	美国	11,890	14,964,590.05	0.69
30	CrowdStrike Holdings Inc	CrowdStrike 控股股份有限公司	CRWD US	纳斯达克	美国	2,850	14,813,360.14	0.68
31	PepsiCo Inc	百事公司	PEP US	纳斯达克	美国	15,560	14,349,367.58	0.66
32	T-Mobile US Inc	T-Mobile US 股份有限公司	TMUS US	纳斯达克	美国	12,320	14,074,272.61	0.65
33	ASML	阿斯麦控	ASML US	纳斯达	美国	1,020	13,820,874.43	0.63

	Holding NV	股公司		克				
34	Gilead Sciences Inc	吉利德科学公司	GILD US	纳斯达克	美国	14,030	12,072,662.16	0.55
35	AppLovin Corp	AppLovin 公司	APP US	纳斯达克	美国	3,380	11,861,028.42	0.54
36	ARM Holdings PLC	ARM 控股公共有限公司	ARM US	纳斯达克	美国	4,730	11,422,670.05	0.52
37	Intuitive Surgical Inc	直觉外科手术公司	ISRG US	纳斯达克	美国	3,990	10,807,149.26	0.50
38	Shopify Inc	Shopify 股份有限公司	SHOP US	纳斯达克	美国	13,790	10,724,049.47	0.49
39	Booking Holdings Inc	缤客控股公司	BKNG US	纳斯达克	美国	8,780	10,658,698.88	0.49
40	Vertex Pharmaceuticals Inc	福泰制药公司	VRTX US	纳斯达克	美国	2,870	9,709,721.88	0.45
41	Starbucks Corp	星巴克公司	SBUX US	纳斯达克	美国	12,870	8,957,595.56	0.41
42	Fortinet Inc	飞塔信息	FTNT US	纳斯达克	美国	8,230	8,610,970.47	0.40
43	Cadence Design Systems Inc	铿腾电子科技有限公司	CDNS US	纳斯达克	美国	3,110	7,949,990.33	0.37
44	Marriott International Inc/MD	万豪国际集团	MAR US	纳斯达克	美国	3,000	7,572,154.29	0.35
45	Monster Beverage Corp	怪兽饮料公司	MNST US	纳斯达克	美国	11,060	7,240,580.61	0.33
46	Automatic Data Processing Inc	自动数据处理公司	ADP US	纳斯达克	美国	4,530	6,909,613.78	0.32
47	Constellation Energy	美国联合能源公司	CEG US	纳斯达克	美国	4,083	6,906,897.66	0.32

	Corp							
48	CSX Corp	CSX 公司	CSX US	纳斯达克	美国	20,950	6,781,977.51	0.31
49	Comcast Corp	康卡斯特公司	CMCSA US	纳斯达克	美国	40,520	6,775,251.75	0.31
50	MercadoLibre Inc	自由市场公司	MELI US	纳斯达克	美国	580	6,705,237.06	0.31
51	Synopsys Inc	新思科技公司	SNPS US	纳斯达克	美国	2,188	6,647,446.30	0.31
52	Datadog Inc	数据狗	DDOG US	纳斯达克	美国	3,690	6,543,425.06	0.30
53	Adobe Inc	奥多比公司	ADBE US	纳斯达克	美国	4,590	6,409,341.60	0.29
54	Astera Labs Inc	Astera Labs 股份有限公司	ALAB US	纳斯达克	美国	1,910	6,283,519.75	0.29
55	O'Reilly Automotive Inc	奥莱利汽车公司	ORLY US	纳斯达克	美国	9,510	5,964,822.08	0.27
56	DoorDash Inc	DoorDash 股份有限公司	DASH US	纳斯达克	美国	4,650	5,844,191.50	0.27
57	Mondelez International Inc	亿滋国际公司	MDLZ US	纳斯达克	美国	14,680	5,783,075.25	0.27
58	American Electric Power Co Inc	美国电力公司	AEP US	纳斯达克	美国	6,170	5,749,201.24	0.26
59	Teradyne Inc	泰瑞达	TER US	纳斯达克	美国	1,740	5,733,971.39	0.26
60	Intuit Inc	财捷集团	INTU US	纳斯达克	美国	3,120	5,546,252.09	0.25
61	NXP Semiconductors NV	恩智浦半导体公司	NXPI US	纳斯达克	美国	2,870	5,493,372.94	0.25
62	Honeywell International Inc	霍尼韦尔国际公司	HON US	纳斯达克	美国	3,550	5,413,609.81	0.25
63	Ross Stores Inc	罗斯百货股份有限公司	ROST US	纳斯达克	美国	3,690	5,349,393.24	0.25
64	Honeywell	霍尼韦尔	HONA US	纳斯达克	美国	3,550	5,345,425.89	0.25

