

广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金  
2025 年年度报告  
2025 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：二〇二六年三月三十日

## §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 2026 年 3 月 26 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 2025 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>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§2 基金简介</b>	<b>5</b>
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	7
2.5 信息披露方式	7
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>	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	9
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
<b>§4 管理人报告</b>	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	15
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	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	18
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	19
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	19
<b>§5 托管人报告</b>	<b>19</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	19
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	19
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	19
<b>§6 审计报告</b>	<b>19</b>
6.1 审计意见	19
6.2 形成审计意见的基础	20
6.3 其他信息	20
6.4 管理层和治理层对财务报表的责任	20
6.5 注册会计师对财务报表审计的责任	20
<b>§7 年度财务报表</b>	<b>21</b>
7.1 资产负债表	21
7.2 利润表	23
7.3 净资产变动表	25
7.4 报表附注	26
<b>§8 投资组合报告</b>	<b>53</b>
8.1 期末基金资产组合情况	53
8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	54

8.3 期末按行业分类的权益投资组合 .....	54
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 .....	55
8.5 报告期内权益投资组合的重大变动 .....	75
8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合 .....	76
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 .....	76
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 .....	77
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 .....	77
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 .....	77
8.11 投资组合报告附注 .....	77
<b>§9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>78</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	78
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	78
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 .....	78
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	79
<b>§10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>79</b>
<b>§11 重大事件揭示.....</b>	<b>79</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	80
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 .....	80
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	80
11.4 基金投资策略的改变 .....	80
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	80
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 .....	80
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	80
11.8 其他重大事件 .....	86
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>87</b>
12.1 影响投资者决策的其他重要信息 .....	87
<b>§13 备查文件目录.....</b>	<b>87</b>
13.1 备查文件目录 .....	87
13.2 存放地点 .....	88
13.3 查阅方式 .....	88

## §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	
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	141,114,612.27 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	广发生物科技指数（QDII） A	广发生物科技指数 （QDII）C
下属分级基金的交易代码	001092	016470
报告期末下属分级基金的份额总额	109,178,917.91 份	31,935,694.36 份

注：广发生物科技指数（QDII）A 含 A 类人民币份额（份额代码：001092）及 A 类美元现汇份额（份额代码：001093），交易代码仅列示 A 类人民币份额代码；广发生物科技指数（QDII）C 含 C 类人民币份额（份额代码：016470）及 C 类美元现汇份额（份额代码：016471），交易代码仅列示 C 类人民币份额代码。

### 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	项军	郭明
	联系电话	020-83936666	010-66105799
	电子邮箱	xiangj@gffunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95105828	95588
传真		020-34281105	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		广东省广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼；广东省珠海市横琴新区环岛东路3018号2603-2622室	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		葛长伟	廖林

## 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	广东省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）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
注册登记机构	广发基金管理有限公司	广东省广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼；广东省珠海市横琴新区环岛东路 3018 号 2603-2622 室

## §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	2025 年		2024 年		2023 年	
	广发生物科技指数 (QDII) A	广发生物科技指数 (QDII) C	广发生物科技指数 (QDII) A	广发生物科技指数 (QDII) C	广发生物科技指数 (QDII) A	广发生物科技指数 (QDII) C
本期已实现收	7,472,373.64	1,853,068.71	4,028,039.50	190,186.18	3,829,747.19	62,029.60

益						
本期利润	32,677,807.21	8,524,174.93	-133,770.96	-2,675,541.27	6,383,416.02	317,280.16
加权平均基金份额本期利润	0.2756	0.2160	-0.0012	-0.1566	0.0483	0.1900
本期加权平均净值利润率	22.37%	18.02%	-0.10%	-12.80%	4.41%	17.53%
本期基金份额净值增长率	25.36%	24.91%	-0.09%	-0.52%	5.11%	4.68%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末		2024 年末		2023 年末	
	广发生物科技指数 (QDII) A	广发生物科技指数 (QDII) C	广发生物科技指数 (QDII) A	广发生物科技指数 (QDII) C	广发生物科技指数 (QDII) A	广发生物科技指数 (QDII) C
期末可供分配利润	49,263,020.58	13,803,085.38	19,231,255.61	5,712,551.37	20,609,600.56	798,286.13
期末可供分配基金份额利润	0.4512	0.4322	0.1714	0.1562	0.1717	0.1618
期末基金资产净值	160,225,250.42	46,102,360.85	131,463,533.34	42,282,005.07	140,676,517.05	5,730,967.49
期末基金份额净值	1.468	1.444	1.171	1.156	1.172	1.162
3.1.3 累计期末指标	2025 年末		2024 年末		2023 年末	
	广发生物科技指数 (QDII) A	广发生物科技指数 (QDII) C	广发生物科技指数 (QDII) A	广发生物科技指数 (QDII) C	广发生物科技指数 (QDII) A	广发生物科技指数 (QDII) C
基金份额累计净值增长率	46.80%	34.58%	17.10%	7.74%	17.20%	8.29%

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) 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

##### 广发生物科技指数（QDII）A：

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	14.78%	1.17%	14.88%	1.17%	-0.10%	0.00%
过去六个月	29.34%	1.14%	30.76%	1.14%	-1.42%	0.00%
过去一年	25.36%	1.38%	27.98%	1.41%	-2.62%	-0.03%
过去三年	31.66%	1.16%	35.02%	1.18%	-3.36%	-0.02%
过去五年	18.96%	1.35%	28.41%	1.36%	-9.45%	-0.01%
自基金合同生效起至今	46.80%	1.48%	77.50%	1.48%	-30.70%	0.00%

##### 广发生物科技指数（QDII）C：

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	14.69%	1.18%	14.88%	1.17%	-0.19%	0.01%
过去六个月	29.16%	1.14%	30.76%	1.14%	-1.60%	0.00%
过去一年	24.91%	1.38%	27.98%	1.41%	-3.07%	-0.03%
过去三年	30.09%	1.16%	35.02%	1.18%	-4.93%	-0.02%
自基金合同生效起至今	34.58%	1.22%	41.17%	1.23%	-6.59%	-0.01%

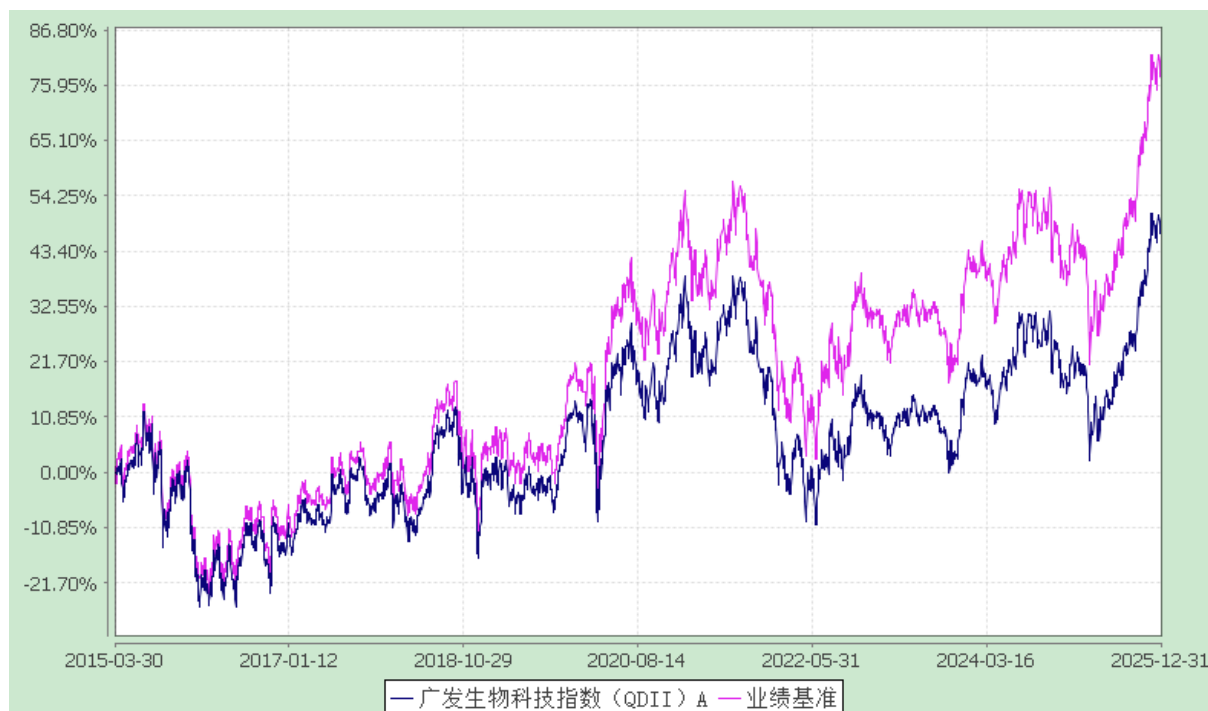
注：业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的，由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照合同规定比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

#### 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  
基金份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2015 年 3 月 30 日至 2025 年 12 月 31 日)

