

摩根纳斯达克 100 指数型发起式证券投资 基金(QDII) 2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：摩根基金管理（中国）有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人上海浦东发展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	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人	6
2.5 信息披露方式	7
2.6 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	17
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	17
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	18
6.3 净资产变动表	20
6.4 报表附注	22
§7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	46
7.3 期末按行业分类的权益投资组合	47
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	47

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动	57
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	59
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	59
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	59
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	59
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	59
7.11 投资组合报告附注	59
§8 基金份额持有人信息	60
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	60
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	61
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	61
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	61
§9 开放式基金份额变动	62
§10 重大事件揭示	62
10.1 基金份额持有人大会决议	62
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	63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	63
10.4 基金投资策略的改变	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	63
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	63
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	63
10.8 其他重大事件	65
§11 影响投资者决策的其他重要信息	65
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	65
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	66
§12 备查文件目录	66
12.1 备查文件目录	66
12.2 存放地点	66
12.3 查阅方式	66

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	摩根纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金 (QDII)			
基金简称	摩根纳斯达克 100 指数 (QDII)			
基金主代码	019172			
基金运作方式	契约型开放式			
基金合同生效日	2023 年 9 月 25 日			
基金管理人	摩根基金管理（中国）有限公司			
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司			
报告期末基金份额总额	2, 257, 820, 234. 86 份			
基金合同存续期	不定期			
下属分级基金的基金简称	摩根纳斯达克 100 指数 (QDII) 人民币 A	摩根纳斯达克 100 指数 (QDII) 人民币 C	摩根纳斯达克 100 指数 (QDII) 美元 A	摩根纳斯达克 100 指数 (QDII) 美元 C
下属分级基金的交易代码	019172	019173	019174	019175
报告期末下属分级基金的份额总额	1, 649, 975, 606. 32 份	605, 644, 650. 22 份	1, 136, 818. 33 份	1, 063, 159. 99 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金采用完全复制策略，按照标的指数成份股构成及其权重构建股票资产组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化对股票组合进行动态调整。但因特殊情况导致基金无法有效跟踪标的指数时，本基金将运用其他方法建立实际组合，力求实现基金相对业绩比较基准的跟踪误差最小化。 1、资产配置策略 为了实现跟踪误差最小化，本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 80%，且不低于非现金基金资产 80%。在正常市场情况下，本基金力争控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度小于 0. 35%，基金净值增长率与业绩比较基准之间的年跟踪误差不超过 4%。 2、股票投资策略 (1) 投资组合构建 本基金通过完全复制策略进行被动式指数化投资，根据纳斯达克 100 指数成份股的基准权重构建股票资产组合，对于因法规限制、流动性限制而无法交易的成份股，将采用与被限制股预期收益率相近的股票或股票组合进行相应的替代。 (2) 投资组合调整 1) 定期调整 本基金所构建的投资组合将定期根据所跟踪标的指数成份股的调整进行相应的跟踪调整。指数调整方案公布后，本基金将及时对现有组合的

	构成进行相应的调整,若成份股的集中调整短期内会对跟踪误差产生较大影响,将采用逐步调整的方式。 2) 不定期调整 ①根据指数编制规则,当标的指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重调整时,本基金将根据标的指数权重比例的变化,进行相应调整。 ②当标的指数成份股因停牌、流动性不足等因素导致基金无法按照指数权重进行配置,基金管理人将综合考虑跟踪误差和投资者利益,选择相关股票进行适当的替代。 ③本基金将根据申购和赎回情况对股票投资组合进行调整,保证基金正常运行,从而有效跟踪标的指数。 3) 股票替代 通常情况下,本基金根据标的指数成份股票在指数中的权重确定成份股票的买卖数量。但在如标的指数成份股流动性严重不足或停牌、标的指数成份股因法律法规的相关规定而为本基金限制投资的股票等特殊情况下,本基金可以选择其他股票或股票组合对标的指数中的成份股进行替换。 3、其他投资策略:包括基金投资策略、金融衍生品投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、存托凭证投资策略。
业绩比较基准	纳斯达克 100 指数收益率(经汇率调整后) $\times 95\%$ + 银行活期存款利率(税后) $\times 5\%$
风险收益特征	本基金属于股票型基金产品,预期风险和收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金为被动管理的指数型基金,具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。 本基金投资于境外证券市场,因此还面临汇率风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		摩根基金管理(中国)有限公司	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	郭海明	汪小敏
	联系电话	021-38794888	021-31888888
	电子邮箱	services@jpmamc.com	wangxm8@spdb.com.cn
客户服务电话		400-889-4888	95528
传真		021-20628400	021-63602540
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 42 层和 43 层	上海市中山东一路 12 号
办公地址		中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 42 层和 43 层	上海市博成路 1388 号浦银中心 A 栋
邮政编码		200120	200126
法定代表人		王琼慧	张为忠

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目	境外投资顾问	境外资产托管人
----	--------	---------

名称	英文	-	Citibank N. A.
	中文	-	花旗银行
注册地址		-	701 East 60th Street North, Sioux Falls, SD57104, USA
办公地址		-	-
邮政编码		-	-

注：本基金暂不设境外投资顾问。

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	am. jpmorgan. com/cn
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	摩根基金管理（中国）有限公司	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 42 层和 43 层

§ 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)			
	摩根纳斯达克 100 指数(QDII) 人民币 A	摩根纳斯达克 100 指数(QDII) 人民币 C	摩根纳斯达克 100 指数(QDII) 美元 A	摩根纳斯达克 100 指数(QDII) 美元 C
本期已实现收益	11, 488, 597. 94	3, 981, 255. 46	56, 553. 04	49, 231. 15
本期利润	341, 467, 428. 70	130, 191, 262. 00	1, 762, 347. 89	1, 694, 774. 63
加权平均基金份额本期利润	0. 2202	0. 2030	1. 6068	1. 5016
本期加权平均净值利润率	13. 60%	12. 69%	13. 90%	13. 06%
本期基金份额净值增长率	14. 64%	14. 48%	18. 32%	18. 14%
3.1.2 期末数据	报告期末(2026 年 6 月 30 日)			

和指标				
期末可供分配利润	10,042,256.77	-3,156,713.09	130,305.88	-4,877.64
期末可供分配基金份额利润	0.0061	-0.0052	0.1146	-0.0046
期末基金资产净值	2,968,994,604.47	1,080,342,036.99	14,619,033.74	13,617,346.59
期末基金份额净值	1.7994	1.7838	1.8881	1.8806
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	79.94%	78.38%	88.81%	88.06%

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

上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），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

摩根纳斯达克 100 指数(QDII)人民币 A

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	23.63%	1.40%	24.26%	1.44%	-0.63%	-0.04%
过去六个月	14.64%	1.30%	15.39%	1.32%	-0.75%	-0.02%
过去一年	24.98%	1.08%	25.68%	1.12%	-0.70%	-0.04%
自基金合同生效起至今	79.94%	1.25%	90.82%	1.26%	-10.88%	-0.01%

摩根纳斯达克 100 指数(QDII)人民币 C

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	23.55%	1.40%	24.26%	1.44%	-0.71%	-0.04%
过去六个月	14.48%	1.30%	15.39%	1.32%	-0.91%	-0.02%
过去一年	24.61%	1.08%	25.68%	1.12%	-1.07%	-0.04%

自基金合同 生效起至今	78.38%	1.25%	90.82%	1.26%	-12.44%	-0.01%
----------------	--------	-------	--------	-------	---------	--------