	l Aerospace Inc	航空航天 股份有限 公司		克				
65	Monolithi c Power Systems Inc	芯源系统 有限公司	MPWR US	纳斯达 克	美国	560	5,272,464.81	0.24
66	Cintas Corp	信达思公 司	CTAS US	纳斯达 克	美国	4,530	5,247,542.36	0.24
67	Warner Bros Discovery Inc	华纳兄弟 探索股份 有限公司	WBD US	纳斯达 克	美国	28,400	5,156,832.07	0.24
68	Regenero n Pharmace uticals Inc	再生元制 药股份有 限公司	REGN US	纳斯达 克	美国	1,170	4,968,836.25	0.23
69	Lumentu m Holdings Inc	Lumentum 控股股份 有限公司	LITE US	纳斯达 克	美国	850	4,967,536.73	0.23
70	PACCAR Inc	帕卡公司	PCAR US	纳斯达 克	美国	5,930	4,851,483.08	0.22
71	Nebius Group NV	Nebius 集 团股份有 限公司	NBIS US	纳斯达 克	美国	2,460	4,627,176.98	0.21
72	Airbnb Inc	爱彼迎股 份有限公 司	ABNB US	纳斯达 克	美国	4,730	4,610,046.21	0.21
73	Rocket Lab Corp	Rocket Lab 公司	RKLB US	纳斯达 克	美国	6,440	4,458,592.22	0.20
74	Baker Hughes Co	贝克休斯 公司	BKR US	纳斯达 克	美国	11,280	4,263,895.84	0.20
75	Fastenal Co	法思诺公 司	FAST US	纳斯达 克	美国	12,950	4,236,301.47	0.19
76	Electronic Arts Inc	艺电公司	EA US	纳斯达 克	美国	2,840	3,966,079.70	0.18
77	PDD Holdings Inc	拼多多控 股公司	PDD US	纳斯达 克	美国	7,490	3,891,320.54	0.18
78	Xcel Energy Inc	Xcel 能源 股份有限 公司	XEL US	纳斯达 克	美国	7,070	3,866,690.96	0.18

79	Diamondback Energy Inc	戴蒙德巴克能源	FANG US	纳斯达克	美国	3,210	3,843,076.21	0.18
80	Microchip Technology Inc	微芯科技股份有限公司	MCHP US	纳斯达克	美国	6,150	3,820,097.59	0.18
81	Ferrovial NV	Ferrovial 股份有限公司	FER US	纳斯达克	美国	8,110	3,789,769.34	0.17
82	Exelon Corp	爱克斯龙公司	EXC US	纳斯达克	美国	11,600	3,683,280.23	0.17
83	Take-Two Interactive Software Inc	Take-Two 互动软件股份有限公司	TTWO US	纳斯达克	美国	2,120	3,609,488.22	0.17
84	Old Dominion Freight Line Inc	奥多明尼昂货运	ODFL US	纳斯达克	美国	2,360	3,481,568.62	0.16
85	Axon Enterprise Inc	Axon Enterprise 股份有限公司	AXON US	纳斯达克	美国	910	3,474,615.37	0.16
86	Coca-Cola Europacific Partners PLC	可口可乐欧洲合伙公开股份公司	CCEP US	纳斯达克	美国	5,060	3,448,727.82	0.16
87	Keurig Dr Pepper Inc	克里格胡椒博士	KDP US	纳斯达克	美国	15,400	3,432,979.66	0.16
88	CoreWeave Inc	CoreWeave 股份有限公司	CRWV US	纳斯达克	美国	5,040	3,416,903.21	0.16
89	IDEXX Laboratories Inc	爱德士股份有限公司	IDXX US	纳斯达克	美国	900	3,226,977.18	0.15
90	Autodesk Inc	欧特克公司	ADSK US	纳斯达克	美国	2,410	3,191,262.18	0.15
91	Alnylam Pharmaceuticals Inc	艾拉伦制药股份有限公司	ALNY US	纳斯达克	美国	1,530	3,136,936.40	0.14
92	PayPal	贝宝	PYPL US	纳斯达克	美国	9,880	2,905,655.26	0.13

