

# 华安纳斯达克 100 指数证券投资基金

## 2021 年第 2 季度报告

2021 年 6 月 30 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：二〇二一年七月二十日

## § 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 2021 年 7 月 16 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 2021 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	华安纳斯达克 100 指数
基金主代码	040046
交易代码	040046
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 8 月 2 日
报告期末基金份额总额	466,349,979.39 份
投资目标	本基金为股票指数基金，通过严格的指数化投资策略与风险控制，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	本基金采用完全复制法，跟踪标的指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。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。 本基金的风险控制目标是追求年跟踪误差不超过 4%（以美元计价计算）。
业绩比较基准	纳斯达克 100 价格指数（Nasdaq 100 Price Index）收益率。
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于较高风险、较高预期收益的基金品种，其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。
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
境外资产托管人英文名称	State Street Bank and Trust Company
境外资产托管人中文名称	美国道富银行

### § 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
	(2021 年 4 月 1 日-2021 年 6 月 30 日)
1. 本期已实现收益	16,467,909.65
2. 本期利润	166,972,694.72
3. 加权平均基金份额本期利润	0.3523
4. 期末基金资产净值	1,972,489,403.38
5. 期末基金份额净值	4.230

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：封闭式基金交易佣金，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。

### 3.2 基金净值表现

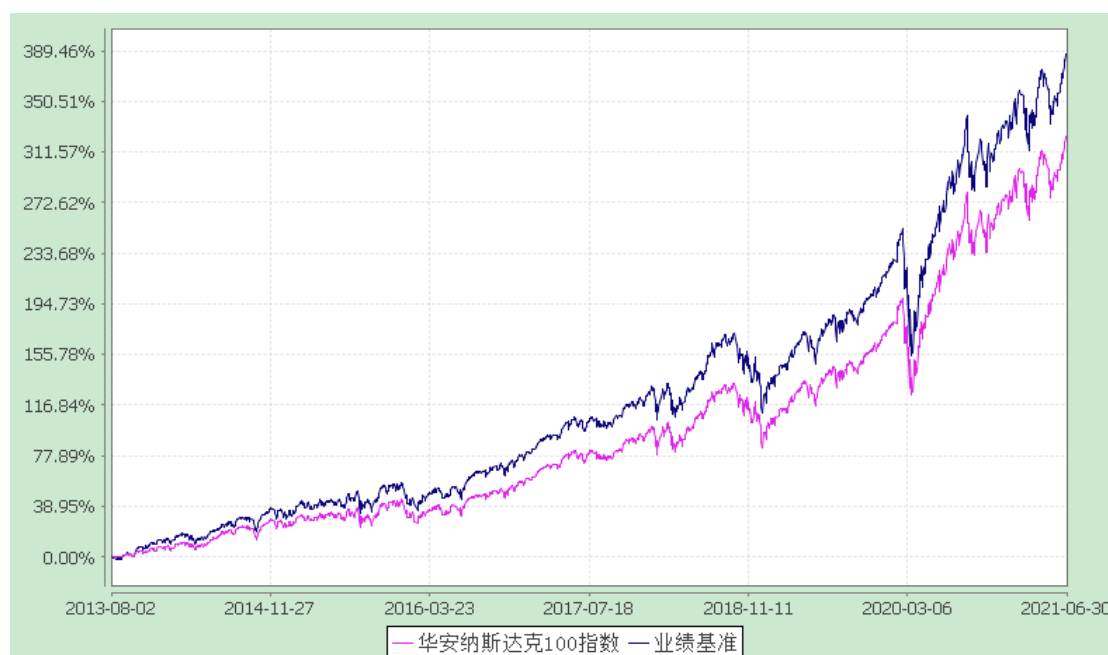
#### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	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	9.33%	1.08%	9.30%	1.09%	0.03%	-0.01%
过去六个月	11.67%	1.41%	11.81%	1.42%	-0.14%	-0.01%
过去一年	30.96%	1.45%	30.76%	1.47%	0.20%	-0.02%
过去三年	101.14%	1.60%	101.83%	1.70%	-0.69%	-0.10%
过去五年	207.41%	1.35%	220.96%	1.43%	-13.55%	-0.08%
自基金合同生效起至今	323.00%	1.21%	386.83%	1.30%	-63.83%	-0.09%

#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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 100 指数证券投资基金  
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2013 年 8 月 2 日至 2021 年 6 月 30 日)



## § 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	本基金的基金经理	2018-09-10	-	10 年	<p>硕士研究生,10 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、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 月起,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 月起,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 月起,同时担任华安中证申万食品饮料交易型开放式指数证券</p>

					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。
--	--	--	--	--	--

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《证券业从业人员资格管理办法》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

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。

## 4.3 公平交易专项说明

### 4.3.1 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市交易的投资品种、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。

