

广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资 基金

2020 年中期报告

2020 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：二〇二〇年八月二十七日

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。本中期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 2020 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 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合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
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.....	14
5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、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.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	35
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	36
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.....	36
7.5 报告期内权益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.....	50
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.....	50
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	53
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	53
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	53
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	53
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	56
11.3	查阅方式	56

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	97,698,625.67 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	姓名	程才良	郭明
	联系电话	020-83936666	010-66105799

负责人	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宝华路6号105室-49848（集中办公区）	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		-	-

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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.gffunds.com.cn
基金中期报告备置地点	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（2020年1月1日至2020年6月30日）
---------------	---------------------------

本期已实现收益	6,413,675.08
本期利润	13,013,099.08
加权平均基金份额本期利润	0.1026
本期加权平均净值利润率	9.22%
本期基金份额净值增长率	10.67%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)
期末可供分配利润	11,232,817.04
期末可供分配基金份额利润	0.1150
期末基金资产净值	120,520,698.20
期末基金份额净值	1.234
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)
基金份额累计净值增长率	23.40%

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

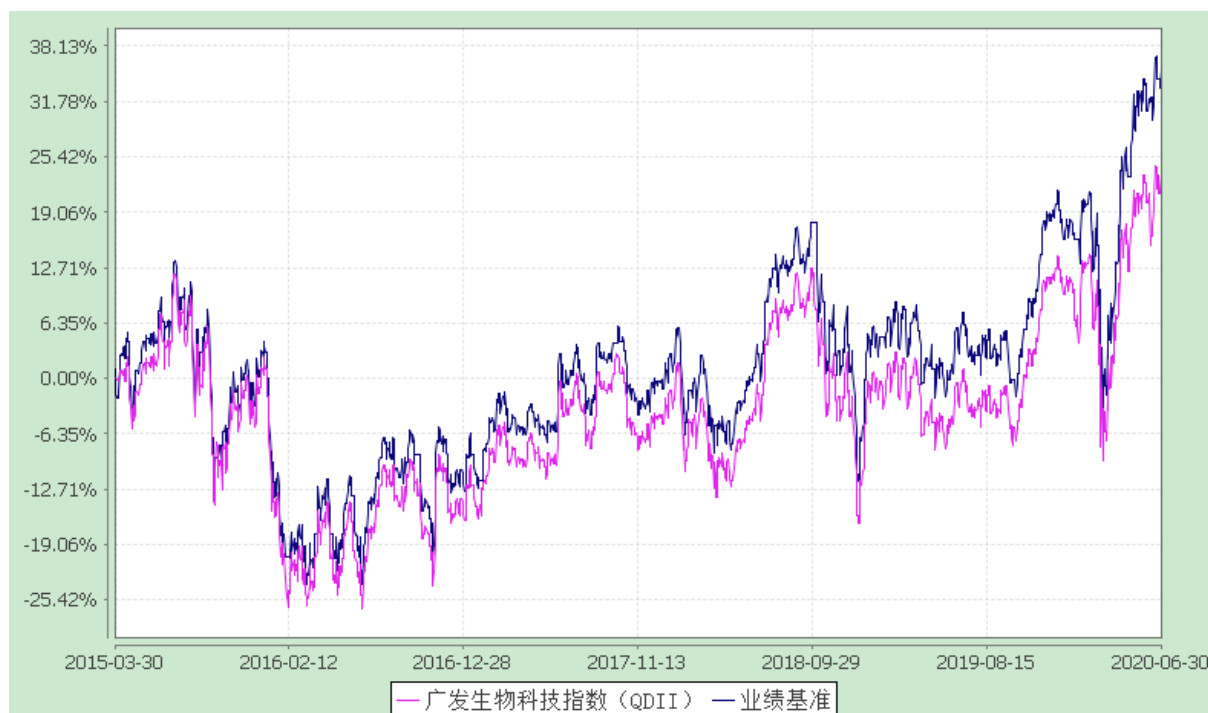
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.08%	1.58%	0.83%	1.20%	-0.75%	0.38%
过去三个月	20.39%	1.71%	25.17%	1.77%	-4.78%	-0.06%
过去六个月	10.67%	2.37%	14.59%	2.48%	-3.92%	-0.11%
过去一年	24.14%	1.79%	27.77%	1.87%	-3.63%	-0.08%
过去三年	29.08%	1.52%	36.84%	1.53%	-7.76%	-0.01%
自基金合同生效起至今	23.40%	1.60%	35.46%	1.58%	-12.06%	0.02%

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 2020 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。公司拥有公募基金管理、特定客户资产管理、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、受托管理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、合格境内机构投资者境外证券投资管理（QDII）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 32 个部门：宏观策略部、价值投资部、策略投资部、成长投资部、专户投资部、固定收益管理总部、指数投资部、量化投资部、资产

配置部、国际业务部、研究发展部、产品设计部、营销管理部、机构理财部、渠道管理总部、养老金部、战略与创新业务部、北京分公司、广州分公司、上海分公司、互联网金融部、中央交易部、基金会计部、注册登记部、信息技术部、合规稽核部、金融工程与风险管理部、规划发展部、人力资源部、财务部、综合管理部、北京办事处。此外，还出资设立了瑞元资本管理有限公司、广发国际资产管理有限公司（香港子公司），参股了证通股份有限公司。

截至 2020 年 6 月 30 日，公司管理 225 只开放式基金，管理公募基金规模为 6394.81 亿元。同时，公司还管理着多个特定客户资产管理投资组合、社保基金投资组合和养老基金投资组合。

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		
刘杰	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；	2018-08-06	-	16 年	刘杰先生，工学学士，持有中国证券基金业从业证书。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

	<p>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；广发美国房地产指数证券投资基金的基金经理；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</p>				<p>(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)、广发中小板 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)、广发中证环保产业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 2018 年 4 月 26 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</p>
--	--	--	--	--	---

