

鹏华恒生生物科技交易型开放式指数证券
投资基金
2026 年第 2 季度报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：广发证券股份有限公司

报告送出日期：2026 年 7 月 20 日

§ 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责任。

基金托管人广发证券股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 07 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。
本报告期自 2026 年 04 月 01 日起至 2026 年 06 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	鹏华恒生生物科技 ETF
场内简称	恒生生物科技 ETF 鹏华
基金主代码	159130
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2025 年 11 月 19 日
报告期末基金份额总额	255,389,466.00 份
投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度控制在 0.35%以内，年跟踪误差控制在 4%以内。
投资策略	本基金主要通过投资于标的指数成份股、备选成份股（含存托凭证）等实现对标的指数的紧密跟踪，本基金力争将日均跟踪偏离度控制在 0.35%以内，年跟踪误差控制在 4%以内。如因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。 1、股票投资策略 本基金采用完全复制策略，按照标的指数成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。 因特殊情况导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可采取包括标的指数成份股（含存托凭证）替代策略在内的其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的。特殊情况包括但不限于以下情形：（1）法律法规的限制；（2）标的指数成份股（含存托凭证）流动性严重不足；（3）标的指数成份股（含

	存托凭证)长期停牌;(4)标的指数成份股(含存托凭证)进行配股或增发;(5)标的指数成份股(含存托凭证)派发现金股息;(6)标的指数成份股(含存托凭证)定期或临时调整;(7)标的指数编制方法发生变化;(8)其它合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等。 2、存托凭证投资策略 本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略,基于对基础证券投资价值的深入研究判断,进行存托凭证的投资。 3、债券投资策略 本基金债券投资组合将采用自上而下的投资策略,根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来利率变化,并利用债券定价技术,进行个券选择。 本基金可投资可转换债券及可交换债券,可转换债券及可交换债券兼具债权和股权双重属性,本基金将通过对目标公司股票的投资价值分析和债券价值分析综合开展投资决策,力争增强本基金的收益。 4、金融衍生品投资策略 为进行流动性管理、应付赎回、降低跟踪误差、提高投资效率及规避外汇风险,本基金可投资金融衍生品,并根据风险管理的原则,主要选择流动性好、交易活跃的衍生品,提高投资效率,从而更好地跟踪标的指数,实现投资目标。 5、资产支持证券的投资策略 本基金将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券的投资组合管理,并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化积极调整投资策略,严格遵守法律法规和基金合同的约定,在保证本金安全和基金资产流动性的基础上获得稳定收益。 6、融资及转融通投资策略 本基金可在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素基础上,参与融资业务。 为更好地实现投资目标,在加强风险防范并遵守审慎经营原则的前提下,本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务。本基金将在分析市场环境、投资者类型与结构、基金历史申赎情况、出借证券流动性情况等因素的基础上,合理确定出借证券的范围、期限和比例。 未来,随着证券市场投资工具的发展和丰富,本基金可在履行适当程序后相应调整和更新相关投资策略,并在招募说明书中更新公告。
业绩比较基准	恒生生物科技指数收益率(经汇率调整后)
风险收益特征	本基金属于股票型基金,其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。同时本基金为交易型开放式指数基金,具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。 本基金主要通过港股通投资于香港证券市场中具有良好流动性的金融工具。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,本基金还会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险,包括但不限于港股市场股价波动较大的风险、汇率风险、港股通机制下交易日不连贯

	可能带来的风险等。
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	广发证券股份有限公司

注：无。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2026 年 4 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日）
1. 本期已实现收益	-2,967,962.90
2. 本期利润	-29,382,214.01
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.1161
4. 期末基金资产净值	198,808,758.00
5. 期末基金份额净值	0.7785

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等未实现收益。

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，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