### 广发生物科技指数 (QDII) A



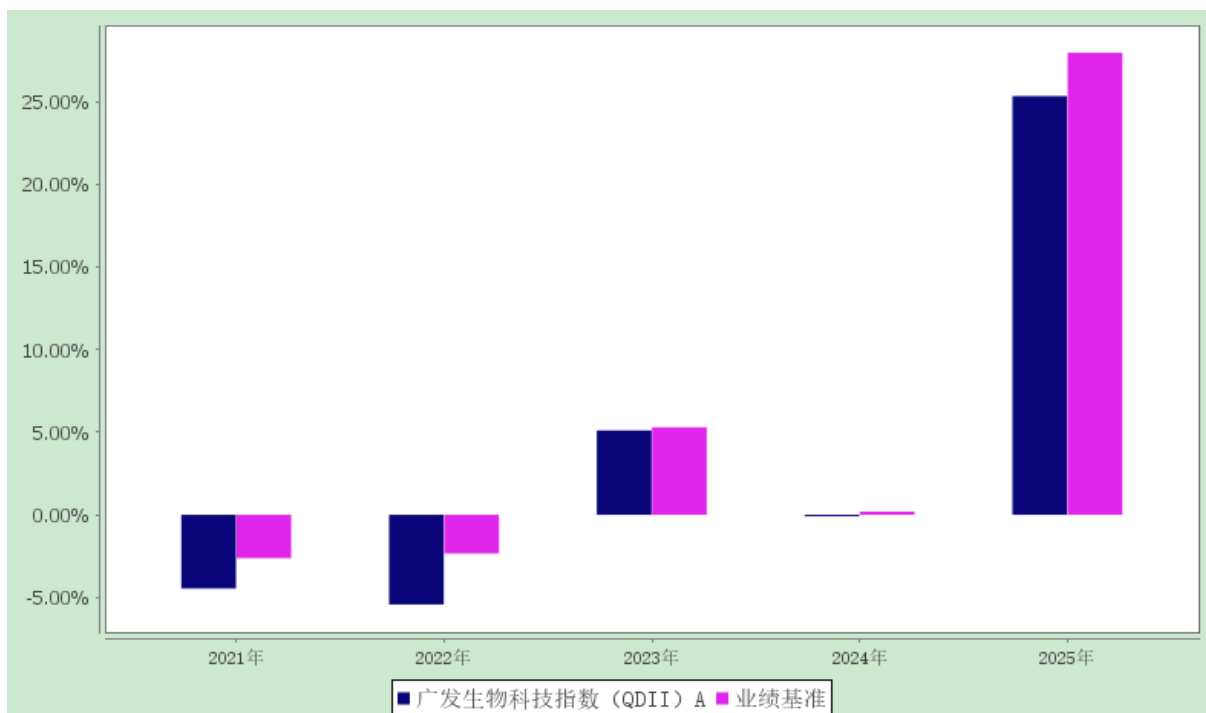
### 广发生物科技指数 (QDII) C



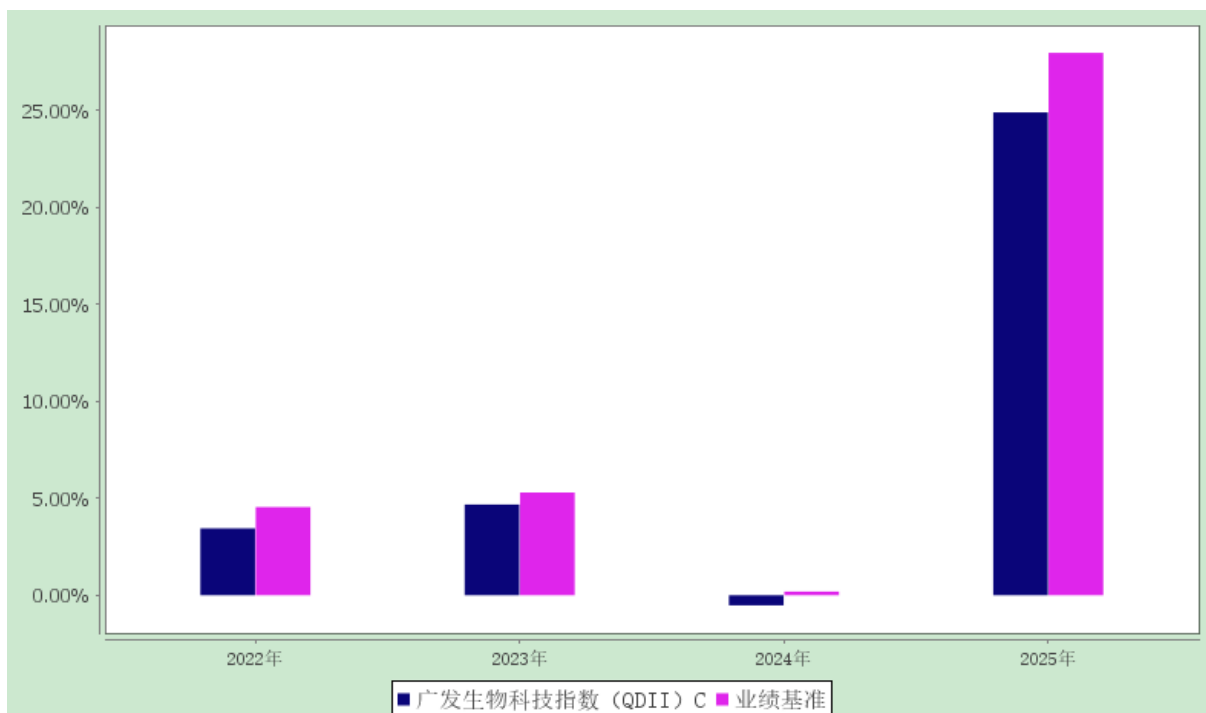
### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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

### 广发生物科技指数 (QDII) A



### 广发生物科技指数 (QDII) C



注：本基金自 2022 年起增设 C 类份额，C 类份额增设当年（2022 年）按实际存续期计算，未按自然年度折算。

### 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。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、QDLP 等业务资格，旗下产品覆盖主动权益、固定收益、海外投资、被动投资、量化投资、FOF 投资、另类投资等类别，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		
刘杰	本基金的基金经理；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；广发中证 500 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	2022-11-16	-	21.5 年	刘杰先生，中国籍，工学学士，持有中国证券投资基金从业证书。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)、广发中证养老产业指数型发起式证券投资基金

	<p>交易型开放式指数证券投资基金联接基金（QDII）的基金经理；广发恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理；广发中证香港创新药交易型开放式指数证券投资基金（QDII）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；广发北证 50 成份指数型证券投资基金的基金经理；广发恒生消费交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理；广发中证香港创新药交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）的基金经理；广发深证 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证红利交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发恒生消费交易型开放式指数</p>			<p>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</p>
--	--	--	--	---

	<p>证券投资基金发起式联接基金（QDII）的基金经理；广发深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理；广发中证港股通汽车产业主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证港股通汽车产业主题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；指数投资部总经理助理</p>			<p>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)、广发纳斯达克 100 指数证券投资基金基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2022 年 3 月 31 日)、广发恒生中国企业精明指数型发起式证券投资基金(QDII)基金经理(自 2019 年 5 月 9 日至 2022 年 4 月 28 日)、广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015 年 8 月 20 日至 2023 年 2 月 22 日)、广发沪深 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 18 日至 2023 年 2 月 22 日)、广发恒生科技指数证券投资基金(QDII)基金经理(自 2021 年 8 月 11 日至 2023 年 3 月 7 日)、广发港股通恒生综合中型股指数证券投资基金(LOF)基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2023 年 12 月 13 日)、广发美国房地产指数证券投资基金基金经理(自 2022 年 11 月 16 日至 2023 年 12 月 13 日)、广发恒生科技交易型开放式指数证券投资基金联接基金(QDII)基金经理(自 2023 年 3 月</p>
--	--	--	--	--

					8 日至 2024 年 3 月 30 日)。
--	--	--	--	--	------------------------

注：1.对基金的首任基金经理，“任职日期”为基金合同生效日/转型生效日，“离任日期”为公司公告解聘日期。对此后的非首任基金经理/基金经理助理，“任职日期”和“离任日期”分别指公司公告聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从中国证监会及行业协会相关规定。

#### 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

公司根据相关法律法规以及自律规则制定了《广发基金管理有限公司公平交易制度》等制度，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，通过持续完善工作制度、流程和提高技术手段保证公平交易原则的实现。同时，公司还通过事后分析、监察稽核和信息披露等手段加强对公平交易过程和结果的监督。

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，按照“时间优先、价格优先、比例分配、平等对待”的原则，公平分配投资指令。公司对投资交易实施全程动态监控，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；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；对于不同投资组合间的同时同向交易，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。

公司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。

#### 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 97 次，其中 84 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 13 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

2025 年上半年，美股整体经历宽幅震荡，三大指数均以上涨收官，其中纳指与标普 500 再创收盘历史新高。一季度市场表现偏弱，呈现先涨后跌格局，尤其在特朗普就任前后走势对比鲜明：年初 DeepSeek 横空出世，引发全球对中美在人工智能及科技领域实力的重新认知，资本市场掀起“东升西降”的预期重估，美股 AI 硬件核心厂商因此承压；4 月初，特朗普政府宣布并升级“对等关税”政策，引发全球市场剧烈波动，美股在二季度初大幅下挫，但随后因日内瓦会谈达成阶段性缓和而逐步修复，并开启持续反弹。这一轮修复既受益于美国经济数据仍具韧性、企业盈利未明显滑坡，也源于市场信心逐步重建——投资者对所谓“TACO 交易”持续抱有期待，叠加临近 7 月美联储下半年降息预期不断升温，共同推动美股回升，至 6 月底纳指创下历史新高。板块层面，科技股显著强于房地产、医药等板块，在“TACO 交易”趋势带动下，AI 算法迭代加速、算力供应链进展顺利，支撑科技板块在二季度稳步走强；而医药板块则受特朗普政府激进药价干预政策拖累，其试图通过行政手段大幅压降药价，却面临法律挑战、行业抵制及国际阻力，政策成效高度依赖执行细节、司法审查结果及全球产业链适应性，整体表现平平。进入三季度，美股震荡上行，在降息预期、科技产业爆发与特朗普政府政策扶持三重驱动下，呈现“指数突破、内部分化、强者恒强”的格局：7 月疲软经济数据强化降息预期，成为新推动力；8 月企业盈利预期改善，叠加白宫推出“大美丽法案”及市场对美联储鸽派立场的持续押注，推动大盘屡创新高；9 月美联储正式降息，联邦政府与英伟

达先后入股英特尔，促成科技巨头联手，进一步助推市场再攀高峰。科技板块估值抬升背后，是宏观经济政策支持、技术进步、盈利改善与情绪回暖的多重共振，其中 AI 技术的快速迭代与商业化落地成为核心驱动力。然而进入四季度，美股转为“高位震荡、结构分化、波动加剧”的态势，反映出投资者在高估值、政策不确定性及盈利验证压力下的谨慎情绪：一方面，市场对 AI 前景出现分歧，尽管“循环投资”占比较低，但美国科技巨头间相互投资的模式引发对其盈利可持续性的担忧；另一方面，美联储降息预期反复摇摆，伴随官员偏鹰派表态，持续扰动市场情绪，使美股在年末阶段维持高位震荡格局。

美联储降息的不断推进，降低了医药企业融资的成本，更有利于提升医药研发的进度，整体有利于市场医药类股票的表现。

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 A 类基金份额净值增长率为 25.36%，C 类基金份额净值增长率为 24.91%，同期业绩比较基准收益率为 27.98%。

#### 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 2026 年，美股市场将进入一个关键的观察期。一方面，美联储降息周期的开启有望缓解高利率压力，为市场提供更宽松的流动性环境；另一方面，市场对科技巨头的高估值已充分反映乐观预期，未来走势将更依赖于 AI 技术能否实现大规模商业化变现及盈利的持续高增长。若美国经济能实现“软着陆”，美股有望维持温和上涨，但波动性可能加大。对于全球投资者而言，美股仍是配置全球顶尖科技资产的核心阵地，但需警惕估值泡沫和宏观经济潜在风险。投资策略上，应聚焦于那些能将 AI 技术转化为真实现金流、拥有全球定价权的领军企业。同时，由于 AI 药品研发、AI 医疗和美联储降息趋势均对医药相关行业有利，叠加人口老龄化，医药相关行业依然值得期待。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，公司严格遵循法律法规、监管规则和自律规范要求，持续加强合规管理、风险控制和监察稽核工作，保障公司各项业务合法、合规、稳健运行。主要工作情况如下：

一是持续推进合规文化建设。积极营造良好的合规经营氛围，通过组织专题培训、合规考试，发布合规资讯与风险提示等多种形式，持续宣导合规要求，强化员工职业操守和道德规范教育，提

升全员合规意识，引导员工依法合规履职、勤勉尽责担当。

二是不断强化投资合规与风险管控。持续完善对投资研究、投资决策和交易执行全过程的合规管理和风险管控，加强对公平交易、关联交易、异常交易及内幕交易等监测管控，并通过制度规范、流程优化和系统建设持续提升控制效能，切实维护基金份额持有人利益。

三是持续健全合规管理体系。坚持制度先行、执行为本，结合法律法规、监管政策变化和业务发展需要，持续推进制度的修订与完善，认真履行合规审核和合规咨询职能，扎实做好日常合规管理、培训、考核等工作，全面提升合规管理的质效。

四是有序开展监察稽核工作。以风险为导向，对投资运作、基金销售、运营管理、信息技术、反洗钱等重点领域开展定期和专项检查，督促问题整改，持续提升内部控制和合规管理水平。

五是规范基金销售和投资者适当性管理。持续做好基金宣传推介材料的审核，坚持贯彻基金销售相关法规和监管要求，加强对自媒体账号、对外言论发布、网络直播等领域的合规管理，加大投资者教育和保护力度。

六是持续强化洗钱风险管控能力。严格贯彻落实国家反洗钱法律法规及相关监管要求，扎实开展客户尽职调查、客户资料保存、可疑交易监测与报告等各项工作，积极开展反洗钱宣传教育。持续加强洗钱风险识别、评估与应对机制建设，稳步推进反洗钱信息系统建设与数据治理，不断提升反洗钱工作的系统化、专业化水平，切实防范洗钱风险。

