

中金科创主题灵活配置混合型证券投资基金
(LOF)
2023 年中期报告

2023 年 6 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

送出日期：2023 年 8 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。本中期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 2023 年 8 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 6 月 30 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 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	8
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	10
4.8 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	10
§ 5 托管人报告	10
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	10
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	10
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	11
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	11
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	12
6.3 净资产（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	35
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	39
7.6 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	39

7.7 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	40
7.8 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贵金属投资明细	40
7.9 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	40
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	40
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	40
7.12 投资组合报告附注	40
§ 8 基金份额持有人信息	41
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	41
8.2 期末上市基金前十名持有人	41
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	42
8.4 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	42
§ 9 开放式基金份额变动	42
§ 10 重大事件揭示	42
10.1 基金份额持有人大会决议	42
10.2 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	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	42
10.4 基金投资策略的改变	42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	43
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	43
10.8 其他重大事件	45
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	45
11.1 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	45
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	45
§ 12 备查文件目录	46
12.1 备查文件目录	46
12.2 存放地点	46
12.3 查阅方式	46

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中金科创主题灵活配置混合型证券投资基金（LOF）
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
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
报告期末基金份额总额	303,169,181.91 份
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	2019 年 12 月 25 日

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险的基础上，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	对于科创板上市的公司，本基金采取定性和定量相结合的方法进行自下而上的个股选择，对公司基本面和估值水平进行综合的研判，精选优质个股。具体包括：1、股票投资策略；2、存托凭证投资策略；3、固定收益品种投资策略；4、股指期货投资策略；5、融资业务投资策略。详见《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。

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	中金基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	席晓峰
	联系电话	010-63211122
	电子邮箱	xxpl@ciccfund.com
客户服务电话	400-868-1166	95566
传真	010-66159121	010-66594942
注册地址	北京市朝阳区建国门外大街 1 号 国贸写字楼 2 座 26 层 05 室	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	北京市朝阳区建国门外大街 1 号 国贸大厦 B 座 43 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	100004	100818

法定代表人	胡长生	葛海蛟
-------	-----	-----

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.ciccfund.com/
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-39,086,019.40
本期利润	93,102,192.53
加权平均基金份额本期利润	0.2709
本期加权平均净值利润率	18.22%
本期基金份额净值增长率	19.30%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	135,714,718.75
期末可供分配基金份额利润	0.4477
期末基金资产净值	488,656,954.39
期末基金份额净值	1.6118
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	61.18%

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

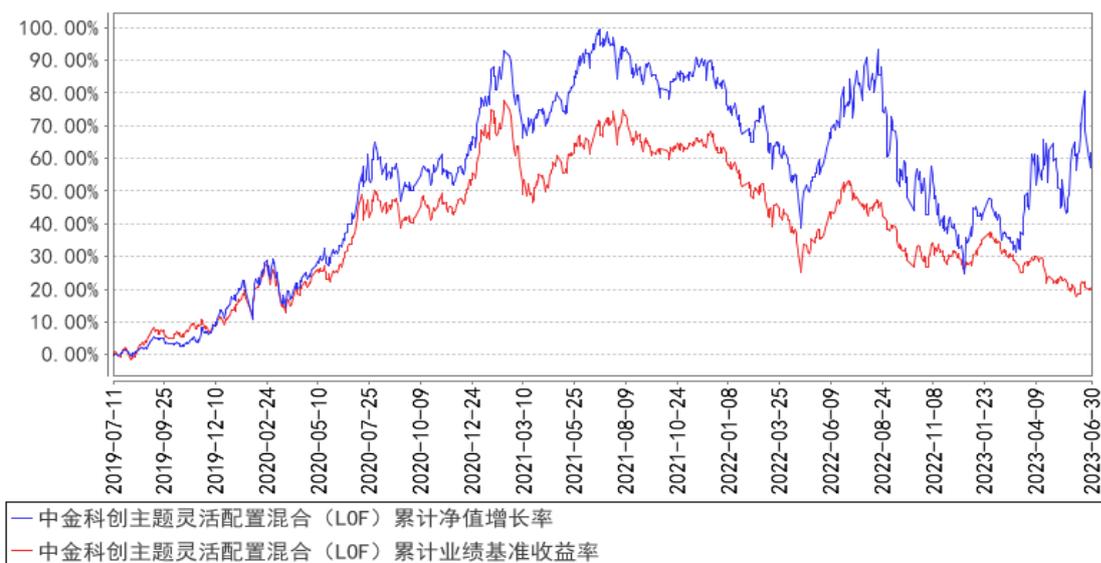
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	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
过去一个月	1.79%	2.87%	1.19%	0.88%	0.60%	1.99%
过去三个月	6.46%	3.02%	-5.93%	0.79%	12.39%	2.23%
过去六个月	19.30%	2.43%	-5.29%	0.75%	24.59%	1.68%