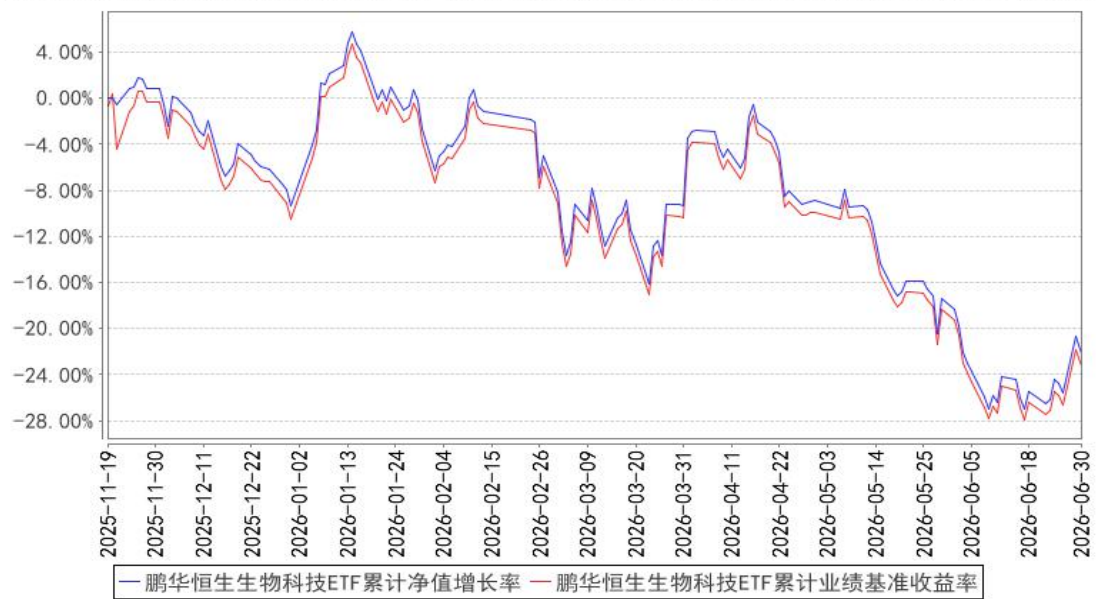
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	-14.07%	2.04%	-14.34%	2.05%	0.27%	-0.01%
过去六个月	-14.11%	2.17%	-14.24%	2.18%	0.13%	-0.01%
自基金合同 生效起至今	-22.15%	2.01%	-23.22%	2.08%	1.07%	-0.07%

注：业绩比较基准=恒生生物科技指数收益率（经汇率调整后）。

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

鹏华恒生生物科技ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2025 年 11 月 19 日生效，截至本报告期末本基金基金合同生效未满一年。2、截至建仓期结束，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

3.3 其他指标

注：无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张羽翔	本基金的基金经理	2025-11-19	-	19 年	张羽翔先生, 国籍中国, 工学硕士, 19 年证券从业经验。曾任招商银行软件中心(原深圳市融博技术公司)数据分析师; 2011 年 3 月加盟鹏华基金管理有限公司, 历任监察稽核部资深金融工程师、量化及衍生品投资部资深量化研究员, 先后从事金融工程、量化研究等工作; 现担任指数与量化投资部基金经理。2015 年 09 月至 2020 年 06 月担任鹏华上证民营企业 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理, 2015 年 09 月至 2020 年 06 月担任上证民营企业 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2016 年 06 月至 2018 年 05 月担任鹏华新丝路指数分级证券投资基金基金经理, 2016 年 07 月至 2020 年 12 月担任鹏华中证高铁产业指数

