

# 汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数 证券投资基金（QDII）2025 年年度报告

2025 年 12 月 31 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2026 年 03 月 31 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 3 月 27 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。

本报告期自 2025 年 01 月 01 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的成员简介	16
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	16
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	16
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	18
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	19
4.7 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	20
4.8 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	21
4.9 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	21
4.10 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	22
§ 5 托管人报告	22
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	22
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	22
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	22
§ 6 审计报告	22
6.1 审计报告的基本信息	22
6.2 审计报告的基本内容	23
§ 7 年度财务报表	24
7.1 资产负债表	24
7.2 利润表	26
7.3 净资产变动表	27
7.4 报表附注	29
§ 8 投资组合报告	60

8.1 期末基金资产组合情况.....	60
8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	61
8.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	61
8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细.....	61
8.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	115
8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	117
8.7 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.....	117
8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	117
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.....	117
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.....	118
8.11 投资组合报告附注.....	118
§ 9 基金份额持有人信息.....	118
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	118
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	119
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	120
9.4 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.....	120
9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的 产品情况.....	120
§ 10 开放式基金份额变动.....	120
§ 11 重大事件揭示.....	120
11.1 基金份额持有人大会决议.....	121
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.....	121
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	121
11.4 基金投资策略的改变.....	121
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	121
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....	121
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	123
11.8 其他重大事件.....	125
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....	133
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20% 的情况.....	133
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	135
§ 13 备查文件目录.....	135
13.1 备查文件目录.....	135
13.2 存放地点.....	135
13.3 查阅方式.....	135

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）
基金简称	汇添富纳斯达克生物科技 ETF
场内简称	纳指生物
基金主代码	513290
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2022 年 08 月 15 日
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额（份）	1,035,072,120.00
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2022 年 08 月 29 日

注：扩位证券简称：纳指生物科技 ETF。

### 2.2 基金产品说明

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。
投资策略	本基金主要采用完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。本基金的投资策略主要包括：资产配置策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、金融衍生工具投资策略、参与境内融资投资策略、参与境内转融通证券出借业务策略、境内外存托凭证的投资策略。
业绩比较基准	经人民币汇率调整的纳斯达克生物科技指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金主要投资于境外证券市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还将面临汇率风险、境外证券市场风险等特殊投资风险。

### 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	汇添富基金管理股份有限公司	中国银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	李鹏	许俊
	联系电话	021-28932888	010-66596688
	电子邮箱	service@99fund.com	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		400-888-9918	95566
传真		021-28932998	010-66594942
注册地址		上海市黄浦区外马路 728 号 9 楼	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		上海市黄浦区外马路 728 号	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		200010	100818
法定代表人		鲁伟铭	葛海蛟

## 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	中文	布朗兄弟哈里曼银行
	英文	Brown Brothers Harriman & Co.
注册地址		140 Broadway New York
办公地址		140 Broadway New York
邮政编码		NY 10005

注：本基金无境外投资顾问。

## 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.99fund.com
基金年度报告备置地点	上海市黄浦区外马路 728 号 汇添富基金管理股份有限公司

## 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
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 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
---------------	--------	--------	--------

本期已实现收益	42,940,980.49	57,414,981.89	2,257,045.81
本期利润	347,467,936.33	-37,007,487.86	40,915,189.29
加权平均基金份额本期利润	0.3071	-0.0359	0.2716
本期加权平均净值利润率	25.44%	-3.05%	25.76%
本期基金份额净值增长率	29.11%	0.25%	4.91%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>2025 年末</b>	<b>2024 年末</b>	<b>2023 年末</b>
期末可供分配利润	132,630,675.08	117,516,195.78	19,856,691.26
期末可供分配基金份额利润	0.1281	0.0870	0.0281
期末基金资产净值	1,511,183,771.80	1,527,169,600.76	797,610,524.33
期末基金份额净值	1.4600	1.1308	1.1280
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>2025 年末</b>	<b>2024 年末</b>	<b>2023 年末</b>
基金份额累计净值增长率	46.00%	13.08%	12.80%

注：1、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。

2、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(例如：基金的申购赎回费等)，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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。

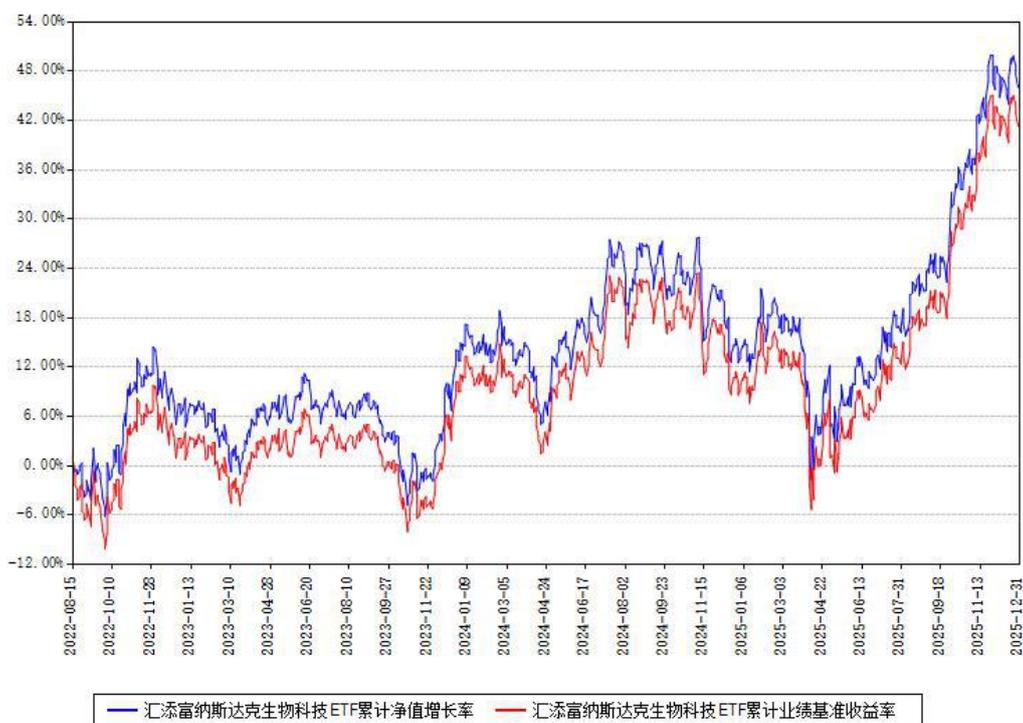
## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	① - ③	② - ④
过去三个月	15.23%	1.23%	15.69%	1.23%	-0.46%	0.00%
过去六个月	32.25%	1.19%	32.55%	1.20%	-0.30%	-0.01%
过去一年	29.11%	1.48%	29.46%	1.49%	-0.35%	-0.01%
过去三年	35.79%	1.24%	36.71%	1.24%	-0.92%	0.00%
自基金合同生效起至今	46.00%	1.28%	41.29%	1.30%	4.71%	-0.02%

### 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

汇添富纳斯达克生物科技ETF累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



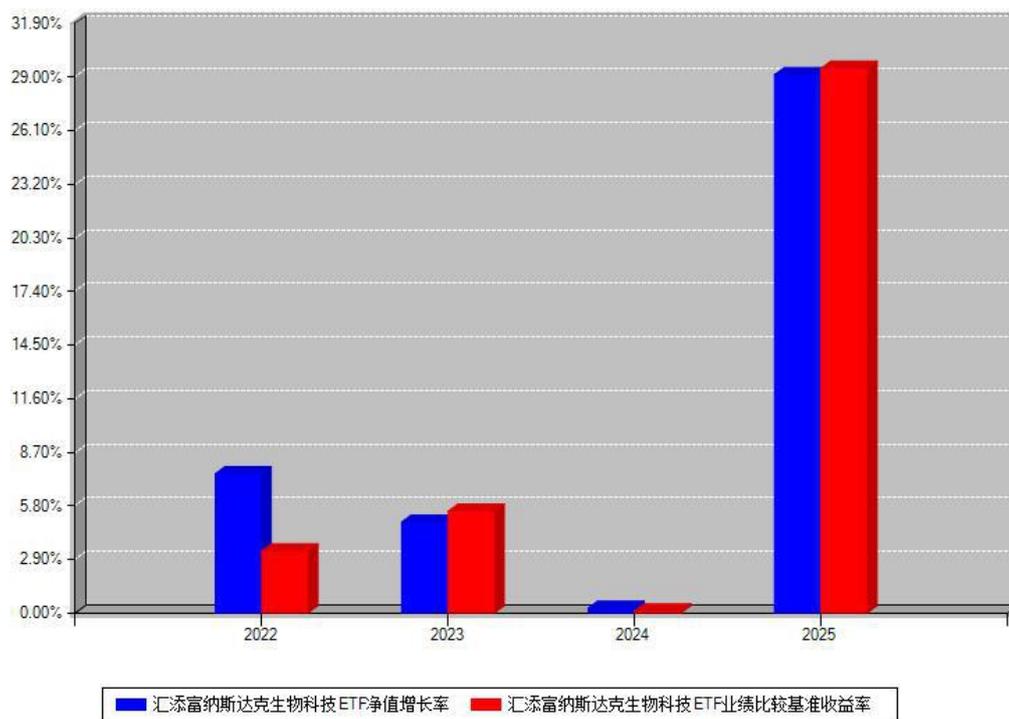
注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2022年08月15日）起6个月，建仓期结

束时各项资产配置比例符合合同约定。

本基金各类份额自实际有资产之日起披露业绩数据。

### 3.2.3 自基金合同生效以来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

汇添富纳斯达克生物科技ETF每年净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：本《基金合同》生效之日为 2022 年 08 月 15 日，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金过去三年均未进行利润分配。

## § 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

汇添富基金成立于 2005 年 2 月，是中国一流的综合性资产管理公司之一。公司总部设立于上海，在北京、上海、广州、成都、南京、深圳等地设有分公司，在香港、上海、美国、

新加坡设有子公司——汇添富资产管理(香港)有限公司、汇添富资本管理有限公司、汇添富投资管理有限公司、汇添富资产管理(美国)控股有限公司、汇添富资产管理(新加坡)有限公司、汇添富基金销售(上海)有限公司。公司及旗下子公司业务牌照齐全,拥有全国社保基金境内委托投资管理人、全国社保基金境外配售策略方案投资管理人、基本养老保险基金投资管理人、保险资金投资管理人、专户资产管理人、特定客户资产管理子公司、QDII 基金管理人、RQFII 基金管理人、QFII 基金管理人、基金投资顾问、公募证券投资基金销售等业务资格。

汇添富现已形成公募业务、私募资管业务、私募股权业务、养老金业务、电商业务、国际业务、基金投顾业务等七大业务板块,被誉为“选股专家”,赢得广大基金持有人和海内外机构的认可和信赖。

成立以来,公司屡获殊荣,包括“金牛奖”“金基金奖”“明星基金奖”等多项权威荣誉奖项。汇添富始终坚持“客户第一”的价值观和“一切从长期出发”的经营理念,致力于打造中国最受认可的资产管理品牌。

2025 年,汇添富基金新成立 54 只公开募集证券投资基金。截至 2025 年 12 月 31 日,汇添富基金共管理 395 只公募基金,涵盖股票型基金、指数型基金、QDII 基金、混合型基金、债券型基金、REITs 基金及货币市场基金等各类产品。

2025 年,汇添富基金持续坚持以客户为中心,以提升投资者长期回报为核心导向,持续完善投顾式服务体系,强化全流程投资陪伴与资产配置能力。公司互联网金融业务围绕数字化转型,依托大数据与 AI 等技术,持续优化平台功能与服务流程,提升客户触达效率与服务精准度。同时,汇添富基金持续深耕互联网平台合作,丰富投教内容与工具供给,通过线上线下融合、内容创新与场景化运营,打造更开放、协同的服务生态,更好满足客户多元化、个性化的投资需求,持续提升客户体验与满意度。

2025 年,汇添富基金坚持金融服务实体经济本源,秉持“一切从长期出发”和“客户第一”的经营理念,以高质量发展为核心,持续提升投资者的获得感。在客户服务方面,公司继续坚定推进与核心机构客户的合作战略。公司深化组织变革,通过团队专业化分工,持续提升客户服务及产品运营能力。公司坚定推进与核心机构客户的合作战略,与银行及银行理财公司加快合作,保险规模维持市场领先地位,同时也致力于服务其他机构投资者的专业投资需求。在产品策略上,公司优化产品布局并夯实底层资产布局,构建多元化、多层次的产品矩阵,满足匹配各类机构投资者的差异化配置需求。养老金业务方面,公司拥有全国社

保基金境内投资管理人及基本养老保险基金投资管理人资格,也是全国社保基金境外配售策略管理人。养老金业务继续稳健发展,受托管理组合规模持续增加。在数字化建设方面,强化科技赋能,加速数字化转型,深化人工智能(AI)技术在业务全流程的应用,在运营效能与服务质量上取得突破,持续为客户及团队赋能。

