

中金科创主题灵活配置混合型证券投资基金（LOF）
2026 年中期报告

2026 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：2026 年 8 月 28 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 2026 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	10
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	11
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	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、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	13
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	34
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	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	35
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	37
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	38
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	38
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	38

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	38
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	38
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	38
7.12 投资组合报告附注	38
§ 8 基金份额持有人信息	40
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	40
8.2 盈利投资者数量占比	40
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	40
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	40
§ 9 开放式基金份额变动	40
§ 10 重大事件揭示	40
10.1 基金份额持有人大会决议	40
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	40
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	41
10.4 基金投资策略的改变	41
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	41
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	41
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	41
10.8 其他重大事件	43
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	44
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	44
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	44
§ 12 备查文件目录	44
12.1 备查文件目录	44
12.2 存放地点	44
12.3 查阅方式	44

§ 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	102,048,897.46 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。

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	许俊
	联系电话	010-63211122	010-66596688
	电子邮箱	xxpl@ciccfund.com	fxjd_hq@bank-of-china.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	李金泽	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》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.ciccfund.com/
基金中期报告置备地点	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(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	42,255,456.61
本期利润	74,635,766.56
加权平均基金份额本期利润	0.6217
本期加权平均净值利润率	38.15%
本期基金份额净值增长率	44.93%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	85,307,014.07
期末可供分配基金份额利润	0.8359
期末基金资产净值	219,991,230.33
期末基金份额净值	2.1557
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	115.57%

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、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。

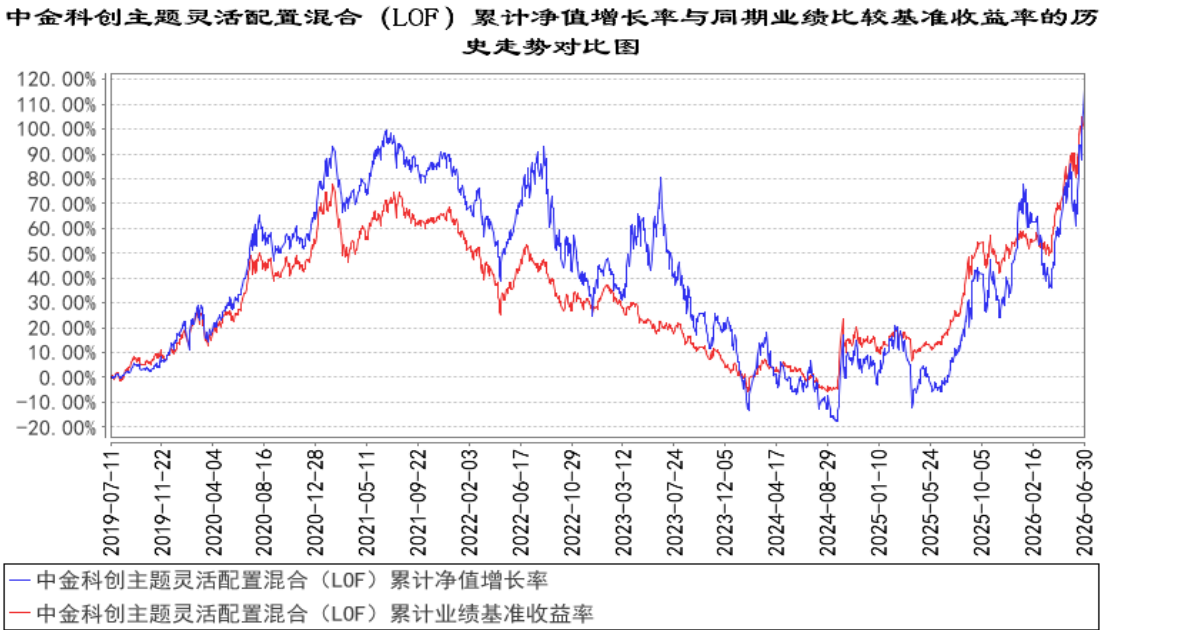
3.2 基金净值表现

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	58.36%	2.54%	37.97%	1.57%	20.39%	0.97%
过去六个月	44.93%	2.54%	34.63%	1.37%	10.30%	1.17%