				分级证券投资基金基金经理，2016 年 09 月至 2022 年 08 月担任鹏华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）基金经理，2016 年 09 月至 2022 年 08 月担任鹏华中证 500 指数证券投资基金（LOF）基金经理，2016 年 11 月至 2020 年 07 月担任鹏华中证新能源指数分级证券投资基金基金经理，2016 年 11 月至 2020 年 12 月担任鹏华中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金经理，2018 年 04 月至 2020 年 12 月担任鹏华创业板指数分级证券投资基金基金经理，2018 年 04 月至 2020 年 12 月担任鹏华中证移动互联网指数分级证券投资基金基金经理，2018 年 05 月至 2018 年 08 月担任鹏华沪深 300 指数增强型证券投资基金基金经理，2018 年 05 月至 2020 年 12 月担任鹏华国证钢铁行业指数分级证券投资基金基金经理，2018 年 05 月至 2021 年 10 月担任鹏华港股通中证香港中小企业投资主题指数证券投资基金（LOF）基金经理，2019 年 04 月至今担任鹏华中证酒交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2019 年 07 月至 2022 年 08 月担任鹏华中证国防交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2019 年 11 月至今担任鹏华港股通中证香港银行投资指数证券投资基金（LOF）基金经理，2019 年 12 月至 2022 年 10 月担任鹏华中证银行交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2020 年 02 月至 2022 年 10 月担任鹏华中证 800 证券保险交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2020 年 03 月至 2022 年 08 月担任鹏华中证传媒交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2021 年 01 月至 2021 年 01 月担任鹏华国证钢铁行业指数型证券投资基金（LOF）基金经理，2021 年 01 月至 2021 年 01 月担任鹏华中证高铁产业指数型证券投资基金（LOF）基金经理，2021 年 01 月至 2021 年 01 月担任鹏华中证一带一路主题指数型证券投资基金（LOF）基金经理，2021 年 01 月至 2021 年 01 月担任鹏华中证移动互联网指数型证券投资基金（LOF）基金经理，2021 年 01 月至 2022 年 08 月担任鹏华创业板指数型证券投资
--	--	--	--	---

					基金（LOF）基金经理，2021 年 01 月至 2022 年 08 月担任鹏华中证传媒指数型证券投资基金（LOF）基金经理，2021 年 01 月至 2022 年 10 月担任鹏华中证银行指数型证券投资基金（LOF）基金经理，2021 年 01 月至今担任鹏华中证酒指数型证券投资基金（LOF）基金经理，2021 年 07 月至今担任鹏华中证港股通医药卫生综合交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2021 年 08 月至今担任鹏华中证港股通消费主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2021 年 08 月至 2026 年 06 月担任鹏华中证医药卫生指数证券投资基金（LOF）基金经理，2021 年 12 月至今担任鹏华中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2022 年 07 月至今担任鹏华中证中药交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2022 年 11 月至今担任鹏华中证中药交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2023 年 05 月至今担任鹏华中证港股通消费主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2024 年 07 月至今担任鹏华中证港股通科技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，2024 年 07 月至今担任鹏华中证港股通医药卫生综合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，2025 年 01 月至今担任鹏华恒生港股通高股息率指数发起式证券投资基金基金经理，2025 年 04 月至 2026 年 05 月担任鹏华上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025 年 06 月至今担任鹏华国证港股通消费主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025 年 07 月至今担任鹏华恒生交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025 年 08 月至今担任鹏华国证港股通创新药交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025 年 11 月至今担任鹏华恒生生物科技交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2026 年 04 月至今担任鹏华恒生港股通汽车主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2026 年 05 月至今担任鹏华上证科创板 50 成份交易型开
--	--	--	--	--	--

					放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，2026 年 05 月至今担任鹏华恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2026 年 06 月至今担任鹏华中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金基金经理，张羽翔先生具备基金从业资格。
林嵩	本基金的基金经理	2025-11-19	-	11 年	林嵩先生，国籍中国，理学硕士，11 年证券从业经验。2015 年 4 月加盟鹏华基金管理有限公司，历任量化及衍生品投资部量化研究员、投资经理等，现担任指数与量化投资部副总监/基金经理。2023 年 06 月至今担任鹏华国证疫苗与生物科技交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2024 年 10 月至今担任鹏华国证疫苗与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基金经理，2024 年 11 月至今担任鹏华北证 50 成份指数发起式证券投资基金基金经理，2025 年 03 月至今担任鹏华上证科创板生物医药交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025 年 03 月至今担任鹏华中证中药交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025 年 03 月至今担任鹏华中证中药交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2025 年 08 月至今担任鹏华国证港股通创新药交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025 年 08 月至今担任鹏华上证科创板半导体材料设备主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025 年 09 月至今担任鹏华上证科创板生物医药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，2025 年 09 月至今担任鹏华创业板综合交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025 年 09 月至今担任鹏华中证金融科技主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025 年 11 月至今担任鹏华恒生生物科技交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025 年 12 月至今担任鹏华中证科创创业人工智能交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2026 年 03 月至今担任鹏华创业板指数型证券投资基金（LOF）基金经理，2026 年 05 月至今担任鹏华中证全指医疗器械交易型开放式指数证券

