

华宝纳斯达克精选股票型发起式证券投资
基金（QDII）
2024 年第 2 季度报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：华宝基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年07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2024年04月01日起至06月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	华宝纳斯达克精选股票发起式（QDII）
基金主代码	017436
基金运作方式	契约型开放式、发起式
基金合同生效日	2023年3月2日
报告期末基金份额总额	618,835,911.79份
投资目标	本基金主要投资美国纳斯达克交易所上市股票，通过精选个股和严格风险控制，力争实现资产的稳健增值。
投资策略	本基金采取积极的资产配置策略，通过宏观策略研究，综合考虑宏观经济、政策形势、证券市场走势以及市场流动性等方面因素，对相关资产类别的预期收益进行动态跟踪，以确定投资组合中各类资产的配置比例。 本基金定位于从美国纳斯达克交易所上市股票中精选质地优异、经营稳健、品牌突出，具备行业领先性的代表性上市公司构建投资组合，以期获得良好的收益回报。本基金主要采取“自下而上”的选股策略，依据上述界定的纳斯达克精选股票主题的投资

	范围，通过定量筛选和基本面分析有机结合的方法，挑选出符合条件的股票进行投资，在有效控制风险前提下，争取实现基金资产的长期稳健增值。	
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×90%+人民币活期存款税后利率×10%。	
风险收益特征	本基金是股票型基金，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。本基金主要投资于美国证券市场挂牌交易的股票，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险之外，本基金还面临汇率风险等海外市场投资所面临的特别投资风险。	
基金管理人	华宝基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华宝纳斯达克精选股票发起式（QDII） A	华宝纳斯达克精选股票发起式（QDII） C
下属分级基金的交易代码	017436	017437
报告期末下属分级基金的份额总额	148,301,024.32 份	470,534,887.47 份
境外资产托管人	英文名称：The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited	
	中文名称：香港上海汇丰银行有限公司	

§ 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）	
	华宝纳斯达克精选股票发起式（QDII） A	华宝纳斯达克精选股票发起式（QDII） C
1. 本期已实现收益	-741,985.58	-2,951,442.95
2. 本期利润	17,505,385.59	50,984,516.81
3. 加权平均基金份额本	0.1571	0.1468

期利润		
4. 期末基金资产净值	241,913,639.92	764,076,070.41
5. 期末基金份额净值	1.6312	1.6238

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，本期利润等于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。

3.2 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

华宝纳斯达克精选股票发起式（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	10.35%	1.38%	7.48%	0.89%	2.87%	0.49%
过去六个月	18.31%	1.29%	15.88%	0.88%	2.43%	0.41%
过去一年	27.77%	1.23%	24.96%	0.88%	2.81%	0.35%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	63.12%	1.20%	60.95%	0.93%	2.17%	0.27%

华宝纳斯达克精选股票发起式（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	10.24%	1.37%	7.48%	0.89%	2.76%	0.48%
过去六个月	18.09%	1.29%	15.88%	0.88%	2.21%	0.41%
过去一年	27.26%	1.23%	24.96%	0.88%	2.30%	0.35%
过去三年	-	-	-	-	-	-

过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	62.38%	1.20%	60.95%	0.93%	1.43%	0.27%