过去一年	117.42%	2.42%	74.71%	1.33%	42.71%	1.09%
过去三年	33.74%	2.34%	70.14%	1.20%	-36.40%	1.14%
过去五年	8.21%	2.17%	20.02%	1.11%	-11.81%	1.06%
自基金合同生效起至今	115.57%	1.95%	105.75%	1.11%	9.82%	0.84%

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



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 10 亿元人民币。母公司中金公司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 2026 年 6 月 30 日，公司共管理 79 只公募基金，证券投资基金管理规模 2,772.40 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	-	15 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。
姜盼宇	本基金基金经理	2025 年 9 月 13 日	2026 年 05 月 22 日	9 年	姜盼宇女士，金融硕士。历任大家资产管理有限责任公司权益研究部研究员；中金基金管理有限公司权益部研究员、基金经理助理、基金经理。

注：1、上述任职日期、离任日期根据本基金管理人作出决定确定的任免日期填写；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、本基金无基金经理助理。
- 3、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

2026 年一季度 A 股走势先扬后抑，整体呈现剧烈震荡格局，政策调控、海外流动性与地缘冲突成为核心影响因素，行业轮动节奏明显加快。

1 月上旬，全球降息预期与复苏交易带动 A 股风险偏好回升，春季躁动行情全面启动，场外资集中入场，沪指一度冲击 4200 点，全 A 市场创下 3.99 万亿单日天量成交额，商业航天、AI 应用、脑机接口等题材板块领涨市场。1 月中旬，监管层发声防范市场过热，通过上调融资保证金比例等方式主动控温，A 股行情随之放缓，而海外多国及地区股指仍续创新高，市场主线转向 AI 通胀与资源品涨价，光通信、PCB、AIDC 等 AI 产业链相关品种因需求旺盛迎来涨价行情。

3 月美伊冲突突发，霍尔木兹海峡断运风险推升布伦特原油价格突破 100 美元，全球滞胀担忧急剧升温，风险资产普遍大幅调整。美联储 3 月 FOMC 会议鹰派表态，令 2026 年降息预期大幅回落，全球流动性预期收紧，同时高油价推升中下游成本，市场交易逻辑从复苏转向滞胀。

二季度 A 股市场呈现显著分化的结构性行情，科技板块尤其是人工智能产业链成为全市场主线，而传统金融、消费等板块则表现不佳，市场风格分化程度突出。从指数层面来看，二季度市场整体呈现震荡向上态势，但内部结构失衡，科技板块表现突出，对资金产生一定虹吸效应。投资者的风险偏好发生转变，对踏空本轮人工智能产业趋势的担忧升温。这种情绪驱动下，科技主线的赚钱效应呈现高度集中特征。电子行业总市值超越银行业，跃居行业排名第一，这一变化深刻反映了资本市场对科技成长方向的青睐。

AI 产业链内部呈现明显的轮动特征。前期涨幅较大的算力硬件板块，包括光模块、服务器等，在二季度随着资金高位兑现有所回撤，资金随后切换至存储芯片、MLCC、功率半导体、面板等相对低位的细分领域，显示出科技主线内部的扩散与轮动逻辑。这种轮动也体现了 AI 产业从基础设施向应用端、从硬件向材料延伸的发展趋势。半导体材料板块的良好表现，正是这一逻辑的体现。

外部扰动因素在二季度末有所升温。美国 5 月 PCE 物价指数创 2023 年 4 月以来新高，部分投资者开始押注 9 月加息，紧缩预期交易升温，海外市场波动对 A 股风险偏好形成一定扰动。中美关税动态方面，二季度前期存在明显的抢出口因素，后续出口数据面临验证压力，这一不确定性对出口导向型企业的业绩预期形成压制。

本基金始终坚持围绕产业趋势挖掘战略新兴行业的投资机会，去年四季度增配半导体设备，同时较早布局商业航天从 0 到 1 的行业渗透率拐点机会，1 月春季躁动行情启动时，组合对成长