过去一年	-8.35%	2.34%	-20.29%	0.85%	11.94%	1.49%
过去三年	12.70%	1.71%	-10.83%	1.05%	23.53%	0.66%
自基金合同生效起至今	61.18%	1.60%	20.93%	1.04%	40.25%	0.56%

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

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

中金基金管理有限公司（简称“中金基金”、“公司”）成立于 2014 年 2 月，由中国国际金融股份有限公司（简称“中金公司”）作为全资股东，是首家通过发起设立方式由单一股东持股的基金公司，注册资本 5 亿元人民币。母公司中金公司作为中国第一家中外合资投资银行，致力于为国内外机构及个人客户提供高品质的金融服务。中金基金充分发挥母公司品牌及资源优势，持续增强公司整体竞争实力。中金基金注册地址为北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸写字楼 2 座 26 层 05 室，办公地址为北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 B 座 43 层。

截至 2023 年 6 月 30 日，公司共管理 45 只公募基金，证券投资基金管理规模 1208.29 亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		

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。
刘重晋	本基金基金助理	2020年8月4日	-	11年	刘重晋先生，理学博士。历任松河投资咨询（深圳）有限公司副总经理、量化研究员。现任中金基金管理有限公司量化指数部基金经理。

注：1、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。

2、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

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的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

一季度海外方面，硅谷银行事件发酵，一方面市场担忧经济进一步衰退风险，另一方面也预期美联储加息节奏的减缓，以缓解市场对银行流动性危机的担忧；国内方面，经历 1、2 月份的报复性出行和消费之后，3 月整体消费复苏减缓，市场也在观望稳增长政策的力度以及实际经济数据的反馈；3 月，全球来看，经济复苏力度是略低预期的，同时以 chatgpt 为代表的人工智能技术迭代加快，海外基于 gpt 开发的新的应用逐渐落地，国内也开始迅速跟进，流动性相对稳健、宽松的环境下，市场对代表未来生产力提升的新技术新应用给与了强正面反馈，相关板块表现强势。本基金在 2 月从新能源板块战略性调整到 TMT 方向，从模型算法、算力、应用等方面配置 AI 相关产业链公司。

4 月制造业 PMI49.2%，大幅回落至收缩区间，供需两端均下行，需求不足是核心矛盾，表明经济内生动力不强。经济弱复苏，整体市场环境有利于成长板块风格和中特估主题投资。同时以 chatgpt 为代表的人工智能技术迭代加快，虽然累计涨幅较大，相关板块依旧有结构性机会。

5 月、6 月市场依旧高度关注经济复苏支持政策以及经济数据状况，经济复苏力度低于预期，市场调整较多，但同时大盘消化了较大部分经济不景气的预期，全年看是第二次做多时间窗口。苹果 MR 于 6 月发布，新硬件给以新的需求拉动期待，AI 板块在经历 4 月下旬到 5 月下旬的大幅调整后，二季度基本面环比进一步改善以及基本面确定性更强的方向机会更好，板块内分化进一步加大，本基金在操作上进一步加大了对算力的配置比例。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金的份额净值为 1.6118 元；本报告期基金份额净值增长率为 19.30%，业绩比较基准收益率为-5.29%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

随着 6 月 1pr 降息落地以及人民币汇率逐渐企稳，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；6 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，我们认为板块进一步分化，二季度基本面环比进一步改善以及基本面确定性更强的方向机会更好，展望下半年维持市场乐观判断，市场主线维持不变，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，影视板块或将下半年和明年进入新的上升周期；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，下半年重点布局光模块、服务器算力基础设施产业链、AI 软件应用、游戏影视、电子及供应链、智能驾驶、机器人等。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

基金管理人建立并执行基金估值相关管理制度，设置估值委员会研究、指导基金估值业务。各估值委员会委员和基金会计均具有相关工作经历和专业胜任能力。参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定以及本基金基金合同对基金利润分配原则的约定，本报告期内未实施利润分配。

4.8 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

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在中金科创主题灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（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，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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地复核，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。

