

华安纳斯达克 100 交易型开放式指数证券
投资基金联接基金（QDII）
2023 年第 4 季度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：华安基金管理有限公司

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 1 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 1 月 17 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 2023 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 华安纳斯达克 100ETF 联接（QDII） |
| 基金主代码 | 040046 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2022 年 12 月 9 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 760,287,556.45 份 |
| 投资目标 | 本基金通过投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，力争实现跟踪偏离度和跟踪误差最小化。 |
| 投资策略 | 1、目标 ETF 投资策略 2、股票投资策略 3、债券投资策略 4、衍生品投资策略 5、资产支持证券投资策略 6、融资及转融通证券出借业务投资策略 |
| 业绩比较基准 | 纳斯达克 100 指数收益率（经汇率调整）×95%+人民币活期存款税后利率×5%。 |

| | | |
|-----------------|--|-----------------------------|
| 风险收益特征 | <p>本基金为 ETF 联接基金，目标 ETF 为股票型基金，因此本基金的预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金主要投资于目标 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。</p> <p>本基金通过主要投资于目标 ETF 间接投资于境外证券市场，需承担汇率风险以及境外市场的风险。</p> | |
| 基金管理人 | 华安基金管理有限公司 | |
| 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 | 华安纳斯达克 100ETF 联接（QDII） A | 华安纳斯达克 100ETF 联接 （QDII）C |
| 下属分级基金的交易代码 | 040046 | 014978 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 622,049,796.89 份 | 138,237,759.56 份 |
| 境外资产托管人 | 英文名称：State Street Bank and Trust Company | |
| | 中文名称：美国道富银行 | |

2.1.1 目标基金基本情况

| | |
|--------------|---------------------------------|
| 基金名称 | 华安纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII） |
| 基金主代码 | 159632 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2022 年 7 月 21 日 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 深圳证券交易所 |
| 上市日期 | 2022 年 8 月 3 日 |
| 基金管理人名称 | 华安基金管理有限公司 |
| 基金托管人名称 | 中国建设银行股份有限公司 |

2.1.2 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最小化。本基金力求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.3%，年跟踪误差不超过 4%。 |
| 投资策略 | <ol style="list-style-type: none"> 1、组合复制策略 2、替代性策略 3、股指期货投资策略 4、债券投资策略 5、资产支持证券投资策略 |

| | |
|--------|---|
| | 6、融资及转融通证券出借业务投资策略 7、存托凭证投资策略 |
| 业绩比较基准 | 纳斯达克 100 指数收益率 (经估值汇率调整) |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型指数基金, 因此本基金的预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现, 具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金为主要投资于境外证券交易市场的证券投资基金, 需要承担汇率风险、境外证券市场投资所面临的特别投资风险。 |

§ 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 (2023 年 10 月 1 日-2023 年 12 月 31 日) | |
|-----------------|--|---------------------------|
| | 华安纳斯达克 100ETF 联接 (QDII) A | 华安纳斯达克 100ETF 联接 (QDII) C |
| 1. 本期已实现收益 | 74,598,627.27 | 14,472,469.73 |
| 2. 本期利润 | 363,226,187.51 | 71,181,609.85 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.5837 | 0.5598 |
| 4. 期末基金资产净值 | 3,234,748,334.65 | 707,799,848.79 |
| 5. 期末基金份额净值 | 5.200 | 5.120 |

注: 1、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 (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。

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

3、自 2022 年 12 月 9 日起, 本基金转型为华安纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (QDII)。详情请参阅相关公告。

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

华安纳斯达克 100ETF 联接 (QDII) A

| 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 | 12.68% | 0.98% | 12.80% | 0.98% | -0.12% | 0.00% |

