

安信中证深圳科技创新主题指数型证券投资 基金 (LOF) 2024 年第 3 季度报告

2024 年 9 月 30 日

基金管理人：安信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 10 月 24 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	安信深圳科技指数 (LOF)
场内简称	安信深圳科技 LOF
基金主代码	167506
基金运作方式	上市契约型开放式 (LOF)
基金合同生效日	2019 年 12 月 6 日
报告期末基金份额总额	109,460,633.07 份
投资目标	本基金采用指数化投资策略,紧密跟踪中证深圳科技创新主题指数。在正常市场情况下,力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在 0.35%以内,年跟踪误差控制在 4%以内。
投资策略	本基金采用完全复制法进行投资,利用长期稳定的风险模型和交易成本模型,按照成份股在中证深圳科技创新主题指数中的组成及其基准权重构建股票投资组合,以拟合跟踪标的指数的收益表现,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。 在标的指数成份股发生变动、增发、配股、分红等公司行为导致成份股的构成及权重发生变化时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或因某些特殊情况导致流动性不足时,或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合,追求尽可能贴近标的指数的表现。
业绩比较基准	中证深圳科技创新主题指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%

风险收益特征	<p>本基金为股票型基金,其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。同时本基金为指数基金,通过跟踪标的指数表现,具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。</p> <p>本基金通过港股通投资于香港证券市场,会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p> <p>根据《证券期货投资者适当性管理办法》及其配套规则,基金管理人及本基金其他销售机构将定期或不定期对本基金产品风险等级进行重新评定,因而本基金的产品风险等级具体结果应以各销售机构提供的最新评级结果为准。</p>	
基金管理人	安信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	安信深圳科技指数 (LOF) A	安信深圳科技指数 (LOF) C
下属分级基金的交易代码	167506	167507
报告期末下属分级基金的份额总额	78,223,064.59 份	31,237,568.48 份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期 (2024 年 7 月 1 日-2024 年 9 月 30 日)	
	安信深圳科技指数 (LOF) A	安信深圳科技指数 (LOF) C
1. 本期已实现收益	-5,831,398.70	-2,280,403.44
2. 本期利润	9,867,505.62	3,882,133.20
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1255	0.1258
4. 期末基金资产净值	78,731,222.85	31,062,983.75
5. 期末基金份额净值	1.0065	0.9944

注: 1、所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;

2、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。

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

安信深圳科技指数 (LOF) A

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

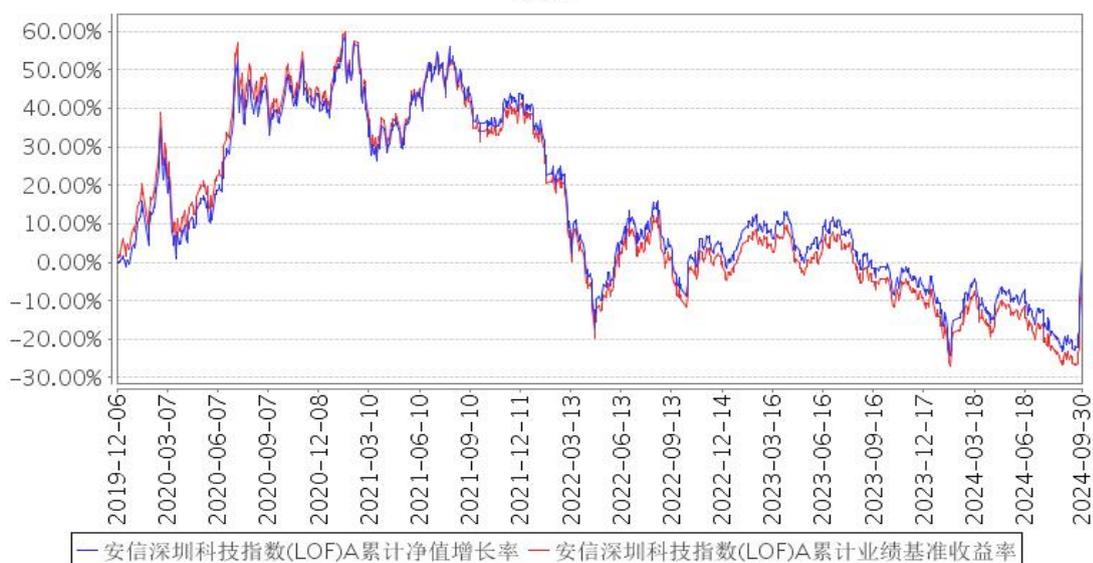
过去三个月	14.45%	2.22%	13.50%	2.25%	0.95%	-0.03%
过去六个月	13.29%	1.87%	11.34%	1.90%	1.95%	-0.03%
过去一年	1.82%	1.74%	-0.18%	1.76%	2.00%	-0.02%
过去三年	-26.12%	1.52%	-28.89%	1.54%	2.77%	-0.02%
自基金合同生效起至今	0.65%	1.60%	-4.64%	1.61%	5.29%	-0.01%

