

广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资 基金

2016 年半年度报告

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一六年八月二十六日

1 重要提示及目录

1.1 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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人.....	6
2.5 信息披露方式.....	6
2.6 其他相关资料.....	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	19
7 投资组合报告	33
7.1 期末基金资产组合情况.....	33
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	33
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	34
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....	34
7.5 报告期内股票投资组合的重大变动.....	49
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	50
7.7 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.....	50
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	51
7.9 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.....	51
7.10 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.....	51
7.11 投资组合报告附注.....	51
8 基金份额持有人信息	52

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	52
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	52
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	52
9 开放式基金份额变动.....	53
10 重大事件揭示.....	53
10.1 基金份额持有人大会决议.....	53
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	53
10.4 基金投资策略的改变.....	54
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况.....	54
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	54
10.8 其他重大事件.....	55
11 备查文件目录.....	56
11.1 备查文件目录.....	56
11.2 存放地点.....	57
11.3 查阅方式.....	57

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金
基金简称	广发生物科技指数（QDII）
基金主代码	001092
交易代码	001092
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 3 月 30 日
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	440,210,994.71 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用被动式指数化投资策略，紧密跟踪纳斯达克生物科技指数，力求实现对标的指数的跟踪偏离度和跟踪误差最小化，为投资者提供一个投资美国纳斯达克生物科技市场的有效投资工具。
投资策略	（一）资产配置策略本基金为被动管理的指数型基金，在正常情况下，力争将本基金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控制在 0.5%以内，年跟踪误差控制在 5%以内。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致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、跟踪误差进一步扩大。（二）权益类投资策略 股票组合构建方法本基金主要采用完全复制法跟踪标的指数，以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为原则，进行被动式指数化投资。（三）固定收益类投资策略（四）衍生品投资策略
业绩比较基准	95%×人民币计价的纳斯达克生物科技指数收益率+5%×人民币活期存款收益率（税后）。
风险收益特征	本基金为股票型基金，风险和收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征。本基金为被动管理的指数型基金，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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		广发基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露	姓名	段西军	洪渊
	联系电话	020-83936666	010-66105799

负责人	电子邮箱	dxj@gffunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95105828, 020-83936999	95588
传真		020-89899158	010-66105798
注册地址		广东省珠海市横琴新区宝中路 3号4004-56室	北京市西城区复兴门内大街55 号
办公地址		广州市海珠区琶洲大道东1号 保利国际广场南塔31-33楼	北京市西城区复兴门内大街55 号
邮政编码		510308	100140
法定代表人		孙树明	易会满

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	-	Brown Brothers Harriman & Co.
	中文	-	布朗兄弟哈里曼银行
注册地址		-	140 Broadway New York, NY 10005
办公地址		-	-
邮政编码		-	-

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.gffunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	广发基金管理有限公司	广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2016年1月1日至2016年6月30日）
---------------	---------------------------

本期已实现收益	-4,209,609.44
本期利润	-92,275,800.63
加权平均基金份额本期利润	-0.2250
本期加权平均净值利润率	-27.80%
本期基金份额净值增长率	-22.85%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)
期末可供分配利润	-96,901,124.56
期末可供分配基金份额利润	-0.2201
期末基金资产净值	343,309,870.15
期末基金份额净值	0.780
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-22.00%

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、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

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

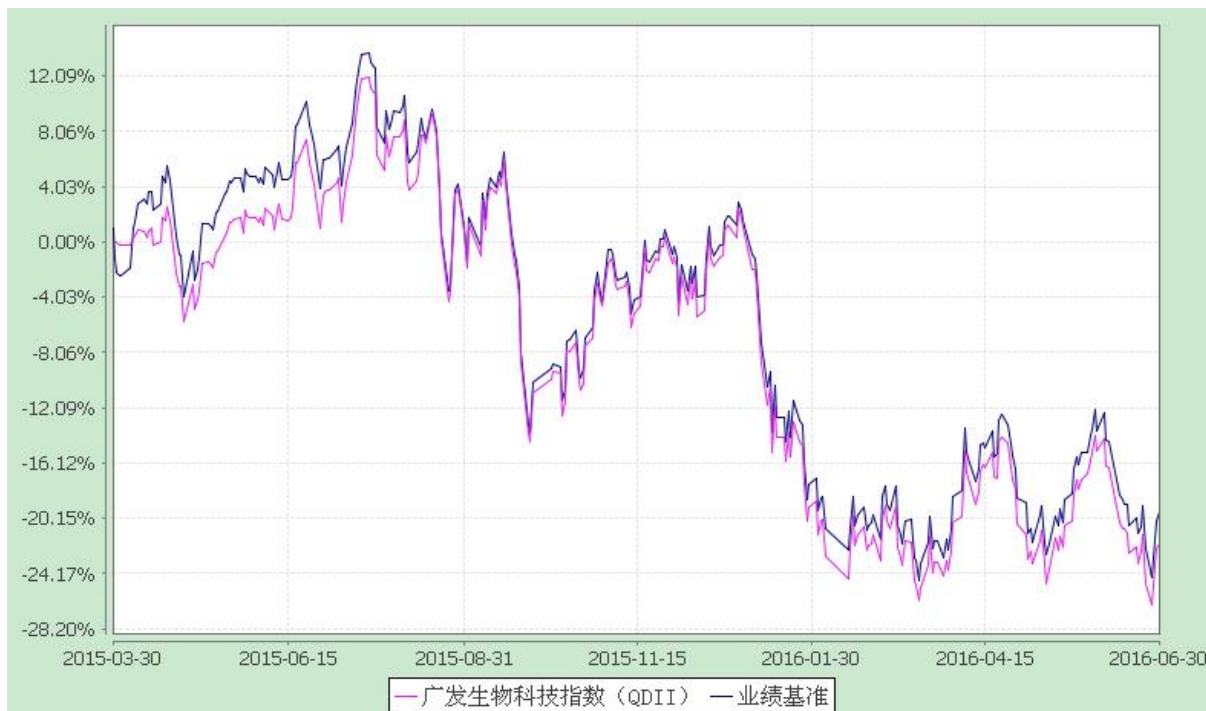
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-7.25%	2.12%	-6.51%	2.10%	-0.74%	0.02%
过去三个月	0.78%	1.97%	1.77%	1.94%	-0.99%	0.03%
过去六个月	-22.85%	2.11%	-20.86%	2.06%	-1.99%	0.05%
过去一年	-24.49%	2.05%	-23.90%	1.99%	-0.59%	0.06%
自基金合同生效起至今	-22.00%	1.91%	-19.63%	1.87%	-2.37%	0.04%

注：1、本基金的业绩比较基准为：95%×人民币计价的纳斯达克生物科技指数收益率+5%×人民币活期存款收益率（税后）。

2、业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的。

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

广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 （2015年3月30日至2016年6月30日）



4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人经中国证监会证监基金字[2003]91号文批准，于2003年8月5日成立，注册资本1.2688亿元人民币。公司的股东为广发证券股份有限公司、烽火通信科技股份有限公司、深圳市前海香江金融控股集团有限公司、康美药业股份有限公司和广州科技金融创新投资控股有限公司。公司拥有公募基金、社保基金境内投资管理人、受托管理保险资金投资管理人、合格境内机构投资者境外证券投资管理（QDII）和特定客户资产管理等业务资格。

本基金管理人在董事会下设合规及风险管理委员会、薪酬与资格审查委员会、战略规划委员会三个专业委员会。公司下设投资决策委员会、风险控制委员会和25个部门：综合管理部、财务部、人力资源部、监察稽核部、基金会计部、注册登记部、信息技术部、中央交易部、规划发展部、研究发展部、权益投资一部、权益投资二部、固定收益部、数量投资部、量化投资部、另类投资部、数据策略投资部、国际业务部、产品营销管理部、机构理财部、北京分公司、广州分公司、上海分公司、互联网金融部、北京办事处。此外，还出资设立了广发国际资产管理有限公司（香港子公司）、瑞元资本管理有限公司，参股了证通股份有限公司。