#### 4.3.2 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。

### 4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度全球经济持续共振复苏，美国经济也继续向好，5 月 Markit 制造业 PMI 指数和服务业 PMI 指数分别回升至 62.1 和 70.4，均创有数据以来新高。5 月个人消费支出和 6 月份密歇根大学消费者信心指数持续上行，6 月非农就业新增 85 万人，其中服务业新增就业显著。通胀回升明显，5 月整体 CPI 和核心 CPI 同比增速分别上行到+5.0%和+3.8%。美

联储 6 月议息会议维持基准利率和资产购买计划维持不变,但大幅上调了经济和通胀预期。十年期美债收益率大幅回落,叠加美股盈利增长持续改善,使得美国科技股表现活跃,推升纳指 100 指数二季度继续创出历史新高。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 6 月 30 日,本基金份额净值为 4.230 元,本报告期份额净值增长率为 9.33%,同期业绩比较基准增长率为 9.30%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度,美国经济复苏进程将有望持续推进,尽管前期财政补贴将逐步停止发放,但我们认为伴随疫苗接种率持续提升、美国所有州全面开放,服务型消费仍将继续推动下阶段经济修复回升,即将公布的美股二季度业绩预计同比将大幅增长,尽管通胀提升且就业有所改善,但疫情对就业的打击并未完全消退,美联储短期内仍将维持宽松态势,购债规模的缩减计划大概率会在年底提出。对纳指而言,企业盈利端的改善有望对冲货币政策转向的预期,美国经济在信息技术、半导体、生物医药等领域的领先优势仍然很大。以高科技和高成长为代表的纳斯达克 100 指数成份股中长期看仍将是现代科技创新进步的主要驱动力之一。

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。

#### 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	1,844,533,740.60	90.18
	其中:普通股	1,807,677,074.20	88.37
	存托凭证	36,856,666.40	1.80
	优先股	-	-



	房地产信托	-	-
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	178,794,513.20	8.74
8	其他各项资产	22,162,920.71	1.08
9	合计	2,045,491,174.51	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	1,844,533,740.60	93.51
合计	1,844,533,740.60	93.51

## 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 期末指数投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

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	902,005,447.06	45.73
通信服务	363,510,528.63	18.43
非日常生活消费品	317,918,630.58	16.12

医疗保健	123,043,457.46	6.24
日常消费品	89,966,298.40	4.56
工业	31,631,743.99	1.60
公用事业	16,457,634.48	0.83
房地产	-	-
能源	-	-
原材料	-	-
金融	-	-
合计	1,844,533,740.60	93.51

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

### 5.3.2 期末积极投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

无。

## 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

### 5.4.1 指数投资期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

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	APPLE INC	苹果公司	AAPL US	纳斯达克 市场	美国	230,820	204,223, 833.82	10.35
2	MICROSOFT CORP	微软	MSFT US	纳斯达克 市场	美国	103,730	181,531, 762.27	9.20
3	AMAZON.COM INC	亚马逊公 司	AMZN US	纳斯达克 市场	美国	6,800	151,121, 687.79	7.66
4	FACEBOOK INC-CLASS A	Facebook 公司	FB US	纳斯达克 市场	美国	33,130	74,417,9 76.62	3.77
5	ALPHABET INC-CL C	Alphabet 公司	GOOG US	纳斯达克 市场	美国	4,533	73,394,1 55.81	3.72
6	TESLA INC	特斯拉公 司	TSLA US	纳斯达克 市场	美国	16,400	72,011,2 51.51	3.65
7	NVIDIA CORP	英伟达	NVDA US	纳斯达克 市场	美国	13,000	67,193,4 38.13	3.41
8	ALPHABET INC-CL A	Alphabet 公司	GOOGL US	纳斯达克 市场	美国	4,133	65,194,7 99.92	3.31
9	PAYPAL HOLDINGS	Paypal 控股股份	PYPL US	纳斯达克 市场	美国	24,500	46,133,2 53.73	2.34

	INC	有限公司						
10	ADOBE INC	奥多比	ADBE US	纳斯达克 市场	美国	10,100	38,211,258.94	1.94

#### 5.4.2 积极投资期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权益投资明细

无。

#### 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

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 SEP21	-	-

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4,766,274.76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

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。

5.10.2 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。

### 5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	10,346,496.16
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	227,576.66
4	应收利息	11,651.56
5	应收申购款	11,577,196.33
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	22,162,920.71

### 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  
无。

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  
无。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	448,797,312.48
报告期期间基金总申购份额	126,412,312.19
减：报告期期间基金总赎回份额	108,859,645.28
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	466,349,979.39

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

## § 8 备查文件目录

### 8.1 备查文件目录

- 1、《华安纳斯达克 100 指数证券投资基金基金合同》
- 2、《华安纳斯达克 100 指数证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安纳斯达克 100 指数证券投资基金托管协议》

### 8.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网站  
<http://www.huaan.com.cn>。

### 8.3 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办公场所免费查阅。

华安基金管理有限公司

二〇二一年七月二十日