2025年,汇添富渠道业务坚持“一切从长期出发、客户第一”原则,围绕提升“客户获得感”开展各项业务合作和产品布局。顺应行业净值化转型与居民稳健理财需求,以固收+产品为核心,深化银行渠道融合与科技赋能,实现高质量增长。将基金产品精准匹配银行客户多元资产配置需求,助力客户优化风险收益结构。银行渠道深化国有行、股份行战略合作,围绕客户全生命周期理财需求,打造专属资产配置方案。全年线下投教活动7786场,覆盖超50万人次;线上升级AI工具与数字化内容矩阵,全流程赋能银行渠道,获合作伙伴高度认可。

2025年,汇添富基金持续深化券商专业化服务。全年紧扣机构客户核心需求,打造“添富投资月度策略会”、“云调研固收+基金专题”等系列调研活动;同时面向渠道客户,在全国范围内开展多场投顾赋能培训,助力券商夯实资产配置能力、优化客户服务体系。为拓宽投资者交流渠道,部门全年落地超300场线下活动,涵盖“指能添富”、“渠道赋能千场行”及“走进汇添富”等特色活动。秉持“客户第一”的理念,汇添富基金通过为券商提供全流程专业支持,推动优质服务触达更广泛的投资者群体。

2025年,汇添富基金持续提升客户服务能力,进一步完善服务体系建设,为公司各项业务提供全方位支持。同时,持续优化电话服务、在线客服、短信系统等服务通道建设,丰富服务渠道,提升客户体验。

2025年,汇添富香港子公司持续深化与母公司的两地一体化运营及垂直化管理模式,核心业务实现跨越式增长,客户覆盖范围进一步拓宽,客群基础进一步夯实。在产品线维度,公司立足权益投资的核心专长,新增多个主动管理权益专户,同时固定收益与权益类资产规模同步攀升,核心产品竞争力持续凸显。至此,公司境外产品线已形成境外权益、固定收益、货币市场的多元布局,为投资者全球资产分散配置提供了坚实支撑。下一步香港子公司将继续通过国际路演保持与全球央行、主权、养老、校务基金、家族信托等海外机构的沟通,进一步完善个性化客户服务体系,积极引导长期资金入市。

2025年以来,汇添富基金积极开展公益慈善工作,充分发挥公募基金优势,践行社会责任,为助力实现“共同富裕”与中国式现代化贡献力量。公司连续十七年开展“河流·孩

子”公益助学项目，举办第十八期乡村优秀青年教师培训和第八届乡村教育管理研习班，助力乡村教育高质量发展；参与中国慈善联合会《慈善组织投资管理指南》团体标准起草，启动“基业上善”慈善资产管理研修营第二期项目，发布《基金会慈善资产管理委员会指南（试行）》，用专业力量推动公益慈善事业可持续发展；发起第三期“致敬城市建设者”公益项目、汇爱社区支持计划一期，助力上海的社区发展，为人民城市增添温度；通过捐赠驰援香港火灾救援工作，与香港同胞共渡难关；参加云南、青海、内蒙古等地产业和教育帮扶等项目，深化东西部协作，助力乡村振兴。

2026 年，汇添富基金将继续秉持一贯的经营理念与原则，进一步加强风险管理能力，提升客户服务水平，推动业务稳步发展，为促进实体经济健康发展、提升中国居民财富水平而不懈努力。

#### 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（年）	说明
		任职日期	离任日期		
过蓓蓓	本基金的基金经理，指数与量化投资部副总监	2022 年 08 月 15 日	-	14	国籍：中国。学历：中国科学技术大学金融工程博士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任国泰基金管理有限公司金融工程部助理分析师、量化投资部基金经理助理。2015 年 6 月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任指数与量化投资部副总监。2015 年 8 月 3 日至今任汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2015 年 8 月 3 日至 2023 年 4 月

					<p>13 日任中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2015 年 8 月 3 日至 2023 年 4 月 6 日任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2015 年 8 月 3 日至今任中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2015 年 8 月 3 日至今任中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2015 年 8 月 18 日至 2023 年 8 月 29 日任汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2015 年 8 月 18 日至 2023 年 5 月 22 日任深证 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2016 年 12 月 22 日至今任汇添富中证生物科技主题指数型发起式证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2016 年 12 月 29 日至 2022 年 12 月 1 日任汇添富中证中药指数型发起式证券投资基金(LOF)的</p>
--	--	--	--	--	--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

					<p>基金经理。2018年5月23日至今任汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2018年10月23日至2023年5月22日任中证银行交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019年3月26日至今任汇添富中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019年4月15日至2022年6月13日任中证银行交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019年10月8日至今任中证800交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021年2月1日至今任汇添富国证生物医药交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021年6月3日至今任汇添富中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021年9月29日至2023年5月18日任汇添富中证</p>
--	--	--	--	--	-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

					<p>800 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022 年 2 月 28 日至 2022 年 10 月 31 日任汇添富国证生物医药交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022 年 8 月 15 日至今任汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 的基金经理。2022 年 9 月 26 日至今任汇添富中证中药交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 10 月 20 日至 2024 年 4 月 8 日任汇添富中证 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 12 月 2 日至今任汇添富中证中药交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 的基金经理。2023 年 3 月 14 日至今任汇添富纳斯达克生物科技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。2023 年 3 月 30 日至今任汇添</p>
--	--	--	--	--	-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

					富纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 的基金经理。2023 年 8 月 2 日至今任汇添富纳斯达克 100 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。2023 年 8 月 23 日至今任汇添富黄金及贵金属证券投资基金 (LOF) 的基金经理。
--	--	--	--	--	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

注:基金的首任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日,其“离任日期”为根据公司决议确定的解聘日期。

非首任基金经理,其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期。

证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注:截至本报告期末,本基金的基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的成员简介

注:本基金无境外投资顾问。

#### 4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,力争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。本基金无重大违法、违规行为,本基金投资运作符合有关法规及基金合同的约定。

#### 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.4.1 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本公司制定了《汇添富基金管理股份有限公司公平交易制度》，建立了健全、有效的公平交易制度体系。公司公平交易管理体系覆盖了公募基金、资产管理计划、社保组合、基本养老组合以及投资顾问业务等各类资产管理业务所涉及的所有投资组合；涵盖了境内外上市股票、债券等所有投资品种的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动；贯穿了授权、研究分析、投资决策、交易执行以及效果评估等投资管理活动的各个环节。具体控制措施包括：

在研究分析环节，公司建立了统一、规范和完善的投研平台信息管理系统，规范了研究人员的投资建议、研究报告的发布流程，使各投资组合经理在获取投资建议的及时性、准确性及深度等方面得到公平对待。

在投资决策环节，公司建立健全投资授权制度，明确投资决策委员会、分管投资副总、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限，合理确定各投资组合经理的投资权限。投资决策委员会和分管投资副总等管理机构和人员不得对投资组合经理在授权范围内的投资活动进行干预。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必须经过严格的审批程序。

在交易执行环节，本公司设立了独立于投资管理职能的交易部门，实行了集中交易制度和公平的交易分配机制。对于交易所公开竞价的同向交易，内部制定了相应的交易管理规则，保证各投资组合获得公平的交易执行机会；对于银行间市场的现券、回购等场外交易，交易部在交易市场开展独立、公平的询价，确保交易得到公平执行；对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，集中交易部按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配，确保公平对待各投资组合。

在日常监控环节，公司通过日常监控分析、投资交易监控报告、专项稽核等形式，对投资交易全过程实施监督，对包括利益输送在内的各类异常交易行为进行核查。核查的范围包括不同时间窗口下的同向交易、反向交易、交易价差、收益率差异、场外交易分配、场外价格公允性等。

在报告分析环节，公司按季度和年度编制公平交易分析报告，对不同组合间同一投资标的、临近交易日的同向交易和反向交易的合理性开展分析评估，并由投资组合经理、督察长、总经理审核签署。

#### 4.4.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人通过建立事前、事中和事后全程嵌入式的管控模式，保障公平交易制度的执行和实现。具体情况如下：

本基金管理人建立了内部公平交易管理规范和流程，公平交易管控覆盖公司所有业务类型、投资策略、投资品种，以及投资授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动相关的各个环节。

本着“时间优先、价格优先”的原则，对同一证券有相同交易需求的投资组合采用交易系统内的公平交易模块，实现事中交易执行层面的公平管控。

对不同投资组合进行同向交易价差分析，具体方法为：在不同时间窗口（日内、3日内、5日内）下，对不同组合同一证券同向交易的平均价差率进行 T 检验。对于未通过 T 检验的交易，再根据同向交易占优比、交易价格、交易频率、交易数量和交易时间等进行具体分析，进一步判断是否存在重大利益输送的可能性。

对于反向交易，根据交易顺序、交易时间窗口跨度、交易价格、交易数量等综合判断交易是否涉及利益输送。

综上，本基金管理人通过事前的制度规范、事中的监控和事后的分析评估，严格执行了公平交易制度，公平对待旗下各投资组合。本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况。

#### 4.4.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价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% 的情况有 4 次，投资组合因投资策略与其他组合发生反向交易。基金管理人事前严格根据内部规定进行管控，事后对交易时点、交易数量、交易价差等多方面进行综合分析，未发现导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

此外，为防范基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的潜在利益冲突，本基金管理人从投资指令、交易行为、交易监测等多方面，对兼任组合进行监控管理和分析评估。本报告期内兼任组合未出现违反公平交易或异常交易的情况。

### 4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2025 年美国展现出韧性，尽管面临关税壁垒、地缘政治紧张局势及政府停摆导致

部分增长推迟至 2026 年初等挑战，强劲的消费支出、人工智能驱动的投资以及企业盈利稳健仍为经济提供支撑。第三季度 GDP 增速创两年新高，主要由消费和 IT 相关投资驱动。劳动力市场温和降温，就业增长放缓，薪资涨幅趋缓，但就业人数仍保持正增长。通胀持续高于目标水平，受关税传导效应及服务价格粘性影响，年底 CPI 预计维持在 2.8%–3.0% 区间，但住房通胀从 5.1% 回落至 3.7%。经济衰退风险从 30%–40% 降至 20%–30%。在货币政策方面，美联储采取鸽派立场，这一宽松周期始于应对通胀放缓和劳动力市场风险。联邦公开市场委员会的《经济预测摘要》呈现均衡预期，政策调整强调数据依赖性，年初曾提及的就业下行风险随着经济增长在 12 月被移除。

在此宏观背景下，美股在波动中实现强劲增长，人工智能投资、贸易紧张局势、关税政策及板块轮动等因素共同推动市场发展。主要股指全年涨幅显著，标普 500 指数全年上涨约 16.39%，纳斯达克 100 上涨 20.17%，均为连续第三年实现两位数回报。经济韧性支撑股市走强，企业盈利超预期及季节性利好因素功不可没，但年末 AI、机器人相关的公司缺乏新的催化因素，科技股获利了结，引发市场震荡回撤。美股传统行业如房地产、能源、主要消费表现仍然相对滞后，但医疗保健板块表现尤为亮眼，纳指生物科技在 2025 年创出近 10 年以来最大年度涨幅，扭转了多年低迷的状态。

年初，美国生物科技产业受关税政策不确定性影响，行业估值触底、融资放缓。但随着美联储降息、政策明朗化以及大型药企专利悬崖压力加剧，2025 年下半年并购热潮涌现、融资回暖，叠加 AI 医疗为行业注入行动力，小型生物科技公司通过技术突破和并购交易推动了股价上涨，纳指生物科技指数显著反弹。可以说，并购活动、临床创新及政策利好共同推动了美股创新药的复苏。根据 CDER 的数据，2025 年 FDA 批准 46 种新型药物，主要聚焦于未满足的医疗需求，其中癌症是最主要的治疗领域，其次是血液病、心血管疾病、免疫/炎症疾病、呼吸系统疾病、罕见遗传或代谢疾病等，大约 30% 的获批新药被认定为首创药物。纳斯达克生物科技指数经历了 2025 年的大幅上涨，年末正数市盈率 27 倍，并未显著高估，基本保持在 2018 年以来的均值水平。

作为被动投资的指数基金，本基金在投资运作上严格遵守基金合同，坚持既定的投资策略，积极采取有效方法控制基金相对业绩比较基准的跟踪误差，实现投资目标。

#### 4.5.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期基金份额净值增长率为 29.11%，同期业绩比较基准收益率为 29.46%。

#### 4.6 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，美股的决定性变量是人工智能的发展和大宗商品涨价带来的通胀概率，以及新任美联储主席在降息缩表上的路径选择。如果美债利率陡峭化，将可能使得长期资金从股票市场流出去配置长端债券，将对美股及低利率国别资产造成一定的流动性压力。目前，市场对人工智能的前景保持乐观态度，认为其将成为推动经济增长、生产力提升和市场表现的变革力量。在 AI 发展的宏观环境下，劳动力成本的工资通胀螺旋有可能逐渐失效，降息缩表的路径有可能达成。

