

**国联安科技创新混合型证券投资基金（LOF）**  
**(原国联安科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资**  
**基金)**

**2023年第1季度报告**

**2023年3月31日**

基金管理人：国联安基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年四月二十二日

## §1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年4月21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。

根据基金合同约定，本基金的封闭运作期将于2023年3月19日届满，本基金自2023年3月20日起进入开放期，基金名称变更为“国联安科技创新混合型证券投资基金(LOF)”。本基金更名后，基金场外简称变更为“国联安科创混合(LOF)”，场内简称仍为“科创国联”，扩位证券简称变更为“国联安科创LOF”，基金代码仍为“501096”。本基金基金合同、托管协议的修订符合相关法律法规，对基金份额持有人利益无实质性不利影响。修订的基金合同和托管协议自2023年3月20日起生效。原国联安科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金报告期自2020年3月20日至2023年3月19日止，国联安科技创新混合型证券投资基金(LOF)报告期自2023年3月20日至2023年3月31日止。

## §2 基金产品概况

### 2.1 国联安科技创新混合型证券投资基金（LOF）

基金简称	国联安科创混合（LOF）
场内简称	国联安科创
基金主代码	501096
交易代码	501096
基金运作方式	契约型开放式

基金合同生效日	2020年3月20日
报告期末基金份额总额	480,866,497.63份
投资目标	在严格控制风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的稳健回报。
投资策略	本基金投资策略的核心在于重点关注并跟踪具备较强盈利能力和可持续成长能力的科技创新主题上市公司，挖掘其中具备核心竞争优势的个股，通过积极的股票选择，采取以合理价格买入的投资方式，通过上市公司价值的回归或兑现，实现基金资产的长期稳定增值。
业绩比较基准	中国战略新兴产业成份指数收益率×50%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×10%+中债综合指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险和预期收益水平高于债券型基金及货币市场基金，低于股票型基金。
基金管理人	国联安基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

## 2.2 国联安科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金

基金简称	国联安科创3年灵活配置混合
场内简称	国联安科创
基金主代码	501096
交易代码	501096
基金运作方式	契约型
基金合同生效日	2020年3月20日
报告期末基金份额总额	556,025,745.68份
投资目标	在严格控制风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的稳健回报。
投资策略	本基金投资策略的核心在于重点关注并跟踪具备较强盈利能力和可持续成长能力的科技创新主题上市公司，挖掘其中具备核心竞争优势的个股，通过积极的股票选择，采

	取以合理价格买入的投资方式，通过上市公司价值的回归或兑现，实现基金资产的长期稳定增值。
业绩比较基准	中国战略新兴产业成份指数收益率×50%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×10%+中债综合指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险和预期收益水平高于债券型基金及货币市场基金，低于股票型基金。
基金管理人	国联安基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

注：本基金合同生效后的前三年为封闭运作期。在封闭运作期内，本基金不办理申购与赎回业务。封闭运作期内基金上市交易后，投资者可将其持有的场外基金份额通过办理跨系统转托管业务转至场内后上市交易。封闭运作期届满后，本基金转为上市开放式基金（LOF），基金名称调整为“国联安科技创新混合型证券投资基金（LOF）”，并接受场外、场内申购赎回。

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

##### 3.1.1 国联安科技创新混合型证券投资基金（LOF）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2023年3月20日-2023年3月31日)
1.本期已实现收益	-11,901,750.81
2.本期利润	7,795,915.64
3.加权平均基金份额本期利润	0.0154
4.期末基金资产净值	383,636,122.84
5.期末基金份额净值	0.7978

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，包含停牌股票按公允价值调整的影响；

2、上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，例如，开放式基金的申购赎回费

等，计入费用后实际收益要低于所列数字。

### 3.1.2 国联安科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2023年1月1日-2023年3月19日)
1.本期已实现收益	-32,293,175.80
2.本期利润	-21,019,943.99
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0378
4.期末基金资产净值	434,234,135.39
5.期末基金份额净值	0.7810

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，包含停牌股票按公允价值调整的影响；

2、上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，例如，开放式基金的申购赎回费等，计入费用后实际收益要低于所列数字。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 国联安科技创新混合型证券投资基金（LOF）

（报告期：2023年3月20日-2023年3月31日）

#### 3.2.1.1 本报告期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
自基金转型起至今(2023年3月20日至2023年3月31日)	2.15%	1.71%	2.48%	0.47%	-0.33%	1.24%