	<p>发中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；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的基金经理；指数投资部总经理助理</p>				<p>金经理(自 2016 年 9 月 26 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)、广发中小板 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</p>
--	--	--	--	--	--

					2016 年 1 月 25 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)。
--	--	--	--	--	---

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，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 3 次，均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

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。

2020 年上半年，由于受到新冠疫情以及复工复产影响，海内外主要指数均呈现先抑后扬，市场超跌反弹，全球市场风险偏好变化激烈，沪深 300 指数上涨 1.64%，中证 500 指数上涨 11.33%，创业板指数上涨 35.60%。美股同样大幅反弹，其中纳斯达克 100 指数上涨 16.30%，纳斯达克生物科技指数上涨 13.49%。海内外市场整体上涨的原因主要有两方面：一方面，随着各国出台货币宽松政策，投资者对疫情造成的流动性危机的担心逐步化解；另一方面，货币政策和财政政策共同发力，对经济产生托底作用，投资者的风险偏好也随之明显提高。

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 10.67%，同期业绩比较基准收益率为 14.59%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年的行情，我们对股票市场总体较为乐观。在疫情中开启的全球货币宽松政策难以在短期退坡。在流动性的支撑下，股市的估值有望维持在较高的水平。其次，经济活动的恢复可能继续修正疫情期间形成的悲观预期。同时，我们仍需密切监视海外疫情控制程度以及中美关系的波动这两个可能对股市造成冲击的因素。欧美复工复产之后，确诊病例仍然较多，在疫苗和特效药物研制成功之前，疫情有对经济造成持续影响的可能。此外，临近美国大选，中美关系可能成为舆论关注的一个焦点，两国在某些领域存在局部摩擦的可能，从而打压市场风险偏好。综上所述，如果世界经济如预期恢复，疫情和中美关系不出现超预期恶化，股市较大可能延续 2 季度的反弹势头。

放眼未来的美股市场，在生物和医药技术方面依然拥有引领全球的相对优势，而纳斯达克生物

科技指数涵盖了全球最优质的生物和医药行业龙头企业，值得投资者关注。

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、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。

4.7 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合规守信、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 托管人对本中期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 2020 年中期报告中财务指标、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：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资 产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	8,854,850.89	11,247,737.72
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	113,505,547.65	150,614,623.10
其中：股票投资		113,283,542.46	149,790,540.29
基金投资		222,005.19	824,082.81
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
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		-	428,628.26
应收利息	6.4.7.5	207.06	495.02

应收股利		583.63	816.84
应收申购款		-	1,095,469.84
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	13,379.05
资产总计		122,361,189.23	163,401,149.83
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 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		1,656,042.33	2,445,152.41
应付管理人报酬		80,978.68	113,636.78
应付托管费		25,305.82	35,511.48
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
应交税费		141.78	15,708.85
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	78,022.42	157,885.90
负债合计		1,840,491.03	2,767,895.42
所有者权益:		-	-
实收基金	6.4.7.9	97,698,625.67	144,014,710.07
未分配利润	6.4.7.10	22,822,072.53	16,618,544.34
所有者权益合计		120,520,698.20	160,633,254.41
负债和所有者权益总计		122,361,189.23	163,401,149.83

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 1.234 元，基金份额总额 97,698,625.67 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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		13,857,686.72	23,245,959.62
1.利息收入		17,125.71	73,403.04

其中：存款利息收入	6.4.7.11	17,125.71	73,403.04
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）		7,200,346.74	1,749,982.11
其中：股票投资收益	6.4.7.12	6,565,486.24	1,338,589.26
基金投资收益	6.4.7.13	145,479.54	-74,521.27
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	489,380.96	485,914.12
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	6,599,424.00	21,481,085.74
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-11,965.05	-106,857.95
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	52,755.32	48,346.68
减：二、费用		844,587.64	1,074,881.82
1. 管理人报酬		561,007.65	794,793.00
2. 托管费		175,314.91	248,372.77
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	17,033.90	8,043.19
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		493.61	-
7. 其他费用	6.4.7.20	90,737.57	23,672.86
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		13,013,099.08	22,171,077.80
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		13,013,099.08	22,171,077.80

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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2020 年 1 月 1 日至 2020 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）	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）	-	13,013,099.08	13,013,099.08
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）	-46,316,084.40	-6,809,570.89	-53,125,655.29
其中：1.基金申购款	27,427,142.50	2,269,975.29	29,697,117.79
2.基金赎回款	-73,743,226.90	-9,079,546.18	-82,822,773.08
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）	97,698,625.67	22,822,072.53	120,520,698.20
项目	上年度可比期间 2019年1月1日至2019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）	221,641,508.67	-23,409,427.05	198,232,081.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	22,171,077.80	22,171,077.80
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）	-26,814,924.47	60,798.90	-26,754,125.57
其中：1.基金申购款	31,890,827.87	-878,911.57	31,011,916.30
2.基金赎回款	-58,705,752.34	939,710.47	-57,766,041.87
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）	194,826,584.20	-1,177,550.35	193,649,033.85

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（“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（BrownBrothersHarriman&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 2020 年 8 月 25 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（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。

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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年上半年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

本基金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[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。

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 2020年6月30日
活期存款	8,854,850.89
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	8,854,850.89

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	92,362,354.90	113,283,542.46	20,921,187.56
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	173,212.74	222,005.19	48,792.45
其他	-	-	-
合计	92,535,567.64	113,505,547.65	20,969,980.01

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 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	207.06
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	207.06

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 2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,442.28
应付证券出借违约金	-
预提费用	76,580.14
合计	78,022.42