七是严格履行信息披露义务。持续完善信息披露工作流程和工作规范，加强信息披露文件审核，不断提升自动化、智能化系统建设水平，确保信息披露的真实性、准确性、完整性和及时性。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、资产管理产品相关会计处理规定、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。

本基金管理人设有估值委员会，负责制订健全、有效的估值政策和程序，定期对估值政策和程序的执行情况进行评价，确保基金估值的公平、合理。估值委员会配备投资、研究、会计和风控等岗位资深人员。为保证基金估值的客观独立，基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。

本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本报告期内，参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、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投资品种的估值数据。

#### 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。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，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，本基金的管理人——广发基金管理有限公司在本基金的投资运作、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，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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本基金 2025 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（2026）审字第 70009676\_G150 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 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年度的利润表、净资产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 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况。

## 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《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》和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。我们在审计中遵循了对公众利益实体审计的独立性要求。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

冯所腾 黄拥璇

北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室

2026年3月27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：2025年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	21,432,589.86	21,864,982.31
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	187,237,151.59	155,077,096.12
其中：股票投资		181,211,295.07	150,463,133.88
基金投资		6,025,856.52	4,613,962.24
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		3,014,831.84	2,056,544.94
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		211,684,573.29	178,998,623.37
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2025 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2024 年 12 月 31 日</b>
<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		-	-
应付清算款		3,153,812.58	3,793,991.73
应付赎回款		1,839,195.80	1,138,437.18
应付管理人报酬		136,150.29	117,543.51
应付托管费		34,037.55	36,732.36
应付销售服务费		14,441.69	13,250.35
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.7	179,324.11	153,129.83
负债合计		5,356,962.02	5,253,084.96
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.8	141,114,612.27	148,801,731.43
未分配利润	7.4.7.9	65,212,999.00	24,943,806.98
净资产合计		206,327,611.27	173,745,538.41
负债和净资产总计		211,684,573.29	178,998,623.37

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，广发生物科技指数（QDII）A 基金份额净值人民币 1.468 元，基金份额总额 109,178,917.91 份；广发生物科技指数（QDII）C 基金份额净值人民币 1.444 元，基金份额总额 31,935,694.36 份；总份额总额 141,114,612.27 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：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至
----	-----	-----------------------	----------------------------

		2025 年 12 月 31 日	2024 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		<b>43,558,242.67</b>	<b>-803,276.06</b>
1.利息收入		28,107.80	23,334.75
其中：存款利息收入	7.4.7.10	28,107.80	23,334.75
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		12,314,204.88	5,874,916.52
其中：股票投资收益	7.4.7.11	11,318,878.48	4,538,974.00
基金投资收益	7.4.7.12	-468,499.28	179,654.26
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-	-
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	1,463,825.68	1,156,288.26
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	31,876,539.79	-7,027,537.91
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-746,388.86	241,132.79
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	85,779.06	84,877.79
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>2,356,260.53</b>	<b>2,006,036.17</b>
1. 管理人报酬		1,547,657.45	1,277,519.34
2. 托管费		396,586.65	399,224.82
3. 销售服务费		189,576.85	83,755.84
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-

其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		-	649.02
8. 其他费用	7.4.7.21	222,439.58	244,887.15
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>41,201,982.14</b>	<b>-2,809,312.23</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>41,201,982.14</b>	<b>-2,809,312.23</b>
五、其他综合收益的税后净额		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		<b>41,201,982.14</b>	<b>-2,809,312.23</b>

### 7.3 净资产变动表

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：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	148,801,731.43	24,943,806.98	173,745,538.41
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	148,801,731.43	24,943,806.98	173,745,538.41
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-7,687,119.16	40,269,192.02	32,582,072.86
（一）、综合收益总额	-	41,201,982.14	41,201,982.14
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-7,687,119.16	-932,790.12	-8,619,909.28
其中：1.基金申购款	145,205,439.67	32,758,301.73	177,963,741.40
2.基金赎回款	-152,892,558.83	-33,691,091.85	-186,583,650.68
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	141,114,612.27	65,212,999.00	206,327,611.27

项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	124,999,597.85	21,407,886.69	146,407,484.54
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	124,999,597.85	21,407,886.69	146,407,484.54
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	23,802,133.58	3,535,920.29	27,338,053.87
(一)、综合收益总额	-	-2,809,312.23	-2,809,312.23
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	23,802,133.58	6,345,232.52	30,147,366.10
其中：1.基金申购款	144,873,584.49	33,625,643.14	178,499,227.63
2.基金赎回款	-121,071,450.91	-27,280,410.62	-148,351,861.53
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	148,801,731.43	24,943,806.98	173,745,538.41

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：葛长伟 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。

本基金自 2022 年 8 月 12 日起增设 C 类基金份额，原份额转为 A 类基金份额。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况。

#### 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

本基金的记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币为单位表示。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

###### （1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要包含货币资金、买入返售金融资产和其他应收科目等。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为股票投资、债券投资、资产支持证券投资和基金投资等，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

#### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

本基金持有的以摊余成本计量的金融负债主要包括卖出回购金融资产款和其他应付科目等。

#### (3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/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。

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和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基

金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，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；

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并确认产生的资产和负债；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。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债(含交易性金融负债和衍生金融负债)，按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债

的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；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，应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，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应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应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应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，应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，应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其公允价值的，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；

（4）如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 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。由于基金份额拆分/折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分/折算日根据拆分/折算前的基金份额数及确定的拆分/折算比例计算确认。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确认。对于已经开放转换业务的基金，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。对于存在分级份额调整的基金，上述申购和赎回包括因级别调整而引起的分级基金份额之间的转换所产生的实收基金变动。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入（若有）、转出（若有）及红利再投资（若有）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) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(4) 转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入转融通证券出借业务利息收入；

(5) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(6) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(7) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的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；

(8) 黄金租借的租金收入，在租约持有期间按租赁合同约定的费率和计算方法逐日确认；

(9) 黄金质押的利息收入，在质押期间按质押合同约定的费率和计算方法逐日确认；

(10) 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

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的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则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

同一类别内的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 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金额。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。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，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 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征增值税试点的通知》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。

根据财政部、国家税务总局公告2025年第4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》，自2025年8月8日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在2025年8月8日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

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，在境内暂不征收企业所得税。

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，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

基金运作过程中通过沪港通/深港通投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2025 年 12 月 31 日	2024 年 12 月 31 日
活期存款	21,432,589.86	21,864,982.31
等于：本金	21,431,384.83	21,863,499.92
加：应计利息	1,205.03	1,482.39
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
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	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
合计	21,432,589.86	21,864,982.31

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2025 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	144,111,636.86	-	181,211,295.07	37,099,658.21
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		4,568,123.52	-	6,025,856.52	1,457,733.00
其他		-	-	-	-
合计		148,679,760.38	-	187,237,151.59	38,557,391.21
项目		上年度末 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		143,450,513.30	-	150,463,133.88	7,012,620.58
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		4,945,731.40	-	4,613,962.24	-331,769.16
其他		-	-	-	-
合计		148,396,244.70	-	155,077,096.12	6,680,851.42

#### 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 债权投资

本基金本报告期末及上年度末无债权投资。

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

#### 7.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	2,540.70	1,129.83
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	-	-
其中：交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	176,783.41	152,000.00
合计	179,324.11	153,129.83

#### 7.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

广发生物科技指数（QDII）A		
项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	112,232,277.73	112,232,277.73
本期申购	64,009,927.37	64,009,927.37
本期赎回（以“-”号填列）	-67,063,287.19	-67,063,287.19
本期末	109,178,917.91	109,178,917.91

金额单位：人民币元

广发生物科技指数（QDII）C		
项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	36,569,453.70	36,569,453.70
本期申购	81,195,512.30	81,195,512.30
本期赎回（以“-”号填列）	-85,829,271.64	-85,829,271.64
本期末	31,935,694.36	31,935,694.36

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。

#### 7.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

广发生物科技指数（QDII）A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	43,113,723.17	-23,882,467.56	19,231,255.61
本期期初	43,113,723.17	-23,882,467.56	19,231,255.61
本期利润	7,472,373.64	25,205,433.57	32,677,807.21
本期基金份额交易产生的变动数	-1,323,076.23	460,345.92	-862,730.31
其中：基金申购款	25,276,285.22	-9,773,325.29	15,502,959.93
基金赎回款	-26,599,361.45	10,233,671.21	-16,365,690.24
本期已分配利润	-	-	-
本期末	49,263,020.58	1,783,311.93	51,046,332.51

单位：人民币元

广发生物科技指数（QDII）C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	13,569,288.73	-7,856,737.36	5,712,551.37
本期期初	13,569,288.73	-7,856,737.36	5,712,551.37
本期利润	1,853,068.71	6,671,106.22	8,524,174.93
本期基金份额交易产生的变动数	-1,619,272.06	1,549,212.25	-70,059.81
其中：基金申购款	30,658,672.07	-13,403,330.27	17,255,341.80
基金赎回款	-32,277,944.13	14,952,542.52	-17,325,401.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	13,803,085.38	363,581.11	14,166,666.49

#### 7.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	27,633.65	23,087.52
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	474.15	247.23

合计	28,107.80	23,334.75
----	-----------	-----------

#### 7.4.7.11 股票投资收益

##### 7.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年 12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年 12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	11,318,878.48	4,538,974.00
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	11,318,878.48	4,538,974.00

##### 7.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12 月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12 月31日
卖出股票成交总额	77,585,845.57	27,682,920.98
减：卖出股票成本总额	66,243,783.44	23,131,385.79
减：交易费用	23,183.65	12,561.19
买卖股票差价收入	11,318,878.48	4,538,974.00

#### 7.4.7.12 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年 12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12 月31日
卖出/赎回基金成交总额	2,796,747.91	1,518,023.60
减：卖出/赎回基金成本总额	3,264,370.38	1,332,334.08
减：买卖基金差价收入应缴纳增值 税额	-	5,408.44
减：交易费用	876.81	626.82
基金投资收益	-468,499.28	179,654.26

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 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。

##### 7.4.7.13.2 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 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.14.1 资产支持证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资产支持证券投资收益。

##### 7.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间内无买卖资产支持证券差价收入。

#### 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
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,422,818.27	1,097,664.95
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	41,007.41	58,623.31
合计	1,463,825.68	1,156,288.26

#### 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
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
1.交易性金融资产	31,876,539.79	-7,027,537.91
——股票投资	30,087,037.63	-5,999,990.67
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-

——基金投资	1,789,502.16	-1,027,547.24
——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	31,876,539.79	-7,027,537.91

#### 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
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
基金赎回费收入	84,061.80	82,729.10
基金转换费收入	1,717.26	2,022.51
其他	-	126.18
合计	85,779.06	84,877.79

#### 7.4.7.20 信用减值损失

本基金本报告期内及上年度可比期间内无信用减值损失。

#### 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
审计费用	32,000.00	32,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	335.00	295.00
指数使用费	49,106.76	40,107.61
其他	20,997.82	52,484.54
合计	222,439.58	244,887.15

#### 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
广发基金管理有限公司	基金管理人
中国工商银行股份有限公司	基金托管人
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
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
广发国际资产管理有限公司	基金管理人子公司
瑞元资本管理有限公司	基金管理人子公司
瑞晨股权投资基金管理（广东）有限公司	基金管理人子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 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
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,547,657.45	1,277,519.34
其中：应支付销售机构的客户维护费	580,905.38	474,738.46
应支付基金管理人的净管理费	966,752.07	802,780.88

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理费=前一日的基金资产净值×约定年费率/当年天数。

约定年费率为 0.80%。

#### 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
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	396,586.65	399,224.82