注：1、2023年3月20日起原国联安科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金转型为国联安科技创新混合型证券投资基金(LOF)，国联安科技创新混合型证券投资基金(LOF)的基金合同亦于该日同时生效；

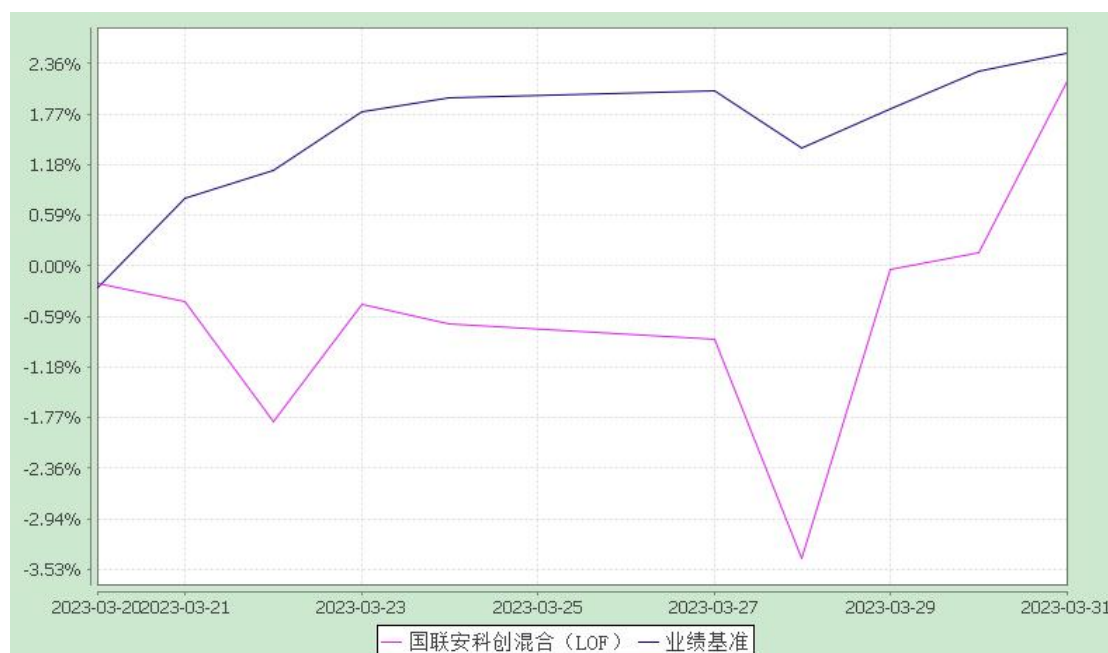
2、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 3.2.1.2 自基金转型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

国联安科技创新混合型证券投资基金（LOF）  
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2023年3月20日-2023年3月31日)

日)



注：1、本基金的业绩比较基准为:中国战略新兴产业成份指数收益率×50%+中债综合指数收益率×40%+恒生指数收益率(使用估值汇率折算)×10%;

2、本基金基金合同于2023年3月20日生效。截至本报告期末，基金合同生效未满1年；

3、本基金的投资转型期为基金合同生效日起的3个月。截止本报告期末，本基金尚在投资转型期；

4、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 3.2.2 国联安科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金

(报告期：2023年1月1日-2023年3月19日)

#### 3.2.2.1 本报告期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	净值增长	业绩比较	业绩比较	①-③	②-④

	率①	率标准差 ②	基准收益 率③	基准收益 率标准差 ④		
过去三个月 (2023年1月1日起至 2023年3月19日)	-4.62%	1.38%	-1.70%	0.63%	-2.92%	0.75%
过去六个月 (2022年10月1日起至 2023年3月19日)	-21.12%	1.70%	-1.17%	0.79%	-19.95%	0.91%
过去一年 (2022年4月1日起至 2023年3月19日)	-20.32%	1.99%	-9.64%	0.88%	-10.68%	1.11%
过去三年 (2020年4月1日起至 2023年3月19日)	-21.50%	1.67%	5.38%	0.90%	-26.88%	0.77%
自基金合同 生效(2020年3月20日) 起至本基金 转型日前一 日(2023年3 月19日)	-21.90%	1.66%	6.93%	0.91%	-28.83%	0.75%