摩根纳斯达克 100 指数 (QDII) 美元 A

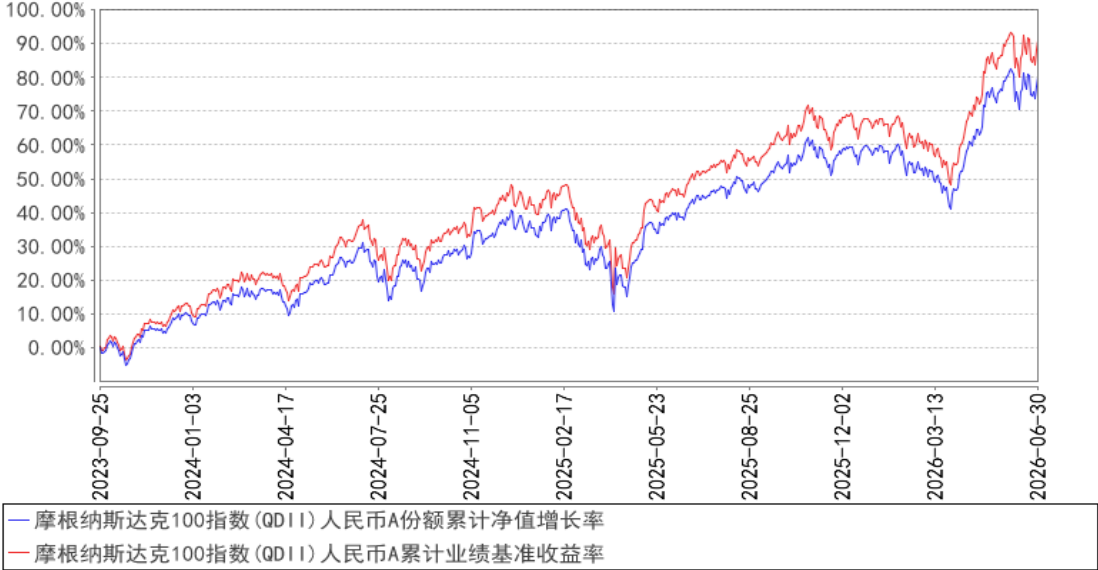
阶段	份额净值增 长率①	份额净值增 长率标准差 ②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	25.61%	1.40%	24.26%	1.44%	1.35%	-0.04%
过去六个月	18.32%	1.30%	15.39%	1.32%	2.93%	-0.02%
过去一年	31.36%	1.08%	25.68%	1.12%	5.68%	-0.04%
自基金合同 生效起至今	88.81%	1.25%	90.82%	1.26%	-2.01%	-0.01%

摩根纳斯达克 100 指数 (QDII) 美元 C

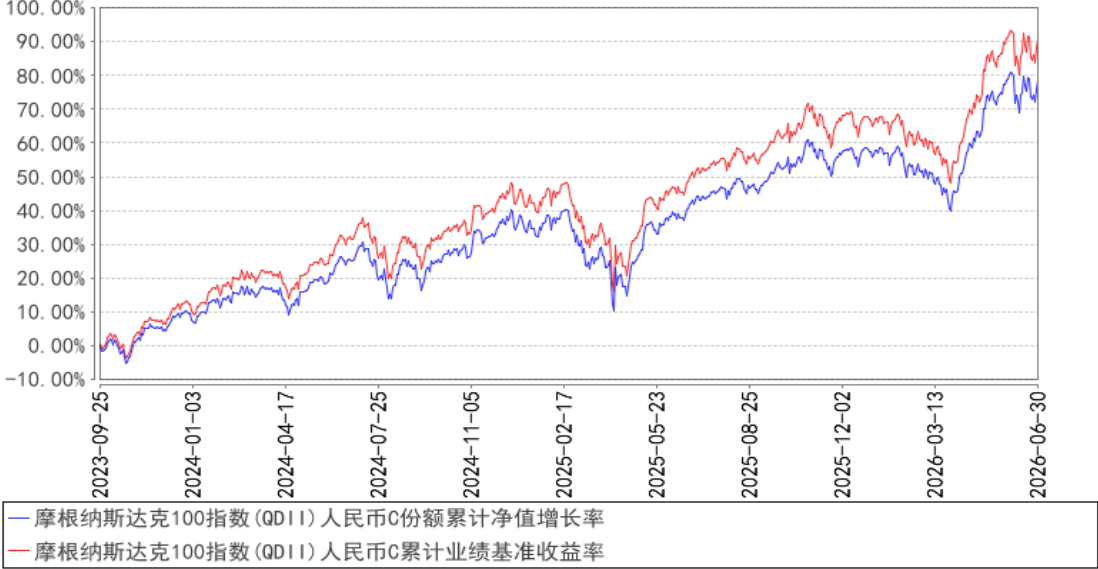
阶段	份额净值增 长率①	份额净值增 长率标准差 ②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	25.51%	1.40%	24.26%	1.44%	1.25%	-0.04%
过去六个月	18.14%	1.30%	15.39%	1.32%	2.75%	-0.02%
过去一年	30.97%	1.08%	25.68%	1.12%	5.29%	-0.04%
自基金合同 生效起至今	88.06%	1.24%	90.82%	1.26%	-2.76%	-0.02%

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

摩根纳斯达克100指数 (QDII) 人民币A份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



摩根纳斯达克100指数 (QDII) 人民币C份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



摩根纳斯达克100指数 (QDII) 美元A份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



摩根纳斯达克100指数 (QDII) 美元C份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金合同生效日为 2023 年 9 月 25 日，图示的时间段为合同生效日至本报告期末。

本基金建仓期为本基金合同生效日起 6 个月，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

摩根基金管理（中国）有限公司经中国证券监督管理委员会批准，于 2004 年 5 月 12 日正式成立，注册资本为 2.5 亿元人民币，注册地上海。2023 年 1 月 19 日，经中国证监会批准，本公

司原股东之一上海国际信托有限公司将其持有的本公司 51%股权，与原另一股东 JPMorgan Asset Management (UK) Limited 将其持有的本公司 49%股权转让给摩根资产管理控股公司(JPMorgan Asset Management Holdings Inc.)，从而摩根资产管理控股公司取得本公司全部股权。2023 年 4 月 10 日，基金管理人的名称由“上投摩根基金管理有限公司”变更为“摩根基金管理（中国）有限公司”。截至 2026 年 6 月底，公司旗下运作的基金共有一百二十二只，均为开放式基金，分别是：摩根中国优势证券投资基金、摩根货币市场基金、摩根阿尔法混合型证券投资基金、摩根双息平衡混合型证券投资基金、摩根成长先锋混合型证券投资基金、摩根内需动力混合型证券投资基金、摩根亚太优势混合型证券投资基金(QDII)、摩根双核平衡混合型证券投资基金、摩根中小盘混合型证券投资基金、摩根纯债债券型证券投资基金、摩根行业轮动混合型证券投资基金、摩根大盘蓝筹股票型证券投资基金、摩根全球新兴市场混合型证券投资基金(QDII)、摩根新兴动力混合型证券投资基金、摩根强化回报债券型证券投资基金、摩根健康品质生活混合型证券投资基金、摩根全球天然资源混合型证券投资基金(QDII)、摩根核心优选混合型证券投资基金、摩根智选 30 混合型证券投资基金、摩根成长动力混合型证券投资基金、摩根转型动力灵活配置混合型证券投资基金、摩根双债增利债券型证券投资基金、摩根核心成长股票型证券投资基金、摩根民生需求股票型证券投资基金、摩根纯债丰利债券型证券投资基金、摩根天添盈货币市场基金、摩根天添宝货币市场基金、摩根安全战略股票型证券投资基金、摩根卓越制造股票型证券投资基金、摩根整合驱动灵活配置混合型证券投资基金、摩根动态多因子策略灵活配置混合型证券投资基金、摩根智慧互联股票型证券投资基金、摩根科技前沿灵活配置混合型证券投资基金、摩根新兴服务股票型证券投资基金、摩根医疗健康股票型证券投资基金、摩根中国世纪灵活配置混合型证券投资基金(QDII)、摩根全球多元配置证券投资基金(QDII-FOF)、摩根安通回报混合型证券投资基金、摩根丰瑞债券型证券投资基金、摩根标普港股通低波红利指数型证券投资基金、摩根量化多因子灵活配置混合型证券投资基金、摩根安隆回报混合型证券投资基金、摩根创新商业模式灵活配置混合型证券投资基金、摩根富时发达市场 REITs 指数型证券投资基金(QDII)、摩根香港精选港股通混合型证券投资基金、摩根尚睿混合型基金中基金(FOF)、摩根安裕回报混合型证券投资基金、摩根欧洲动力策略股票型证券投资基金(QDII)、摩根核心精选股票型证券投资基金、摩根动力精选混合型证券投资基金、摩根中国生物医药混合型证券投资基金(QDII)、摩根领先优选混合型证券投资基金、摩根日本精选股票型证券投资基金(QDII)、摩根锦程均衡养老目标三年持有期混合型基金中基金(FOF)、摩根瑞益纯债债券型证券投资基金、摩根慧选成长股票型证券投资基金、摩根瑞泰 38 个月定期开放债券型证券投资基金、摩根锦程稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)、摩根 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金、摩根研究驱动股票型证券投资基

