

中金科创主题灵活配置混合型证券投资基金
(LOF)
2023 年第 3 季度报告

2023 年 9 月 30 日

基金管理人：中金基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 10 月 25 日

§1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 7 月 1 日起至 2023 年 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中金科创主题灵活配置混合（LOF）
场内简称	科创中金（扩位简称：科创主题投资基金 LOF）
基金主代码	501080
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2019 年 7 月 11 日
报告期末基金份额总额	297,982,587.77 份
投资目标	在控制风险和保持流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产长期稳健的增值。
投资策略	本基金主要投资科创主题相关证券。投资策略具体包括：1、资产配置策略；2、股票投资策略；3、存托凭证投资策略；4、普通债券投资策略；5、可转换债券投资策略；6、可交换债券投资策略；7、资产支持证券投资策略；8、国债期货投资策略；9、股指期货投资策略；10、融资业务投资策略。详见《中金科创主题灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》。
业绩比较基准	中国战略新兴产业成份指数收益率*65%+中债-综合全价（总值）指数收益率*35%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。
基金管理人	中金基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

§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（2023 年 7 月 1 日-2023 年 9 月 30 日）
1. 本期已实现收益	-16,034,604.30
2. 本期利润	-108,077,966.78
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.3547
4. 期末基金资产净值	374,800,008.65
5. 期末基金份额净值	1.2578

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. 本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

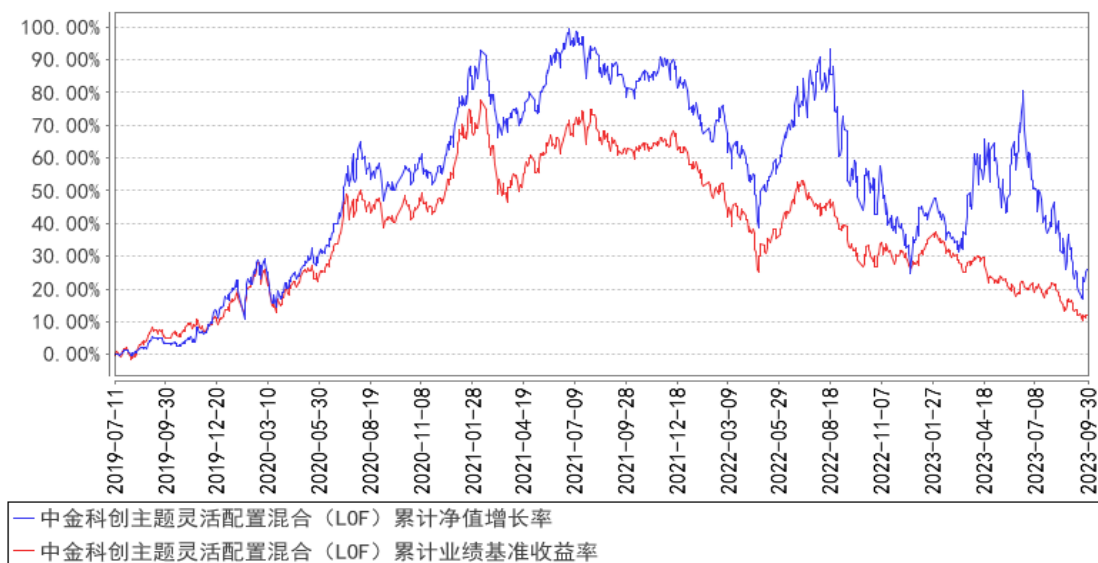
3.2 基金净值表现

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	-21.96%	2.13%	-7.43%	0.73%	-14.53%	1.40%
过去六个月	-16.92%	2.59%	-12.91%	0.76%	-4.01%	1.83%
过去一年	-15.08%	2.29%	-13.21%	0.81%	-1.87%	1.48%
过去三年	-17.23%	1.77%	-21.08%	1.01%	3.85%	0.76%
自基金合同 生效起至今	25.78%	1.64%	11.95%	1.03%	13.83%	0.61%

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

中金科创主题灵活配置混合（LOF）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：本基金于 2022 年 07 月 11 日转型为中金科创主题灵活配置混合型证券投资基金（LOF）。

§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		
许忠海	本基金基金经理	2022 年 6 月 20 日	-	13 年	许忠海先生，理学硕士。历任贝迪研发中心（北京）工程师；方正证券股份有限公司研究所研究员；中邮创业基金管理股份有限公司研究员、基金经理助理、基金经理、投资决策委员会委员。现任中金基金管理有限公司权益部基金经理。

注：上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

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

本报告期，本基金不存在基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情形。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》、基金合同和其他法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一直坚持公平对待旗下所有投资组合，严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，规范投资、研究和交易等各相关流程，通过系统控制和人工监控等方式在各环节严格控制，确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。