5.3 托管人对本中期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）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中金科创主题灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	35,214,641.17	42,317,144.05
结算备付金		985,654.79	873,771.11
存出保证金		194,600.15	821,030.49
交易性金融资产	6.4.7.2	447,876,027.76	472,040,824.46
其中：股票投资		366,111,622.84	445,988,984.28
基金投资		-	-
债券投资		81,764,404.92	26,051,840.18
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		7,120,810.34	15,638,238.63
应收股利		-	-
应收申购款		75,241.92	61,214.54
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		491,466,976.13	531,752,223.28
负债和净资产	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		1,272,058.10	-
应付赎回款		338,109.11	21,254,449.29
应付管理人报酬		505,682.60	551,781.90
应付托管费		84,280.44	91,963.65
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,485.13	626.65
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	608,406.36	842,810.86
负债合计		2,810,021.74	22,741,632.35
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	303,169,181.91	376,732,769.59
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	185,487,772.48	132,277,821.34
净资产合计		488,656,954.39	509,010,590.93
负债和净资产总计		491,466,976.13	531,752,223.28

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.6118 元，基金份额总额 303,169,181.91 份。

6.2 利润表

会计主体：中金科创主题灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		96,766,286.13	-69,564,652.64
1. 利息收入		77,754.89	356,209.06
其中：存款利息收入	6.4.7.13	77,754.89	356,209.06
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-35,751,639.43	-124,844,358.52
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-31,054,561.65	-136,876,117.54
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-5,850,493.74	4,002,611.46
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	1,153,415.96	8,029,147.56
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）	6.4.7.20	132,188,211.93	54,923,496.82
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	251,958.74	-
减：二、营业总支出		3,664,093.60	10,069,794.36
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,051,981.32	8,085,369.71
2. 托管费	6.4.10.2.2	508,663.55	1,617,073.88
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	203,761.12
其中：卖出回购金融资产支出		-	203,761.12
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		826.11	14,478.10
8. 其他费用	6.4.7.23	102,622.62	149,111.55
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		93,102,192.53	-79,634,447.00
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		93,102,192.53	-79,634,447.00
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		93,102,192.53	-79,634,447.00

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中金科创主题灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	376,732,769.59	-	132,277,821.34	509,010,590.93
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	376,732,769.59	-	132,277,821.34	509,010,590.93
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-73,563,587.68	-	53,209,951.14	-20,353,636.54
（一）、综合收益总额	-	-	93,102,192.53	93,102,192.53
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-73,563,587.68	-	-39,892,241.39	-113,455,829.07
其中：1. 基金申购款	31,891,913.86	-	17,398,848.31	49,290,762.17
2. 基金赎回款	-105,455,501.54	-	-57,291,089.70	-162,746,591.24
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	303,169,181.91	-	185,487,772.48	488,656,954.39
项目	上年度可比期间			

	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	991,298,498.25	-	831,618,976.67	1,822,917,474.92
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	991,298,498.25	-	831,618,976.67	1,822,917,474.92
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	-	-79,634,447.00	-79,634,447.00
（一）、综合收益总额	-	-	-79,634,447.00	-79,634,447.00
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-	-
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	991,298,498.25	-	751,984,529.67	1,743,283,027.92

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

赵璧

二

白娜

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中金科创主题灵活配置混合型证券投资基金(LOF)(原名中金科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金,以下简称“该基金”)依据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)于 2019 年 6 月 5 日证监许可[2019]1010 号《关于准予中金科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准,由中金基金管理有限公司(以下简称“中金基金”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》及配套规则、《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招募说明书》和《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基金份额发售公告》公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期。《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基金合同》生效后的前三年为封闭运作期,在封闭运作期内,本基金不办理申购和赎回业务。封闭运作期届满后,本基金将转为上市开放式基金(LOF),基金名称调整为“中金科创主题灵活配置混合型证券投资基金(LOF)”,并接受场内、场外申购和赎回。本基金的管理人为中金基金,托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)。

本基金通过中金基金直销柜台、中金基金网上直销平台、中国国际金融股份有限公司(以下简称“中金公司”)、中国中金财富证券有限公司(以下简称“中金财富证券”)、平安银行股份有限公司及中国银行等、以及场内销售机构为上海证券交易所内具有基金销售业务资格并经上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的会员单位共同销售,募集期为自 2019 年 6 月 24 日至 2019 年 7 月 5 日止期间。经向中国证监会备案,基金合同于 2019 年 7 月 11 日正式生效,基金合同生效日基金实收份额为 991,298,498.25 份(含利息转份额 420,773.98 份),发行价格为人民币 1.00 元。该资金已由毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)审验并出具验资报告。

