

# 广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金

## 2021 年年度报告

### 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

送出日期：二〇二二年三月三十日

## §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 2022 年 3 月 25 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。

本报告中财务资料已经审计。安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	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.....	6
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.....	7
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
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.....	14
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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
<b>§5 托管人报告</b> .....	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	16
<b>§6 审计报告</b> .....	17
6.1 审计意见.....	17
6.2 形成审计意见的基础.....	17
6.3 其他信息.....	17
6.4 管理层和治理层对财务报表的责任.....	17
6.5 注册会计师对财务报表审计的责任.....	18
<b>§7 年度财务报表</b> .....	19
7.1 资产负债表.....	19
7.2 利润表.....	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	22
7.4 报表附注.....	23
<b>§8 投资组合报告</b> .....	48
8.1 期末基金资产组合情况.....	48
8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	49
8.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	50

8.4 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 .....	50
8.5 报告期内权益投资组合的重大变动 .....	78
8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合 .....	79
8.7 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 .....	79
8.8 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 .....	79
8.9 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 .....	80
8.10 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 .....	80
8.11 投资组合报告附注 .....	80
<b>§9 基金份额持有人信息</b> .....	<b>81</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	81
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	81
9.3 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情况 .....	81
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	81
<b>§10 开放式基金份额变动</b> .....	<b>82</b>
<b>§11 重大事件揭示</b> .....	<b>82</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	82
11.2 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 .....	82
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	82
11.4 基金投资策略的改变 .....	82
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	82
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	83
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	83
11.8 其他重大事件 .....	84
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>85</b>
12.1 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 .....	85
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	86
<b>§13 备查文件目录</b> .....	<b>86</b>
13.1 备查文件目录 .....	86
13.2 存放地点 .....	86
13.3 查阅方式 .....	86

## §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	122,553,862.57 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	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。
--	--------------------------------------

### 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 负责人	姓名	程才良	郭明
	联系电话	020-83936666	010-66105799
	电子邮箱	ccl@gffunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95105828	95588
传真		020-89899158	010-66105798
注册地址		广东省珠海市横琴新区环岛东路3018号2608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	陈四清

### 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		-	140 Broadway New York, NY 10005
邮政编码		-	10005

### 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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.gffunds.com.cn

基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	中国 北京
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、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2021 年	2020 年	2019 年
本期已实现收益	6,708,693.84	12,636,206.01	6,530,129.98
本期利润	-5,153,947.23	12,321,538.67	42,021,466.13
加权平均基金份额本期利润	-0.0593	0.1191	0.2209
本期加权平均净值利润率	-4.71%	10.40%	22.28%
本期基金份额净值增长率	-4.46%	10.67%	24.72%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
期末可供分配利润	21,925,583.35	15,864,731.36	8,719,903.72
期末可供分配基金份额利润	0.1789	0.1946	0.0605
期末基金资产净值	144,479,445.92	100,586,395.99	160,633,254.41
期末基金份额净值	1.179	1.234	1.115
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末

基金份额累计净值增长率	17.90%	23.40%	11.49%
-------------	--------	--------	--------

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）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）。

### 3.2 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

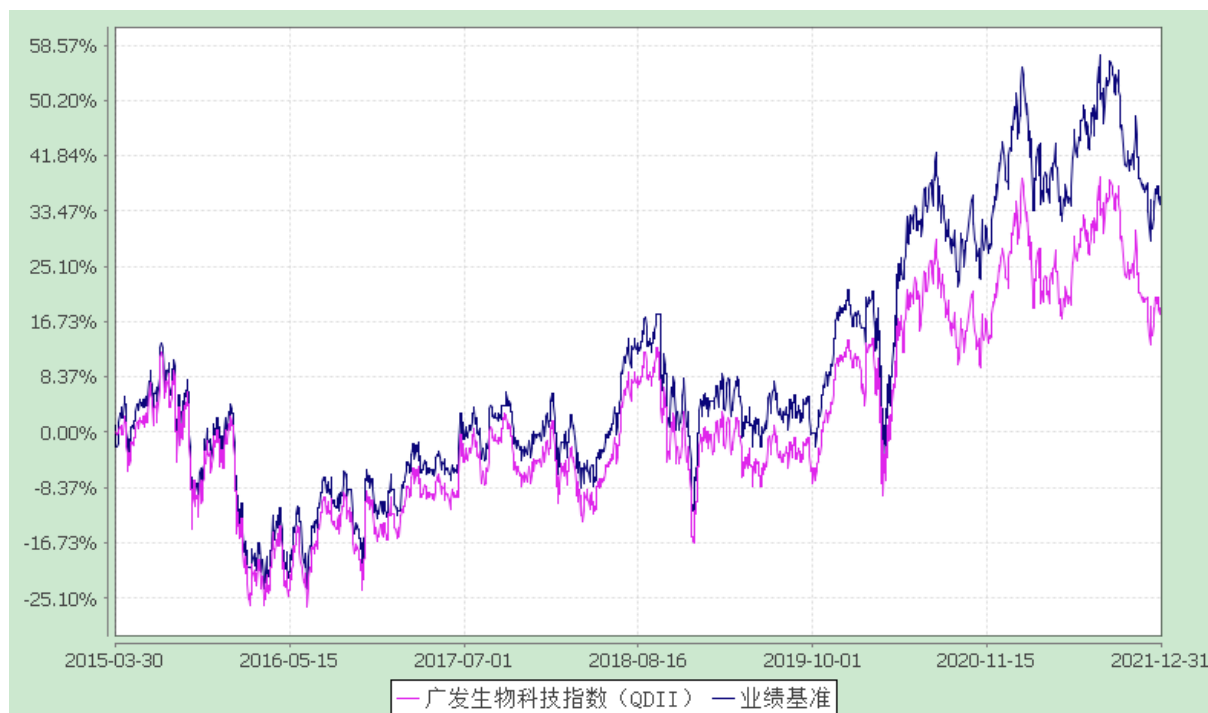
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-9.10%	1.37%	-8.14%	1.31%	-0.96%	0.06%
过去六个月	-10.14%	1.31%	-8.83%	1.31%	-1.31%	0.00%
过去一年	-4.46%	1.41%	-2.62%	1.40%	-1.84%	0.01%
过去三年	31.88%	1.54%	42.48%	1.58%	-10.60%	-0.04%
过去五年	40.86%	1.46%	54.48%	1.47%	-13.62%	-0.01%
自基金合同生效起至今	17.90%	1.56%	34.61%	1.55%	-16.71%	0.01%

注：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，由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照合同规定比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

#### 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

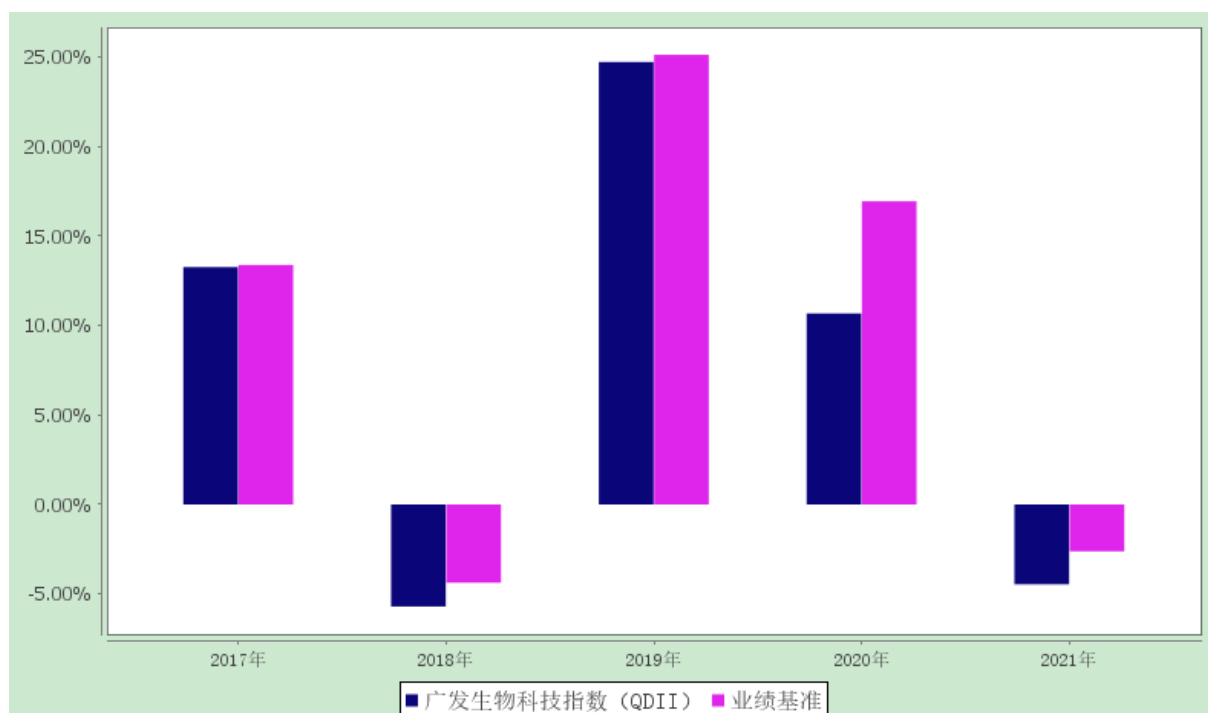
广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金  
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
 (2015年3月30日至2021年12月31日)





### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金  
过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

## §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

经中国证监会证监基金字[2003]91 号文批准，本基金管理人于 2003 年 8 月 5 日成立，总部设在广州，在北京、上海、广州、南京、成都、香港等地设有分公司或子公司。本基金管理人拥有公募基金管理、特定客户资产管理、基金投资顾问、社保基金境内投资管理人、基本养老保险基金证券投资管理机构、保险资金投资管理人、保险保障基金委托资产管理投资管理人、QDII 等业务资格，旗下产品覆盖主动权益、债券、货币、海外投资、被动投资、量化对冲、另类投资等不同类别，为境内外客户提供标准化和定制化的资产管理服务。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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		
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	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。

	投资基金的基金经理				
刘杰	<p>本基金的基金经理；广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理；广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 的基金经理；广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发创业板交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发创业板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；广发港股通恒生综合中型股指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理；广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发纳斯达克 100 指数证券投资基金</p>	2018-08-06	2021-09-16	18 年	<p>刘杰先生，工学学士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任广发基金管理有限公司信息技术部系统开发专员、数量投资部研究员、广发沪深 300 指数证券投资基金基金经理 (自 2014 年 4 月 1 日至 2016 年 1 月 17 日)、广发中证环保产业指数型发起式证券投资基金基金经理 (自 2016 年 1 月 25 日至 2018 年 4 月 25 日)、广发量化稳健混合型证券投资基金基金经理 (自 2017 年 8 月 4 日至 2018 年 11 月 30 日)、广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理 (自 2016 年 1 月 25 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理 (自 2016 年 1 月 25 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发中证养老产业指数型发起式证券投资基金基金经理 (自 2016 年 1 月 25 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金基金经理 (自 2016 年 8 月 30 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发中证军工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 (自 2016 年 9 月 26 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理 (自 2017 年 1 月 25 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金发</p>

	<p>的基金经理； 广发恒生中国企业精明指数型发起式证券投资基金(QDII)的基金经理；广发恒生科技指数证券投资基金(QDII)的基金经理；指数投资部总经理助理</p>			<p>起式联接基金基金经理(自2018年4月26日至2019年11月14日)、广发标普全球农业指数证券投资基金基金经理(自2018年8月6日至2020年2月28日)、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联接基金基金经理(自2020年5月21日至2021年7月2日)、广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金基金经理(自2018年8月6日至2021年9月16日)、广发全球医疗保健指数证券投资基金基金经理(自2018年8月6日至2021年9月16日)、广发美国房地产指数证券投资基金基金经理(自2018年8月6日至2021年9月16日)、广发道琼斯美国石油开发与生产指数证券投资基金(QDII-LOF)基金经理(自2018年8月6日至2021年9月16日)、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基金经理(自2019年12月16日至2021年9月16日)、广发中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自2019年9月20日至2021年11月17日)、广发中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(自2019年11月6日至2021年11月17日)。</p>
--	--	--	--	--