截至2016年6月30日，本基金管理人管理九十八只开放式基金——广发聚富开放式证券投资基

金、广发稳健增长开放式证券投资基金、广发小盘成长股票型证券投资基金（LOF）、广发货币市场基金、广发聚丰股票型证券投资基金、广发策略优选混合型证券投资基金、广发大盘成长混合型证券投资基金、广发增强债券型证券投资基金、广发核心精选股票型证券投资基金、广发沪深 300 指数证券投资基金、广发聚瑞股票型证券投资基金、广发中证 500 指数证券投资基金（LOF）、广发内需增长灵活配置混合型证券投资基金、广发全球精选股票型证券投资基金、广发行业领先股票型证券投资基金、广发聚祥灵活配置混合型证券投资基金、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、广发标普全球农业指数证券投资基金、广发聚利债券型证券投资基金、广发制造业精选股票型证券投资基金、广发聚财信用债证券投资基金、广发深证 100 指数分级证券投资基金、广发消费品精选股票型证券投资基金、广发理财年年红债券型证券投资基金、广发纳斯达克 100 指数证券投资基金，广发双债添利债券型证券投资基金、广发纯债债券型证券投资基金、广发理财 30 天债券型证券投资基金、广发新经济股票型发起式证券投资基金、广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、广发聚源定期开放债券型证券投资基金、广发轮动配置股票型证券投资基金、广发聚鑫债券型证券投资基金、广发理财 7 天债券型证券投资基金、广发美国房地产指数证券投资基金、广发集利一年定期开放债券型证券投资基金、广发趋势优选灵活配置混合型证券投资基金、广发聚优灵活配置混合型证券投资基金、广发天天红发起式货币市场基金、广发亚太中高收益债券型证券投资基金、广发现金宝场内实时申赎货币市场基金、广发全球医疗保健指数证券投资基金、广发成长优选灵活配置混合型证券投资基金、广发钱袋子货币市场基金、广发天天利货币市场基金、广发集鑫债券型证券投资基金、广发竞争优势灵活配置混合型证券投资基金、广发新动力股票型证券投资基金、广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金、广发主题领先灵活配置混合型证券投资基金、广发活期宝货币基金、广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金、广发中证百度百发策略 100 指数型证券投资基金、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金、广发中证养老产业指数型发起式证券投资基金、广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金、广发中证环保产业指数型证券投资基金、广发聚安混合型证券投资基金、广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金、广发聚宝混合型证券投资基金、广发聚惠灵活配置混合型证券投资基金、广发中证全指可选消费交易型开放式证券投资基金发起式联接基金、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发安心回报混合型证券投资基金、广发安泰回报混合型证券投资基金、广发聚康混合型证券投资基金、广发聚泰混合型证券投资基金、广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指能源交

易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发中证医疗指数分级证券投资基金、广发改革先锋灵活配置混合型证券投资基金、广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、广发百发大数据策略精选灵活配置混合型证券投资基金、广发百发大数据策略成长灵活配置混合型证券投资基金、广发聚盛灵活配置混合型证券投资基金、广发多策略灵活配置混合型证券投资基金、广发安富回报灵活配置混合型证券投资基金和广发安宏回报灵活配置混合型证券投资基金、广发新兴产业精选灵活配置混合型证券投资基金、广发稳安保本混合型证券投资基金、广发鑫享灵活配置混合型证券投资基金、广发鑫裕灵活配置混合型证券投资基金、广发安享灵活配置混合型证券投资基金、广发稳鑫保本混合型证券投资基金、广发沪港深新机遇股票型证券投资基金、广发集裕债券型证券投资基金、广发稳裕保本混合型证券投资基金、广发安泽回报混合型证券投资基金，管理资产规模为 2341 亿元。同时，公司还管理着多个特定客户资产管理投资组合和社保基金投资组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
邱炜	本基金的基金经理；广发全球农业指数(QDII)的基金经理；广发纳斯达克 100 指数(QDII)基金的基金经理；广发美国房地产指数(QDII)基金的基金经理；广发亚太中高收益债券	2015-03-30	-	9 年	男，中国籍，统计学博士，持有中国证券投资基金业从业证书，2007 年 5 月至 2008 年 7 月在摩根大通集团（纽约）任高级分析师兼助理副总裁，2008 年 7 月至 2011 年 6 月任

	<p>(QDII)基金的基金经理;广发全球医疗保健</p> <p>(QDII)基金的基金经理;广发纳指</p> <p>100ETF 基金的基金经理;广发鑫享混合基金的基金经理;国际业务部总经理</p>				<p>广发基金管理有限公司国际业务部研究员,</p> <p>2011 年 6 月 28 日起任广发全球农业指数(QDII)基金的基金经理,</p> <p>2012 年 8 月 15 日起任广发纳斯达克 100 指数(QDII)基金的基金经理,</p> <p>2013 年 8 月 9 日起任广发美国房地产指数(QDII)基金的基金经理,</p> <p>2013 年 11 月 28 日起任广发亚太中高收益债券(QDII)基金的基金经理,</p> <p>2013 年 12 月 10 日起任广发全球医疗保健(QDII)基金的基金经理,</p> <p>2014 年 1 月 21 日至</p>
--	--	--	--	--	--

					2016 年 1 月 27 日任国际业务部副总经理，2015 年 1 月 14 日至 2016 年 1 月 27 日任另类投资部副总经理，2015 年 3 月 30 日起任广发生物科技指数(QDII)基金的基金经理，2015 年 6 月 10 日起任广发纳指 100ETF 基金的基金经理，2016 年 1 月 15 日起任广发鑫享混合基金的基金经理，2016 年 1 月 28 日起任国际业务部总经理。
--	--	--	--	--	--

注：1. “任职日期”和“离职日期”指公司公告聘任或解聘日期。

2. 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合规守信情况的说明

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》及其配套法规、《广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最

大利益。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司通过建立科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控与及时的分析评估，保证公平交易原则的实现。

在投资决策的内部控制方面，公司制度规定投资组合投资的股票必须来源于备选股票库，重点投资的股票必须来源于核心股票库。公司建立了严格的投资授权制度，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易过程中，中央交易部按照“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”的原则，公平分配投资指令。监察稽核部风险控制岗通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控及预警，实现投资风险的事中风险控制；稽核岗通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核，实现投资风险的事后控制。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，不同的投资组合受到了公平对待，未发生任何不公平的交易事项。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司原则上禁止不同投资组合之间（完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合除外）或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易。如果因应对大额赎回等特殊情况进行反向交易的，则需经公司领导严格审批并留痕备查。

本报告期内，本投资组合与本公司管理的其他投资组合未发生过同日反向交易的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年初，美国股市受到中国股市连续熔断的影响大幅下行，同时油价在一月份持续下跌，引起市场对通缩的担心。随着中国叫停熔断政策，欧洲央行在一月末释放宽松信号推动美国股市见底回升。进入二月份，市场对欧洲银行关于能源业敞口的担忧推升市场的避险情绪，风险资产持续暴跌。随着德银公布债券回购计划以及沙特和俄罗斯的冻产计划慢慢让石油价格企稳，风险资产在二月中下旬止跌。纳斯达克生物科技行业也慢慢筑底。由于加拿大医药公司 VALEANT 控制药价的丑闻与美国限制药价的预期打压美国医药行业二级市场的表现，行业指数的走势弱于其它板块，一季度纳斯达克生物科技指数大幅下行。

二季度纳斯达克生物科技指数总体在底部震荡整固的格局。二季度关于生物科技行业的消息不多，整个行业还在底部震荡。今年生物科技行业远远跑输市场的原因在于美国医药高药价的问题提交到了总统大选的议题，高药价的问题受到监管层的关注，市场预期未来药物价格有一定的压力，从而对生物科技行业的盈利产生影响，所以相关公司的股价一直表现不佳。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金的净值增长率为-22.85%，同期业绩比较基准收益率为-20.86%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，虽然生物科技指数今年远远跑输大市，但是从中长期的角度来看我们仍然看好生物科技行业的前景。首先，生物科技行业是需求很强的行业，人类的健康医疗需求是人类最基本的需求之一。根据世界卫生组织的统计，人均医疗费用支出每年都在稳定增长，而生物科技是医疗行业中最终解决人类健康问题的方案之一，所以该行业的需求也会陆续地增长。其次，美国监管药价是为了打击虚高的药物价格，对于有真正疗效的药物的价格影响不大，因为本质还是供求关系决定，所以药价最终不会有很大的折让。但是这个结果估计会在大选之后才会让市场意识到生物科技企业的负面因素没有想象那么大。所以股价有望在美国大选后真正企稳而重新回到上升通道。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设有估值委员会，按照相关法律法规和证监会的相关规定，负责制定旗下基金投资品种的估值原则和估值程序，并选取适当的估值方法，经公司管理层批准后方可实施。估值委员会的成员包括：公司分管投研、估值的副总经理、督察长、投资管理部负责人、研究发展部负责人、金融工程部负责人、监察稽核部负责人和基金会计部负责人。估值委员会定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。基金日常估值由基金会计部具体执行，并确保和托管行核对一致。投资研究人员积极关注市场变化、证券发行机构重大事件等可能对估值产生重大影响的因素，向估值委员会提出估值建议，确保估值的公允性。金融工程部负责提供有关涉及模型的技术支持。监察稽核部负责定期对基金估值程序和方法进行核查，确保估值委员会的各项决策得以有效执行。以上所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。为保证基金估值的客观独立，基金经理不参与估值的具体流程，但若存在对相关投资品种估值有失公允的情况，可向估值委员会提出意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以维护基金持有人利益为准则。本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署

服务协议，由其按合同约定提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同中“基金的收益与分配”之“基金收益分配原则”的相关规定，本基金本报告期内未进行利润分配，符合合同规定。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金的管理人——广发基金管理有限公司在广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对广发基金管理有限公司编制和披露的广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金 2016 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资 产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	44,514,198.66	22,547,943.23
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	291,621,839.01	378,590,103.82
其中：股票投资		270,472,643.84	349,281,567.11
基金投资		21,149,195.17	29,308,536.71
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	11,459,596.64
应收利息	6.4.7.5	2,460.41	294.86
应收股利		-	-
应收申购款		9,220,434.56	738,250.31
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	988,200.00
资产总计		345,358,932.64	414,324,388.86
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
负 债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		1,213,446.16	3,449,770.08
应付管理人报酬		217,648.14	272,718.31
应付托管费		68,015.04	85,224.49
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	549,953.15	1,549,616.25
负债合计		2,049,062.49	5,357,329.13
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	440,210,994.71	404,557,252.06