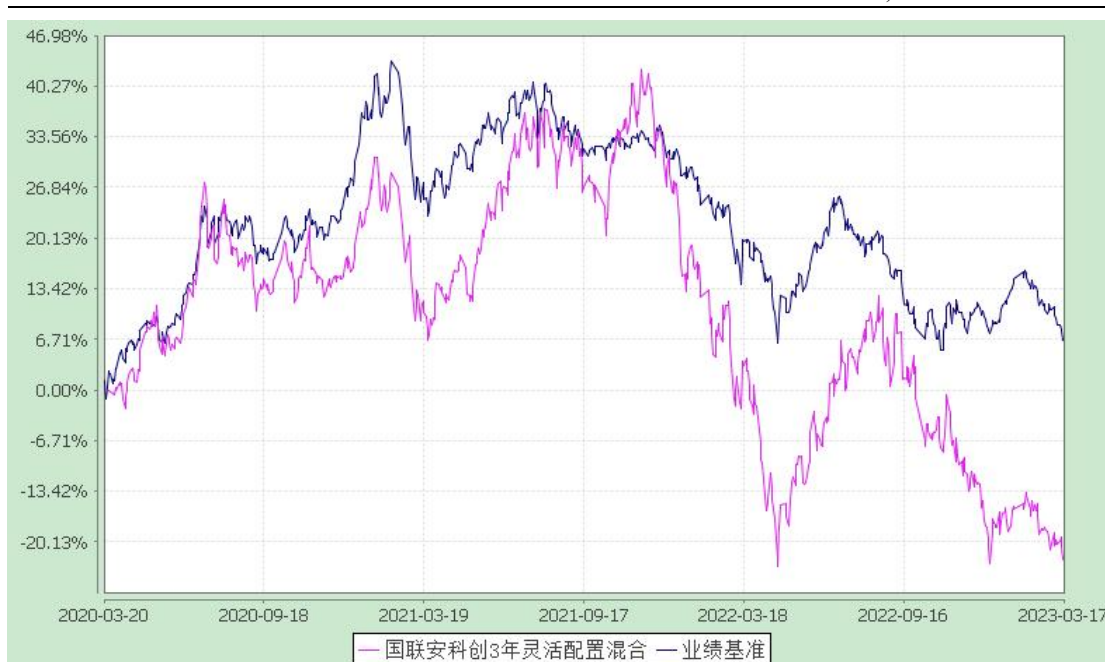
注：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 3.2.2.2 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

国联安科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2020年3月20日-2023年3月19日)



- 注：1、原国联安科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金的业绩比较基准为中国战略新兴产业成份指数收益率×50%+中债综合指数收益率×40%+恒生指数收益率(使用估值汇率折算)×10%；
- 2、原国联安科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金的基金合同于2020年3月20日生效；
- 3、原国联安科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金的建仓期为自基金合同生效之日起的6个月，建仓期结束时各项资产配置符合合同约定；
- 4、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

## §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		
潘明	本基金基金经理、兼任国联安科技动力股票型证券投资	2020-03-20	-	14年（自2009年起）	潘明先生,硕士研究生。曾任计算机科学公司咨询师,摩托罗拉公司高级行政工程师,扎克斯投资管理公司投资分析师,短剑投资公司执行董事,指导资本公司基金经理兼大宗商品研究总监,海通证券股份有限公司投



	<p>基金基金经理、国联安优选行业混合型证券投资基金基金经理、国联安匠心科技1个月滚动持有混合型证券投资基金基金经理、国联安气候变化责任投资混合型证券投资基金基金经理。</p>				<p>资经理，GCS母基金公司、GCS有限公司、GCS有限责任公司独立董事，光大证券资产管理有限公司投资经理助理、投资经理。2014年1月起加入国联安基金管理有限公司，历任基金经理助理，基金经理、权益投资部总监等职。2014年2月起担任国联安优选行业混合型证券投资基金的基金经理；2015年4月至2018年7月兼任国联安德盛红利混合型证券投资基金的基金经理；2015年4月至2017年2月兼任国联安主题驱动混合型证券投资基金的基金经理；2016年1月起兼任国联安科技动力股票型证券投资基金的基金经理；2020年3月起兼任国联安科技创新混合型证券投资基金（LOF）（2023年3月20日由国联安科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金转型而来）的基金经理；2021年5月起兼任国联安匠心科技1个月滚动持有混合型证券投资基金的基金经理；2022年9月起兼任国联安气候变化责任投资混合型证券投资基金的基金经理。</p>
--	------------------------------------------------------------------------------------------	--	--	--	---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

