

汇添富纳斯达克 100 交易型开放式指数证券 投资基金发起式联接基金 (QDII) 2026 年第 2 季度报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2026 年 07 月 21 日

§ 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约定，于 2026 年 7 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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 2026 年 04 月 01 日起至 2026 年 06 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	汇添富纳斯达克 100ETF 发起式联接（QDII）
基金主代码	018966
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2023 年 08 月 02 日
报告期末基金份额总额(份)	1,842,927,052.98
投资目标	通过投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要投资于目标 ETF，方便特定的客户群通过本基金投资目标 ETF。本基金不参与目标 ETF 的投资管理。为实现投资目标，本基金将以不低于基金资产净值 90%的资产投资于目标 ETF。在正常市场情况下，本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。本基金的投资策略主要包括：资产配置策略；目标 ETF 的投资策略；成份股、备选成份股投资策略；金融衍生品投资策略；资产支持证券投资策略；境内融资投资策略；参与境内转融通证券出借业务策略；境内外存托凭证的投资策略及汇率避险策略等。
业绩比较基	经人民币汇率调整的纳斯达克 100 指数收益率*95%+商业银行活期存款利

准	率（税后）*5%				
风险收益特征	本基金为汇添富纳斯达克 100ETF 的联接基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金通过投资目标 ETF，紧密跟踪标的指数，具有与标的指数相似的风险收益特征。 本基金可投资于境外证券市场，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，本基金还将面临汇率风险、境外证券市场风险等特殊投资风险。				
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司				
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	汇添富纳斯达克 100ETF 发起式联接（QDII）人民币 A	汇添富纳斯达克 100ETF 发起式联接（QDII）人民币 C	汇添富纳斯达克 100ETF 发起式联接（QDII）人民币 E	汇添富纳斯达克 100ETF 发起式联接（QDII）美元现汇	汇添富纳斯达克 100ETF 发起式联接（QDII）美元现钞
下属分级基金的交易代码	018966	018967	021773	018968	018969
报告期末下属分级基金的份额总额(份)	963,943,204.64	661,880,718.82	215,236,022.74	1,867,106.78	—
境外资产托管人	英文名称:State Street Bank and Trust Company				
	中文名称:道富银行				

注：汇添富纳斯达克 100ETF 发起式联接（QDII）美元现钞类份额本报告期无份额余额。

2.1 目标基金基本情况

基金名称	汇添富纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）
基金主代码	159660
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 03 月 30 日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2023 年 04 月 17 日
基金管理人名称	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人名称	中国建设银行股份有限公司

2.2 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采用完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，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，追求尽可能贴近标的指数的表现。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过

	4%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。本基金的投资策略主要包括：资产配置策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、金融衍生工具投资策略、参与境内融资投资策略、参与境内转融通证券出借业务策略、境内外存托凭证的投资策略。
业绩比较基准	经人民币汇率调整的纳斯达克 100 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。 本基金主要投资于境外证券市场，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，本基金还将面临汇率风险、境外证券市场风险等特殊投资风险。

§ 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(2026 年 04 月 01 日 – 2026 年 06 月 30 日)				
	汇添富纳斯达克 100ETF 发起式联接（QDII）人民币 A	汇添富纳斯达克 100ETF 发起式联接（QDII）人民币 C	汇添富纳斯达克 100ETF 发起式联接（QDII）人民币 E	汇添富纳斯达克 100ETF 发起式联接（QDII）美元现汇	汇添富纳斯达克 100ETF 发起式联接（QDII）美元现钞
1.本期已实现收益	28,682,944.19	19,915,144.26	6,610,481.62	422,226.96	—
2.本期利润	289,986,320.41	223,610,562.19	71,332,746.15	4,389,722.88	—
3.加权平均基金份额本期利润	0.3163	0.3223	0.3258	2.3061	—
4.期末基金资产净值	1,633,433,512.76	1,108,805,510.10	364,028,399.96	22,721,236.82	—
5.期末基金份额净值	1.6945	1.6752	1.6913	12.1692	—

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、汇添富纳斯达克 100ETF 发起式联接（QDII）美元现汇的期末基金份额净值为 1.7867 美元,折合人民币份额净值 12.1692 元。