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日的基金资产净值×约定年费率/当年天数。

自 2025 年 2 月 6 日起，约定年费率由 0.25% 调整为 0.20%。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2025年1月1日至2025年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	广发生物科技指数（QDII）A	广发生物科技指数（QDII）C	合计
广发基金管理有限公司	-	5,645.70	5,645.70
中国工商银行股份有	-	4,636.55	4,636.55

限公司			
广发证券股份有限公司	-	118.90	118.90
合计	-	10,401.15	10,401.15
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	广发生物科技指数（QDII） A	广发生物科技指数（QDII） C	合计
广发基金管理有限公司	-	3,940.03	3,940.03
中国工商银行股份有限公司	-	1,645.07	1,645.07
广发证券股份有限公司	-	74.06	74.06
合计	-	5,659.16	5,659.16

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额资产净值 × 约定年费率 / 当年天数。

C 类基金份额的约定年费率为 0.40%。

如涉及费率优惠，相关费率优惠安排以本基金管理人发布的最新公告为准。

#### 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未运用固有资金投资本基金。

**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**

广发生物科技指数（QDII）A

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

广发生物科技指数（QDII）C

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

**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 2025年1月1日至2025年12月31日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024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	15,877,290.34	27,633.65	16,343,971.51	23,087.52
布朗兄弟哈里曼银行	5,555,299.52	-	5,521,010.80	-

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司、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。

**7.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

无。

**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（2025 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 2025 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	数量 (单位：股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
------	------	------	------	--------	------	-----	--------------	------------	------------	----

						盘单 价				
AKA OQ US	ACHA OGEN INC	2021-06 -21	重大事 项停牌	0.18	-	-	1,615.00	114,806.61	283.82	-
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	213.39	-
SNNA Q US	SIENN A BIOPH ARMA CEUTI CAL S IN	2022-01 -05	重大事 项停牌	0.00	-	-	732.00	89,482.79	0.49	-

#### 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 2025 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 2025 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 2025 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，建立了由董事会及其下设的合规及风险管理委员会、

经营管理层及其下设的风险控制委员会、风险管理职能部门、各业务部门四个层级构成的风险管理组织架构。在职责分工中，董事会及其下设的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；经营管理层及其下设的风险控制委员会负责讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；各业务部门、风险管理职能部门以及合规稽核部下设的稽核审计组构成公司风险管理三道防线，共同发挥事前识别与防范、事中监测与控制、事后监督与评价功能，通过相互协作，分层次、多方面、持续性地监测和管理公司面临的各类风险。

#### 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，将对基金资产造成损失的风险。为了防范信用风险，本基金管理人建立了内部信用评级制度与交易对手库，对证券发行人的信用等级进行评估与控制，并分散化投资，对交易对手的资信情况进行充分评估。

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。

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，对组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析，通过独立的风险管理部门对投资组合的流动性风险进行评估与监测。

在日常运作中，本基金的流动性安排能够与基金合同约定的申购赎回安排以及投资者的申购赎回需求相匹配。本基金主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具，基金管理人持续监测本基金持有资产的流动性水平。本期末，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标的为具有良好流动性的金融工具。同时，基金管理人持续监测本基金开放期内投资者的申购赎回情况，保持基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。

如遭遇极端市场情形或投资者非预期巨额赎回情形，基金管理人将采用本基金合同约定的赎回申请处理方式及其他各类流动性风险管理工具，控制极端情况下的潜在流动性风险。

#### 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最大的风险，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、凸性等方法来评估投资组合面临的利率风险，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
货币资金	21,432,589.86	-	-	-	21,432,589.86
交易性金融资产	-	-	-	187,237,151.59	187,237,151.59
应收申购款	15,926.24	-	-	2,998,905.60	3,014,831.84
资产总计	21,448,516.10	-	-	190,236,057.19	211,684,573.29
<b>负债</b>					
应付清算款	-	-	-	3,153,812.58	3,153,812.58
应付赎回款	-	-	-	1,839,195.80	1,839,195.80

应付管理人报酬	-	-	-	136,150.29	136,150.29
应付托管费	-	-	-	34,037.55	34,037.55
应付销售服务费	-	-	-	14,441.69	14,441.69
其他负债	-	-	-	179,324.11	179,324.11
负债总计	-	-	-	5,356,962.02	5,356,962.02
利率敏感度缺口	21,448,516.10	-	-	184,879,095.17	206,327,611.27
<b>上年度末 2024 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>
<b>资产</b>					
货币资金	21,864,982.31	-	-	-	21,864,982.31
交易性金融资产	-	-	-	155,077,096.12	155,077,096.12
应收申购款	24,631.75	-	-	2,031,913.19	2,056,544.94
资产总计	21,889,614.06	-	-	157,109,009.31	178,998,623.37
<b>负债</b>					
应付清算款	-	-	-	3,793,991.73	3,793,991.73
应付赎回款	-	-	-	1,138,437.18	1,138,437.18
应付管理人报酬	-	-	-	117,543.51	117,543.51
应付托管费	-	-	-	36,732.36	36,732.36
应付销售服务费	-	-	-	13,250.35	13,250.35
其他负债	-	-	-	153,129.83	153,129.83
负债总计	-	-	-	5,253,084.96	5,253,084.96
利率敏感度缺口	21,889,614.06	-	-	151,855,924.35	173,745,538.41

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。

#### 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。持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债会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			
	2025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				
货币资金	8,307,014.20	-	-	8,307,014.20
交易性金融资产	187,237,151.59	-	-	187,237,151.59
应收申购款	390,688.26	-	-	390,688.26
<b>资产合计</b>	<b>195,934,854.05</b>	-	-	<b>195,934,854.05</b>
以外币计价的负债				
应付清算款	3,153,812.58	-	-	3,153,812.58
应付赎回款	131,817.06	-	-	131,817.06
其他负债	24,853.28	-	-	24,853.28
<b>负债合计</b>	<b>3,310,482.92</b>	-	-	<b>3,310,482.92</b>
<b>资产负债表 外汇风险敞 口净额</b>	<b>192,624,371.13</b>	-	-	<b>192,624,371.13</b>
项目	上年度末			
	2024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				
货币资金	5,681,229.38	-	-	5,681,229.38
交易性金融资产	155,077,096.12	-	-	155,077,096.12
应收申购款	42,739.35	-	-	42,739.35
<b>资产合计</b>	<b>160,801,064.85</b>	-	-	<b>160,801,064.85</b>
以外币计价的负债				

应付清算款	3,793,991.73	-	-	3,793,991.73
应付赎回款	11,052.52	-	-	11,052.52
其他负债	30.19	-	-	30.19
<b>负债合计</b>	<b>3,805,074.44</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>3,805,074.44</b>
<b>资产负债表</b>				
外汇风险敞口净额	<b>156,995,990.41</b>	-	-	<b>156,995,990.41</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 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
	所有外币相对人民币升值 5%	9,631,218.56	7,849,799.52
	所有外币相对人民币贬值 5%	-9,631,218.56	-7,849,799.52

#### 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 2025年12月31日		上年度末 2024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	181,211,295.07	87.83	150,463,133.88	86.60
交易性金融资产—基金投资	6,025,856.52	2.92	4,613,962.24	2.66
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	-	-	-	-
<b>合计</b>	<b>187,237,151.59</b>	<b>90.75</b>	<b>155,077,096.12</b>	<b>89.26</b>

#### 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 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	上升 5%	10,094,196.16	8,555,007.83
	下降 5%	-10,094,196.16	-8,555,007.83

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 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。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	187,236,653.89	155,076,587.11
第二层次	497.70	509.01
第三层次	-	-
合计	187,237,151.59	155,077,096.12

###### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的金融工具，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会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金融工具的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关金融工具的公允价值应属第二层次或第三层次。

##### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

###### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无需披露的第三层次公允价值余额及变动情况。

#### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

本基金本报告期末及上年度末无需披露的使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的项目。

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内及上年度可比期间内无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

## §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	181,211,295.07	85.60
	其中：普通股	160,688,716.09	75.91
	存托凭证	20,522,578.98	9.69
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	6,025,856.52	2.85
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	21,432,589.86	10.12
8	其他各项资产	3,014,831.84	1.42
9	合计	211,684,573.29	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	181,211,295.07	87.83
合计	181,211,295.07	87.83

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	181,211,295.07	87.83
金融	-	-
信息技术	-	-
通讯业务	-	-
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	181,211,295.07	87.83

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	Vertex Pharmace uticals Inc	福泰制药 公司	VRTX US	纳斯达 克证券 交易所	美国	4,929.00	15,706,636.89	7.61
2	Gilead Sciences Inc	吉利德科 学公司	GILD US	纳斯达 克证券 交易所	美国	16,983.00	14,651,487.35	7.10
3	Amgen Inc	安进公司	AMGN US	纳斯达 克证券 交易所	美国	6,186.00	14,231,490.12	6.90
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	2,028.00	11,002,548.67	5.33
5	AstraZene ca PLC	阿斯利康 公共有限 公司	AZN US	纳斯达 克证券 交易所	美国	11,471.00	7,412,073.65	3.59
6	Alnylam Pharmace uticals Inc	艾拉伦制 药股份有 限公司	ALNY US	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,595.00	7,253,031.02	3.52
7	Insmmed Inc	Insmmed 股 份有限公 司	INSM US	纳斯达 克证券 交易所	美国	4,191.00	5,126,818.25	2.48
8	Biogen Inc	渤健公司	BIIB US	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,882.00	3,565,029.71	1.73
9	Argenx SE	Argenx 公 司	ARGX US	纳斯达 克证券 交易所	美国	571.00	3,375,106.40	1.64
10	United Therapeut ics Corp	联合治疗 公司	UTHR US	纳斯达 克证券 交易所	美国	845.00	2,893,941.47	1.40
11	Incyte Corp	因赛特公 司	INCY US	纳斯达 克证券 交易所	美国	3,858.00	2,678,356.99	1.30
12	Royalty Pharma PLC	Royalty Pharma 公 司	RPRX US	纳斯达 克证券 交易所	美国	8,396.00	2,280,293.42	1.11

13	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	552.00	2,179,144.49	1.06
14	Revolution Medicines Inc	Revolution 医药股份有限公司	RVMD US	纳斯达克证券交易所	美国	3,798.00	2,126,287.21	1.03
15	Roivant Sciences Ltd	-	ROIV US	纳斯达克证券交易所	美国	13,668.00	2,084,711.15	1.01
16	Bridgebio Pharma Inc	Bridgebio 制药股份有限公司	BBIO US	纳斯达克证券交易所	美国	3,786.00	2,035,478.20	0.99
17	Viartis Inc	晖致	VTRS US	纳斯达克证券交易所	美国	22,634.00	1,980,668.75	0.96
18	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	1,958.00	1,951,919.83	0.95
19	Guardant Health Inc	Guardant Health 股份有限公司	GH US	纳斯达克证券交易所	美国	2,541.00	1,824,238.87	0.88
20	Madrigal Pharmaceuticals Inc	Madrigal 制药有限公司	MDGL US	纳斯达克证券交易所	美国	445.00	1,821,452.37	0.88
21	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	1,206.00	1,807,578.50	0.88
22	Summit Therapeutics Inc	Summit Therapeutics 股份有限公司	SMMT US	纳斯达克证券交易所	美国	14,629.00	1,798,397.27	0.87
23	Sanofi SA	赛诺菲	SNY US	纳斯达克证券交易所	美国	5,199.00	1,770,860.75	0.86
24	Ionis Pharmaceuticals Inc	Ionis 制药股份有限公司	IONS US	纳斯达克证券交易所	美国	3,183.00	1,769,901.96	0.86
25	Exelixis Inc	Exelixis 股份有限公司	EXEL US	纳斯达克证券交易所	美国	5,268.00	1,622,924.90	0.79
26	Moderna Inc	莫德纳公司	MRNA US	纳斯达克证券交易所	美国	7,677.00	1,591,283.28	0.77

