

宝盈纳斯达克 100 指数型发起式
证券投资基金 (QDII)
2024 年第 2 季度报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：宝盈基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 7 月 19 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 7 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	宝盈纳斯达克 100 指数发起（QDII）
基金主代码	019736
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2024 年 3 月 22 日
报告期末基金份额总额	240,823,114.10 份
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的最小化。
投资策略	<p>本基金主要采用完全复制法跟踪标的指数，即原则上按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。</p> <p>由于标的指数编制方法调整、成份股及其权重发生变化（包括配送股、增发、临时调入及调出成份股等）的原因，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或因基金规模而投资受限，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。</p> <p>本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照基金份额持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。</p> <p>本基金的投资策略主要包括资产配置策略、股票投资策略、衍生品投资策略、境外市场公募基金投资策略、债券投资策略、可转换债券（含可交换债券）投资策略、资产支持证券投资策略、存托凭证投资策略、融资和转融通证券出借、境外回购交易及证券</p>

	借贷交易策略等。	
业绩比较基准	纳斯达克 100 指数收益率 (使用估值汇率调整) × 95% + 人民币活期存款收益率 (税后) × 5%	
风险收益特征	<p>本基金为股票型基金, 其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金, 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。</p> <p>本基金投资于境外证券, 除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外, 本基金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。</p>	
基金管理人	宝盈基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	宝盈纳斯达克 100 指数发起 (QDII) A 人民币	宝盈纳斯达克 100 指数发起 (QDII) C 人民币
下属分级基金的交易代码	019736	019737
报告期末下属分级基金的份额总额	80,373,181.00 份	160,449,933.10 份
境外资产托管人	英文名称: JPMorgan Chase Bank, National Association	
	中文名称: 摩根大通银行	

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位: 人民币元

主要财务指标	报告期 (2024 年 4 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)	
	宝盈纳斯达克 100 指数发起 (QDII) A 人民币	宝盈纳斯达克 100 指数发起 (QDII) C 人民币
1. 本期已实现收益	-1,525,397.60	-1,677,106.57
2. 本期利润	7,403,852.52	6,226,883.48
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0740	0.0642
4. 期末基金资产净值	86,511,718.35	172,533,844.64
5. 期末基金份额净值	1.0764	1.0753

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。

2、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、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

宝盈纳斯达克 100 指数发起 (QDII) A 人民币

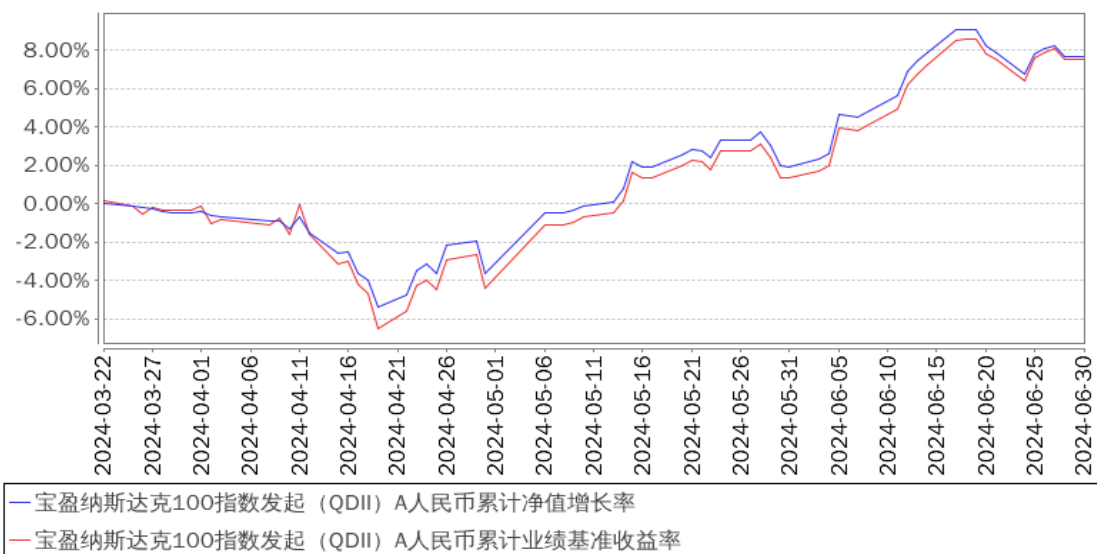
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	8.14%	0.83%	7.90%	0.94%	0.24%	-0.11%
自基金合同生效起至今	7.64%	0.79%	7.54%	0.90%	0.10%	-0.11%