未分配利润	6.4.7.1 0	-96,901,124.56	4,409,807.67
所有者权益合计		343,309,870.15	408,967,059.73
负债和所有者权益总计		345,358,932.64	414,324,388.86

注：报告截止日 2016 年 06 月 30 日，基金份额净值人民币 0.780 元，基金份额总额 440,210,994.71 份。

6.2 利润表

会计主体：广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 3 月 30 日（基 金合同生效日）至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		-90,264,776.31	30,653,727.21
1. 利息收入		23,617.71	348,794.95
其中：存款利息收入	6.4.7.1 1	23,617.71	348,794.95
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-2,890,039.93	13,025,824.92
其中：股票投资收益	6.4.7.1 2	-1,483,939.21	566,783.42
基金投资收益	6.4.7.1 3	-1,948,171.29	4,658,164.45
债券投资收益	6.4.7.1 4	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.1 5	-	-
股利收益	6.4.7.1 5	542,070.57	7,800,877.05
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.1 7	-88,066,191.19	22,857,400.19
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		624,432.39	-6,212,020.13
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.1 8	43,404.71	633,727.28
减：二、费用		2,011,024.32	3,357,526.24

1. 管理人报酬		1,318,857.92	1,882,496.67
2. 托管费		412,143.05	588,280.24
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.1 9	11,832.31	642,691.61
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.2 0	268,191.04	244,057.72
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-92,275,800.63	27,296,200.97
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-92,275,800.63	27,296,200.97

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	404,557,252.06	4,409,807.67	408,967,059.73
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-92,275,800.63	-92,275,800.63
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	35,653,742.65	-9,035,131.60	26,618,611.05
其中：1. 基金申购款	91,414,005.18	-18,637,768.15	72,776,237.03
2. 基金赎回款	-55,760,262.53	9,602,636.55	-46,157,625.98
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	440,210,994.71	-96,901,124.56	343,309,870.15
项目	上年度可比期间 2015 年 3 月 30 日（基金合同生效日）至 2015 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,051,001,960.92	-	1,051,001,960.92
二、本期经营活动产生的基	-	27,296,200.97	27,296,200.97

金净值变动数（本期利润）			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-421,405,050.67	-6,527,712.46	-427,932,763.13
其中：1. 基金申购款	80,304,555.75	956,061.95	81,260,617.70
2. 基金赎回款	-501,709,606.42	-7,483,774.41	-509,193,380.83
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	629,596,910.25	20,768,488.51	650,365,398.76

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：孙树明，主管会计工作负责人：窦刚，会计机构负责人：张晓章

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金（“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称中国证监会）证监许可[2015]99号《关于核准广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金注册的批复》核准，由广发基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》等有关规定和《广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金基金合同》（“基金合同”）发起，于2015年3月30日募集成立。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司，境外资产托管人为布朗兄弟哈里曼银行（Brown Brothers Harriman & Co.）。

本基金募集期为2015年3月6日至2015年3月24日，本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，募集资金总额为人民币1,051,001,960.92元，有效认购户数为19,045户。其中，认购款项在基金验资确认日之前产生的利息共计人民币122,012.43元，折合基金份额122,012.43份，按照基金合同的有关约定计入基金份额持有人的基金账户。本基金募集资金经德勤华永会计师事务所特殊普通合伙验资。

根据《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》和基金合同等有关规定，本基金的投资范围包括：纳斯达克生物科技指数成份股、备选成份股、以纳斯达克生物科技指数为投资标的的指数基金（包括ETF）等。本基金还可投资全球证券市场中具有良好流动性的其他金融工具，包括已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证

券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证(可简称“REITs”); 已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金; 与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品; 远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品; 银行存款、短期政府债券等货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种, 基金管理人在履行适当程序后, 可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为: $95% \times$ 人民币计价的纳斯达克生物科技指数收益率 $+5% \times$ 人民币活期存款收益率(税后)。

本基金的财务报表于 2016 年 8 月 22 日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制, 同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求, 真实、完整地反映了本基金 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年上半年度度的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》及其

他相关境内外税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1. 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不缴纳营业税。
2. 证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征营业税和增值税。
3. 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。
4. 基金取得的源自境外的收入，其涉及的境外所得税按照相关国家或地区税收法律和法规执行。

6.4.7重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
活期存款	44,514,198.66
定期存款	-
其他存款	-
合计	44,514,198.66

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	348,235,251.70	270,472,643.84	-77,762,607.86
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	33,414,247.51	21,149,195.17	-12,265,052.34
其他	-	-	-
合计	381,649,499.21	291,621,839.01	-90,027,660.20

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2016 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	2,460.41
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	-
合计	2,460.41

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

本基金本报告期末无应付交易费用。

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	5,041.39
预提费用	544,911.76
合计	549,953.15

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	404,557,252.06	404,557,252.06
本期申购	91,414,005.18	91,414,005.18
本期赎回（以“-”号填列）	-55,760,262.53	-55,760,262.53
本期末	440,210,994.71	440,210,994.71

注：本期申购含转换转入份（金）额，本期赎回含转换转出份（金）额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	17,647,036.89	-13,237,229.22	4,409,807.67
本期利润	-4,209,609.44	-88,066,191.19	-92,275,800.63
本期基金份额交易产生的变动数	1,182,787.15	-10,217,918.75	-9,035,131.60

其中：基金申购款	3,158,168.50	-21,795,936.65	-18,637,768.15
基金赎回款	-1,975,381.35	11,578,017.90	9,602,636.55
本期已分配利润	-	-	-
本期末	14,620,214.60	-111,521,339.16	-96,901,124.56

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2016年1月1日至2016年6月30日	
活期存款利息收入	23,617.71	
定期存款利息收入	-	
其他存款利息收入	-	
结算备付金利息收入	-	
其他	-	
合计	23,617.71	

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	
	2016年1月1日至2016年6月30日	
卖出股票成交总额	17,246,527.37	
减：卖出股票成本总额	18,730,466.58	
买卖股票差价收入	-1,483,939.21	

6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期	
	2016年1月1日至2016年6月30日	
卖出/赎回基金成交总额	3,156,046.19	
减：卖出/赎回基金成本总额	5,104,217.48	
基金投资收益	-1,948,171.29	

6.4.7.14 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	
	2016年1月1日至2016年6月30日	
股票投资产生的股利收益	542,070.57	
基金投资产生的股利收益	-	
合计	542,070.57	

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	-88,066,191.19
——股票投资	-76,385,506.62
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-11,680,684.57
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-88,066,191.19

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	43,194.98
基金转换费收入	209.73
合计	43,404.71

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	11,832.31
银行间市场交易费用	-
合计	11,832.31

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	19,890.78
信息披露费	149,179.94
银行汇划费	206.00
指数使用费	98,914.32
合计	268,191.04

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
广发基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人、注册登记与过户机构、直销机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
布朗兄弟哈里曼银行	基金境外资产托管人

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内无应支付关联方的佣金，本报告期末及上年度末无应付关联方佣金余额。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年3月30日（基金合同生效日）至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,318,857.92	1,882,496.67
其中：支付销售机构的客户维护费	531,386.96	730,490.82

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值 0.80% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金的管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金的管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年3月30日（基金合同生效日）至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	412,143.05	588,280.24

注：本基金托管费自基金合同生效日起，按如下方法进行计提。本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年3月30日（基金合同生效日）至2015年6月30日
基金合同生效日（2015年3月30日）持有的基金份额	-	10,000,200.02
期初持有的基金份额	10,000,200.02	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	10,000,200.02	10,000,200.02
期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.27%	1.59%

注：基金管理人上年度可比期间内持有本基金份额变动的相关费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
-------	----	---------

	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		2015 年 3 月 30 日（基金合同生效日） 至 2015 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	23,724,623.21	23,617.71	21,111,764.44	348,658.87
布朗兄弟哈里曼银行	20,789,575.45	-	3,704,347.99	-

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司和境外资产托管人布朗兄弟哈里曼银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

截至本报告期末 2016 年 06 月 30 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金无持有暂时停牌流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要是信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人奉行全面风险管理的理念，在董事会下设立合规及风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部对公司

总裁负责。

本基金管理人建立了以合规及风险管理委员会为核心的、由总裁和风险控制委员会、督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险指由于在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或所投资证券之发行人出现违约、无法支付到期本息，或由于债券发行人信用等级降低导致债券价格下降，将对基金资产造成的损失。为了防范信用风险，本基金主要投资于信用等级较高的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。但是，随着短期资金市场的发展，本基金的投资范围扩大以后，可能会在一定程度上增加信用风险。