2026 年美国生物科技投资前景总体向好，创新驱动、并购活跃及政策利好将延续行业动能，但政府对于低药价的诉求有可能成为股价波动性因素。在临床数据利好、商业化上市及 IPO 市场复苏推动下，生物科技板块有望延续强劲表现。同时，人工智能赋能的健康科技与医疗科技有可能成为新的增长点，研发效率提升为降低创新成本带来空间。投资纳斯达克生物科技板块需要把握技术创新和宏观政策周期双重主线，关注技术和宏观双重因素。

#### 4.7 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人内部稽核监察工作主要包括以下几个方面：

##### 1、持续提升合规管理

公司以党的二十届四中全会精神为指导，全面响应公募基金高质量发展行动方案，持续完善合规管理体系建设，在合规管理工作中贯彻落实政策精神及各项法规要求，坚守合规底线、防范合规风险。公司持续践行“合规、诚信、专业、稳健”的行业文化，坚持“正直”、“客户第一”的价值观，通过完善合规管理体系、提升合规专业能力、优化合规资源配置等举措，不断提升合规管理工作的有效性。公司强化合规制度建设，同时深入审慎开展合规审查、合规咨询、合规检查、合规监测等日常工作；高度重视并持续开展员工执业操守和职业道德建设，广泛开展合规培训，强化全员合规意识及合规敏感度；加强监督督促职能，规范人员执业行为，强化一线合规执行效果；高度重视合规管理专业能力建设，保障合规资源配置、优化合规工作机制，不断提升公司合规管理水平。

##### 2、完善投资合规风险控制工作

本基金管理人持续优化投资运作管理事前、事中、事后全流程的投资合规风险管理措施。

事前，加强新产品、新业务的风险识别、评估。在产品的设计环节评估新产品、新业务的投资合规性，为管控新产品、新业务运作中的潜在投资合规风险奠定基础。此外，本基金管理人坚持制度先行，通过制定或修订各项投资管理制度，为业务的开展提供了科学规范的制度依据。

事中，管控措施不断完善。通过配置投资交易系统风控参数、加强事中流程审核等，有效保障投资交易行为合规。同时，通过对基金日常流动性、投资组合风险敞口等进行监控、分析、提示，完善日常投资合规风险监控体系。

事后，风险跟踪提示机制持续优化。通过对投资范围、投资限制、公平交易、异常交易情况等的跟踪、分析和提示，有效落实法律法规、基金合同及公司内部制度的各项要求。

### 3、持续加强稽核工作

公司持续完善稽核管理机制，促进稽核工作高质量发展；通过开展多种类型多项目稽核检查工作，对公司内部控制的合规与风险管理情况，以及人员履职情况进行检查、评价、报告与监督；通过协助监管机构开展各项自查、核查工作，协调第三方独立机构开展审计、鉴证工作，进一步评估公司内控管理有效性；通过督促并跟踪检查风险隐患整改，持续优化公司内部控制管理，切实维护基金份额持有人利益，促进公司持续、稳定、健康发展。

通过上述工作，本报告期内，本基金管理人管理的基金能够合法合规开展投资运作。本基金管理人将规范运作基金资产，加强风险控制，持续提高监察稽核工作的科学性和有效性，充分保障基金份额持有人的合法权益。

## 4.8 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、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，并保持估值政策和程序的一贯性。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责构建估值决策体系、适时更新估值相关制度、指导并监督各类投资品种的估值程序。估值委员会由投资、研究、集中交易、合规稽核、风险管理、基金营运等部门中具有丰富从业经验和专业胜任能力的员工担任，且互相不存在直接的重大利益冲突。基金经理可参与估值委员会对于估值方法的讨论，但无最终决策权，从而将其影响程度进行适当限制，保证基金估值的公平、合理。

基金日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由管理人完成估值后，经托管人复核无误后由管理人对外公布。

## 4.9 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：本基金收益分配采用现金分红；每一基金份额享有同等分配权；本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分

配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

本基金本报告期内未进行收益分配。

#### 4.10 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

无。

## § 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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责的履行了应尽的义务。

### 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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。（如果报告期内基金的投资运作存在违反法律法规、基金合同的行为，或损害基金份额持有人利益的行为，我行将根据对年报终稿的审核情况，如实描述违法违规或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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等财务数据真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告的基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见

审计报告编号	安永华明（2026）审字第 70015647_B238 号
--------	-------------------------------

## 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）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。</p> <p>我们认为，后附的汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）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，公允反映了汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>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，我们独立于汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII），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。</p>
强调事项	不适用
其他事项	不适用
其他信息	<p>汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>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。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）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。</p> <p>治理层负责监督汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证</p>

	券投资基金（QDII）的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>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。</p> <p>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：</p> <p>（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。</p> <p>（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。</p> <p>（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。</p> <p>（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，就可能对汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）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汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）不能持续经营。</p> <p>（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。</p> <p>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。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	蔺育化   戴唯
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层
审计报告日期	2026年03月27日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）

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	8,747,418.65	13,944,085.98
结算备付金		1,069.73	1,055.12
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	1,503,454,517.06	1,521,097,935.71
其中：股票投资		1,503,454,517.06	1,521,097,935.71
基金投资		-	-
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		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,512,203,005.44	1,535,043,076.81
<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		-	6,920,749.94
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		645,564.33	613,635.47
应付托管费		193,669.31	184,090.64
应付销售服务费		-	-
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	180,000.00	155,000.00
负债合计		1,019,233.64	7,873,476.05
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.8	1,035,072,120.00	1,350,572,120.00
未分配利润	7.4.7.9	476,111,651.80	176,597,480.76
净资产合计		1,511,183,771.80	1,527,169,600.76
负债和净资产总计		1,512,203,005.44	1,535,043,076.81

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.4600 元，基金份额总额 1,035,072,120.00 份。

## 7.2 利润表

会计主体：汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）

本报告期：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 01 月 01 日 至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日 至 2024 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		<b>356,604,389.87</b>	<b>-28,881,742.22</b>
1.利息收入		30,367.32	59,993.56
其中：存款利息收入	7.4.7.10	30,367.32	59,993.56
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）		51,752,729.02	65,510,624.66
其中：股票投资收益	7.4.7.11	42,009,508.62	56,493,688.69
基金投资收益	7.4.7.12	-	-
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	9,743,220.40	9,016,935.97
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	304,526,955.84	-94,422,469.75
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		3,400,675.26	-5,626,708.30
5.其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.19	-3,106,337.57	5,596,817.61

<b>减：二、营业总支出</b>		<b>9,136,453.54</b>	<b>8,125,745.64</b>
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	6,862,563.48	6,103,960.09
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	2,058,769.15	1,831,188.11
3. 销售服务费		-	-
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		-	-
8. 其他费用	7.4.7.21	215,120.91	190,597.44
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>347,467,936.33</b>	<b>-37,007,487.86</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>347,467,936.33</b>	<b>-37,007,487.86</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>347,467,936.33</b>	<b>-37,007,487.86</b>

### 7.3 净资产变动表

会计主体：汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）

本报告期：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 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	1,350,572,120.00	176,597,480.76	1,527,169,600.76
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	1,350,572,120.00	176,597,480.76	1,527,169,600.76
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-315,500,000.00	299,514,171.04	-15,985,828.96
（一）、综合收益总额	-	347,467,936.33	347,467,936.33
（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）	-315,500,000.00	-47,953,765.29	-363,453,765.29

其中：1.基金申购款	330,500,000.00	63,168,717.72	393,668,717.72
2.基金赎回款	-646,000,000.00	-111,122,483.01	-757,122,483.01
（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	1,035,072,120.00	476,111,651.80	1,511,183,771.80
项目	上年度可比期间		
	2024年01月01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	707,072,120.00	90,538,404.33	797,610,524.33
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	707,072,120.00	90,538,404.33	797,610,524.33
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	643,500,000.00	86,059,076.43	729,559,076.43
（一）、综合收益总额	-	-37,007,487.86	-37,007,487.86
（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）	643,500,000.00	123,066,564.29	766,566,564.29
其中：1.基金申购款	1,874,500,000.00	330,330,808.69	2,204,830,808.69
2.基金赎回款	-1,231,000,000.00	-207,264,244.40	-1,438,264,244.40
（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	1,350,572,120.00	176,597,480.76	1,527,169,600.76

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：

<u>张晖</u>	<u>李骁</u>	<u>雷青松</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可〔2021〕3806号文《关于准予汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)注册的批复》准予注册,由汇添富基金管理股份有限公司向社会公开募集。经向中国证监会备案,基金合同于2022年8月15日生效。首次设立基金募集规模为282,072,120.00份基金份额,业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)出具安永华明(2022)验字第60466941\_B43号验资报告予以验证。本基金为交易型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为汇添富基金管理股份有限公司,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为中国银行股份有限公司,境外托管人为布朗兄弟哈里曼银行。

### 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》第2号《年度报告的内容与格式》、《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01月01日至2025年12月31日的经营成果和净值变动情况。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

### 7.4.4.2 记账本位币

本基金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，均以人民币元为单位表示。

### 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：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

#### （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。

### 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的有关过去事项、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，且该种法定权利现在是可执行的，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的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 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)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;

(4)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;

(5)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;

(6)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;

(7)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;

(8)其他收入在经济利益很可能流入从而导致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

- 1、《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配;
- 2、本基金收益分配采用现金分红;
- 3、每一基金份额享有同等分配权;

4、本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；

5、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

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

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 本基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

### 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

本基金本报告期无会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 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。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，本基金的基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对本基金在 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，已纳税额从本基金的基金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；

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育附加；

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，在境内暂免征增值税和企业所得税；

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

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 货币资金

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
活期存款	8,747,418.65	13,944,085.98
等于：本金	8,746,831.16	13,943,490.27
加：应计利息	587.49	595.71
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
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	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	8,747,418.65	13,944,085.98

#### 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	1,252,891,292.89	-	1,503,454,517.06	250,563,224.17
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	境外 OTC 市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-

基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,252,891,292.89	-	1,503,454,517.06	250,563,224.17
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	1,575,061,667.38	-	1,521,097,935.71	-53,963,731.67
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	境外 OTC 市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,575,061,667.38	-	1,521,097,935.71	-53,963,731.67

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

#### 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

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 债权投资

##### 7.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金无债权投资。

##### 7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金不存在债权投资减值准备计提情况。

#### 7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

### 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	-	-
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	-	-
应付审计费	60,000.00	35,000.00
应付信息披露费	120,000.00	120,000.00
应付指数使用费	-	-
应付账户维护费	-	-
应付汇划费	-	-
应付上市费	-	-
应付持有人大会费-公证费	-	-
应付持有人大会费-律师费	-	-
应付或有管理费	-	-
申购款利息	-	-
应付登记结算费	-	-
应付 IOPV 计算与发布费	-	-
其他	-	-
合计	180,000.00	155,000.00

### 7.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,350,572,120.00	1,350,572,120.00
本期申购	330,500,000.00	330,500,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-646,000,000.00	-646,000,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号	-	-

填列)		
本期末	1,035,072,120.00	1,035,072,120.00

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.9 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	117,516,195.78	59,081,284.98	176,597,480.76
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	117,516,195.78	59,081,284.98	176,597,480.76
本期利润	42,940,980.49	304,526,955.84	347,467,936.33
本期基金份额交易产生的变动数	-27,826,501.19	-20,127,264.10	-47,953,765.29
其中：基金申购款	30,481,965.07	32,686,752.65	63,168,717.72
基金赎回款	-58,308,466.26	-52,814,016.75	-111,122,483.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	132,630,675.08	343,480,976.72	476,111,651.80

#### 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01月01日至2025年12月31日	2024年01月01日至2024年12月31日
活期存款利息收入	30,352.71	59,975.26
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	14.61	18.30
其他	-	-
合计	30,367.32	59,993.56

#### 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	上年度可比期间
	2025年01月01日至2025年12月31日	2024年01月01日至2024年12月31日
股票投资收益—买卖股票差价收入	42,009,508.62	56,493,688.69
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	42,009,508.62	56,493,688.69

#### 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	上年度可比期间
	2025年01月01日至2025年12月31日	2024年01月01日至2024年12月31日
卖出股票成交总额	1,023,629,411.13	1,616,388,860.38
减：卖出股票成本总额	981,125,305.39	1,558,475,230.35
减：交易费用	494,597.12	1,419,941.34
买卖股票差价收入	42,009,508.62	56,493,688.69