根据中金基金于 2022 年 7 月 8 日发布的《关于中金科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金封闭运作期届满相关安排的公告》,本基金于 2022 年 7 月 10 日封闭运作期届满,自 2022 年 7 月 11 日起自动转为上市开放式基金(LOF),并接受场外、场内申购赎回,基金名称变更为“中金科创主题灵活配置混合型证券投资基金(LOF)”。经与托管人协商一致,并报中国证监会备案,管理人因本基金更名、法律法规的更新等对基金合同、托管协议进行了修订。修订后的基金合同和托管协议自 2022 年 7 月 11 日起生效,本基金将适用其中封闭运作期届满开放后的有关规定。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《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基金合同》和《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招募说明书》的有关规定，本基金封闭运作期的投资范围包括国内依法发行上市的股票（含科创板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、债券（包括国债、地方政府债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券、短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金将根据法律法规的规定参与融资业务。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《中金科创主题灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》和《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》的有关规定，本基金封闭运作期届满转型后，投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括科创板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、次级债、地方政府债券、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券等）、资产支持证券、货币市场工具、债券回购、同业存单、银行存款、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金将根据法律法规的规定参与融资业务。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《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〉》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年上半年度的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期末发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期末发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》（财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号）、财税[2014]81 号文《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《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》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、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》、财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(b) 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（以下简称“营改增”）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债

券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

2018 年 1 月 1 日(含)以后，管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日以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，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(c)基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d)对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入个人所得税应纳税所得额。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴 20%的个人所得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，其股息红利所得暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

(e)基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。对于基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定

缴纳印花税。

(f)对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(g)对基金在 2018 年 1 月 1 日(含)以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	35,214,641.17
等于：本金	35,210,674.27
加：应计利息	3,966.90
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	35,214,641.17

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	276,281,309.09	-	366,111,622.84	89,830,313.75	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	75,063,234.64	286,486.04	81,764,404.92	6,414,684.24
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	75,063,234.64	286,486.04	81,764,404.92	6,414,684.24
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	

其他	-	-	-	-
合计	351,344,543.73	286,486.04	447,876,027.76	96,244,997.99

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末无其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末无其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末无其他权益工具投资。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期末无其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	9.63
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	516,656.88
其中：交易所市场	516,656.88
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	91,739.85
合计	608,406.36

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	376,732,769.59	376,732,769.59
本期申购	31,891,913.86	31,891,913.86
本期赎回（以“-”号填列）	-105,455,501.54	-105,455,501.54
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	303,169,181.91	303,169,181.91

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期末无其他综合收益。

6.4.7.12 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	206,478,257.28	-74,200,435.94	132,277,821.34
本期利润	-39,086,019.40	132,188,211.93	93,102,192.53
本期基金份额交易产生的变动数	-31,677,519.13	-8,214,722.26	-39,892,241.39
其中：基金申购款	13,384,169.30	4,014,679.01	17,398,848.31
基金赎回款	-45,061,688.43	-12,229,401.27	-57,291,089.70
本期已分配利润	-	-	-
本期末	135,714,718.75	49,773,053.73	185,487,772.48

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	64,409.16
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	11,151.35
其他	2,194.38
合计	77,754.89

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-31,054,561.65
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	-31,054,561.65

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	1,136,795,378.60
减：卖出股票成本总额	1,165,012,969.92
减：交易费用	2,836,970.33
买卖股票差价收入	-31,054,561.65

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内无股票出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	229,436.31
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-6,079,930.05
债券投资收益——赎回差价收入	-

债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-5,850,493.74

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	124,543,068.09
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	130,303,261.77
减：应计利息总额	307,688.58
减：交易费用	12,047.79
买卖债券差价收入	-6,079,930.05

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券赎回差价收入。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券申购差价收入。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期末未持有贵金属。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属赎回差价收入。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属申购差价收入。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无其他衍生工具投资收益。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,153,415.96
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	1,153,415.96

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	132,188,211.93
股票投资	122,608,446.56
债券投资	9,579,765.37
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	-
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	132,188,211.93

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	251,900.59
基金转换费收入	58.15
合计	251,958.74

6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	32,232.48
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
划款手续费	10,882.77
合计	102,622.62

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中金基金	基金管理人、基金销售机构
中国银行	基金托管人、基金销售机构
中国中金财富证券有限公司（以下简称“中金财富证券”）	基金管理人股东的一级全资子公司、基金销售机构

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金在本年度及上年度可比期间均没有应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,051,981.32	8,085,369.71
其中：支付销售机构的客户维护费	1,082,457.57	2,405,996.98

注：支付基金管理人中金基金的基金管理费按前一日基金资产净值 1.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×1.20% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	508,663.55	1,617,073.88

注：支付基金托管人中国银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.20% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期及上年度可比期间无销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在本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。