本报告期末，本基金未持有债券投资。

6.4.13.3 流动性风险

开放式基金的流动性是指基金管理人为满足投资者赎回要求，在一定时间内将一定数量的基金资产按正常市场价格变现的能力。流动性风险指因市场交易量不足，导致不能以适当价格及时进行证券交易的风险，或基金无法应付基金赎回支付的要求所引起的违约风险。本基金坚持组合持有、分散投资的原则，在一定程度上减轻了投资变现压力。本基金所持大部分交易性金融资产在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。本基金所持有的其他金融负债以及可赎回基金份额净值(所有者权益)的合同约定到期日均为无固定期限且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人在对市场特征和发展形势等方面进行分析和判断的基础上，由投资决策委员会根据市场运行情况和基金运行情况制订本基金的风险控制目标和方法，由基金绩效评估与风险管理组具体计算与监控各类风险控制指标，从而对流动性风险进行监控。

6.4.13.4 市场风险

本基金的市场风险是指由于证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理等各种因素的影响，导致基金收益水平变化而产生的风险，反映了基金资产中金融工具或证券价值对市场参数变化的敏感性。一般来讲，市场风险是开放式基金面临的重大风险，也往往是众多风险中最基本和最常见的，也是最难防范的风险，其他如流动性风险最终是因为市场风险在起作用。市场风险包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的利率敏感性资产主要是债券投资。本基金管理人通过久期、凸性、风险价值模型(VAR)等方法来评估投资组合中债券的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	44,514,198.66	-	-	-	44,514,198.66
交易性金融资产	-	-	-	291,621,839.01	291,621,839.01
应收利息	-	-	-	2,460.41	2,460.41

应收申购款	871,075.43	-	-	8,349,359.13	9,220,434.56
资产总计	45,385,274.09	-	-	299,973,658.55	345,358,932.64
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,213,446.16	1,213,446.16
应付管理人报酬	-	-	-	217,648.14	217,648.14
应付托管费	-	-	-	68,015.04	68,015.04
其他负债	-	-	-	549,953.15	549,953.15
负债总计	-	-	-	2,049,062.49	2,049,062.49
利率敏感度缺口	45,385,274.09	-	-	297,924,596.06	343,309,870.15
上年度末 2015 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	22,547,943.23	-	-	-	22,547,943.23
交易性金融资产	-	-	-	378,590,103.82	378,590,103.82
应收利息	-	-	-	294.86	294.86
应收申购款	180,701.53	-	-	557,548.78	738,250.31
应收证券清算款	-	-	-	11,459,596.64	11,459,596.64
其他资产	-	-	-	988,200.00	988,200.00
资产总计	22,728,644.76	-	-	391,595,744.10	414,324,388.86
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,449,770.08	3,449,770.08
应付管理人报酬	-	-	-	272,718.31	272,718.31
应付托管费	-	-	-	85,224.49	85,224.49
其他负债	-	-	-	1,549,616.25	1,549,616.25
负债总计	-	-	-	5,357,329.13	5,357,329.13
利率敏感度缺口	22,728,644.76	-	-	386,238,414.97	408,967,059.73

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末未持有债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末			
	2016年6月30日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	25,107,972.30	-	-	25,107,972.30
交易性金融资产	291,621,839.01	-	-	291,621,839.01
应收利息	56.23	-	-	56.23
应收申购款	699,346.18	-	-	699,346.18
资产合计	317,429,213.72	-	-	317,429,213.72
以外币计价的负债				
应付赎回款	79,862.33	-	-	79,862.33
其他负债	1,284.80	-	-	1,284.80
负债合计	81,147.13	-	-	81,147.13
资产负债表 外汇风险敞 口净额	317,348,066.59	-	-	317,348,066.59
项目	上年度末			
	2015年12月31日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计

以外币计价的资产				
银行存款	20,716,814.88	-	-	20,716,814.88
交易性金融资产	378,590,103.82	-	-	378,590,103.82
应收利息	9.16	-	-	9.16
应收证券清算款	11,459,596.64	-	-	11,459,596.64
应收申购款	300,785.69	-	-	300,785.69
资产合计	411,067,310.19	-	-	411,067,310.19
以外币计价的负债				
应付赎回款	25,700.44	-	-	25,700.44
其他负债	975,100.28	-	-	975,100.28
负债合计	1,000,800.72	-	-	1,000,800.72
资产负债表外汇风险敞口净额	410,066,509.47	-	-	410,066,509.47

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末	上年度末
		2016年6月30日	2015年12月31日
	所有外币相对人民币升值 5%	15,867,403.33	20,503,325.47
	所有外币相对人民币贬值 5%	-15,867,403.33	-20,503,325.47

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金管理人通过采用 Barra 风险管理系统，通过标准差、跟踪误差、beta 值、风险价值模型 (VAR) 等指标监控投资组合面临的市场价格波动风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		上年度末 2015年12月31日	
	公允价值	占基金资	公允价值	占基金资

		产净值比 例 (%)		产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	270,472,643.84	78.78	349,281,567.11	85.41
交易性金融资产—基金投资	21,149,195.17	6.16	29,308,536.71	7.17
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	291,621,839.01	84.94	378,590,103.82	92.57

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末	上年度末
		2016年6月30日	2015年12月31日
	业绩比较基准上升 5%	13,250,384.93	19,179,374.66
	业绩比较基准下降 5%	-13,250,384.93	-19,179,374.66

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1. 公允价值

(1) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值接近于公允价值。

(2) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值确定公允价值计量层级。公允价值计量层级参见本基金最近一期年报。

(ii) 各层级金融工具公允价值

于 2016 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 291,621,839.01 元，无属于第二层级和第三层级的余额（2015 年 12 月 31 日，第一层级的余额为 378,590,103.82 元，无属于第二层级和第三层级的余额）。

(iii) 公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列

入第二层级或第三层级，上述事项解除时将相关证券的公允价值列入第一层级。

2. 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	270,472,643.84	78.32
	其中：普通股	262,658,021.85	76.05
	存托凭证	7,814,621.99	2.26
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	21,149,195.17	6.12
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	44,514,198.66	12.89
8	其他各项资产	9,222,894.97	2.67
9	合计	345,358,932.64	100.00

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
美国	270,472,643.84	78.78
合计	270,472,643.84	78.78

注：1、国家（地区）类别根据股票及存托凭证所在的证券交易所确定。

2、上述美国比重包括注册地为英国、法国在美国上市的 ADR。

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

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（%）
能源	-	-
材料	-	-
工业	-	-
非必须消费品	-	-
必须消费品	-	-
保健	270,472,643.84	78.78
金融	-	-
信息技术	-	-
电信服务	-	-
公共事业	-	-
合计	270,472,643.84	78.78

注：注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

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	AMGEN INC	安进	AMGN US	纳斯达 克证券 交易所	美国	22,913.00	23,117,775.31	6.73
2	CELGENE CORP	新基医药	CELG US	纳斯达 克证券 交易所	美国	32,333.00	21,146,921.93	6.16
3	GILEAD SCIENCES INC	吉利德科 学	GILD US	纳斯达 克证券 交易所	美国	37,365.00	20,669,372.81	6.02
4	BIOGEN INC	百健	BIIB US	纳斯达 克证券 交易所	美国	12,567.00	20,151,898.10	5.87
5	REGENERO N PHARMA CE UTICALS	再生元制 药股份有 限公司	REGN US	纳斯达 克证券 交易所	美国	8,163.00	18,903,989.49	5.51
6	VERTEX	维特制药	VRTX US	纳斯达	美国	19,067.00	10,876,118.52	3.17

	PHARMACE UTICALS INC	股份有限 公司		克证券 交易所				
7	MYLAN NV	迈兰公司	MYL US	纳斯达 克证券 交易所	美国	36,167.00	10,370,275.59	3.02
8	ILLUMINA INC	Illumina 公司	ILMN US	纳斯达 克证券 交易所	美国	10,850.00	10,100,133.24	2.94
9	ALEXION PHARMACE UTICALS INC	Alexion 制 药公司	ALXN US	纳斯达 克证券 交易所	美国	11,577.00	8,963,595.42	2.61
10	INCYTE CORP	Incyte 有 限公司	INCY US	纳斯达 克证券 交易所	美国	15,882.00	8,423,231.14	2.45
11	BIOMARIN PHARMACE UTICAL INC	BioMarin 制药股份 有限公司	BMRN US	纳斯达 克证券 交易所	美国	13,709.00	7,072,574.00	2.06
12	MEDIVATI ON INC	Medivatio n 股份有 限公司	MDVN US	纳斯达 克证券 交易所	美国	13,933.00	5,571,268.33	1.62
13	JAZZ PHARMACE UTICALS PLC	Jazz 医药 公司	JAZZ US	纳斯达 克证券 交易所	美国	5,191.00	4,864,251.84	1.42
14	SHIRE PLC-ADR	Shire 公司	SHPG US	纳斯达 克证券 交易所	美国	3,860.00	4,711,791.20	1.37
15	ALKERMES PLC	Alkermes 公共有限 公司	ALKS US	纳斯达 克证券 交易所	美国	12,789.00	3,665,333.33	1.07
16	SEATTLE GENETICS INC	Seattle Genetics 股份有限 公司	SGEN US	纳斯达 克证券 交易所	美国	11,872.00	3,181,301.75	0.93
17	QIAGEN N.V.	德国 QIAGEN 公 共有限公 司	QGEN US	纳斯达 克证券 交易所	美国	19,771.00	2,859,409.98	0.83
18	UNITED THERAPEU TICS CORP	联合治疗 公司	UTHR US	纳斯达 克证券 交易所	美国	3,848.00	2,702,745.56	0.79
19	ALNYLAM	Alnylam 制	ALNY US	纳斯达	美国	7,223.00	2,657,813.28	0.77