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	144,014,710.07	144,014,710.07
本期申购	27,427,142.50	27,427,142.50
本期赎回（以“-”号填列）	-73,743,226.90	-73,743,226.90
本期末	97,698,625.67	97,698,625.67

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。

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	8,719,903.72	7,898,640.62	16,618,544.34
本期利润	6,413,675.08	6,599,424.00	13,013,099.08
本期基金份额交易产生的变动数	-3,900,761.76	-2,908,809.13	-6,809,570.89
其中：基金申购款	1,895,565.18	374,410.11	2,269,975.29
基金赎回款	-5,796,326.94	-3,283,219.24	-9,079,546.18
本期已分配利润	-	-	-
本期末	11,232,817.04	11,589,255.49	22,822,072.53

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
活期存款利息收入	17,124.72
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	0.99
合计	17,125.71

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	51,390,247.92
减：卖出股票成本总额	44,824,761.68
买卖股票差价收入	6,565,486.24

6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	1,433,855.48
减：卖出/赎回基金成本总额	1,288,375.94
基金投资收益	145,479.54

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 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	489,380.96
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	489,380.96

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1.交易性金融资产	6,599,424.00
——股票投资	6,681,807.33
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-82,383.33
——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	6,599,424.00

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	52,684.81
基金转换费收入	70.51
合计	52,755.32

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	17,033.90
银行间市场交易费用	-

合计	17,033.90
----	-----------

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	16,907.80
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行汇划费	150.00
指数使用费	13,379.05
其他	628.38
合计	90,737.57

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
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

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。

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 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。

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 2020年1月1日至2020年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	561,007.65	794,793.00
其中：支付销售机构的客户维护费	213,960.06	305,195.87

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	175,314.91	248,372.77

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。

6.4.10.4 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

6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30 日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30 日
报告期初持有的基金份额	-	10,000,200.02
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	3,500,100.00
报告期末持有的基金份额	-	6,500,100.02
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	3.34%

注：本报告期内基金管理人无运用自有资金投资本基金的情况。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。

6.4.10.5.2 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。

6.4.10.6 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 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	4,507,916.26	8,840.59	2,063,112.86	8,237.95
布朗兄弟哈里曼银行	4,346,934.63	8,284.13	8,957,645.76	65,130.34

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。

6.4.10.7 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。

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（2020 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 2020 年 6 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

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	0.30	-	-	2,656.00	442,882.65	789.72	-
SGYP Q US	SYNE RGY PHAR MACE UTICA LS INC	2019-05 -02	重大事项	0.02	-	-	9,201.00	238,281.99	214.93	-

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 2020 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 2020 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。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2020 年 6 月 30 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

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。

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。

本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，违约风险较小；银行间同业市场主要通过对交易对手进行风险评估防范相应的信用风险。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投资、资产支持证券投资、同业存单投资，因此与其相关的信用风险不重大。

6.4.13.3 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 6.4.12 中列示的流通暂时受限的证券外，本基金所持大部分证券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。

6.4.13.3.1 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。

6.4.13.4 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，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 2020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	8,854,850.89	-	-	-	8,854,850.89
交易性金融资产	-	-	-	113,505,547.65	113,505,547.65
应收利息	-	-	-	207.06	207.06
应收股利	-	-	-	583.63	583.63
资产总计	8,854,850.89	-	-	113,506,338.34	122,361,189.23
负债：					
应付赎回款	-	-	-	1,656,042.33	1,656,042.33
应付管理人报酬	-	-	-	80,978.68	80,978.68
应付托管费	-	-	-	25,305.82	25,305.82
应交税费	-	-	-	141.78	141.78
其他负债	-	-	-	78,022.42	78,022.42
负债总计	-	-	-	1,840,491.03	1,840,491.0

					3
利率敏感度缺口	8,854,850.89	-	-	111,665,847.31	120,520,698.20
上年度末 2019 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	11,247,737.72	-	-	-	11,247,737.72
交易性金融资产	-	-	-	150,614,623.10	150,614,623.10
应收证券清算款	-	-	-	428,628.26	428,628.26
应收利息	-	-	-	495.02	495.02
应收股利	-	-	-	816.84	816.84
应收申购款	33,534.46	-	-	1,061,935.38	1,095,469.84
其他资产	-	-	-	13,379.05	13,379.05
资产总计	11,281,272.18	-	-	152,119,877.65	163,401,149.83
负债：					
应付赎回款	-	-	-	2,445,152.41	2,445,152.41
应付管理人报酬	-	-	-	113,636.78	113,636.78
应付托管费	-	-	-	35,511.48	35,511.48
应交税费	-	-	-	15,708.85	15,708.85
其他负债	-	-	-	157,885.90	157,885.90
负债总计	-	-	-	2,767,895.42	2,767,895.42
利率敏感度缺口	11,281,272.18	-	-	149,351,982.23	160,633,254.41

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交易性债券投资，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			
	2020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	6,929,011.36	-	-	6,929,011.36
交易性金融资产	113,505,547.65	-	-	113,505,547.65
应收利息	21.24	-	-	21.24
应收股利	583.63	-	-	583.63
资产合计	120,435,163.88	-	-	120,435,163.88
以外币计价的负债				
应付赎回款	340,458.61	-	-	340,458.61
其他负债	49.20	-	-	49.20
负债合计	340,507.81	-	-	340,507.81
资产负债表 外汇风险敞 口净额	120,094,656.07	-	-	120,094,656.07
项目	上年度末			
	2019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	8,977,529.96	-	-	8,977,529.96
交易性金融资产	150,614,623.10	-	-	150,614,623.10
应收证券清算款	428,628.26	-	-	428,628.26
应收利息	60.27	-	-	60.27

