华夏国证疫苗与生物科技指数发起式证券投资基金

2026 年第 3 季度报告

2026 年 9 月 30 日

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年十月二十七日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华夏国证疫苗与生物科技指数发起式	
基金主代码	016355	
交易代码	016355	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 9 月 6 日	
报告期末基金份额总额	255,156,956.23 份	
投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。在正常市场情况下，力争控制本基金的份额净值与业绩比较基准的收益率日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%	
投资策略	主要投资策略包括股票投资策略，存托凭证投资策略，债券投资策略，资产支持证券投资策略，衍生品投资策略，融资、转融通证券出借业务投资策略等。	
业绩比较基准	国证疫苗与生物科技指数收益率×95%＋人民币活期存款税后利率×5%	
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。	
基金管理人	华夏基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华夏国证疫苗与生物科技指数发起式 A	华夏国证疫苗与生物科技指数发起式 C
下属分级基金的交易代码	016355	016356
报告期末下属分级基金的份额总额	105,390,559.28 份	149,766,396.95 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2026 年 7 月 1 日-2026 年 9 月 30 日）	
	华夏国证疫苗与生物科技指数发起式 A	华夏国证疫苗与生物科技指数发起式 C
1.本期已实现收益	-1,803,334.66	-2,650,452.10
2.本期利润	6,679,488.62	8,370,546.76
3.加权平均基金份额本期利润	0.0625	0.0537

4.期末基金资产净值	66,485,066.92	93,334,893.51
5.期末基金份额净值	0.6308	0.6232

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华夏国证疫苗与生物科技指数发起式 A：

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	11.10%	2.23%	10.82%	2.24%	0.28%	-0.01%
过去六个月	-0.13%	1.98%	-1.20%	1.99%	1.07%	-0.01%
过去一年	-15.02%	1.67%	-16.35%	1.68%	1.33%	-0.01%
过去三年	-25.27%	1.66%	-27.33%	1.68%	2.06%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-36.92%	1.60%	-41.44%	1.61%	4.52%	-0.01%

华夏国证疫苗与生物科技指数发起式 C：

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	11.03%	2.23%	10.82%	2.24%	0.21%	-0.01%
过去六个月	-0.27%	1.98%	-1.20%	1.99%	0.93%	-0.01%
过去一年	-15.27%	1.67%	-16.35%	1.68%	1.08%	-0.01%
过去三年	-25.94%	1.66%	-27.33%	1.68%	1.39%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-37.68%	1.60%	-41.44%	1.61%	3.76%	-0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏国证疫苗与生物科技指数发起式证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2022 年 9 月 6 日至 2026 年 9 月 30 日）

华夏国证疫苗与生物科技指数发起式 A：



华夏国证疫苗与生物科技指数发起式 C：



§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
鲁亚运	本基金的基金经理	2022-09-06	-	11 年	硕士。曾任国泰基金管理

					有限公司研究员、银华基金管理有限公司营销经理。2020 年 6 月加入华夏基金管理有限公司。历任数量投资部研究员、基金经理助理、华夏恒生互联网科技业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）基金经理（2022 年 6 月 10 日至 2024 年 7 月 3 日期间)、华夏中证石化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（2023 年 3 月 14 日至 2024 年 11 月 7 日期间)、华夏中证石化产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2023 年 3 月 27 日至 2024 年 11 月 7 日期间)、华夏中证农业主题交易型开放式指数证券投资基

					金基金经理（2024 年 5 月 31 日至 2025 年 7 月 29 日期间）、华夏中证农业主题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（2022 年 8 月 19 日至 2025 年 9 月 9 日期间）、华夏中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（2023 年 11 月 8 日至 2025 年 9 月 9 日期间）、华夏中证物联网主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（2023 年 11 月 10 日至 2025 年 9 月 9 日期间）、华夏中证浙江国资创新发展交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2023 年 3 月 27 日至 2026 年 6 月 11 日期间）、

					华夏中证浙江国资创新发展交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2023 年 3 月 27 日至 2026 年 6 月 11 日期间)等。

注：①上述“任职日期”和“离任日期”为根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。首任基金经理的，其“任职日期”为基金合同生效日。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》等法律法规和基金合同，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《华夏基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人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 32 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要发生的反向交易。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪的标的指数为国证疫苗与生物科技指数，基金业绩比较基准为：国证疫苗与生物科技指数收益率×95%＋人民币活期存款税后利率×5%，国证疫苗与生物科技指数由业务涉及生物科技产业的 A 股上市公司组成，包括疫苗、血液制品、生物药物、生物检验、生物技术服务等细分领域，反映 A 股市场的生物科技产业中优质上市公司的整体表现。本基金主要采取复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。