	Holdings Inc			克				
93	Paychex Inc	沛齐公司	PAYX US	纳斯达克	美国	4,070	2,725,743.29	0.13
94	Roper Technologies Inc	儒博技术公司	ROP US	纳斯达克	美国	1,150	2,650,451.52	0.12
95	Thomson Reuters Corp	汤森路透公司	TRI US	纳斯达克	美国	4,376	2,434,133.38	0.11
96	GE Healthcare Technologies Inc	GE 医疗技术公司	GEHC US	纳斯达克	美国	5,140	2,240,863.74	0.10
97	Strategy Inc	Strategy 股份有限公司	MSTR US	纳斯达克	美国	3,670	2,172,902.54	0.10
98	Kraft Heinz Co/The	卡夫亨氏公司	KHC US	纳斯达克	美国	13,500	2,171,791.68	0.10
99	Copart Inc	科帕特公司	CPRT US	纳斯达克	美国	11,220	2,154,231.82	0.10
100	Dexcom Inc	德康医疗	DXCM US	纳斯达克	美国	4,410	2,022,929.25	0.09
101	Workday Inc	Workday 股份有限公司	WDAY US	纳斯达克	美国	2,270	1,892,704.16	0.09

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权益投资。

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	58,808,060.38	3.17
2	Alphabet Inc	GOOGL US	27,373,892.12	1.48
		GOOG US	4,238,458.85	0.23
3	Apple Inc	AAPL US	24,380,103.86	1.31

4	Micron Technology Inc	MU US	24,346,118.57	1.31
5	PepsiCo Inc	PEP US	18,777,168.36	1.01
6	ASML Holding NV	ASML US	17,269,827.75	0.93
7	Intel Corp	INTC US	12,660,073.67	0.68
8	Costco Wholesale Corp	COST US	11,076,911.70	0.60
9	Sandisk Corp	SNDK US	10,886,900.00	0.59
10	NVIDIA Corp	NVDA US	10,752,802.32	0.58
11	Microsoft Corp	MSFT US	9,924,285.70	0.53
12	Tesla Inc	TSLA US	9,257,148.23	0.50
13	ARM Holdings PLC	ARM US	7,360,327.82	0.40
14	Amazon.com Inc	AMZN US	5,682,048.12	0.31
15	Lumentum Holdings Inc	LITE US	5,252,930.61	0.28
16	Teradyne Inc	TER US	5,181,545.78	0.28
17	Astera Labs Inc	ALAB US	5,100,339.63	0.27
18	Nebius Group NV	NBIS US	4,029,551.29	0.22
19	Advanced Micro Devices Inc	AMD US	3,843,525.87	0.21
20	Rocket Lab Corp	RKLB US	3,711,213.34	0.20

注：1.此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

2.买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	Alphabet Inc	GOOGL US	29,697,189.24	1.60
		GOOG US	5,728,788.81	0.31
2	Apple Inc	AAPL US	29,951,612.94	1.61
3	Micron Technology Inc	MU US	28,157,963.19	1.52
4	ASML Holding NV	ASML US	18,183,924.31	0.98
5	PepsiCo Inc	PEP US	16,683,126.58	0.90
6	NVIDIA Corp	NVDA US	15,968,744.70	0.86
7	Microsoft Corp	MSFT US	14,116,531.34	0.76
8	Walmart Inc	WMT US	13,384,427.24	0.72
9	Intel Corp	INTC US	12,449,465.73	0.67
10	Costco Wholesale Corp	COST US	12,023,674.12	0.65
11	Amazon.com Inc	AMZN US	8,230,278.25	0.44
12	Meta Platforms Inc	META US	6,165,239.56	0.33
13	Tesla Inc	TSLA US	5,457,750.61	0.29
14	Broadcom Inc	AVGO US	5,005,746.02	0.27

15	AstraZeneca PLC	AZN US	4,416,988.97	0.24
16	Advanced Micro Devices Inc	AMD US	4,373,366.76	0.24
17	Netflix Inc	NFLX US	3,541,782.32	0.19
18	Lam Research Corp	LRCX US	3,427,312.95	0.18
19	Cisco Systems Inc	CSCO US	3,260,867.79	0.18
20	Applied Materials Inc	AMAT US	3,219,912.10	0.17

注：1.此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

2.卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	341,876,083.88
卖出收入（成交）总额	317,081,562.64

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.6 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	股指期货	NASDAQ 100 E-MINI Sep26	-	-

注：股指期货投资采用当日无负债结算制度，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益。

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 本报告期内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或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

7.11.2 基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同约定备选股票库之外的情况。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	35,209,056.52
2	应收清算款	-
3	应收股利	198,151.97
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	35,407,208.49

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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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

		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
456,458	1,034.67	54,207.60	0.01%	472,230,326.29	99.99%