	PHARMACE UTICALS INC	药股份有 限公司		克证券 交易所				
20	BIO-TECH NE CORP	Bio-techn e 公司	TECH US	纳斯达 克证券 交易所	美国	3,155.00	2,359,310.34	0.69
21	JUNO THERAPEU TICS INC	朱诺疗法 股份有限 公司	JUNO US	纳斯达 克证券 交易所	美国	8,828.00	2,250,286.58	0.66
22	NEUROCRI NE BIOSCIEN CES INC	Neurocrin e 生物科学 股份有限 公司	NBIX US	纳斯达 克证券 交易所	美国	7,335.00	2,210,681.27	0.64
23	ACADIA PHARMACE UTICALS INC	ACADIA 制 药股份有 限公司	ACAD US	纳斯达 克证券 交易所	美国	9,556.00	2,056,917.07	0.60
24	INTERCEP T PHARMACE UTICALS IN	Intercept 制药公司	ICPT US	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,071.00	1,959,455.14	0.57
25	ENDO INTERNAT IONAL PLC	Endo 制药 控股有限 公司	ENDP US	纳斯达 克证券 交易所	美国	18,851.00	1,948,824.07	0.57
26	TESARO INC	Tesaro 股 份有限公 司	TSRO US	纳斯达 克证券 交易所	美国	3,418.00	1,905,030.37	0.55
27	AKORN INC	Akorn 股份 有限公司	AKRX US	纳斯达 克证券 交易所	美国	9,708.00	1,833,741.52	0.53
28	CHINA BIOLOGIC PRODUCTS INC	中国生物 制品股份 有限公司	CBPO US	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,256.00	1,590,545.84	0.46
29	IONIS PHARMACE UTICALS INC	Ionis 制药 股份有限 公司	IONS US	纳斯达 克证券 交易所	美国	10,236.00	1,580,854.47	0.46
30	HORIZON PHARMA PLC	Horizon 制 药公共有 限公司	HZNP US	纳斯达 克证券 交易所	美国	13,564.00	1,481,403.98	0.43
31	GRIFOLS SA-ADR	基立福公 司	GRFS US	纳斯达 克证券 交易所	美国	12,884.00	1,424,224.47	0.41

32	PRA HEALTH SCIENCES INC	PRA 保健科 技股份有 限公司	PRAH US	纳斯达 克证券 交易所	美国	5,114.00	1,416,163.32	0.41
33	LIGAND PHARMA CEUTICALS	Ligand 制 药股份有 限公司	LGND US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,762.00	1,393,571.48	0.41
34	KITE PHARMA INC	Kite 制药 公司	KITE US	纳斯达 克证券 交易所	美国	4,143.00	1,373,653.08	0.40
35	MEDICINE S COMPANY	Medicines 公司	MDCO US	纳斯达 克证券 交易所	美国	5,906.00	1,317,080.85	0.38
36	MYRIAD GENETICS INC	米利亚德 基因公司	MYGN US	纳斯达 克证券 交易所	美国	6,045.00	1,226,619.48	0.36
37	IMPAX LABORATO RIES INC	Impax Laborator ies 有限公 司	IPXL US	纳斯达 克证券 交易所	美国	6,159.00	1,177,053.78	0.34
38	INC RESEARCH HOLDINGS INC-A	INC Research 控股有限 公司	INCR US	纳斯达 克证券 交易所	美国	4,579.00	1,157,789.42	0.34
39	NOVAVAX INC	诺瓦瓦克 斯股份有 限公司	NVAX US	纳斯达 克证券 交易所	美国	22,932.00	1,105,524.75	0.32
40	ULTRAGEN YX PHARMA CEUTICAL IN	Ultrageny x 制药股份 有限公司	RARE US	纳斯达 克证券 交易所	美国	3,307.00	1,072,565.90	0.31
41	NEKTAR THERAPEU TICS	内克塔治 疗公司	NKTR US	纳斯达 克证券 交易所	美国	11,322.00	1,068,366.29	0.31
42	OPHTHOTE CH CORP	Ophthotec h 公司	OPHT US	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,991.00	1,012,124.90	0.29
43	EXELIXIS INC	Exelixis 股份有限 公司	EXEL US	纳斯达 克证券 交易所	美国	19,359.00	1,002,596.26	0.29
44	IRONWOOD PHARMA CEUTICALS INC	Ironwood 制药股份 有限公司	IRWD US	纳斯达 克证券 交易所	美国	10,813.00	937,518.92	0.27
45	BLUEBIRD	蓝鸟生物	BLUE US	纳斯达	美国	3,133.00	899,373.54	0.26

	BIO INC	公司		克证券 交易所				
46	AGIOS PHARMA CEUTICALS INC	Agios 制 药公 司	AGIO US	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美 国	3,211.00	892,061.19	0.26
47	RADIUS HEALTH INC	Radius 健 康公 司	RDUS US	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美 国	3,649.00	889,248.89	0.26
48	LEXICON PHARMA CEUTICALS INC	Lexicon 制 药股 份有 限公 司	LXRX US	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美 国	8,791.00	836,531.52	0.24
49	ARIAD PHARMA CEUTICALS INC	Ariad 制 药公 司	ARIA US	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美 国	16,134.00	790,639.70	0.23
50	GW PHARMA CEUTICALS -ADR	GW 制 药公 共 有 限 公 司	GWPH US	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美 国	1,298.00	788,170.24	0.23
51	SPARK THERAPEU TICS INC	火花治 疗股 份有 限公 司	ONCE US	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美 国	2,296.00	778,466.28	0.23
52	PORTOLA PHARMA CEUTICALS INC	Portola 制 药股 份有 限公 司	PTLA US	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美 国	4,782.00	748,365.40	0.22
53	ACCELERON PHARMA INC	Accelaron 制 药股 份有 限公 司	XLRN US	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美 国	3,147.00	709,107.77	0.21
54	PACIRA PHARMA CEUTICALS INC	Pacira 制 药股 份有 限公 司	PCRX US	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美 国	3,144.00	703,219.66	0.20
55	INNOVIVA INC	Innoviva 股 份有 限公 司	INVA US	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美 国	9,682.00	676,060.52	0.20
56	PROTHENA CORP PLC	Prothena 公 共 有 限 公 司	PRTA US	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美 国	2,913.00	675,311.33	0.20
57	DEPOMED INC	Depomed 股 份有 限公 司	DEPO US	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美 国	5,167.00	672,248.11	0.20
58	ACORDA	阿索尔达	ACOR US	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美 国	3,881.00	656,388.74	0.19

	THERAPEUTICS INC	医药股份有限公司		克证券交易所				
59	FIVE PRIME THERAPEUTICS INC	Five Prime Therapeutics 股份	FPRX US	纳斯达克证券交易所	美国	2,333.00	639,708.88	0.19
60	SERES THERAPEUTICS INC	Seres 医疗股份有限公司	MCRB US	纳斯达克证券交易所	美国	3,313.00	638,204.26	0.19
61	HALOZYME THERAPEUTICS INC	Halozyme Therapeutics 股份有	HALO US	纳斯达克证券交易所	美国	10,949.00	626,581.23	0.18
62	CONCORDIA INTERNATIONAL CORP	Concordia 国际公司	CXRX US	纳斯达克证券交易所	美国	4,327.00	618,051.58	0.18
63	ALDER BIOPHARMACEUTICALS INC	Alder 生物医药股份有限公司	ALDR US	纳斯达克证券交易所	美国	3,712.00	614,636.91	0.18
64	ACHILLION PHARMACEUTICALS	Achillion 制药股份有限公司	ACHN US	纳斯达克证券交易所	美国	11,592.00	599,577.19	0.17
65	FIBROGEN INC	FibroGen 有限公司	FGEN US	纳斯达克证券交易所	美国	5,266.00	573,035.55	0.17
66	SUPERNUS PHARMACEUTICALS INC	Supernus 制药股份有限公司	SUPN US	纳斯达克证券交易所	美国	4,151.00	560,706.89	0.16
67	SAGE THERAPEUTICS INC	Sage Therapeutics 公司	SAGE US	纳斯达克证券交易所	美国	2,717.00	542,851.32	0.16
68	MACROGENICS INC	MacroGenics 股份有限公司	MGNX US	纳斯达克证券交易所	美国	2,929.00	524,220.96	0.15
69	INSYS THERAPEUTICS INC	Insys Therapeutics 股份有限公司	INSY US	纳斯达克证券交易所	美国	6,067.00	520,595.49	0.15
70	REPLIGEN CORP	Repligen 公司	RGEN US	纳斯达克证券交易所	美国	2,802.00	508,365.83	0.15