3.2 基金净值表现

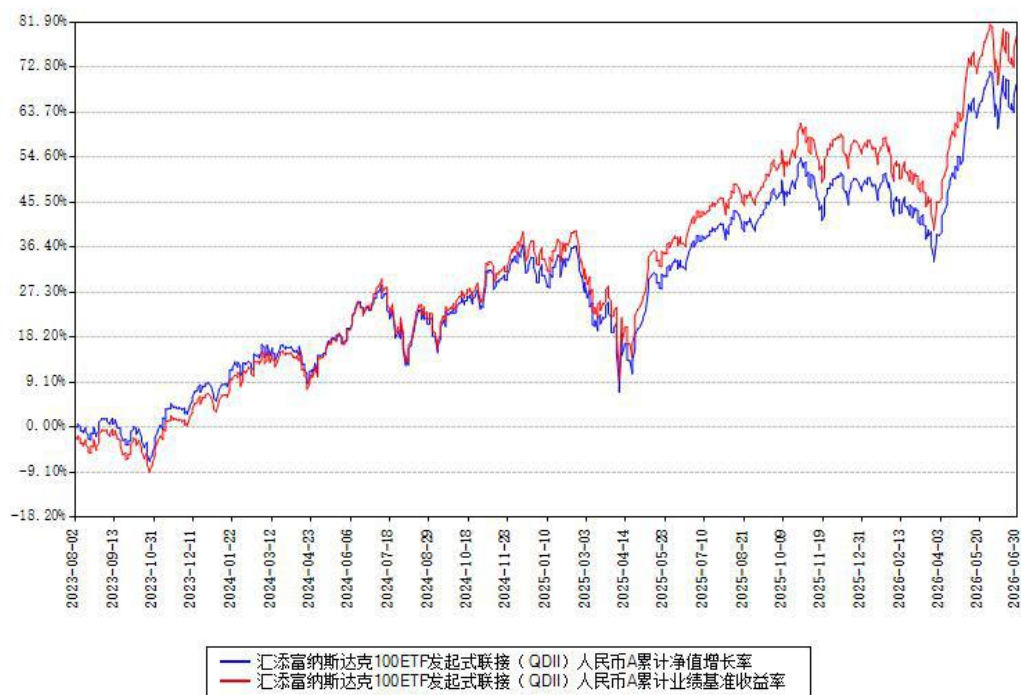
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富纳斯达克 100ETF 发起式联接（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	23.07%	1.43%	24.16%	1.44%	-1.09%	-0.01%
过去六个 月	14.72%	1.31%	15.39%	1.32%	-0.67%	-0.01%
过去一年	23.10%	1.11%	25.63%	1.12%	-2.53%	-0.01%
自基金合 同生效起 至今	69.45%	1.21%	79.12%	1.24%	-9.67%	-0.03%
汇添富纳斯达克 100ETF 发起式联接（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	22.94%	1.43%	24.16%	1.44%	-1.22%	-0.01%
过去六个 月	14.49%	1.31%	15.39%	1.32%	-0.90%	-0.01%
过去一年	22.61%	1.11%	25.63%	1.12%	-3.02%	-0.01%
自基金合 同生效起 至今	67.52%	1.21%	79.12%	1.24%	-11.60%	-0.03%
汇添富纳斯达克 100ETF 发起式联接（QDII）人民币 E						
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	23.04%	1.43%	24.16%	1.44%	-1.12%	-0.01%
过去六个	14.66%	1.31%	15.39%	1.32%	-0.73%	-0.01%