本报告期内，本基金运作符合法律法规和公司公平交易制度的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

本报告期内，本公司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未超过该证券当日成交量的 5%。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

随着 6 月 1pr 降息落地以及 rmb 汇率逐渐企稳，同时大盘消化了较大部分经济不景气的预期，电新、汽车等顺周期板块存在超跌反弹的空间；7 月中下旬以来，以 chatgpt 为代表的人工智能板块面临资金分流和半年报业绩考验，部分公司减持更加剧了板块的调整，市场重归配置再均衡。AI 板块经历补跌调整后，算力方向光模块、服务器业绩确定性强，传媒游戏板块进入三季度以后，市场会更关注流水的变化，因为前期版号下发，三季度游戏板块流水方面会有积极的变化，暑期档票房以及现象级影片的加持，影视板块料下半年和明年会进入新的上升周期；此外，开始关注电子板块的库存出清机会，紧密跟踪以确认是否开启新一轮硬件周期，智能驾驶和机器人本质上是 AI 的应用衍生，已经处于行业渗透率开始向上提升的阶段，也是重点关注的投资领域。

根据行业调研和分析，本基金重点把握内需拉动、营收保持增长确定性的方向，提高生产要素效率的创新科技产业以及未来能够走出去，深度受益区域全球化需求的中国优势产业及供应链公司，在三季度重点布局人工智能、光模块、服务器算力基础设施产业链、AI 应用、半导体设备材料、消费电子、智能驾驶、机器人等。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.2578 元；本报告期基金份额净值增长率为-21.96%，业绩比较基准收益率为-7.43%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	283,417,572.71	75.33
	其中：股票	283,417,572.71	75.33
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	69,422,518.69	18.45
	其中：债券	69,422,518.69	18.45
	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	23,220,873.86	6.17
8	其他资产	174,898.05	0.05
9	合计	376,235,863.31	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	151,726,952.84	40.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	33,563.97	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	117,988,569.90	31.48
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	6,004,830.00	1.60
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	7,663,656.00	2.04
S	综合	-	-
	合计	283,417,572.71	75.62

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票资产。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300308	中际旭创	203,600	23,576,880.00	6.29
2	300502	新易盛	486,000	22,356,000.00	5.96
3	300394	天孚通信	233,500	22,182,500.00	5.92
4	688111	金山办公	58,852	21,822,321.60	5.82
5	002475	立讯精密	701,600	20,921,712.00	5.58
6	002517	恺英网络	1,544,800	19,464,480.00	5.19
7	002230	科大讯飞	379,335	19,217,111.10	5.13
8	002555	三七互娱	850,400	18,453,680.00	4.92
9	002463	沪电股份	800,700	18,023,757.00	4.81
10	600602	云赛智联	1,129,108	16,823,709.20	4.49

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	69,422,518.69	18.52
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	69,422,518.69	18.52

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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	123025	精测转债	68,880	13,803,919.99	3.68
2	128074	游族转债	108,770	12,910,081.16	3.44

3	113616	韦尔转债	100,360	11,344,119.74	3.03
4	128136	立讯转债	83,679	9,304,962.66	2.48
5	113061	拓普转债	57,240	7,573,954.46	2.02

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期末本基金未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

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的发行主体中，三七互娱网络科技集团股份有限公司本期出现被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司投资制度的要求。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	150,168.29
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	24,729.76
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	174,898.05

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	123025	精测转债	13,803,919.99	3.68
2	128074	游族转债	12,910,081.16	3.44
3	113616	韦尔转债	11,344,119.74	3.03
4	128136	立讯转债	9,304,962.66	2.48
5	113061	拓普转债	7,573,954.46	2.02
6	118015	芯海转债	7,164,211.05	1.91
7	123059	银信转债	3,759,217.96	1.00
8	113626	伯特转债	3,562,051.67	0.95

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	303,169,181.91
报告期期间基金总申购份额	15,134,143.57
减：报告期期间基金总赎回份额	20,320,737.71
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	297,982,587.77

§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

本报告期内，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

§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

本报告期内，本基金不存在单一投资者持有份额比例达到或超过总份额 20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金不存在影响投资者决策的其他重要信息。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予中金科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金募集注册的文件
- 2、《中金科创主题灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》
- 3、《中金科创主题灵活配置混合型证券投资基金（LOF）托管协议》
- 4、《中金科创主题灵活配置混合型证券投资基金（LOF）招募说明书》及其更新
- 5、中金科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金申请募集注册的法律意见书
- 6、基金管理人业务资格批复和营业执照
- 7、基金托管人业务资格批复和营业执照
- 8、报告期内中金科创主题灵活配置混合型证券投资基金（LOF）在规定媒介上披露的各项公告
- 9、中国证监会要求的其他文件

9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

9.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人。

咨询电话：（86）010-63211122 400-868-1166

传真：（86）010-66159121

中金基金管理有限公司

2023 年 10 月 25 日