#### 7.4.7.12 基金投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无基金投资收益。

#### 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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益。

##### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无买卖资产支持证券差价收入。

#### 7.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.16 衍生工具收益

#### 7.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无买卖权证差价收入。

#### 7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具其他投资收益。

#### 7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025 年12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024 年12月31日
股票投资产生的股利收益	9,743,220.40	9,016,935.97
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	9,743,220.40	9,016,935.97

#### 7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年01月01日至2025年12 月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12 月31日
1.交易性金融资产	304,526,955.84	-94,422,469.75
——股票投资	304,526,955.84	-94,422,469.75
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
——期货投资	-	-
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	304,526,955.84	-94,422,469.75

#### 7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年12月	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月

	31 日	31 日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	-3,106,337.57	5,596,817.61
其他	-	-
合计	-3,106,337.57	5,596,817.61

#### 7.4.7.20 信用减值损失

注：本基金无信用减值损失。

#### 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 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
审计费用	60,000.00	35,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费	-	-
银行费用	-	-
指数使用费	-	-
登记结算服务费	-	-
IOPV 计算与发布费	-	-
持有人大会-公证费	-	-
持有人大会-律师费	-	-
开户费	-	-
上市费	-	-
或有管理费	-	-
其他	35,120.91	35,597.44
合计	215,120.91	190,597.44

#### 7.4.7.22 分部报告

注：本基金目前以一个经营分部运作。

### 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重大或有事项。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，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
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人,基金销售机构
中国银行股份有限公司 ("中国银行")	基金托管人
布朗兄弟哈里曼银行 (Brown Brothers Harriman & Co.) ("布朗兄弟")	境外资产托管人
东方证券股份有限公司 ("东方证券")	基金管理人的股东
上海上报资产管理有限公司	基金管理人的股东
上海菁聚金投资管理合伙企业 (有限合伙)	基金管理人的股东
东航金控有限责任公司	基金管理人的股东
汇添富资本管理有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富资产管理 (美国) 控股有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富资产管理 (香港) 有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富资产管理 (新加坡) 有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富投资管理有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富基金销售 (上海) 有限公司	基金管理人的全资子公司
东方证券承销保荐有限公司	基金管理人的股东的全资子公司
上海汇添富公益基金会	与基金管理人同一批关键管理人员
汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 (QDII)	该基金是本基金的联接基金

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

##### 7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

##### 7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

##### 7.4.10.1.4 基金交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行基金交易。

#### 7.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间均不存在向关联方支付佣金的情况。

### 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 2025年01月01日至 2025年12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至 2024年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	6,862,563.48	6,103,960.09
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,034,784.05	358,613.50
应支付基金管理人的净管理费	5,827,779.43	5,745,346.59

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，由基金托管人根据基金管理人指令或者双方约定的方式，在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付。若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、公休日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。

对于基金中基金、ETF 联接基金等特殊类型的基金产品，由于本基金管理人对基金财产中持有的本基金管理人自身管理的基金部分或基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费，但客户维护费的收取标准并不调减，可能出现净管理费为负值的情况。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025 年12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024 年12月31日

当期发生的基金应支付的托管费	2,058,769.15	1,831,188.11
----------------	--------------	--------------

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，由基金托管人根据基金管理人指令或者双方约定的方式，在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付。若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、公休日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。

#### 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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行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

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2025 年 12 月 31 日		上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)
汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 (QDII)	296,986,100.00	28.69	258,363,700.00	19.13

注:除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用符合基金招募说明书和相关公告的规定。

#### 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 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2024 年 01 月 01 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
中国银行	6,175,871.51	30,352.71	7,078,665.11	59,975.26
布朗兄弟	2,571,547.14	-	6,865,420.87	-

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

注:本基金本报告期末进行利润分配。于资产负债表日之后、财务报表批准日之前批准、公告或实施的利润分配情况详见资产负债表日后事项章节。

#### 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

注：本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末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

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 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

注：截至本报告期末 2025 年 12 月 31 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末 2025 年 12 月 31 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：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

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、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。

本基金管理人建立了董事会、经营管理层、风险管理部门、各职能部门四级风险管理组织架构，并明确了相应的风险管理职能。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金持有同一机构（政府、国际金融组织除外）发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%。此外，基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的 10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的 3%。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具

有基金销售资格的金融机构进行。另外，基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

#### 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》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

除本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，本基金本报告期末的其他资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，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

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险,其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控,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个月以内	1-3 个月	3个 月-1 年	1-5 年	5年 以上	不计息	合计
资产							
货币资金	8,747,418.65	-	-	-	-	-	8,747,418.65
结算备付金	1,069.73	-	-	-	-	-	1,069.73
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,503,454,517.06	1,503,454,517.06
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收	-	-	-	-	-	-	-

股利							
应收 申购 款	-	-	-	-	-	-	-
递延 所得 税资 产	-	-	-	-	-	-	-
其他 资产	-	-	-	-	-	-	-
资产 总计	8,748,488.38	-	-	-	-	1,503,454,517.06	1,512,203,005.44
负债							
短期 借款	-	-	-	-	-	-	-
交易 性金 融负 债	-	-	-	-	-	-	-
衍生 金融 负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出 回购 金融 资产 款	-	-	-	-	-	-	-
应付 清算 款	-	-	-	-	-	-	-
应付 赎回 款	-	-	-	-	-	-	-
应付 管理 人报 酬	-	-	-	-	-	645,564.33	645,564.33
应付 托管 费	-	-	-	-	-	193,669.31	193,669.31
应付 销售 服务 费	-	-	-	-	-	-	-

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	-	-	-	-	-	180,000.00	180,000.00
负债 总计	-	-	-	-	-	1,019,233.64	1,019,233.64
利率 敏感 度缺 口	8,748,488.38	-	-	-	-	1,502,435,283.42	1,511,183,771.80
上年 度末 2024 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个 月-1 年	1-5 年	5 年 以上	不计息	合计
资产							
货币 资金	13,944,085.98	-	-	-	-	-	13,944,085.98
结算 备付 金	1,055.12	-	-	-	-	-	1,055.12
存出 保证 金	-	-	-	-	-	-	-
交易 性金 融资 产	-	-	-	-	-	1,521,097,935.71	1,521,097,935.71
衍生 金融 资产	-	-	-	-	-	-	-
买入 返售	-	-	-	-	-	-	-

金融资产							
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	13,945,141.10	-	-	-	-	1,521,097,935.71	1,535,043,076.81
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	6,920,749.94	6,920,749.94
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报	-	-	-	-	-	613,635.47	613,635.47

酬								
应付 托管 费		-	-	-	-	-	184,090.64	184,090.64
应付 销售 服务 费		-	-	-	-	-	-	-
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		-	-	-	-	-	155,000.00	155,000.00
负债 总计		-	-	-	-	-	7,873,476.05	7,873,476.05
利率 敏感 度缺 口	13,945,141.10	-	-	-	-	-	1,513,224,459.66	1,527,169,600.76

表中所示为本基金资产及负债的公允价值,并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 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均未持有债券资产及资产支持证券(不含可转换债券及可交换债券),因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债,因此存在相应的外汇风险。本基金的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	2,572,181.00	-	-	2,572,181.00
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	1,503,454,517.06	-	-	1,503,454,517.06
衍生金融资产	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	1,506,026,698.06	-	-	1,506,026,698.06
以外币计价的负债				
短期借款	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-

应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
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	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇率风险敞口净额	1,506,026,698.06	-	-	1,506,026,698.06
	上年度末 2024 年 12 月 31 日			
项目	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	6,865,697.48	-	-	6,865,697.48
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	1,521,097,935.71	-	-	1,521,097,935.71
衍生金融资产	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-

递延所得税资产	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	1,527,963,633.19	-	-	1,527,963,633.19
以外币计价的负债				
短期借款	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-
应付清算款	5,581,250.81	-	-	5,581,250.81
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
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	-	-	-	-
负债合计	5,581,250.81	-	-	5,581,250.81
资产负债表外汇风险敞口净额	1,522,382,382.38	-	-	1,522,382,382.38

#### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	1.除汇率以外的其他市场变量保持不变，且未考虑基金管理人为降低汇率风险而可能采取的风险管理活动。	
分析	相关风险变量	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民

	的变动	币元)	
		本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	美元相对人民币升值 5%	75,301,334.90	76,119,119.12
	美元相对人民币贬值 5%	-75,301,334.90	-76,119,119.12

### 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

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	1,503,454,517.06	99.49	1,521,097,935.71	99.60
交易性金融资产 - 基金投资	-	-	-	-
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	1,503,454,517.06	99.49	1,521,097,935.71	99.60

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1.本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变； 2.以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
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

			日
	纳斯达克生物科技指数（汇率调整）上涨 5%	75,185,879.69	76,032,134.02
	纳斯达克生物科技指数（汇率调整）下跌 5%	-75,185,879.69	-76,032,134.02

注：本基金管理人运用资本—资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

#### 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	1,503,454,517.06	1,521,097,935.71
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	1,503,454,517.06	1,521,097,935.71

###### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，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投资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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

### 7.4.14.3 第三层次公允价值余额及变动情况

#### 7.4.14.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

注：本基金本报告期末以及上年度末均不存在第三层次公允价值余额。

#### 7.4.14.3.2 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

注：本基金本报告期末以及上年度末均不存在第三层次公允价值余额。

#### 7.4.14.4 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均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 7.4.14.5 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

截至资产负债表日，除本报告“4 管理人报告-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”章节中所列示情况外，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,503,454,517.06	99.42
	其中：普通股	1,333,167,515.79	88.16
	存托凭证	170,287,001.27	11.26
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	-	-
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	8,748,488.38	0.58
8	其他各项资产	-	-
9	合计	1,512,203,005.44	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	1,503,454,517.06	99.49
合计	1,503,454,517.06	99.49

注：按公允价值占基金资产净值比例从大到小排序；国家（地区）类别根据其所在的证券交易所确定；此处股票包括普通股和优先股；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

### 8.3.1 期末指数投资按行业分类的权益投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
10 能源	-	-
15 原材料	-	-
20 工业	-	-
25 可选消费	-	-
30 日常消费	-	-
35 医疗保健	1,503,454,517.06	99.49
40 金融	-	-
45 信息技术	-	-
50 电信服务	-	-
55 公用事业	-	-
60 房地产	-	-
合计	1,503,454,517.06	99.49

### 8.3.2 期末积极投资按行业分类的权益投资组合

注：本报告期末未持有积极投资。

## 8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细

8.4.1 期末指数投资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 Pharmaceuticals Inc	福泰制药公司	VRTX US	纳斯达克证券交易所	美国	40,867	130,225,832.78	8.62
2	Gilead Sciences Inc	吉利德科学公司	GILD US	纳斯达克证券交易所	美国	140,818	121,485,788.48	8.04
3	Amgen Inc	安进公司	AMGN US	纳斯达克证券交易所	美国	51,296	118,011,399.50	7.81
4	Regeneron Pharmaceuticals Inc	再生元制药股份有限公司	REGN US	纳斯达克证	美国	16,830	91,308,133.18	6.04

		司		券交易所				
5	AstraZeneca PLC	阿斯利康公共有限公司	AZN US	纳斯达克证券交易所	美国	95,117	61,460,570.92	4.07
6	Alnylam Pharmaceuticals 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	21,528	60,170,809.94	3.98
7	Insmem Inc	-	INSM US	纳斯达克证券交易所	美国	34,753	42,513,079.11	2.81
8	Biogen Inc	渤健公司	BIIB US	纳斯达克证券交易所	美国	23,905	29,570,449.43	1.96
9	Argenx SE	-	ARGX US	纳斯达克	美国	4,744	28,041,164.24	1.86

				证 券 交 易 所				
10	United Therapeutics Corp	联合 治疗 公司	UTHR US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	7,016	24,028,276.12	1.59
11	Incyte Corp	因 赛 特 公 司	INCY US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	31,991	22,209,258.32	1.47
12	Royalty Pharma PLC	-	RPRX US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	69,620	18,908,292.96	1.25
13	Medpace Holdings Inc	-	MEDP US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	4,590	18,120,060.14	1.20
14	Revolution Medicines Inc	-	RVMD US	纳 斯 达	美国	31,501	17,635,643.32	1.17

				克 证 券 交 易 所				
15	Roivant Sciences Ltd	-	ROIV US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	113,330	17,285,653.72	1.14
16	Bridgebio Pharma Inc	-	BBIO US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	31,402	16,882,748.70	1.12
17	Viartis Inc	晖致	VTRS US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	187,680	16,423,606.54	1.09
18	Neurocrine Biosciences Inc	-	NBIX US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	16,247	16,196,548.26	1.07
19	Madrigal Pharmaceuticals	-	MDGL US	纳 斯	美国	3,701	15,148,753.30	1.00