注：1、基金经理的任职日期和离职日期以公司对外公告为准；

2、证券从业年限的统计标准为证券行业的工作经历年限。

#### 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

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
潘明	公募基金	5.00	2,401,286,846.46	2014-02-15
	私募资产管理计划	1.00	193,421,891.84	2022-08-01

	其他组合	0.00	0.00	-
	合计	6.00	2,594,708,738.30	

#### 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》、《国联安科技创新混合型证券投资基金（LOF）基金（原国联安科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金）基金合同》及其他相关法律法规、法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人遵照相应法律法规和内部规章，制定并完善了《国联安基金管理有限公司公平交易制度》（以下简称“公平交易制度”），用以规范包括投资授权、研究分析、投资决策、交易执行以及投资管理过程中涉及的实施效果与业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

本报告期内，本基金管理人严格执行公平交易制度的规定，公平对待不同投资组合，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和投资决策等方面均享有平等机会；在交易环节严格按照时间优先，价格优先的原则执行指令；如遇指令价位相同或指令价位不同但市场条件都满足时，及时执行交易系统中的公平交易模块；采用公平交易分析系统对不同投资组合的交易价差进行定期分析；对投资流程独立稽核等。

本报告期内，公司旗下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发现有超过该证券当日成交量 5% 的情况。公平交易制度总体执行情况良好。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的无法解释的异常交易行为。

#### 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

与此前相比，2023 年一季度股票市场的结构性分化已经发生了明显的变化。科技股大涨，尤其是计算机、传媒和通信板块，中信 TMT 指数大幅跑赢沪深 300 指数。以 ChatGPT 为代表的 AI（人工智能）主题的虹吸效应对非 AI 板块产生了较大的影响，资金不断流出新能源等行业。新能源是中国具有全球竞争优势的核心制造业之一，预计其长期收益预期将有所提升，但行业的机构筹码太重导致其短期或许不太会重新受到市场青睐。

ChatGPT 可能成为基于芯片垄断和金融力量基础的新的科技霸权，而 AI 算力也将越来越

越代表战略国力。科技行业从信息时代加速进入人工智能时代，AI大概率将重塑大部分行业。重塑之后，强者恒强、弱者和新玩家弯道超车以及强者被颠覆的情况均会发生。市场在一季度对国产 ChatGPT 产业链尤其机构筹码不重的应用端的各类行业软件、游戏和营销等轮番炒作。从未来 GPT 带来的增量营收和利润的确定性来看，本基金目前更看好算力芯片、半导体设备、办公软件、光模块和 PCB 等。本基金在一季度主要增加了 AI 赛道的配置，选择性降低了对微逆、储能和半导体设计等的配置。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末，本基金份额净值为 0.7978 元。

自本基金转型日起至本报告期末（2023 年 3 月 20 日至 2023 年 3 月 31 日），本报告期份额净值增长率为 2.15%，同期业绩比较基准收益率为 2.48%。

自本报告期初起至本基金转型日前一日（2023 年 1 月 1 日至 2023 年 3 月 19 日），原国联安科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金的份额净值增长率为-4.62%，同期业绩比较基准收益率为-1.70%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

## §5 投资组合报告

### 5.1 国联安科技创新混合型证券投资基金（LOF）

（报告期：2023年3月20日-2023年3月31日）

#### 5.1.1 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	359,085,585.91	90.88
	其中：股票	359,085,585.91	90.88
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-

5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	32,704,373.87	8.28
7	其他各项资产	3,312,750.60	0.84
8	合计	395,102,710.38	100.00

注：1、由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

2、报告期末，本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为15,310,690.68元，占基金资产净值的比例为3.99%。

### 5.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.1.2.1 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	259,331,825.74	67.60
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	80,765,669.49	21.05
J	金融业	3,677,400.00	0.96
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	343,774,895.23	89.61

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

### 5.1.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
消费者非必需品	189,688.22	0.05
电信服务	15,121,002.46	3.94
合计	15,310,690.68	3.99

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

### 5.1.3 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	688072	拓荆科技	114,381	32,249,722.95	8.41
2	688256	寒武纪	139,099	25,865,459.05	6.74
3	688111	金山办公	49,372	23,352,956.00	6.09
4	688032	禾迈股份	31,689	21,096,634.86	5.50
5	688063	派能科技	75,903	18,634,186.50	4.86
6	688037	芯源微	74,846	16,681,676.48	4.35
7	688777	中控技术	156,439	16,246,190.15	4.23
8	688120	华海清科	51,110	16,191,648.00	4.22
9	002371	北方华创	60,100	15,977,585.00	4.16
10	300666	江丰电子	215,000	15,093,000.00	3.93