金、摩根 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金、摩根瑞盛 87 个月定期开放债券型证券投资基金、摩根慧见两年持有期混合型证券投资基金、摩根远见两年持有期混合型证券投资基金、摩根行业睿选股票型证券投资基金、摩根优势成长混合型证券投资基金、摩根安荣回报混合型证券投资基金、摩根中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、摩根景气甄选混合型证券投资基金、摩根均衡优选混合型证券投资基金、摩根月月盈 30 天滚动持有发起式短债债券型证券投资基金、摩根恒生科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)、摩根全景优势股票型证券投资基金、摩根沃享远见一年持有期混合型证券投资基金、摩根鑫睿优选一年持有期混合型证券投资基金、摩根博睿均衡一年持有期混合型基金中基金(FOF)、摩根中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金、摩根慧享成长混合型证券投资基金、摩根时代睿选股票型证券投资基金、摩根瑞享纯债债券型证券投资基金、摩根标普 500 指数型发起式证券投资基金(QDII)、摩根海外稳健配置混合型证券投资基金(QDII-FOF)、摩根双季鑫 6 个月持有期债券型发起式基金中基金(FOF)、摩根恒生科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(QDII)、摩根世代趋势混合型发起式证券投资基金、摩根纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金(QDII)、摩根瑞锦纯债债券型证券投资基金、摩根标普港股通低波红利交易型开放式指数证券投资基金、摩根中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、摩根中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金、摩根悦享回报 6 个月持有期混合型证券投资基金、摩根中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、摩根瑞欣利率债债券型证券投资基金、摩根红利优选股票型证券投资基金、摩根均衡精选混合型证券投资基金、摩根中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金、摩根中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、摩根共同分类目录绿色债券债券型证券投资基金、摩根上证科创板新一代信息技术交易型开放式指数证券投资基金、摩根恒鑫债券型证券投资基金、摩根 90 天持有期债券型证券投资基金、摩根 60 天持有期债券型证券投资基金、摩根沪深 300 自由现金流交易型开放式指数证券投资基金、摩根中证 A500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、摩根 30 天持有期债券型证券投资基金、摩根盈元稳健三个月持有期混合型基金中基金(FOF)、摩根沪深 300 自由现金流交易型开放式指数证券投资基金联接基金、摩根汇智优选混合型证券投资基金、摩根中证 A500 指数增强型证券投资基金、摩根上证科创板新一代信息技术交易型开放式指数证券投资基金联接基金、摩根标普港股通低波红利交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、摩根上证 AAA 科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金、摩根恒生港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金、摩根慧启成长混合型证券投资基金、摩根中证科创创业人工智能交易型开放式指数证券投资基金、摩根恒睿债券型证券投资基金、摩根聚利稳健三个月持有期 FOF 基金、摩根恒悦纯债债券型证券投资基金、摩根恒生生物科技交易型开放式指数证券投资基金、摩根港股通

宁远成长混合型证券投资基金、摩根均衡成长混合型证券投资基金、摩根恒利稳健三个月持有期混合型基金中基金(ETF-FOF)。

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		
徐寅	本基金的基金助理	2025 年 9 月 22 日	-	14 年	徐寅先生自 2012 年 5 月至 2021 年 7 月在兴业证券经济与金融研究院金融工程研究中心担任分析师、首席分析师；自 2021 年 8 月至 2024 年 2 月在华夏基金管理有限公司数量投资部担任基金经理助理、基金经理；自 2024 年 3 月至 2025 年 7 月在上海华证指数信息服务有限公司担任研发部负责人。2025 年 8 月加入摩根基金管理（中国）有限公司，担任 ETF 与指数研发主管兼基金经理助理。
何智豪	本基金的基金经理	2025 年 10 月 22 日	-	12 年	何智豪先生曾任中国国际金融股份有限公司组合与量化策略研究员、资产管理部高级经理。2020 年 7 月起加入摩根基金管理（中国）有限公司（原上投摩根基金管理有限公司），现任指数及量化投资部基金经理。

注：1. 对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2. 证券从业的含义遵从中国证监会及行业协会的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为，在控制风险的前提下，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益。基金管理人遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、本基金基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本公司继续贯彻落实《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规和公司内部公平交易流程的各项要求，严格规范上市股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等活动，通过系统和人工相结合的方式进行交易执行和监控分析，以确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的环节均得

到公平对待。

对于交易所市场投资活动，本公司执行集中交易制度，确保不同投资组合在买卖同一证券时，按照时间优先、比例分配的原则在各投资组合间公平分配交易量；对于银行间市场投资活动，本公司通过对手库控制和交易室询价机制，严格防范对手风险并检查价格公允性；对于申购投资行为，本公司遵循价格优先、比例分配的原则，根据事前独立申报的价格和数量对交易结果进行公平分配。

报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异比较、对同向交易和反向交易的交易时机和交易价差监控分析，未发现整体公平交易执行出现异常的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，通过对交易价格、交易时间、交易方向等的分析，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行为。

报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共有 2 次，均为指数投资组合因跟踪指数需要而发生的反向交易。

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，纳斯达克 100 指数累计上涨约 19.9%，分季度来看，2026 年一季度，纳斯达克 100 指数（NDX）震荡下行，季度累计下跌 5.98%，市场波动明显加大。行情回撤背后，一方面是 AI 投入回报预期分化引发的科技股估值重定价，软件、半导体板块首当其冲；另一方面，关税与中东冲突升级带来的通胀压力持续压制降息预期，资金阶段性撤离高估值成长股，进一步放大了指数的调整幅度。2026 年二季度，纳斯达克 100 指数先扬后抑，大幅上涨 27.53%。季度前半段，地缘风险缓和叠加 AI、半导体行情，推动指数自一季度低位强劲反弹并刷新历史高点；而进入 6 月之后行情出现转向，年内降息预期落空叠加市场对 AI 投入回报的担忧，引发了科技股估值重估，板块内部分化加剧——存储芯片大幅走强，而部分权重科技股回调，进一步放大了指数的波动幅度。

本基金采用完全复制的方法跟踪标的指数，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整，以实现基金的投资目标并争取将跟踪误差保持在合理范围内。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期摩根纳斯达克 100 指数(QDII)人民币 A 份额净值增长率为：14.64%，同期业绩比较

基准收益率为：15.39%；

摩根纳斯达克 100 指数 (QDII) 人民币 C 份额净值增长率为：14.48%，同期业绩比较基准收益率为：15.39%；

摩根纳斯达克 100 指数 (QDII) 美元 A 份额净值增长率为：18.32%，同期业绩比较基准收益率为：15.39%；

摩根纳斯达克 100 指数 (QDII) 美元 C 份额净值增长率为：18.14%，同期业绩比较基准收益率为：15.39%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，宏观层面，随着美伊关系的缓和、霍尔木兹海峡逐步恢复通航，油价持续回落，叠加关税效应趋于消退，输入性通胀压力有望逐步缓解；但考虑到短期内降息窗口仍未打开，货币政策路径与关税走向的不确定性可能依然会构成指数估值扩张的主要约束。产业层面，AI 投入回报预期的分化仍是核心变量：若盈利兑现加快，有望重燃市场信心；若回报低于预期，叠加估值与持仓集中度偏高，科技股估值仍将承压，股价波动或维持高位。中长期看，AI 从基础设施建设向应用层渗透的趋势未变，相关板块有望成为指数后续表现的主要驱动力。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本公司的基金估值和会计核算由基金会计部负责，根据相关的法律法规规定、基金合同的约定，制定了内部控制措施，对基金估值和会计核算的各个环节和整个流程进行风险控制，目的是保证基金估值和会计核算的准确性。基金会计部人员均具备基金从业资格和相关工作经历。本公司成立了估值委员会，并制订有关议事规则。估值委员会成员包括投资研究、督察长、基金会计、风险管理等方面的负责人，所有相关成员均具有丰富的证券投资基金行业从业经验。公司估值委员会对估值事项发表意见，评估基金估值的公允性和合理性。基金经理可参加估值委员会会议，参与估值程序和估值技术的讨论。估值委员会各方不存在直接的重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

无。

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

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对摩根纳斯达克 100

指数型发起式证券投资基金 (QDII) 的托管过程中, 严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定, 不存在损害基金份额持有人利益的行为, 完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内, 本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定, 对摩根纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金 (QDII) 的投资运作进行了监督, 对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核, 未发现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

本报告期内, 由摩根基金管理(中国)有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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: 摩根纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金 (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	378,754,222.73	280,768,911.63
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	3,732,916,550.33	3,632,371,491.27
其中: 股票投资		3,732,916,550.33	3,632,371,491.27
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	6.4.7.5	-	-
其中: 债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-