	Inc			达 克 证 券 交 易 所				
20	Guardant Health Inc	-	GH US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	21,081	15,134,505.92	1.00
21	Ascendis Pharma A/S	-	ASND US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	10,004	14,994,208.41	0.99
22	Summit Therapeutics Inc	-	SMMT US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	121,307	14,912,719.80	0.99
23	Sanofi SA	赛 诺 菲	SNY US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	43,120	14,687,346.74	0.97
24	Ionis	-	IONS	纳	美国	26,394	14,676,340.62	0.97

	Pharmaceuticals Inc		US	纳斯达克证券交易所				
25	Exelixis Inc	-	EXEL US	纳斯达克证券交易所	美国	43,689	13,459,370.89	0.89
26	Moderna Inc	莫德纳公司	MRNA US	纳斯达克证券交易所	美国	63,661	13,195,608.28	0.87
27	BioMarin Pharmaceutical Inc	-	BMRN US	纳斯达克证券交易所	美国	31,305	13,076,774.19	0.87
28	Avidity Biosciences Inc	-	RNA US	纳斯达克证券交易所	美国	24,553	12,448,060.26	0.82

29	Jazz Pharmaceuticals PLC	爵士制药有限公司	JAZZ US	纳斯达克证券交易所	美国	9,902	11,831,860.19	0.78
30	Tempus AI Inc	-	TEM US	纳斯达克证券交易所	美国	28,168	11,691,146.43	0.77
31	BioNTech SE	-	BNTX US	纳斯达克证券交易所	美国	16,475	11,024,110.50	0.73
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	5,129	10,952,567.78	0.72
33	Axsome Therapeutics Inc	-	AXSM US	纳斯达克证券交易所	美国	8,215	10,545,924.36	0.70

				所				
34	Arrowhead Pharmaceuticals Inc	-	ARWR US	纳斯达克 证券 交易所	美国	22,130	10,326,788.17	0.68
35	Abivax SA	-	ABVX US	纳斯达克 证券 交易所	美国	9,619	9,117,550.25	0.60
36	Halozyme Therapeutics Inc	-	HALO US	纳斯达克 证券 交易所	美国	19,162	9,064,358.75	0.60
37	Cytokinetics Inc	-	CYTK US	纳斯达克 证券 交易所	美国	19,923	8,897,810.07	0.59
38	Caris Life Sciences Inc	-	CAI US	纳斯达克 证券 交	美国	45,976	8,718,751.82	0.58

				易所				
39	Praxis Precision Medicines Inc	-	PRAX US	纳斯达克 证券交易 所	美国	4,075	8,442,049.19	0.56
40	Nuvalent Inc	-	NUVL US	纳斯达克 证券交易 所	美国	11,769	8,321,000.67	0.55
41	Krystal Biotech Inc	-	KRYS US	纳斯达克 证券交易 所	美国	4,725	8,187,859.66	0.54
42	Rhythm Pharmaceuticals Inc	-	RYTM US	纳斯达克 证券交易 所	美国	10,875	8,181,944.93	0.54
43	PTC Therapeutics Inc	-	PTCT US	纳斯达克 证券交易 所	美国	13,083	6,985,113.76	0.46

				交易所				
44	Vaxcyte Inc	-	PCVX US	纳斯达克 证券交易 所	美国	21,331	6,917,831.70	0.46
45	Kymera Therapeutics Inc	-	KYMR US	纳斯达克 证券交易 所	美国	11,724	6,411,983.72	0.42
46	Protagonist Therapeutics Inc	-	PTGX US	纳斯达克 证券交易 所	美国	10,187	6,253,752.36	0.41
47	Cogent Biosciences Inc	-	COGT US	纳斯达克 证券交易 所	美国	25,014	6,245,069.68	0.41
48	CRISPR Therapeutics AG	-	CRSP US	纳斯达克 证	美国	15,529	5,723,838.33	0.38

				券交易所				
49	Structure Therapeutics Inc	-	GPCR US	纳斯达克证券交易所	美国	10,888	5,322,631.90	0.35
50	Alkermes PLC	-	ALKS US	纳斯达克证券交易所	美国	26,906	5,291,490.66	0.35
51	ACADIA Pharmaceuticals Inc	-	ACAD US	纳斯达克证券交易所	美国	27,568	5,175,595.59	0.34
52	Scholar Rock Holding Corp	-	SRRK US	纳斯达克证券交易所	美国	16,622	5,146,481.03	0.34
53	Indivior PLC	-	INDV US	纳斯达克	美国	20,345	5,130,873.58	0.34

				证 券 交 易 所				
54	Immunovant Inc	-	IMVT US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	28,561	5,103,053.73	0.34
55	Crinetics Pharmaceuticals Inc	-	CRNX US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	15,463	5,059,348.87	0.33
56	Amicus Therapeutics Inc	-	FOLD US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	50,275	5,032,030.38	0.33
57	ADMA Biologics Inc	-	ADMA US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	38,782	4,972,058.41	0.33
58	Apogee Therapeutics Inc	-	APGE US	纳 斯 达	美国	8,935	4,740,319.72	0.31

				克 证 券 交 易 所				
59	Mirum Pharmaceuticals Inc	-	MIRM US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	8,375	4,649,841.14	0.31
60	Newamsterdam Pharma Co NV	-	NAMS US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	18,477	4,555,879.51	0.30
61	Amneal Pharmaceuticals Inc	-	AMRX US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	51,225	4,536,633.53	0.30
62	Arcellx Inc	-	ACLX US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	9,422	4,317,893.05	0.29
63	Ligand Pharmaceuticals	-	LGND US	纳 斯	美国	3,207	4,261,895.24	0.28

	Inc			达 克 证 券 交 易 所				
64	Terns Pharmaceuticals Inc	拓 臻 生 物	TERN US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	14,678	4,168,016.55	0.28
65	Arcutis Biotherapeutics Inc	-	ARQT US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	19,960	4,074,162.39	0.27
66	Tarsus Pharmaceuticals Inc	-	TARS US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	6,917	3,980,859.00	0.26
67	Xenon Pharmaceuticals Inc	-	XENE US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	12,592	3,966,868.04	0.26
68	Travere	-	TVTX	纳	美国	14,579	3,915,488.56	0.26

	Therapeutics Inc		US	斯达克 证 券 交 易 所				
69	CG oncology Inc	-	CGON US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	13,145	3,836,181.28	0.25
70	GRAIL Inc	-	GRAL US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	6,352	3,821,331.39	0.25
71	Veracyte Inc	-	VCYT US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	12,881	3,811,648.65	0.25
72	Vera Therapeutics Inc	-	VERA US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	10,417	3,707,810.65	0.25

73	Apellis Pharmaceuticals Inc	-	APLS US	纳斯达克 证券 交易所	美国	20,617	3,640,208.77	0.24
74	Ideaya Biosciences Inc	-	IDYA US	纳斯达克 证券 交易所	美国	14,285	3,471,049.52	0.23
75	Disc Medicine Inc	-	IRON US	纳斯达克 证券 交易所	美国	6,151	3,433,223.76	0.23
76	Mineralys Therapeutics Inc	-	MLYS US	纳斯达克 证券 交易所	美国	12,896	3,289,449.16	0.22
77	Supernus Pharmaceuticals Inc	-	SUPN US	纳斯达克 证券 交易所	美国	9,343	3,263,802.90	0.22

				所				
78	WaVe Life Sciences Ltd	-	WVE US	纳斯达克 证券交易 所	美国	27,242	3,255,135.68	0.22
79	Beam Therapeutics Inc	-	BEAM US	纳斯达克 证券交易 所	美国	16,535	3,221,651.89	0.21
80	Dyne Therapeutics Inc	-	DYN US	纳斯达克 证券交易 所	美国	23,273	3,199,649.49	0.21
81	Edgewise Therapeutics Inc	-	EWTX US	纳斯达克 证券交易 所	美国	17,251	3,008,913.80	0.20
82	Ocular Therapeutix Inc	-	OCUL US	纳斯达克 证券交	美国	34,716	2,962,303.50	0.20

				易所				
83	Spyre Therapeutics Inc	-	SYRE US	纳斯达克 证券交易 所	美国	12,644	2,911,451.54	0.19
84	Adaptive Biotechnologies Corp	-	ADPT US	纳斯达克 证券交易 所	美国	24,877	2,839,652.63	0.19
85	Denali Therapeutics Inc	-	DNLI US	纳斯达克 证券交易 所	美国	23,898	2,773,255.07	0.18
86	Centessa Pharmaceuticals PLC	-	CNTA US	纳斯达克 证券交易 所	美国	15,721	2,763,599.12	0.18
87	Sarepta Therapeutics Inc	-	SRPT US	纳斯达克 证券交易 所	美国	17,075	2,582,760.68	0.17

				交易所				
88	Ultragenyx Pharmaceutical Inc	-	RARE US	纳斯达克 证券交易 所	美国	15,721	2,541,494.59	0.17
89	Harmony Biosciences Holdings Inc	-	HRMY US	纳斯达克 证券交易 所	美国	9,385	2,468,421.08	0.16
90	Recursion Pharmaceuticals Inc	-	RXR US	纳斯达克 证券交易 所	美国	83,787	2,408,691.25	0.16
91	Aurinia Pharmaceuticals Inc	-	AUPH US	纳斯达克 证券交易 所	美国	21,483	2,408,445.38	0.16
92	Maze Therapeutics Inc	-	MAZE US	纳斯达克 证	美国	7,841	2,283,324.17	0.15

				券交易所				
93	Zymeworks Inc	-	ZYME US	纳斯达克证 券交易所	美国	12,195	2,256,907.97	0.15
94	Olema Pharmaceuticals Inc	-	OLMA US	纳斯达克证 券交易所	美国	12,818	2,252,378.96	0.15
95	ImmunityBio Inc	-	IBRX US	纳斯达克证 券交易所	美国	160,500	2,233,682.35	0.15
96	Zenas Biopharma Inc	-	ZBIO US	纳斯达克证 券交易所	美国	8,747	2,232,371.97	0.15
97	Twist Bioscience Corp	特维 斯特 生物 科技	TWST US	纳斯 达克	美国	9,964	2,221,509.03	0.15

		公司		证 券 交 易 所				
98	Nurix Therapeutics Inc	-	NRIX US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	16,518	2,202,449.60	0.15
99	10X Genomics Inc	-	TXG US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	18,979	2,175,747.40	0.14
100	Kiniksa Pharmaceuticals International Plc	-	KNSA US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	7,359	2,133,653.74	0.14
101	Sionna Therapeutics Inc	-	SION US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	7,272	2,102,806.66	0.14
102	Legend Biotech Corp	传 奇 生 物 科 技	LEGN US	纳 斯 达	美国	13,720	2,096,499.86	0.14

		公司		克 证 券 交 易 所				
103	Syndax Pharmaceuticals Inc	-	SNDX US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	14,163	2,091,522.27	0.14
104	Vericel Corp	-	VCEL US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	8,241	2,085,855.51	0.14
105	Harrow Inc	-	HROW US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	6,035	2,078,521.59	0.14
106	Stoke Therapeutics Inc	-	STOK US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	9,307	2,076,336.90	0.14
107	Dynavax Technologies Corp	-	DVAX US	纳 斯	美国	19,134	2,068,441.73	0.14

				达 克 证 券 交 易 所				
108	Genmab A/S	-	GMAB US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	9,525	2,062,039.06	0.14
109	Pharvaris NV	-	PHVS US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	10,438	2,035,923.55	0.13
110	ANI Pharmaceuticals Inc	-	ANIP US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	3,660	2,030,763.71	0.13
111	MannKind Corp	曼恩 凯德 公司	MNKD US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	50,037	1,994,139.37	0.13
112	BioCryst	-	BCRX	纳	美国	34,308	1,880,923.75	0.12

	Pharmaceuticals Inc		US	纳斯达克证券交易所				
113	Alvotech SA	-	ALVO US	纳斯达克证券交易所	美国	51,006	1,839,161.29	0.12
114	Trevi Therapeutics Inc	-	TRVI US	纳斯达克证券交易所	美国	20,895	1,838,772.04	0.12
115	Fortrea Holdings Inc	-	FTRE US	纳斯达克证券交易所	美国	15,057	1,825,613.07	0.12
116	Agios Pharmaceuticals Inc	-	AGIO US	纳斯达克证券交易所	美国	9,502	1,817,960.04	0.12

117	Immunocore Holdings PLC	-	IMCR US	纳斯达克 证券 交易所	美国	7,109	1,734,380.23	0.11
118	EyePoint Inc	-	EYPT US	纳斯达克 证券 交易所	美国	13,490	1,732,334.21	0.11
119	Taysha Gene Therapies Inc	-	TSHA US	纳斯达克 证券 交易所	美国	44,635	1,725,517.68	0.11
120	Innoviva Inc	-	INVA US	纳斯达克 证券 交易所	美国	12,184	1,711,921.60	0.11
121	uniQure NV	-	QURE US	纳斯达克 证券 交易	美国	10,150	1,707,221.72	0.11