				交易所				
27	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	3,774.00	1,576,481.26	0.76
28	Avidity Biosciences Inc	Avidity 生 物科学股份 有限公司	RNA US	纳斯达克 证券交易所	美国	2,961.00	1,501,189.53	0.73
29	Jazz Pharmaceuticals PLC	爵士制药 公司	JAZZ US	纳斯达克 证券交易所	美国	1,194.00	1,426,705.82	0.69
30	Tempus AI Inc	-	TEM US	纳斯达克 证券交易所	美国	3,397.00	1,409,927.02	0.68
31	BioNTech SE	BioNTech 公司	BNTX US	纳斯达克 证券交易所	美国	1,987.00	1,329,584.68	0.64
32	BeOne Medicines Ltd	百济神州 有限公司	ONC US	纳斯达克 证券交易所	美国	617.00	1,317,553.97	0.64
33	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	990.00	1,270,902.63	0.62
34	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	2,668.00	1,245,000.94	0.60
35	Abivax SA	Abivax 股 份有限公 司	ABVX US	纳斯达克 证券交易所	美国	1,159.00	1,098,580.00	0.53
36	Halozyne Therapeutics Inc	Halozyne Therapeutic s 股份有 限公司	HALO US	纳斯达克 证券交易所	美国	2,310.00	1,092,718.33	0.53
37	Cytokinetics Inc	Cytokinetic s 股份有 限公司	CYTK US	纳斯达克 证券交易所	美国	2,402.00	1,072,757.10	0.52
38	Caris Life Sciences Inc	-	CAI US	纳斯达克 证券交易所	美国	5,543.00	1,051,158.02	0.51
39	Praxis Precision Medicines Inc	Praxis Precision 制药股份 有限公司	PRAX US	纳斯达克 证券交易所	美国	490.00	1,015,117.57	0.49

40	Nuvalent Inc	Nuvalent 股份有限公司	NUVL US	纳斯达克证券交易所	美国	1,419.00	1,003,271.30	0.49
41	Krystal Biotech Inc	Krystal 生物科技股份有限公司	KRYS US	纳斯达克证券交易所	美国	569.00	986,008.92	0.48
42	Rhythm Pharmaceuticals Inc	Rhythm 制药股份有限公司	RYTM US	纳斯达克证券交易所	美国	1,310.00	985,595.21	0.48
43	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	1,577.00	841,972.36	0.41
44	Vaxcyte Inc	Vaxcyte 股份有限公司	PCVX US	纳斯达克证券交易所	美国	2,572.00	834,122.32	0.40
45	Kymera Therapeutics Inc	Kymera Therapeutics 股份有限公司	KYMR US	纳斯达克证券交易所	美国	1,413.00	772,785.14	0.37
46	Protagonist Therapeutics Inc	Protagonist Therapeutics 股份有限公司	PTGX US	纳斯达克证券交易所	美国	1,227.00	753,249.65	0.37
47	Cogent Biosciences Inc	Cogent 生物技术股份有限公司	COGT US	纳斯达克证券交易所	美国	3,016.00	752,983.54	0.36
48	CRISPR Therapeutics AG	CRISPR 治疗股份公司	CRSP US	纳斯达克证券交易所	美国	1,872.00	690,000.99	0.33
49	Structure Therapeutics Inc	-	GPCR US	纳斯达克证券交易所	美国	1,312.00	641,375.19	0.31
50	Alkermes PLC	Alkermes 公共有限公司	ALKS US	纳斯达克证券交易所	美国	3,244.00	637,983.93	0.31
51	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	3,324.00	624,045.26	0.30
52	Scholar Rock Holding Corp	Scholar Rock 控股公司	SRRK US	纳斯达克证券交易所	美国	2,004.00	620,475.75	0.30
53	Indivior	Indivior 公	INDV US	纳斯达克	美国	2,453.00	618,630.27	0.30

	Pharmaceuticals Inc	共有限公司		克证券交易所				
54	Immunovant Inc	Immunovant 股份有限公司	IMVT US	纳斯达克证券交易所	美国	3,443.00	615,168.03	0.30
55	Crinetics Pharmaceuticals Inc	Crinetics 制药股份有限公司	CRNX US	纳斯达克证券交易所	美国	1,864.00	609,883.35	0.30
56	Amicus Therapeutics Inc	Amicus Therapeutics 股份有限公司	FOLD US	纳斯达克证券交易所	美国	6,063.00	606,846.35	0.29
57	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	4,676.00	599,488.04	0.29
58	Apogee Therapeutics Inc	Apogee Therapeutics 股份有限公司	APGE US	纳斯达克证券交易所	美国	1,077.00	571,384.93	0.28
59	Mirum Pharmaceuticals Inc	Mirum 制药股份有限公司	MIRM US	纳斯达克证券交易所	美国	1,008.00	559,646.55	0.27
60	Newamsterdam Pharma Co NV	-	NAMS US	纳斯达克证券交易所	美国	2,228.00	549,358.64	0.27
61	Amneal Pharmaceuticals Inc	Amneal 制药股份有限公司	AMRX US	纳斯达克证券交易所	美国	6,178.00	547,141.47	0.27
62	Arcellx Inc	Arcellx 股份有限公司	ACLX US	纳斯达克证券交易所	美国	1,136.00	520,603.54	0.25
63	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	386.00	512,968.99	0.25
64	Terns Pharmaceuticals Inc	拓臻生物	TERN US	纳斯达克证券交易所	美国	1,770.00	502,615.43	0.24
65	Arcutis Biotherapeutics Inc	Arcutis 生物疗法股份有限公司	ARQT US	纳斯达克证券交易所	美国	2,406.00	491,103.94	0.24
66	Tarsus Pharmaceuticals	Tarsus 制药股份有限公司	TARS US	纳斯达克证券交易所	美国	833.00	479,406.61	0.23

	uticals Inc	公司		交易所				
67	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	1,517.00	477,901.75	0.23
68	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	1,757.00	471,878.28	0.23
69	CG Oncology Inc	CG Oncology 股份有限公司	CGON US	纳斯达克证券交易所	美国	1,585.00	462,559.70	0.22
70	GRAIL Inc	GRAIL 股份有限公司	GRAL US	纳斯达克证券交易所	美国	765.00	460,220.17	0.22
71	Veracyte Inc	Veracyte 股份有限公司	VCYT US	纳斯达克证券交易所	美国	1,553.00	459,552.08	0.22
72	Vera Therapeutics Inc	Vera Therapeutics 股份有限公司	VERA US	纳斯达克证券交易所	美国	1,256.00	447,058.67	0.22
73	Apellis Pharmaceuticals Inc	Apellis 制药公司	APLS US	纳斯达克证券交易所	美国	2,485.00	438,760.19	0.21
74	Ideaya Biosciences Inc	Ideaya 生物科技股份有限公司	IDYA US	纳斯达克证券交易所	美国	1,722.00	418,421.23	0.20
75	Disc Medicine Inc	Disc 制药股份有限公司	IRON US	纳斯达克证券交易所	美国	742.00	414,152.50	0.20
76	Mineralys Therapeutics Inc	Mineralys Therapeutics 股份有限公司	MLYS US	纳斯达克证券交易所	美国	1,555.00	396,641.86	0.19
77	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	1,126.00	393,347.11	0.19
78	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	3,285.00	392,523.34	0.19
79	Beam Therapeutics Inc	Beam Therapeutics 股份有限公司	BEAM US	纳斯达克证券交易所	美国	1,994.00	388,507.64	0.19

		公司						
80	Dyne Therapeutics Inc	Dyne Therapeutics 股份有限公司	DYN US	纳斯达克证券交易所	美国	2,806.00	385,778.22	0.19
81	Edgewise Therapeutics Inc	Edgewise Therapeutics 股份有限公司	EWTX US	纳斯达克证券交易所	美国	2,079.00	362,618.53	0.18
82	Ocular Therapeutics Inc	Ocular Therapeutics 股份有限公司	OCUL US	纳斯达克证券交易所	美国	4,185.00	357,104.51	0.17
83	Spyre Therapeutics Inc	Spyre Therapeutics 股份有限公司	SYRE US	纳斯达克证券交易所	美国	1,523.00	350,691.29	0.17
84	Adaptive Biotechnologies Corp	Adaptive 生物技术公司	ADPT US	纳斯达克证券交易所	美国	2,998.00	342,214.84	0.17
85	Denali Therapeutics Inc	Denali 制药股份有限公司	DNLI US	纳斯达克证券交易所	美国	2,881.00	334,327.05	0.16
86	Centessa Pharmaceuticals PLC	-	CNTA US	纳斯达克证券交易所	美国	1,895.00	333,122.60	0.16
87	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	2,059.00	311,443.88	0.15
88	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	1,895.00	306,350.25	0.15
89	Harmony Biosciences Holdings Inc	Harmony Biosciences 控股股份有限公司	HRMY US	纳斯达克证券交易所	美国	1,131.00	297,473.01	0.14
90	Recursion Pharmaceuticals Inc	Recursion 制药股份有限公司	RXRX US	纳斯达克证券交易所	美国	10,104.00	290,467.69	0.14
91	Aurinia Pharmaceuticals	Aurinia 制药股份有	AUPH US	纳斯达克证券交易所	美国	2,590.00	290,363.24	0.14

	uticals Inc	限公司		交易所				
92	Maze Therapeutics Inc	Maze Therapeutics 股份有限公司	MAZE US	纳斯达克证券交易所	美国	944.00	274,895.81	0.13
93	Zymeworks Inc	Zymeworks 股份有限公司	ZYME US	纳斯达克证券交易所	美国	1,470.00	272,050.41	0.13
94	Olema Pharmaceuticals Inc	Olema 制药股份有限公司	OLMA US	纳斯达克证券交易所	美国	1,546.00	271,663.12	0.13
95	ImmunityBio Inc	ImmunityBio 股份有限公司	IBRX US	纳斯达克证券交易所	美国	19,355.00	269,364.00	0.13
96	Zenas Biopharma Inc	Zenas 生物制药股份有限公司	ZBIO US	纳斯达克证券交易所	美国	1,054.00	268,997.38	0.13
97	Twist Bioscience Corp	特维斯特生物科技公司	TWST US	纳斯达克证券交易所	美国	1,201.00	267,767.20	0.13
98	Nurix Therapeutics Inc	Nurix Therapeutics 股份有限公司	NRIX US	纳斯达克证券交易所	美国	1,992.00	265,605.98	0.13
99	10X Genomics Inc	10X Genomics 股份有限公司	TXG US	纳斯达克证券交易所	美国	2,288.00	262,295.70	0.13
100	Kiniksa Pharmaceuticals International Plc	Kiniksa 制药国际公共有限公司	KNSA US	纳斯达克证券交易所	美国	887.00	257,175.01	0.12
101	Sionna Therapeutics Inc	Sionna Therapeutics 股份有限公司	SION US	纳斯达克证券交易所	美国	876.00	253,308.39	0.12
102	Legend Biotech Corp	传奇生物科技公司	LEGN US	纳斯达克证券交易所	美国	1,654.00	252,741.31	0.12
103	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	1,708.00	252,229.05	0.12
104	Vericel Corp	Vericel 公司	VCEL US	纳斯达克证券交易所	美国	993.00	251,335.34	0.12