应收股利	816.84	-	-	816.84
应收申购款	42,228.12	-	-	42,228.12
资产合计	160,063,886.55	-	-	160,063,886.55
以外币计价的负债				
应付赎回款	286,780.91	-	-	286,780.91
其他负债	455.48	-	-	455.48
负债合计	287,236.39	-	-	287,236.39
资产负债表外汇风险敞口净额	159,776,650.16	-	-	159,776,650.16

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
		2020年6月30日	2019年12月31日
	所有外币相对人民币升值 5%	6,004,732.80	7,988,832.51
	所有外币相对人民币贬值 5%	-6,004,732.80	-7,988,832.51

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 2020年6月30日		上年度末 2019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	113,283,542.46	94.00	149,790,540.29	93.25
交易性金融资产—基金投资	222,005.19	0.18	824,082.81	0.51
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	113,505,547.65	94.18	150,614,623.10	93.76

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 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
	业绩比较基准上升 5%	5,784,993.51	3,935,514.73
	业绩比较基准下降 5%	-5,784,993.51	-3,935,514.73

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

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 2020 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次的余额为人民币 113,504,543.00 元，属于第二层次的余额为人民币 1,004.65 元，无属于第三层次的金额（2019 年 12 月 31 日：属于第一层次的余额为人民币 150,614,411.30 元，属于第二层次的余额为人民币 211.80 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。

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	113,283,542.46	92.58
	其中：普通股	109,079,425.77	89.15
	存托凭证	4,204,116.69	3.44
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	222,005.19	0.18
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	8,854,850.89	7.24
8	其他各项资产	790.69	0.00
9	合计	122,361,189.23	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	113,283,542.46	94.00

合计	113,283,542.46	94.00
----	----------------	-------

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、丹麦、开曼群岛、法国、比利时、西班牙、日本、爱尔兰在美国上市的 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（%）
公用事业	-	-
能源	-	-
信息技术	-	-
日常消费品	-	-
非日常生活消费品	-	-
房地产	-	-
原材料	-	-
通信服务	-	-
工业	-	-
金融	-	-
医疗保健	113,283,542.46	94.00
合计	113,283,542.46	94.00

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	-	AMGN US	纳斯达 克证券 交易所	美国	6,542.00	10,923,641.03	9.06
2	Gilead Sciences Inc	吉利德科 学	GILD US	纳斯达 克证券 交易所	美国	19,696.00	10,728,346.79	8.90
3	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	1,964.00	8,671,315.66	7.19
4	Vertex	Vertex 制药	VRTX US	纳斯达	美国	3,819.00	7,848,998.39	6.51

	Pharmaceuticals Inc	股份有限公司		克证券交易所				
5	Biogen Inc	百健	BIIB US	纳斯达克证券交易所	美国	4,069.00	7,707,175.20	6.39
6	Illumina Inc	Illumina 公司	ILMN US	纳斯达克证券交易所	美国	2,808.00	7,362,275.05	6.11
7	Bristol-Myers Squibb Co	百时美施贵宝	BMY US	纽约证券交易所	美国	10,286.00	4,281,800.54	3.55
8	Seattle Genetics Inc	西雅图遗传学股份有限公司	SGEN US	纳斯达克证券交易所	美国	3,088.00	3,714,705.40	3.08
9	Alexion Pharmaceuticals Inc	Alexion 制药公司	ALXN US	纳斯达克证券交易所	美国	4,337.00	3,446,193.56	2.86
10	Incyte Corp	Incyte 有限公司	INCY US	纳斯达克证券交易所	美国	4,131.00	3,040,645.75	2.52
11	BioMarin Pharmaceutical Inc	BioMarin 制药股份有限公司	BMRN US	纳斯达克证券交易所	美国	3,446.00	3,008,997.34	2.50
12	Alnylam Pharmaceuticals Inc	Alnylam 制药有限公司	ALNY US	纳斯达克证券交易所	美国	1,966.00	2,061,438.97	1.71
13	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	1,761.00	1,520,973.94	1.26
14	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	1,287.00	1,460,908.49	1.21
15	Bio-Techne Corp	Bio-technique 公司	TECH US	纳斯达克证券交易所	美国	743.00	1,389,026.29	1.15
16	Horizon Therapeutics Plc	Horizon Therapeutic 公共有限公司	HZNP US	纳斯达克证券交易所	美国	3,222.00	1,267,788.08	1.05
17	Mylan NV	迈兰公司	MYL US	纳斯达克证券交易所	美国	10,031.00	1,141,912.59	0.95
18	Ionis	Ionis 制药	IONS US	纳斯达克	美国	2,455.00	1,024,734.97	0.85

	Pharmaceuticals Inc	股份有限公司		克证券交易所				
19	BeiGene Ltd	百济神州	BGNE US	纳斯达克证券交易所	美国	733.00	977,659.13	0.81
20	Exelixis Inc	Exelixis 股份有限公司	EXEL US	纳斯达克证券交易所	美国	5,782.00	971,765.30	0.81
21	Jazz Pharmaceuticals PLC	爵士制药有限公司	JAZZ US	纳斯达克证券交易所	美国	1,182.00	923,321.70	0.77
22	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	1,263.00	869,909.63	0.72
23	Takeda Pharmaceutical Co Ltd	武田药品工业	TAK US	纽约证券交易所	美国	6,738.00	855,290.96	0.71
24	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	2,438.00	836,583.52	0.69
25	Syneos Health Inc	Syneos 健康股份有限公司	SYNH US	纳斯达克证券交易所	美国	2,009.00	828,473.18	0.69
26	Immunomedics Inc	Immunomedics 股份有限公司	IMMU US	纳斯达克证券交易所	美国	3,266.00	819,431.17	0.68
27	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	745.00	780,058.25	0.65
28	Repligen Corp	Repligen 公司	RGEN US	纳斯达克证券交易所	美国	861.00	753,458.51	0.63
29	Novocure Ltd	Novocure 有限公司	NVCR US	纳斯达克证券交易所	美国	1,778.00	746,429.91	0.62
30	United Therapeutics Corp	联合治疗公司	UTHR US	纳斯达克证券交易所	美国	859.00	735,836.15	0.61
31	Acceleron Pharma Inc	Acceleron 制药股份有限公司	XLRN US	纳斯达克证券交易所	美国	905.00	610,389.89	0.51