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》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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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。公司原则上禁止不同投资组合之间（完全复制指数组合及量化组合除外）或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易；对于不同投资组合的同时同向交易，公司可以启用公平交易模块，确保交易的公平。

公司金融工程与风险管理部对非公开发行股票申购和以公司名义进行的债券一级市场申购方案和分配过程进行审核和监控，保证分配结果符合公平交易的原则；对银行间债券交易根据市场公认的第三方信息，对投资组合和交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，并由相关投资组合经理对交易价格异常情况进行合理性解释；公司开发了专门的系统对不同投资组合同日、3 日内和 5 日内的股票同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析，发现异常情况再做进一步的调查和核实。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。在本年度本基金与公司其余各组合的同日、3 日内和 5 日内的同向交易价差专项分析中，未发现存在足够的样本量且差价率均值显著不趋于 0 的情况，表明报告期内本基金未发生可能导致不公平交易和利益输送的异常情况。

### 4.3.3 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 49 次，其中 41 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，其余 8 次为不同投资经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，有关投资经理按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

#### 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

2021 年，美股整体震荡上行，标普 500 指数上涨 26.89%，纳斯达克 100 指数上涨 26.63%，道琼斯工业指数上涨 18.73%、纳斯达克生物科技指数下跌 0.63%，道琼斯美国石油开发与生产指数上涨 71.63%，MSCI 美国 REIT 指数上涨 38.77%，标普全球 1200 医疗保健指数上涨 18.03%。

美股市场全年主要围绕奥密克戎新毒株、美联储货币政策以及龙头企业盈利情况进行演变。在新毒株奥密克戎出现初期，市场避险情绪突然加剧，但新毒株导致的重症率和致死率并未上升，且现有疫苗对重症依然具有保护作用，美股市场经历了一个 U 型反转。在疫情再度升级、美联储货币政策收紧等各种“不利因素”的衬托下，美股三季度表现大超预期，纳斯达克 100 指数三季度 EPS 同比增速为 48.4%，体现了美国头部上市公司盈利非周期性波动的结构性韧性，同时对成本和费用抬升有较好的消化能力，这也是 2021 年 10 月以来尽管面临各种通胀和货币收紧担忧，美国市场仍得以持续上行并创新高的核心动力。

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。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金的份额净值增长率为-4.46%，同期业绩比较基准收益率为-2.62%。

#### 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，为了控通胀，美联储加快了紧缩的节奏，市场对未来通胀将被可控的预期也做出反应。同时，美国非农就业发展强劲，劳动力参与率回升说明了美国经济的内生动能正在朝着疫情前的水平逐步恢复，驱动实际利率更快上行。疫情流感化、供应链问题逐步缓解，使得越来越多的宏观研究团队预期美国的核心 CPI、核心 PCE 等通胀指标将在 2022 年 1 季度见顶；根据高盛的通胀预测模型，2021 年 12 月 4.85% 的核心 PCE 和 5.49% 的核心 CPI 都已处在顶部区域，两者都或将于 2022

年 1 季度见顶，此后可能持续回落。另外，随着美国疫情逐渐流感化，美国的供给不畅问题也开始缓解，供应商配送时间等指标开始呈现高位回落的趋势。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本年度，公司严格按照法律法规和监管部门要求，稳步推进各项监察稽核工作。主要工作情况如下：

(1) 持续加强制度建设，开展内部制度修订完善工作，积极推进公司内部管理进一步精细化、规范化、科学化。

(2) 积极探索合规管理工作模式创新，强化合规考核，增强员工参与合规管理的主动性与积极性；制作并优化各类工作指引，积极防控各项操作风险。

(3) 加强运营管理薄弱环节检查力度，全年稽核检查范围覆盖投资、交易、销售、IT 等业务的各个运作环节，及时发现问题并推动解决。

(4) 扎实推进反洗钱日常工作，有序推进洗钱风险自评估工作，积极组织专项风险排查，认真开展可疑交易监测分析，丰富反洗钱宣传形式。

(5) 加强对专兼合规管理人员的工作指导，明确专兼合规管理人员日常合规管理职责，建立合规管理事项沟通机制并细化绩效考核方案，提高专兼合规管理人员履职积极性。

(6) 加强基金产品宣传推介活动管理，明确公司内部宣传推介材料合规口径，加强合规培训，提高合规意识，结合工作实际及时推出有针对性的管理措施。

(7) 持续完善信息披露与监管报送工作，不断完善信息披露或监管报送的系统功能建设，提高工作效率，按时、保质、保量完成各类信息披露与监管数据报送工作。

(8) 强化投资组合日常合规风险监控，大力推进统一风险监控平台建设，提升信息化管理水平，完善对合规风险的闭环监控；通过持续完善系统指标，实现对投资组合更精细化的风险管理。

本基金管理人承诺将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，积极健全内部管理制度，不断提高监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，切实保护基金资产的安全与利益。

#### 4.7 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、估值的公司领导、督察长、各投资部门负责人、研究发展部负责人、合规稽核部负责人、金融工程与风险管理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其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。合规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、中证指数有限公司签署服务协议，由其按合同约定提供相关债券品种的估值数据。

#### 4.8 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。

### 5.3 托管人对本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 2021 年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 审计报告

安永华明（2022）审字第 60873695\_G86 号

广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金全体基金份额持有人：

### 6.1 审计意见

我们审计了广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和净值变动情况。

### 6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

### 6.3 其他信息

广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

### 6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，管理层负责评估广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止

运营或别无其他现实的选择。

治理层负责监督广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金的财务报告过程。

## 6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金不能持续经营。

(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

赵雅 马婧

中国 北京

2022 年 3 月 25 日

## §7 年度财务报表

### 7.1 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：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		-	-
银行存款	7.4.7.1	15,507,563.82	14,260,750.18
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	129,989,482.64	90,547,197.45
其中：股票投资		118,228,944.97	85,682,585.40
基金投资		11,760,537.67	4,864,612.05
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	569.20	681.02
应收股利		-	381.71
应收申购款		466,612.57	583,870.44
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	71,723.03	25,104.47
资产总计		146,035,951.26	105,417,985.27
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>

		2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
<b>负债：</b>		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		594,552.71	3,482,056.41
应付赎回款		678,174.08	1,143,367.78
应付管理人报酬		97,157.08	65,838.86
应付托管费		30,361.59	20,574.66
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	-	-
应交税费		-	3,123.80
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	156,259.88	116,627.77
负债合计		1,556,505.34	4,831,589.28
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	7.4.7.9	122,553,862.57	81,514,594.67
未分配利润	7.4.7.10	21,925,583.35	19,071,801.32
所有者权益合计		144,479,445.92	100,586,395.99
负债和所有者权益总计		146,035,951.26	105,417,985.27

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值人民币 1.179 元，基金份额总额 122,553,862.57 份。

## 7.2 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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		<b>-3,632,691.84</b>	<b>13,795,869.36</b>
1.利息收入		13,578.29	20,530.76
其中：存款利息收入	7.4.7.11	13,578.29	20,530.76
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		8,239,950.91	14,598,038.43
其中：股票投资收益	7.4.7.12	6,796,063.26	13,558,789.62
基金投资收益	7.4.7.13	978,820.15	272,972.52
债券投资收益	7.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.14.3	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-	-
股利收益	7.4.7.17	465,067.50	766,276.29
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-11,862,641.07	-314,667.34
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-115,344.00	-576,640.09
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	91,764.03	68,607.60
<b>减：二、费用</b>		<b>1,521,255.39</b>	<b>1,474,330.69</b>
1. 管理人报酬		872,109.02	951,084.67
2. 托管费		272,534.23	297,213.96
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.20	48,544.34	51,276.03
5. 利息支出		-	-

其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		3,846.66	952.58
7. 其他费用	7.4.7.21	324,221.14	173,803.45
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-5,153,947.23</b>	<b>12,321,538.67</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-5,153,947.23</b>	<b>12,321,538.67</b>

### 7.3 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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 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）	81,514,594.67	19,071,801.32	100,586,395.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-5,153,947.23	-5,153,947.23
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）	41,039,267.90	8,007,729.26	49,046,997.16
其中：1.基金申购款	107,901,523.60	26,117,436.66	134,018,960.26
2.基金赎回款	-66,862,255.70	-18,109,707.40	-84,971,963.10
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	122,553,862.57	21,925,583.35	144,479,445.92

项目	上年度可比期间		
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 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）	144,014,710.07	16,618,544.34	160,633,254.41
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	12,321,538.67	12,321,538.67
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）	-62,500,115.40	-9,868,281.69	-72,368,397.09
其中：1.基金申购款	40,605,297.95	5,246,821.49	45,852,119.44
2.基金赎回款	-103,105,413.35	-15,115,103.18	-118,220,516.53
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）	81,514,594.67	19,071,801.32	100,586,395.99

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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（“中国证监会”）证监许可[2015]99 号文核准，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》、《公开募集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。

本基金的财务报表于 2022 年 3 月 25 日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

#### 7.4.2 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(以下简称“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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 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 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度,即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类



金融工具是指形成一个单位的金融资产（负债），并形成其他单位的金融负债（资产）或权益工具的合同。

#### （1）金融资产分类

金融资产应当在初始确认时划分以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、持有至到期投资、贷款和应收款项，以及可供出售金融资产。本基金根据持有意图和能力，将持有的股票投资、债券投资和衍生工具于初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产；其他金融资产划分为贷款和应收款项。

#### （2）金融负债分类

金融负债应当在初始确认时划分以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债两类。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

基金初始确认金融资产或金融负债，应当按照取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票投资、债券投资、基金投资等，以及不作为有效套期工具的衍生金融工具，相关的交易费用在发生时计入当期损益。对于本基金的其他金融资产和其他金融负债，相关交易费用在发生时计入初始确认金额。

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利等，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益。对于本基金的其他金融资产和其他金融负债，采用实际利率法，按摊余成本进行后续计量。

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，其中包括同时结转的公允价值变动收益。当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方（转入方）。本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产。本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，

终止确认该金融资产；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，按其估值日不加调整的报价确定公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不将该限制作为特征考虑。基金管理人不考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融工具公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配（未分配利润）已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配（未分配利润）。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或债券发行价计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按融出资金应付或实际支付的总额及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）：

卖出交易所上市债券：于成交日确认债券投资收益/（损失），并按成交金额与其成本、应收利息的差额入账；

卖出银行间同业市场交易债券：于成交日确认债券投资收益/（损失），并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 基金投资收益/（损失）于卖出/赎回基金成交日确认，并按卖出/赎回基金成交金额与其成本的差额入账；

(8) 衍生工具投资收益/（损失）于卖出衍生工具成交日确认，并按卖出衍生工具成交金额与其成本的差额入账；

(9) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除股票所在地使用的预缴所得税后的净额入账；基金投资在持有期间取得的红利于除息日确认；

(10) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(11) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致企业资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同，基金注册登记机构将以投资者最后一次选择的分红方式为准。

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。对于外币认购、申购的份额，由于汇率因素影响，存在收益分配后外币折算净值低于对应的基金份额面值的可能。

(4) 本基金同一类别每一基金份额享有同等分配权。

(5) 收益分配币种与其对应份额的认购/申购币种相同。美元收益分配金额按除权前一日中国人民银行最新公布的人民币对美元汇率中间价折算为相应的美元金额。

(6) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，折算后记账本位币金额与原记账本位币金额的差额作为公允价值变动处理，直接计入当期损益。

#### 7.4.4.13 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策及计量基础一致。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 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。

#### 7.4.5.2 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。

#### 7.4.5.3 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。

### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。金融商品转让，按照卖出价扣除买入价后的余额为销售额。对证券投资基金（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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3% 和 2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂免征增值税和企业所得税；

基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂未征收个人所得税和企业所得税。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	15,507,563.82	14,260,750.18
定期存款	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-