				所				
122	AtaiBeckley Inc	-	ATAI US	纳斯达克 证 券 交 易 所	美国	59,182	1,701,351.83	0.11
123	Kodiak Sciences Inc	-	KOD US	纳斯达克 证 券 交 易 所	美国	8,644	1,698,764.24	0.11
124	Precigen Inc	-	PGEN US	纳斯达克 证 券 交 易 所	美国	57,656	1,693,955.42	0.11
125	Oruka Therapeutics Inc	-	ORKA US	纳斯达克 证 券 交 易 所	美国	7,888	1,680,482.62	0.11
126	Upstream Bio Inc	-	UPB US	纳斯达克 证 券 交	美国	8,806	1,680,465.89	0.11

				易所				
127	Relay Therapeutics Inc	-	RLAY US	纳斯达克 证券交易 所	美国	28,243	1,679,431.81	0.11
128	Collegium Pharmaceutical Inc	-	COLL US	纳斯达克 证券交易 所	美国	5,151	1,676,307.65	0.11
129	Novocure Ltd	-	NVCR US	纳斯达克 证券交易 所	美国	18,247	1,658,330.86	0.11
130	Rapport Therapeutics Inc	-	RAPP US	纳斯达克 证券交易 所	美国	7,766	1,656,128.95	0.11
131	Ardelyx Inc	-	ARDX US	纳斯达克 证券交易 所	美国	39,593	1,622,438.15	0.11

				交易所				
132	MBX Biosciences Inc	-	MBX US	纳斯达克证券交易所	美国	7,317	1,622,093.67	0.11
133	Tyra Biosciences Inc	-	TYRA US	纳斯达克证券交易所	美国	8,697	1,607,093.86	0.11
134	AnaptysBio Inc	-	ANAB US	纳斯达克证券交易所	美国	4,512	1,537,492.08	0.10
135	Amylyx Pharmaceuticals Inc	-	AMLX US	纳斯达克证券交易所	美国	17,895	1,519,426.94	0.10
136	Mind Medicine MindMed Inc	-	MNMD US	纳斯达克证	美国	16,052	1,510,744.12	0.10

				券交易所				
137	Xeris Biopharma Holdings Inc	-	XERS US	纳斯达克证券交易所	美国	27,037	1,491,795.67	0.10
138	Septerna Inc	-	SEPN US	纳斯达克证券交易所	美国	7,296	1,429,745.64	0.09
139	Amphastar Pharmaceuticals Inc	-	AMPH US	纳斯达克证券交易所	美国	7,488	1,409,475.70	0.09
140	Savara Inc	-	SVRA US	纳斯达克证券交易所	美国	33,155	1,405,230.38	0.09
141	Omeros Corp	-	OMER US	纳斯达克	美国	11,553	1,394,674.04	0.09

				证 券 交 易 所				
142	Tango Therapeutics Inc	-	TNGX US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	21,946	1,366,690.84	0.09
143	Phathom Pharmaceuticals Inc	-	PHAT US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	11,592	1,351,717.52	0.09
144	ARS Pharmaceuticals Inc	-	SPRY US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	16,107	1,318,930.07	0.09
145	Inhibrx Biosciences Inc	-	INBX US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	2,370	1,316,002.22	0.09
146	Grifols SA	基 立 福 公 司	GRFS US	纳 斯 达	美国	19,879	1,306,433.57	0.09

				克 证 券 交 易 所				
147	Castle Biosciences Inc	-	CSTL US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	4,756	1,300,387.04	0.09
148	Pacira BioSciences Inc	-	PCRX US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	7,010	1,275,156.46	0.08
149	UroGen Pharma Ltd	-	URGN US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	7,627	1,255,514.76	0.08
150	Xencor Inc	-	XNCR US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	11,636	1,252,160.76	0.08
151	Novavax Inc	诺 瓦 瓦 克	NVAX US	纳 斯	美国	26,479	1,250,696.80	0.08

		斯股份有限公司		达克证券交易所				
152	Sana Biotechnology Inc	-	SANA US	纳斯达克证券交易所	美国	43,404	1,241,667.60	0.08
153	Iovance Biotherapeutics Inc	-	IOVA US	纳斯达克证券交易所	美国	64,686	1,241,235.33	0.08
154	Erasca Inc	-	ERAS US	纳斯达克证券交易所	美国	46,231	1,208,808.24	0.08
155	Intellia Therapeutics Inc	-	NTLA US	纳斯达克证券交易所	美国	18,874	1,192,627.53	0.08
156	AbCellera Biologics	-	ABCL	纳	美国	48,777	1,172,525.72	0.08

	Inc		US	斯达克证 券交易 所				
157	Monte Rosa Therapeutics Inc	-	GLUE US	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美国	10,611	1,169,455.12	0.08
158	Day One Biopharmaceuticals Inc	-	DAWN US	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美国	16,731	1,096,021.31	0.07
159	Alumis Inc	-	ALMS US	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美国	15,840	1,086,641.23	0.07
160	Theravance Biopharma Inc	-	TBPH US	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美国	8,257	1,085,868.56	0.07

161	RAPT Therapeutics Inc	-	RAPT US	纳斯达克 证券 交易所	美国	4,515	1,074,865.53	0.07
162	Arbutus Biopharma Corp	-	ABUS US	纳斯达克 证券 交易所	美国	31,339	1,059,525.46	0.07
163	Bicara Therapeutics Inc	-	BCAX US	纳斯达克 证券 交易所	美国	8,927	1,056,016.82	0.07
164	CorMedix Inc	-	CRMD US	纳斯达克 证券 交易所	美国	12,839	1,049,523.34	0.07
165	Enliven Therapeutics Inc	-	ELVN US	纳斯达克 证券 交易	美国	9,671	1,046,823.08	0.07

				所				
166	Kura Oncology Inc	-	KURA US	纳斯达克 证券交易 所	美国	14,179	1,035,481.48	0.07
167	Mesoblast Ltd	-	MESO US	纳斯达克 证券交易 所	美国	7,992	1,013,382.02	0.07
168	Esperion Therapeutics Inc	-	ESPR US	纳斯达克 证券交易 所	美国	38,955	1,013,085.54	0.07
169	Geron Corp	杰龙 公司	GERN US	纳斯达克 证券交易 所	美国	104,020	965,099.22	0.06
170	Vir Biotechnology Inc	-	VIR US	纳斯达克 证券交	美国	22,670	960,837.66	0.06

				易所				
171	ArriVent Biopharma Inc	-	AVBP US	纳斯达克 证券交易 所	美国	6,727	951,328.68	0.06
172	Janux Therapeutics Inc	-	JANX US	纳斯达克 证券交易 所	美国	9,801	950,671.91	0.06
173	KalVista Pharmaceuticals Inc	-	KALV US	纳斯达克 证券交易 所	美国	8,236	934,910.53	0.06
174	ORIC Pharmaceuticals Inc	-	ORIC US	纳斯达克 证券交易 所	美国	15,870	912,454.92	0.06
175	Aquestive Therapeutics Inc	-	AQST US	纳斯达克 证券交易 所	美国	19,880	902,672.23	0.06

				交易所				
176	GH Research PLC	-	GHR US	纳斯达克证 券交易 所	美国	10,107	902,209.04	0.06
177	Rigel Pharmaceuticals Inc	-	RIGL US	纳斯达克证 券交易 所	美国	2,958	890,486.68	0.06
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	3,332	874,969.77	0.06
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	12,782	873,265.42	0.06
180	Arvinas Inc	-	ARVN US	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美国	10,465	872,378.81	0.06

				券交易所				
181	REGENXBIO Inc	-	RGNX US	纳斯达克证 券交易所	美国	8,249	834,920.23	0.06
182	Annexon Inc	-	ANNX US	纳斯达克证 券交易所	美国	23,584	832,151.44	0.06
183	Lexeo Therapeutics Inc	-	LXEO US	纳斯达克证 券交易所	美国	11,893	830,083.64	0.05
184	CytomX Therapeutics Inc	-	CTMX US	纳斯达克证 券交易所	美国	27,609	826,687.67	0.05
185	Gossamer Bio Inc	-	GOSS US	纳斯达克	美国	37,716	821,804.48	0.05

				证 券 交 易 所				
186	Personalis Inc	-	PSNL US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	14,471	809,641.57	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	6,380	791,043.64	0.05
188	Invivyd Inc	-	IVVD US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	45,157	783,976.82	0.05
189	Lyell Immunopharma Inc	-	LYEL US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	3,457	747,909.73	0.05
190	Compass Pathways Plc	-	CMPS US	纳 斯 达	美国	15,353	744,600.85	0.05

				克 证 券 交 易 所				
191	Ventyx Biosciences Inc	-	VTYX US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	11,628	738,029.90	0.05
192	MeiraGTx Holdings plc	-	MGTX US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	13,116	732,908.44	0.05
193	Prime Medicine Inc	-	PRME US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	29,414	717,405.58	0.05
194	Keros Therapeutics Inc	-	KROS US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	4,964	710,380.01	0.05
195	Fulcrum Therapeutics Inc	-	FULC US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	8,819	701,072.83	0.05

				达 克 证 券 交 易 所				
196	Cullinan Therapeutics Inc	-	CGEM US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	9,626	700,273.02	0.05
197	Corvus Pharmaceuticals Inc	-	CRVS US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	12,169	658,607.70	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	49,196	646,625.14	0.04
199	Ironwood Pharmaceuticals Inc	-	IRWD US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	26,508	627,896.48	0.04
200	Design	-	DSGN	纳	美国	9,282	611,963.60	0.04

	Therapeutics Inc		US	斯达克证 券交易 所				
201	Absci Corp	-	ABSI US	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美国	24,503	601,071.14	0.04
202	Vanda Pharmaceuticals Inc	-	VNDA US	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美国	9,630	597,002.37	0.04
203	Prothena Corp PLC	-	PRTA US	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美国	8,772	588,820.85	0.04
204	Zevra Therapeutics Inc	-	ZVRA US	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美国	9,174	577,760.61	0.04

205	LENZ Therapeutics Inc	-	LENZ US	纳斯达克 证券 交易所	美国	5,099	573,437.62	0.04
206	BioAge Labs Inc	-	BIOA US	纳斯达克 证券 交易所	美国	5,843	543,346.55	0.04
207	Galapagos NV	-	GLPG US	纳斯达克 证券 交易所	美国	2,356	541,507.19	0.04
208	Maravai LifeSciences Holdings Inc	-	MRVI US	纳斯达克 证券 交易所	美国	23,631	539,817.11	0.04
209	Enanta Pharmaceuticals Inc	-	ENTA US	纳斯达克 证券 交易所	美国	4,703	521,300.16	0.03

				所				
210	Eton Pharmaceuticals Inc	-	ETON US	纳斯达克证券交易所	美国	4,370	519,405.12	0.03
211	PepGen Inc	-	PEPG US	纳斯达克证券交易所	美国	11,202	512,575.38	0.03
212	Solid Biosciences Inc	-	SLDB US	纳斯达克证券交易所	美国	12,695	503,260.67	0.03
213	SIGA Technologies Inc	-	SIGA US	纳斯达克证券交易所	美国	11,669	501,136.50	0.03
214	Evolus Inc	-	EOLS US	纳斯达克证券交易所	美国	10,562	493,683.93	0.03

				易所				
215	4D Molecular Therapeutics Inc	-	FDMT US	纳斯达克 证券交易 所	美国	9,310	490,785.96	0.03
216	Immuneering Corp	-	IMRX US	纳斯达克 证券交易 所	美国	10,522	486,637.28	0.03
217	NovaBridge Biosciences	新桥 生物	NBP US	纳斯达克 证券交易 所	美国	16,940	473,890.13	0.03
218	Kyverna Therapeutics Inc	-	KYTX US	纳斯达克 证券交易 所	美国	7,137	471,546.73	0.03
219	Kamada Ltd	-	KMDA US	纳斯达克 证券交易 所	美国	9,399	466,409.66	0.03

				交易所				
220	Autolus Therapeutics PLC	-	AUTL US	纳斯达克 证券交易 所	美国	32,687	457,203.27	0.03
221	Entrada Therapeutics Inc	-	TRDA US	纳斯达克 证券交易 所	美国	6,228	450,010.77	0.03
222	Tectonic Therapeutic Inc	-	TECX US	纳斯达克 证券交易 所	美国	3,050	447,193.34	0.03
223	Rocket Pharmaceuticals Inc	-	RCKT US	纳斯达克 证券交易 所	美国	17,635	435,074.64	0.03
224	Altimmune Inc	-	ALT US	纳斯达克 证	美国	17,003	431,433.58	0.03