其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		409,538.20	564,447.56
应收申购款		14,150,428.00	5,961,408.72
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		4,126,230,739.26	3,919,666,259.18
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		46,222,392.82	54,605,215.48
应付管理人报酬		1,635,484.20	1,368,051.31
应付托管费		327,096.81	273,610.26
应付销售服务费		266,457.32	267,744.35
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	6.4.7.9	206,286.32	174,000.00
负债合计		48,657,717.47	56,688,621.40
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	2,271,284,397.48	2,466,737,977.93
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	1,806,288,624.31	1,396,239,659.85
净资产合计		4,077,573,021.79	3,862,977,637.78
负债和净资产总计		4,126,230,739.26	3,919,666,259.18

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额：2,257,820,234.86 份，其中：摩根纳斯达克 100 指数 (QDII) 人民币 A，基金份额净值：1.7994 元，基金份额：1,649,975,606.32 份。摩根纳斯达克 100 指数 (QDII) 人民币 C，基金份额净值：1.7838 元，基金份额：605,644,650.22 份。摩根纳斯达克 100 指数 (QDII) 美元 A，基金份额净值：1.8881 美元，基金份额：1,136,818.33 份。摩根纳斯达克 100 指数 (QDII) 美元 C，基金份额净值：1.8806 美元，基金份额：1,063,159.99 份。

6.2 利润表

会计主体：摩根纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金 (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		487,360,609.44	59,607,086.32
1. 利息收入		240,617.30	61,992.93
其中：存款利息收入	6.4.7.13	240,617.30	61,992.93
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）		34,905,277.09	4,333,495.10
其中：股票投资收益	6.4.7.14	24,987,542.83	1,636,394.45
基金投资收益	6.4.7.15	-	-
债券投资收益	6.4.7.16	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.17	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.18	-	-
衍生工具收益	6.4.7.19	-	-
股利收益	6.4.7.20	9,917,734.26	2,697,100.65
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）	6.4.7.21	459,540,175.63	55,857,641.31
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-7,404,898.53	-662,946.10
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.22	79,437.95	16,903.08
减：二、营业总支出		12,244,796.22	3,006,366.27
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	8,820,824.81	2,016,953.30
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,764,164.94	403,390.70
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,546,865.89	484,647.83
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	6.4.7.23	-	-
7. 税金及附加		4,470.39	-
8. 其他费用	6.4.7.24	108,470.19	101,374.44

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		475, 115, 813. 22	56, 600, 720. 05
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		475, 115, 813. 22	56, 600, 720. 05
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		475, 115, 813. 22	56, 600, 720. 05

6.3 净资产变动表

会计主体：摩根纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金 (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	2, 466, 737, 977. 93	-	1, 396, 239, 659. 85	3, 862, 977, 637. 78
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	2, 466, 737, 977. 93	-	1, 396, 239, 659. 85	3, 862, 977, 637. 78
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-195, 453, 580. 45	-	410, 048, 964. 46	214, 595, 384. 01
（一）、综合收益总额	-	-	475, 115, 813. 22	475, 115, 813. 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）	-195, 453, 580. 45	-	-65, 066, 848. 76	-260, 520, 429. 21
其中：1. 基金申购款	634, 716, 146. 82	-	439, 897, 370. 77	1, 074, 613, 517. 59
2. 基金赎回款	-830, 169, 727. 27	-	-504, 964, 219. 53	-1, 335, 133, 946. 80
（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	2,271,284,397.48	-	1,806,288,624.31	4,077,573,021.79
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	605,092,763.63	-	206,443,438.49	811,536,202.12
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	605,092,763.63	-	206,443,438.49	811,536,202.12
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	35,082,180.21	-	73,172,088.19	108,254,268.40
（一）、综合收益总额	-	-	56,600,720.05	56,600,720.05
（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）	35,082,180.21	-	16,571,368.14	51,653,548.35
其中：1. 基金申购款	238,643,077.26	-	78,703,484.48	317,346,561.74
2. 基金赎回款	-203,560,897.05	-	-62,132,116.34	-265,693,013.39
（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	640,174,943.84	-	279,615,526.68	919,790,470.52

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：

<u>王琼慧</u>	<u>徐振晨</u>	<u>俞文涵</u>
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

摩根纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金(QDII) (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[2023]1720 号《关于准予摩根纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金(QDII)注册的批复》注册，由摩根基金管理(中国)有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《摩根纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金(QDII)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 90,587,194.98 元和美元 64,229.31 元，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 91,047,924.67 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2023)第 0490 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《摩根纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金(QDII)基金合同》于 2023 年 9 月 25 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 91,054,147.76 份基金份额，其中认购资金利息折合 6,223.09 份基金份额。本基金的基金管理人为摩根基金管理(中国)有限公司，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司，境外托管人为花旗银行(Citibank N.A.)。

根据摩根基金管理(中国)有限公司 2023 年 4 月 12 日发布的《关于公司法定名称变更的公告》，本基金管理人的中文法定名称由“上投摩根基金管理有限公司”变更为“摩根基金管理(中国)有限公司”。

本基金为发起式基金，发起资金认购部分为 10,000,208.33 份基金份额，发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

根据《摩根纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金(QDII)招募说明书》，本基金根据认购/申购、赎回所使用货币的不同，将基金份额分为不同的类别。以人民币计价并进行认购/申购、赎

回的份额类别，称为人民币份额；以美元计价并进行认购/申购、赎回的份额类别，称为美元份额（特指美元现汇份额）。在人民币份额和美元份额类别内，本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费，不收取认购/申购费用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金对人民币份额类别内的 A 类基金份额和 C 类基金份额及美元份额类别内的 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码，分别公布基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《摩根纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金(QDII)基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。其余资产可投资于其他金融产品或工具。境外投资工具包括：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与本基金跟踪同一标的指数的公募基金(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。境内投资工具包括：国内依法发行或上市的股票、存托凭证、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、证券公司短期公司债等)、资产支持证券、银行存款、债券回购、同业存单、衍生工具(包括股指期货、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相关规定。本基金的投资组合比例为：投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 80%，且不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约应缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券投资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、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：纳斯达克 100 指数收益率(经汇率调整后)X95%+银行活期存款利率(税后)X5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则——基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企

业会计准则”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)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》、《摩根纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金(QDII) 基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

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 2026 年上半年度财务报表符合企业会计准则的要求, 真实、完整地反映了本基金 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年上半年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、国务院令第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部 税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关境内外财税法规和实务操作, 主要税项列示如下:

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为, 以资管产品管理人为增值税纳税人。2027 年 12 月 31 日前, 资管产品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, 可以选择适用简易计税方法, 按照 3% 的征收率缴纳增值税。

2027 年 12 月 31 日前, 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务, 以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 目前基金取得的源自境外的差价收入,其涉及的境外所得税税收政策,按照相关国家或地区税收法律和法规执行,在境内暂不征收企业所得税。

(3) 目前基金取得的源自境外的股利收益,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,在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

(4) 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	378,754,222.73
等于: 本金	378,717,502.93
加: 应计利息	36,719.80
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	378,754,222.73

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		3,070,685,958.16	-	3,732,916,550.33	662,230,592.17
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		3,070,685,958.16	-	3,732,916,550.33	662,230,592.17

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

无余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无余额。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无余额。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无余额。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无余额。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无余额。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无余额。

6.4.7.8 其他资产

无余额。

6.4.7.9 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	206,286.32
合计	206,286.32

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

摩根纳斯达克 100 指数 (QDII) 人民币 A

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	1,665,474,958.47	1,665,474,958.47
本期申购	470,932,265.23	470,932,265.23
本期赎回 (以“-”号填列)	-486,431,617.38	-486,431,617.38
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	1,649,975,606.32	1,649,975,606.32

摩根纳斯达克 100 指数 (QDII) 人民币 C

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	783,895,329.95	783,895,329.95
本期申购	161,826,012.15	161,826,012.15
本期赎回 (以“-”号填列)	-340,076,691.88	-340,076,691.88
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	605,644,650.22	605,644,650.22

摩根纳斯达克 100 指数 (QDII) 美元 A

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	1,112,315.74	7,910,268.30
本期申购	160,819.54	1,100,030.71

本期赎回（以“-”号填列）	-136,316.95	-937,005.63
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,136,818.33	8,073,293.38

摩根纳斯达克 100 指数(QDII)美元 C

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	1,331,479.86	9,457,421.21
本期申购	125,354.13	857,838.73
本期赎回（以“-”号填列）	-393,674.00	-2,724,412.38
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,063,159.99	7,590,847.56