宝盈纳斯达克 100 指数发起 (QDII) C 人民币

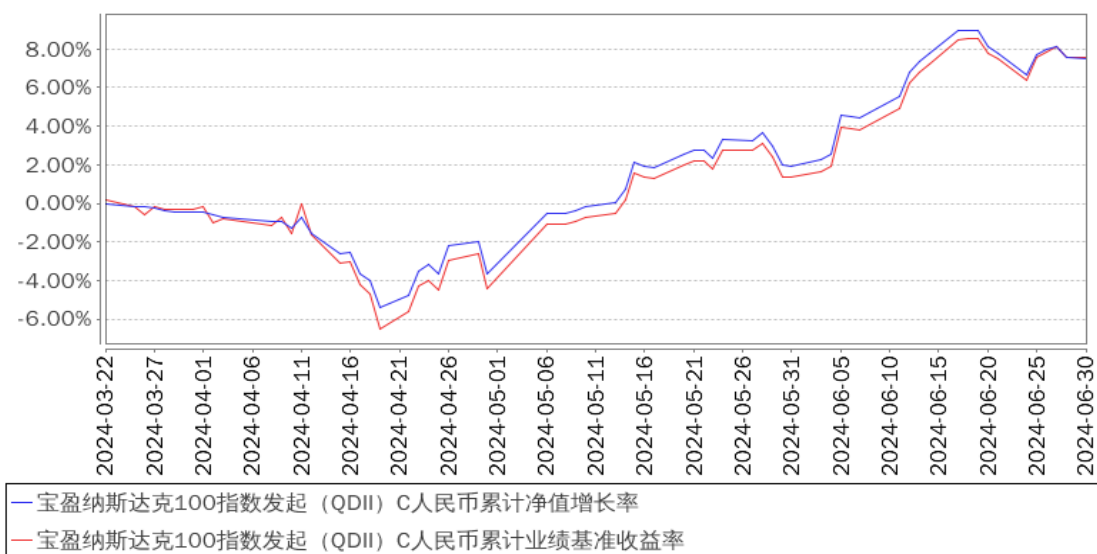
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	8.04%	0.83%	7.90%	0.94%	0.14%	-0.11%
自基金合同生效起至今	7.53%	0.79%	7.54%	0.90%	-0.01%	-0.11%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

宝盈纳斯达克100指数发起 (QDII) A人民币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



宝盈纳斯达克100指数发起 (QDII) C人民币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：1、本基金合同于 2024 年 3 月 22 日生效，自合同生效日起至披露时点未满一年。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起的 6 个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项资产配置比例将符合基金合同中的相关约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
蔡丹	本基金、宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金、宝盈宝盈祥瑞混合型证券投资基金、宝盈国证证券龙头指数型发起式证券投资基金、宝盈中证沪港深科技龙头指数型发起式证券投资基金、宝盈祥和 9 个月定期开放混合型证券投资基金、宝盈祥庆 9 个月持有期混合型证券投资基金、宝盈祥裕增强回报混合型证券投资基金、宝盈祥颐定期开放混合型证券投资基金、宝盈华证龙头红利 50 指数型发起式证券投资基金、宝盈新锐灵活配置混合型证券投资	2024 年 3 月 22 日	-	13 年	蔡丹女士，CFA，中山大学概率论与数理统计硕士。曾任职于网易互动娱乐有限公司、广发证券股份有限公司，2011 年 9 月至 2017 年 7 月任职于长城证券股份有限公司，先后担任金融研究所金融工程研究员、资产管理部量化投资经理、执行董事。2017 年 7 月加入宝盈基金管理有限公司，中国国籍，证券投资基金从业人员资格。