注：（1）基金业绩基准：经人民币汇率调整的纳斯达克 100 指数收益率×90%+人民币活期存款税后利率×10%；

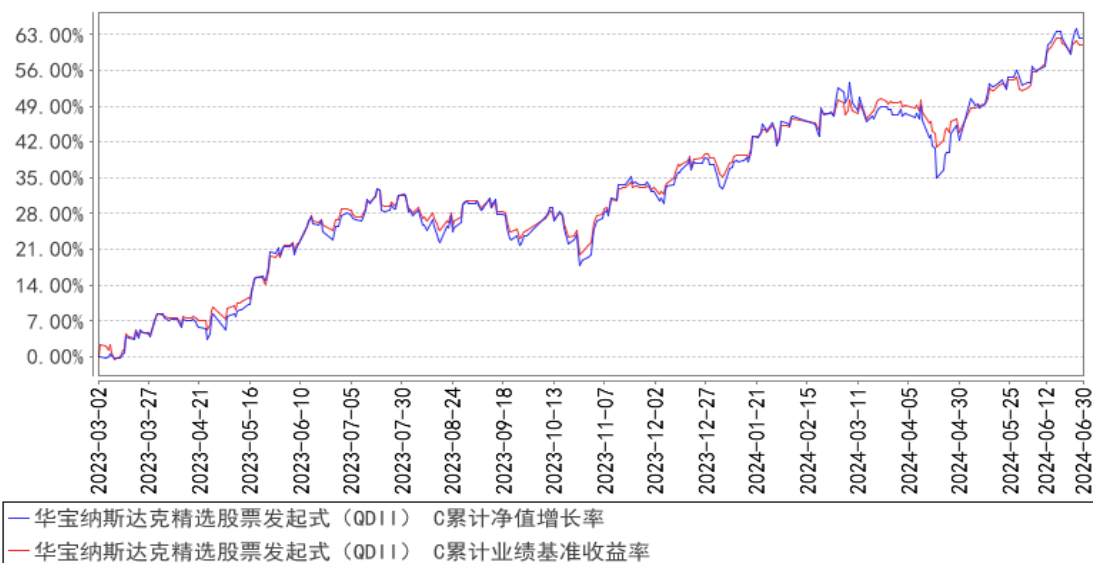
（2）净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

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

华宝纳斯达克精选股票发起式（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



华宝纳斯达克精选股票发起式 (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：按照基金合同的约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定，截至 2023 年 09 月 02 日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

§ 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		
周晶	本基金基金经理、公司总经理助理、国际业务部总经理	2023-03-02	-	20 年	博士。先后在德亚投资(美国)、华宝基金、汇丰证券(美国)从事风控、投资分析等工作。2011 年 6 月再次加入华宝基金管理有限公司，先后担任策略部总经理、首席策略分析师、海外投资部总经理等职务，现任公司总经理助理兼国际业务部总经理。2013 年 6 月至 2015 年 11 月任华宝兴业成熟市场动量优选证券投资基金基金经理，2014 年 9 月起任华宝标普石油天然气上游股票指数证券投资基金 (LOF) 基金经理，2015 年 9 月至 2017 年 8 月任华宝兴业中国互联网股票型证券投资基金基金经理，2016 年 3 月起任华宝标普美国品质消费股票指数证券投资基金 (LOF) 基金经理，2016 年 6 月起任华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金 (LOF) 基金经理，2017 年 4 月起任华宝港股通恒生中国(香港上市)25 指数证券投资基金 (LOF) 基金经理，2018 年 3 月至

					<p>2023年3月任华宝港股通恒生香港35指数证券投资基金(LOF)基金经理,2018年10月起任华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金(LOF)基金经理,2019年11月起任华宝致远混合型证券投资基金(QDII)基金经理,2020年11月至2023年11月任华宝英国富时100指数发起式证券投资基金基金经理,2022年2月起任华宝中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2022年9月起任华宝海外中国成长混合型证券投资基金基金经理,2022年12月起任华宝中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理,2023年3月起任华宝纳斯达克精选股票型发起式证券投资基金(QDII)基金经理,2023年4月起任华宝海外科技股票型证券投资基金(QDII-LOF)基金经理,2023年5月起任华宝海外新能源汽车股票型发起式证券投资基金(QDII)基金经理。</p>
杨洋	本基金基金经理、国际投资助理总监	2023-03-02	-	14年	<p>硕士。曾在法兴银行、东北证券从事证券交易、研究、投资管理工作。2014年6月加入华宝基金管理有限公司,先后担任高级分析师、投资经理等职务,现任国际投资助理总监。2021年5月至2023年11月任华宝英国富时100指数发起式证券投资基金基金经理,2021年5月至2023年3月任华宝港股通恒生香港35指数证券投资基金(LOF)基金经理,2021年5月起任华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金(LOF)、华宝标普美国品质消费股票指数证券投资基金(LOF)、华宝港股通恒生中国(香港上市)25指数证券投资基金(LOF)、华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金(LOF)、华宝标普石油天然气上游股票指数证券投资基金(LOF)基金经理,2022年1月起任华宝致远混合型证券投资基金(QDII)基金经理,2022年9月起任华宝海外中国成长混合型证券投资基金基金经理,2023年3月起任华宝纳斯达克精选股票型发起式证券投资基金(QDII)基金经理,2023年4月起任华宝海外科技股票型证券投资基金(QDII-LOF)基金经理,2023年5月起任华宝海外新能源汽车股票型发起</p>