32	Nektar Therapeutics	内克塔治疗公司	NKTR US	纳斯达克证券交易所	美国	3,346.00	548,614.24	0.46
33	Ultragenyx Pharmaceuticals Inc	Ultragenyx 制药股份有限公司	RARE US	纳斯达克证券交易所	美国	983.00	544,344.60	0.45
34	MyoKardia Inc	MyoKardia 股份有限公司	MYOK US	纳斯达克证券交易所	美国	786.00	537,640.73	0.45
35	Halozyne Therapeutics Inc	Halozyne Therapeutics 股份有限公司	HALO US	纳斯达克证券交易所	美国	2,813.00	533,911.32	0.44
36	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	1,715.00	524,384.58	0.44
37	CRISPR Therapeutics AG	CRISPR 治疗股份有限公司	CRSP US	纳斯达克证券交易所	美国	932.00	484,893.93	0.40
38	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	865.00	477,653.87	0.40
39	China Biologic Products Holdings Inc	泰邦生物控股公司	CBPO US	纳斯达克证券交易所	美国	658.00	475,986.22	0.39
40	FibroGen Inc	FibroGen 股份有限公司	FGEN US	纳斯达克证券交易所	美国	1,640.00	470,568.70	0.39
41	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	705.00	464,267.24	0.39
42	GW Pharmaceuticals PLC	GW 制药公共有限公司	GWPH US	纳斯达克证券交易所	美国	530.00	460,462.01	0.38
43	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	1,022.00	456,761.27	0.38
44	Reata Pharmaceuticals	Reata 制药股份有限公司	RETA US	纳斯达克证券交易所	美国	406.00	448,444.70	0.37

	uticals Inc	公司		交易所				
45	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	971.00	432,730.54	0.36
46	Agios Pharmace uticals Inc	Agios 制药 公司	AGIO US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,133.00	428,967.01	0.36
47	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	989.00	427,379.22	0.35
48	Alkermes PLC	Alkermes 公共有限 公司	ALKS US	纳斯达 克证券 交易所	美国	3,027.00	415,842.33	0.35
49	ChemoCe ntryx Inc	ChemoCent ryx 股份有 限公司	CCXI US	纳斯达 克证券 交易所	美国	968.00	394,319.09	0.33
50	Amicus Therapeut ics Inc	Amicus Therapeutic s 股份有限 公司	FOLD US	纳斯达 克证券 交易所	美国	3,674.00	392,232.05	0.33
51	Grifols SA	基立福公 司	GRFS US	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,823.00	364,534.22	0.30
52	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	1,523.00	358,719.75	0.30
53	Ligand Pharmace uticals Inc	Ligand 制 药股份有 限公司	LGND US	纳斯达 克证券 交易所	美国	431.00	341,283.93	0.28
54	Iovance Biotherap eutics 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	1,756.00	341,247.47	0.28
55	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	1,784.00	340,373.86	0.28
56	PTC Therapeut ics Inc	PTC 治疗 股份有限 公司	PTCT US	纳斯达 克证券 交易所	美国	917.00	329,399.08	0.27
57	Pacira BioScienc es 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	804.00	298,654.94	0.25
58	Galapagos NV	Galapagos 制药公司	GLPG US	纳斯达 克证券	美国	213.00	297,500.20	0.25

				交易所				
59	Insmed Inc	Insmed 股份有限公司	INSM US	纳斯达克证券交易所	美国	1,504.00	293,234.02	0.24
60	Amarin Corp PLC	Amarin 公共有限公司	AMRN US	纳斯达克证券交易所	美国	5,676.00	278,068.03	0.23
61	Exact Sciences Corp	Exact 科学公司	EXAS US	纳斯达克证券交易所	美国	442.00	272,047.34	0.23
62	Sage Therapeutics Inc	Sage Therapeutics 公司	SAGE US	纳斯达克证券交易所	美国	920.00	270,816.36	0.22
63	OPKO Health Inc	Opko 健康公司	OPK US	纳斯达克证券交易所	美国	10,884.00	262,751.68	0.22
64	Xencor Inc	Xencor 股份有限公司	XNCR US	纳斯达克证券交易所	美国	1,094.00	250,859.68	0.21
65	uniQure NV	uniQure 股份有限公司	QURE US	纳斯达克证券交易所	美国	720.00	229,681.63	0.19
66	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	381.00	224,819.08	0.19
67	Luminex Corp	Luminex 公司	LMNX US	纳斯达克证券交易所	美国	877.00	201,969.71	0.17
68	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	587.00	199,097.98	0.17
69	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	2,696.00	196,970.95	0.16
70	Innoviva Inc	Innoviva 股份有限公司	INVA US	纳斯达克证券交易所	美国	1,987.00	196,656.19	0.16
71	Intra-Cellular Therapies Inc	Intra-Cellular Therapies 公司	ITCI US	纳斯达克证券交易所	美国	1,077.00	195,724.03	0.16
72	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	932.00	195,171.62	0.16