					投资基金基金经理，2026 年 06 月至今担任鹏华中证医药卫生指数证券投资基金（LOF）基金经理，林嵩先生具备基金从业资格。
--	--	--	--	--	---

注：1. 任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日；担任新成立基金基金经理的，任职日期为基金合同生效日。2. 证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

4.1.1 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：本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规、中国证监会的有关规定以及基金合同的约定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，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，本基金运作合规，不存在违反基金合同和损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行公平交易制度，确保不同投资组合在研究、交易、分配等各环节得到公平对待。公司对不同投资组合在不同时间窗口下（日内、3 日内、5 日内）的同向交易价差进行专项分析，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发生违法违规且对基金财产造成损失的异常交易行为。本报告期内，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% 的交易共有 1 次，为投资组合的投资策略需要而发生的同日反向交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

今年二季度，除了科技方向以外，其他行业、风格大多有明显的下跌，除了内外部、宏微观流动性挤压外，某种程度也在定价基本面景气度的分化。医药各个子行业也如此，港股医药受到的双重挤压更甚。二季度，医药（中信）行业指数下跌 8.8%，大幅跑输沪深 300 指数 21%，在 30 个一级行业指数中位于第 16 位。中证 800 医药卫生指数下跌 7.6%，大幅跑输中证 800 指数 21.3%。恒生生物科技指数下跌 12.9%，显著跑输恒生指数。细分子板块上，港股通创新药、中药指数、

医疗器械、疫苗生科指数分别下跌 17.6%、14.5%、14.3%和 11.4%，均跑输行业指数；CRO/CMO 指数上涨 17.3%，医疗服务行业指数上涨 5.9%，表现较好；科创生物医药下跌 3.9%，主要是 6 月底的上涨贡献。

如过去季报中，我们依旧认为创新和出海是医药行业最值得关注的投资主线，其中创新药和创新医疗器械则是兼具创新出海逻辑的主赛道。进一步展开，我们按照内需市场和海外市场去观察医药行业的投资。内需市场的增长主要来自新产品放量和困境反转两个维度。前者典型的如一个创新药通过谈判纳入医保目录中，可以通过以量补价实现收入高增；后者更多来自于价格信号的反转，如部分耗材经历集采后开始有涨价预期，BD 催化和融资环境好转共同驱动国内 CRO 结束价格内卷并实现量价齐升。海外市场更多是 alpha 特征，即能够成功出海的公司基本都呈现海外收入明显快于国内、毛利率明显好于国内的态势。近几年除了爆发的 BD 交易带来的首付款和部分里程碑付款则能够持续带来创新药企表观收入的增厚外，我们也看到越来越多的医疗器械公司深耕海外渠道以及在更多的海外国家获得产品准入，通过海外市场的放量去对冲内需市场的阶段性疲软。

创新药行业，二季度在临床数据读出和海内外政策上都有一定变化。市场关注度最高的是 5 月底 ASCO 会议上读出 HARMONi-6 的中期 OS 分析数据，该临床是一个中国区的 III 期临床，也是首个在肺癌大适应症上展示出比当前标准疗法（PD-1 单抗±化疗）有显著疗效和患者生存获益的临床。但是，美国临床专家和海外投资者普遍对于 H6 的入组条件以及部分人群的效果（如 70 岁以上老年人）有诸多质疑，而打消此类质疑则需要通过全球 III 期临床 HARMONi-3 的数据读出。也就是说，当前国内创新药产业已走入深水区，即需要在全球市场上拿出头对头优于标准疗法的临床数据，以此在估值上重新计入更多的海外估值。而在政策变化上，我们会密切跟踪美国当前讨论较多的限制 FDA 采用来自特定国家和地区的临床数据在美进行 IND 申报、BINSa 法案中关于限制中美生物技术领域合作的投资审查条款等。国内政策变化上，我们预计在三季度后半段会有更高的清晰度，而涉及到的补税和增值税优惠条件变更更多是一过性的影响。