安信深圳科技指数(LOF)C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	14.38%	2.22%	13.50%	2.25%	0.88%	-0.03%
过去六个月	13.15%	1.87%	11.34%	1.90%	1.81%	-0.03%
过去一年	1.56%	1.74%	-0.18%	1.76%	1.74%	-0.02%
过去三年	-26.68%	1.52%	-28.89%	1.54%	2.21%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-0.56%	1.60%	-4.64%	1.61%	4.08%	-0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

安信深圳科技指数(LOF)A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



安信深圳科技指数(LOF)C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：1、本基金基金合同生效日为2019年12月6日。

2、本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

§ 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		
施荣盛	本基金的基金经理	2020年1月13日	-	11年	施荣盛先生，经济学博士。历任东方证券资产管理有限公司量化投资部研究员，安信基金管理有限责任公司量化投资部研究助理、基金经理助理、投资经理，现任安信基金管理有限责任公司量化投资部基金经理。现任安信中证一带一路主题指数型证券投资基金（原安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金）、安信中证深圳科技创新主题指数型证券投资基金（LOF）、安信量化精选沪深300指数增强型证券投资基金的基金经理。

注：1、此处的“任职日期”、“离任日期”根据公司决定的公告（生效）日期填写。

2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

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销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规、监管部门的相关规定及基金合同的约定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易不存在成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2024 年三季度，国际方面，美国经济增速放缓的趋势可能持续，欧洲经济复苏的步伐仍不稳定，全球经济增长面临诸多不确定性。美联储开启降息周期，但是年内降息的预期可能有一些调整，需密切关注相关政策动向及其对全球金融市场的潜在影响。与此同时，外部环境的复杂性和严峻性不容忽视，地缘政治风险、美国大选、贸易摩擦、汇率波动等因素也可能对市场造成波动。国内方面，中国经济有望继续保持稳定增长的态势，但有效需求不足和社会预期偏弱等挑战依然存在。政府正在多措并举，加大宏观调控力度，以促进经济的实质性提升和改善，特别是在消费、投资等领域，政策支持力度不断加强，以期实现全年经济增长目标。

本基金跟踪的标的指数是中证深圳科技创新主题指数，该指数是基于科技部、财政部、税务总局联合颁布的《高新技术企业认定管理办法》界定的国家重点支持的高新技术领域：电子信息、新材料、先进制造与自动化、新能源与节能、资源与环境、高技术服务、航空航天等，并且立足于对标硅谷的高科技城市、中国科技创新的龙头城市深圳，选择深圳本地科技类上市公司（沪港深三地上市）中，以研发投入为核心指标，与估值、成长、质量等指标相结合形成科技股指标体

系，筛选出研发驱动型的优秀深圳科技公司。

本基金秉承指数基金的投资策略，严格遵守风险和合规等管理流程，确保本基金的安全运作。在应对申购、赎回和成分股调整的基础上，跟踪指数的收益，力争将基金跟踪误差控制在合理范围内。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末安信深圳科技指数 (LOF) A 基金份额净值为 1.0065 元，本报告期基金份额净值增长率为 14.45%；安信深圳科技指数 (LOF) C 基金份额净值为 0.9944 元，本报告期基金份额净值增长率为 14.38%；同期业绩比较基准收益率为 13.50%。