73	Esperion Therapeutics Inc	Esperion Therapeutics 公司	ESPR US	纳斯达克证券交易所	美国	535.00	194,338.29	0.16
74	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	1,651.00	189,934.14	0.16
75	Cytokinetics Inc	Cytokinetics 股份有限公司	CYTK US	纳斯达克证券交易所	美国	1,069.00	178,377.42	0.15
76	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	1,020.00	171,500.89	0.14
77	Coherus Biosciences Inc	Coherus 生物科学公司	CHRS US	纳斯达克证券交易所	美国	1,316.00	166,394.87	0.14
78	REGENXBIO Inc	REGENXBIO 股份有限公司	RGNX US	纳斯达克证券交易所	美国	637.00	166,090.10	0.14
79	MacroGenics Inc	MacroGenics 股份有限公司	MGNX US	纳斯达克证券交易所	美国	835.00	165,045.80	0.14
80	Portola Pharmaceuticals Inc	Portola 制药股份有限公司	PTLA US	纳斯达克证券交易所	美国	1,292.00	164,549.38	0.14
81	Akcea Therapeutics Inc	Akcea Therapeutics 股份有限公司	AKCA US	纳斯达克证券交易所	美国	1,676.00	162,553.82	0.13
82	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	1,081.00	160,635.20	0.13
83	Karyopharm Therapeutics Inc	Karyopharm Therapeutics 股份有限公司	KPTI US	纳斯达克证券交易所	美国	1,189.00	159,427.93	0.13
84	Epizyme Inc	Epizyme 股份有限公司	EPZM US	纳斯达克证券交易所	美国	1,363.00	154,968.70	0.13
85	Amphastar Pharmaceuticals Inc	Amphastar 制药公司	AMPH US	纳斯达克证券交易所	美国	920.00	146,285.12	0.12
86	NantKwest	NantKwest	NK US	纳斯达克	美国	1,598.00	138,924.14	0.12

	t Inc	股份有限 公司		克证券 交易所				
87	Enanta Pharmace uticals Inc	Enanta 制 药公司	ENTA US	纳斯达 克证券 交易所	美国	387.00	137,563.68	0.11
88	Aimmune Therapeut ics Inc	Aimmune 医疗股份 有限公司	AIMT US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,145.00	135,451.72	0.11
89	Zogenix Inc	Zogenix 股 份有限公 司	ZGNX US	纳斯达 克证券 交易所	美国	699.00	133,660.89	0.11
90	Intellia Therapeut ics Inc	Intellia Therapeutic s 股份有 限公司	NTLA US	纳斯达 克证券 交易所	美国	852.00	126,787.05	0.11
91	Sangamo Therapeut ics 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	1,988.00	126,103.45	0.10
92	Revance Therapeut ics Inc	Revance Therapeutic s 股份有 限公司	RVNC US	纳斯达 克证券 交易所	美国	729.00	126,030.53	0.10
93	Veracyte Inc	Veracyte 股 份有限公 司	VCYT US	纳斯达 克证券 交易所	美国	683.00	125,234.23	0.10
94	Athenex Inc	Athenex 股 份有限公 司	ATNX US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,248.00	121,572.57	0.10
95	Cerus Corp	Cerus 公司	CERS US	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,551.00	119,194.71	0.10
96	Retrophin Inc	Retrophin 股份有限 公司	RTRX US	纳斯达 克证券 交易所	美国	790.00	114,149.15	0.09
97	G1 Therapeut ics Inc	-	GTHX US	纳斯达 克证券 交易所	美国	651.00	111,808.38	0.09
98	Myriad Genetics Inc	米利亚德 基因公司	MYGN US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,373.00	110,226.54	0.09
99	Akebia Therapeut ics Inc	Akebia Therapeutic s 股份有 限公司	AKBA US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,118.00	107,484.08	0.09

100	NanoString Technologies Inc	NanoString 技术公司	NSTG US	纳斯达克证券交易所	美国	514.00	106,800.63	0.09
101	Endo International PLC	远藤国际 公司	ENDP US	纳斯达克证券交易所	美国	4,361.00	105,896.79	0.09
102	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	302.00	102,581.67	0.09
103	Omeros Corp	Omeros 公 司	OMER US	纳斯达克证券交易所	美国	953.00	99,312.36	0.08
104	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	1,388.00	98,361.72	0.08
105	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	868.00	89,532.74	0.07
106	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	899.00	86,747.73	0.07
107	ImmunoGen Inc	英基股份 有限公司	IMGN US	纳斯达克证券交易所	美国	2,598.00	84,605.69	0.07
108	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	1,027.00	83,176.20	0.07
109	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	783.00	81,818.35	0.07
110	NantHealth Inc	NantHealth 股份有限 公司	NH US	纳斯达克证券交易所	美国	2,520.00	81,708.76	0.07
111	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	656.00	81,272.66	0.07
112	PetIQ Inc	PetIQ 股份 有限公司	PETQ US	纳斯达克证券交易所	美国	329.00	81,147.78	0.07
113	Cara Therapeutics Inc	Cara Therapeutics 公司	CARA US	纳斯达克证券交易所	美国	651.00	78,809.70	0.07

114	Mersana Therapeutics Inc	-	MRSN US	纳斯达克证券交易所	美国	461.00	76,369.40	0.06
115	Kura Oncology Inc	Kura 肿瘤学股份有限公司	KURA US	纳斯达克证券交易所	美国	661.00	76,276.66	0.06
116	AnaptysBio Inc	AnaptysBio 股份有限公司	ANAB US	纳斯达克证券交易所	美国	471.00	74,491.49	0.06
117	Flexion Therapeutics Inc	Flexion Therapeutics 公司	FLXN US	纳斯达克证券交易所	美国	744.00	69,263.00	0.06
118	Corbus Pharmaceuticals Holdings Inc	Corbus 制药控股股份有限公司	CRBP US	纳斯达克证券交易所	美国	1,125.00	66,821.63	0.06
119	BioCryst Pharmaceuticals Inc	BioCrys 制药股份有限公司	BCRX US	纳斯达克证券交易所	美国	1,936.00	65,308.67	0.05
120	Pacific Biosciences 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	2,578.00	62,965.78	0.05
121	PDL BioPharma 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	2,940.00	60,567.95	0.05
122	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	58,352.64	0.05
123	Ardelyx Inc	Ardelyx 股份有限公司	ARDX US	纳斯达克证券交易所	美国	1,184.00	58,004.33	0.05
124	Voyager Therapeutics Inc	Voyager 医疗股份有限公司	VYGR US	纳斯达克证券交易所	美国	643.00	57,447.74	0.05
125	ANI Pharmaceuticals Inc	ANI 制药股份有限公司	ANIP US	纳斯达克证券交易所	美国	242.00	55,406.15	0.05
126	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	748.00	55,231.71	0.05
127	Geron Corp	杰龙公司	GERN US	纳斯达克证券交易所	美国	3,426.00	52,874.52	0.04