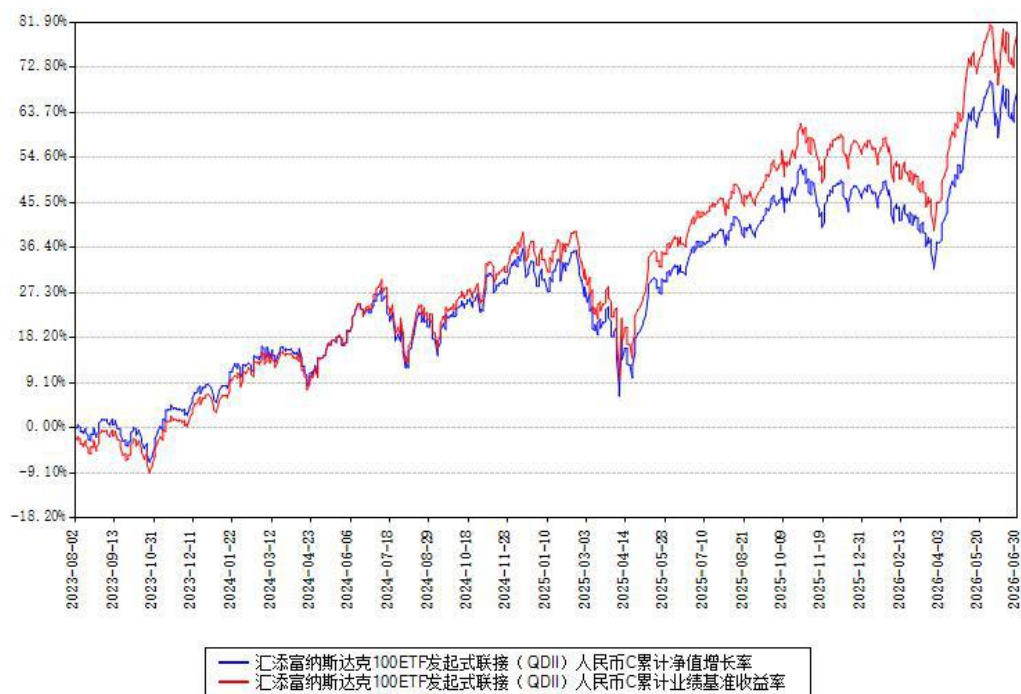
月						
过去一年	22.98%	1.11%	25.63%	1.12%	-2.65%	-0.01%
自基金合 同生效起 至今	34.18%	1.33%	41.07%	1.36%	-6.89%	-0.03%
汇添富纳斯达克 100ETF 发起式联接（QDII）美元现汇						
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①－③	②－④
过去三个 月	25.03%	1.43%	24.16%	1.44%	0.87%	-0.01%
过去六个 月	18.39%	1.31%	15.39%	1.32%	3.00%	-0.01%
过去一年	29.39%	1.11%	25.63%	1.12%	3.76%	-0.01%
自基金合 同生效起 至今	75.67%	1.22%	80.21%	1.25%	-4.54%	-0.03%
汇添富纳斯达克 100ETF 发起式联接（QDII）美元现钞						
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
	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%

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

汇添富纳斯达克100ETF发起式联接 (QDII) 人民币A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富纳斯达克100ETF发起式联接 (QDII) 人民币C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富纳斯达克100ETF发起式联接 (QDII) 人民币E累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富纳斯达克100ETF发起式联接 (QDII) 美元现汇累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2023 年 08 月 02 日）起 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

本基金各类份额自实际有资产之日起披露业绩数据。

本基金于 2024 年 07 月 03 日新增 E 类份额。

§ 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（年）	说明
		任职日期	离任日期		
过蓓蓓	本基金的基金经理,指数与量化投资部副总监	2023 年 08 月 02 日	—	15	国籍：中国。学历：中国科学技术大学金融工程博士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任国泰基金管理有限公司金融工程部助理分析师、量化投资部基金经理助理。2015 年 6 月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任指数与量化投资部副总监。2015 年 8 月 3 日至今任汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2015 年 8 月 3 日至 2023 年 4 月 13 日任中证金融地产交易型开放式指数证

					券投资基金的基金经理。2015 年 8 月 3 日至 2023 年 4 月 6 日任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2015 年 8 月 3 日至今任中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2015 年 8 月 3 日至今任中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2015 年 8 月 18 日至 2023 年 8 月 29 日任汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2015 年 8 月 18 日至 2023 年 5 月 22 日任深证 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2016 年 12 月 22 日至今任汇添富中证生物科技主题指数型发起式
--	--	--	--	--	--