基金基金经理				
--------	--	--	--	--

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

报告期内本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

无。

4.3 报告期内本基金运作合规守信情况说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，无损害基金持有人利益的行为。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《宝盈基金管理有限公司公平交易制度》对本基金的日常交易行为进行监控，并定期制作公平交易分析报告，对不同投资组合的收益率、同向交易价差、反向交易价差作专项分析。报告结果表明，本基金在本报告期内的同向交易价差均在可合理解释范围之内；在本报告期内基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，在投资活动中公平对待不同投资组合，公平交易制度执行情况良好，无损害基金持有人利益的行为。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

今年一季度美国 GDP 同增 1.6%，低于预期值 2.5%；4 月 ISM 制造业和非制造业 PMI 均低于预期；5 月 ISM 非制造业 PMI 反弹，但制造业 PMI 仍低于预期，宏观经济前景有一定不确定性。通胀方面，今年 4 月 CPI 同比增速符合预期，相比 3 月小幅回落；5 月 CPI 和核心 CPI 同比增速均低于预期回落，通胀压力边际缓解。就业方面，今年 4 月就业数据强劲程度全面弱于预期。5 月非农数据和失业率出现背离，失业率超预期升高，非农数据表现较好或来自统计因素影响。6 月份美联储召开议息会议，维持 525-550bps 的政策利率不变，强调尽管 5 月通胀回落增强了降息

信心，但单月数据并不足以改变议息决策，美联储需要更多证据证明降通胀取得进展。

今年一季度由于 AI 算力高景气支撑、科技巨头 23 年业绩超预期，美股上涨明显，4 月初，由于超微电脑未发布业绩预告带来对 AI 算力产业的恐慌，叠加美联储强调持续通胀风险，美股股价大幅回调，4 月下旬随着 24Q1 财报季到来、4 月份通胀和就业数据降温，ISM 非制造业 PMI 低于预期，美股出现反弹，季度上涨 7.82%，同期上证指数下跌 2.43%，标普 500 指数上涨 3.92%。当前美股投资者情绪整体乐观，市场流动性充裕，估值和杠杆率位于合理区间。纳斯达克 100 指数季度末市盈率为 32.33X，ROE 为 21.11%，24 年、25 年一致预期 ROE 分别为 21.59%和 23.50%，指数净利润单季度同比增速为 26.55%，24 年、25 年一致预期净利润同比增速分别为 18.48%和 22.48%，未来两年业绩有望保持高速增长。

本基金采取完全复制的被动式指数基金管理策略，用量化方法来跟踪和控制偏离度，力争跟踪指数的收益，并将基金跟踪误差控制在合理范围内。本基金 4 月 22 日开放申赎，截止本季末 A 份额年化跟踪误差为 1.14%，较好地跟踪了基准指数的表现。

截至本报告期末宝盈纳斯达克 100 指数发起 (QDII) A 人民币的基金份额净值为 1.0764 元，本报告期基金份额净值增长率为 8.14%；截至本报告期末宝盈纳斯达克 100 指数发起 (QDII) C 人民币的基金份额净值为 1.0753 元，本报告期基金份额净值增长率为 8.04%。同期业绩比较基准收益率为 7.90%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额 (人民币元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	239,391,455.13	83.32
	其中：普通股	235,581,659.34	81.99
	优先股	-	-
	存托凭证	3,809,795.79	1.33
	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	27,095,094.31	9.43
8	其他资产	20,831,797.38	7.25
9	合计	287,318,346.82	100.00

5.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家（地区）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
美国	239,391,455.13	92.41
合计	239,391,455.13	92.41