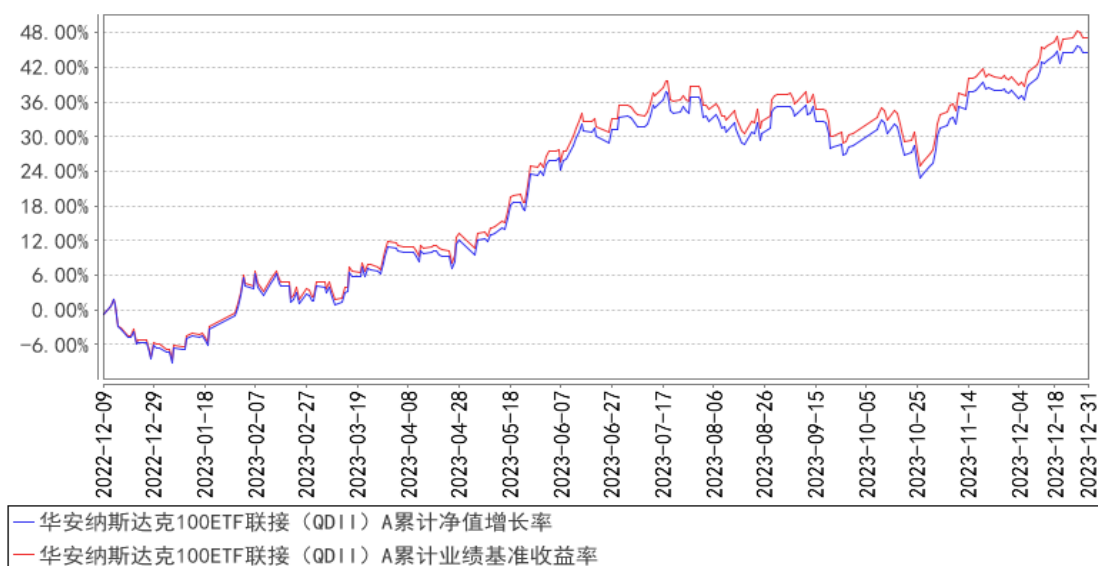
| | | | | | | |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|--------|
| 过去六个月 | 8.40% | 0.98% | 8.65% | 0.99% | -0.25% | -0.01% |
| 过去一年 | 54.67% | 1.14% | 56.41% | 1.14% | -1.74% | 0.00% |
| 过去三年 | - | - | - | - | - | - |
| 过去五年 | - | - | - | - | - | - |
| 自基金合同生效起至今 | 44.61% | 1.17% | 47.12% | 1.17% | -2.51% | 0.00% |

华安纳斯达克 100ETF 联接（QDII）C

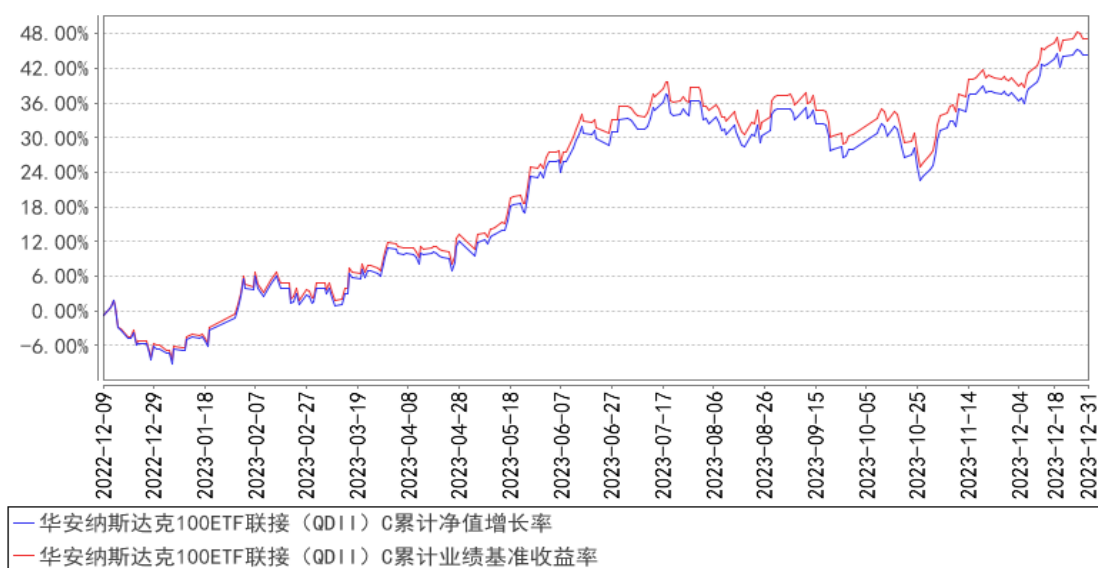
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率 标准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较基 准收益率标 准差④ | ①—③ | ②—④ |
|------------|--------|---------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月 | 12.63% | 0.98% | 12.80% | 0.98% | -0.17% | 0.00% |
| 过去六个月 | 8.29% | 0.98% | 8.65% | 0.99% | -0.36% | -0.01% |
| 过去一年 | 54.26% | 1.13% | 56.41% | 1.14% | -2.15% | -0.01% |
| 过去三年 | - | - | - | - | - | - |
| 过去五年 | - | - | - | - | - | - |
| 自基金合同生效起至今 | 44.23% | 1.17% | 47.12% | 1.17% | -2.89% | 0.00% |