方向聚焦收敛，减仓机器人及算力硬件相关标的，重点布局半导体与商业航天赛道，精选火箭、卫星、地面终端、太空光伏细分领域核心标的，积极把握行情机遇。2 月增配燃机、变压器相关方向，紧抓产业链景气度提升机会。3 月美伊冲突爆发后，市场底层假设产生变化，能源安全及风险偏好快速变化，关注受益于油价中枢抬升的新能源方向，优化组合防御性，应对市场波动风险。二季度初重点加仓 AI 硬件相关的 PCB、MLCC、半导体设备方向布局，减仓商业航天、太空光伏等。

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 2.1557 元；本报告期基金份额净值增长率为 44.93%，业绩比较基准收益率为 34.63%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

市场短时间内快速消化前一阶段在涨幅、结构方面积累的调整需求，逐步进入换筹、再均衡的后半段。前期市场面临的主要矛盾为估值偏高以及风险跨资产传导问题，受海外市场剧烈波动影响，国内前期超额收益明显的科技海外链、涨价链跟随调整，筹码快速出清，杠杆显著下降，引发市场再平衡调整，红利、双低等策略超额明显。至本报告期末，海外市场风险阶段性释放，国内市场前期强势板块已回吐部分涨幅，市场在行业离散度、风格因子超额、集中度等各横切面也趋于均衡，市场前期上涨过程中积累的调整需求得到初步缓和。但在宏观面和产业面缺乏新驱动因素背景下，叠加市场调整速度偏快，使得国内投资者持有的市场筹码并未实现充分换手，即使结构性矛盾有所缓解，也尚不足以支撑市场马上走出震荡格局，反而在波动率逐步走低过程中，存量资金在不同板块之间轮动，使得市场投资机会更加难以把握。这种博弈与轮动的格局持续演绎，并在此过程中形成新的筹码压力，可能进一步制约市场表现。直至总量经济或产业端出现新的变局，投资策略端也将随之打破原有的循环。

配置上，现阶段本基金仍将重点围绕战略新兴行业的产业趋势和基本面进行投资：1）科技创新：AI 技术领域经历 3 年高速发展，2026 年有望逐步进入产业应用兑现阶段，半导体设备、存力、电力等云计算基础设施领域仍有机会，只不过会更聚焦专注 alpha；应用端关注机器人、消费电子、智能驾驶、商业航天和软件应用等；2）外需突围：出海仍然是当前较为确定性的增长机会，结合出海趋势和对美敞口，关注电网设备、光伏设备和游戏，以及有色金属等全球定价资源品。

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》、《资产管理产品相关会计处理规定》、《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 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”部分未在本托管人复核范围内）、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：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6. 4. 7. 1	12, 506, 712. 84	11, 692, 001. 42
结算备付金		305, 036. 95	966, 884. 59
存出保证金		132, 341. 03	88, 263. 95
交易性金融资产	6. 4. 7. 2	208, 076, 503. 05	190, 113, 777. 64
其中：股票投资		75, 730, 604. 30	152, 581, 912. 30
基金投资		-	-
债券投资		132, 345, 898. 75	37, 531, 865. 34
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		2, 350, 638. 79	1, 965, 543. 16
应收股利		-	-
应收申购款		174, 548. 40	13, 343. 02
递延所得税资产		-	-
其他资产	6. 4. 7. 8	-	-
资产总计		223, 545, 781. 06	204, 839, 813. 78
负 债 和 净 资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 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		854, 502. 60	-
应付赎回款		2, 286, 096. 96	889, 352. 02
应付管理人报酬		189, 599. 71	200, 381. 26
应付托管费		31, 599. 95	33, 396. 89
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		691. 36	389. 03

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	192,060.15	459,318.69
负债合计		3,554,550.73	1,582,837.89
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	102,048,897.46	136,656,575.37
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	117,942,332.87	66,600,400.52
净资产合计		219,991,230.33	203,256,975.89
负债和净资产总计		223,545,781.06	204,839,813.78

注： 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 2.1557 元，基金份额总额 102,048,897.46 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：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		76,079,470.62	-2,171,999.79
1. 利息收入		23,979.45	26,609.49
其中：存款利息收入	6.4.7.13	23,979.45	26,609.49
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）		43,533,482.74	3,493,397.91
其中：股票投资收益	6.4.7.14	48,140,832.39	3,526,824.86
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-4,802,332.17	-350,877.93
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	194,982.52	317,450.98
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	32,380,309.95	-5,726,529.28
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	141,698.48	34,522.09
减：二、营业总支出		1,443,704.06	1,598,857.61
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,165,873.97	1,293,790.43
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	194,312.29	215,631.68
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
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	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		565.40	494.22
8. 其他费用	6.4.7.23	82,952.40	88,941.28
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		74,635,766.56	-3,770,857.40
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		74,635,766.56	-3,770,857.40
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		74,635,766.56	-3,770,857.40