### 5.1.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本报告期末本基金未持有债券。

### 5.1.5 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

本报告期末本基金未持有债券。

### 5.1.6 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

本报告期末本基金未持有资产支持证券。

### 5.1.7 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

本报告期末本基金未持有贵金属。

### 5.1.8 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

本报告期末本基金未持有权证。

### 5.1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 5.1.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本报告期末本基金未持有股指期货。

#### 5.1.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期末本基金未投资股指期货。若本基金投资股指期货，在股指期货投资上，本基金以套期保值为目标，在控制风险的前提下，谨慎适当参与股指期货的投资。本基金在进行股指期货投资中，将分析股指期货的收益性、流动性及风险特征，主要选择流动性好、交易活跃的期货合约，通过研究现货和期货市场的发展趋势，运用定价模型对其进行合理估值，谨慎利用股指期货，调整投资组合的风险暴露，及时调整投资组合仓位，以降低组合风险、提高组合的运作效率。

### 5.1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 5.1.10.1 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本报告期末本基金未持有国债期货。

#### 5.1.10.2 本期国债期货投资评价

本报告期末本基金未持有国债期货，没有相关投资评价。

### 5.1.11 投资组合报告附注

5.1.11.1 本报告期内，经查询上海证券交易所、深圳证券交易所等机构公开信息披露平台，本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.1.11.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

#### 5.1.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	68,944.64
2	应收证券清算款	3,212,369.52

3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	31,436.32
6	其他应收款	0.12
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,312,750.60

#### 5.1.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

#### 5.1.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

## 5.2 国联安科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金

（报告期：2023年1月1日-2023年3月19日）

### 5.2.1 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	343,713,452.15	79.04
	其中：股票	343,713,452.15	79.04
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-

6	银行存款和结算备付金合计	90,672,049.53	20.85
7	其他各项资产	497,979.94	0.11
8	合计	434,883,481.62	100.00

注：1、由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

2、报告期末，本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为9,107,782.44元，占基金资产净值的比例为2.10%。

## 5.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.2.1 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	287,632,480.21	66.24
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	42,824,959.50	9.86
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	4,148,230.00	0.96
S	综合	-	-
	合计	334,605,669.71	77.06

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

#### 5.2.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
消费者非必需品	173,214.48	0.04
电信服务	8,934,567.96	2.06
合计	9,107,782.44	2.10

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

#### 5.2.3 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	688072	拓荆科技	121,491	35,675,832.15	8.22
2	688032	禾迈股份	32,533	21,673,159.27	4.99
3	300666	江丰电子	266,000	21,625,800.00	4.98
4	688063	派能科技	83,327	19,601,843.48	4.51
5	002371	北方华创	70,500	19,035,000.00	4.38
6	688385	复旦微电	233,458	16,647,889.98	3.83
7	688409	富创精密	133,529	16,558,931.29	3.81
8	688111	金山办公	45,074	16,113,955.00	3.71
9	688120	华海清科	51,110	15,695,881.00	3.61
10	688777	中控技术	128,041	13,124,202.50	3.02

#### 5.2.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本报告期末本基金未持有债券。

#### 5.2.5 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

本报告期末本基金未持有债券。

#### 5.2.6 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

本报告期末本基金未持有资产支持证券。

#### 5.2.7 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

本报告期末本基金未持有贵金属。

#### 5.2.8 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

本报告期末本基金未持有权证。

## 5.2.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.2.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本报告期末本基金未持有股指期货。

### 5.2.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期末本基金未投资股指期货。若本基金投资股指期货，在股指期货投资上，本基金以套期保值为目标，在控制风险的前提下，谨慎适当参与股指期货的投资。本基金在进行股指期货投资中，将分析股指期货的收益性、流动性及风险特征，主要选择流动性好、交易活跃的期货合约，通过研究现货和期货市场的发展趋势，运用定价模型对其进行合理估值，谨慎利用股指期货，调整投资组合的风险暴露，及时调整投资组合仓位，以降低组合风险、提高组合的运作效率。