71	DERMIRA INC	Dermira 股 份有限公 司	DERM US	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,538.00	492,277.08	0.14
72	LUMINEX CORP	Luminex 公 司	LMNX US	纳斯达 克证券 交易所	美国	3,660.00	490,985.98	0.14
73	SAREPTA THERAPEU TICS INC	Sarepta 治 疗股份有 限公司	SRPT US	纳斯达 克证券 交易所	美国	3,874.00	489,894.36	0.14
74	THERAVAN CE BIOPHARM A INC	Theravanc e 生物制药 股份有限 公司	TBPH US	纳斯达 克证券 交易所	美国	3,210.00	482,982.79	0.14
75	GENOMIC HEALTH INC	Genomic Health 股 份有限公 司	GHDX US	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,761.00	474,104.94	0.14
76	AMAG PHARMACE UTICALS INC	AMAG 制药 公司	AMAG US	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,948.00	467,606.76	0.14
77	RELYPSA INC	Relypsa 股 份有限公 司	RLYP US	纳斯达 克证券 交易所	美国	3,674.00	450,716.03	0.13
78	CEMPRA INC	Cempra 股 份有限公 司	CEMP US	纳斯达 克证券 交易所	美国	4,087.00	446,907.27	0.13
79	XENCOR INC	Xencor 股 份有限公 司	XNCR US	纳斯达 克证券 交易所	美国	3,434.00	432,431.56	0.13
80	DBV TECHNOLO GIES SA-SPON ADR	DBV 技术公 司	DBVT US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,997.00	431,970.56	0.13
81	MOMENTA PHARMACE UTICALS INC	Momenta 制 药股份有 限公司	MNTA US	纳斯达 克证券 交易所	美国	5,866.00	420,105.09	0.12
82	AMPHASTA R PHARMACE UTICALS IN	Amphastar 制药公司	AMPH US	纳斯达 克证券 交易所	美国	3,819.00	408,231.79	0.12
83	ADURO	Aduro	ADRO US	纳斯达	美国	5,364.00	402,293.95	0.12

	BIOTECH INC	Biotech 股 份有限公 司		克证券 交易所				
84	AMICUS THERAPEU TICS INC	Amicus Therapeut ics 股份有 限	FOLD US	纳斯达 克证券 交易所	美国	10,623.00	384,620.08	0.11
85	XBIOTECH INC	XBiotech 股份有限 公司	XBIT US	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,730.00	378,718.44	0.11
86	INOVIO PHARMACE UTICALS INC	Inovio 制 药股份有 限公司	INO US	纳斯达 克证券 交易所	美国	6,124.00	375,231.49	0.11
87	COHERUS BIOSCIEN CES INC	Coherus 生 物科学公 司	CHRS US	纳斯达 克证券 交易所	美国	3,317.00	371,507.21	0.11
88	RETROPHI N INC	Retrophin 股份有限 公司	RTRX US	纳斯达 克证券 交易所	美国	3,097.00	365,760.88	0.11
89	SCICLONE PHARMACE UTICALS INC	赛生医药 股份有限 公司	SCLN US	纳斯达 克证券 交易所	美国	4,189.00	362,781.94	0.11
90	ATARA BIOTHERA PEUTICS INC	Atara 生物 医药股份 有限公司	ATRA US	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,429.00	362,572.73	0.11
91	FOUNDATI ON MEDICINE INC	Foundatio n 医药股份 有限公司	FMI US	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,923.00	361,686.74	0.11
92	ANI PHARMACE UTICALS INC	ANI 制药股 份有限公 司	ANIP US	纳斯达 克证券 交易所	美国	971.00	359,419.13	0.10
93	MERRIMAC K PHARMACE UTICALS IN	Merrimack 制药股份 有限公司	MACK US	纳斯达 克证券 交易所	美国	9,846.00	351,917.39	0.10
94	INSMED INC	Insmmed 股 份有限公 司	INSM US	纳斯达 克证券 交易所	美国	5,248.00	343,133.30	0.10
95	EAGLE	Eagle 制药	EGRX US	纳斯达	美国	1,327.00	341,336.58	0.10

	PHARMACE UTICALS INC	股份有限 公司		克证券 交易所				
96	CERUS CORP	Cerus 公司	CERS US	纳斯达 克证券 交易所	美国	8,241.00	341,001.77	0.10
97	EPIZYME INC	Epizyme 股 份有限公 司	EPZM US	纳斯达 克证券 交易所	美国	4,841.00	328,720.79	0.10
98	PACIFIC BIOSCIEN CES OF CALIF	加州太平 洋生物科 学股份有 限公	PACB US	纳斯达 克证券 交易所	美国	6,786.00	316,570.24	0.09
99	BLUEPRIN T MEDICINE S CORP	Blueprint 医药股份 有限公司	BPMC US	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,299.00	308,713.86	0.09
100	CLOVIS ONCOLOGY INC	Clovis 肿 瘤学股份 有限公司	CLVS US	纳斯达 克证券 交易所	美国	3,254.00	296,049.13	0.09
101	PDL BIOPHARM A INC	PDL 生物制 药股份有 限公司	PDLI US	纳斯达 克证券 交易所	美国	13,938.00	290,216.59	0.08
102	ARRAY BIOPHARM A INC	Array BioPharma 股份有限 公司	ARRY US	纳斯达 克证券 交易所	美国	12,160.00	287,062.00	0.08
103	NANTKWES T INC	NantKwest 股份有限 公司	NK US	纳斯达 克证券 交易所	美国	6,891.00	284,226.63	0.08
104	MANNKIND CORP	MannKind 公司	MNKD US	纳斯达 克证券 交易所	美国	36,367.00	279,741.95	0.08
105	SUCAMPO PHARMACE UTICALS- CL A	Sucampo 制 药股份有 限公司	SCMP US	纳斯达 克证券 交易所	美国	3,845.00	279,701.70	0.08
106	SAGENT PHARMACE UTICALS INC	赛进制药 公司	SGNT US	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,782.00	276,351.02	0.08
107	VANDA PHARMACE UTICALS INC	Vanda 制药 股份有限 公司	VNDA US	纳斯达 克证券 交易所	美国	3,657.00	271,360.84	0.08

108	ALBANY MOLECULAR RESEARCH	Albany Molecular 研究股份 有限	AMRI US	纳斯达 克证券 交易所	美国	3,012.00	268,439.46	0.08
109	OTONOMY INC	Otonomy 股 份有限公 司	OTIC US	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,544.00	267,891.99	0.08
110	AERIE PHARMACE UTICALS INC	Aerie 制药 公司	AERI US	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,237.00	261,078.30	0.08
111	RAPTOR PHARMACE UTICAL CORP	Raptor 制 药公司	RPTP US	纳斯达 克证券 交易所	美国	7,232.00	257,528.22	0.08
112	SPECTRUM PHARMACE UTICALS INC	Spectrum 制药股份 有限公司	SPPI US	纳斯达 克证券 交易所	美国	5,784.00	251,991.44	0.07
113	XENOPORT INC	XenoPort 股份有限 公司	XNPT US	纳斯达 克证券 交易所	美国	5,383.00	251,298.08	0.07
114	CELLDEX THERAPEU TICS INC	Celldex 治 疗股份有 限公司	CLDX US	纳斯达 克证券 交易所	美国	8,374.00	243,775.25	0.07
115	FLAMEL TECHNOLO GIES-SP ADR	弗拉梅技 术有限公 司	FLML US	纳斯达 克证券 交易所	美国	3,414.00	243,141.97	0.07
116	SYNERGY PHARMACE UTICALS INC	协同制药 公司	SGYP US	纳斯达 克证券 交易所	美国	9,646.00	243,065.31	0.07
117	GERON CORP	桀能公司	GERN US	纳斯达 克证券 交易所	美国	13,423.00	238,548.40	0.07
118	ENANTA PHARMACE UTICALS INC	Enanta 制 药公司	ENTA US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,606.00	234,826.04	0.07
119	ARENA PHARMACE UTICALS INC	Arena 制药 股份有限 公司	ARNA US	纳斯达 克证券 交易所	美国	20,605.00	233,647.35	0.07
120	SANGAMO	桑加莫生	SGMO US	纳斯达	美国	5,970.00	229,216.05	0.07