				交易所				
105	Stoke Therapeutics Inc	Stoke Therapeutics 股份有限公司	STOK US	纳斯达克证券交易所	美国	1,121.00	250,088.50	0.12
106	Harrow Inc	Harrow 股份有限公司	HROW US	纳斯达克证券交易所	美国	726.00	250,042.53	0.12
107	Dynavax Technologies Corp	Dynavax 科技公司	DVAX US	纳斯达克证券交易所	美国	2,306.00	249,285.39	0.12
108	Genmab A/S	Genmab 股份有限公司	GMAB US	纳斯达克证券交易所	美国	1,148.00	248,527.12	0.12
109	Pharvaris NV	-	PHVS US	纳斯达克证券交易所	美国	1,258.00	245,371.89	0.12
110	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	441.00	244,690.38	0.12
111	MannKind Corp	曼恩凯德公司	MNKD US	纳斯达克证券交易所	美国	6,034.00	240,474.79	0.12
112	BioCryst Pharmaceuticals Inc	BioCryst 制药股份有限公司	BCRX US	纳斯达克证券交易所	美国	4,137.00	226,809.54	0.11
113	Alvotect SA	-	ALVO US	纳斯达克证券交易所	美国	6,150.00	221,755.13	0.11
114	Trevi Therapeutics Inc	Trevi Therapeutics 股份有限公司	TRVI US	纳斯达克证券交易所	美国	2,519.00	221,673.45	0.11
115	Fortrea Holdings Inc	Fortrea 控股股份有限公司	FTRE US	纳斯达克证券交易所	美国	1,815.00	220,062.94	0.11
116	Agios Pharmaceuticals Inc	Agios 制药公司	AGIO US	纳斯达克证券交易所	美国	1,145.00	219,065.91	0.11
117	Immunocore Holdings PLC	Immunocore Holdings PLC	IMCR US	纳斯达克证券交易所	美国	857.00	209,081.99	0.10
118	EyePoint	EyePoint	EYPT US	纳斯达克	美国	1,626.00	208,804.70	0.10

	Inc	股份有限 公司		克证券 交易所				
119	Taysha Gene Therapies Inc	Taysha Gene Therapies 股份有限 公司	TSHA US	纳斯达 克证券 交易所	美国	5,383.00	208,098.17	0.10
120	Innoviva Inc	Innoviva 股 份有限公 司	INVA US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,467.00	206,121.88	0.10
121	uniQure NV	uniQure 股 份有限公 司	QURE US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,223.00	205,707.60	0.10
122	AtaiBeckl ey Inc	-	ATAI US	纳斯达 克证券 交易所	美国	7,137.00	205,172.99	0.10
123	Kodiak Sciences Inc	Kodiak Sciences 股 份有限公 司	KOD US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,042.00	204,779.31	0.10
124	Precigen Inc	Precigen 股 份有限公 司	PGEN US	纳斯达 克证券 交易所	美国	6,952.00	204,252.43	0.10
125	Relay Therapeut ics Inc	Relay Therapeutic s 股份有限 公司	RLAY US	纳斯达 克证券 交易所	美国	3,406.00	202,533.19	0.10
126	Upstream Bio Inc	Upstream Bio 股份有 限公司	UPB US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,061.00	202,472.67	0.10
127	Oruka Therapeut ics Inc	Oruka 制药 股份有限 公司	ORKA US	纳斯达 克证券 交易所	美国	950.00	202,390.78	0.10
128	Collegium Pharmace utical Inc	Collegium 制药股份 有限公司	COLL US	纳斯达 克证券 交易所	美国	620.00	201,768.73	0.10
129	Novocure Ltd	Novocure 有限公司	NVCR US	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,199.00	199,850.36	0.10
130	Rapport Therapeut ics Inc	Rapport Therapeutic s 股份有限 公司	RAPP US	纳斯达 克证券 交易所	美国	935.00	199,392.30	0.10
131	Ardelyx Inc	Ardelyx 股 份有限公	ARDX US	纳斯达 克证券	美国	4,774.00	195,628.51	0.09

		司		交易所				
132	MBX Biosciences Inc	MBX 生物科学股份有限公司	MBX US	纳斯达克证券交易所	美国	882.00	195,529.13	0.09
133	Tyra Biosciences Inc	Tyra 生物科学股份有限公司	TYRA US	纳斯达克证券交易所	美国	1,048.00	193,656.94	0.09
134	AnaptysBio Inc	AnaptysBio 股份有限公司	ANAB US	纳斯达克证券交易所	美国	543.00	185,030.63	0.09
135	Amylyx Pharmaceuticals Inc	Amylyx 制药股份有限公司	AMLX US	纳斯达克证券交易所	美国	2,158.00	183,231.26	0.09
136	Definium Therapeutics Inc	Mind Medicine 股份有限公司	MNMD US	纳斯达克证券交易所	美国	1,935.00	182,113.75	0.09
137	Xeris Biopharma Holdings Inc	Xeris 生物制药控股股份有限公司	XERS US	纳斯达克证券交易所	美国	3,260.00	179,874.02	0.09
138	Septerna Inc	Septerna 股份有限公司	SEPN US	纳斯达克证券交易所	美国	878.00	172,055.46	0.08
139	Amphastar Pharmaceuticals Inc	Amphastar 制药公司	AMPH US	纳斯达克证券交易所	美国	902.00	169,784.60	0.08
140	Savara Inc	Savara 股份有限公司	SVRA US	纳斯达克证券交易所	美国	3,998.00	169,449.89	0.08
141	Omeros Corp	Omeros 公司	OMER US	纳斯达克证券交易所	美国	1,392.00	168,041.74	0.08
142	Tango Therapeutics Inc	Tango Therapeutics 股份有限公司	TNGX US	纳斯达克证券交易所	美国	2,646.00	164,780.09	0.08
143	Phathom Pharmaceuticals Inc	Phathom 制药股份有限公司	PHAT US	纳斯达克证券交易所	美国	1,397.00	162,901.09	0.08
144	ARS Pharmaceuticals Inc	ARS 制药股份有限公司	SPRY US	纳斯达克证券交易所	美国	1,942.00	159,021.68	0.08

145	Inhibrx Biosciences Inc	Inhibrx 生物科技股份有限公司	INBX US	纳斯达克证券交易所	美国	285.00	158,253.43	0.08
146	Grifols SA	基立福公司	GRFS US	纳斯达克证券交易所	美国	2,396.00	157,463.39	0.08
147	Castle Biosciences Inc	Castle 生物技术股份有限公司	CSTL US	纳斯达克证券交易所	美国	573.00	156,669.84	0.08
148	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	844.00	153,528.11	0.07
149	UroGen Pharma Ltd	UroGen 制药有限公司	URGN US	纳斯达克证券交易所	美国	919.00	151,280.72	0.07
150	Xencor Inc	Xencor 股份有限公司	XNCR US	纳斯达克证券交易所	美国	1,402.00	150,870.52	0.07
151	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	3,193.00	150,816.68	0.07
152	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	7,830.00	150,246.93	0.07
153	Sana Biotechnology Inc	Sana 生物技术股份有限公司	SANA US	纳斯达克证券交易所	美国	5,234.00	149,730.17	0.07
154	Erasca Inc	Erasca 股份有限公司	ERAS US	纳斯达克证券交易所	美国	5,574.00	145,744.14	0.07
155	Intellia Therapeutics Inc	Intellia Therapeutics 股份有限公司	NTLA US	纳斯达克证券交易所	美国	2,275.00	143,754.77	0.07
156	AbCellera Biologics Inc	-	ABCL US	纳斯达克证券交易所	美国	5,882.00	141,394.43	0.07
157	Monte Rosa Therapeutics Inc	Monte Rosa Therapeutics 股份有限公司	GLUE US	纳斯达克证券交易所	美国	1,279.00	140,960.62	0.07
158	Day One	Day One 生	DAWN US	纳斯达	美国	2,017.00	132,130.48	0.06

	Biopharmaceuticals Inc	物制药股份有限公司		克证券交易所				
159	Alumis Inc	Alumis 股份有限公司	ALMS US	纳斯达克证券交易所	美国	1,910.00	131,028.08	0.06
160	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	995.00	130,851.30	0.06
161	RAPT Therapeutics Inc	-	RAPT US	纳斯达克证券交易所	美国	544.00	129,507.61	0.06
162	Arbutus Biopharma Corp	Arbutus 生物制药公司	ABUS US	纳斯达克证券交易所	美国	3,778.00	127,728.62	0.06
163	Bicara Therapeutics Inc	Bicara Therapeutics 股份有限公司	BCAX US	纳斯达克证券交易所	美国	1,076.00	127,285.10	0.06
164	CorMedix Inc	CorMedix 股份有限公司	CRMD US	纳斯达克证券交易所	美国	1,548.00	126,541.17	0.06
165	Enliven Therapeutics Inc	Enliven Therapeutics 股份有限公司	ELVN US	纳斯达克证券交易所	美国	1,165.00	126,103.70	0.06
166	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	1,710.00	124,879.99	0.06
167	Mesoblast Ltd	Mesoblast 有限公司	MESO US	纳斯达克证券交易所	美国	964.00	122,234.77	0.06
168	Esperion Therapeutics Inc	Esperion Therapeutics 公司	ESPR US	纳斯达克证券交易所	美国	4,696.00	122,126.81	0.06
169	Vir Biotechnology Inc	Vir 生物技术股份有限公司	VIR US	纳斯达克证券交易所	美国	2,734.00	115,876.94	0.06
170	ArriVent Biopharma Inc	ArriVent 生物制药股份有限公司	AVBP US	纳斯达克证券交易所	美国	811.00	114,691.18	0.06
171	Janux Therapeutics	Janux Therapeutic	JANX US	纳斯达克证券交易所	美国	1,181.00	114,553.98	0.06

	ics Inc	s 股份有限 公司		交易所				
172	Geron Corp	杰龙公司	GERN US	纳斯达克 证券 交易所	美国	12,153.00	112,755.73	0.05
173	KalVista Pharmaceuticals Inc	KalVista 制 药股份有 限公司	KALV US	纳斯达克 证券 交易所	美国	992.00	112,607.00	0.05
174	ORIC Pharmaceuticals Inc	ORIC 制药 股份有限 公司	ORIC US	纳斯达克 证券 交易所	美国	1,913.00	109,989.05	0.05
175	Aquestive Therapeutics Inc	Aquestive Therapeutic s 股份有限 公司	AQST US	纳斯达克 证券 交易所	美国	2,397.00	108,838.30	0.05
176	GH Research PLC	-	GHR US	纳斯达克 证券 交易所	美国	1,218.00	108,725.70	0.05
177	Rigel Pharmaceuticals Inc	Rigel 制药 公司	RIGL US	纳斯达克 证券 交易所	美国	356.00	107,171.49	0.05
178	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	401.00	105,300.98	0.05
179	Replimune Group Inc	域适都技 术股份有 限公司	REPL US	纳斯达克 证券 交易所	美国	1,540.00	105,212.70	0.05
180	Arvinas Inc	Arvinas 股 份有限公 司	ARVN US	纳斯达克 证券 交易所	美国	1,262.00	105,202.30	0.05
181	REGENXBIO Inc	REGENXB IO 股份有 限公司	RGNX US	纳斯达克 证券 交易所	美国	994.00	100,607.43	0.05
182	Annexon Inc	Annexon 股份有限 公司	ANNX US	纳斯达克 证券 交易所	美国	2,843.00	100,314.05	0.05
183	Lexeo Therapeutics Inc	Lexeo Therapeutic s 股份有限 公司	LXEO US	纳斯达克 证券 交易所	美国	1,434.00	100,087.44	0.05
184	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	3,329.00	99,679.21	0.05