					证券投资基金（LOF）的基金经理。2016 年 12 月 29 日至 2022 年 12 月 1 日任汇添富中证中药指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2018 年 5 月 23 日至今任汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2018 年 10 月 23 日至 2023 年 5 月 22 日任中证银行交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 3 月 26 日至今任汇添富中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 4 月 15 日至 2022 年 6 月 13 日任中证银行交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年
--	--	--	--	--	---

					10 月 8 日至 今任中证 800 交易型开放 式指数证券 投资基金的 基金经理。 2021 年 2 月 1 日至今任汇 添富国证生 物医药交易 型开放式指 数证券投资 基金的基金 经理。2021 年 6 月 3 日至 今任汇添富 中证新能源 汽车产业交 易型开放式 指数证券投资 基金的基金 经理。2021 年 9 月 29 日 至 2023 年 5 月 18 日任汇 添富中证 800 交易型开放 式指数证券 投资基金联 接基金的基 金经理。2022 年 2 月 28 日 至 2022 年 10 月 31 日任汇 添富国证生 物医药交易 型开放式指 数证券投资 基金联接基 金的基金经 理。2022 年 8 月 15 日至今 任汇添富纳 斯达克生物 科技交易型 开放式指数
--	--	--	--	--	---

					证券投资基金（QDII）的基金经理。2022 年 9 月 26 日至今任汇添富中证中药交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 10 月 20 日至 2024 年 4 月 8 日任汇添富中证 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 12 月 2 日至今任汇添富中证中药交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）的基金经理。2023 年 3 月 14 日至今任汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）的基金经理。2023 年 3 月 30 日至今任汇添富纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2023
--	--	--	--	--	---

					年8月2日至 今任汇添富 纳斯达克100 交易型开放 式指数证券 投资基金发 起式联接基 金（QDII）的 基金经理。 2023年8月 23日至今任 汇添富黄金 及贵金属证 券投资基金 （LOF）的基 金经理。
--	--	--	--	--	--

注:基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离任日期”为根据公司决议确定的解聘日期。

非首任基金经理,其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期。

证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

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

注：截至本报告期末，本基金的基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的成员简介

注：本基金无境外投资顾问。

4.3 报告期内本基金运作合规守信情况说明

本基金管理人在本报告期内遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，力争在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金无重大违法、违规行为，本基金投资运作符合有关法规及基金合同的约定。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人通过建立事前、事中和事后全程嵌入式的管控模式，保障公平交易制度的执行和实现。具体情况如下：

一、本基金管理人建立了内部公平交易管理规范 and 流程，公平交易管控覆盖公司所有业务类型、投资策略、投资品种，以及投资授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动相关的各个环节。

二、本着“时间优先、价格优先”的原则，对同一证券有相同交易需求的投资组合采用交易系统内的公平交易模块，实现事中交易执行层面的公平管控。

三、对不同投资组合进行同向交易价差分析，具体方法为：在不同时间窗口（日内、3 日内、5 日内）下，对不同组合同一证券同向交易的平均价差率进行 T 检验。对于未通过 T 检验的交易，再根据同向交易占优比、交易价格、交易频率、交易数量和交易时间等进行具体分析，进一步判断是否存在重大利益输送的可能性。

四、对于反向交易，根据交易顺序、交易时间窗口跨度、交易价格、交易数量等综合判断交易是否涉及利益输送。

综上，本基金管理人通过事前的制度规范、事中的监控和事后的分析评估，严格执行了公平交易制度，公平对待旗下各投资组合。本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的次数为 1。基金管理人事前严格根据内部规定进行管控，事后对交易时点、交易数量、交易价差等多方面进行综合分析，未发现导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

此外，为防范基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的潜在利益冲突，本基金管理人从投资指令、交易行为、交易监测等多方面，对兼任组合进行监控管理和分析评估。本报告期内兼任组合未出现违反公平交易或异常交易的情况。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

2026 年二季度，美国权益市场在一季度地缘冲击后的低基数上显著修复，盈利上修、AI 产业景气延续与中东风险溢价回落共同推动主要指数走强，但同时也伴随着通胀抬升、联储转鹰、估值继续抬升三重约束。标普 500 指数二季度上涨 14.9%，创 2020 年以来最佳单季表现；纳斯达克 100 指数上涨约 27%，强势修复。市场结构上，涨幅仍主要由 AI 基础设施、半导体、云计算和大型科技驱动，而传统防御板块相对占优的阶段主要出现在油价快速上冲和联储政策不确定性抬升时点。

