

国泰智享科技 1 个月滚动持有混合型发起式证券投资基金
2023 年第 3 季度报告
2023 年 9 月 30 日

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：杭州银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年十月二十五日

§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。

基金托管人杭州银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2023 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。

为更好地满足广大投资者的投资理财需求，降低投资者的理财成本，经与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，本基金管理人决定自 2023 年 7 月 24 日起，调低本基金的管理费率、托管费率并对基金合同有关条款进行修订。具体可查阅本基金管理人于 2023 年 7 月 22 日发布的《国泰基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国泰智享科技 1 个月滚动持有混合发起
基金主代码	014433
基金运作方式	契约型开放式。 1、在基金份额的每个运作期到期日前，基金份额持有人不能就该基金份额提出赎回申请。 对于每份基金份额，第一个运作期指基金合同生效日（对认购份额而言，下同）或基金份额申购确认日（对申购份额而言，下同）起（即第一个运作期起始日），至基金合同生效日或基金份额申购申请日 1 个月后的月度对日（即第一个运作期到期日，如该对应日为非工作日，或无对应日期，则顺延至下一工作日）止。第二个运作期指第一个运作期

	到期日的次一日起（即第二个运作期起始日），至基金合同生效日或基金份额申购申请日 2 个月后的月度对日（即第二个运作期到期日，如该对应日为非工作日，或无对应日期，则顺延至下一工作日）止，以此类推。 2、在基金份额的每个运作期到期日，基金份额持有人可就该基金份额提出赎回申请。如果基金份额持有人在当期运作期到期日未提出赎回申请，则自该运作期到期日次一日起该基金份额进入下一个运作期。 如发生不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放或需依据基金合同暂停申购与赎回业务的，基金管理人有权合理调整申购或赎回业务的办理期间并予以公告。
基金合同生效日	2022 年 7 月 27 日
报告期末基金份额总额	15,583,257.87 份
投资目标	本基金重点投资于科技相关领域的优质上市公司，在有效控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	1、资产配置策略；2、科技主题的界定；3、股票投资策略；4、存托凭证投资策略；5、债券投资策略；6、可转换债券和可交换债券策略；7、资产支持证券投资策略；8、股指期货投资策略。
业绩比较基准	中证 TMT 产业主题指数收益率*70%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*10%+中债综合指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平理论上高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。 本基金投资港股通标的股票时，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。
基金管理人	国泰基金管理有限公司
基金托管人	杭州银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称	国泰智享科技 1 个月滚动持有混合发起 A	国泰智享科技 1 个月滚动持有混合发起 C
下属分级基金的交易代码	014433	014434
报告期末下属分级基金的份额总额	15,089,410.24 份	493,847.63 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 (2023 年 7 月 1 日-2023 年 9 月 30 日)	
	国泰智享科技 1 个月滚动持有混合发起 A	国泰智享科技 1 个月滚动持有混合发起 C
1.本期已实现收益	-1,069,786.17	-37,847.18
2.本期利润	-1,292,900.54	-54,803.00
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0859	-0.0871
4.期末基金资产净值	11,274,684.24	366,804.96
5.期末基金份额净值	0.7472	0.7427

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。

(2)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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

1、国泰智享科技 1 个月滚动持有混合发起 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	-10.29%	1.60%	-9.10%	1.04%	-1.19%	0.56%
过去六个月	-12.57%	1.83%	-11.95%	1.21%	-0.62%	0.62%

过去一年	-13.96%	1.70%	12.37%	1.17%	-26.33%	0.53%
自基金合同生效起至今	-25.28%	1.69%	1.80%	1.16%	-27.08%	0.53%

2、国泰智享科技 1 个月滚动持有混合发起 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	-10.41%	1.60%	-9.10%	1.04%	-1.31%	0.56%
过去六个月	-12.80%	1.83%	-11.95%	1.21%	-0.85%	0.62%
过去一年	-14.40%	1.70%	12.37%	1.17%	-26.77%	0.53%
自基金合同生效起至今	-25.73%	1.69%	1.80%	1.16%	-27.53%	0.53%

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

国泰智享科技 1 个月滚动持有混合型发起式证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2022 年 7 月 27 日至 2023 年 9 月 30 日)

1. 国泰智享科技 1 个月滚动持有混合发起 A:



注：本基金的合同生效日为 2022 年 7 月 27 日。本基金在 6 个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

2. 国泰智享科技 1 个月滚动持有混合发起 C:



注：本基金的合同生效日为 2022 年 7 月 27 日。本基金在 6 个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

§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		
于腾达	国泰金鑫股票、国泰智享科技 1 个月滚动持有混合发起的基金经理	2022-07-27	-	10 年	硕士研究生。曾任职于兴业证券、泰康资产。2017 年 9 月加入国泰基金，历任研究员、基金经理助理。2021 年 11 月起任国泰金鑫股票型证券投资基金的基金经理，2022 年 7 月起兼任国泰智享科技 1 个月滚动持有混合型发起式证券投资基金的基金经理。