6.3 净资产变动表

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：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	136,656,575.37	-	66,600,400.52	203,256,975.89
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

二、本期期初净资产	136,656,575.37	-	66,600,400.52	203,256,975.89
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-34,607,677.91	-	51,341,932.35	16,734,254.44
（一）、综合收益总额	-	-	74,635,766.56	74,635,766.56
（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）	-34,607,677.91	-	-23,293,834.21	-57,901,512.12
其中：1. 基金申购款	11,644,860.40	-	7,926,066.38	19,570,926.78
2. 基金赎回款	-46,252,538.31	-	-31,219,900.59	-77,472,438.90
（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）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	102,048,897.46	-	117,942,332.87	219,991,230.33
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	224,288,662.33	-	4,229,429.69	228,518,092.02
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	224,288,662.33	-	4,229,429.69	228,518,092.02
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-25,754,742.02	-	-5,911,942.42	-31,666,684.44
（一）、综合收益总额	-	-	-3,770,857.40	-3,770,857.40

（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）	-25,754,742.02	-	-2,141,085.02	-27,895,827.04
其中：1. 基金申购款	8,111,419.82	-	315,887.58	8,427,307.40
2. 基金赎回款	-33,866,161.84	-	-2,456,972.60	-36,323,134.44
（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）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	198,533,920.31	-	-1,682,512.73	196,851,407.58

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：

宗喆

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 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)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》(以下简称“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《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、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。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

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》(以下合称“企业会计准则”)的要求，同时亦按照中国证券投资基金业协会(以下简称“基金业协会”)颁布的《公开募集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》、《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的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及 2026 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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

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《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《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》、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《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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》、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》、财税[2023] 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延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》、财税[2025] 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》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) 本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税。

本基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入，自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，免征增值税；对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。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，对该日期之前已发行的国债、地

方政府债券、金融债券（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。本基金管理人运营本基金提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(b) 对本基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(c) 对本基金从上市公司、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，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。对本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%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

对本基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向本基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

(d) 本基金卖出股票按 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。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(e) 对本基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照本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附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	12,506,712.84
等于：本金	12,505,498.64
加：应计利息	1,214.20
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	12,506,712.84

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		43,227,021.45	-	75,730,604.30	32,503,582.85
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	95,394,973.39	182,974.95	132,345,898.75	36,767,950.41
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	95,394,973.39	182,974.95	132,345,898.75	36,767,950.41
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		138,621,994.84	182,974.95	208,076,503.05	69,271,533.26

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。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

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 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	140.64
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	116,045.99
其中：交易所市场	116,045.99
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	75,873.52
合计	192,060.15

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	136,656,575.37	136,656,575.37
本期申购	11,644,860.40	11,644,860.40
本期赎回（以“-”号填列）	-46,252,538.31	-46,252,538.31
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	102,048,897.46	102,048,897.46

6.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期无其他综合收益。

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	69,108,341.24	-2,507,940.72	66,600,400.52
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	69,108,341.24	-2,507,940.72	66,600,400.52
本期利润	42,255,456.61	32,380,309.95	74,635,766.56
本期基金份额交易产生的变动数	-26,056,783.78	2,762,949.57	-23,293,834.21
其中：基金申购款	9,172,686.42	-1,246,620.04	7,926,066.38
基金赎回款	-35,229,470.20	4,009,569.61	-31,219,900.59
本期已分配利润	-	-	-
本期末	85,307,014.07	32,635,318.80	117,942,332.87

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	22,273.46
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	1,473.21
其他	232.78
合计	23,979.45

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
----	----

	2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	48,140,832.39
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	48,140,832.39

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 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出股票成交总额	457,196,254.76
减：卖出股票成本总额	408,426,739.42
减：交易费用	628,682.95
买卖股票差价收入	48,140,832.39