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

5.3.1 报告期末指数投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
能源	1,129,807.61	0.44
原材料	3,443,169.53	1.33
工业	8,624,389.76	3.33
非必需消费品	26,968,433.16	10.41
必需消费品	14,202,645.58	5.48
医疗保健	14,404,062.87	5.56
金融	1,522,805.09	0.59
信息技术	124,630,986.26	48.11
通讯	41,301,417.88	15.94
公用事业	2,678,683.68	1.03
房地产	485,053.71	0.19
合计	239,391,455.13	92.41

注：以上分类采用国际通用的行业分类标准。

5.3.2 报告期末积极投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。

5.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细

5.4.1 报告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前十名股票及存托凭证投资明细

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代 码	所在证 券市场	所属 国家 (地 区)	数量 (股)	公允价值 (人 民币元)	占基金 资产净 值比例 (%)
1	Microsoft Corp	微软	MSFT US	纳斯达 克证 券交 易所	美国	6,605	21,039,060.13	8.12
2	Apple Inc	苹果公司	AAPL US	纳斯达 克证 券交 易所	美国	13,626	20,453,261.19	7.90
3	NVIDIA Corp	英伟达	NVDA US	纳斯达 克证 券交 易所	美国	21,858	19,244,764.01	7.43
4	Amazon.com Inc	亚马逊公司	AMZN US	纳斯达 克证 券交 易所	美国	9,248	12,736,845.92	4.92
5	Broadcom Inc	博通股份有限公司	AVGO US	纳斯达 克证 券交 易所	美国	1,064	12,174,597.84	4.70
6	Meta Platforms Inc	Meta 平台股份有限公司	META US	纳斯达 克证 券交 易所	美国	3,098	11,132,585.85	4.30
7	Alphabet Inc	Alphabet 公司	GOOGL US	纳斯达 克证 券交 易所	美国	5,220	6,776,325.36	2.62
8	Alphabet Inc	Alphabet 公司	GOOG US	纳斯达 克证 券交 易所	美国	4,991	6,524,223.50	2.52
9	Costco Wholesale Corp	开市客	COST US	纳斯达 克证 券交 易所	美国	1,018	6,166,747.49	2.38
10	Tesla Inc	特斯拉公司	TSLA US	纳斯达 克证 券交 易所	美国	4,290	6,049,977.58	2.34

注：本基金对以上证券代码采用当地市场代码。

5.4.2 报告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前五名股票及存托凭证投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。

5.5 报告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。

5.6 报告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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资 明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8 报告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。

5.9 报告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。

5.10 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内没有被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

5.10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（人民币元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	27,215.75
4	应收利息	-
5	应收申购款	20,804,581.63
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	20,831,797.38

5.10.4 报告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。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.10.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.10.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项与合计项之间可能存在尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	宝盈纳斯达克 100 指数发起 (QDII) A 人民币	宝盈纳斯达克 100 指数发起 (QDII) C 人民币
报告期期初基金份额总额	114,537,759.83	98,169,975.53
报告期期间基金总申购份额	27,767,676.19	143,356,921.56
减:报告期期间基金总赎回份额	61,932,255.02	81,076,963.99
报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	80,373,181.00	160,449,933.10

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§ 8 报告期末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	10,004,950.50	4.15	10,004,950.50	4.15	自合同生效之日起不少于 3 年
基金管理人高级管理人员	3,649.94	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,008,600.44	4.16	10,004,950.50	4.15	-

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

中国证监会准予宝盈纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金（QDII）注册的文件。

《宝盈纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金（QDII）基金合同》。

《宝盈纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金（QDII）托管协议》。

法律意见书。

基金管理人业务资格批件、营业执照。

基金托管人业务资格批件、营业执照。

中国证监会要求的其他文件。

10.2 存放地点

基金管理人办公地址：广东省深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 10 层

基金托管人办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

10.3 查阅方式

上述备查文件文本分别存放在基金管理人和基金托管人的办公场所，在办公时间内基金持有人可免费查阅。

宝盈基金管理有限公司

2024 年 7 月 19 日