	BIOSCIEN CES INC	物科学股 份有限公 司		克证券 交易所				
121	OMEROS CORP	Omeros 公 司	OMER US	纳斯达 克证券 交易所	美国	3,221.00	224,697.68	0.07
122	LION BIOTECHN OLOGIES INC	Lion 生物 技术公司	LBIO US	纳斯达 克证券 交易所	美国	4,058.00	217,966.22	0.06
123	AMARIN CORP PLC -ADR	Amarin 公 共有限公 司	AMRN US	纳斯达 克证券 交易所	美国	15,033.00	215,323.55	0.06
124	REVANCE THERAPEU TICS INC	Revance Therapeut ics 股份有 限	RVNC US	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,381.00	214,728.87	0.06
125	TELIGENT INC	Teligent 股份有限 公司	TLGT US	纳斯达 克证券 交易所	美国	4,486.00	212,397.60	0.06
126	ONCOMED PHARMACE UTICALS INC	OncoMed 制 药公司	OMED US	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,554.00	208,483.20	0.06
127	NEURODER M LTD	NeuroDerm 有限公司	NDRM US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,827.00	196,872.04	0.06
128	BELLICUM PHARMACE UTICALS INC	Bellicum 制药公司	BLCM US	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,248.00	193,193.91	0.06
129	COMPUGEN LTD	Compugen 有限公司	CGEN US	纳斯达 克证券 交易所	美国	4,281.00	183,955.32	0.05
130	NEWLINK GENETICS CORP	纽琳基因 公司	NLNK US	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,448.00	182,785.58	0.05
131	VERSARTI S INC	Versartis 股份有限 公司	VSAR US	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,491.00	182,692.61	0.05
132	ADAMAS PHARMACE UTICALS INC	Adamas 制 药股份有 限公司	ADMS US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,817.00	182,420.20	0.05
133	FLEXION	Flexion	FLXN US	纳斯达	美国	1,827.00	181,304.04	0.05

	THERAPEUTICS INC	Therapeutics 公司		克证券交易所				
134	TREVENA INC	Trevena 股份有限公司	TRVN US	纳斯达克证券交易所	美国	4,309.00	180,015.20	0.05
135	ARROWHEAD PHARMACEUTICALS INC	Arrowhead 制药股份有限公司	ARWR US	纳斯达克证券交易所	美国	5,059.00	178,471.32	0.05
136	ARDELYX INC	Ardelyx 公司	ARDX US	纳斯达克证券交易所	美国	2,934.00	169,850.36	0.05
137	PROGENICS PHARMACEUTICALS	Progenics 制药股份有限公司	PGNX US	纳斯达克证券交易所	美国	5,922.00	165,719.26	0.05
138	AKEBIA THERAPEUTICS INC	Akebia Therapeutics 股份有限公司	AKBA US	纳斯达克证券交易所	美国	3,199.00	158,674.80	0.05
139	COLLEGIUM PHARMACEUTICAL INC	Collegium 制药股份有限公司	COLL US	纳斯达克证券交易所	美国	1,993.00	156,609.38	0.05
140	IMMUNOGEN INC	英基公司	IMGN US	纳斯达克证券交易所	美国	7,386.00	150,852.37	0.04
141	APPLIED GENETIC TECHNOLOGIES	应用基因科技公司	AGTC US	纳斯达克证券交易所	美国	1,530.00	143,359.25	0.04
142	CONCERT PHARMACEUTICALS INC	Concert 制药股份有限公司	CNCE US	纳斯达克证券交易所	美国	1,874.00	139,553.74	0.04
143	NANOSTRING TECHNOLOGIES INC	NanoString 技术公司	NSTG US	纳斯达克证券交易所	美国	1,655.00	138,280.41	0.04
144	PTC THERAPEUTICS INC	PTC 治疗股份有限公司	PTCT US	纳斯达克证券交易所	美国	2,908.00	135,370.38	0.04
145	KARYOPHARMA	Karyophar	KPTI US	纳斯达克	美国	3,031.00	134,865.41	0.04

	RM THERAPEU TICS INC	m Therapeut ics 股份		克证券 交易所				
146	VITAE PHARMA CE UTICALS INC	Vitae 制 药公 司	VTAE US	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美国	1,855.00	132,726.45	0.04
147	ESPERION THERAPEU TICS INC	Esperion Therapeut ics 公 司	ESPR US	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美国	1,912.00	125,267.08	0.04
148	ARATANA THERAPEU TICS INC	Aratana Therapeut ics 股 份有 限	PETX US	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美国	2,970.00	124,470.28	0.04
149	IMMUNOME DICS INC	Immunomed ics 股 份有 限公 司	IMMU US	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美国	8,038.00	123,659.68	0.04
150	BIOCRYST PHARMA CE UTICALS INC	BioCrys 制 药股 份有 限公 司	BCRX US	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美国	6,247.00	117,647.30	0.03
151	CURIS INC	Curis 股 份有 限公 司	CRIS US	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美国	10,946.00	113,232.78	0.03
152	ZOGENIX INC	Zogenix 股 份有 限公 司	ZGNX US	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美国	2,101.00	112,153.82	0.03
153	CHEMOCEN TRYX INC	ChemoCent ryx 股 份有 限公 司	CCXI US	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美国	3,744.00	111,474.19	0.03
154	RIGEL PHARMA CE UTICALS INC	Rigel 制 药公 司	RIGL US	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美国	7,510.00	111,054.70	0.03
155	INOTEK PHARMA CE UTICALS CORP	Inotek 制 药公 司	ITEK US	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美国	2,241.00	110,562.26	0.03
156	FOAMIX PHARMA CE UTICALS LTD	Foamix 制 药有 限公 司	FOMX US	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美国	2,592.00	109,144.25	0.03
157	VITAL THERAPIE S INC	美国生 命治 疗公 司	VTL US	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美国	2,581.00	106,113.79	0.03

158	FLEX PHARMA INC	Flex 医药有限公司	FLKS US	纳斯达克证券交易所	美国	1,522.00	103,046.33	0.03
159	CHIMERIX INC	Chimerix 股份有限公司	CMRX US	纳斯达克证券交易所	美国	3,918.00	102,105.49	0.03
160	OSIRIS THERAPEUTICS INC	Osiris Therapeutics 股份有限公司	OSIR US	纳斯达克证券交易所	美国	2,923.00	98,659.46	0.03
161	UNIQUIRE NV	uniQure 股份有限公司	QURE US	纳斯达克证券交易所	美国	1,928.00	94,225.11	0.03
162	IMMUNE DESIGN CORP	Immune Design 公司	IMDZ US	纳斯达克证券交易所	美国	1,709.00	92,475.00	0.03
163	ZAFGEN INC	Zafgen 公司	ZFGN US	纳斯达克证券交易所	美国	2,311.00	91,794.97	0.03
164	TETRAPHASE PHARMACEUTICALS INC	Tetraphase 制药公司	TTPH US	纳斯达克证券交易所	美国	3,105.00	88,536.47	0.03
165	REGULUS THERAPEUTICS INC	Regulus Therapeutics 股份有限公司	RGLS US	纳斯达克证券交易所	美国	4,471.00	85,683.00	0.02
166	NEOS THERAPEUTICS INC	Neos 医疗股份有限公司	NEOS US	纳斯达克证券交易所	美国	1,353.00	83,260.29	0.02
167	DURECT CORPORATION	Durect 有限公司	DRRX US	纳斯达克证券交易所	美国	10,225.00	82,720.90	0.02
168	OVASCIENCE INC	Ovascience 股份有限公司	OVAS US	纳斯达克证券交易所	美国	2,316.00	80,014.45	0.02
169	ENDOCYTE INC	Endocyte 股份有限公司	ECYT US	纳斯达克证券交易所	美国	3,561.00	75,799.99	0.02
170	CARA THERAPEUTICS INC	Cara Therapeutics 公司	CARA US	纳斯达克证券交易所	美国	2,310.00	73,679.93	0.02
171	TOKAI PHARMACEUTICALS	东海制药公司	TKAI US	纳斯达克证券交易所	美国	1,916.00	70,006.64	0.02

	INC							
172	EGALET CORP	Egalet 公 司	EGLT US	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,125.00	69,892.85	0.02
173	ANTHERA PHARMA CEUTICALS INC	Anthera 制 药股份有 限公司	ANTH US	纳斯达 克证券 交易所	美国	3,383.00	69,319.05	0.02
174	ALCOBRA LTD	Alcobra 有 限公司	ADHD US	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,321.00	69,105.66	0.02
175	OCULAR THERAPEU TIX INC	Ocular Therapeut ix 股份有 限公	OCUL US	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,098.00	68,865.68	0.02
176	AQUINOX PHARMA CEUTICALS INC	Aquinox 制 药股份有 限公司	AQXP US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,460.00	64,091.87	0.02
177	SEQUENOM INC	西格诺股 份有限公 司	SQNM US	纳斯达 克证券 交易所	美国	10,060.00	60,952.80	0.02
178	CASCADIA N THERAPEU TICS INC	Cascadian Therapeut ics 股份有	CASC US	纳斯达 克证券 交易所	美国	8,054.00	50,368.80	0.01
179	AFFIMED NV	Affimed 公 司	AFMD US	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,822.00	46,408.85	0.01
180	ADVERUM BIOTECHN OLOGIES INC	Adverum 生 物技术公 司	ADVM US	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,185.00	45,785.78	0.01
181	CHIASMA INC	Chiasma 股 份有限公 司	CHMA US	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,031.00	38,922.43	0.01
182	ATYR PHARMA INC	aTyr 制药 股份有限 公司	LIFE US	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,006.00	36,980.08	0.01
183	INFINITY PHARMA CEUTICALS INC	英菲尼迪 制药股份 有限公司	INFI US	纳斯达 克证券 交易所	美国	4,186.00	36,918.41	0.01
184	OREXIGEN THERAPEU	Orexigen 治疗股份	OREX US	纳斯达 克证券	美国	12,349.00	35,212.14	0.01

