

中金科创主题灵活配置混合型证券投资基金
（LOF）
2022 年第 4 季度报告

2022 年 12 月 31 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 1 月 20 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 1 月 19 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 2022 年 10 月 1 日起至 2022 年 12 月 31 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 | 376,732,769.59 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股票，包括科创板上市的科创主题公司的股票以及在境内上市的科创主题公司的股票。具体领域包括新一代信息技术领域、高端装备领域、新材料领域、新能源领域、节能环保领域、生物医药领域及符合科创板定位的其他领域。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（2022 年 10 月 1 日-2022 年 12 月 31 日） |
|-----------------|---------------------------------------|
| 1. 本期已实现收益 | -54,972,040.04 |
| 2. 本期利润 | -53,940,254.49 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.1303 |
| 4. 期末基金资产净值 | 509,010,590.93 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.3511 |

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。

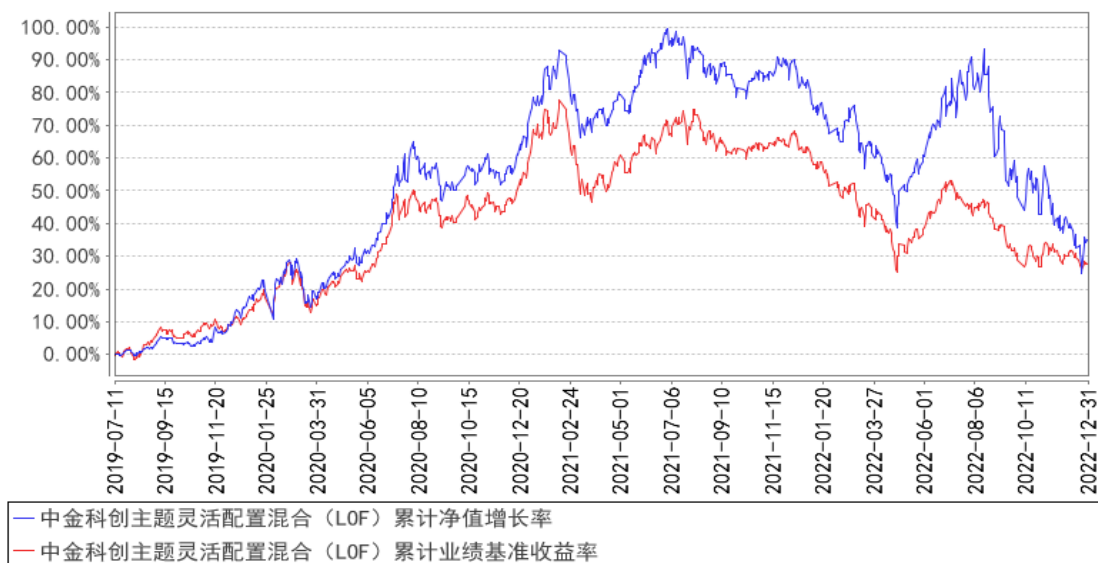
3.2 基金净值表现

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 | -8.78% | 2.19% | -1.01% | 1.00% | -7.77% | 1.19% |
| 过去六个月 | -23.17% | 2.26% | -15.84% | 0.94% | -7.33% | 1.32% |
| 过去一年 | -26.53% | 1.93% | -21.91% | 1.10% | -4.62% | 0.83% |
| 过去三年 | 17.17% | 1.54% | 13.99% | 1.13% | 3.18% | 0.41% |
| 自基金合同 生效起至今 | 35.11% | 1.45% | 27.68% | 1.08% | 7.43% | 0.37% |

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 | - | 12 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

四季度全球通胀压力出现一定降温，全球股市整体平稳回升；国内方面，随着 20 条优化措施的发布，全国各地开始陆续实现放开，防疫政策的持续优化为推动国内经济的进一步修复打下坚实的基础，进而推动市场走强。此外，央行再度降准，对流动性进一步支持。

海外方面，市场对于美联储紧缩预期趋于缓和，加息拐点确认。国内方面，PMI 连续两个月跌落至荣枯线之下，高频数据显示经济再度探底，倒逼稳增长加码发力。

外部紧缩预期缓和，内部经济维稳加码，市场整体震荡蓄势前行，跨年行情可期。年底政治局会议和中央经济工作会议对 2023 年政策定调偏积极，防疫优化、货币宽松、泛财政发力、稳地产和专项债提前下发等政策可期，助力经济疫后修复，驱动 A 股跨年行情。

根据行业调研和分析，本基金重点把握四季度营收保持增长确定性的方向，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，储能、光伏新技术、海上风电、半导体设备、创新药、影视传媒、整车全球化以及新能源汽车智能驾驶供应链体系。

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 1.3511 元；本报告期基金份额净值增长率为-8.78%，业绩比较基准收益率为-1.01%。

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 | 445,988,984.28 | 83.87 |
| | 其中：股票 | 445,988,984.28 | 83.87 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 26,051,840.18 | 4.90 |
| | 其中：债券 | 26,051,840.18 | 4.90 |
| | 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 | 43,190,915.16 | 8.12 |
| 8 | 其他资产 | 16,520,483.66 | 3.11 |
| 9 | 合计 | 531,752,223.28 | 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 | 413,411,297.55 | 81.22 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 9,576,946.63 | 1.88 |
| 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 | 29,837.98 | 0.01 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 19,871,036.12 | 3.90 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |

| | | | |
|---|-----------|----------------|-------|
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 3,099,866.00 | 0.61 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 445,988,984.28 | 87.62 |

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 | 300274 | 阳光电源 | 345,500 | 38,626,900.00 | 7.59 |
| 2 | 603596 | 伯特利 | 406,927 | 32,472,774.60 | 6.38 |
| 3 | 601689 | 拓普集团 | 512,583 | 30,027,112.14 | 5.90 |
| 4 | 002920 | 德赛西威 | 258,700 | 27,251,458.00 | 5.35 |
| 5 | 688390 | 固德威 | 81,514 | 26,336,358.26 | 5.17 |
| 6 | 002487 | 大金重工 | 600,600 | 24,846,822.00 | 4.88 |
| 7 | 605117 | 德业股份 | 71,000 | 23,515,200.00 | 4.62 |
| 8 | 603606 | 东方电缆 | 343,521 | 23,301,029.43 | 4.58 |
| 9 | 002335 | 科华数据 | 399,400 | 19,926,066.00 | 3.91 |
| 10 | 688248 | 南网科技 | 347,918 | 19,866,117.80 | 3.90 |

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） | 26,051,840.18 | 5.12 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 26,051,840.18 | 5.12 |

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 | 113626 | 伯特转债 | 68,250 | 15,514,851.78 | 3.05 |
| 2 | 113061 | 拓普转债 | 83,930 | 10,536,988.40 | 2.07 |

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

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本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 基金投资的前十名股票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 | 821,030.49 |
| 2 | 应收证券清算款 | 15,638,238.63 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 61,214.54 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 16,520,483.66 |

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 | 113626 | 伯特转债 | 15,514,851.78 | 3.05 |

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 | 433,484,478.96 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 13,148,636.97 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 69,900,346.34 |
| 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 | 376,732,769.59 |

§ 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、关于申请募集中金科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金之法律意见书
- 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）在指定媒介上发布的各项公告
- 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 1 月 20 日