存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计	15,507,563.82	14,260,750.18

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末		
		2021 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		115,352,364.32	118,228,944.97	2,876,580.65
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		12,443,870.72	11,760,537.67	-683,333.05
其他		-	-	-
合计		127,796,235.04	129,989,482.64	2,193,247.60
项目		上年度末		
		2020 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		72,205,779.48	85,682,585.40	13,476,805.92
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-

资产支持证券	-	-	-
基金	4,285,529.30	4,864,612.05	579,082.75
其他	-	-	-
合计	76,491,308.78	90,547,197.45	14,055,888.67

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融工具。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末无买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	569.20	681.02
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	-	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	-	-
合计	569.20	681.02



#### 7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
其他应收款	-	-
待摊费用	71,723.03	25,104.47
合计	71,723.03	25,104.47

#### 7.4.7.7 应付交易费用

本基金本报告期末及上年度末无应付交易费用。

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	2,259.88	2,627.77
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	154,000.00	114,000.00
合计	156,259.88	116,627.77

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	81,514,594.67	81,514,594.67
本期申购	107,901,523.60	107,901,523.60
本期赎回（以“-”号填列）	-66,862,255.70	-66,862,255.70
本期末	122,553,862.57	122,553,862.57

注：申购含转换转入、红利再投资份（金）额，赎回含转换转出份（金）额。

#### 7.4.7.10 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	15,864,731.36	3,207,069.96	19,071,801.32
本期利润	6,708,693.84	-11,862,641.07	-5,153,947.23
本期基金份额交易产生的变动数	9,851,302.44	-1,843,573.18	8,007,729.26
其中：基金申购款	24,851,806.30	1,265,630.36	26,117,436.66
基金赎回款	-15,000,503.86	-3,109,203.54	-18,109,707.40
本期已分配利润	-	-	-
本期末	32,424,727.64	-10,499,144.29	21,925,583.35

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	13,577.90	20,529.74
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	0.39	1.02
合计	13,578.29	20,530.76

#### 7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	31,668,658.16	107,693,546.76
减：卖出股票成本总额	24,872,594.90	94,134,757.14
买卖股票差价收入	6,796,063.26	13,558,789.62

### 7.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
卖出/赎回基金成交总额	9,124,411.64	3,059,309.47
减：卖出/赎回基金成本总额	8,145,591.49	2,786,336.95
基金投资收益	978,820.15	272,972.52

### 7.4.7.14 债券投资收益

#### 7.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期内及上年度可比期间内无债券投资收益。

#### 7.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间内无买卖债券差价收入。

#### 7.4.7.14.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间内无资产支持证券投资收益。

### 7.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间内无贵金属投资收益。

### 7.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期内及上年度可比期间内无衍生工具收益。

### 7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	465,067.50	766,276.29
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-

合计	465,067.50	766,276.29
----	------------	------------

#### 7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
1.交易性金融资产	-11,862,641.07	-314,667.34
——股票投资	-10,600,225.27	-762,574.31
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-1,262,415.80	447,906.97
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-11,862,641.07	-314,667.34

#### 7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
基金赎回费收入	91,405.63	68,354.59
基金转换费收入	358.40	253.01
合计	91,764.03	68,607.60

#### 7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日

交易所市场交易费用	48,544.34	51,276.03
银行间市场交易费用	-	-
合计	48,544.34	51,276.03

#### 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31 日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
审计费用	34,000.00	34,000.00
信息披露费	120,000.00	80,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	260.00	270.00
指数使用费	168,547.99	58,169.58
其他	1,413.15	1,363.87
合计	324,221.14	173,803.45

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 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。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
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
布朗兄弟哈里曼银行	基金境外资产托管人
广发证券股份有限公司	基金管理人控股股东、代销机构
深圳市前海香江金融控股集团有限公司	基金管理人股东
烽火通信科技股份有限公司	基金管理人股东
广州科技金融创新投资控股有限公司	基金管理人股东
嘉裕元（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东

嘉裕祥（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
嘉裕禾（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
嘉裕泓（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
嘉裕富（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
GF International Investment Management Limited（广发国际资产管理有限公司）	基金管理人全资子公司
瑞元资本管理有限公司	基金管理人全资子公司
珠海瑞元祥和股权投资基金合伙企业（有限合伙）	基金管理人全资子公司（瑞元资本管理有限公司）的控股子公司
GF International Asset Management (UK) Company Limited（广发国际资产管理（英国）有限公司）	基金管理人全资子公司（GF International Investment Management Limited）的全资子公司

注：根据广发基金管理有限公司于 2021 年 11 月 4 日签订的股权转让协议，广发基金管理有限公司收购子公司瑞元资本管理有限公司 46.61% 的股权，并于 2021 年 12 月 7 日完成变更登记。广发基金管理有限公司完成收购后，瑞元资本管理有限公司成为广发基金管理有限公司的全资子公司。珠海瑞元祥和股权投资基金合伙企业（有限合伙）于 2021 年 12 月 21 日向横琴粤澳深度合作区商事服务局申请注销登记，并于 2022 年 1 月 26 日完成注销登记。根据 UK Companies House 于 2021 年 11 月 29 日出具的 Notice of final account prior to dissolution in MVL（停业报告），GF International Asset Management (UK) Company Limited（广发国际资产管理（英国）有限公司）已于 2021 年 11 月 29 日停业。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间内无应支付关联方的佣金，本报告期末及上年度可比期间末无应付关联方佣金余额。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	872,109.02	951,084.67
其中：支付销售机构的客户维护费	300,578.16	359,985.60

注：基金的管理费包含基金管理人的管理费和境外投资顾问的投资顾问费（如有）两部分，其中境外投资顾问的投资顾问费在境外投资顾问与基金管理人签订的《顾问协议》中进行约定。

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。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	272,534.23	297,213.96

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。

### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

#### 7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

#### 7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

#### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

#### 7.4.10.5.2 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。

### 7.4.10.6 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	
	2021年1月1日至2021年12月31日		2020年1月1日至2020年12月31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	9,483,903.45	13,577.90	11,864,916.13	12,245.61
布朗兄弟哈里曼银行	6,023,660.37	-	2,395,834.05	8,284.13

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。

### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销的证券。

### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。



#### 7.4.12 期末（2021 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 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 2021 年 12 月 31 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。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
INSY Q US	INSYS THER APEU TICS INC	2020-02 -19	重大事项停牌	0.27	-	-	2,656.00	442,882.65	711.21	-
AKA OQ US	ACHA OGEN INC	2021-06 -21	重大事项停牌	0.16	-	-	1,615.00	114,806.61	257.45	-
SGYP Q US	SYNE RGY PHAR MACE UTICA LS INC	2019-05 -02	重大事项停牌	0.02	-	-	9,201.00	238,281.99	193.57	-
PDLI US	PDL BIOPH ARMA INC	2020-12 -31	重大事项停牌	15.75	-	-	1,393.00	54,611.56	21,936.93	-

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 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。

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 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。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 7.4.13 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。

##### 7.4.13.1 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合规稽核部、金融工程与风险管理部负责，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。合规稽核部、金融工程与风险管理部对公司总经理负责。本基金管理人建立了以合规及风险管理委员会为核心的、由总经理和风险控制委员会、督察长、合规稽核部、金融工程与风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

##### 7.4.13.2 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。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金在境外交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，在境内交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险小。在场外市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。本基金管理人认为与应收证券清算款相关的信用风险不重大。本基金本报告期末及上年度末未持有债券、资产支持证券、同业存单，因此无相关重大信用风险。

##### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险指因市场交易不活跃，基金资产无法以适当价格及时变现的风险或基金无法应付基金赎回支付的要求所引起的风险。本基金坚持组合持有、分散投资的原则，基金管理人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，具体计算与分析各类风险控制指标，从而对流动性风险进行监控和防范。

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，除在附注 7.4.12 中列示的流通暂时受限的证券外，本基金所持大部分投资品种均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，资产变现能力强。本基金持有的其他资产主要为银行存款等期限短、流动性强的品种。本基金的负债水平也严格按照基金合同及中国证监会相关规定进行管理，因此无重大流动性风险。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金投资标的为具有良好流动性的金融工具，主要投资品种均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，本身具有较好的流动性；在投资限制中采取多种措施保障本基金分散投资；同时，本基金投资策略成熟，能够支持不同市场情形下的投资者赎回要求。实际投资中，本基金投资组合的流动性能够与本基金申购和赎回的安排相匹配。

综上所述，本基金的流动性良好，无重大流动性风险。

#### 7.4.13.4 市场风险

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。

##### 7.4.13.4.1 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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 12 月 31	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

日					
资产					
银行存款	15,507,563.82	-	-	-	15,507,563.82
交易性金融资产	-	-	-	129,989,482.64	129,989,482.64
应收利息	-	-	-	569.20	569.20
应收申购款	17,953.40	-	-	448,659.17	466,612.57
其他资产	-	-	-	71,723.03	71,723.03
资产总计	15,525,517.22	-	-	130,510,434.04	146,035,951.26
负债					
应付证券清算款	-	-	-	594,552.71	594,552.71
应付赎回款	-	-	-	678,174.08	678,174.08
应付管理人报酬	-	-	-	97,157.08	97,157.08
应付托管费	-	-	-	30,361.59	30,361.59
其他负债	-	-	-	156,259.88	156,259.88
负债总计	-	-	-	1,556,505.34	1,556,505.34
利率敏感度缺口	15,525,517.22	-	-	128,953,928.70	144,479,445.92
<b>上年度末 2020 年 12 月 31 日</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
资产					
银行存款	14,260,750.18	-	-	-	14,260,750.18
交易性金融资产	-	-	-	90,547,197.45	90,547,197.45
应收利息	-	-	-	681.02	681.02
应收股利	-	-	-	381.71	381.71
应收申购款	8,980.00	-	-	574,890.44	583,870.44
其他资产	-	-	-	25,104.47	25,104.47
资产总计	14,269,730.18	-	-	91,148,255.09	105,417,985.27
负债					
应付证券清算款	-	-	-	3,482,056.41	3,482,056.41
应付赎回款	-	-	-	1,143,367.78	1,143,367.78
应付管理人报酬	-	-	-	65,838.86	65,838.86
应付托管费	-	-	-	20,574.66	20,574.66

应交税费	-	-	-	3,123.80	3,123.80
其他负债	-	-	-	116,627.77	116,627.77
负债总计	-	-	-	4,831,589.28	4,831,589.28
利率敏感度缺口	14,269,730.18	-	-	86,316,665.81	100,586,395.99

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。

#### 7.4.13.4.1.2 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资产（不含可转债、可交换债），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.13.4.2 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。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	
	美元 折合人民币	合计
以外币计价的资产		
银行存款	11,055,693.77	11,055,693.77
交易性金融资产	129,989,482.64	129,989,482.64
应收利息	15.05	15.05
应收申购款	15,423.58	15,423.58
<b>资产合计</b>	<b>141,060,615.04</b>	<b>141,060,615.04</b>
以外币计价的负债		
应付证券清算款	594,552.71	594,552.71

应付赎回款	263.64	263.64
其他负债	0.89	0.89
<b>负债合计</b>	<b>594,817.24</b>	<b>594,817.24</b>
<b>资产负债表 外汇风险敞 口净额</b>	<b>140,465,797.80</b>	<b>140,465,797.80</b>
项目	上年度末 2020年12月31日	
	美元 折合人民币	合计
以外币计价的资产		
银行存款	6,399,941.05	6,399,941.05
交易性金融资产	90,547,197.45	90,547,197.45
应收利息	11.16	11.16
应收股利	381.71	381.71
应收申购款	192,923.15	192,923.15
<b>资产合计</b>	<b>97,140,454.52</b>	<b>97,140,454.52</b>
以外币计价的负债		
应付证券清算款	3,482,056.41	3,482,056.41
应付赎回款	211,046.91	211,046.91
其他负债	75.30	75.30
<b>负债合计</b>	<b>3,693,178.62</b>	<b>3,693,178.62</b>
<b>资产负债表 外汇风险敞 口净额</b>	<b>93,447,275.90</b>	<b>93,447,275.90</b>

#### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变	
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 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	所有外币相对人民币升值 5%	7,023,289.89	4,672,363.80
	所有外币相对人民币贬值 5%	-7,023,289.89	-4,672,363.80

#### 7.4.13.4.3 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，以及标准差、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。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	118,228,944.97	81.83	85,682,585.40	85.18
交易性金融资产—基金投资	11,760,537.67	8.14	4,864,612.05	4.84
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	129,989,482.64	89.97	90,547,197.45	90.02

##### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
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

		2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
	上升 5%	7,471,130.25	4,531,906.26
	下降 5%	-7,471,130.25	-4,531,906.26

#### 7.4.14 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

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

###### (ii) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 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次的余额为人民币 129,966,383.48 元，属于第二层次的余额为人民币 23,099.16 元，无属于第三层次的金额（2020 年 12 月 31 日：属于第一层次的余额为人民币 90,523,821.21 元，属于第二层次的余额为人民币 23,376.24 元，无属于第三层次的金额）。

###### (iii) 公允价值所属层次间的重大变动

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次或第三层次，上述事项解除时将相关证券的公允价值列入第一层次。

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。

## §8 投资组合报告

### 8.1 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	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	-	-
	房地产信托凭证	-	-
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	其他各项资产	538,904.80	0.37
9	合计	146,035,951.26	100.00

## 8.2 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	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。

### 8.3 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	-	-
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。

### 8.4 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	-	AMGN US	纳斯达 克证券 交易所	美国	7,051.00	10,113,540.01	7.00
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	Regenero n Pharmace uticals 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	美国	2,377.00	5,765,583.00	3.99

				交易所				
6	Vertex Pharmaceuticals Inc	福泰制药	VRTX US	纳斯达克证券交易所	美国	3,910.00	5,474,405.55	3.79
7	Biogen Inc	百健	BIIB US	纳斯达克证券交易所	美国	2,216.00	3,389,722.00	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	2,770.00	2,730,342.52	1.89
9	Horizon Therapeutics Plc	Horizon Therapeutic 公共有限公司	HZNP US	纳斯达克证券交易所	美国	3,673.00	2,523,517.87	1.75
10	BioNTech SE	BioNTech 公司	BNTX US	纳斯达克证券交易所	美国	1,346.00	2,212,360.25	1.53
11	Alnylam Pharmaceuticals Inc	Alnylam 制药股份有限公司	ALNY US	纳斯达克证券交易所	美国	1,916.00	2,071,562.35	1.43
12	AstraZeneca PLC	阿斯利康公共有限公司	AZN US	纳斯达克证券交易所	美国	5,083.00	1,887,747.54	1.31
13	Royalty Pharma PLC	Royalty Pharma 公司	RPRX US	纳斯达克证券交易所	美国	7,195.00	1,828,045.49	1.27
14	BioMarin Pharmaceutical Inc	拜玛林制药	BMRN US	纳斯达克证券交易所	美国	2,877.00	1,620,594.23	1.12
15	Incyte Corp	因赛特公司	INCY US	纳斯达克证券交易所	美国	3,320.00	1,553,681.58	1.08
16	BeiGene Ltd	百济神州	BGNE US	纳斯达克证券交易所	美国	758.00	1,309,345.25	0.91
17	Sanofi	赛诺菲	SNY US	纳斯达克证券交易所	美国	3,807.00	1,216,041.72	0.84
18	Viatis Inc	-	VTRS US	纳斯达克证券交易所	美国	12,590.00	1,086,053.95	0.75
19	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	1,190.00	1,085,483.96	0.75

20	Syneos Health Inc	Syneos 健康公司	SYNH US	纳斯达克证券交易所	美国	1,642.00	1,074,946.59	0.74
21	Argenx SE	Argenx 公司	ARGX US	纳斯达克证券交易所	美国	468.00	1,044,906.59	0.72
22	United Therapeutics Corp	联合治疗公司	UTHR US	纳斯达克证券交易所	美国	732.00	1,008,448.04	0.70
23	Guardant Health Inc	-	GH US	纳斯达克证券交易所	美国	1,530.00	975,677.20	0.68
24	Jazz Pharmaceuticals PLC	爵士制药公司	JAZZ US	纳斯达克证券交易所	美国	1,063.00	863,436.82	0.60
25	Neurocrine Biosciences Inc	Neurocrine 生物科学股份有限公司	NBIX US	纳斯达克证券交易所	美国	1,584.00	860,141.10	0.60
26	Intellia Therapeutics Inc	Intellia Therapeutics 股份有限公司	NTLA US	纳斯达克证券交易所	美国	1,090.00	821,710.42	0.57
27	Medpace Holdings Inc	Medpace 控股股份有限公司	MEDP US	纳斯达克证券交易所	美国	579.00	803,424.65	0.56
28	Mirati Therapeutics Inc	Mirati 治疗公司	MRTX US	纳斯达克证券交易所	美国	834.00	779,999.70	0.54
29	Ascendis Pharma A/S	Ascendis 制药股份有限公司	ASND US	纳斯达克证券交易所	美国	878.00	753,080.72	0.52
30	Sarepta Therapeutics Inc	Sarepta 治疗股份有限公司	SRPT US	纳斯达克证券交易所	美国	1,296.00	744,074.79	0.52
31	Blueprint Medicines Corp	Blueprint 医药股份有限公司	BPMC US	纳斯达克证券交易所	美国	1,049.00	716,363.39	0.50
32	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	1,658.00	700,851.37	0.49
33	Halozyne Therapeutics	Halozyne Therapeutic	HALO US	纳斯达克证券交易所	美国	2,546.00	652,710.12	0.45

	ics Inc	s 股份有限 公司		交易所				
34	CRISPR Therapeut ics AG	CRISPR 治 疗股份公 司	CRSP US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,330.00	642,590.23	0.44
35	Beam Therapeut ics Inc	-	BEAM US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,221.00	620,365.11	0.43
36	Exelixis Inc	Exelixis 股 份有限公 司	EXEL US	纳斯达 克证券 交易所	美国	5,169.00	602,435.56	0.42
37	Denali Therapeut ics Inc	-	DNLI US	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,105.00	598,569.84	0.41
38	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	1,003.00	594,335.23	0.41
39	Ultrageny x Pharmace utical Inc	Ultragenyx 制药股份 有限公司	RARE US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,085.00	581,703.89	0.40
40	Fate Therapeut ics Inc	Fate Therapeutic s 股份公 司	FATE US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,551.00	578,588.46	0.40
41	Vir Biotechno logy Inc	-	VIR US	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,074.00	553,655.46	0.38
42	Novocure Ltd	Novocure 有限公司	NVCR US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,081.00	517,461.25	0.36
43	Pacific Bioscienc es of California Inc	加州太平 洋生物科 学股份有 限公司	PACB US	纳斯达 克证券 交易所	美国	3,941.00	514,090.93	0.36
44	Kodiak Sciences Inc	-	KOD US	纳斯达 克证券 交易所	美国	951.00	514,045.79	0.36
45	Intra-Cell ular Therapies Inc	Intra-Cellul ar Therapies 公司	ITCI US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,515.00	505,561.77	0.35
46	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	2,525.00	489,881.69	0.34

47	Zai Lab Ltd	再鼎医药	ZLAB US	纳斯达克证券交易所	美国	1,210.00	484,862.42	0.34
48	Adaptive Biotechnologies Corp	-	ADPT US	纳斯达克证券交易所	美国	2,595.00	464,251.06	0.32
49	Twist Bioscience Corp	-	TWST US	纳斯达克证券交易所	美国	937.00	462,330.25	0.32
50	Apellis Pharmaceuticals Inc	Apellis 制药公司	APLS US	纳斯达克证券交易所	美国	1,507.00	454,274.75	0.31
51	Aurinia Pharmaceuticals Inc	Aurinia 制药股份有限公司	AUPH US	纳斯达克证券交易所	美国	3,098.00	451,726.38	0.31
52	CureVac NV	-	CVAC US	纳斯达克证券交易所	美国	1,945.00	425,469.27	0.29
53	Arvinas Inc	-	ARVN US	纳斯达克证券交易所	美国	812.00	425,244.40	0.29
54	Karuna Therapeutics Inc	-	KRTX US	纳斯达克证券交易所	美国	487.00	406,750.53	0.28
55	ACADIA Pharmaceuticals Inc	ACADIA 制药股份有限公司	ACAD US	纳斯达克证券交易所	美国	2,644.00	393,450.57	0.27
56	Alkermes PLC	Alkermes 公共有限公司	ALKS US	纳斯达克证券交易所	美国	2,652.00	393,288.37	0.27
57	Cytokinetics Inc	Cytokinetics 股份有限公司	CYTK US	纳斯达克证券交易所	美国	1,334.00	387,666.28	0.27
58	Zentalis Pharmaceuticals Inc	-	ZNTL US	纳斯达克证券交易所	美国	704.00	377,302.70	0.26
59	Relay Therapeutics Inc	-	RLAY US	纳斯达克证券交易所	美国	1,909.00	373,777.90	0.26
60	Maravai LifeSciences Holdings Inc	-	MRVI US	纳斯达克证券交易所	美国	1,368.00	365,450.02	0.25

61	Insmed Inc	Insmed 股份有限公司	INSM US	纳斯达克证券交易所	美国	1,967.00	341,616.89	0.24
62	Veracyte Inc	Veracyte 股份有限公司	VCYT US	纳斯达克证券交易所	美国	1,266.00	332,551.41	0.23
63	Iovance Biotherapeutics Inc	Iovance 生物医疗股份有限公司	IOVA US	纳斯达克证券交易所	美国	2,731.00	332,395.78	0.23
64	Amicus Therapeutics Inc	Amicus Therapeutics 股份有限公司	FOLD US	纳斯达克证券交易所	美国	4,228.00	311,347.11	0.22
65	SpringWorks Therapeutics Inc	-	SWTX US	纳斯达克证券交易所	美国	770.00	304,277.73	0.21
66	BridgeBio Pharma Inc	-	BBIO US	纳斯达克证券交易所	美国	2,810.00	298,834.16	0.21
67	Pacira BioSciences Inc	Pacira 生物科学股份有限公司	PCRX US	纳斯达克证券交易所	美国	768.00	294,624.67	0.20
68	Nektar Therapeutics	内克塔治疗公司	NKTR US	纳斯达克证券交易所	美国	3,404.00	293,205.95	0.20
69	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	1,140.00	289,496.31	0.20
70	ImmunityBio Inc	ImmunityBio 股份有限公司	IBRX US	纳斯达克证券交易所	美国	7,249.00	281,002.09	0.19
71	ChemoCentryx Inc	ChemoCentryx 股份有限公司	CCXI US	纳斯达克证券交易所	美国	1,155.00	268,120.82	0.19
72	AbCellera Biologics Inc	-	ABCL US	纳斯达克证券交易所	美国	2,931.00	267,226.63	0.18
73	Sage Therapeutics Inc	Sage Therapeutics 公司	SAGE US	纳斯达克证券交易所	美国	984.00	266,882.72	0.18
74	Ligand Pharmaceuticals Inc	Ligand 制药股份有限公司	LGND US	纳斯达克证券交易所	美国	263.00	258,999.93	0.18