				券交易所				
225	Aura Biosciences Inc	-	AURA US	纳斯达克证券交易所	美国	10,348	396,400.42	0.03
226	Bicycle Therapeutics PLC	-	BCYC US	纳斯达克证券交易所	美国	7,540	375,219.84	0.02
227	Aclaris Therapeutics Inc	-	ACRS US	纳斯达克证券交易所	美国	17,655	373,521.33	0.02
228	Larimar Therapeutics Inc	-	LRMR US	纳斯达克证券交易所	美国	13,947	373,496.87	0.02
229	Neurogene Inc	-	NGNE US	纳斯达克	美国	2,524	365,458.24	0.02

				证 券 交 易 所				
230	Anavex Life Sciences Corp	-	AVXL US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	14,559	364,302.99	0.02
231	AC Immune SA	-	ACIU US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	16,362	361,116.41	0.02
232	Candel Therapeutics Inc	-	CADL US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	8,946	355,269.99	0.02
233	Allogene Therapeutics Inc	-	ALLO US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	36,620	352,630.68	0.02
234	Lifecore Biomedical Inc	-	LFCR US	纳 斯 达	美国	6,105	351,010.54	0.02

				克 证 券 交 易 所				
235	Foghorn Therapeutics Inc	-	FHTX US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	9,215	349,760.12	0.02
236	Jyong Biotech Ltd	健 永 生 技 股 份 有 限 公 司	MENS US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	12,389	343,965.22	0.02
237	Puma Biotechnology Inc	-	PBYI US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	8,211	343,395.19	0.02
238	Neumora Therapeutics Inc	-	NMRA US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	27,227	342,557.92	0.02
239	Aardvark Therapeutics Inc	-	AARD US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	3,548	327,313.64	0.02

				达 克 证 券 交 易 所				
240	Silence Therapeutics PLC	-	SLN US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	7,653	327,051.75	0.02
241	Atea Pharmaceuticals Inc	-	AVIR US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	12,731	319,456.64	0.02
242	OmniAb Inc	-	OABI US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	23,457	305,017.94	0.02
243	Contineum Therapeutics Inc	-	CTNM US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	3,764	302,396.69	0.02
244	Orchestra BioMed	-	OBIO	纳	美国	9,201	268,388.75	0.02

	Holdings Inc		US	斯达克证 券交易 所				
245	Voyager Therapeutics Inc	-	VYGR US	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美国	9,603	265,265.44	0.02
246	Vor BioPharma Inc	-	VOR US	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美国	2,746	252,458.19	0.02
247	Quantum-Si Inc	-	QSI US	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美国	31,865	246,369.98	0.02
248	Cabaletta Bio Inc	-	CABA US	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美国	15,686	241,455.73	0.02

249	Alpha Teknova Inc	-	TKNO US	纳斯达克 证券 交易所	美国	8,723	232,986.45	0.02
250	Editas Medicine Inc	-	EDIT US	纳斯达克 证券 交易所	美国	15,907	229,204.60	0.02
251	C4 Therapeutics Inc	-	CCCC US	纳斯达克 证券 交易所	美国	15,792	212,007.73	0.01
252	Sagimet Biosciences Inc	-	SGMT US	纳斯达克 证券 交易所	美国	5,052	210,216.23	0.01
253	Humacyte Inc	-	HUMA US	纳斯达克 证券 交易	美国	30,516	206,018.49	0.01

				所				
254	Arcturus Therapeutics Holdings Inc	-	ARCT US	纳斯达克 证券交易 所	美国	4,630	199,490.70	0.01
255	Coherus Oncology Inc	-	CHRS US	纳斯达克 证券交易 所	美国	19,696	196,583.73	0.01
256	Caribou Biosciences Inc	-	CRBU US	纳斯达克 证券交易 所	美国	15,231	170,218.49	0.01
257	Codexis Inc	-	CDXS US	纳斯达克 证券交易 所	美国	14,718	168,623.30	0.01
258	Black Diamond Therapeutics Inc	-	BDTX US	纳斯达克 证券交	美国	9,284	158,570.57	0.01

				易所				
259	Rani Therapeutics Holdings Inc	-	RANI US	纳斯达克 证券交易 所	美国	15,894	150,816.26	0.01
260	Tenaya Therapeutics Inc	-	TNYA US	纳斯达克 证券交易 所	美国	27,132	135,686.91	0.01
261	Pyxis Oncology Inc	-	PYXS US	纳斯达克 证券交易 所	美国	10,146	82,011.34	0.01

#### 8.4.2 积极投资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

注:本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。

#### 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	66,793,562.90	4.37
2	Gilead Sciences Inc	GILD US	63,236,294.53	4.14
3	Amgen Inc	AMGN US	47,831,307.29	3.13
4	Regeneron Pharmaceuticals Inc	REGN US	33,052,025.76	2.16
5	Alnylam Pharmaceuticals Inc	ALNY US	26,269,582.91	1.72
6	AstraZeneca PLC	AZN US	25,914,376.04	1.70
7	Insmed Inc	INSM US	14,340,346.90	0.94
8	Biogen Inc	BIIB US	11,083,758.21	0.73
9	Argenx SE	ARGX US	10,520,488.97	0.69
10	Caris Life Sciences Inc	CAI US	9,062,720.52	0.59
11	United Therapeutics Corp	UTHR US	8,473,670.35	0.55
12	Summit Therapeutics Inc	SMMT US	8,460,039.72	0.55
13	Abivax SA	ABVX US	7,803,728.55	0.51
14	Incyte Corp	INCY US	7,686,562.70	0.50
15	Royalty Pharma PLC	RPRX US	6,692,926.93	0.44
16	Neurocrine Biosciences Inc	NBIX US	6,615,408.84	0.43
17	Tempus AI Inc	TEM US	6,583,200.62	0.43
18	Moderna Inc	MRNA US	6,533,106.34	0.43
19	Sanofi SA	SNY US	6,338,172.57	0.42
20	BioMarin Pharmaceutical Inc	BMRN US	6,306,793.60	0.41

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，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	108,242,701.24	7.09
2	Amgen Inc	AMGN US	78,608,982.26	5.15
3	Vertex Pharmaceuticals Inc	VRTX US	68,294,420.91	4.47
4	Regeneron Pharmaceuticals Inc	REGN US	60,669,484.53	3.97
5	AstraZeneca PLC	AZN US	41,011,897.41	2.69

6	Alnylam Pharmaceuticals Inc	ALNY US	36,895,106.96	2.42
7	Illumina Inc	ILMN US	24,915,630.79	1.63
8	Intra-Cellular Therapies Inc	ITCI US	24,455,857.34	1.60
9	Argenx SE	ARGX US	20,661,651.30	1.35
10	Biogen Inc	BIIB US	18,005,048.74	1.18
11	Insmed Inc	INSM US	15,867,546.63	1.04
12	United Therapeutics Corp	UTHR US	15,358,153.34	1.01
13	Verona Pharma PLC	VRNA US	15,351,398.44	1.01
14	Blueprint Medicines Corp	BPMC US	14,347,785.11	0.94
15	Summit Therapeutics Inc	SMMT US	14,299,070.86	0.94
16	BeOne Medicines Ltd	ONC US	14,037,500.86	0.92
17	Sanofi SA	SNY US	13,963,855.37	0.91
18	Royalty Pharma PLC	RPRX US	12,960,048.70	0.85
19	Incyte Corp	INCY US	12,769,277.53	0.84
20	Merus NV	MRUS US	11,689,049.89	0.77

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额填列，不考虑相关交易费用。

### 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	658,954,930.90
卖出收入（成交）总额	1,023,629,411.13

注：“买入成本”、“卖出收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

注：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序的前五名债券投资明细

注：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序的所有资产支持证券投资明细

注：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

注：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

注：本基金本报告期末未持有基金投资。

### 8.11 投资组合报告附注

#### 8.11.1

报告期内本基金投资前十名证券的发行主体没有被中国人民银行及其派出机构、国家金融监督管理总局（前身为中国银保监会）及其派出机构、中国证监会及其派出机构、国家市场监督管理总局及机关单位、交易所立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

#### 8.11.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

#### 8.11.3 期末其他各项资产构成

注：本基金本报告期末无其他资产。

#### 8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：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

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		中国银行股份有限公司-汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(QDII)	
		持有份额	占总份额	持有份额	占总份额	持有份额	占总份额

			比例 (%)		比例 (%)		比例 (%)
20,815	49,727.2 2	533,615,587.0 0	51.55	501,456,533.0 0	48.45	296,986,100.0 0	28.69

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中包含“汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

## 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例 (%)
1	华泰证券资管－工商银行－华泰鹏泰 11 号集合资产管理计划	46,037,800.00	4.45
2	工银理财有限责任公司－工银理财鑫添益 30 天持盈固收增强开放式理财产品	27,462,300.00	2.65
3	工银理财有限责任公司－工银理财鑫添益 90 天持盈固收增强开放式理财产品	26,932,200.00	2.60
4	中信证券－工行－中信证券贵宾定制 6 号集合资产管理计划	24,590,700.00	2.38
5	工银理财有限责任公司－工银理财鑫添益 60 天持盈固收增强开放式理财产品	15,505,400.00	1.50
6	上海迎水投资管理有限公司－迎水龙凤呈祥 2 号私募证券投资基金	12,012,600.00	1.16
7	法巴农银理财有限责任公司－法巴农银理财珐琅金固收增强 180 天最短持有期 1 号	11,940,500.00	1.15
8	杨志琼	10,490,400.00	1.01
9	工银理财有限责任公司－工银理财鑫鼎利	9,910,400.00	0.96

	30 天持盈固收增强开放式理财产品		
10	杜桂枝	7,700,000.00	0.74
11	中国银行股份有限公司-汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）	296,986,100.00	28.69

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

### 9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产 品情况

注：本基金基金经理期末未兼任私募资产管理计划的投资经理。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2022 年 08 月 15 日） 基金份额总额	282,072,120.00
本报告期期初基金份额总额	1,350,572,120.00
本报告期基金总申购份额	330,500,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	646,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,035,072,120.00

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2025 年 7 月 15 日发布公告，自 2025 年 7 月 14 日起，鲁伟铭先生担任公司董事长，李文先生不再担任公司董事长。

本报告期内，经中国银行股份有限公司研究决定，聘任边济东先生为资产托管部总经理。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产的重大诉讼事项。

本报告期内，无涉及本基金托管业务的诉讼。

### 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

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）自产品成立日（2022 年 08 月 15 日）起至本报告期末，为本基金进行审计。本报告期内应付的审计费用为人民币 60,000.00 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

管理人受调查或处罚等情况	内容
受到调查或处罚等措施的主体	管理人
受到调查或处罚等措施的时间	2025 年 11 月 11 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会上海证监局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	责令改正
受到调查或处罚等措施的原因	合规内控、投资运作、其他问题(基金销售等)
受到处罚的依据	《证券投资基金管理公司管理办法》《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》《证券期货投资者适当性管理办法》

管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司高度重视监管检查指出的问题及整改要求，通过完善制度、优化管理等完成相关问题整改并已通过监管检查验收。公司将从严加强内控及各业务管理，持续提升管理质效。
其他	无

### 11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

管理人相关从业人员受调查或处罚等情况	内容
受到调查或处罚等措施的主体	高级管理人员 1；高级管理人员 2；高级管理人员 3
受到调查或处罚等措施的时间	2025 年 11 月 11 日；2025 年 11 月 11 日；2025 年 11 月 11 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会上海证监局；中国证监会上海证监局；中国证监会上海证监局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施；行政监管措施；行政监管措施
受到的具体措施类型	出具警示函；出具警示函；出具警示函
受到调查或处罚等措施的原因	合规内控、投资运作；其他问题(基金销售)；合规内控
受到处罚的依据	《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管理办法》《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》；《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》《证券期货投资者适当性管理办法》；《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司高度重视监管检查指出的问题及整改要求，通过完善制度、优化管理等完成相关问题整改并已通过监管检查验收。公司将从严加强内控及各业务管理，持续提升管理质效。
其他	无

### 11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的基金托管业务履职不涉及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的基金托管业务履职不涉及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 (%)	
Jefferies International Limited	-	998,403,696.79	61.07	257,114.80	56.26	
Sanford C. Bernstein (Hong Kong) Limited	-	613,905,157.70	37.55	192,847.00	42.20	
CLSA Limited	-	22,558,084.95	1.38	7,025.94	1.54	
长江证券	1	-	-	-	-	
东方证券	2	-	-	-	-	
广发证券	4	-	-	-	-	
国泰海通	2	-	-	-	-	
华泰证券	2	-	-	-	-	
民生证券	2	-	-	-	-	
平安证券	2	-	-	-	-	
申万宏源证券	1	-	-	-	-	
银河证券	2	-	-	-	-	
招商证券	4	-	-	-	-	
中信建投证券	2	-	-	-	-	
中信证券	4	-	-	-	-	