				交易所				
128	Syndax Pharmaceuticals Inc	Syndax 制药股份有限公司	SNDX US	纳斯达克证券交易所	美国	496.00	52,039.42	0.04
129	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	1,034.00	49,411.37	0.04
130	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	2,038.00	48,766.71	0.04
131	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	829.00	47,420.76	0.04
132	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	773.00	45,585.54	0.04
133	Lantheus Holdings Inc	Lantheus 控股股份有限公司	LNTH US	纳斯达克证券交易所	美国	449.00	45,455.35	0.04
134	TherapeuticsMD Inc	Therapeutic sMD 股份有限公司	TXMD US	纳斯达克证券交易所	美国	4,773.00	42,238.07	0.04
135	Rigel Pharmaceuticals Inc	Rigel 制药公司	RIGL US	纳斯达克证券交易所	美国	3,193.00	41,366.86	0.03
136	AMAG Pharmaceuticals Inc	AMAG 制药公司	AMAG US	纳斯达克证券交易所	美国	717.00	38,831.41	0.03
137	Kala Pharmaceuticals Inc	Kala 制药股份有限公司	KALA US	纳斯达克证券交易所	美国	492.00	36,607.53	0.03
138	MannKind Corp	曼恩凯德公司	MNKD US	纳斯达克证券交易所	美国	2,888.00	35,779.79	0.03
139	Elanco Animal Health Inc	Elanco 动物健康股份有限公司	ELAN US	纽约证券交易所	美国	222.00	33,711.87	0.03
140	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	470.00	33,107.28	0.03
141	Jounce Therapeutics	Jounce Therapeutic	JNCE US	纳斯达克证券交易所	美国	646.00	31,556.16	0.03

	ics Inc	s 股份有限 公司		交易所				
142	Five Prime Therapeutics Inc	Five Prime Therapeutics 股份有限公司	FPRX US	纳斯达克证券交易所	美国	699.00	30,186.28	0.03
143	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	2,071.00	29,250.02	0.02
144	Collectis SA	Collectis 公司	CLLS US	纳斯达克证券交易所	美国	224.00	28,227.38	0.02
145	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	802.00	27,026.13	0.02
146	Calithera Biosciences Inc	Calithera 生物科学公司	CALA US	纳斯达克证券交易所	美国	712.00	26,614.39	0.02
147	Aduro Biotech Inc	Aduro 生物科技股份有限公司	ADRO US	纳斯达克证券交易所	美国	1,622.00	26,525.61	0.02
148	Strongbridge Biopharma PLC	Strongbridge 生物制药公共有限公司	SBBP US	纳斯达克证券交易所	美国	900.00	24,084.46	0.02
149	Paratek Pharmaceuticals Inc	Paratek 制药公司	PRTK US	纳斯达克证券交易所	美国	630.00	23,281.64	0.02
150	GlycoMimetics Inc	GlycoMimetics 股份有限公司	GLYC US	纳斯达克证券交易所	美国	841.00	22,386.51	0.02
151	Calyxt Inc	Calyxt 股份有限公司	CLXT US	纳斯达克证券交易所	美国	630.00	21,988.22	0.02
152	Chimerix Inc	Chimerix 股份有限公司	CMRX US	纳斯达克证券交易所	美国	940.00	20,629.66	0.02
153	Minerva Neurosciences Inc	Minerva 神经科学股份有限公司	NERV US	纳斯达克证券交易所	美国	768.00	19,627.77	0.02
154	Cyclerion Therapeutics Inc	-	CYCN US	纳斯达克证券交易所	美国	464.00	19,413.69	0.02

155	Celldex Therapeutics Inc	Celldex 治疗股份有限公司	CLDX US	纳斯达克证券交易所	美国	200.00	18,406.70	0.02
156	DBV Technologies SA	DBV 技术公司	DBVT US	纳斯达克证券交易所	美国	532.00	16,534.03	0.01
157	Arbutus Biopharma Corp	Arbutus 生物制药公司	ABUS US	纳斯达克证券交易所	美国	1,142.00	14,714.32	0.01
158	Marinus Pharmaceuticals Inc	Marinus 制药股份有限公司	MRNS US	纳斯达克证券交易所	美国	815.00	14,655.27	0.01
159	Savara Inc	Savara 股份有限公司	SVRA US	纳斯达克证券交易所	美国	668.00	11,775.47	0.01
160	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	580.00	11,168.62	0.01
161	Lumos Pharma Inc	Lumos 制药股份有限公司	LUMO US	纳斯达克证券交易所	美国	88.00	10,273.20	0.01
162	Adamas Pharmaceuticals Inc	Adamas 制药股份有限公司	ADMS US	纳斯达克证券交易所	美国	539.00	9,768.58	0.01
163	Aclaris Therapeutics Inc	Aclaris 医疗股份有限公司	ACRS US	纳斯达克证券交易所	美国	651.00	7,466.18	0.01
164	Menlo Therapeutics Inc	-	MNLO US	纳斯达克证券交易所	美国	586.00	7,177.06	0.01
165	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	352.00	7,052.31	0.01
166	Axovant Gene Therapies Ltd	Axovant 基因疗法有限公司	AXGT US	纳斯达克证券交易所	美国	275.00	5,490.15	0.00
167	Bellicum Pharmaceuticals Inc	Bellicum 制药股份有限公司	BLCM US	纳斯达克证券交易所	美国	101.00	5,312.67	0.00
168	Forte Biosciences Inc	-	FBRX US	纳斯达克证券交易所	美国	33.00	3,406.23	0.00
169	Immunic	Immunic 公	IMUX US	纳斯达克	美国	34.00	2,917.32	0.00