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

摩根纳斯达克 100 指数(QDII)人民币 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-2,050,814.31	950,701,394.55	948,650,580.24
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-2,050,814.31	950,701,394.55	948,650,580.24
本期利润	11,488,597.94	329,978,830.76	341,467,428.70
本期基金份额交易产生的变动数	604,473.14	28,296,516.07	28,900,989.21
其中：基金申购款	4,000,651.97	323,928,307.81	327,928,959.78
基金赎回款	-3,396,178.83	-295,631,791.74	-299,027,970.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,042,256.77	1,308,976,741.38	1,319,018,998.15

摩根纳斯达克 100 指数(QDII)人民币 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-7,914,270.65	445,496,342.67	437,582,072.02
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-

本期期初	-7,914,270.65	445,496,342.67	437,582,072.02
本期利润	3,981,255.46	126,210,006.54	130,191,262.00
本期基金份额交易产生的变动数	776,302.10	-93,852,249.35	-93,075,947.25
其中：基金申购款	-333,953.99	110,725,873.69	110,391,919.70
基金赎回款	1,110,256.09	-204,578,123.04	-203,467,866.95
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,156,713.09	477,854,099.86	474,697,386.77

摩根纳斯达克 100 指数 (QDII) 美元 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	58,225.71	4,508,180.26	4,566,405.97
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	58,225.71	4,508,180.26	4,566,405.97
本期利润	56,553.04	1,705,794.85	1,762,347.89
本期基金份额交易产生的变动数	15,527.13	201,459.37	216,986.50
其中：基金申购款	63,816.37	828,418.11	892,234.48
基金赎回款	-48,289.24	-626,958.74	-675,247.98
本期已分配利润	-	-	-
本期末	130,305.88	6,415,434.48	6,545,740.36

摩根纳斯达克 100 指数 (QDII) 美元 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-3,490.23	5,444,091.85	5,440,601.62
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-3,490.23	5,444,091.85	5,440,601.62
本期利润	49,231.15	1,645,543.48	1,694,774.63
本期基金份额交易产生的变动数	-50,618.56	-1,058,258.66	-1,108,877.22
其中：基金申购款	39,564.20	644,692.61	684,256.81
基金赎回款	-90,182.76	-1,702,951.27	-1,793,134.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-4,877.64	6,031,376.67	6,026,499.03

6.4.7.13 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	239,380.33
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	1,236.97
合计	240,617.30

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 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	24,987,542.83
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	24,987,542.83

6.4.7.14.2 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	830,273,130.36
减：卖出股票成本总额	805,212,730.74
减：交易费用	72,856.79
买卖股票差价收入	24,987,542.83

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 基金投资收益

无。

6.4.7.16 债券投资收益

6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 资产支持证券投资收益

6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 贵金属投资收益

6.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.19 衍生工具收益

6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.20 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	9,917,734.26
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	9,917,734.26

6.4.7.21 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	459,540,175.63
——股票投资	459,540,175.63
——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	459,540,175.63

6.4.7.22 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	79,437.95
合计	79,437.95

6.4.7.23 信用减值损失

无。

6.4.7.24 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	26,778.95
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
银行汇划费	22,183.87
合计	108,470.19

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
无。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
摩根基金管理（中国）有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司（“上海浦东发展银行”）	基金托管人、基金销售机构
花旗银行 (Citibank)（“花旗银行”）	境外资产托管人

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

无。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 基金交易

无。

6.4.10.1.5 权证交易

无。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------	--

当期发生的基金应支付的管理费	8,820,824.81	2,016,953.30
其中：应支付销售机构的客户维护费	3,816,323.67	688,979.27
应支付基金管理人的净管理费	5,004,501.14	1,327,974.03

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值的 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.50\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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	1,764,164.94	403,390.70

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.1%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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.1\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日				
	当期发生的基金应支付的销售服务费				
	摩根纳斯达克 100 指数 (QDII)人民币 A	摩根纳斯达克 100 指数 (QDII)人民币 C	摩根纳斯达克 100 指数 (QDII)美元 A	摩根纳斯达克 100 指数 (QDII)美元 C	合计
浦发银行	-	11,687.19	-	2,952.93	14,640.12
摩根基金管理（中国）有限公司	-	22,407.22	-	1,716.22	24,123.44
合计	-	34,094.41	-	4,669.15	38,763.56
获得销售服务费的各关联方名称	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销售服务费				
	摩根纳斯达克 100 指数	摩根纳斯达克 100 指数	摩根纳斯达克 100 指数	摩根纳斯达克 100 指数	合计

	(QDII)人民币 A	(QDII)人民币 C	(QDII)美元 A	(QDII)美元 C	
浦发银行	-	5,854.99	-	2,407.66	8,262.65
摩根基金管理 (中国)有限公司	-	12,314.04	-	2,305.25	14,619.29
合计	-	18,169.03	-	4,712.91	22,881.94

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.30%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给管理人，再由管理人计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额不收取销售服务费。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类的基金资产净值} \times 0.30\% / \text{当年天数}。$$

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

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期			
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	摩根纳斯达克 100 指数 (QDII)人民币 A	摩根纳斯达克 100 指数(QDII) 人民币 C	摩根纳斯达克 100 指数(QDII) 美元 A	摩根纳斯达克 100 指数(QDII) 美元 C
基金合同生效日 (2023 年 9 月 25 日) 持有的基金份额	-	-	-	-
报告期初持有的基金份额	10,000,208.33	-	-	-

报告期间 申购/买入 总份额	-	-	-	-
报告期间 因拆分变 动份额	-	-	-	-
减：报告期 间赎回/卖 出总份额	-	-	-	-
报告期末 持有的基 金份额	10,000,208.33	-	-	-
报告期末 持有的基 金份额 占基金总 份额比例	0.44%	-	-	-
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	摩根纳斯达克 100 指数 (QDII) 人民币 A	摩根纳斯达克 100 指数 (QDII) 人民币 C	摩根纳斯达克 100 指数 (QDII) 美元 A	摩根纳斯达克 100 指数 (QDII) 美元 C
基金合同 生效日 (2023 年 9 月 25 日) 持有的基 金份额	-	-	-	-
报告期初 持有的基 金份额	10,000,208.33	-	-	-
报告期间 申购/买入 总份额	-	-	-	-
报告期间 因拆分变 动份额	-	-	-	-
减：报告期 间赎回/卖 出总份额	-	-	-	-
报告期末 持有的基 金份额	10,000,208.33	-	-	-
报告期末	1.58%	-	-	-

持有的基金份额 占基金总 份额比例				
-------------------------	--	--	--	--

注：上述基金管理人持有的份额包括基金管理人的高级管理人员、主要业务部门负责人、基金经理根据《基金管理公司绩效考核与薪酬管理指引》的要求，将一定比例的绩效薪酬购买本基金的部分。

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

无。

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
花旗银行	35,521,177.53	2,410.60	20,752,869.45	155.33
上海浦东发展银行	343,233,045.20	236,969.73	31,248,004.11	61,820.57

注：本基金的银行存款分别由基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司和境外资产托管人花旗银行保管，按适用利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间内均无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本报告期本基金未实施利润分配。

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

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数型基金，主要采用抽样复制法跟踪纳斯达克 100 指数，具有与标的指数以及标的指数所代表的投资市场相似的风险收益特征，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度小于 0.35%，年跟踪误差不超过 4%，以实现纳斯达克 100 指数的有效跟踪。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，董事会主要负责基金管理人风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。董事会下设督察长，负责对基金管理人各业务环节合法合规运作的监督检查和基金管理人内部稽核监控工作，并可向基金管理人董事会和中国证监会直接报告。经营管理层下设风险评估联席会议，进行各部门管理程序的风险确认，并对各类风险予以事先充分的评估和防范，并进行及时控制和采取应急措施；在业务操作层面监察稽核部负责基金管理人各部门的风险控制检查，定期或不定期对业务部门内部控制制度执行情况和遵循国家法律、法规及其他规定的执行情况进行检查，并适时提出修改建议；风险管理部负责建立并完善公司市场风险、流动性风险、信用风险管理框架，运用系统化分析工具对以上进行分析和识别，提升公司风险科技水平。运营风险管理部负责协助各部门修正、修订内部控制作业制度，并对各部门的日常作业，依风险管理的考评，定期或不定期对各项风险指标进行控管，并提出内控建议。投资准则管理部负责执行和管控投资准则，通过设立投资准则、事前管控、事后管控，保障基金投资运作符合法规、合同及公司内部要求。

本基金的基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、风险管理部、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

本基金的基金管理人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同责任，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。本基金的货币资金存放于信用良好的银行，与货币资金相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小；在场外交易市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种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 06 月 30 日，本基金无债券投资 (2025 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