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 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	157,038.85
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-4,959,371.02
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	-4,802,332.17

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 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	284,236,569.45
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	288,500,368.20
减：应计利息总额	670,428.76
减：交易费用	25,143.51
买卖债券差价收入	-4,959,371.02

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期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

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

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

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	194,982.52
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	194,982.52

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	32,380,309.95
股票投资	-1,346,286.40
债券投资	33,726,596.35
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	32,380,309.95

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	141,482.96
基金转换费收入	215.52
合计	141,698.48

6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	16,366.15
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
划款手续费	7,078.88
合计	82,952.40

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、关联关系

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

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

注：本基金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

本基金本报告期及上年度可比期间无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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,165,873.97	1,293,790.43
其中：应支付销售机构的客户维护费	505,909.14	495,563.40
应支付基金管理人的净管理费	659,964.83	798,227.03

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	上年度可比期间
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	194,312.29	215,631.68

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		上年度可比期间	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		2025 年 1 月 1 日至 2025 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	12,506,712.84	22,273.46	12,497,680.67	25,041.15

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

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金本报告期无其他关联交易事项。

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（2026 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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688260	昀冢科技	2026 年 6 月 26 日	重大事项停牌	145.02	2026 年 7 月 1 日	132.00	103,265	8,066,988.28	14,975,490.30	-

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

截至本报告期末 2026 年 06 月 30 日，本基金无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 06 月 30 日，本基金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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	132,345,898.75	37,531,865.34
未评级	-	-
合计	132,345,898.75	37,531,865.34

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 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	12,505,498.64	-	-	1,214.20	12,506,712.84
结算备付金	305,007.25	-	-	29.70	305,036.95
存出保证金	132,328.13	-	-	12.90	132,341.03
交易性金融资产	10,637,599.50	73,588,690.60	47,936,633.70	75,913,579.25	208,076,503.05
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	2,350,638.79	2,350,638.79
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	174,548.40	174,548.40
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	23,580,433.52	73,588,690.60	47,936,633.70	78,440,023.24	223,545,781.06
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	854,502.60	854,502.60
应付赎回款	-	-	-	2,286,096.96	2,286,096.96
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	189,599.71	189,599.71
应付托管费	-	-	-	31,599.95	31,599.95
应交税费	-	-	-	691.36	691.36
其他负债	-	-	-	192,060.15	192,060.15
负债总计	-	-	-	3,554,550.73	3,554,550.73
利率敏感度缺口	23,580,433.52	73,588,690.60	47,936,633.70	74,885,472.51	219,991,230.33
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	11,690,585.85	-	-	1,415.57	11,692,001.42
结算备付金	966,781.19	-	-	103.40	966,884.59
存出保证金	88,254.49	-	-	9.46	88,263.95
交易性金融资产	-	24,905,856.60	12,564,628.10	152,643,292.94	190,113,777.64
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	1,965,543.16	1,965,543.16
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	13,343.02	13,343.02
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	12,745,621.53	24,905,856.60	12,564,628.10	154,623,707.55	204,839,813.78
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-

应付赎回款	-	-	-	889,352.02	889,352.02
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	200,381.26	200,381.26
应付托管费	-	-	-	33,396.89	33,396.89
应交税费	-	-	-	389.03	389.03
其他负债	-	-	-	459,318.69	459,318.69
负债总计	-	-	-	1,582,837.89	1,582,837.89
利率敏感度缺口	12,745,621.53	24,905,856.60	12,564,628.10	153,040,869.66	203,256,975.89

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025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	75,730,604.30	34.42	152,581,912.30	75.07
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	75,730,604.30	34.42	152,581,912.30	75.07

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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	16,499,342.27	17,378,471.44
	业绩比较基准下降 5%	-16,499,342.27	-17,378,471.44

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	193,101,012.75	190,113,777.64
第二层次	14,975,490.30	—
第三层次	—	—
合计	208,076,503.05	190,113,777.64

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，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	75,730,604.30	33.88
	其中：股票	75,730,604.30	33.88
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	132,345,898.75	59.20
	其中：债券	132,345,898.75	59.20
	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	12,811,749.79	5.73
8	其他各项资产	2,657,528.22	1.19
9	合计	223,545,781.06	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	75,730,604.30	34.42
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	-	-
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	-	-
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	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	75,730,604.30	34.42