	Inc	司		克证券 交易所				
170	Tetraphase Pharmaceuticals Inc	Tetraphase 制药公司	TTPH US	纳斯达克 证券 交易所	美国	65.00	1,159.62	0.00
171	Insys Therapeutics Inc	Insys Therapeutics 股份有限公司	INSYQ US	美国场 外交易 市场	美国	2,656.00	789.72	0.00
172	Synergy Pharmaceuticals Inc	Synergy 制 药股份有 限公司	SGYPQ US	美国场 外交易 市场	美国	9,201.00	214.93	0.00
173	Achaogen Inc	Achaogen 股份有限 公司	AKAOQ US	美国场 外交易 市场	美国	1,615.00	160.07	0.00
174	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	62.16	0.00

注：此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

7.5 报告期内权益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	Gilead Sciences Inc	GILD US	1,567,947.47	0.98
2	Lantheus Holdings Inc	LNTH US	45,373.73	0.03
3	Menlo Therapeutics Inc	MNLO US	22,635.32	0.01

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	Gilead Sciences Inc	GILD US	4,748,051.87	2.96
2	Amgen Inc	AMGN US	4,737,617.28	2.95
3	Bristol-Myers Squibb Co	BMY US	4,265,032.44	2.66
4	Biogen Inc	BIIB US	3,735,079.67	2.33
5	Regeneron Pharmaceuticals Inc	REGN US	3,319,808.97	2.07
6	Vertex Pharmaceuticals Inc	VRTX US	3,162,469.14	1.97
7	Illumina Inc	ILMN US	2,845,073.74	1.77
8	Alexion Pharmaceuticals Inc	ALXN US	1,447,377.05	0.90
9	Seattle Genetics Inc	SGEN US	1,374,251.10	0.86
10	Medicines Co/The	MDCO US	1,235,550.23	0.77
11	Incyte Corp	INCY US	1,205,813.46	0.75
12	BioMarin Pharmaceutical Inc	BMRN US	1,052,620.12	0.66
13	Alnylam Pharmaceuticals Inc	ALNY US	820,961.15	0.51
14	Neurocrine Biosciences Inc	NBIX US	592,570.69	0.37
15	Mylan NV	MYL US	549,077.05	0.34
16	Sarepta Therapeutics Inc	SRPT US	529,505.81	0.33
17	Bio-Techne Corp	TECH US	522,570.42	0.33
18	Audentes Therapeutics Inc	BOLD US	433,194.37	0.27
19	Ionis Pharmaceuticals Inc	IONS US	428,929.21	0.27
20	Jazz Pharmaceuticals PLC	JAZZ US	420,408.66	0.26

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	1,635,956.52
卖出收入（成交）总额	51,390,247.92

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 Nasdaq Biotechnology	ETF 基金	开放式	ProShare Advisors LLC	222,005.19	0.18

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中, ILLUMINA 收购 PacBio 因可能不利于市场竞争而被美国联邦贸易委员会阻止。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

除上述主体外, 本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查, 或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.11.2 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。

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	583.63
4	应收利息	207.06
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	790.69

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

本基金本报告期末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
11,502	8,494.06	0.00	0.00%	97,698,625.67	100.00%

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	161,449.18	0.1653%

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	0
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	-	-	10,000,200.0 2	10.24%	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	10.24%	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	144,014,710.07
本报告期基金总申购份额	27,427,142.50
减：本报告期基金总赎回份额	73,743,226.90
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	97,698,625.67

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

本基金管理人于 2020 年 7 月 11 日发布公告，自 2020 年 7 月 11 日起，邱春杨先生不再担任公司督察长，程才良先生新任公司督察长。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 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。

10.5 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。

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

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。

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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	----	------	-----------	----

	单元数量	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	
Citigroup	-	50,627,302.46	100.00%	15,783.86	100.00%	-
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：

- 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		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

Citigroup	-	-	-	-	-	-	2,206,650.54	100.00%
Credit Suisse	-	-	-	-	-	-	-	-
State Street Global Markets International Ltd.	-	-	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs Group Inc.	-	-	-	-	-	-	-	-

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	关于旗下部分基金继续暂停申购等业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-06-22
2	关于旗下部分基金继续暂停申购等业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-06-08
3	关于旗下部分基金继续暂停申购等业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-05-25
4	关于旗下部分基金暂停 C 类收费申购业务及开展费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-05-16
5	关于旗下部分基金继续暂停申购等业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-05-11
6	关于旗下部分基金继续暂停申购等业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-27
7	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-21
8	关于旗下部分基金继续暂停申购业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-13
9	关于旗下部分基金继续暂停申购业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-03-30
10	广发基金管理有限公司旗下基金 2019 年年度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-03-27
11	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	中国证监会指定报刊及网站	2020-03-13
12	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	中国证监会指定报刊及网站	2020-03-02
13	关于旗下基金调整申购（含定期定额投资）及转换转入确认业务规则的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-02-28
14	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	中国证监会指定报刊及网站	2020-02-12
15	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2019 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-01-17
16	关于增加中邮证券为旗下部分基金销售机构	中国证监会指定报刊及	2020-01-08

	的公告	网站	
--	-----	----	--

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：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
二〇二〇年八月二十七日