

广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金

2021 年第 4 季度报告

2021 年 12 月 31 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：二〇二二年一月二十一日

§ 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 1 月 20 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 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	122,553,862.57 份
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	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。本基金对纳斯达克生物科技指数成份股、备选成份股及以纳斯达克生物科技指数为投资标的的指数基金（包括 ETF）的投资比例不低于基金资产净值的 90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。
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。
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
境外资产托管人英文名称	Brown Brothers Harriman & Co.
境外资产托管人中文名称	布朗兄弟哈里曼银行

§ 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 10 月 1 日-2021 年 12 月 31 日)
--------	---

1.本期已实现收益	3,207,720.28
2.本期利润	-10,574,674.45
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1048
4.期末基金资产净值	144,479,445.92
5.期末基金份额净值	1.179

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，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 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	-9.10%	1.37%	-8.14%	1.31%	-0.96%	0.06%
过去六个月	-10.14%	1.31%	-8.83%	1.31%	-1.31%	0.00%
过去一年	-4.46%	1.41%	-2.62%	1.40%	-1.84%	0.01%
过去三年	31.88%	1.54%	42.48%	1.58%	-10.60%	-0.04%
过去五年	40.86%	1.46%	54.48%	1.47%	-13.62%	-0.01%
自基金合同生效起至今	17.90%	1.56%	34.61%	1.55%	-16.71%	0.01%

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

广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金
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

(2015 年 3 月 30 日至 2021 年 12 月 31 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		
叶帅	本基金的基金 经理；广发道 琼斯美国石油 开发与生产指 数证券投资基 金(QDII-LOF) 的基金经理； 广发美国房地 产指数证券投 资基金的基金 经理；广发全 球医疗保健指 数证券投资基 金的基金经	2021-09- 16	-	5 年	叶帅先生，哲学博士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾先后任广发基金管理有限公司指数投资部研究员、投资经理。

	理；广发粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证稀有金属主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理				
--	--	--	--	--	--

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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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》等有关法律法规及基金合同、基金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。本报告期内基金运作合法合规，无损害基金持有人利益的行为，基金的投资管理符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

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，公司建立了严格的投资备选库制度及投资授权制度，投资组合的投资标的必须来源于公司备选库，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。金融工程与风险管理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

本报告期内，本公司旗下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% 的交易共有 1 次，为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

本报告期内，未发现本组合有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

美股市场 4 季度的表现主要围绕美联储货币政策和全球疫情变化波动，其中前者占据主导作用。季度初，能源价格的持续大涨驱动了通胀预期和利率预期的升温，但是美债实际利率反而下跌，同时美联储的紧缩预期没有跟上通胀预期飙升的幅度，而远期增长的偏弱预期也限制了长端利率的回升幅度；叠加美联储 Taper 延后至 2021 年 11 月，美股在 10 月份迎来了强势反弹。11 月初，美联储 FOMC 会议落幕，Taper 如期而至、节奏符合预期。值得关注的是，美联储表示未来缩减购债的节奏将视经济情况而灵活调整，同时维持“暂时性通胀”表述，加息为时尚早，缓解了市场的担忧。之后美股继续震荡上行，部分宽基指数创出历史新高。11 月下旬，新冠变异毒株 Omicron 突然爆发，其高突变程度和高传染性引发了市场恐慌，美股市场出现快速回调。但随着市场关注到 Omicron 导致的重症率和致死率未上升，且现有疫苗对重症依然具有保护作用，美股市场再次迎来反弹。

本基金主要采用完全复制法来跟踪纳斯达克生物科技指数，按照个股在标的指数中的基准权重构建股票组合，呈现出股票型指数基金的特征。纳斯达克生物科技指数由纳斯达克上市的生物科技和制药行业证券（依据 ICB 行业分类标准分类）组成，旨在反映该类公司的整体表现。

2021 年 4 季度，美股整体震荡上行，标普 500 指数涨幅为 10.65%，纳斯达克 100 指数涨幅为 11.10%，纳斯达克指数涨幅为 8.28%，道琼斯工业指数涨幅为 7.37%，纳斯达克生物科技指数跌幅为 7.00%。