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

华安纳斯达克100ETF联接 (QDII) A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



华安纳斯达克100ETF联接 (QDII) C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：自 2022 年 12 月 9 日起，本基金转型为华安纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (QDII)。详情请参阅相关公告。

§ 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 | | |
| 倪斌 | 指数与量化投资部助理总 | 2018年9月10日 | - | 13年 | 硕士研究生，13年基金行业从业经历。曾任毕马威华振会计师事务所审计员。2010年7月加入华安基金，历任基金运 |

| | | | | |
|--|-------------------|--|--|--|
| | <p>监、本基金的基金经理</p> | | | <p>营部基金会计、指数与量化投资部分析师、基金经理助理。2018 年 9 月起，同时担任华安标普全球石油指数证券投资基金（LOF）、华安纳斯达克 100 指数证券投资基金（2022 年 12 月起，转型为华安纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（QDII））、华安国际龙头（DAX）交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、华安 CES 港股通精选 100 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。2019 年 6 月起，同时担任华安三菱日联日经 225 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2020 年 5 月起，同时担任华安法国 CAC40 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2021 年 1 月至 2022 年 7 月，同时担任华安中证全指证券公司指数型证券投资基金的基金经理。2021 年 2 月起，同时担任华安中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月至 2022 年 7 月，同时担任华安中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 4 月至 2023 年 11 月，同时担任华安中证申万食品饮料交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 5 月起，同时担任华安恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2021 年 6 月起，同时担任华安中证沪港深科技 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 10 月起，同时担任华安中证新能源汽车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。2022 年 4 月起，同时担任华安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）的基金经理。2022 年 7 月起，同时担任华安纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2023 年 1 月起，同时担任华安恒生互联网科技业交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2023 年 12 月起，同时担任华安恒生港股通中国央企红利交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> |
|--|-------------------|--|--|--|

注：此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日，即以公告日为准。证券从业的含义遵从行业协会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

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《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，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，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，将各投资组合在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括：在研究环节，研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中，使用晨会发言、邮件发送、登录在研究报告管理系统等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节，公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略，制定并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节，公司实行强制公平交易机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。（1）交易所二级市场业务，遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则，实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。（2）交易所一级市场业务，投资组合经理按意愿独立进行业务申报，集中交易部以投资组合名义对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签，则按实际中签情况以价格优先、比例分配原则进行分配。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在合规监察员监督参与下，进行公平协商分配。（3）银行间市场业务遵循指令时间优先原则，先到先询价的控制原则。通过内部共同的 iwind 群，发布询价需求和结果，做到信息公开。若是多个投资组合进行一级市场投标，则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向，交易员以此进行投标，以确保中签结果与投资组合投标意

向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在风险管理部投资监督参与下，进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节，公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司风险管理部会同基金投资、交易部门讨论制定了各类投资组合针对股票、债券、回购等投资品种在交易所及银行间的同日反向交易控制规则，并在投资系统中进行了设置，实现了完全的系统控制。同时加强了对各类投资组合间的同日反向交易的监控与隔日反向交易的检查；风险管理部开发了同向交易分析系统，对相关同向交易指标进行持续监控，并定期对组合间的同向交易行为进行了重点分析。

本报告期内，因组合流动性管理或投资策略调整需要，除指数基金以外的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% 的次数为 1 次，未出现异常交易。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