美国宏观层面, 二季度的主线并非“增长坍塌”, 而是增长韧性仍在、但通胀和政策约束重新抬头。一方面, 企业盈利与名义增长保持较强支撑。预计 Q2 美国 GDP 由 2.0% 上调至 2.5%。另一方面, 通胀并未如市场年初预期那样顺畅回落, 能源分项 5 月同比高达 23.5%, 成为整体通胀的最主要贡献项。这意味着二季度美国宏观并未走向典型衰退, 而是走向了“增长尚可、通胀偏高、利率难降”的组合, 这也是美股在上涨过程中始终伴随高波动的重要原因。

从就业看, 劳动力市场呈现的是边际降温但总体仍稳定的状态, 并未给联储提供快速转向的充分理由。部分中期研究仍指出美国就业创造能力弱化、消费支撑减弱、居民高利率负担上升, 显示美国经济内生动能并非无虞。这使得二季度的市场定价不断在两种逻辑间切换: 一是“增长韧性+AI 投资热潮”支撑盈利, 二是“高通胀+高利率维持更久”压制估值。

政策层面, 二季度最关键的变化来自美联储从“按兵不动”转向“按兵不动但更鹰派”。4 月 FOMC 会议显示美联储内部成员意见出现严重分歧。进入 6 月后, 点阵图显著上修利率路径, 新任主席 Warsh 删除前瞻指引、弱化点阵图、成立五个工作组审查沟通机制、资产负债表、数据使用、生产率与就业、通胀框架, 整体传递出“短期不降、对通胀更敏感、对未来加息保持开放”的政策信号。市场反馈也较直接, 2 年期、10 年期美债收益率在决议后上行, 美元指数走强, 美股三大指数当日回落。

二季度海外变量仍是资本市场波动的重要外生来源, 其中中东地缘冲突、全球货币政策再定价、关税扰动边际缓和以及国际指数再平衡构成了对 A 股与港股影响最直接的四条主线。油价上行显著强化了全球“类滞胀”交易, 对权益风险偏好形成压制; 至 6 月中旬美伊确认阶段性停火、霍尔木兹海峡重开预期升温后, 前期地缘溢价快速出清。与此同时, 全球流动性边际上呈现由宽松转向收敛的特征。

纳斯达克 100 指数二季度的核心逻辑是 AI 产业景气从“叙事驱动”转向“业绩与资本开支兑现驱动”。4 月市场完成对 3 月回调的快速修复, 5 月继续上涨突破 30,000 点关口。4 月反弹来自三重驱动: 一是市场对地缘冲突逐步脱敏; 二是 4 月核心 CPI、PPI 阶段性低于预期, 缓和“滞胀”恐慌; 三是大型科技公司财报与 AI 产品迭代强化景气预期。5 月则进一步由英伟达、戴尔等财报超预期, 谷歌开发者大会、AI 智能体和云基础设施投资加速推动。到 6 月, 虽然指数仍处高位, 但在联储转鹰、美元走强、AI 板块高位波动加剧影响下, 月内由上涨转为震荡, 市场开始从单边拔估值切换到验证盈利与资本开支回报率。

作为被动投资的指数基金, 本基金在投资运作上严格遵守基金合同, 坚持既定的投资策略

略，积极采取有效方法控制基金相对业绩比较基准的跟踪误差，实现投资目标。

本报告期汇添富纳斯达克 100ETF 发起式联接（QDII）人民币 A 类份额净值增长率为 23.07%，同期业绩比较基准收益率为 24.16%。本报告期汇添富纳斯达克 100ETF 发起式联接（QDII）人民币 C 类份额净值增长率为 22.94%，同期业绩比较基准收益率为 24.16%。本报告期汇添富纳斯达克 100ETF 发起式联接（QDII）人民币 E 类份额净值增长率为 23.04%，同期业绩比较基准收益率为 24.16%。本报告期汇添富纳斯达克 100ETF 发起式联接（QDII）美元现汇类份额净值增长率为 25.03%，同期业绩比较基准收益率为 24.16%。本报告期汇添富纳斯达克 100ETF 发起式联接（QDII）美元现钞类份额为 0。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金为发起式基金，且截至本报告期末，本基金基金合同生效未满 3 年，暂不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条第一款的规定。