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	300285	国瓷材料	156,600	16,157,988.00	7.34
2	300136	信维通信	135,020	16,101,135.00	7.32
3	688260	昀冢科技	103,265	14,975,490.30	6.81
4	688409	富创精密	34,710	10,629,937.50	4.83
5	601126	四方股份	134,400	8,494,080.00	3.86
6	688200	华峰测控	9,965	5,232,621.50	2.38
7	000636	风华高科	57,300	4,139,352.00	1.88

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	601126	四方股份	18,601,082.00	9.15
2	688387	信科移动	17,019,076.94	8.37
3	300751	迈为股份	16,066,199.83	7.90
4	002943	宇晶股份	12,675,242.00	6.24
5	688270	ST 臻镭	12,673,639.83	6.24
6	688726	拉普拉斯	10,639,784.56	5.23
7	300285	国瓷材料	10,335,250.18	5.08
8	688200	华峰测控	10,159,552.41	5.00
9	688409	富创精密	9,917,392.12	4.88
10	688260	昀冢科技	8,774,983.39	4.32
11	300476	胜宏科技	8,757,639.00	4.31
12	300762	上海瀚讯	8,382,344.30	4.12
13	300418	昆仑万维	7,859,182.00	3.87
14	688516	奥特维	7,555,778.43	3.72
15	002865	钧达股份	7,550,479.00	3.71
16	688020	方邦股份	6,909,625.77	3.40
17	300331	苏大维格	6,900,938.28	3.40
18	603119	浙江荣泰	6,113,698.00	3.01
19	688372	伟测科技	6,099,292.22	3.00
20	688041	海光信息	5,408,529.55	2.66
21	300378	鼎捷数智	5,362,979.00	2.64
22	301550	斯菱智驱	5,182,737.50	2.55
23	688120	华海清科	4,923,435.49	2.42
24	688062	迈威生物	4,716,989.07	2.32
25	688362	甬矽电子	4,536,091.13	2.23
26	300342	天银机电	4,528,867.00	2.23
27	300136	信维通信	4,455,003.00	2.19
28	300033	同花顺	4,371,062.00	2.15
29	603061	金海通	4,291,583.00	2.11
30	688012	中微公司	4,163,159.31	2.05
31	688498	源杰科技	4,072,832.06	2.00

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	688387	信科移动	27,126,631.23	13.35
2	688270	ST 臻镭	21,324,005.52	10.49
3	603119	浙江荣泰	15,893,663.90	7.82
4	300308	中际旭创	15,150,958.00	7.45
5	601126	四方股份	13,021,633.00	6.41
6	300751	迈为股份	12,874,703.76	6.33
7	688498	源杰科技	12,214,298.19	6.01
8	002384	东山精密	11,748,367.19	5.78

9	002943	宇晶股份	11,608,261.00	5.71
10	300502	新易盛	11,232,542.02	5.53
11	688726	拉普拉斯	10,374,993.44	5.10
12	688200	华峰测控	10,141,365.54	4.99
13	002050	三花智控	10,047,923.50	4.94
14	300476	胜宏科技	9,274,602.00	4.56
15	301005	超捷股份	8,939,152.68	4.40
16	600879	航天电子	8,237,973.00	4.05
17	603179	新泉股份	7,948,986.00	3.91
18	688020	方邦股份	7,806,476.25	3.84
19	300342	天银机电	7,776,361.00	3.83
20	300762	上海瀚讯	7,652,504.70	3.76
21	300418	昆仑万维	7,637,356.00	3.76
22	300331	苏大维格	7,173,995.00	3.53
23	002865	钧达股份	7,093,679.40	3.49
24	601689	拓普集团	6,891,274.00	3.39
25	688516	奥特维	6,610,477.44	3.25
26	688372	伟测科技	6,450,989.62	3.17
27	300378	鼎捷数智	6,264,024.00	3.08
28	688041	海光信息	5,502,486.20	2.71
29	688409	富创精密	5,143,876.17	2.53
30	688062	迈威生物	5,113,670.03	2.52
31	301550	斯菱智驱	5,102,875.89	2.51
32	603061	金海通	4,976,524.00	2.45
33	688120	华海清科	4,851,869.02	2.39
34	600183	生益科技	4,796,448.00	2.36
35	688012	中微公司	4,627,492.59	2.28
36	688362	甬矽电子	4,625,741.88	2.28
37	601698	中国卫通	4,592,480.00	2.26
38	300136	信维通信	4,539,409.00	2.23
39	300033	同花顺	4,377,753.00	2.15
40	002149	西部材料	4,089,918.00	2.01