185	Gossamer Bio Inc	Gossamer 生物制药股份有限公司	GOSS US	纳斯达克证券交易所	美国	4,547.00	99,075.86	0.05
186	Personalis Inc	Personalis 股份有限公司	PSNL US	纳斯达克证券交易所	美国	1,744.00	97,575.49	0.05
187	Zai Lab Ltd	再鼎医药有限公司	ZLAB US	纳斯达克证券交易所	美国	768.00	95,222.81	0.05
188	Invivyd Inc	Invivyd 股份有限公司	IVVD US	纳斯达克证券交易所	美国	5,446.00	94,548.75	0.05
189	Lyell Immunopharma Inc	Lyell Immunopharma 股份有限公司	LYEL US	纳斯达克证券交易所	美国	416.00	90,000.13	0.04
190	Compass Pathways Plc	Compass Pathways Plc	CMPS US	纳斯达克证券交易所	美国	1,851.00	89,771.13	0.04
191	Ventyx Biosciences Inc	Ventyx 生物科技股份有限公司	VTYX US	纳斯达克证券交易所	美国	1,402.00	88,985.03	0.04
192	MeiraGTX Holdings plc	MeiraGTX 控股公共有限公司	MGTX US	纳斯达克证券交易所	美国	1,580.00	88,288.76	0.04
193	Prime Medicine Inc	Prime 医药股份有限公司	PRME US	纳斯达克证券交易所	美国	3,547.00	86,511.10	0.04
194	Keros Therapeutics Inc	Keros Therapeutics 股份有限公司	KROS US	纳斯达克证券交易所	美国	598.00	85,577.61	0.04
195	Fulcrum Therapeutics Inc	Fulcrum Therapeutics 股份有限公司	FULC US	纳斯达克证券交易所	美国	1,062.00	84,424.46	0.04
196	Cullinan Therapeutics Inc	Cullinan Therapeutics 股份有限公司	CGEM US	纳斯达克证券交易所	美国	1,160.00	84,387.77	0.04
197	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	1,466.00	79,342.50	0.04

198	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	5,932.00	77,969.35	0.04
199	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	3,196.00	75,703.83	0.04
200	Design Therapeutics Inc	Design Therapeutics 股份有限公司	DSGN US	纳斯达克证券交易所	美国	1,118.00	73,709.90	0.04
201	Absci Corp	Absci 公司	ABSI US	纳斯达克证券交易所	美国	2,955.00	72,487.66	0.04
202	Prothena Corp PLC	Prothena 公共有限公司	PRTA US	纳斯达克证券交易所	美国	1,057.00	70,951.17	0.03
203	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	1,140.00	70,673.18	0.03
204	Zevra Therapeutics Inc	Zevra 医疗股份有限公司	ZVRA US	纳斯达克证券交易所	美国	1,106.00	69,653.72	0.03
205	LENZ Therapeutics Inc	LENZ Therapeutics 股份有限公司	LENZ US	纳斯达克证券交易所	美国	607.00	68,263.71	0.03
206	BioAge Labs Inc	BioAge Labs 股份有限公司	BIOA US	纳斯达克证券交易所	美国	704.00	65,465.68	0.03
207	Maravai LifeSciences Holdings Inc	Maravai LifeSciences 控股股份有限公司	MRVI US	纳斯达克证券交易所	美国	2,849.00	65,081.42	0.03
208	Galapagos NV	Galapagos 股份有限公司	GLPG US	纳斯达克证券交易所	美国	282.00	64,815.38	0.03
209	Eton Pharmaceuticals Inc	Eton 制药股份有限公司	ETON US	纳斯达克证券交易所	美国	527.00	62,637.64	0.03
210	Enanta Pharmaceuticals Inc	Enanta 制药公司	ENTA US	纳斯达克证券交易所	美国	565.00	62,626.96	0.03

211	PepGen Inc	PepGen 股份有限公司	PEPG US	纳斯达克证券交易所	美国	1,350.00	61,772.61	0.03
212	Solid Biosciences Inc	Solid 生物科学股份有限公司	SLDB US	纳斯达克证券交易所	美国	1,530.00	60,652.92	0.03
213	SIGA Technologies Inc	SIGA 科技股份有限公司	SIGA US	纳斯达克证券交易所	美国	1,406.00	60,382.03	0.03
214	Evolus Inc	Evolus 股份有限公司	EOLS US	纳斯达克证券交易所	美国	1,273.00	59,501.95	0.03
215	4D Molecular Therapeutics Inc	4D Molecular Therapeutics 股份有限公司	FDMT US	纳斯达克证券交易所	美国	1,122.00	59,147.35	0.03
216	Immuneering Corp	-	IMRX US	纳斯达克证券交易所	美国	1,268.00	58,644.37	0.03
217	NovaBridge Biosciences	新桥生物	NBP US	纳斯达克证券交易所	美国	2,042.00	57,124.18	0.03
218	Kyverna Therapeutics Inc	Kyverna Therapeutics 股份有限公司	KYTX US	纳斯达克证券交易所	美国	860.00	56,820.82	0.03
219	Kamada Ltd	Kamada 有限公司	KMDA US	纳斯达克证券交易所	美国	1,133.00	56,223.23	0.03
220	Autolus Therapeutics PLC	-	AUTL US	纳斯达克证券交易所	美国	3,941.00	55,124.00	0.03
221	Entrada Therapeutics Inc	Entrada Therapeutics 股份有限公司	TRDA US	纳斯达克证券交易所	美国	751.00	54,264.30	0.03
222	Tectonic Therapeutic Inc	Tectonic Therapeutic 股份有限公司	TECX US	纳斯达克证券交易所	美国	367.00	53,809.82	0.03
223	Rocket Pharmaceuticals Inc	Rocket 制药公司	RCKT US	纳斯达克证券交易所	美国	2,125.00	52,426.06	0.03

224	Altimmune Inc	Altimmune 股份有限公司	ALT US	纳斯达克证券交易所	美国	2,049.00	51,991.26	0.03
225	Aura Biosciences Inc	Aura Biosciences 股份有限公司	AURA US	纳斯达克证券交易所	美国	1,247.00	47,768.78	0.02
226	Bicycle Therapeutics PLC	-	BCYC US	纳斯达克证券交易所	美国	909.00	45,235.39	0.02
227	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	2,128.00	45,021.43	0.02
228	Larimar Therapeutics Inc	Larimar 治疗股份有限公司	LRMR US	纳斯达克证券交易所	美国	1,680.00	44,989.94	0.02
229	Anavex Life Sciences Corp	Anavex 生命科学公司	AVXL US	纳斯达克证券交易所	美国	1,755.00	43,914.54	0.02
230	Neurogene Inc	Neurogene 股份有限公司	NGNE US	纳斯达克证券交易所	美国	302.00	43,727.57	0.02
231	AC Immune SA	-	ACIU US	纳斯达克证券交易所	美国	1,972.00	43,522.89	0.02
232	Candel Therapeutics Inc	Candel Therapeutics 股份有限公司	CADL US	纳斯达克证券交易所	美国	1,078.00	42,810.31	0.02
233	Lifecore Biomedical Inc	Lifecore 生物医药公司	LFCR US	纳斯达克证券交易所	美国	736.00	42,316.75	0.02
234	Foghorn Therapeutics Inc	Foghorn Therapeutics 股份有限公司	FHTX US	纳斯达克证券交易所	美国	1,111.00	42,168.58	0.02
235	Jyong Biotech Ltd	健永生科技股份有限公司	MENS US	纳斯达克证券交易所	美国	1,493.00	41,451.29	0.02
236	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	989.00	41,361.33	0.02
237	Neumora Therapeutics	Neumora Therapeutic	NMRA US	纳斯达克证券交易所	美国	3,282.00	41,292.65	0.02

	ics Inc	s 股份有限 公司		交易所				
238	Allogene Therapeut ics Inc	Allogene 治疗股份 有限公司	ALLO US	纳斯达 克证券 交易所	美国	4,278.00	41,194.81	0.02
239	Silence Therapeut ics PLC	Silence 治 疗公共有 限公司	SLN US	纳斯达 克证券 交易所	美国	922.00	39,401.77	0.02
240	Aardvark Therapeut ics Inc	Aardvark 制药股份 有限公司	AARD US	纳斯达 克证券 交易所	美国	427.00	39,392.07	0.02
241	Atea Pharmace uticals Inc	Atea 制药 股份有限 公司	AVIR US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,534.00	38,492.38	0.02
242	OmniAb Inc	OmniAb 股 份有限公 司	OABI US	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,828.00	36,773.28	0.02
243	Contineu m Therapeut ics Inc	Contineum Therapeutic s 股份有限 公司	CTNM US	纳斯达 克证券 交易所	美国	454.00	36,473.99	0.02
244	Voyager Therapeut ics Inc	Voyager 医 疗股份有 限公司	VYGR US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,178.00	32,540.11	0.02
245	Orchestra BioMed Holdings Inc	Orchestra BioMed 控 股股份有 限公司	OBIO US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,109.00	32,349.00	0.02
246	Vor BioPharm a Inc	-	VOR US	纳斯达 克证券 交易所	美国	330.00	30,339.11	0.01
247	Cabaletta Bio Inc	Cabaletta Bio 股份有 限公司	CABA US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,891.00	29,108.30	0.01
248	Quantum- Si Inc	Quantum-S i 股份有限 公司	QSI US	纳斯达 克证券 交易所	美国	3,723.00	28,785.04	0.01
249	Alpha Teknova Inc	-	TKNO US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,051.00	28,071.62	0.01
250	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	1,911.00	27,535.68	0.01
251	C4	C4	CCCC US	纳斯达	美国	1,903.00	25,547.79	0.01

	Therapeutics Inc	Therapeutics 股份有限公司		克证券交易所				
252	Sagimet Biosciences Inc	-	SGMT US	纳斯达克证券交易所	美国	608.00	25,299.18	0.01
253	Arcturus Therapeutics Holdings Inc	Arcturus Therapeutics 控股股份有限公司	ARCT US	纳斯达克证券交易所	美国	577.00	24,860.94	0.01
254	Humacyte Inc	Humacyte 股份有限公司	HUMA US	纳斯达克证券交易所	美国	3,565.00	24,067.88	0.01
255	Coherus Oncology Inc	Coherus Oncology 股份有限公司	CHRS US	纳斯达克证券交易所	美国	2,301.00	22,966.04	0.01
256	Caribou Biosciences Inc	-	CRBU US	纳斯达克证券交易所	美国	1,835.00	20,507.58	0.01
257	Codexis Inc	Codexis 股份有限公司	CDXS US	纳斯达克证券交易所	美国	1,775.00	20,336.08	0.01
258	Black Diamond Therapeutics Inc	Black Diamond Therapeutics 股份有限公司	BDTX US	纳斯达克证券交易所	美国	1,119.00	19,112.50	0.01
259	Rani Therapeutics Holdings Inc	-	RANI US	纳斯达克证券交易所	美国	1,857.00	17,620.85	0.01
260	Pyxis Oncology Inc	Pyxis Oncology 股份有限公司	PYXS US	纳斯达克证券交易所	美国	1,277.00	10,322.14	0.01
261	Achaogen Inc	Achaogen 股份有限公司	AKAOQ US	-	美国	1,615.00	283.82	0.00
262	Synergy Pharmaceuticals LLC	Synergy 制药有限公司	SGYPQ US	-	美国	9,201.00	213.39	0.00