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且不计息，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 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性

风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限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。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。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上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。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未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率

敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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

6.4.13.4.1.1 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	378,754,222.73	-	-	-	378,754,222.73
交易性金融资产	-	-	-	3,732,916,550.33	3,732,916,550.33
应收股利	-	-	-	409,538.20	409,538.20
应收申购款	-	-	-	14,150,428.00	14,150,428.00
资产总计	378,754,222.73	-	-	3,747,476,516.53	4,126,230,739.26
负债					
应付赎回款	-	-	-	46,222,392.82	46,222,392.82
应付管理人报酬	-	-	-	1,635,484.20	1,635,484.20
应付托管费	-	-	-	327,096.81	327,096.81
应付销售服务费	-	-	-	266,457.32	266,457.32
其他负债	-	-	-	206,286.32	206,286.32
负债总计	-	-	-	48,657,717.47	48,657,717.47
利率敏感度缺口	378,754,222.73	-	-	3,698,818,799.06	4,077,573,021.79
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	280,768,911.63	-	-	-	280,768,911.63
交易性金融资产	-	-	-	3,632,371,491.27	3,632,371,491.27
应收股利	-	-	-	564,447.56	564,447.56
应收申购款	-	-	-	5,961,408.72	5,961,408.72
资产总计	280,768,911.63	-	-	3,638,897,347.55	3,919,666,259.18
负债					
应付赎回款	-	-	-	54,605,215.48	54,605,215.48
应付管理人报酬	-	-	-	1,368,051.31	1,368,051.31
应付托管费	-	-	-	273,610.26	273,610.26
应付销售服务费	-	-	-	267,744.35	267,744.35

其他负债	-	-	-	174,000.00	174,000.00
负债总计	-	-	-	56,688,621.40	56,688,621.40
利率敏感度缺口	280,768,911.63	-	-	3,582,208,726.15	3,862,977,637.78

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，本基金未持有交易性债券投资(2025 年 12 月 31 日:同)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(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人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
货币资金	44,315,686.23	-	-	44,315,686.23
交易性金融资产	3,732,916,550.33	-	-	3,732,916,550.33
应收股利	409,538.20	-	-	409,538.20
应收申购款	38,953.18	-	-	38,953.18
资产合计	3,777,680,727.94	-	-	3,777,680,727.94
以外币计价的负债				
应付赎回款	220,463.04	-	-	220,463.04
应付销售服务费	3,339.72	-	-	3,339.72
负债合计	223,802.76	-	-	223,802.76

资产负债表外 汇风险敞口净 额	3,777,456 ,925.18	-	-	3,777,456,925.18
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	142,281,8 53.07	-	-	142,281,853.07
交易性金融资 产	3,632,371 ,491.27	-	-	3,632,371,491.27
应收股利	564,447.5 6	-	-	564,447.56
应收申购款	10,031.92	-	-	10,031.92
资产合计	3,775,227 ,823.82	-	-	3,775,227,823.82
以外币计价的 负债				
应付赎回款	94,924.44	-	-	94,924.44
负债合计	94,924.44	-	-	94,924.44
资产负债表外 汇风险敞口净 额	3,775,132 ,899.38	-	-	3,775,132,899.38

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%	188,870,000.00	188,760,000.00
	2. 所有外币相对人 民币贬值 5%	-188,870,000.00	-188,760,000.00

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以

外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，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。

本基金采用完全复制策略，按照标的指数成份股构成及其权重构建股票资产组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化对股票组合进行动态调整。但因特殊情况导致基金无法有效跟踪标的指数时，本基金将运用其他方法建立实际组合，力求实现基金相对业绩比较基准的跟踪误差最小化。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 80%，且不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约应缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券投资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、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	3,732,916,550.33	91.55	3,632,371,491.27	94.03
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	3,732,916,550.33	91.55	3,632,371,491.27	94.03

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

	动	本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	1. 业绩比较基准上升 5%	196,230,000.00	190,510,000.00
	2. 业绩比较基准下降 5%	-196,230,000.00	-190,510,000.00

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	3,732,916,550.33	3,632,371,491.27
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	3,732,916,550.33	3,632,371,491.27

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的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

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资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 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	3,732,916,550.33	90.47
	其中：普通股	3,670,848,780.97	88.96
	存托凭证	62,067,769.36	1.50
	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	378,754,222.73	9.18
8	其他各项资产	14,559,966.20	0.35
9	合计	4,126,230,739.26	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	3,732,916,550.33	91.55
合计	3,732,916,550.33	91.55

注：国家（地区）类别根据其所在的证券交易所确定，ADR、GDR 按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

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（%）
基础材料	38,822,381.73	0.95
消费者非必需品	397,991,897.85	9.76
消费者常用品	232,681,304.83	5.71
能源	16,910,219.94	0.41
金融	6,163,047.74	0.15
医疗保健	132,730,709.27	3.26
工业	128,559,418.79	3.15
信息技术	2,285,101,683.85	56.04
电信服务	451,565,635.41	11.07
公用事业	42,390,250.92	1.04
房地产	-	-
合计	3,732,916,550.33	91.55

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

7.3.2 期末积极投资按行业分类的权益投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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	-	NVDA	纳斯达克交易所	美国	208,255	283,808,452.26	6.96
2	APPLE INC	-	AAPL	纳斯达克交易所	美国	126,393	249,095,580.22	6.11
3	MICRON TECHNOLOGIES INC	-	MU	纳斯达克交易所	美国	26,792	210,632,106.76	5.17

	LOGY INC							
4	MICRO SOFT CORP	—	MSFT	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	63,926	162,410,518.21	3.98
5	ADVAN CED MICRO DEVIC ES	—	AMD	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	38,739	153,271,625.14	3.76
6	AMAZO N.COM INC	—	AMZN	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	92,571	150,271,421.31	3.69
7	TESLA INC	—	TSLA	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	42,989	123,149,063.91	3.02
8	ALPHA BET INC-C L A	—	GOOGL	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	50,119	121,990,214.00	2.99
9	INTEL CORP	—	INTC	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	119,404	113,553,916.48	2.78
10	ALPHA BET INC-C L C	—	GOOG	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	46,952	112,989,767.18	2.77
11	BROAD COM INC	—	AVGO	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	40,801	104,973,525.80	2.57
12	META PLATF ORMS INC-C LASS A	—	META	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	25,484	97,769,668.27	2.40
13	APPLI ED MATER IALS INC	—	AMAT	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	18,862	92,881,782.56	2.28
14	WALMA RT INC	—	WMT	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	115,893	89,400,153.87	2.19
15	LAM	—	LRCX	纳 斯 达	美国	29,710	87,685,122.39	2.15

	RESEARCH CORP			克 交 易 所				
16	CISCO SYSTEMS INC	-	CSCO	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	93,638	74,911,178.51	1.84
17	COSTCO WHOLESALE CORP	-	COST	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	10,540	67,154,478.25	1.65
18	KLA CORP	-	KLAC	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	31,034	63,772,282.97	1.56
19	SANDISK CORP	-	SNDK	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	3,518	54,480,267.46	1.34
20	NETFLIX INC	-	NFLX	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	100,037	48,647,819.04	1.19
21	PALO ALTO NETWORKS INC	-	PANW	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	19,386	45,026,953.35	1.10
22	TEXAS INSTRUMENTS INC	-	TXN	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	21,621	43,893,331.83	1.08
23	PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	-	PLTR	纳 斯 达 克 资 本 市 场	美国	54,549	43,346,146.57	1.06
24	MARVELL TECHNOLOGY INC	-	MRVL	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	20,783	42,166,607.94	1.03
25	LINDE PLC	-	LIN	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	10,984	38,822,381.73	0.95
26	WESTERN	-	WDC	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	8,189	35,624,263.16	0.87

	DIGIT AL CORP			所				
27	SEAGA TE TECHN OLOGY HOLDI NGS	—	STX	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	5,327	35,011,806.05	0.86
28	AMGEN INC	—	AMGN	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	12,822	31,623,707.77	0.78
29	QUALC OMM INC	—	QCOM	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	25,040	31,514,998.72	0.77
30	CROWD STRIK E HOLDI NGS INC – A	—	CRWD	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	6,048	31,435,509.53	0.77
31	ANALO G DEVIC ES INC	—	ADI	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	11,572	31,303,245.39	0.77
32	PEPSI CO INC	—	PEP	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	32,471	29,944,621.77	0.73
33	ASML HOLDI NG NV–NY REG SHS	—	ASML	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	2,177	29,498,082.00	0.72
34	T–MOB ILE US INC	—	TMUS	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	25,710	29,370,904.93	0.72
35	APPLO VIN CORP– CLASS A	—	APP	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	7,263	25,487,174.39	0.63
36	GILEA D	—	GILD	纳 斯 达 克 交 易	美国	29,496	25,380,986.67	0.62