75	Turning Point Therapeutics Inc	-	TPTX US	纳斯达克证券交易所	美国	851.00	258,806.88	0.18
76	I-Mab	天境生物	IMAB US	纳斯达克证券交易所	美国	834.00	251,988.45	0.17
77	Xencor Inc	Xencor 股份有限公司	XNCR US	纳斯达克证券交易所	美国	971.00	248,375.08	0.17
78	Prothena Corp PLC	Prothena 公共有限公司	PRTA US	纳斯达克证券交易所	美国	788.00	248,188.15	0.17
79	BioCryst Pharmaceuticals Inc	BioCryst 制药有限公司	BCRX US	纳斯达克证券交易所	美国	2,697.00	238,154.39	0.16
80	Myriad Genetics Inc	米利亚德基因公司	MYGN US	纳斯达克证券交易所	美国	1,340.00	235,798.89	0.16
81	Allogene Therapeutics Inc	-	ALLO US	纳斯达克证券交易所	美国	2,383.00	226,683.93	0.16
82	NanoString Technologies Inc	NanoString 技术公司	NSTG US	纳斯达克证券交易所	美国	836.00	225,089.50	0.16
83	Agios Pharmaceuticals Inc	Agios 制药公司	AGIO US	纳斯达克证券交易所	美国	1,047.00	219,419.01	0.15
84	REVOLUTION Medicines Inc	-	RVMD US	纳斯达克证券交易所	美国	1,367.00	219,371.20	0.15
85	Kymera Therapeutics Inc	-	KYMR US	纳斯达克证券交易所	美国	535.00	216,564.36	0.15
86	Ironwood Pharmaceuticals Inc	Ironwood 制药股份有限公司	IRWD US	纳斯达克证券交易所	美国	2,846.00	211,573.52	0.15
87	Genmab A/S	Genmab 股份有限公司	GMAB US	纳斯达克证券交易所	美国	836.00	210,858.17	0.15
88	Editas Medicine Inc	Editas 医药股份有限公司	EDIT US	纳斯达克证券交易所	美国	1,239.00	209,731.52	0.15



89	Global Blood Therapeutics Inc	Global Blood 治疗股份有限公司	GBT US	纳斯达克证券交易所	美国	1,098.00	204,905.18	0.14
90	Krystal Biotech Inc	-	KRYS US	纳斯达克证券交易所	美国	458.00	204,258.94	0.14
91	Codexis Inc	Codexis 股份有限公司	CDXS US	纳斯达克证券交易所	美国	1,023.00	203,953.61	0.14
92	IVERIC bio Inc	IVERIC 生物公司	ISEE US	纳斯达克证券交易所	美国	1,896.00	202,116.83	0.14
93	Rocket Pharmaceuticals Inc	Rocket 制药公司	RCKT US	纳斯达克证券交易所	美国	1,416.00	197,081.05	0.14
94	Sana Biotechnology Inc	-	SANA US	纳斯达克证券交易所	美国	1,966.00	194,036.01	0.13
95	HUTCH MED China Ltd	和黄医药	HCM US	纳斯达克证券交易所	美国	835.00	186,755.73	0.13
96	Alector Inc	-	ALEC US	纳斯达克证券交易所	美国	1,414.00	186,164.70	0.13
97	Traverse Therapeutics Inc	Traverse 医疗股份有限公司	TVTX US	纳斯达克证券交易所	美国	936.00	185,236.02	0.13
98	Recursion Pharmaceuticals Inc	-	RXRX US	纳斯达克证券交易所	美国	1,661.00	181,407.35	0.13
99	Protagonist Therapeutics Inc	-	PTGX US	纳斯达克证券交易所	美国	818.00	178,364.03	0.12
100	Xenon Pharmaceuticals Inc	Xenon 制药股份有限公司	XENE US	纳斯达克证券交易所	美国	871.00	173,483.05	0.12
101	ImmunoGen Inc	英基股份有限公司	IMGN US	纳斯达克证券交易所	美国	3,658.00	173,051.54	0.12
102	REGENXBIO Inc	REGENXBIO 股份有限公司	RGNX US	纳斯达克证券交易所	美国	808.00	168,456.20	0.12

103	Harmony Biosciences Holdings Inc	-	HRMY US	纳斯达克证券交易所	美国	609.00	165,562.65	0.11
104	iTeos Therapeutics Inc	-	ITOS US	纳斯达克证券交易所	美国	556.00	165,050.04	0.11
105	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	872.00	162,118.24	0.11
106	Vaxcyte Inc	-	PCVX US	纳斯达克证券交易所	美国	1,057.00	160,323.54	0.11
107	Madrigal Pharmaceuticals Inc	Madrigal 制药有限公司	MDGL US	纳斯达克证券交易所	美国	281.00	151,817.79	0.11
108	Legend Biotech Corp	传奇生物科技公司	LEGN US	纳斯达克证券交易所	美国	510.00	151,557.40	0.10
109	Axsome Therapeutics Inc	Axsome 医疗股份有限公司	AXSM US	纳斯达克证券交易所	美国	623.00	150,064.47	0.10
110	Enanta Pharmaceuticals Inc	Enanta 制药公司	ENTA US	纳斯达克证券交易所	美国	314.00	149,707.30	0.10
111	NGM Biopharmaceuticals Inc	-	NGM US	纳斯达克证券交易所	美国	1,311.00	148,029.79	0.10
112	Instil Bio Inc	-	TIL US	纳斯达克证券交易所	美国	1,342.00	146,396.40	0.10
113	Amarin Corp PLC	Amarin 公共有限公司	AMRN US	纳斯达克证券交易所	美国	6,795.00	145,998.11	0.10
114	Keros Therapeutics Inc	-	KROS US	纳斯达克证券交易所	美国	387.00	144,367.33	0.10
115	Grifols SA	基立福公司	GRFS US	纳斯达克证券交易所	美国	1,983.00	141,981.04	0.10
116	Nurix Therapeutics Inc	-	NRIX US	纳斯达克证券交易所	美国	769.00	141,939.34	0.10

117	Replimune Group Inc	-	REPL US	纳斯达克证券交易所	美国	820.00	141,680.81	0.10
118	Crinetics Pharmaceuticals Inc	-	CRNX US	纳斯达克证券交易所	美国	766.00	138,748.37	0.10
119	Revance Therapeutics Inc	Revance Therapeutics 股份有限公司	RVNC US	纳斯达克证券交易所	美国	1,314.00	136,723.57	0.09
120	Reata Pharmaceuticals Inc	Reata 制药股份有限公司	RETA US	纳斯达克证券交易所	美国	810.00	136,183.04	0.09
121	Arcutis Biotherapeutics Inc	-	ARQT US	纳斯达克证券交易所	美国	1,000.00	132,232.02	0.09
122	Atara Biotherapeutics 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	1,285.00	129,118.13	0.09
123	Castle Biosciences Inc	-	CSTL US	纳斯达克证券交易所	美国	468.00	127,916.69	0.09
124	Sangamo Therapeutics Inc	桑加莫疗法股份有限公司	SGMO US	纳斯达克证券交易所	美国	2,668.00	127,577.76	0.09
125	Erasca Inc	-	ERAS US	纳斯达克证券交易所	美国	1,262.00	125,358.76	0.09
126	FibroGen Inc	FibroGen 股份有限公司	FGEN US	纳斯达克证券交易所	美国	1,390.00	124,957.34	0.09
127	RAPT Therapeutics Inc	-	RAPT US	纳斯达克证券交易所	美国	529.00	123,880.93	0.09
128	Innoviva Inc	Innoviva 股份有限公司	INVA US	纳斯达克证券交易所	美国	1,124.00	123,618.45	0.09
129	Lyell Immunopharma Inc	-	LYEL US	纳斯达克证券交易所	美国	2,503.00	123,517.84	0.09
130	Coherus Biosciences Inc	Coherus 生物科学公司	CHRS US	纳斯达克证券交易所	美国	1,186.00	120,682.82	0.08
131	Zogenix	Zogenix 股	ZGNX US	纳斯达克	美国	1,159.00	120,078.34	0.08

	Inc	份有限公司		克证券 交易所				
132	Amphastar Pharmaceuticals Inc	Amphastar 制药公司	AMPH US	纳斯达克 交易所	美国	794.00	117,901.10	0.08
133	Verve Therapeutics Inc	-	VERV US	纳斯达克 交易所	美国	501.00	117,771.10	0.08
134	Morphic Holding Inc	-	MORF US	纳斯达克 交易所	美国	385.00	116,301.06	0.08
135	Kura Oncology Inc	Kura 肿瘤 学股份有 限公司	KURA US	纳斯达克 交易所	美国	1,300.00	116,037.74	0.08
136	Syndax Pharmaceuticals Inc	Syndax 制 药股份有 限公司	SNDX US	纳斯达克 交易所	美国	819.00	114,302.98	0.08
137	Avidity Biosciences Inc	-	RNA US	纳斯达克 交易所	美国	747.00	113,208.14	0.08
138	MannKind Corp	曼恩凯德 公司	MNKD US	纳斯达克 交易所	美国	4,052.00	112,896.05	0.08
139	ALX Oncology Holdings Inc	-	ALXO US	纳斯达克 交易所	美国	821.00	112,488.32	0.08
140	Scholar Rock Holding Corp	-	SRRK US	纳斯达克 交易所	美国	703.00	111,335.79	0.08
141	Inhibrx Inc	-	INBX US	纳斯达克 交易所	美国	395.00	109,978.59	0.08
142	MacroGenics Inc	MacroGenics 股份有 限公司	MGNX US	纳斯达克 交易所	美国	1,025.00	104,888.23	0.07
143	Immunovant Inc	-	IMVT US	纳斯达克 交易所	美国	1,925.00	104,567.86	0.07
144	uniQure NV	uniQure 股 份有限公 司	QURE US	纳斯达克 交易所	美国	786.00	103,934.37	0.07

145	C4 Therapeutics Inc	-	CCCC US	纳斯达克证券交易所	美国	506.00	103,880.56	0.07
146	Inovio Pharmaceuticals Inc	Inovio 制药股份有限公司	INO US	纳斯达克证券交易所	美国	3,265.00	103,875.14	0.07
147	Allovir Inc	-	ALVR US	纳斯达克证券交易所	美国	1,240.00	102,301.93	0.07
148	MeiraGTX Holdings plc	-	MGTX US	纳斯达克证券交易所	美国	675.00	102,167.40	0.07
149	Prometheus Biosciences Inc	-	RXDX US	纳斯达克证券交易所	美国	405.00	102,098.55	0.07
150	Stoke Therapeutics Inc	-	STOK US	纳斯达克证券交易所	美国	647.00	98,960.62	0.07
151	Rubius Therapeutics Inc	-	RUBY US	纳斯达克证券交易所	美国	1,602.00	98,870.28	0.07
152	Endo International PLC	远藤国际公司	ENDP US	纳斯达克证券交易所	美国	4,102.00	98,335.74	0.07
153	Repare Therapeutics Inc	-	RPTX US	纳斯达克证券交易所	美国	729.00	98,023.90	0.07
154	Ideaya Biosciences Inc	-	IDYA US	纳斯达克证券交易所	美国	632.00	95,256.02	0.07
155	Arcturus Therapeutics Holdings Inc	-	ARCT US	纳斯达克证券交易所	美国	399.00	94,149.90	0.07
156	Gossamer Bio Inc	-	GOSS US	纳斯达克证券交易所	美国	1,303.00	93,958.24	0.07
157	AnaptysBio Inc	AnaptysBio 股份有限公司	ANAB US	纳斯达克证券交易所	美国	421.00	93,274.90	0.06
158	Vanda Pharmaceuticals Inc	Vanda 制药股份有限公司	VNDA US	纳斯达克证券交易所	美国	917.00	91,731.85	0.06

159	Y-mAbs Therapeutics Inc	-	YMAB US	纳斯达克证券交易所	美国	878.00	90,741.39	0.06
160	Merus NV	Merus 公共 有限责任 公司	MRUS US	纳斯达克证券交易所	美国	444.00	90,019.78	0.06
161	IGM Biosciences Inc	-	IGMS US	纳斯达克证券交易所	美国	477.00	89,198.66	0.06
162	Anavex Life Sciences Corp	Anavex 生 命科学公 司	AVXL US	纳斯达克证券交易所	美国	791.00	87,448.72	0.06
163	Precigen Inc	Precigen 股 份有限公 司	PGEN US	纳斯达克证券交易所	美国	3,685.00	87,164.43	0.06
164	Akero Therapeutics Inc	-	AKRO US	纳斯达克证券交易所	美国	645.00	86,975.71	0.06
165	Seer Inc	-	SEER US	纳斯达克证券交易所	美国	594.00	86,385.25	0.06
166	Personalis Inc	-	PSNL US	纳斯达克证券交易所	美国	905.00	82,338.02	0.06
167	ATAI Life Sciences NV	-	ATAI US	纳斯达克证券交易所	美国	1,669.00	81,191.16	0.06
168	Theravance Biopharma Inc	Theravance 生物制药 股份有限 公司	TBPH US	纳斯达克证券交易所	美国	1,152.00	81,160.11	0.06
169	Kezar Life Sciences Inc	-	KZR US	纳斯达克证券交易所	美国	758.00	80,804.09	0.06
170	Sutro Biopharma Inc	-	STRO US	纳斯达克证券交易所	美国	848.00	80,450.11	0.06
171	Fulcrum Therapeutics Inc	-	FULC US	纳斯达克证券交易所	美国	713.00	80,416.51	0.06
172	Bicycle Therapeutics PLC	-	BCYC US	纳斯达克证券交易所	美国	207.00	80,334.39	0.06