三季度，宏观层面延续“外需强于内需、生产强于需求”的分化，7-8 月出口延续快速增长态势。制造业景气回升，PMI 由 7 月 49.2%抬升至 9 月 50.1%，供给端走强。高技术制造业 PMI 三季度均值在 52%以上，装备制造业 PMI 均值在 51%以上，持续位于扩张区间。而社会消费品零售总额 7 月同比增长 0.6%、8 月同比增长 0.4%，大宗消费承压，但通讯器材、服务消费等韧性较强，结构性机会好于总量机会。固定资产投资与地产链仍处于调整期。

外部环境方面，中东局势反复对油价与通胀扰动不断，美债利率高位与美联储加息周期对估值形成压制，放大市场波动。

市场表现上，第三季度 A 股经历先快跌、后震荡的再平衡行情。7 月高拥挤科技交易松动后，资金从电子、通信、电力设备等成长主线阶段性切向红利、周期等品种，第三季度成交缩量、风险偏好降温。行业层面，煤炭、石油石化等资源类及银行、地产、农林牧渔等领涨，而电子、通信、电力设备等此前强势板块回撤明显。港股方面，第三季度呈现冲高回落、结构分化格局，7 月上冲后连续两月回调，资源与金融相对占优，科技承压。

基金投资运作方面，报告期内，本基金在做好跟踪标的指数的基础上，认真应对投资者日常申购、赎回等工作。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2026 年 9 月 30 日，华夏国证疫苗与生物科技指数发起式 A 基金份额净值为 0.6308 元，本报告期份额净值增长率为 11.10%，同期业绩比较基准增长率为 10.82%，本报告期跟踪偏离度为+0.28%；华夏国证疫苗与生物科技指数发起式 C 基金份额净值为 0.6232 元，本报告期份额净值增长率为 11.03%，同期业绩比较基准增长率为 10.82%，本报告期跟踪偏离度为+0.21%。与业绩比较基准产生偏离的主要原因为日常运作费用、指数结构调整、申购赎回、成份股分红等产生的差异。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	151,561,512.04	93.77
	其中：股票	151,561,512.04	93.77
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	9,093,439.55	5.63
8	其他各项资产	970,204.91	0.60
9	合计	161,625,156.50	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	119,102,709.98	74.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	5,400,069.00	3.38
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-

L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	25,729,046.00	16.10
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,329,687.06	0.83
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	151,561,512.04	94.83

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600196	复星医药	760,053	18,256,473.06	11.42
2	300142	沃森生物	965,200	13,734,796.00	8.59
3	000661	长春高新	179,900	12,922,217.00	8.09
4	603127	昭衍新药	249,615	12,306,019.50	7.70
5	300122	智飞生物	672,885	9,406,932.30	5.89
6	002007	华兰生物	604,290	8,061,228.60	5.04
7	603259	药明康德	40,800	6,827,472.00	4.27
8	000513	丽珠集团	204,100	6,714,890.00	4.20
9	603392	万泰生物	206,978	5,658,778.52	3.54
10	600739	辽宁成大	528,900	5,400,069.00	3.38

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

5.11.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同约定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	21,797.58
2	应收证券清算款	606,186.15
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	342,221.18
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	970,204.91

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华夏国证疫苗与生物科技指数发起式 A	华夏国证疫苗与生物科技指数发起式 C
报告期期初基金份额总额	102,416,112.59	156,215,912.95
报告期期间基金总申购份额	28,563,887.75	122,812,280.06
减：报告期期间基金总赎回份额	25,589,441.06	129,261,796.06
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	105,390,559.28	149,766,396.95

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

项目	华夏国证疫苗与生物科技指数发起式 A	华夏国证疫苗与生物科技指数发起式 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	10,011,251.13	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,011,251.13	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	9.50	-

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

截至 2025 年 9 月 6 日，华夏国证疫苗与生物科技指数发起式证券投资基金的基金合同生效届满三年。

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期无需要披露的单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、报告期内披露的主要事项

本基金本报告期内无需要披露的主要事项。

2、其他相关信息

华夏基金管理有限公司成立于 1998 年 4 月 9 日，是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京，在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、广州、青岛、武汉及沈阳设有分公司，在香港、深圳、上海、北京设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批 QDII 基金管理人、境内首只 ETF 基金管理人、境内首只沪港通 ETF 基金管理人、首批内地与香港基金互认基金管理人、首批基本养老保险基金投资管理人、首家加入联合国责任投资原则组织的公募基金公司、首批公募 FOF 基金管理人、首批公募养老目标基金管理人、首批个人养老金基金管理人、境内首批中日互通 ETF 基金管理人、首批商品期货 ETF 基金管理人、首批纳入互联互通 ETF 基金管理人、首批北交所主题基金管理人以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人、公募 REITs 管理人、首批浮动管理费基金管理人、首批公募 REITs 指数基金管理人，境内首家承诺“碳中和”具体目标和路径的公募基金公司，香港子公司是首批 RQFII 基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

1、中国证监会准予基金注册的文件；

2、基金合同；

3、托管协议；

4、法律意见书；

5、基金管理人业务资格批件、营业执照；

6、基金托管人业务资格批件、营业执照。

10.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

10.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

华夏基金管理有限公司

二〇二六年十月二十七日