263	Evelo Biosciences Inc	Evelo Biosciences Inc	EVLO US	美国场外交易市场	美国	347.00	1.19	0.00
264	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	0.49	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	Vertex Pharmaceuticals Inc	VRTX US	6,748,039.40	3.88
2	Gilead Sciences Inc	GILD US	5,197,012.78	2.99
3	Amgen Inc	AMGN US	4,054,706.14	2.33
4	Illumina Inc	ILMN US	3,419,737.42	1.97
5	Regeneron Pharmaceuticals Inc	REGN US	3,358,732.80	1.93
6	AstraZeneca PLC	AZN US	2,118,844.01	1.22
7	Alnylam Pharmaceuticals Inc	ALNY US	1,840,484.67	1.06
8	Insmid Inc	INSM US	1,651,349.24	0.95
9	Abivax SA	ABVX US	1,185,364.49	0.68
10	Caris Life Sciences Inc	CAI US	1,105,848.52	0.64
11	Biogen Inc	BIIB US	1,020,009.89	0.59
12	Argenx SE	ARGX US	961,970.69	0.55
13	United Therapeutics Corp	UTHR US	806,956.06	0.46
14	Incyte Corp	INCY US	730,343.10	0.42
15	Summit Therapeutics Inc	SMMT US	710,939.47	0.41
16	Sanofi SA	SNY US	686,666.91	0.40
17	Royalty Pharma PLC	RPRX US	656,838.96	0.38
18	Neurocrine Biosciences Inc	NBIX US	619,697.04	0.36
19	Moderna Inc	MRNA US	611,375.00	0.35
20	Viatis Inc	VTRS US	585,055.69	0.34

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	Gilead Sciences Inc	GILD US	7,595,906.52	4.37
2	Illumina Inc	ILMN US	6,359,571.06	3.66
3	Amgen Inc	AMGN US	4,469,856.89	2.57
4	Regeneron Pharmaceuticals Inc	REGN US	4,050,503.60	2.33
5	Vertex Pharmaceuticals Inc	VRTX US	3,291,003.16	1.89
6	Alnylam Pharmaceuticals Inc	ALNY US	2,933,371.68	1.69
7	Intra-Cellular Therapies Inc	ITCI US	2,575,409.05	1.48
8	AstraZeneca PLC	AZN US	2,569,386.83	1.48
9	Argenx SE	ARGX US	1,626,136.78	0.94
10	Verona Pharma PLC	VRNA US	1,622,597.49	0.93
11	Insmid Inc	INSM US	1,584,552.88	0.91
12	Blueprint Medicines Corp	BPMC US	1,503,787.88	0.87
13	BeOne Medicines Ltd	ONC US	1,314,056.66	0.76
14	Merus NV	MRUS US	1,245,108.73	0.72
15	Biogen Inc	BIIB US	1,207,616.88	0.70
16	United Therapeutics Corp	UTHR US	1,124,549.79	0.65
17	Medpace Holdings Inc	MEDP US	1,023,106.91	0.59
18	Sanofi SA	SNY US	1,011,293.39	0.58
19	Royalty Pharma PLC	RPRX US	975,781.50	0.56
20	Incyte Corp	INCY US	938,090.07	0.54

### 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	66,904,907.00
卖出收入（成交）总额	77,585,845.57

### 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	股票型	交易型开放式	ProShare Advisors LLC	6,025,856.52	2.92

### 8.11 投资组合报告附注

**8.11.1** 本报告期内，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，本基金不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情况。

### 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	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,014,831.84
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	3,014,831.84
---	----	--------------

#### 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

份额级别	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
广发生物科技指数(QDII)A	46,539	2,345.97	18,613.28	0.02%	109,160,304.63	99.98%
广发生物科技指数(QDII)C	24,818	1,286.80	1,031.32	0.00%	31,934,663.04	100.00%
合计	71,357	1,977.59	19,644.60	0.01%	141,094,967.67	99.99%

#### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	广发生物科技指数(QDII)A	42,439.90	0.0389%
	广发生物科技指数(QDII)C	9,059.87	0.0284%
	合计	51,499.77	0.0365%

#### 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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	广发生物科技指数(QDII)A	0
	广发生物科技指数(QDII)C	0

	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	广发生物科技指数 (QDII) A	0
	广发生物科技指数 (QDII) C	0
	合计	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	-	-	10,000,200.02	7.09%	三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	-	-	10,000,200.02	7.09%	三年

#### §10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	广发生物科技指数 (QDII) A	广发生物科技指数 (QDII) C
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	112,232,277.73	36,569,453.70
本报告期基金总申购份额	64,009,927.37	81,195,512.30
减：本报告期基金总赎回份额	67,063,287.19	85,829,271.64
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	109,178,917.91	31,935,694.36

注：本基金份额变动含人民币份额及美元现汇份额。

#### §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金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

本报告期内，本基金管理人、本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 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 8 年为本基金提供审计服务，本报告年度的审计费用为 32,000 元。

### 11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人无受调查或处罚等情况。

#### 11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

#### 11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人无受调查或处罚等情况。

#### 11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

### 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	-	-	-	-	-	-
Citigroup	-	-	-	-	-	-

Goldman Sachs Group Inc.	-	138,054,894.56	100.00%	21,549.99	100.00%	-
State Street Global Markets International Ltd.	-	-	-	-	-	-
United Bank of Switzerland	-	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	减少 1 个
长江证券	3	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	减少 1 个
东北证券	2	-	-	-	-	减少 2 个
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	3	-	-	-	-	-
东兴证券	3	-	-	-	-	-
方正证券	4	-	-	-	-	减少 1 个
高盛中国	1	-	-	-	-	-
光大证券	3	-	-	-	-	-
广发证券	8	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国联民生	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰海通	4	-	-	-	-	-
国投证券	5	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	减少 1 个
华创证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	5	-	-	-	-	-
华兴证券	2	-	-	-	-	-
汇丰前海	2	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	4	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券	3	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
太平洋	2	-	-	-	-	-
天风证券	3	-	-	-	-	-

万联证券	2	-	-	-	-	减少 2 个
西部证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	减少 1 个
兴业证券	3	-	-	-	-	减少 1 个
英大证券	2	-	-	-	-	-
粤开证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	4	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中国银河	2	-	-	-	-	-
中金财富	3	-	-	-	-	-
中金公司	4	-	-	-	-	-
中泰证券	3	-	-	-	-	减少 1 个
中天证券	1	-	-	-	-	-
中信建投证券	3	-	-	-	-	减少 1 个
中信证券	2	-	-	-	-	-

注：一、境内合作券商的选择标准和程序

#### 1、选择标准

- (1) 财务状况良好，经营行为稳健规范，在业内具有良好声誉；
- (2) 内控与合规体系健全，相关制度和流程持续完善，风险控制能力较强；
- (3) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金证券交易需要；
- (4) 具有较强的综合研究能力，有完善的研究报告质量保障机制，能及时提供宏观、行业及市场走向、个股分析报告；
- (5) 具有广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务；
- (6) 中国证监会要求的或公司认为应当具备的其他条件。

#### 2、选择流程

(1) 对拟合作券商进行准入评估。本基金管理人根据上述标准对拟合作券商是否符合准入条件进行评估并确定合作券商。

(2) 协议签署及通知托管人。本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议并通知基金托管人。

#### 二、境外合作券商的选择标准和程序

##### 1、选择标准

- (1) 具有较强的研究和行业分析能力，能及时、全面、准确地向公司提供关于宏观、行业、市场及个股的高质量报告，并能根据境外投资组合投资的特殊要求，提供专门的研究报告；
- (2) 具备投资运作所需的高效、安全、合规的交易执行能力，满足投资组合进行证券交易执行

的需要；

(3) 券商中后台系统能提供良好的交收结算服务。开展股票交易的境外券商，原则上需要支持 DTCC 系统进行交易匹配与交收；

(4) 需要配合完成境外券商尽职调查问卷；

(5) 最近3年未因反洗钱、交易业务内控问题受到经营地监管机构的处罚。

## 2、选择流程

对拟合作券商进行准入评估。本基金管理人根据上述准入标准，对拟合作券商是否符合准入条件进行评估，确定选用符合条件的合作券商，并办理开立交易账户事宜。

### 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	-	-	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs Group Inc.	-	-	-	-	-	-	5,683,510.38	100.00%
State Street Glob	-	-	-	-	-	-	-	-

al Mark ets Inter natio nal Ltd.									
Unite d Bank of Switz erlan d	-	-	-	-	-	-	-	-	-
长城 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
长江 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
德邦 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东北 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东方 财富 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东方 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东海 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
方正 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
高盛 中国	-	-	-	-	-	-	-	-	-
光大 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
广发 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国都 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国海	-	-	-	-	-	-	-	-	-

证券									
国金	-	-	-	-	-	-	-	-	-
证券									
国联	-	-	-	-	-	-	-	-	-
民生									
国盛	-	-	-	-	-	-	-	-	-
证券									
国泰	-	-	-	-	-	-	-	-	-
海通									
国投	-	-	-	-	-	-	-	-	-
证券									
国信	-	-	-	-	-	-	-	-	-
证券									
国元	-	-	-	-	-	-	-	-	-
证券									
华创	-	-	-	-	-	-	-	-	-
证券									
华泰	-	-	-	-	-	-	-	-	-
证券									
华兴	-	-	-	-	-	-	-	-	-
证券									
汇丰	-	-	-	-	-	-	-	-	-
前海									
开源	-	-	-	-	-	-	-	-	-
证券									
民生	-	-	-	-	-	-	-	-	-
证券									
南京	-	-	-	-	-	-	-	-	-
证券									
平安	-	-	-	-	-	-	-	-	-
证券									
瑞银	-	-	-	-	-	-	-	-	-
证券									
申万	-	-	-	-	-	-	-	-	-
宏源									
证券									
世纪	-	-	-	-	-	-	-	-	-
证券									
首创	-	-	-	-	-	-	-	-	-
证券									
太平	-	-	-	-	-	-	-	-	-
洋									
天风	-	-	-	-	-	-	-	-	-
证券									

万联 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
西部 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
西南 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
信达 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
英大 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
粤开 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
招商 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中国 银河	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中金 财富	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中金 公司	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中天 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 建投 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-

### 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	关于旗下部分基金因境外主要投资市场休市暂停申购赎回等业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-01-07
2	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2024 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-01-21
3	广发基金管理有限公司关于调低旗下部分基金管理费率及托管费率并修订基金合同等法	中国证监会规定报刊及网站	2025-01-28

	律文件的公告		
4	关于广发基金管理有限公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-03-19
5	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2024 年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-03-29
6	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2025 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-04-21
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人民币份额调整大额申购(含转换转入、定期定额和不定额投资)业务限额的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-04-28
8	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2025 年第 2 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-07-18
9	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2025 年中期报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-08-30
10	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2025 年第 3 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-10-28
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 2026 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	2025-12-31

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 影响投资者决策的其他重要信息

1、为更好地满足广大投资者的投资理财需求，降低投资者的理财成本，经与基金托管人协商一致，本基金管理人自 2025 年 2 月 6 日起，调低本基金的托管费率，并对基金合同有关条款进行修订。详情可见本基金管理人网站（www.gffunds.com.cn）刊登的《广发基金管理有限公司关于调低旗下部分基金管理费率及托管费率并修订基金合同等法律文件的公告》。

2、为降低投资者的理财成本，经与基金托管人协商一致，自 2025 年 3 月 21 日起，本基金指数使用费调整为基金管理人承担，本基金管理人相应修订了基金合同有关内容。本次调整后，基金管理人旗下全部指数基金指数使用费均由基金管理人承担。详情可见本基金管理人网站

（www.gffunds.com.cn）刊登的《关于广发基金管理有限公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告》。

## §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

### 13.2 存放地点

广东省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 [www.gffunds.com.cn](http://www.gffunds.com.cn)。

广发基金管理有限公司  
二〇二六年三月三十日