## 5.2.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.2.10.1 本期国债期货投资政策

本报告期末本基金未持有国债期货，没有相关投资政策。

### 5.2.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本报告期末本基金未持有国债期货。

### 5.2.10.3 本期国债期货投资评价

本报告期末本基金未持有国债期货，没有相关投资评价。

## 5.2.11 投资组合报告附注

5.2.11.1 本报告期内，经查询上海证券交易所、深圳证券交易所等机构公开信息披露平台，本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.2.11.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 5.2.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	64,370.68
2	应收证券清算款	433,609.26
3	应收股利	-

4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	497,979.94

#### 5.2.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

#### 5.2.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

### §6 开放式基金份额变动

#### 6.1 国联安科技创新混合型证券投资基金（LOF）

单位：份

本报告期期初基金份额总额	556,025,745.68
报告期期间基金总申购份额	978,429.55
减：报告期期间基金总赎回份额	76,137,677.60
报告期期间基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	480,866,497.63

注：总申购份额包含本报告期内发生的转换入和红利再投资份额；总赎回份额包含本报告期内发生的转换出份额。

#### 6.2 国联安科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金

单位：份

本报告期期初基金份额总额	556,025,745.68
报告期期间基金总申购份额	-
减：报告期期间基金总赎回份额	-
报告期期间基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	556,025,745.68

注：总申购份额包含本报告期内发生的转换入和红利再投资份额；总赎回份额包含本报告期内发生的转换出份额。

## §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

#### 7.1.1 国联安科技创新混合型证券投资基金（LOF）

本报告期内，本基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金。

#### 7.1.2 国联安科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金

本报告期内，本基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 国联安科技创新混合型证券投资基金（LOF）

#### 8.1.1 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2023年3月20日至2023年3月31日	199,999,000.0	-	-	199,999,000.00	41.59%
产品特有风险							
<p>(1) 持有份额比例较高的投资者（“高比例投资者”）大额赎回时易使本基金发生巨额赎回或连续巨额赎回，中小投资者可能面临赎回申请需要与高比例投资者按同比例部分延期办理的风险，赎回款项延期获得。</p> <p>(2) 基金净值大幅波动的风险</p> <p>高比例投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动；若高比例投资者赎回的基金份额收取赎回费，相应的赎回费用按约定将部分或全部归入基金资产，可能对基金资产净值造成较大波动。</p> <p>(3) 基金规模较小导致的风险</p> <p>高比例投资者赎回后，可能导致基金规模较小，从而使得基金投资及运作管理的难度增加。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。</p>							

## 8.2 国联安科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金

### 8.2.1 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2023年1月1日至2023年3月19日	199,999,000.00	-	-	199,999,000.00	35.97%

#### 产品特有风险

(1) 持有份额比例较高的投资者（“高比例投资者”）大额赎回时易使本基金发生巨额赎回或连续巨额赎回，中小投资者可能面临赎回申请需要与高比例投资者按同比例部分延期办理的风险，赎回款项延期获得。

#### (2) 基金净值大幅波动的风险

高比例投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动；若高比例投资者赎回的基金份额收取赎回费，相应的赎回费用按约定将部分或全部归入基金资产，可能对基金资产净值造成较大波动。

#### (3) 基金规模较小导致的风险

高比例投资者赎回后，可能导致基金规模较小，从而使得基金投资及运作管理的难度增加。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。

### 8.3 影响投资者决策的其他重要信息

根据基金合同约定，本基金的封闭运作期将于2023年3月19日届满，本基金自2023年3月20日起进入开放期，基金名称变更为“国联安科技创新混合型证券投资基金(LOF)”。本基金更名后，基金场外简称变更为“国联安科创混合(LOF)”，场内简称仍为“科创国联”，扩位证券简称变更为“国联安科创LOF”，基金代码仍为“501096”。本基金基金合同、托管协议的修订符合相关法律法规，对基金份额持有人利益无实质性不利影响。修订的基金合同和托管协议自2023年3月20日起生效。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准国联安科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金（现国

联安科技创新混合型证券投资基金（LOF）基金）发行及募集的文件

- 2、《国联安科技创新混合型证券投资基金（LOF）基金合同》
- 3、《国联安科技创新混合型证券投资基金（LOF）招募说明书》
- 4、《国联安科技创新混合型证券投资基金（LOF）托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 7、中国证监会要求的其他文件

## 9.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1318号9楼

## 9.3 查阅方式

网址：[www.cpicfunds.com](http://www.cpicfunds.com)

国联安基金管理有限公司

二〇二三年四月二十二日