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 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	103,332,614.24	93.19
	其中：股票	103,332,614.24	93.19
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,675,318.82	5.12
	其中：债券	5,675,318.82	5.12
	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	1,262,231.91	1.14
8	其他资产	608,998.31	0.55
9	合计	110,879,163.28	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资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	97,725,164.17	89.01
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	5,481,603.85	4.99
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	103,206,768.02	94.00

5.2.2 报告期末积极投资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	70,706.40	0.06
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	55,139.82	0.05
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	125,846.22	0.11

5.2.3 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。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末指数投资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	300124	汇川技术	148,227	9,256,776.15	8.43
2	000063	中兴通讯	270,000	8,410,500.00	7.66
3	002594	比亚迪	24,900	7,652,019.00	6.97
4	002916	深南电路	56,900	6,314,193.00	5.75
5	603160	汇顶科技	76,300	5,337,948.00	4.86
6	300724	捷佳伟创	77,300	5,251,762.00	4.78
7	002850	科达利	52,500	5,100,375.00	4.65
8	002139	拓邦股份	346,118	3,911,133.40	3.56
9	002130	沃尔核材	279,800	3,903,210.00	3.56
10	002837	英维克	123,200	3,205,664.00	2.92

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	301551	无线传媒	438	55,139.82	0.05
2	001279	强邦新材	2,060	19,940.80	0.02
3	301392	汇成真空	210	10,218.60	0.01
4	301536	星辰科技	182	7,165.34	0.01
5	301571	国科天成	191	6,515.01	0.01

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	5,675,318.82	5.17
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)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,675,318.82	5.17

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	019733	24国债02	25,000	2,537,677.40	2.31
2	019740	24国债09	19,000	1,914,869.97	1.74

3	019727	23 国债 24	6,000	613,252.60	0.56
4	019693	22 国债 28	3,000	305,870.14	0.28
5	019698	23 国债 05	2,000	203,395.34	0.19

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，在风险可控的前提下，以套期保值为目的，本着谨慎原则，参与股指期货的投资。本基金投资股指期货将主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的进行国债期货投资，将构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上管理利率波动风险，实现基金资产保值增值。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

报告期内本基金投资的前十名证券除中兴通讯（代码：000063 SZ）、科达利（代码：002850 SZ）外其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

1. 中兴通讯股份有限公司

2024年6月24日，中兴通讯股份有限公司因未按期申报税款被国家税务总局上海市浦东新区税务局第十一税务所责令改正。

2. 深圳市科达利实业股份有限公司

2024年1月29日，深圳市科达利实业股份有限公司因未依法履行职责被惠州大亚湾经济技术开发区消防救援大队罚款。

以上证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	4,482.50
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	604,515.81
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	608,998.31

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	301551	无线传媒	55,139.82	0.05	新股锁定
2	001279	强邦新材	19,940.80	0.02	新股未上市
3	301392	汇成真空	10,218.60	0.01	新股锁定
4	301571	国科天成	6,515.01	0.01	新股锁定

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	安信深圳科技指数 (LOF) A	安信深圳科技指数 (LOF) C
报告期期初基金份额总额	79,167,789.16	30,882,080.36
报告期期间基金总申购份额	2,016,533.66	2,351,236.29
减：报告期期间基金总赎回份额	2,961,258.23	1,995,748.17
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	78,223,064.59	31,237,568.48

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内本基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予安信中证深圳科技创新主题指数型证券投资基金(LOF)募集注册的文件；
- 2、《安信中证深圳科技创新主题指数型证券投资基金(LOF)基金合同》；
- 3、《安信中证深圳科技创新主题指数型证券投资基金(LOF)托管协议》；
- 4、《安信中证深圳科技创新主题指数型证券投资基金(LOF)招募说明书》；
- 5、中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

本基金管理人和基金托管人的住所。

9.3 查阅方式

上述文件可在安信基金管理有限责任公司互联网站上查阅，或者在营业时间内到安信基金管理有限责任公司查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人安信基金管理有限责任公司。

客户服务电话：4008-088-088

网址：<http://www.essencefund.com>

安信基金管理有限责任公司

2024年10月24日