6.4.10.4 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

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金在本期及上期间均未与关联方进行转融通证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金在本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行转融通证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 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

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30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	35,214,641.17	64,409.16	32,536,410.78	286,176.24

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2023年1月1日至2023年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
中金公司	688173	希荻微	网下	4,236	142,202.52
中金公司	688225	亚信安全	网下	5,534	168,842.34
中金公司	688282	理工导航	网下	3,185	207,693.85
中金公司	301216	万凯新材	网下	11,195	399,437.60
中金公司	688295	中复神鹰	网下	13,998	410,561.34
中金公司	688125	安达智能	网下	3,774	228,515.70
中金公司	600938	中国海油	网上	5,000	54,000.00
中金公司	301150	中一科技	网下	2,684	438,995.04
中金公司	688320	禾川科技	网下	6,048	143,095.68
中金公司	603206	嘉环科技	网下	1,210	17,581.30
中金公司	688400	凌云光	网下	13,111	287,524.23

注：本基金本报告期在承销期内未参与认购关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001286	陕西能源	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于混合型基金，其预期的风险和收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。本基金投资风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险等。对于上述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对相应风险进行控制，从而控制风险，实现本基金的投资目标。

本基金的基金管理人风险管理的目标为在有效控制风险的前提下，实现基金份额持有人利益最大化；建立并完善风险控制体系，实现从公司决策、执行到监督的有效运作，从而将各种风险控制合理水平，保障业务稳健运行。

本基金管理人建立科学严密的风险管理体系和职责清晰的五道内部控制防线，采用“自上而下”和“自下而上”相结合的方式进行风险管理。“自上而下”是指通过董事会、风控与合规委员会、公司下设的风险管理委员会和风险管理部、各业务部门以及每个业务环节和岗位自上而下形成的风险管理和监督体系。“自下而上”是指每个业务环节和岗位，各业务部门以及风险管理部对相关风险进行监控并逐级上报从而形成的风险控制和反馈体系。通过这种上下结合的风险控制体系，实现风险控制的有效性和全面性。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中发生交收违约，或者基金所投资的债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金持有一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。除通过上述投资限定控制相应信用风险外，本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的债券投资。（上年度末：同）

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。（上年度末：同）

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。（上年度末：同）

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	81,764,404.92	26,051,840.18
未评级	-	-
合计	81,764,404.92	26,051,840.18

注：以上按长期信用评级列示的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。（上年度末：同）

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。（上年度末：同）

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。基金管理人制定了《中金基金管理有限公司流动性风险管理办法》，对基金组合的流动性管理的组织架构和职责分工、流动性风险的流程管理、流动性压力测试、流动性风险预警、指标超标及危机的处理、流动性风险管理工具、各类资产的流动性风险管理指标与措施等方面进行了规定，并遵守《中金基金管理有限公司投资风险控制指标管理办法》中对风险控制的相关规定，对本基金组合的各项流动性指标进行监控。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的流动性风险主要来自两个方面：一是基金份额持有人在本基金封闭运作期届满转型后，可随时要求赎回其持有的基金份额，二是基金投资品种所处的交易市场不活跃而造成变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。首先，本基金封闭运作期届满转型后，保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，以备支付基金份额持有人的赎回款项，可以满足短期少量赎回的流动性需要；其次，基于分散投资的原则，本基金持有一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%，在个券方面无高集中度的特征；第三，本基金的投资市场主要为证券交易所、全国银行间债券市场等流动性较好的规范型交易场所，主要投资对象为具有良好流动性的金融工具，且本基金封闭运作期届满转型后，主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过该基金资产净值的 15%，正常市场环境下，大部分资产可以较快变现应对赎回。因此在正常市场环境下本基金的流动性风险适中。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指证券市场中各种证券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，导致基金收益的不确定性。包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指由于市场利率变动导致金融工具的公允价值或现金流量发生波动，由此带来基金收益的不确定性。利率敏感性金融工具面临因市场利率上升而导致公允价值下降的风险。市场利率的变化还将带来票息的再投资风险，对基金的收益造成影响。本基金管理人在利率风险管理方面，定期监控本基金面临的利率风险敞口，并通过调整基金投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	35,210,674.27	-	-	3,966.90	35,214,641.17
结算备付金	985,211.49	-	-	443.30	985,654.79
存出保证金	194,512.65	-	-	87.50	194,600.15
交易性金融资产	-	64,697,389.30	16,780,529.58	366,398,108.88	447,876,027.76
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	7,120,810.34	7,120,810.34
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	75,241.92	75,241.92
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	36,390,398.41	64,697,389.30	16,780,529.58	373,598,658.84	491,466,976.13
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	1,272,058.10	1,272,058.10
应付赎回款	-	-	-	338,109.11	338,109.11
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	505,682.60	505,682.60
应付托管费	-	-	-	84,280.44	84,280.44
应交税费	-	-	-	1,485.13	1,485.13
其他负债	-	-	-	608,406.36	608,406.36
负债总计	-	-	-	2,810,021.74	2,810,021.74
利率敏感度缺口	36,390,398.41	64,697,389.30	16,780,529.58	370,788,637.10	488,656,954.39
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	42,313,022.75	-	-	4,121.30	42,317,144.05
结算备付金	873,338.70	-	-	432.41	873,771.11
存出保证金	820,624.26	-	-	406.23	821,030.49
交易性金融资产	-	15,500,940.00	10,530,697.10	446,009,187.36	472,040,824.46
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	15,638,238.63	15,638,238.63
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	61,214.54	61,214.54
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	44,006,985.71	15,500,940.00	10,530,697.10	461,713,600.47	531,752,223.28
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	21,254,449.29	21,254,449.29
应付销售服务费	-	-	-	-	-