§ 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	—	—
	其中：普通股	—	—
	存托凭证	—	—
	优先股	—	—
	房地产信托	—	—
2	基金投资	2,828,901,241.40	88.20
3	固定收益投资	20,112,839.31	0.63
	其中：债券	20,112,839.31	0.63
	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	310,519,610.94	9.68
8	其他资产	47,757,675.58	1.49
9	合计	3,207,291,367.23	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

注:本基金本报告期末未持有权益投资。

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

注：本基金本报告期末未持有权益投资。

5.4 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股票及存托凭证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权益投资。

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

债券信用等级	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
A-至 A+	20,112,839.31	0.64

注:本基金债券投资组合主要采用穆迪、标准普尔等国际权威评级机构提供的债券信用评级信息。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例
----	------	------	----	------------	-----------

					(%)
1	019792	25 国债 19	19,904,000	20,112,839.3 1	0.64

注：数量列示债券面值，外币按照期末估值汇率折为人民币，四舍五入保留整数。

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

注: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

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值（人民 币元）	占基金资产净值 比例（%）
1	期货品种_指数	NASDAQ 100 E-MINI Sep26	-	-

注：期货投资采用当日无负债结算制度，公允价值变动金额为 3,327,994.10 元，已包含在结
算备付金中。

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

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值 （元）	占基金资 产净值比 例（%）
1	纳指 ETF 汇添富	股票型	交易型开 放式	汇添富基 金管理股 份有限公 司	2,828,901, 241.40	90.41

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

报告期内本基金投资前十名证券的发行主体没有被中国人民银行及其派出机构、国家金融监督管理总局（前身为中国银保监会）及其派出机构、中国证监会及其派出机构、国家市场监督管理总局及机关单位、交易所立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.10.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票库。

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	15,345,023.52
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	32,412,652.06
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	47,757,675.58

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注: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

注：本基金本报告期末未持有股票。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富纳斯达克 100ETF 发起式联接（QDII）人民币 A	汇添富纳斯达克 100ETF 发起式联接（QDII）人民币 C	汇添富纳斯达克 100ETF 发起式联接（QDII）人民币 E	汇添富纳斯达克 100ETF 发起式联接（QDII）美元现汇	汇添富纳斯达克 100ETF 发起式联接（QDII）美元现钞
本报告期期初基金份额总额	751,968,858.03	646,249,011.08	197,442,726.23	1,698,390.30	—
本报告期基金总申购份额	383,211,470.40	270,374,532.19	92,152,870.06	386,535.25	—
减：本报告期基金总赎回份额	171,237,123.79	254,742,824.45	74,359,573.55	217,818.77	—
本报告期基金拆分变动份额	—	—	—	—	—
本报告期期末基金份额总额	963,943,204.64	661,880,718.82	215,236,022.74	1,867,106.78	—

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本基金的基金管理人本报告期末运用固有资金投资本基金。

§ 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	10,000,990.00	0.54	10,000,990.00	0.54	3 年
基金管理人高级管理人员	494,562.22	0.03	—	—	
基金经理等人员	79,765.07	0.00	—	—	
基金管理人股东	—	—	—	—	
其他	965,635.74	0.05	—	—	
合计	11,540,953.03	0.63	10,000,990.00	0.54	

§ 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者超过 20%的情况

注：无

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）募集的文件；
- 2、《汇添富纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）基金合同》；
- 3、《汇添富纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内汇添富纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）在规定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

10.2 存放地点

上海市黄浦区外马路 728 号 汇添富基金管理股份有限公司

10.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，或登录基金管理人网站 www.99fund.com 查阅，还可拨打基金管理人客户服务中心电话：400-888-9918 查询相关信息。

汇添富基金管理股份有限公司

2026 年 07 月 21 日