					式证券投资基金（QDII）基金经理。
赵启元	本基金基金经理	2023-08-05	-	13 年	硕士。曾在 SunsetMesaCapital、GramercyFundsManagement、ZhaoInvestments、摩根斯坦利、赤子之心亚洲资本等从事投资研究分析工作。2019 年 7 月加入华宝基金管理有限公司历任高级分析师、投资经理、基金经理助理等职务。2023 年 8 月起任华宝纳斯达克精选股票型发起式证券投资基金（QDII）、华宝海外科技股票型证券投资基金（QDII-LOF）、华宝海外新能源汽车股票型发起式证券投资基金（QDII）基金经理。

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从《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。

4.1.1 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

本报告期内，本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 报告期内本基金运作合规守信情况说明

本报告期内，本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》及其各项实施细则、《华宝纳斯达克精选股票型发起式证券投资基金（QDII）基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，基金管理人通过严格执行投资决策委员会议事规则、公司股票库管理制度、中央交易室制度、防火墙机制、系统中的公平交易程序、每日交易日结报告、定期基金投资绩效评价等机制，确保所管理的所有投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。同时，基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定和公司内部制度要求，分析了本公司旗下所有投资组合之间的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异以及连续四个季度期间内、不同时间窗下同向交易的交易价差；分析结果未发现异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，基金管理人未发生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%。

本报告期内，本基金未发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

整个 24 年二季度，纳斯达克 100 指数在四月份震荡之后，稳健上行并连创新高。二季度，美国整体经济依然强劲。制造业景气度继续升温，PMI 持续维持在高位。服务业景气度更加强势，6 月份服务业 PMI 为 55.3。

美国通胀从 4% 下降到 3% 的趋势持续。二季度美国通胀较 23 年高位继续回落，核心 CPI 已经降到 3.4% 的同比水平。美国强势的经济增长对美国十年期国债利率有较强的支撑作用，维持在 4.2% 以上。

我们精选质地优良、高护城河、强现金流以及有产业趋势的科技行业个股，突出产品的科技属性。另外从去年 3 月成立以来，我们持续看好 AI 板块算力，因而将更多的权重赋予了能够在本次 AI 浪潮中受益的公司。中长期来看，我们看好美国科技巨头在这次 AI 浪潮中的表现，以及其它受益于 AI 革命的中小型企业表现。

本报告期基金份额 A 净值增长率为 10.35%，本报告期基金份额 C 净值增长率为 10.24%；同期业绩比较基准收益率为 7.48%。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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	952,186,889.15	88.54
	其中：普通股	938,443,241.13	87.26
	优先股	-	-
	存托凭证	13,743,648.02	1.28
	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	54,540,892.05	5.07
8	其他资产	68,684,854.94	6.39
9	合计	1,075,412,636.14	100.00

注：本基金本报告期末“固定收益投资”、“买入返售金融资产”、“银行存款和结算备付金合计”等项目的列报金额已包含对应的“应计利息”和“减值准备”（若有），“其他资产”中的“应收利息”指本基金截至本报告期末已过付息期但尚未收到的利息金额（下同）。