四季度，美国经济整体继续呈现降温趋势，但在就业、消费等方面依然呈现较强韧性，尤其在超额储蓄支撑下，美国居民消费需求依然旺盛，而以人工智能为代表的科技进步刺激企业投资。同时通胀持续下行，11 月美国 PCE 价格指数同比增速回落为 2.6%，通胀压力较前期大幅缓和。在此背景下，美联储 12 月议息会议出现鸽派转向，鲍威尔首次提及开始讨论降息，从美联储点阵图看，预计 2024 年降息 75BP。受较强的经济数据以及市场偏乐观的降息预期，叠加科技公司三季度财报整体超市场预期，四季度纳指 100 指数大幅上行。作为基金管理人，我们继续坚持积极将基金回报与指数相拟合的原则，降低跟踪偏离和跟踪误差，勤勉尽责，为投资者获得长期稳定的回报。

截至 2023 年 12 月 31 日，本基金 A 类份额净值为 5.200 元，本报告期份额净值增长率为 12.68%；本基金 C 类份额净值为 5.120 元，本报告期份额净值增长率为 12.63%，同期业绩比较基准增长率为 12.80%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金报告期内不存在基金持有人数低于 200 人或基金资产净值低于 5000 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 | - | - |
| | 其中：普通股 | - | - |
| | 优先股 | - | - |
| | 存托凭证 | - | - |
| | 房地产信托凭证 | - | - |
| 2 | 基金投资 | 3,579,388,938.46 | 89.59 |
| 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 | 317,122,985.40 | 7.94 |
| 8 | 其他资产 | 98,768,122.28 | 2.47 |
| 9 | 合计 | 3,995,280,046.14 | 100.00 |

5.2 期末投资目标基金明细

| 序号 | 基金名称 | 基金类型 | 运作方式 | 管理人 | 公允价值 (人民币元) | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|----------------------------------|------|--------|------------|------------------|---------------|
| 1 | 华安纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) | 股票型 | 交易型开放式 | 华安基金管理有限公司 | 3,579,388,938.46 | 90.79 |

5.3 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

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.4 报告期末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股票及存托凭证。

5.5 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

5.5.1 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

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.6 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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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。

5.9 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 | 股指期货 | NASDAQ 100 E-MINI MAR24 | - | - |

注：按照期货每日无负债结算的结算规则，根据《基金股指期货投资会计业务核算细则（试行）》及《企业会计准则-金融工具列报》的相关规定，“其他衍生工具-期货投资”与“证券清算款-期货每日无负债结算暂收暂付款”，符合金融资产与金融负债相抵销的条件，故将“其他衍生工具-期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。期货投资的公允价值变动金额为人民币 12,922,942.29 元，已包含在结算备付金中。

5.10 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（人民币元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------|------|------|-----|------------|--------------|
|----|------|------|------|-----|------------|--------------|

| | | | | | | |
|---|----------------------------------|-----|--------|------------|------------------|-------|
| 1 | 华安纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) | 股票型 | 交易型开放式 | 华安基金管理有限公司 | 3,579,388,938.46 | 90.79 |
|---|----------------------------------|-----|--------|------------|------------------|-------|

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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

本报告期内，本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的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 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中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额 (人民币元) |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | 26,010,479.32 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 72,757,642.96 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 98,768,122.28 |

5.11.4 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。

5.11.5 报告期末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。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 华安纳斯达克 100ETF 联接 (QDII) A | 华安纳斯达克 100ETF 联接 (QDII) C |
|-------------|---------------------------|---------------------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 642,510,809.47 | 144,389,600.91 |

| | | |
|---------------------------|----------------|----------------|
| 报告期期间基金总申购份额 | 115,786,814.44 | 105,793,888.21 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 136,247,827.02 | 111,945,729.56 |
| 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 | 622,049,796.89 | 138,237,759.56 |

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、《华安纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（QDII）基金合同》
- 2、《华安纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（QDII）招募说明书》
- 3、《华安纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（QDII）托管协议》

9.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所，并登载于基金管理人互联网站

<http://www.huaan.com.cn>。

9.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的住所免费查阅。

华安基金管理有限公司

2024 年 1 月 19 日