	TICS INC	有限公司		交易所				
185	DICERNA PHARMACEUTICALS INC	Dicerna 制药公司	DRNA US	纳斯达克证券交易所	美国	1,747.00	34,754.12	0.01
186	PRONAI THERAPEUTICS INC	Pronai 医疗股份有限公司	DNAI US	纳斯达克证券交易所	美国	2,550.00	33,650.02	0.01
187	KEMPHARM INC	KemPharm 股份有限公司	KMPH US	纳斯达克证券交易所	美国	1,228.00	32,409.59	0.01
188	AEGERION PHARMACEUTICALS INC	Aegerion 制药股份有限公司	AEGR US	纳斯达克证券交易所	美国	2,455.00	24,256.60	0.01

注：本基金对以上证券代码采用当地市场代码。

7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	REGENERON PHARMACEUTICALS	REGN US	1,585,381.87	0.39
2	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	VRTX US	1,316,661.20	0.32
3	INCYTE CORP	INCY US	782,839.25	0.19
4	BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	BMRN US	746,199.01	0.18
5	JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	JAZZ US	417,799.54	0.10
6	MEDIVATION INC	MDVN US	412,947.63	0.10
7	SHIRE PLC-ADR	SHPG US	320,550.92	0.08
8	ACADIA PHARMACEUTICALS INC	ACAD US	319,012.64	0.08
9	ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	ALNY US	303,274.19	0.07
10	QIAGEN N. V.	QGEN US	297,805.30	0.07
11	ENDO INTERNATIONAL PLC	ENDP US	295,403.35	0.07
12	JUNO THERAPEUTICS INC	JUNO US	290,205.90	0.07
13	ALKERMES PLC	ALKS US	289,833.09	0.07

14	IONIS PHARMACEUTICALS INC	IONS US	281,461.50	0.07
15	SEATTLE GENETICS INC	SGEN US	280,973.04	0.07
16	UNITED THERAPEUTICS CORP	UTHR US	273,684.67	0.07
17	KITE PHARMA INC	KITE US	227,154.47	0.06
18	BIO-TECHNE CORP	TECH US	203,583.17	0.05
19	NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	NBIX US	193,635.77	0.05
20	INTERCEPT PHARMACEUTICALS IN	ICPT US	181,528.19	0.04

注：本项及下项 7.5.2、7.5.3 的买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，此外，“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出 金额	占期初基金 资产净值比例 （%）
1	CELGENE CORP	CELG US	4,240,760.75	1.04
2	BIOGEN INC	BIIB US	3,779,409.61	0.92
3	AMGEN INC	AMGN US	3,426,312.91	0.84
4	ANACOR PHARMACEUTICALS INC	ANAC US	2,505,359.25	0.61
5	GILEAD SCIENCES INC	GILD US	1,707,314.72	0.42
6	AFFYMETRIX INC	AFFX US	619,866.31	0.15
7	MYLAN NV	MYL US	360,470.86	0.09
8	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	ALXN US	321,704.89	0.08
9	ILLUMINA INC	ILMN US	285,643.39	0.07

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	16,307,049.93
卖出收入（成交）总额	17,246,842.69

7.6 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。

7.7 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。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。

7.9 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。

7.10 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

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	PROSHARES ULTRA NASD BIOTECH	EFT 基金	契约式 开放式 基金	ProShares Trust	21,149,195.17	6.16

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期末出现被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责和处罚的情况。

7.11.2 报告期内本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。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,460.41
5	应收申购款	9,220,434.56
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,222,894.97

7.11.4 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。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
14,157	31,094.93	22,354,046.17	5.08%	417,856,948.54	94.92%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	985,551.42	0.2239%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0

8.4 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	10,000,200 .02	2.27%	10,000,200 .02	2.27%	三年
基金管理人高级管理人员	494,589.84	0.11%	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,494,789 .86	2.38%	10,000,200 .02	2.27%	三年

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年3月30日）基金份额总额	1,051,001,960.92
本报告期期初基金份额总额	404,557,252.06
本报告期基金总申购份额	91,414,005.18
减：本报告期基金总赎回份额	55,760,262.53
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	440,210,994.71

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

自 2016 年 4 月 30 日起，王志伟不再担任本基金管理人的董事长。自 2016 年 5 月 26 日起，孙树明担任本基金管理人的新任董事长。自 2016 年 5 月 5 日起，本基金管理人聘任魏恒江为公司的副总经理。

相关事项已向中国证券投资基金业协会备案。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，涉及本基金管理人的诉讼事项有两起，分别是：

1、吴明芳诉平安银行股份有限公司义乌福田小微企业专营支行财产损害赔偿纠纷一案，我公司系本案第三人。原告认为银行未尽适当推介义务导致投资损失，请求银行赔偿损失。该案尚在浙江省义乌市人民法院审理中。

2、喇永强诉平安银行股份有限公司宁波慈溪支行和我公司合同纠纷一案，在浙江省慈溪市人民法院审理过程中，原告向法院申请撤回对我公司的起诉，经法院裁定准许后我公司不再参与该诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

2016 年 4 月 18 日，本基金管理人收到中国证监会关于责令整改的行政监管措施决定书（【2016】34 号）。中国证监会指出我司对火炬电子的跟踪研究报告未及时更新。我司高度重视该问题的整改，进一步梳理了股票入库的流程，并强化了研究报告的跟踪要求。

本报告期内本基金的基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚的情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
State Street Global Markets International Ltd.	-	30,428,667.04	100.00%	11,473.85	100.00%	-
Credit Suisse	-	-	-	-	-	-

Goldman Sachs Group Inc.	-	-	-	-	-	新增
--------------------------	---	---	---	---	---	----

注：1、为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

- i. 财务状况良好，经营状况稳定，信誉良好，符合监管标准；
- ii. 研究实力较强，分析报告质量高，准确及时，同时报告覆盖范围广泛；
- iii. 交易执行能力强，交易效率高，能保证较佳成交价格，及时反馈交易结果；
- iv. 清算和交割能力强，能确保流程顺畅以及结果准确；
- v. 能与服务匹配的合理的佣金和收费标准；
- vi. 经营行为规范，有健全的内部控制制度；
- vii. 具备高效、安全的通讯条件。

2、券商专用交易单元选择程序：

- i. 本基金管理人组织相关部门人员，根据经纪商选择原则与标准对交易单元候选经纪商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用的交易单元经纪商。
- ii. 本基金管理人与选用的交易单元经纪商签署交易单元租用协议，并通知基金托管人。
- iii. 本基金管理人定期对经纪商的服务进行评分，可根据结果调整交易分配比例以及更换经纪商。

3、此处股票交易含股票、存托凭证及信托凭证交易，佣金指基金通过单一券商进行股票、基金等交易而合计支付该券商的佣金合计。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
State Street Global Markets International Ltd.	-	-	-	-	-	-	11,781,606.70	100.00%

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	广发基金管理有限公司关于增加广州证券为	《中国证券报》、《证券时	2016-06-29

	广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金代销机构的公告	报》、《上海证券报》	
2	广发基金管理有限公司关于增加天津银行为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-06-27
3	广发基金管理有限公司关于增加苏宁基金为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-06-07
4	广发基金管理有限公司关于增加德州银行为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-06-06
5	广发基金管理有限公司关于增加富滇银行为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-05-24
6	广发基金管理有限公司关于增加大智慧财富为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-05-20
7	广发基金管理有限公司关于增加徽商银行为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-05-17
8	广发基金管理有限公司关于增加汇成基金为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-05-13
9	广发基金管理有限公司关于增加首创证券为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-05-05
10	广发基金管理有限公司关于广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金恢复申购业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-03-30
11	广发基金管理有限公司关于增加鼎信汇金为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-03-30
12	广发基金管理有限公司关于广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金暂停申购业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-03-22
13	广发基金管理有限公司关于增加北京增财基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-02-18
14	广发基金管理有限公司关于增加厦门鑫鼎盛为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-02-02
15	广发基金管理有限公司旗下 QDII 基金资产净值公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-01-04

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会准予广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金募集注册的文件
- (二) 《广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金基金合同》
- (三) 《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》
- (四) 《广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金托管协议》
- (五) 法律意见书
- (六) 基金管理人业务资格批件、营业执照

(七) 基金托管人业务资格批件、营业执照

11.2 存放地点

广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

11.3 查阅方式

1. 书面查阅：查阅时间为每工作日 8:30-11:30，13:30-17:00。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件；

2. 网站查阅：基金管理人网址：<http://www.gffunds.com.cn>。

投资者如对本报告有疑问，可咨询本基金管理人广发基金管理有限公司，咨询电话 95105828 或 020-83936999，或发电子邮件：services@gf-funds.com.cn。

广发基金管理有限公司

二〇一六年八月二十六日