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	332,921,717.82
卖出股票收入（成交）总额	457,196,254.76

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）	132,345,898.75	60.16
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	132,345,898.75	60.16

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	123255	鼎龙转债	30,640	17,107,504.02	7.78
2	123176	精测转2	30,945	16,626,061.78	7.56
3	118058	微导转债	26,630	14,528,375.16	6.60
4	118061	茂莱转债	46,620	12,300,561.83	5.59
5	118030	睿创转债	21,800	11,107,571.84	5.05

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约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同约定的备选股票库。

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	132,341.03
2	应收清算款	2,350,638.79
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	174,548.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,657,528.22

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	123255	鼎龙转债	17,107,504.02	7.78
2	123176	精测转 2	16,626,061.78	7.56
3	118058	微导转债	14,528,375.16	6.60
4	118061	茂莱转债	12,300,561.83	5.59
5	118030	睿创转债	11,107,571.84	5.05
6	128136	立讯转债	10,717,566.18	4.87
7	123241	欧通转债	10,629,457.67	4.83
8	118056	路维转债	10,450,808.79	4.75
9	113697	应流转债	8,958,042.87	4.07
10	118059	颀中转债	3,704,223.97	1.68
11	118042	奥维转债	3,108,037.55	1.41
12	123122	富瀚转债	2,929,181.19	1.33
13	123124	晶瑞转 2	1,719,046.78	0.78

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688260	昀冢科技	14,975,490.30	6.81	重大事项停牌

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 (%)
4,880	20,911.66	244,191.00	0.24	101,804,706.46	99.76

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）
盈利投资者数量占比 (%)	90.75

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	19,334.17	0.0189

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
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	136,656,575.37
本报告期基金总申购份额	11,644,860.40
减：本报告期基金总赎回份额	46,252,538.31
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	102,048,897.46

§ 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

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

(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，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

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，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金财产、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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本基金管理人在本报告期内未受到调查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本基金管理人相关从业人员在本报告期内未受到调查或处罚。

10.6.3 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。

10.6.4 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。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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(%)	
信达证券	2	381,510,974.75	48.63	170,118.70	48.63	—
华安证券	2	294,450,050.18	37.54	131,297.59	37.54	—
国投证券	2	108,492,212.65	13.83	48,377.35	13.83	—

长江证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方财富 证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国联民生	2	-	-	-	-	-
国泰海通	1	-	-	-	-	-
金融街证 券	1	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
中金财富 证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中银证券	2	-	-	-	-	-

注：1、基金交易单元的选择标准如下：

- (1) 财务状况良好，资本充足，财务指标等符合监管要求；
- (2) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (3) 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；
- (4) 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、个股分析报告及全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告；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) 本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》《证券综合服务协议》
- (注：被动股票型基金不通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用)。