应付管理人报酬	-	-	-	551,781.90	551,781.90
应付托管费	-	-	-	91,963.65	91,963.65
应交税费	-	-	-	626.65	626.65
其他负债	-	-	-	842,810.86	842,810.86
负债总计	-	-	-	22,741,632.35	22,741,632.35
利率敏感度缺口	44,006,985.71	15,500,940.00	10,530,697.10	438,971,968.12	509,010,590.93

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本期末本基金未持有交易性债券投资（不含可转换债券、可交换债券）和资产支持证券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。（上年度末：同）

6.4.13.4.2 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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金面临的其他价格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除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金部分投资于证券交易所上市的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022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	366,111,622.84	74.92	445,988,984.28	87.62
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	366,111,622.84	74.92	445,988,984.28	87.62
----	----------------	-------	----------------	-------

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	32,154,555.00	32,157,509.90
业绩比较基准下降5%	-32,154,555.00	-32,157,509.90	

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

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到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 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 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	447,840,580.29	471,995,339.06
第二层次	-	-
第三层次	35,447.47	45,485.40
合计	447,876,027.76	472,040,824.46

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金是在发生转换当年的报告期末确认各层次之间的转换。

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌

停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况时,本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关证券公允价值的层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末无非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括应收款项、卖出回购金融资产款和其他金融负债,其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	366,111,622.84	74.49
	其中:股票	366,111,622.84	74.49
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	81,764,404.92	16.64
	其中:债券	81,764,404.92	16.64
	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	36,200,295.96	7.37
8	其他各项资产	7,390,652.41	1.50
9	合计	491,466,976.13	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位:人民币元

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	96,118,896.40	19.67

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	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	231,636,021.79	47.40
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	13,012,548.00	2.66
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	25,308,709.18	5.18
S	综合	-	-
	合计	366,111,622.84	74.92

7.2.2 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。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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	002605	姚记科技	926,500	43,017,395.00	8.80
2	603019	中科曙光	709,216	36,099,094.40	7.39
3	002517	恺英网络	1,885,500	29,677,770.00	6.07
4	300394	天孚通信	270,400	28,886,832.00	5.91
5	002230	科大讯飞	405,735	27,573,750.60	5.64
6	688111	金山办公	56,917	26,877,345.74	5.50
7	002555	三七互娱	745,100	25,989,088.00	5.32
8	600602	云赛智联	1,432,108	21,567,546.48	4.41
9	601801	皖新传媒	2,157,100	20,255,169.00	4.15
10	300494	盛天网络	754,743	18,710,078.97	3.83
11	300308	中际旭创	114,600	16,897,770.00	3.46
12	002174	游族网络	780,200	13,107,360.00	2.68
13	300280	紫天科技	272,400	13,012,548.00	2.66
14	002558	巨人网络	610,900	10,953,437.00	2.24
15	002472	双环传动	266,700	9,681,210.00	1.98
16	002602	世纪华通	1,205,400	9,148,986.00	1.87
17	300182	捷成股份	800,878	5,053,540.18	1.03

18	300148	天舟文化	908,200	5,013,264.00	1.03
19	300502	新易盛	67,000	4,553,990.00	0.93
20	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.01