173	Design Therapeutics Inc	-	DSGN US	纳斯达克证券交易所	美国	579.00	79,035.66	0.05
174	Forma Therapeutics Holdings Inc	-	FMTX US	纳斯达克证券交易所	美国	866.00	78,513.69	0.05
175	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	1,449.00	76,955.78	0.05
176	Chinook Therapeutics Inc	Chinook 治疗股份有限公司	KDNY US	纳斯达克证券交易所	美国	727.00	75,599.03	0.05
177	Cara Therapeutics Inc	Cara Therapeutics 公司	CARA US	纳斯达克证券交易所	美国	970.00	75,326.35	0.05
178	PetIQ Inc	PetIQ 股份有限公司	PETQ US	纳斯达克证券交易所	美国	496.00	71,816.90	0.05
179	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	598.00	71,220.65	0.05
180	Eagle Pharmaceuticals Inc/DE	特拉华 Eagle 制药股份有限公司	EGRX US	纳斯达克证券交易所	美国	217.00	70,449.19	0.05
181	Rhythm Pharmaceuticals Inc	-	RYTM US	纳斯达克证券交易所	美国	1,106.00	70,374.21	0.05
182	Applied Molecular Transport Inc	-	AMTI US	纳斯达克证券交易所	美国	789.00	70,325.37	0.05
183	PMV Pharmaceuticals Inc	-	PMVP US	纳斯达克证券交易所	美国	472.00	69,515.53	0.05
184	Day One Biopharmaceuticals Inc	-	DAWN US	纳斯达克证券交易所	美国	645.00	69,292.70	0.05
185	ORIC Pharmaceuticals Inc	-	ORIC US	纳斯达克证券交易所	美国	728.00	68,230.19	0.05
186	MaxCyte	-	MXCT US	纳斯达克	美国	1,045.00	67,891.96	0.05

	Inc			克证券 交易所				
187	Bluebird Bio Inc	Bluebird 生 物股份有 限公司	BLUE US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,061.00	67,578.53	0.05
188	Affimed NV	Affimed 公 司	AFMD US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,884.00	66,305.24	0.05
189	Deciphera Pharmace uticals Inc	-	DCPH US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,037.00	64,595.34	0.04
190	Monte Rosa Therapeut ics Inc	-	GLUE US	纳斯达 克证券 交易所	美国	484.00	63,012.83	0.04
191	Allakos Inc	-	ALLK US	纳斯达 克证券 交易所	美国	986.00	61,544.25	0.04
192	Quantum- Si Inc	-	QSI US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,223.00	61,366.18	0.04
193	Caribou Bioscienc es Inc	-	CRBU US	纳斯达 克证券 交易所	美国	627.00	60,323.24	0.04
194	Nkarta Inc	-	NKTX US	纳斯达 克证券 交易所	美国	612.00	59,894.60	0.04
195	Icosavax Inc	-	ICVX US	纳斯达 克证券 交易所	美国	406.00	59,225.66	0.04
196	Aclaris Therapeut ics Inc	Aclaris 医 疗股份有 限公司	ACRS US	纳斯达 克证券 交易所	美国	637.00	59,051.61	0.04
197	Praxis Precision Medicines Inc	-	PRAX US	纳斯达 克证券 交易所	美国	467.00	58,655.80	0.04
198	Mersana Therapeut ics Inc	-	MRSN US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,468.00	58,216.26	0.04
199	Gritstone bio Inc	-	GRTS US	纳斯达 克证券 交易所	美国	708.00	58,049.98	0.04
200	Century	-	IPSC US	纳斯达	美国	569.00	57,536.48	0.04



	Therapeutics Inc			克证券交易所				
201	Bioventus Inc	-	BVS US	纳斯达克证券交易所	美国	619.00	57,185.63	0.04
202	Pliant Therapeutics Inc	-	PLRX US	纳斯达克证券交易所	美国	659.00	56,721.42	0.04
203	Karyopharm Therapeutics Inc	Karyopharm Therapeutics 股份有限公司	KPTI US	纳斯达克证券交易所	美国	1,361.00	55,795.22	0.04
204	Singular Genomics Systems Inc	-	OMIC US	纳斯达克证券交易所	美国	750.00	55,277.32	0.04
205	Intercept Pharmaceuticals Inc	Intercept 制药股份有限公司	ICPT US	纳斯达克证券交易所	美国	529.00	54,942.02	0.04
206	Janux Therapeutics Inc	-	JANX US	纳斯达克证券交易所	美国	433.00	54,468.18	0.04
207	23andMe Holding Co	-	ME US	纳斯达克证券交易所	美国	1,281.00	54,394.03	0.04
208	Nuvalent Inc	-	NUVL US	纳斯达克证券交易所	美国	446.00	54,141.42	0.04
209	Avadel Pharmaceuticals PLC	Avadel 制药公共有限公司	AVDL US	纳斯达克证券交易所	美国	1,044.00	53,782.34	0.04
210	Imago Biosciences Inc	-	IMGO US	纳斯达克证券交易所	美国	349.00	52,757.58	0.04
211	Adicet Bio Inc	-	ACET US	纳斯达克证券交易所	美国	467.00	52,075.63	0.04
212	Adaptimmune Therapeutics Plc	Adaptimmune 治疗公共有限公司	ADAP US	纳斯达克证券交易所	美国	2,174.00	51,977.89	0.04
213	Tenaya Therapeut	-	TNYA US	纳斯达克证券交易所	美国	430.00	51,952.39	0.04

	ics Inc			交易所				
214	Kinnate Biopharm a Inc	-	KNTE US	纳斯达 克证券 交易所	美国	455.00	51,404.72	0.04
215	Kronos Bio Inc	-	KRON US	纳斯达 克证券 交易所	美国	587.00	50,861.06	0.04
216	Galapagos NV	Galapagos 制药公司	GLPG US	纳斯达 克证券 交易所	美国	144.00	50,614.90	0.04
217	Absci Corp	-	ABSI US	纳斯达 克证券 交易所	美国	964.00	50,398.63	0.03
218	Ocular Therapeut ix Inc	Ocular Therapeuti x 股份有限 公司	OCUL US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,131.00	50,260.09	0.03
219	Edgewise Therapeut ics Inc	-	EWTX US	纳斯达 克证券 交易所	美国	513.00	49,976.82	0.03
220	Spero Therapeut ics Inc	-	SPRO US	纳斯达 克证券 交易所	美国	488.00	49,812.58	0.03
221	Humacyte Inc	-	HUMA US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,072.00	49,551.94	0.03
222	Atea Pharmace uticals Inc	-	AVIR US	纳斯达 克证券 交易所	美国	865.00	49,303.93	0.03
223	SIGA Technolog ies Inc	SIGA 科技 股份有限 公司	SIGA US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,022.00	49,000.06	0.03
224	Graphite Bio Inc	-	GRPH US	纳斯达 克证券 交易所	美国	605.00	47,946.22	0.03
225	Precision BioScienc es Inc	-	DTIL US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,015.00	47,887.88	0.03
226	Annexon Inc	-	ANNX US	纳斯达 克证券 交易所	美国	643.00	47,104.12	0.03
227	4D Molecular Therapeut	-	FDMT US	纳斯达 克证券 交易所	美国	335.00	46,860.76	0.03

	ics Inc							
228	Generatio n Bio Co	-	GBIO US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,032.00	46,584.43	0.03
229	BioAtla Inc	-	BCAB US	纳斯达 克证券 交易所	美国	368.00	46,057.04	0.03
230	Selecta Bioscienc es Inc	Selecta 生 物科学股 份有限公 司	SELB US	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,199.00	45,705.74	0.03
231	Rigel Pharmace uticals Inc	Rigel 制 药公司	RIGL US	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,698.00	45,584.34	0.03
232	Cullinan Oncology Inc	-	CGEM US	纳斯达 克证券 交易所	美国	455.00	44,761.56	0.03
233	Omeros Corp	Omeros 公 司	OMER US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,090.00	44,685.37	0.03
234	G1 Therapeut ics Inc	-	GTHX US	纳斯达 克证券 交易所	美国	681.00	44,330.31	0.03
235	Relmada Therapeut ics Inc	Relmada 治 疗股份有 限公司	RLMD US	纳斯达 克证券 交易所	美国	301.00	43,237.00	0.03
236	Verastem Inc	Verastem 股份有限 公司	VSTM US	纳斯达 克证券 交易所	美国	3,304.00	43,183.89	0.03
237	Compuge n Ltd	Compugen 有限公司	CGEN US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,574.00	43,152.01	0.03
238	Marinus Pharmace uticals Inc	Marinus 制 药股份有 限公司	MRNS US	纳斯达 克证券 交易所	美国	566.00	42,870.72	0.03
239	Nautilus Biotechno logy Inc	-	NAUT US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,293.00	42,702.78	0.03
240	Jounce Therapeut ics Inc	Jounce Therapeutic s 股份有限 公司	JNCE US	纳斯达 克证券 交易所	美国	788.00	41,950.83	0.03
241	Talaris Therapeut	-	TALS US	纳斯达 克证券	美国	430.00	41,918.31	0.03

	ics Inc			交易所				
242	BELLUS Health Inc	BELLUS 健康股份有限公司	BLU US	纳斯达克证券交易所	美国	815.00	41,829.37	0.03
243	Phathom Pharmaceuticals Inc	-	PHAT US	纳斯达克证券交易所	美国	327.00	41,009.08	0.03
244	Poseida Therapeutics Inc	-	PSTX US	纳斯达克证券交易所	美国	943.00	40,943.66	0.03
245	Phibro Animal Health Corp	辉宝动物保健公司	PAHC US	纳斯达克证券交易所	美国	313.00	40,750.03	0.03
246	Aerie Pharmaceuticals Inc	Aerie 制药股份有限公司	AERI US	纳斯达克证券交易所	美国	908.00	40,639.73	0.03
247	Dyne Therapeutics Inc	-	DYN US	纳斯达克证券交易所	美国	536.00	40,632.59	0.03
248	AC Immune SA	-	ACIU US	纳斯达克证券交易所	美国	1,284.00	40,522.67	0.03
249	Kiniksa Pharmaceuticals Ltd	-	KNSA US	纳斯达克证券交易所	美国	530.00	39,772.25	0.03
250	Cortexyme Inc	-	CRTX US	纳斯达克证券交易所	美国	489.00	39,345.59	0.03
251	Arbutus Biopharma Corp	Arbutus 生物制药公司	ABUS US	纳斯达克证券交易所	美国	1,578.00	39,136.72	0.03
252	Lexicon Pharmaceuticals Inc	Lexicon 制药股份有限公司	LXRX US	纳斯达克证券交易所	美国	1,550.00	38,936.40	0.03
253	Alpha Teknova Inc	-	TKNO US	纳斯达克证券交易所	美国	292.00	38,127.71	0.03
254	ProQR Therapeutics NV	ProQR Therapeutics 公司	PRQR US	纳斯达克证券交易所	美国	741.00	37,842.39	0.03
255	Akebia Therapeutics Inc	Akebia Therapeutics 股份有限公司	AKBA US	纳斯达克证券交易所	美国	2,624.00	37,809.43	0.03