本报告期内，本基金的份额净值增长率为-9.10%，同期业绩比较基准收益率为-8.14%。

§ 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	118,228,944.97	80.96
	其中：普通股	107,788,703.44	73.81
	存托凭证	10,440,241.53	7.15
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	11,760,537.67	8.05
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	15,507,563.82	10.62
8	其他资产	538,904.80	0.37
9	合计	146,035,951.26	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	118,228,944.97	81.83
合计	118,228,944.97	81.83

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）ADR、GDR 按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

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（%）
能源	-	-
原材料	-	-
工业	-	-
非日常生活消费品	-	-
日常消费品	-	-
医疗保健	118,228,944.97	81.83
金融	-	-
信息技术	-	-
通信服务	-	-
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	118,228,944.97	81.83

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

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

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	Amgen Inc	-	AMGN US	纳斯达克证券	美国	7,051.00	10,113,540.01	7.00

				交易所				
2	Gilead Sciences Inc	吉利德科学	GILD US	纳斯达克证券交易所	美国	19,048.00	8,818,073.06	6.10
3	Moderna Inc	莫德纳公司	MRNA US	纳斯达克证券交易所	美国	4,367.00	7,071,484.35	4.89
4	Regeneron Pharmaceuticals Inc	再生元制药股份有限公司	REGN US	纳斯达克证券交易所	美国	1,610.00	6,482,475.12	4.49
5	Illumina Inc	Illumina 公司	ILMN US	纳斯达克证券交易所	美国	2,377.00	5,765,583.00	3.99
6	Vertex Pharmaceuticals Inc	福泰制药	VRTX US	纳斯达克证	美国	3,910.00	5,474,405.55	3.79

				券交易所				
7	Biogen Inc	百健	BIIB US	纳斯达克证 券交易所	美国	2,216.0 0	3,389,722.0 0	2.35
8	Seagen Inc	Seagen 股 份有限公司	SGEN US	纳斯达克证 券交易所	美国	2,770.0 0	2,730,342.5 2	1.89
9	Horizon Therapeutics Plc	Horizon Therapeut ic 公共有 限公司	HZNP US	纳斯达克证 券交易所	美国	3,673.0 0	2,523,517.8 7	1.75
10	BioNTech SE	BioNTech 公司	BNT X US	纳斯达克证 券交易所	美国	1,346.0 0	2,212,360.2 5	1.53

注：此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

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

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

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	ProShares Ultra Nasdaq Biotechnology	ETF 基金	开放式	ProShare Advisors LLC	11,760,537.67	8.14

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

5.10.2 本报告期内，基金投资的前十名股票未出现超出基金合同规定的备选股票库的情形。

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	-

4	应收利息	569.20
5	应收申购款	466,612.57
6	其他应收款	-
7	待摊费用	71,723.03
8	其他	-
9	合计	538,904.80

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。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	79,695,653.81
报告期期间基金总申购份额	55,837,941.19
减：报告期期间基金总赎回份额	12,979,732.43
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	122,553,862.57

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人不存在运用固有资金（认）申购、赎回或买卖本基金的情况。

§ 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	-	-	10,000,200.02	8.16%	三年
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	-	-	10,000,200.02	8.16%	三年

§ 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
个人	1	20211123-20211130,20211202-20211231	-	28,664,350.76	-	28,664,350.76	23.39%

产品特有风险

报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：

- ① 当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；
- ② 在极端情况下，基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；
- ③ 当个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；
- ④ 在特定情况下，当个别投资者大额赎回，可能导致本基金资产规模和基金份额持有人数量未能满足合同约定，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；

⑤ 在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时，持有基金份额占比较高的投资者可能拥有较大话语权。
本基金管理人将对基金的大额申赎进行审慎评估并合理应对，完善流动性风险管控机制，切实保护持有人利益。

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1.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
- 2.《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》
- 3.《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》
- 4.《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》
- 5.法律意见书
- 6.基金管理人业务资格批件、营业执照
- 7.基金托管人业务资格批件、营业执照

10.2 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

10.3 查阅方式

- 1.书面查阅：投资者可在营业时间免费查阅，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>。

广发基金管理有限公司
二〇二二年一月二十一日