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300474	景嘉微	39,103,772.66	7.68
2	300418	昆仑万维	27,194,653.86	5.34
3	600536	中国软件	25,737,434.41	5.06
4	688111	金山办公	25,139,667.70	4.94
5	000977	浪潮信息	24,660,444.61	4.84
6	300148	天舟文化	24,595,817.00	4.83
7	002605	姚记科技	24,499,657.00	4.81
8	002555	三七互娱	24,223,787.00	4.76
9	300413	芒果超媒	23,651,917.45	4.65
10	603019	中科曙光	23,129,899.20	4.54
11	601801	皖新传媒	22,999,056.00	4.52
12	002624	完美世界	21,950,310.50	4.31
13	002517	恺英网络	19,638,038.00	3.86
14	002230	科大讯飞	19,389,711.80	3.81
15	600941	中国移动	19,212,282.68	3.77
16	600602	云赛智联	19,185,109.43	3.77
17	300559	佳发教育	18,997,791.00	3.73
18	002236	大华股份	18,918,661.20	3.72
19	300033	同花顺	18,606,682.17	3.66
20	688600	皖仪科技	17,008,883.02	3.34
21	688036	传音控股	16,965,291.13	3.33
22	002153	石基信息	14,934,375.56	2.93
23	002174	游族网络	14,907,991.00	2.93
24	603516	淳中科技	14,868,817.45	2.92
25	002368	太极股份	14,571,335.95	2.86
26	300058	蓝色光标	14,338,080.00	2.82
27	601360	三六零	13,614,693.74	2.67
28	300494	盛天网络	13,386,550.00	2.63
29	002558	巨人网络	13,230,164.98	2.60
30	300280	紫天科技	12,847,113.00	2.52
31	002955	鸿合科技	12,777,935.00	2.51
32	300766	每日互动	12,404,458.00	2.44
33	300394	天孚通信	12,178,504.60	2.39
34	600418	江淮汽车	11,839,050.02	2.33
35	002712	思美传媒	11,768,625.00	2.31

36	001270	铖昌科技	11,582,459.00	2.28
37	300308	中际旭创	11,341,432.00	2.23
38	000100	TCL 科技	11,273,925.00	2.21
39	300896	爱美客	10,630,659.00	2.09
40	000066	中国长城	10,454,713.00	2.05

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300274	阳光电源	40,307,668.57	7.92
2	300418	昆仑万维	35,342,471.43	6.94
3	300474	景嘉微	34,682,630.74	6.81
4	688390	固德威	32,850,967.66	6.45
5	601689	拓普集团	31,895,541.33	6.27
6	603596	伯特利	29,530,572.14	5.80
7	002920	德赛西威	28,950,908.23	5.69
8	002487	大金重工	26,806,508.34	5.27
9	605117	德业股份	24,912,182.78	4.89
10	000977	浪潮信息	23,489,186.85	4.61
11	600536	中国软件	23,459,454.50	4.61
12	300413	芒果超媒	22,966,992.00	4.51
13	688248	南网科技	21,829,349.67	4.29
14	002236	大华股份	21,803,107.00	4.28
15	002624	完美世界	21,212,648.00	4.17
16	300058	蓝色光标	21,202,483.00	4.17
17	603606	东方电缆	20,811,634.42	4.09
18	300068	南都电源	20,649,758.51	4.06
19	002335	科华数据	19,308,899.80	3.79
20	300559	佳发教育	19,239,071.00	3.78
21	600941	中国移动	19,150,368.61	3.76
22	002837	英维克	18,326,422.72	3.60
23	603197	保隆科技	17,567,061.10	3.45
24	000887	中鼎股份	16,980,446.30	3.34
25	002594	比亚迪	16,973,581.00	3.33
26	300681	英搏尔	16,921,936.20	3.32
27	300014	亿纬锂能	16,643,705.00	3.27
28	600522	中天科技	16,467,255.32	3.24
29	300148	天舟文化	16,385,998.00	3.22
30	601360	三六零	15,978,097.62	3.14
31	300033	同花顺	15,896,032.32	3.12
32	688036	传音控股	15,409,502.33	3.03
33	603516	淳中科技	14,496,551.64	2.85
34	688600	皖仪科技	14,461,230.62	2.84

35	002368	太极股份	14,402,670.00	2.83
36	002955	鸿合科技	12,502,216.20	2.46
37	300438	鹏辉能源	11,872,385.17	2.33
38	300364	中文在线	11,760,480.00	2.31
39	002153	石基信息	11,687,495.76	2.30
40	002712	思美传媒	11,366,615.00	2.23
41	600418	江淮汽车	10,954,036.92	2.15
42	300766	每日互动	10,871,130.00	2.14
43	000100	TCL 科技	10,782,669.00	2.12
44	001270	铖昌科技	10,613,197.71	2.09
45	300271	华宇软件	10,481,076.00	2.06
46	688579	山大地纬	10,464,426.48	2.06
47	300896	爱美客	10,266,901.00	2.02