其他子行业上，CXO 是医药行业内除创新药外景气度最高的子行业，大部分公司公开指引 26 年收入端有 20%以上的增速，显著快于国内医药大盘低个位数的增长。医疗器械我们会更多的关注新产品新技术和海外 alpha 的投资机会，一方面脑机接口、手术机器人以及部分高耗仍有广阔的国产渗透率提升的空间，另一方面，医疗器械子行业的海外收入占比已经达到 1/3、而且海外收入增速普遍在 20%以上，能够有效对冲内需市场的阶段性疲软。中药行业当前的估值分位数已经来到了过去 10 年最底的 2%分位数水平，隐含了较多消费的悲观预期，且股息率已经有 4%、处于历史最高水平。疫苗和 IVD 仍处在基本面的底部区域。

本基金跟踪的标的指数为恒生生物科技指数（HSBIO）。在投资运作上，本基金秉承指数基金的投资策略，力争跟踪指数，并将基金跟踪误差控制在合理范围内。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期份额净值增长率为-14.07%，同期业绩比较基准增长率为-14.34%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	197,358,693.54	97.63
	其中：股票	197,358,693.54	97.63
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	1,255,802.36	0.62
8	其他资产	3,528,463.46	1.75
9	合计	202,142,959.36	100.00

注：1、上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 5.2 的合计项不含可退替代款估值增值。

2、本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 197,358,693.54 元，占净值比 99.27%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

注：无。

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

注：无。

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	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	6,499,218.95	3.27
医疗保健	190,859,474.59	96.00
金融	—	—
信息技术	—	—
通信服务	—	—
公用事业	—	—
房地产	—	—
合计	197,358,693.54	99.27

注：以上分类采用国际通用行业分类标准。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	06160	百济神州	139,100	20,586,927.97	10.36
2	01801	信达生物	297,500	20,568,132.55	10.35
3	02269	药明生物	668,000	20,074,622.44	10.10
4	02359	药明康德	127,700	17,047,456.44	8.57
5	09926	康方生物	194,000	14,836,310.54	7.46
6	01093	石药集团	2,124,000	12,858,257.39	6.47
7	01177	中国生物制药	2,717,000	10,406,940.04	5.23
8	03692	翰森制药	398,000	10,239,127.50	5.15
9	01530	三生制药	534,500	7,841,013.18	3.94
10	06990	科伦博泰生物	17,100	6,478,531.82	3.26

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

注：无。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：无。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：无。

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

注：无。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：无。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：无。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

为进行流动性管理、应付赎回、降低跟踪误差、提高投资效率及规避外汇风险，本基金可投资金融衍生品，并根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的衍生品，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数，实现投资目标。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

为进行流动性管理、应付赎回、降低跟踪误差、提高投资效率及规避外汇风险，本基金可投资金融衍生品，并根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的衍生品，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数，实现投资目标。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券中本期没有发行主体被监管部门立案调查的、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券备选库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	2,883,033.19
3	应收股利	584,937.64
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	60,492.63
8	其他	-
9	合计	3,528,463.46

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	277,389,466.00
报告期期间基金总申购份额	54,000,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	76,000,000.00
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	255,389,466.00

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：无。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- （一）《鹏华恒生生物科技交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- （二）《鹏华恒生生物科技交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- （三）《鹏华恒生生物科技交易型开放式指数证券投资基金 2026 年第 2 季度报告》（原文）。

9.2 存放地点

深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层鹏华基金管理有限公司。

9.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅，也可按工本费购买复印件，或通过本基金管理人网站（<http://www.phfund.com.cn>）查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人鹏华基金管理有限公司，本公司已开通客户服务系统，咨询电话：400-6788-533。

鹏华基金管理有限公司

2026 年 7 月 20 日