	SCIEN CES INC			所				
37	ARM HOLDI NGS PLC-A DR	—	ARM	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	10,073	24,325,698.81	0.60
38	INTUI TIVE SURGI CAL INC	—	ISRG	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	8,414	22,789,813.00	0.56
39	SHOPI FY INC — CLASS A	—	SHOP	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	28,974	22,532,168.92	0.55
40	BOOKI NG HOLDI NGS INC	—	BKNG	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	18,409	22,348,062.39	0.55
41	VERTE X PHARM ACEUT ICALS INC	—	VRTX	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	6,030	20,400,565.49	0.50
42	STARB UCKS CORP	—	SBUX	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	27,076	18,845,054.96	0.46
43	FORTI NET INC	—	FTNT	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	17,406	18,211,731.71	0.45
44	CADEN CE DESIG N SYS INC	—	CDNS	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	6,553	16,751,217.57	0.41
45	MARRI OTT INTER NATIO NAL	—	MAR	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	6,265	15,813,182.22	0.39

	-CL A							
46	MONSTER BEVERAGE CORP	-	MNST	纳斯达克交易所	美国	23,235	15,211,111.26	0.37
47	CONSTELLATION ENERGY	-	CEG	纳斯达克交易所	美国	8,581	14,515,818.96	0.36
48	AUTOMATIC DATA PROCESSING	-	ADP	纳斯达克交易所	美国	9,497	14,485,784.12	0.36
49	CSX CORP	-	CSX	纳斯达克交易所	美国	44,144	14,290,387.37	0.35
50	COMCAST CORP-CLASS A	-	CMCSA	纳斯达克交易所	美国	84,642	14,152,785.26	0.35
51	DATADOG INC - CLASS A	-	DDOG	纳斯达克交易所	美国	7,860	13,938,027.36	0.34
52	MERCADOLIBRE INC	-	MELI	纳斯达克交易所	美国	1,204	13,919,147.28	0.34
53	SYNOPTICS INC	-	SNPS	纳斯达克交易所	美国	4,549	13,820,490.50	0.34
54	ADOBE INC	-	ADBE	纳斯达克交易所	美国	9,603	13,409,348.00	0.33
55	ASTERALABS INC	-	ALAB	纳斯达克交易所	美国	4,072	13,396,069.34	0.33
56	O'REILLY AUTOMOTIVE	-	ORLY	纳斯达克交易所	美国	19,688	12,348,624.30	0.30

	INC							
57	DOORD ASH INC – A	–	DASH	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	9,772	12,281,599.86	0.30
58	TERAD YNE INC	–	TER	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	3,719	12,255,540.00	0.30
59	AMERI CAN ELECT RIC POWER	–	AEP	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	12,926	12,044,436.83	0.30
60	MONDE LEZ INTER NATIO NAL INC–A	–	MDLZ	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	30,496	12,013,669.14	0.29
61	INTUI T INC	–	INTU	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	6,499	11,552,914.21	0.28
62	NXP SEMIC ONDUC TORS NV	–	NXPI	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	5,998	11,480,575.23	0.28
63	HONEY WELL INTER NATIO NAL INC	–	HON	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	7,442	11,348,756.12	0.28
64	HONEY WELL AEROS PACE	–	HONA	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	7,442	11,205,819.57	0.27
65	ROSS STORE S INC	–	ROST	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	7,653	11,094,554.60	0.27
66	CINTA S CORP	–	CTAS	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	9,505	11,010,571.77	0.27
67	MONOL ITHIC	–	MPWR	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	1,167	10,987,440.05	0.27

	POWER SYSTE MS INC			所				
68	WARNE R BROS DISCO VERY INC	—	WBD	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	59,563	10,815,365.79	0.27
69	LUMEN TUM HOLDI NGS INC	—	LITE	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	1,848	10,800,009.26	0.26
70	REGEN ERON PHARM ACEUT ICALS	—	REGN	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	2,448	10,396,334.30	0.25
71	PACCA R INC	—	PCAR	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	12,503	10,229,020.73	0.25
72	NEBIU S GROUP NV	—	NBIS	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	5,236	9,848,739.30	0.24
73	AIRBN B INC-C LASS A	—	ABNB	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	9,929	9,677,198.47	0.24
74	ROCKE T LAB CORP	—	RKLB	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	13,750	9,519,509.79	0.23
75	FASTE NAL CO	—	FAST	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	27,274	8,922,076.17	0.22
76	BAKER HUGHE S CO	—	BKR	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	23,569	8,909,198.67	0.22
77	ELECT RONIC ARTS INC	—	EA	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	5,957	8,318,991.82	0.20
78	PDD HOLDI NGS	—	PDD	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	15,868	8,243,988.55	0.20

	INC							
79	XCEL ENERG Y INC	—	XEL	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	14,831	8,111,300.37	0.20
80	DIAMO NDBAC K ENERG Y INC	—	FANG	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	6,683	8,001,021.27	0.20
81	MICRO CHIP TECHN OLOGY INC	—	MCHP	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	12,878	7,999,222.24	0.20
82	Ferro vial NV	—	FER	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	17,092	7,987,020.65	0.20
83	EXELO N CORP	—	EXC	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	24,309	7,718,694.76	0.19
84	TAKE- TWO INTER ACTIV E SOFTW RE	—	TTWO	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	4,411	7,510,119.12	0.18
85	AXON ENTER PRISE INC	—	AXON	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	1,915	7,311,965.31	0.18
86	OLD DOMIN ION FREIG HT LINE	—	ODFL	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	4,941	7,289,165.48	0.18
87	COCA- COLA EUROP ACIFI C PARTN ERS P	—	CCEP	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	10,593	7,219,836.72	0.18
88	COREW	—	CRWV	纳 斯 达	美国	10,633	7,208,716.63	0.18

	EAVE INC-C L A			克 交 易 所				
89	KEURI G DR PEPPE R INC	-	KDP	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	32,323	7,205,467.63	0.18
90	IDEXX LABOR ATORI ES INC	-	IDXX	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	1,874	6,719,283.59	0.16
91	AUTOD ESK INC	-	ADSK	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	5,013	6,638,090.17	0.16
92	ALNYL AM PHARM ACEUT ICALS INC	-	ALNY	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	3,172	6,503,504.74	0.16
93	PAYPA L HOLDI NGS INC	-	PYPL	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	20,956	6,163,047.74	0.15
94	PAYCH EX INC	-	PAYX	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	8,512	5,700,620.86	0.14
95	ROPER TECHN OLOGI ES INC	-	ROP	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	2,398	5,526,767.60	0.14
96	THOMS ON REUTE RS CORP	-	TRI	纳 斯 达 克 资 本 市场	美国	9,053	5,035,696.88	0.12
97	GE HEALT HCARE TECHN OLOGY	-	GEHC	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	10,807	4,711,481.42	0.12
98	STRAT EGY INC	-	MSTR	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	7,859	4,653,090.21	0.11

99	KRAFT HEINZ CO/TH E	-	KHC	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	28,171	4,531,966.19	0.11
100	COPAR T INC	-	CPRT	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	21,995	4,223,023.97	0.10
101	DEXCO M INC	-	DXCM	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	9,167	4,205,032.29	0.10
102	WORKD AY INC-C LASS A	-	WDAY	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	4,775	3,981,349.05	0.10

注：此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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	113,861,786.20	2.95
2	SANDISK CORP	SNDK	24,461,825.11	0.63
3	TESLA INC	TSLA	20,743,264.40	0.54
4	ARM HOLDINGS PLC-ADR	ARM	20,584,339.06	0.53
5	NVIDIA CORP	NVDA	17,306,096.79	0.45
6	APPLE INC	AAPL	14,981,638.41	0.39
7	ASTERA LABS INC	ALAB	11,810,138.01	0.31
8	TERADYNE INC	TER	11,592,472.52	0.30
9	LUMENTUM HOLDINGS INC	LITE	11,044,851.73	0.29
10	MICRON TECHNOLOGY INC	MU	10,407,471.62	0.27
11	MICROSOFT CORP	MSFT	10,391,084.23	0.27
12	NEBIUS GROUP NV	NBIS	10,334,479.26	0.27
13	ROCKET LAB CORP	RKLB	10,020,901.96	0.26
14	AMAZON.COM INC	AMZN	9,139,600.01	0.24
15	COREWEAVE INC-CL A	CRWV	8,611,902.32	0.22
16	ADVANCED MICRO DEVICES	AMD	7,647,094.29	0.20