		公司						
256	Chimerix Inc	Chimerix 股份有限公司	CMRX US	纳斯达克证券交易所	美国	904.00	37,060.16	0.03
257	Geron Corp	杰龙公司	GERN US	纳斯达克证券交易所	美国	4,738.00	36,853.84	0.03
258	Passage Bio Inc	-	PASG US	纳斯达克证券交易所	美国	904.00	36,599.07	0.03
259	Radius Health Inc	Radius 健康股份有限公司	RDUS US	纳斯达克证券交易所	美国	829.00	36,575.35	0.03
260	Abcam PLC	Abcam 公共有限公司	ABCM US	纳斯达克证券交易所	美国	242.00	36,335.75	0.03
261	Omega Therapeutics Inc	-	OMGA US	纳斯达克证券交易所	美国	497.00	35,901.63	0.02
262	Altimmune Inc	Altimmune 股份有限公司	ALT US	纳斯达克证券交易所	美国	610.00	35,624.86	0.02
263	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	2,024.00	34,970.97	0.02
264	Tricida Inc	-	TCDA US	纳斯达克证券交易所	美国	569.00	34,681.51	0.02
265	KalVista Pharmaceuticals Inc	KalVista 制药有限公司	KALV US	纳斯达克证券交易所	美国	393.00	33,149.75	0.02
266	UroGen Pharma Ltd	-	URGN US	纳斯达克证券交易所	美国	537.00	32,559.87	0.02
267	Mirum Pharmaceuticals Inc	-	MIRM US	纳斯达克证券交易所	美国	319.00	32,439.88	0.02
268	Athira Pharma Inc	-	ATHA US	纳斯达克证券交易所	美国	389.00	32,316.32	0.02
269	Compass Pathways Plc	-	CMPS US	纳斯达克证券交易所	美国	229.00	32,266.78	0.02
270	Proventio	-	PRVB US	纳斯达克	美国	892.00	31,961.64	0.02

	n Bio Inc			克证券 交易所				
271	Oyster Point Pharma Inc	-	OYST US	纳斯达 克证券 交易所	美国	272.00	31,666.32	0.02
272	Magenta Therapeut ics Inc	-	MGTA US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,111.00	31,379.47	0.02
273	Aligos Therapeut ics Inc	-	ALGS US	纳斯达 克证券 交易所	美国	411.00	31,104.30	0.02
274	Akouos Inc	-	AKUS US	纳斯达 克证券 交易所	美国	562.00	30,456.72	0.02
275	BioDelive ry Sciences Internatio nal Inc	BioDeliver y Sciences 国际股份 有限公司	BDSI US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,524.00	30,121.36	0.02
276	Ikena Oncology Inc	-	IKNA US	纳斯达 克证券 交易所	美国	374.00	29,901.78	0.02
277	Taysha Gene Therapies Inc	-	TSHA US	纳斯达 克证券 交易所	美国	401.00	29,785.04	0.02
278	Epizyme Inc	Epizyme 股 份有限公 司	EPZM US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,862.00	29,678.88	0.02
279	Prelude Therapeut ics Inc	-	PRLD US	纳斯达 克证券 交易所	美国	373.00	29,607.79	0.02
280	Autolus Therapeut ics PLC	-	AUTL US	纳斯达 克证券 交易所	美国	893.00	29,549.27	0.02
281	Applied Therapeut ics Inc	-	APLT US	纳斯达 克证券 交易所	美国	516.00	29,444.26	0.02
282	Curis Inc	Curis 股份 有限公司	CRIS US	纳斯达 克证券 交易所	美国	954.00	28,952.31	0.02
283	Vor BioPharm a Inc	-	VOR US	纳斯达 克证券 交易所	美国	388.00	28,745.23	0.02

284	Immuneering Corp	-	IMRX US	纳斯达克证券交易所	美国	270.00	27,835.67	0.02
285	EyePoint Pharmaceuticals Inc	EyePoint 制药股份有限公司	EYPT US	纳斯达克证券交易所	美国	353.00	27,547.61	0.02
286	Alpine Immune Sciences Inc	Alpine 免疫科学股份有限公司	ALPN US	纳斯达克证券交易所	美国	304.00	26,844.25	0.02
287	Cyteir Therapeutics Inc	-	CYT US	纳斯达克证券交易所	美国	368.00	26,676.95	0.02
288	CytomX Therapeutics Inc	CytomX 医疗股份有限公司	CTMX US	纳斯达克证券交易所	美国	934.00	25,784.73	0.02
289	Cymabay Therapeutics Inc	Cymabay 医疗股份有限公司	CBAY US	纳斯达克证券交易所	美国	1,178.00	25,385.74	0.02
290	Olema Pharmaceuticals Inc	-	OLMA US	纳斯达克证券交易所	美国	419.00	25,004.48	0.02
291	Immunic Inc	Immunic 股份有限公司	IMUX US	纳斯达克证券交易所	美国	407.00	24,833.29	0.02
292	Summit Therapeutics Inc	-	SMMT US	纳斯达克证券交易所	美国	1,443.00	24,748.36	0.02
293	Harpoon Therapeutics Inc	-	HARP US	纳斯达克证券交易所	美国	511.00	24,597.77	0.02
294	Rapid Micro Biosystems Inc	-	RPID US	纳斯达克证券交易所	美国	359.00	24,353.64	0.02
295	Evolus Inc	-	EOLS US	纳斯达克证券交易所	美国	579.00	24,031.86	0.02
296	Shattuck Labs Inc	-	STTK US	纳斯达克证券交易所	美国	440.00	23,873.17	0.02
297	Paratek Pharmaceuticals Inc	Paratek 制药公司	PRTK US	纳斯达克证券交易所	美国	825.00	23,617.19	0.02

298	Alaunos Therapeutics Inc	Alaunos Therapeutics 股份有限公司	ZIOP US	纳斯达克证券交易所	美国	3,347.00	23,260.02	0.02
299	Aeglea BioTherapeutics Inc	-	AGLE US	纳斯达克证券交易所	美国	764.00	23,137.42	0.02
300	Surface Oncology Inc	-	SURF US	纳斯达克证券交易所	美国	750.00	22,856.88	0.02
301	Cogent Biosciences Inc	-	COGT US	纳斯达克证券交易所	美国	415.00	22,701.95	0.02
302	SAB Biotherapeutics Inc	-	SABS US	纳斯达克证券交易所	美国	453.00	22,556.78	0.02
303	Spectrum Pharmaceuticals Inc	Spectrum 制药股份有限公司	SPPI US	纳斯达克证券交易所	美国	2,768.00	22,412.88	0.02
304	Neoleukin Therapeutics Inc	Neoleukin 制药股份有限公司	NLTX US	纳斯达克证券交易所	美国	720.00	22,126.23	0.02
305	PDL BioPharma Inc	PDL 生物制药股份有限公司	PDLI US	-	美国	1,393.00	21,936.93	0.02
306	Ovid therapeutics Inc	Ovid therapeutic s 股份有限公司	OVID US	纳斯达克证券交易所	美国	1,068.00	21,857.68	0.02
307	Werewolf Therapeutics Inc	-	HOWL US	纳斯达克证券交易所	美国	287.00	21,793.23	0.02
308	Evelo Biosciences Inc	-	EVLO US	纳斯达克证券交易所	美国	557.00	21,556.18	0.01
309	Kamada Ltd	Kamada 有限公司	KMDA US	纳斯达克证券交易所	美国	510.00	21,395.57	0.01
310	Rani Therapeutics Holdings Inc	-	RANI US	纳斯达克证券交易所	美国	205.00	21,369.75	0.01
311	Codex	-	DNAY US	纳斯达克	美国	305.00	21,001.56	0.01



	DNA Inc			克证券 交易所				
312	Syros Pharmace uticals Inc	Syros 制药 股份有限 公司	SYRS US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,009.00	20,971.85	0.01
313	Homolog y Medicines Inc	-	FIXX US	纳斯达 克证券 交易所	美国	901.00	20,910.00	0.01
314	TCR2 Therapeut ics Inc	-	TCRR US	纳斯达 克证券 交易所	美国	688.00	20,441.00	0.01
315	KemPhar m Inc	KemPharm 股份有限 公司	KMPH US	纳斯达 克证券 交易所	美国	368.00	20,435.90	0.01
316	Rallybio Corp	-	RLYB US	纳斯达 克证券 交易所	美国	334.00	20,315.28	0.01
317	Black Diamond Therapeut ics Inc	-	BDTX US	纳斯达 克证券 交易所	美国	594.00	20,185.59	0.01
318	Gracell Biotechno logies Inc	亘喜生物 科技有限 公司	GRCL US	纳斯达 克证券 交易所	美国	521.00	20,063.31	0.01
319	Larimar Therapeut ics Inc	Larimar 治 疗股份有 限公司	LRMR US	纳斯达 克证券 交易所	美国	286.00	19,675.03	0.01
320	Eiger BioPharm aceuticals Inc	Eiger 生物 制药有限 公司	EIGR US	纳斯达 克证券 交易所	美国	581.00	19,225.22	0.01
321	Avrobio Inc	-	AVRO US	纳斯达 克证券 交易所	美国	779.00	19,121.68	0.01
322	Harvard Bioscienc e Inc	哈佛生物 科学公司	HBIO US	纳斯达 克证券 交易所	美国	425.00	19,103.19	0.01
323	Aerovate Therapeut ics Inc	-	AVTE US	纳斯达 克证券 交易所	美国	254.00	19,093.05	0.01
324	Leap Therapeut ics Inc	-	LPTX US	纳斯达 克证券 交易所	美国	919.00	18,984.03	0.01

325	Collectis SA	Collectis 公司	CLLS US	纳斯达克证券交易所	美国	366.00	18,948.07	0.01
326	Redhill Biopharma Ltd	Redhill 生物制药有限公司	RDHL US	纳斯达克证券交易所	美国	1,141.00	18,768.66	0.01
327	Frequency Therapeutics Inc	-	FREQ US	纳斯达克证券交易所	美国	573.00	18,741.31	0.01
328	NRX Pharmaceuticals Inc	-	NRXP US	纳斯达克证券交易所	美国	612.00	18,651.22	0.01
329	Gamida Cell Ltd	-	GMDA US	纳斯达克证券交易所	美国	1,133.00	18,348.12	0.01
330	ADMA Biologics Inc	ADMA 生物制剂股份有限公司	ADMA US	纳斯达克证券交易所	美国	2,038.00	18,321.08	0.01
331	Acumen Pharmaceuticals Inc	-	ABOS US	纳斯达克证券交易所	美国	421.00	18,144.99	0.01
332	89bio Inc	-	ETNB US	纳斯达克证券交易所	美国	211.00	17,582.71	0.01
333	Adverum Biotechnologies Inc	Adverum 生物技术公司	ADVUM US	纳斯达克证券交易所	美国	1,547.00	17,359.25	0.01
334	WaVe Life Sciences Ltd	WaVe 生命科学有限公司	WVE US	纳斯达克证券交易所	美国	850.00	17,016.74	0.01
335	Verrica Pharmaceuticals Inc	-	VRCA US	纳斯达克证券交易所	美国	286.00	16,702.80	0.01
336	Codiak Biosciences Inc	-	CDAK US	纳斯达克证券交易所	美国	233.00	16,548.89	0.01
337	Rain Therapeutics Inc	-	RAIN US	纳斯达克证券交易所	美国	195.00	16,013.21	0.01
338	Silverback Therapeutics Inc	-	SBTX US	纳斯达克证券交易所	美国	365.00	15,498.69	0.01