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	962,527,161.92
卖出股票收入（成交）总额	1,136,795,378.60

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	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）	81,764,404.92	16.73
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	81,764,404.92	16.73

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	128074	游族转债	125,930	17,932,915.02	3.67
2	123025	精测转债	78,550	17,697,476.40	3.62
3	113616	韦尔转债	146,410	17,042,605.35	3.49
4	123059	银信转债	79,170	9,908,862.97	2.03

5	118015	芯海转债	77,400	8,791,282.85	1.80
---	--------	------	--------	--------------	------

7.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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。

7.10 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	194,600.15
2	应收清算款	7,120,810.34
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	75,241.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,390,652.41

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	128074	游族转债	17,932,915.02	3.67
2	123025	精测转债	17,697,476.40	3.62
3	113616	韦尔转债	17,042,605.35	3.49
4	123059	银信转债	9,908,862.97	2.03
5	118015	芯海转债	8,791,282.85	1.80
6	123157	科蓝转债	8,025,589.51	1.64
7	123101	拓斯转债	2,365,672.82	0.48

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限股票。

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
9,958	30,444.79	19,825,001.59	6.54	283,344,180.32	93.46

8.2 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	张勤	10,702,252.00	18.34
2	唐辉	2,348,189.00	4.02
3	张群英	1,666,000.00	2.85
4	施霄音	1,395,945.00	2.39
5	肖祖初	1,313,252.00	2.25
6	赵伟华	1,306,300.00	2.24
7	董彦芳	1,070,000.00	1.83
8	卢国飞	1,000,100.00	1.71
9	上海易则投资管理有 限公司—易则源识一 号私募证券投资基金	985,300.00	1.69
10	吴松源	860,057.00	1.47

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	5,640.78	0.0019

8.4 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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019年7月11日）基金份额总额	991,298,498.25
本报告期期初基金份额总额	376,732,769.59
本报告期基金总申购份额	31,891,913.86
减：本报告期基金总赎回份额	105,455,501.54
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	303,169,181.91

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额；基金总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 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

(1) 基金管理人的重大人事变动情况

2023年1月20日，本基金管理人发布公告，赵璧先生自2023年1月18日起担任公司总经理、董事，同日起不再担任公司副总经理；孙菁女士自2023年1月18日起不再担任公司总经理、董事。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙），该审计机构自基金合同生效日起向本基金提供审计服务，无改聘情况。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人及其高级管理人员在本报告期内未受到稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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 (%)	
中信建投	2	549,578,346.49	26.18	401,895.50	26.18	-
东吴证券	2	508,273,791.00	24.22	371,699.70	24.22	-
信达证券	2	293,881,358.10	14.00	214,912.76	14.00	-
恒泰证券	1	292,074,304.43	13.92	213,592.80	13.92	-
民生证券	2	199,222,769.01	9.49	145,685.82	9.49	-
国泰君安	1	147,689,796.76	7.04	108,006.11	7.04	-
国金证券	2	108,240,571.53	5.16	79,154.62	5.16	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
中金财富证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中银证券	2	-	-	-	-	-

注：1、本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单元的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面的向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息；能根据基金所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金交易单元的选择程序如下：

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
- (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

10.7.2 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	
	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(%)
中信建投	131,025,081.31	43.64	-	-	-	-
东吴证券	71,980,849.80	23.98	-	-	-	-
信达证券	14,369,682.45	4.79	-	-	-	-
恒泰证券	37,953,684.57	12.64	-	-	-	-
民生证券	12,574,668.72	4.19	-	-	-	-
国泰君安	21,980,056.99	7.32	-	-	-	-
国金证券	10,330,485.20	3.44	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-

东方财富证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中银证券	-	-	-	-	-	-

10.8 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	中金基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定媒介	2023-01-20
2	中金基金管理有限公司旗下基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2023-01-20
3	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	中国证监会规定媒介	2023-01-20
4	中金基金管理有限公司关于不法分子假冒“中金基金”名义、虚构“中金基金静态战略投资项目”进行诈骗活动的风险提示	中国证监会规定媒介	2023-03-09
5	中金基金管理有限公司旗下基金 2022 年年度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2023-03-31
6	中金科创主题灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 2022 年年度报告	中国证监会规定媒介	2023-03-31
7	中金基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2023-04-21
8	中金科创主题灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 2023 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2023-04-21

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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。

11.2 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。

§ 12 备查文件目录

12.1 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

12.2 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。

12.3 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 8 月 31 日