注:此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计, 不单指股票交易佣金。

### 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 (%)
Jefferies	-	-	-	-	-	-	-	-

International Limited									
Sanford C. Bernstein (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CLSA Limited	-	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-

注:1、专用交易单元的选择标准和程序:

(1) 基金交易单元选择和成交量的分配工作由公司投资研究总部/指数与量化投资部(合称“投资研究部门”)根据法律法规及公司内部规定相应负责组织、协调和监督。投资研究部门选择财务状况良好、经营行为规范、合规风控能力和交易、研究服务能力较强的证券公司,租用其交易单元。

(2) 交易单元分配的目标是按照中国证监会的有关规定和对券商交易或研究服务的评价控制交易单元的分配比例。

(3) 投资研究部门根据定期评分的结果决定交易单元分配比例。通过一家证券公司进行证券交易的年交易佣金总额的上限,需符合相关法律法规规定的要求。(采用券商交易模式的基金不适用相关法律法规规定的证券交易佣金分配比例上限。)

(4) 每半年综合考虑近半年及最新的评分情况,作为增加或更换券商交易单元的依据。

(5) 调整租用交易单元的选择及决定交易单元成交量的分布情况由投资研究部门决定。

(6) 交易单元的选择程序为投资研究部门按上述标准对券商进行评估,根据法律法规及公司内部规定确认选用的券商,与被选中的券商签订相关协议。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况:

本基金本报告期内未新增或退租交易单元。

## 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	关于汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)因境外主要市场休市暂停申购、赎回业务的公告	中证报,上交所,公司网站,中国证监会基金电子披露网站	2025年01月07日
2	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)溢价风险的提示性公告	上交所,公司网站,中国证监会基金电子披露网站,中证报	2025年01月15日
3	关于汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)因境外主要市场节假日暂停申购、赎回业务的公告	中证报,上交所,公司网站,中国证监会基金电子披露网站	2025年01月16日
4	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金2024年第四季度报告	上交所,深交所,公司网站,中国证监会基金电子披露网站,上证报	2025年01月22日
5	关于汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)因境外主要市场节假日暂停申购、赎回业务的公告	上交所,中证报,公司网站,中国证监会基金电子披露网站	2025年02月13日
6	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)增加申购赎回代理券商的公告	中证报,上交所,公司网站,中国证监会基金电子披露网站	2025年02月26日
7	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加长城证券为申购赎回代理券商的公告	上交所,深交所,公司网站,中国证监会基金电子披露网站,上证报	2025年03月18日
8	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加国新证券为申购赎回代理券商的公告	上交所,深交所,上证报,公司网站,中国证监会基金电子披露网站	2025年03月24日
9	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金2024年年报	上交所,深交所,上证报,公司网站,中国证监会基金电子披露网站	2025年03月31日
10	汇添富基金管理股份有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况(2024年度)	公司网站,中国证监会基金电子披露网站,上交所,深交所,上证报	2025年03月31日

11	关于汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)因境外主要市场节假日暂停申购、赎回业务的公告	上交所,中证报,公司网站,中国证监会基金电子披露网站	2025年04月16日
12	关于汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)暂停申购业务的公告	上交所,中证报,公司网站,中国证监会基金电子披露网站	2025年04月22日
13	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2025 年第一季度报告	上交所,深交所,上证报,公司网站,中国证监会基金电子披露网站	2025年04月22日
14	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加东莞证券为申购赎回代理券商的公告	公司网站,中国证监会基金电子披露网站,上证报,上交所,深交所	2025年04月30日
15	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加开源证券为申购赎回代理券商的公告	上交所,深交所,公司网站,中国证监会基金电子披露网站,证券时报	2025年05月14日
16	关于汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)因境外主要市场节假日暂停赎回业务的公告	中证报,上交所,公司网站,中国证监会基金电子披露网站	2025年05月22日
17	关于汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)恢复申购业务的公告	上交所,中证报,公司网站,中国证监会基金电子披露网站	2025年06月07日
18	关于汇添富基金管理股份有限公司终止与民商基金销售(上海)有限公司合作关系的公告	上证报,公司网站,中国证监会基金电子披露网站	2025年06月16日
19	关于汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)因境外主要市场节假日暂停申购、赎回业务的公告	中证报,公司网站,中国证监会基金电子披露网站,上交所	2025年06月17日
20	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加瑞银证券为申购赎回代理券商的公告	上交所,深交所,上证报,公司网站,中国证监会基金电子披露网站	2025年06月23日
21	关于汇添富基金管理股份有限公司终止与大华银行(中国)有限公司合作关系的公告	上证报,中国证监会基金电子披露网站,公司网站	2025年06月26日
22	关于汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)因境外主要市场节假日暂停申购、赎回业务的公告	上交所,中证报,公司网站,中国证监会基金电子披露网站	2025年07月02日

23	汇添富基金管理股份有限公司关于董事长变更的公告	深交所,上交所,上证报,中国证监会基金电子披露网站,公司网站	2025年07月15日
24	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2025 年第二季度报告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,深交所,上交所,上证报	2025年07月21日
25	关于汇添富基金管理股份有限公司住所变更的公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,深交所,上交所,上证报	2025年07月29日
26	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加西部证券为申购赎回代理券商的公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,深交所,上交所,上证报	2025年08月06日
27	关于防范不法分子冒用汇添富基金名义进行非法活动的重要提示	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上证报	2025年08月07日
28	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新基金产品资料概要	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,深交所,上交所	2025年08月15日
29	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新招募说明书	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,深交所,上交所	2025年08月15日
30	关于汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)因境外主要市场节假日暂停申购、赎回业务的公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上交所,中证报	2025年08月28日
31	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2025 年中期报告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,深交所,上交所,上证报	2025年08月29日
32	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加西南证券为申购赎回代理券商的公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,深交所,上交所,上证报	2025年09月10日
33	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加民生证券为申购赎回代理券商的公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,深交所,上交所,上证报	2025年10月27日
34	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加国联民生为申购赎回代理券商的公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,深交所,上交所,上	2025年10月27日

		证报	
35	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2025 年第三季度报告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,深交所,上交所,上证报	2025 年 10 月 28 日
36	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 溢价风险的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上交所,中证报	2025 年 10 月 30 日
37	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 溢价风险的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上交所,中证报	2025 年 10 月 31 日
38	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 溢价风险的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上交所,中证报	2025 年 11 月 03 日
39	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 溢价风险的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上交所,中证报	2025 年 11 月 04 日
40	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 溢价风险的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上交所,中证报	2025 年 11 月 05 日
41	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 溢价风险的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上交所,中证报	2025 年 11 月 06 日
42	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 溢价风险的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上交所,中证报	2025 年 11 月 07 日
43	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分上交所 ETF 申购赎回清单版本更新的公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上交所,上证报	2025 年 11 月 10 日
44	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 溢价风险的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上交所,中证报	2025 年 11 月 10 日
45	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 溢价风险的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上交所,中证报	2025 年 11 月 11 日

46	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）溢价风险的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上交所,中证报	2025 年 11 月 12 日
47	汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）更新招募说明书（2025 年 11 月 13 日更新）	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上交所	2025 年 11 月 13 日
48	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）溢价风险的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上交所,中证报	2025 年 11 月 13 日
49	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）溢价风险的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上交所,中证报	2025 年 11 月 14 日
50	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）溢价风险的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上交所,中证报	2025 年 11 月 17 日
51	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）溢价风险的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上交所,中证报	2025 年 11 月 18 日
52	关于汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）暂停申购业务的公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上交所,中证报	2025 年 11 月 18 日
53	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）溢价风险的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上交所,中证报	2025 年 11 月 19 日
54	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）溢价风险的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上交所,中证报	2025 年 11 月 20 日
55	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）溢价风险的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上交所,中证报	2025 年 11 月 24 日
56	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）溢价风险的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上交所,中证报	2025 年 11 月 25 日
57	关于汇添富纳斯达克生物科技交易	中国证监会基金电	2025 年 11 月 25 日

	型开放式指数证券投资基金(QDII)因境外主要市场节假日暂停赎回业务的公告	子披露网站,公司网站,上交所,中证报	
58	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)溢价风险的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上交所,中证报	2025年11月26日
59	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)溢价风险的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上交所,中证报	2025年11月27日
60	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)溢价风险的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上交所,中证报	2025年11月28日
61	关于汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)恢复申购业务的公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上交所,中证报	2025年11月29日
62	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)溢价风险的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上交所,中证报	2025年11月29日
63	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)溢价风险的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上交所,中证报	2025年12月01日
64	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)溢价风险的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上交所,中证报	2025年12月02日
65	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)溢价风险的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上交所,中证报	2025年12月03日
66	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)溢价风险的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上交所,中证报	2025年12月04日
67	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)溢价风险的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上交所,中证报	2025年12月05日
68	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富纳斯达克生物科技交易型开	中国证监会基金电子披露网站,公司网	2025年12月05日

	放式指数证券投资基金（QDII）溢价风险提示及停牌公告	站,上交所,中证报	
69	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）溢价风险提示的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上交所,中证报	2025 年 12 月 06 日
70	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）溢价风险提示的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上交所,中证报	2025 年 12 月 08 日
71	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）溢价风险提示的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上交所,中证报	2025 年 12 月 09 日
72	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）溢价风险提示的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上交所,中证报	2025 年 12 月 10 日
73	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）溢价风险提示的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上交所,中证报	2025 年 12 月 11 日
74	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）溢价风险提示的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上交所,中证报	2025 年 12 月 12 日
75	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）溢价风险提示的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上交所,中证报	2025 年 12 月 13 日
76	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）溢价风险提示的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上交所,中证报	2025 年 12 月 15 日
77	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）溢价风险提示的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上交所,中证报	2025 年 12 月 16 日
78	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）溢价风险提示的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上交所,中证报	2025 年 12 月 17 日
79	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富纳斯达克生物科技交易型开	中国证监会基金电子披露网站,公司网	2025 年 12 月 18 日

	放式指数证券投资基金（QDII）溢价风险的提示性公告	站,上交所,中证报	
80	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）溢价风险的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上交所,中证报	2025 年 12 月 19 日
81	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）溢价风险的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上交所,中证报	2025 年 12 月 20 日
82	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）溢价风险的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上交所,中证报	2025 年 12 月 22 日
83	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）溢价风险的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上交所,中证报	2025 年 12 月 23 日
84	关于汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）因境外主要市场节假日暂停申购、赎回业务的公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上交所,中证报	2025 年 12 月 23 日
85	汇添富基金管理股份有限公司关于设立汇添富基金销售（上海）有限公司的公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,深交所,上交所,上证报	2025 年 12 月 24 日
86	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）溢价风险的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上交所,中证报	2025 年 12 月 24 日
87	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）溢价风险的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站,上交所,公司网站,中证报	2025 年 12 月 24 日
88	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）溢价风险的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上交所,中证报	2025 年 12 月 25 日
89	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）溢价风险的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上交所,中证报	2025 年 12 月 26 日
90	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富纳斯达克生物科技交易型开	中国证监会基金电子披露网站,公司网	2025 年 12 月 27 日

	放式指数证券投资基金（QDII）溢价风险的提示性公告	站,上交所,中证报	
91	关于汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）暂停申购业务的公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上交所,中证报	2025 年 12 月 27 日
92	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）溢价风险的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上交所,中证报	2025 年 12 月 29 日
93	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）溢价风险的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上交所,中证报	2025 年 12 月 31 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	2025 年 3 月 5 日至 2025 年 3 月 16 日,2025 年 3 月 18 日至 2025	153,435,931.00	1,506,575,784.00	1,660,002,500.00	9,215.00	0.00

		年3月18日,2025年3月21日至2025年3月23日,2025年4月16日至2025年4月16日					
中国银行股份有限公司-汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(QDII)	1	2025年5月14日至2025年12月31日	258,363,700.00	265,506,300.00	226,883,900.00	296,986,100.00	28.69
产品特有风险							
<p>1、持有人大会投票权集中的风险</p> <p>当基金份额集中度较高时,少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高,其在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。</p> <p>2、基金规模较小导致的风险</p> <p>持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后,可能导致基金规模较小,基金持续稳定运作可能面临一定困难。本基金管理人将继续勤勉尽责,执行相关投资策略,力争实现投资目标。</p> <p>3、提前终止基金合同的风险</p> <p>持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后,可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于5000万元,进而可能导致本基金终止、转换运作方式或与其他基金合并。</p>							

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）募集的文件；
- 2、《汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金合同》；
- 3、《汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）在规定的报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

### 13.2 存放地点

上海市黄浦区外马路 728 号 汇添富基金管理股份有限公司

### 13.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，或登录基金管理人网站 [www.99fund.com](http://www.99fund.com) 查阅，还可拨打基金管理人客户服务中心电话：400-888-9918 查询相关信息。

汇添富基金管理股份有限公司

2026 年 03 月 31 日