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	952,186,889.15	94.65
合计	952,186,889.15	94.65

5.3 报告期末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（%）
通讯	248,334,496.55	24.69
科技	459,061,358.54	45.63
公用事业	-	-
非必须消费品	190,410,982.77	18.93
必须消费品	54,380,051.29	5.41
能源	-	-
金融	-	-
房地产	-	-
医疗保健	-	-
工业	-	-
材料	-	-
合计	952,186,889.15	94.65

注：本基金对以上行业分类采用彭博行业分类标准。

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	NVIDIA Corp	英伟达	NVDA US	美国	美国	109,764	96,641,150.93	9.61
2	Microsoft Corp	微软	MSFT US	美国	美国	29,106	92,712,018.81	9.22
3	Apple Inc	苹果公司	AAPL US	美国	美国	61,697	92,610,073.07	9.21
4	Tesla Inc	特斯拉公司	TSLA US	美国	美国	56,555	79,756,755.71	7.93
5	Broadcom Inc	博通股份有限公司	AVGO US	美国	美国	6,712	76,800,658.56	7.63
6	Amazon.com Inc	亚马逊公司	AMZN US	美国	美国	53,675	73,924,113.82	7.35
7	Meta Platforms Inc	Meta 平台股份有限公司	META US	美国	美国	19,398	69,706,229.91	6.93
8	Alphabet Inc	Alphabet 公司	GOOG US	美国	美国	30,379	39,711,357.59	3.95
8	Alphabet Inc	Alphabet 公司	GOOGL US	美国	美国	18,066	23,452,316.84	2.33
9	Netflix Inc	奈飞公司	NFLX US	美国	美国	11,719	56,365,281.93	5.60
10	Costco Wholesale Corp	开市客	COST US	美国	美国	8,977	54,380,051.29	5.41

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投资。

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投资。

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投资。

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

基金管理人没有发现本基金投资的前十名证券的发行主体在报告期内被监管部门立案调查，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚，无证券投资决策程序需特别说明。

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

基金投资的前十名股票未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	178,819.40
4	应收利息	-
5	应收申购款	68,506,035.54
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	68,684,854.94

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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，合计数可能不等于分项之和。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华宝纳斯达克精选股票发起式（QDII）A	华宝纳斯达克精选股票发起式（QDII）C

报告期期初基金份额总额	94,063,062.84	344,156,791.37
报告期期间基金总申购份额	97,437,042.01	425,503,534.11
减：报告期期间基金总赎回份额	43,199,080.53	299,125,438.01
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	148,301,024.32	470,534,887.47

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未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	10,000,000.00	1.62	10,000,000.00	1.62	不少于 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	10,000,000.00	1.62	10,000,000.00	1.62	-

注：1、本基金募集期间，本基金管理人运用固有资金作为发起资金总计 10,001,000.00 元认购了本基金。发起资金认购的基金份额自基金合同生效之日起持有期不少于 3 年；

2、本基金管理人运用固有资金于 2023 年 2 月 28 日通过本公司直销柜台认购本基金作为发起资金的认购费用为 1,000 元。符合基金合同和招募说明书等法律文件的约定。

§ 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

-

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件；
华宝纳斯达克精选股票型发起式证券投资基金（QDII）基金合同；
华宝纳斯达克精选股票型发起式证券投资基金（QDII）招募说明书；
华宝纳斯达克精选股票型发起式证券投资基金（QDII）托管协议；
基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
基金管理人报告期内在指定报刊上披露的各种公告；
基金托管人业务资格批件和营业执照。

10.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人办公场所备投资者查阅。

10.3 查阅方式

投资者可以通过基金管理人网站，查阅或下载基金合同、招募说明书、托管协议及基金的各种定期和临时公告。

华宝基金管理有限公司

2024 年 7 月 19 日