17	ALPHABET INC-CL A	GOOGL	7,098,578.07	0.18
18	INTEL CORP	INTC	6,977,049.22	0.18
19	ALPHABET INC-CL C	GOOG	6,747,911.12	0.17
20	BROADCOM INC	AVGO	6,624,913.31	0.17

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

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	NVIDIA CORP	NVDA	71,283,996.92	1.85
2	APPLE INC	AAPL	60,795,017.75	1.57
3	MICROSOFT CORP	MSFT	48,660,109.00	1.26
4	AMAZON.COM INC	AMZN	37,233,029.84	0.96
5	ALPHABET INC-CL A	GOOGL	28,873,990.87	0.75
6	META PLATFORMS INC-CLASS A	META	27,806,954.63	0.72
7	TESLA INC	TSLA	27,753,522.98	0.72
8	ALPHABET INC-CL C	GOOG	26,184,276.40	0.68
9	BROADCOM INC	AVGO	25,023,569.10	0.65
10	MICRON TECHNOLOGY INC	MU	20,377,066.11	0.53
11	COSTCO WHOLESALE CORP	COST	18,105,287.38	0.47
12	ADVANCED MICRO DEVICES	AMD	17,331,873.46	0.45
13	NETFLIX INC	NFLX	16,416,850.60	0.42
14	WALMART INC	WMT	16,308,824.27	0.42
15	PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	PLTR	14,950,708.31	0.39
16	CISCO SYSTEMS INC	CSCO	13,851,605.21	0.36
17	LAM RESEARCH CORP	LRCX	12,775,166.91	0.33
18	APPLIED MATERIALS INC	AMAT	12,112,306.95	0.31
19	INTEL CORP	INTC	10,694,790.19	0.28
20	ASTRAZENECA PLC-SPONS ADR	AZN	10,520,751.89	0.27

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

7.5.3 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	446,217,614.17
卖出收入（成交）总额	830,310,402.12

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

7.6 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

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

报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或者在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.11.2

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	409,538.20
4	应收利息	-
5	应收申购款	14,150,428.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,559,966.20

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前五名积极投资中不存在流通受限情况。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中分项之和与合计可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级 别	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 （%）
摩 根 纳 斯 达 克 100 指数 (QDII) 人民币 A	1,037,159	1,590.86	70,369,215.11	4.26%	1,579,606,391.21	95.74%
摩 根 纳 斯 达 克 100 指数 (QDII) 人民币 C	432,114	1,401.59	37,403,588.78	6.18%	568,241,061.44	93.82%
摩 根 纳 斯 达 克 100 指数 (QDII) 美元 A	4,510	252.07	0.00	0.00%	1,136,818.33	100.00%
摩 根 纳 斯 达 克 100 指数 (QDII) 美元 C	3,678	289.06	0.00	0.00%	1,063,159.99	100.00%

合计	1,477,461	1,528.18	107,772,803.89	4.77%	2,150,047,430.97	95.23%
----	-----------	----------	----------------	-------	------------------	--------

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	摩根纳斯达克 100 指数 (QDII) 人民币 A	1,025,384.31	0.0621
	摩根纳斯达克 100 指数 (QDII) 人民币 C	66,402.92	0.0110
	摩根纳斯达克 100 指数 (QDII) 美元 A	173.89	0.0153
	摩根纳斯达克 100 指数 (QDII) 美元 C	106.41	0.0100
	合计	1,092,067.53	0.0484

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	份额级别	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	摩根纳斯达克 100 指数 (QDII) 人民币 A	0~10
	摩根纳斯达克 100 指数 (QDII) 人民币 C	0
	摩根纳斯达克 100 指数 (QDII) 美元 A	0
	摩根纳斯达克 100 指数 (QDII) 美元 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	摩根纳斯达克 100 指数 (QDII) 人民币 A	0~10
	摩根纳斯达克 100 指数 (QDII) 人民币 C	0~10
	摩根纳斯达克 100 指数 (QDII) 美元 A	0
	摩根纳斯达克 100 指数 (QDII) 美元 C	0
	合计	0~10

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,208.33	0.44	10,000,208.33	0.44	3 年

基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,208.33	0.44	10,000,208.33	0.44	3 年

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	摩根纳斯达克 100 指数 (QDII) 人民币 A	摩根纳斯达克 100 指数 (QDII) 人民币 C	摩根纳斯达克 100 指数 (QDII) 美元 A	摩根纳斯达克 100 指数 (QDII) 美元 C
基金合同生效日 (2023 年 9 月 25 日) 基金份额总额	47,399,510.43	43,193,905.27	4,320.31	59,909.33
本报告期期初基金份额总额	1,665,474,958.47	783,895,329.95	1,112,315.74	1,331,479.86
本报告期基金总申购份额	470,932,265.23	161,826,012.15	160,819.54	125,354.13
减：本报告期基金总赎回份额	486,431,617.38	340,076,691.88	136,316.95	393,674.00
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-	-
本报告期末基金份额总额	1,649,975,606.32	605,644,650.22	1,136,818.33	1,063,159.99

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内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

基金管理人：无。

基金托管人：本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未发生改聘为其审计的会计师事务所的情况。

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，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，未发现管理人相关从业人员受调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

报告期内，托管人无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

报告期内，托管人相关从业人员无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 (%)	
Instinet LLC	1	704,026,313.36	55.15	39,754.01	58.61	-
Citigroup Global Markets Ltd.	1	352,961,079.36	27.65	17,071.08	25.17	-
UBS SECURITIE	1	176,461,406.67	13.82	7,566.92	11.16	-

S LLC						
Bofa Securitie s Inc.	1	43,079,216.91	3.37	3,433.94	5.06	-
Citigroup Global Markets Inc	1	-	-	-	-	-
Merril Lynch	1	-	-	-	-	-

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

2. 证券公司的选择标准：
- 1) 资本金雄厚，信誉良好。
 - 2) 财务状况良好，经营行为规范，最近一年未因发生重大违规行为而受到有关管理机关处罚。
 - 3) 合规风控能力较强，内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。
 - 4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要。
 - 5) 具备较完善的清算系统，能及时、高效地完成资金的结算交收。
 - 6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时、定期、全面地为本基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析的研究报告及周到的信息服务。

3. 证券公司的选择程序：
- 1) 本基金管理人定期组织相关部门依据证券公司的选择标准对候选券商进行评估，确定选用的券商。
 - 2) 本基金管理人与券商签订协议，并通知基金托管人。
 - 4. 本基金本年度新增席位 UBS SECURITIES LLC，无注销席位。
 - 5. 《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》自 2024 年 7 月 1 日起实施，2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日期间，本公司旗下管理基金的股票交易佣金费率符合法规要求，即被动股票型基金的股票交易佣金费率不得超过市场平均股票交易佣金费率，其他类型基金的股票交易佣金费率不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍。市场平均股票交易佣金费率由中国证券业协会定期测算并向行业机构通报。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
Instinet LLC	-	-	-	-	-	-	-	-
Citigroup Global Markets Ltd.	-	-	-	-	-	-	-	-
UBS SECURITIES LLC	-	-	-	-	-	-	-	-
Bofa Securities Inc.	-	-	-	-	-	-	-	-
Citigroup Global Markets Inc	-	-	-	-	-	-	-	-
Merril Lynch	-	-	-	-	-	-	-	-

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	摩根纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金 (QDII) 2026 年境外主要市场节假日暂停申购、赎回、定期定额投资及转换转入业务的公告	基金管理人公司网站及本基金选定的信息披露报纸	2026 年 01 月 09 日
2	摩根纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金 (QDII) 调整大额申购、定期定额投资及转换转入业务的公告	同上	2026 年 04 月 27 日
3	摩根纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金 (QDII) 调整申购、定期定额投资及转换转入业务限制金额的公告	同上	2026 年 06 月 11 日

§ 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

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会准予摩根纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金 (QDII) 募集注册的文件
- (二) 摩根纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金 (QDII) 基金合同
- (三) 摩根纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金 (QDII) 托管协议
- (四) 法律意见书
- (五) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (六) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (七) 摩根基金管理(中国)有限公司开放式基金业务规则
- (八) 中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人住所。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

摩根基金管理（中国）有限公司

2026 年 8 月 31 日