8.2 盈利投资者数量占比

本基金不适用。

8.3 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	144,547.26	0.03%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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（2010 年 4 月 29 日）基金份额总额	555,982,545.46
本报告期期初基金份额总额	467,078,133.08
本报告期基金总申购份额	47,119,163.53
减：本报告期基金总赎回份额	41,912,762.72
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	472,284,533.89

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，本基金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

报告期内，本基金管理人重大人事变动如下：

2026 年 5 月 9 日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，经本基金管理人第八届董事会第四十三次会议审议通过，吴洪涛先生任公司首席信息官。

报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，本基金无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内，本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

报告期内，为本基金提供审计服务的会计师事务所为毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)。

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

报告期内，基金管理人未受调查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，基金管理人相关从业人员未受调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

报告期内，基金托管人未受调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，基金托管人相关从业人员未受调查或处罚。

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	
State Street Global Market	1	-	-	-	-	-
Morgan Stanley Co. International plc	1	-	-	-	-	-
Deutsche Bank Asia Limited	1	-	-	-	-	-
Haitong International Securities Co Ltd	1	-	-	-	-	-
China	1	-	-	-	-	-

International Capital Corp Ltd						
China Merchants Securities (HK) Co. Ltd	1	-	-	-	-	-
Goldman Sachs And Co. LLC.	1	-	-	-	-	-
UBS Securities LLC	1	658,957,646.52	100.00%	69,277.06	100.00%	-
Huatai Financial Holdings	1	-	-	-	-	-
GF Securities (HongKong) Brokerage Limited	1	-	-	-	-	-

注：1、交易单元的选择标准：

- （1）实力雄厚、信誉良好；
- （2）财务状况良好，经营行为稳健、规范，合规风控能力较强；
- （3）具备基金交易所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本公司管理的基金进行证券交易的需要；
- （4）研究实力较强，能及时为本公司管理的基金提供高质量服务，包括但不限于各类研究报告、上市公司路演及反路演、各类研究策略会等。

2、选择程序：

券商按照我司要求提供机构情况介绍说明，该说明作为券商尽调材料进行内部审议，符合要求的券商经批准进入券商白名单，白名单内的券商根据其提供的研究服务情况进行考评，符合交易席位租用标准的，经审批后可成为我司签约券商并签订交易业务单元租用协议。

3、本基金本报告期内渤海证券减少 1 个席位。

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		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	成交金额	占当期回购成交总	成交金额	占当期权证成交总额的	成交金额	占当期基金成交总

		比例		额的比例		比例		额的比例
State Street Global Market	-	-	-	-	-	-	-	-
Morgan Stanley Co. International plc	-	-	-	-	-	-	-	-
Deutsche Bank Asia Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Haitong International Securities Co Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
China International Capital Corp Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
China Merchants Secur	-	-	-	-	-	-	-	-

ities (HK) Co. Ltd								
Gold man Sachs And Co. LLC.	-	-	-	-	-	-	-	-
UBS Secur ities LLC	-	-	-	-	-	-	-	-
Huat ai Finan cial Holdi ngs	-	-	-	-	-	-	-	-
GF Secur ities (Hon gKon g) Brok erage Limit ed	-	-	-	-	-	-	-	-

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	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	《证券日报》、《上海证券报》、《中国证券报》	2026-01-14
2	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	《证券日报》、《上海证券报》、《中国证券报》	2026-03-31
3	国泰基金管理有限公司关于深圳市分公司办公地址变更的公告	《中国证券报》	2026-04-02
4	国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公	《中国证券报》	2026-05-09

	告		
5	关于国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金恢复申购及定期定额投资业务（限制大额）的公告	《证券日报》	2026-05-19
6	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	《证券日报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》	2026-05-20
7	关于国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金调整大额申购及定期定额投资业务金额限制的公告	《证券日报》	2026-05-26
8	国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金暂停申购、定期定额投资业务的公告	《证券日报》	2026-05-29
9	关于旗下部分基金 2026 年 7 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	《证券日报》、《上海证券报》、《中国证券报》	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

本基金本报告期内无需要披露的单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、关于核准国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金募集的批复
- 2、国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金基金合同
- 3、国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金托管协议
- 4、报告期内披露的各项公告
- 5、法律法规要求备查的其他文件

12.2 存放地点

本基金管理人国泰基金管理有限公司办公地点——上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 15-20 层。

基金托管人住所。

12.3 查阅方式

可咨询本基金管理人；部分备查文件可在本基金管理人公司网站上查阅。

客户服务中心电话：（021）31089000，400-888-8688

客户投诉电话：（021）31089000

公司网址：<http://www.gtfund.com>

国泰基金管理有限公司

二〇二六年八月三十一日