339	Athenex Inc	Athenex 股份有限公司	ATNX US	纳斯达克证券交易所	美国	1,782.00	15,451.64	0.01
340	Harrow Health Inc	Imprimis 制药股份有限公司	HROW US	纳斯达克证券交易所	美国	280.00	15,424.09	0.01
341	Esperion Therapeutics Inc	Esperion Therapeutics 公司	ESPR US	纳斯达克证券交易所	美国	476.00	15,174.17	0.01
342	Candel Therapeutics Inc	-	CADL US	纳斯达克证券交易所	美国	299.00	14,907.53	0.01
343	Molecular Templates Inc	Molecular Templates 股份有限公司	MTEM US	纳斯达克证券交易所	美国	586.00	14,645.75	0.01
344	Brooklyn Immunotherapeutics Inc	Brooklyn Immunotherapeutics 股份有限公司	BTX US	纳斯达克证券交易所	美国	542.00	14,409.97	0.01
345	Biomea Fusion Inc	-	BMEA US	纳斯达克证券交易所	美国	302.00	14,344.69	0.01
346	Centessa Pharmaceuticals PLC	-	CNTA US	纳斯达克证券交易所	美国	198.00	14,214.50	0.01
347	Sera Prognostics Inc	-	SERA US	纳斯达克证券交易所	美国	305.00	13,359.32	0.01
348	Infinity Pharmaceuticals 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	927.00	13,298.12	0.01
349	Oncocyte Corp	Oncocyte 公司	OCX US	纳斯达克证券交易所	美国	960.00	13,281.86	0.01
350	Impel Neuropharma Inc	-	IMPL US	纳斯达克证券交易所	美国	240.00	13,205.35	0.01
351	Xeris Biopharma Holdings Inc	-	XERS US	纳斯达克证券交易所	美国	700.00	13,076.56	0.01

352	Achilles Therapeutics PLC	-	ACHL US	纳斯达克证券交易所	美国	406.00	12,968.56	0.01
353	Landos Biopharma Inc	-	LABP US	纳斯达克证券交易所	美国	419.00	12,822.81	0.01
354	Solid Biosciences Inc	-	SLDB US	纳斯达克证券交易所	美国	1,148.00	12,808.78	0.01
355	Bolt Biotherapeutics Inc	-	BOLT US	纳斯达克证券交易所	美国	388.00	12,121.48	0.01
356	NextCure Inc	-	NXTC US	纳斯达克证券交易所	美国	314.00	12,011.82	0.01
357	Terns Pharmaceuticals Inc	-	TERN US	纳斯达克证券交易所	美国	263.00	11,855.04	0.01
358	Cabaletta Bio Inc	-	CABA US	纳斯达克证券交易所	美国	489.00	11,816.15	0.01
359	Mereo Biopharma Group PLC	-	MREO US	纳斯达克证券交易所	美国	1,157.00	11,802.70	0.01
360	Sensei Biotherapeutics Inc	-	SNSE US	纳斯达克证券交易所	美国	319.00	11,796.32	0.01
361	Connect Biopharma Holdings Ltd	康乃德生物医药控股有限公司	CNTB US	纳斯达克证券交易所	美国	339.00	11,131.02	0.01
362	Clearside Biomedical Inc	Clearside 生物医学股份有限公司	CLSD US	纳斯达克证券交易所	美国	621.00	10,888.10	0.01
363	TherapeuticsMD Inc	TherapeuticsMD 股份有限公司	TXMD US	纳斯达克证券交易所	美国	4,646.00	10,530.42	0.01
364	Aquestive Therapeutics Inc	-	AQST US	纳斯达克证券交易所	美国	418.00	10,367.02	0.01
365	ObsEva SA	-	OBSV US	纳斯达克证券交易所	美国	811.00	10,289.68	0.01

				交易所				
366	Mustang Bio Inc	-	MBIO US	纳斯达克证券交易所	美国	964.00	10,202.65	0.01
367	Puma Biotechnology Inc	Puma 生物科技股份有限公司	PBYI US	纳斯达克证券交易所	美国	518.00	10,039.94	0.01
368	Oncorus Inc	-	ONCR US	纳斯达克证券交易所	美国	269.00	9,038.38	0.01
369	Viracta Therapeutics Inc	Viracta Therapeutics 股份有限公司	VIRX US	纳斯达克证券交易所	美国	388.00	9,029.27	0.01
370	Optinose Inc	-	OPTN US	纳斯达克证券交易所	美国	856.00	8,841.31	0.01
371	Decibel Therapeutics Inc	-	DBTX US	纳斯达克证券交易所	美国	259.00	7,678.57	0.01
372	Corvus Pharmaceuticals Inc	Corvus 制药股份有限公司	CRVS US	纳斯达克证券交易所	美国	485.00	7,452.24	0.01
373	Calithera Biosciences Inc	Calithera 生物科学公司	CALA US	纳斯达克证券交易所	美国	806.00	3,418.33	0.00
374	Insys Therapeutics Inc	Insys Therapeutics 股份有限公司	INSYQ US	-	美国	2,656.00	711.21	0.00
375	Achaogen Inc	Achaogen 股份有限公司	AKAOQ US	-	美国	1,615.00	257.45	0.00
376	Synergy Pharmaceuticals LLC	Synergy 制药有限责任公司	SGYPQ US	-	美国	9,201.00	193.57	0.00
377	Evoform Biosciences Inc	Evoform 生物科学有限公司	EVFM US	纳斯达克证券交易所	美国	4.00	9.56	0.00
378	Sienna Biopharmaceuticals Inc	Sienna 生物制药股份有限公司	SNNAQ US	美国场外交易市场	美国	732.00	0.45	0.00

注：此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

## 8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

### 8.5.1 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	Amgen Inc	AMGN US	4,435,779.96	4.41
2	AstraZeneca PLC	AZN US	3,947,819.67	3.92
3	Moderna Inc	MRNA US	3,754,597.36	3.73
4	Gilead Sciences Inc	GILD US	2,366,068.49	2.35
5	Illumina Inc	ILMN US	2,308,771.67	2.30
6	Regeneron Pharmaceuticals Inc	REGN US	2,249,181.92	2.24
7	BioNTech SE	BNTX US	2,138,020.61	2.13
8	Royalty Pharma PLC	RPRX US	2,125,341.25	2.11
9	Novavax Inc	NVAX US	1,653,173.97	1.64
10	Seagen Inc	SGEN US	1,580,889.72	1.57
11	Biogen Inc	BIIB US	1,452,296.23	1.44
12	Vertex Pharmaceuticals Inc	VRTX US	1,199,480.86	1.19
13	Viatis Inc	VTRS US	1,094,971.96	1.09
14	BeiGene Ltd	BGNE US	816,502.84	0.81
15	Horizon Therapeutics Plc	HZNP US	786,553.45	0.78
16	Alnylam Pharmaceuticals Inc	ALNY US	708,981.10	0.70
17	Beam Therapeutics Inc	BEAM US	646,542.90	0.64
18	Guardant Health Inc	GH US	638,019.53	0.63
19	Incyte Corp	INCY US	570,287.44	0.57
20	ImmunityBio Inc	IBRX US	448,851.99	0.45
		NK US	100,844.53	0.10

注：本项及下项 8.5.2、8.5.3 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。

### 8.5.2 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	Moderna Inc	MRNA US	4,530,953.13	4.50
2	Alexion Pharmaceuticals Inc/MA	ALXN US	3,258,140.25	3.24
3	AstraZeneca PLC	AZN US	2,236,791.85	2.22
4	Novocure Ltd	NVCR US	1,354,261.64	1.35
5	Bio-Techne Corp	TECH US	986,399.97	0.98
6	Seagen Inc	SGEN US	914,991.52	0.91
7	Acceleron Pharma Inc	XLRN US	879,918.46	0.87
8	PRA Health Sciences Inc	PRAH US	867,913.44	0.86
9	Regeneron Pharmaceuticals Inc	REGN US	864,834.56	0.86
10	Gilead Sciences Inc	GILD US	789,516.36	0.78
11	Viatis Inc	VTRS US	788,350.81	0.78
12	Illumina Inc	ILMN US	685,001.84	0.68
13	BioNTech SE	BNTX US	635,793.77	0.63
14	ICON PLC	ICLR US	596,428.63	0.59
15	Vertex Pharmaceuticals Inc	VRTX US	525,606.53	0.52
16	GW Pharmaceuticals Ltd	GWPH US	523,495.55	0.52
17	Novavax Inc	NVAX US	514,082.17	0.51
18	Biogen Inc	BIIB US	486,681.48	0.48
19	Guardant Health Inc	GH US	483,600.22	0.48
20	China Biologic Products Holdings Inc	CBPO US	392,196.18	0.39

### 8.5.3 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	68,019,179.74
卖出收入（成交）总额	31,668,658.16

### 8.6 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。

### 8.7 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。

### 8.8 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。

### 8.9 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。

### 8.10 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 Nasdaq Biotechnology	ETF 基金	开放式	ProShare Advisors LLC	11,760,537.67	8.14

### 8.11 投资组合报告附注

**8.11.1** 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。

**8.11.2** 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。

### 8.11.3 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	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

### 8.11.4 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。



### 8.11.5 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。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 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
15,670	7,820.92	0.00	0.00%	122,553,862.57	100.00%

### 9.2 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	30,501.75	0.0249%

### 9.3 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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

### 9.4 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	-	-	10,000,200.0 2	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	-	-	10,000,200.0 2	8.16%	三年
----	---	---	-------------------	-------	----

## §10 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	81,514,594.67
本报告期基金总申购份额	107,901,523.60
减：本报告期基金总赎回份额	66,862,255.70
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	122,553,862.57

## §11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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

本基金管理人于 2021 年 7 月 23 日发布公告，易阳方先生自 2021 年 7 月 21 日起不再担任公司常务副总经理；于 2021 年 9 月 17 日发布公告，刘格菘先生、傅友兴先生自 2021 年 9 月 17 日起任公司副总经理。

中国工商银行股份有限公司根据工作需要，任命刘彤女士担任资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任资产托管部总经理职务。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。截至本报告期末，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）已连续 4 年为本基金提供审计服务，本报告年度的审计费用为 34,000 元。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 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	
China International Capital Corporation Limited	-	23,782,076.30	26.46%	15,623.87	33.54%	-
Citigroup	-	66,113,416.58	73.54%	30,955.15	66.46%	-
Credit Suisse	-	-	-	-	-	-
State Street Global Markets International Ltd.	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs Group Inc.	-	-	-	-	-	-

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：

- (1) 财务状况良好，经营状况稳定，信誉良好，符合监管标准；
- (2) 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；
- (3) 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；
- (4) 清算和交割能力强，能确保流程顺畅以及结果准确；
- (5) 能与服务匹配的合理的佣金和收费标准；
- (6) 经营行为规范，有健全的内部控制制度；
- (7) 具备高效、安全的通讯条件。

2、券商专用交易单元选择程序：

(1) 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。

(2) 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。

(3) 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。

### 11.7.2 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		债券回购交易		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	占当期债券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
China International Capital Corporation Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Citigroup	-	-	-	-	-	-	25,460,400.17	100.00%
Credit Suisse	-	-	-	-	-	-	-	-
State Street Global Markets International Ltd.	-	-	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs Group Inc.	-	-	-	-	-	-	-	-

### 11.8 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旗下基金 2020 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-01-21
2	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-03-30
3	关于旗下部分基金根据《公开募集证券投资基金	中国证监会规定报刊及	2021-03-31

	金运作指引第 3 号——指数基金指引》修改基金合同等法律文件的公告	网站	
4	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-04-21
5	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2021 年第 2 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-07-20
6	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2021 年中期报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-08-30
7	关于广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-09-16
8	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2021 年第 3 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-10-26
9	关于广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金 2022 年境外主要交易市场节假日暂停申购赎回等业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-12-31

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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							
<p>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：</p> <p>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；</p> <p>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；</p> <p>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；</p> <p>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；</p> <p>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。</p> <p>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。</p>							

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》和《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》等法律法规的规定和基金合同的约定，经与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，本公司决定自 2021 年 3 月 31 日起，对旗下部分基金的基金合同、托管协议等法律文件进行修订。详情可见基金管理人网站（[www.gffunds.com.cn](http://www.gffunds.com.cn)）刊登的《关于旗下部分基金根据<公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引>修改基金合同等法律文件的公告》。

## §13 备查文件目录

### 13.1 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

### 13.2 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

### 13.3 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

二〇二二年三月三十日