10.7.2 基金租用或者通过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(%)
招商证券	1,234,567,890	15.23	567,890,123	12.45	234,567,890	8.76
中信证券	2,345,678,901	28.91	1,234,567,890	26.78	456,789,012	16.54
华泰证券	3,456,789,012	42.56	2,345,678,901	50.12	789,012,345	28.32
国泰君安	4,567,890,123	56.78	3,456,789,012	74.56	901,234,567	32.67
光大证券	5,678,901,234	70.12	4,567,890,123	98.90	1,234,567,890	44.51
广发证券	6,789,012,345	84.56	5,678,901,234	123.45	2,345,678,901	84.51
兴业证券	7,890,123,456	98.90	6,789,012,345	147.89	3,456,789,012	123.45
国信证券	8,901,234,567	110.23	7,890,123,456	170.12	4,567,890,123	163.29
海通证券	9,012,345,678	112.34	8,901,234,567	194.56	5,678,901,234	202.70
东方证券	10,123,456,789	125.67	9,012,345,678	196.78	6,789,012,345	243.54
安信证券	11,234,567,890	138.90	10,123,456,789	220.12	7,890,123,456	283.95
方正证券	12,345,678,901	152.34	11,234,567,890	244.56	8,901,234,567	324.36
长江证券	13,456,789,012	165.67	12,345,678,901	268.90	9,012,345,678	364.77
西南证券	14,567,890,123	179.01	13,456,789,012	293.23	1,012,345,678	405.18
中原证券	15,678,901,234	192.34	14,567,890,123	317.67	1,123,456,789	445.59
东方红	16,789,012,345	205.67	15,678,901,234	342.10	1,234,567,890	486.00
国联证券	17,890,123,456	219.01	16,789,012,345	366.54	1,345,678,901	526.41
浙商证券	18,901,234,567	232.34	17,890,123,456	390.98	1,456,789,012	566.82
东吴证券	19,012,345,678	245.67	18,901,234,567	415.42	1,567,890,123	607.23
信达证券	20,123,456,789	259.01	19,012,345,678	439.86	1,678,901,234	647.64
华创证券	21,234,567,890	272.34	20,123,456,789	464.30	1,789,012,345	688.05
华鑫证券	22,345,678,901	285.67	21,234,567,890	488.74	1,890,123,456	728.46
国盛证券	23,456,789,012	299.01	22,345,678,901	513.18	1,901,234,567	768.87
华安证券	24,567,890,123	312.34	23,456,789,012	537.62	2,012,345,678	809.28
恒泰证券	25,678,901,234	325.67	24,567,890,123	562.06	2,123,456,789	849.69
华林证券	26,789,012,345	339.01	25,678,901,234	586.50	2,234,567,890	890.10
国元证券	27,890,123,456	352.34	26,789,012,345	610.94	2,345,678,901	930.51
华创阳安	28,901,234,567	365.67	27,890,123,456	635.38	2,456,789,012	970.92
华创证券	29,012,345,678	379.01	28,901,234,567	659.82	2,567,890,123	1,011.33
华创证券	30,123,456,789	392.34	29,012,345,678	684.26	2,678,901,234	1,051.74
华创证券	31,234,567,890	405.67	30,123,456,789	708.70	2,789,012,345	1,092.15
华创证券	32,345,678,901	419.01	31,234,567,890	733.14	2,890,123,456	1,132.56
华创证券	33,456,789,012	432.34	32,345,678,901	757.58	2,901,234,567	1,172.97
华创证券	34,567,890,123	445.67	33,456,789,012	782.02	3,012,345,678	1,213.38
华创证券	35,678,901,234	459.01	34,567,890,123	806.46	3,123,456,789	1,253.79
华						

信达证 券	185,240,337 .12	29.46	-	-	-	-
华安证 券	270,018,564 .43	42.95	-	-	-	-
国投证 券	173,434,551 .61	27.59	-	-	-	-
长江证 券	-	-	-	-	-	-
东北证 券	-	-	-	-	-	-
东方财 富证券	-	-	-	-	-	-
东吴证 券	-	-	-	-	-	-
东兴证 券	-	-	-	-	-	-
国金证 券	-	-	-	-	-	-
国联民 生	-	-	-	-	-	-
国泰海 通	-	-	-	-	-	-
金融街 证券	-	-	-	-	-	-
民生证 券	-	-	-	-	-	-
山西证 券	-	-	-	-	-	-
中金财 富证券	-	-	-	-	-	-
中信建 投	-	-	-	-	-	-
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关于旗下部分基金投资北交所股票及相关风险提示的公告	中国证监会规定媒介	2026-02-07
2	中金基金管理有限公司关于新增基金直销账户的公告	中国证监会规定媒介	2026-04-21
3	中金科创主题灵活配置混合型证券投资	中国证监会规定媒介	2026-05-23

	资基金（LOF）基金经理变更公告		
4	中金基金管理有限公司关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告	中国证监会规定媒介	2026-06-26
5	中金基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金估值调整情况的公告	中国证监会规定媒介	2026-06-27

§ 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

2026 年 8 月 28 日