注：1、此处的任职日期和离任日期均指公司决定生效之日，首任基金经理，任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从法律法规及行业协会的相关规定。

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《证券法》、《证券投资基金法》、《基金管理公司公平交易制度指导意见》等有关法律法规的规定，严格遵守基金合同和招募说明书约定，本着诚实信用、勤勉尽责、最大限度保护投资人合法权益等原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合法合规，未发生损害基金份额持有人利益的行为，未发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为，信息披露及时、准确、完整，本基金与本基金管理人管理的其他基金资产、投资组合与公司资产之间严格分开、公平对待，基金管理团队保持独立运作，并通过科学决策、规范运作、精心管理和健全内控体系，有效保障投资人的合法权益。

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，本基金管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定，通过严格的内部风险控制制度和流程，对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制，严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易，确保公平对待所管理的所有基金和投资组合，切实防范利益输送行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金与本基金管理人管理的其他投资组合未发生大额同日反向交易。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。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

智享科技定位于投资科技范围成长股，2022 年 3 季度我们刚开始建仓，展望未来 5 到 10 年，科技自主可控，高端制造会是国内科技发展的主脉络，但同时也面临美国的各种打压，是风险与机遇并存的行业。短周期来看，经历了 4 个季度的下行和去库存，当下处于这一轮下行周期的尾声，我们也加大了复苏类 IC 设计公司的配置。3 季度我们看好的电子版块复苏有一定的滞后，净值冲高后有一定的回撤，3 季度股价已经企稳，再下行风险较小。展望 4 季度，电子元器件在库存见底，创新拉动下，将逐步走出底部区域，现在或是布局的时刻。我们的配置依然会以电子元器件为主，围绕创新和复苏的方向。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金 A 类本报告期内的净值增长率为-10.29%，同期业绩比较基准收益率为-9.10%。

本基金 C 类本报告期内的净值增长率为-10.41%，同期业绩比较基准收益率为-9.10%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 4 季度，对于科技中的硬件版块，我们认为不宜再过于悲观，我们会加大配置。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

不适用。

§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	10,812,527.21	90.23
	其中：股票	10,812,527.21	90.23
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	1,115,720.85	9.31
7	其他各项资产	55,082.87	0.46
8	合计	11,983,330.93	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	9,424,945.46	80.96
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	1,387,581.75	11.92
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	10,812,527.21	92.88

5.3 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	688332	中科蓝讯	10,402	741,974.66	6.37
2	300661	圣邦股份	9,030	702,263.10	6.03
3	600584	长电科技	22,800	695,400.00	5.97
4	603986	兆易创新	7,000	690,200.00	5.93
5	688123	聚辰股份	12,468	687,610.20	5.91
6	688486	龙迅股份	7,268	685,372.40	5.89
7	300373	扬杰科技	19,500	681,720.00	5.86

8	688279	峰昭科技	4,431	487,410.00	4.19
9	688381	帝奥微	17,697	479,588.70	4.12
10	688049	炬芯科技	14,610	478,039.20	4.11

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期内未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 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情况。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	55,072.87
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	10.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	55,082.87

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

本基金本报告期末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

单位：份

项目	国泰智享科技1个月滚动持有混合发起A	国泰智享科技1个月滚动持有混合发起C
本报告期期初基金份额总额	15,011,127.88	742,466.35
报告期期间基金总申购份额	130,330.00	205,806.77
减：报告期期间基金总赎回份额	52,047.64	454,425.49
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	15,089,410.24	493,847.63

§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

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	10,122,895.42
报告期期间买入/申购总份额	-

报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,122,895.42
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	64.96

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，本基金的基金管理人未运用固有资金投资本基金。

8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额 总数	持有份额占 基金总份额 比例	发起份额 总数	发起份额占 基金总份额 比例	发起份额承诺 持有期限
基金管理人固有资金	10,122,895.42	64.96%	10,000,000.00	64.17%	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,122,895.42	64.96%	10,000,000.00	64.17%	-

9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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 07 月 01 日至 2023 年 09 月 30 日	10,122,895.42	-	-	10,122,895.42	64.96%
个人	1	2023 年 07 月 01 日至 2023 年 09 月 30 日	3,226,602.07	-	-	3,226,602.07	20.71%
产品特有风险							
当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。							

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、关于准予国泰智享科技 1 个月滚动持有混合型发起式证券投资基金注册的批复
- 2、国泰智享科技 1 个月滚动持有混合型发起式证券投资基金基金合同
- 3、国泰智享科技 1 个月滚动持有混合型发起式证券投资基金托管协议
- 4、报告期内披露的各项公告
- 5、法律法规要求备查的其他文件

10.2 存放地点

本基金管理人国泰基金管理有限公司办公地点——上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 16 层-19 层。

基金托管人住所。

10.3 查阅方式

可咨询本基金管理人；部分备查文件可在本基金管理人公司网站上查阅。

客户服务中心电话：（021）31089000，400-888-8688

客户投诉电话：（021）31089000

公司网址：<http://www.gtfund.com>

国泰基金管理有限公司

二〇二三年十月二十五日