

中银证券科技创新混合型证券投资基金
(LOF)
2026 年第 1 季度报告

2026 年 3 月 31 日

基金管理人：中银国际证券股份有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 4 月 21 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 2026 年 4 月 20 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 2026 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 中银证券科技创新混合（LOF） |
| 场内简称 | BOCI 科创 扩位简称：中银证券科技创新 LOF |
| 基金主代码 | 501095 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2020 年 3 月 12 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 450,254,682.50 份 |
| 投资目标 | 在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。 |
| 投资策略 | <p>本基金将通过跟踪考量通常的宏观经济变量（包括 GDP 增长率、CPI 走势、M2 的绝对水平和增长率、利率水平与走势等）以及各项国家政策（包括财政、货币、税收、汇率政策等）来判断经济周期目前的位置以及未来将发展的方向，在此基础上对各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估，制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。</p> <p>封闭运作期内，本基金在投资股票时，将根据市场整体估值水平评估系统性风险，同时根据个股估值水平（中证 800 指数的市净率 P/B）决定股票资产的投资比例。</p> <p>本基金通过自上而下及自下而上相结合的方式，密切关注科技创新前沿，挖掘优质的上市公司，构建股票投资组合。针对科创板，本基金将从上市公司的成长性、科技研发能力、公司治理结构、估值水平等方面对科技创新主题的上市公司进行综合评价。</p> <p>本基金所指科技创新主题相关证券主要是指坚持面向世界科技前沿、面向经济主战场、面向国家重大需求的科技创新，主要投资于包括符合国家战略、突破关键核心技术、市场认可度高，属于新一代信息技</p> |

| | |
|--------|--|
| | 术、高端装备、新材料、新能源、节能环保以及生物医药等高新技术产业和战略性新兴产业，属于互联网、大数据、云计算、人工智能和制造业深度融合等方面的科技创新上市公司。 |
| 业绩比较基准 | 封闭运作期内，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*55%+中债综合全价指数收益率*45% 封闭运作期届满转型后，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*80%+中债综合全价指数收益率*20% |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型证券投资基金，其预期风险和预期收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。本基金封闭运作期内将参与科创板发行人战略配售股票投资，由此产生的投资风险与价格波动由投资者自行承担。 |
| 基金管理人 | 中银国际证券股份有限公司 |
| 基金托管人 | 中国农业银行股份有限公司 |

§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（2026年1月1日-2026年3月31日） |
|-----------------|---------------------------|
| 1. 本期已实现收益 | 23,223,759.04 |
| 2. 本期利润 | -30,884,868.47 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0671 |
| 4. 期末基金资产净值 | 344,885,978.99 |
| 5. 期末基金份额净值 | 0.7660 |

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

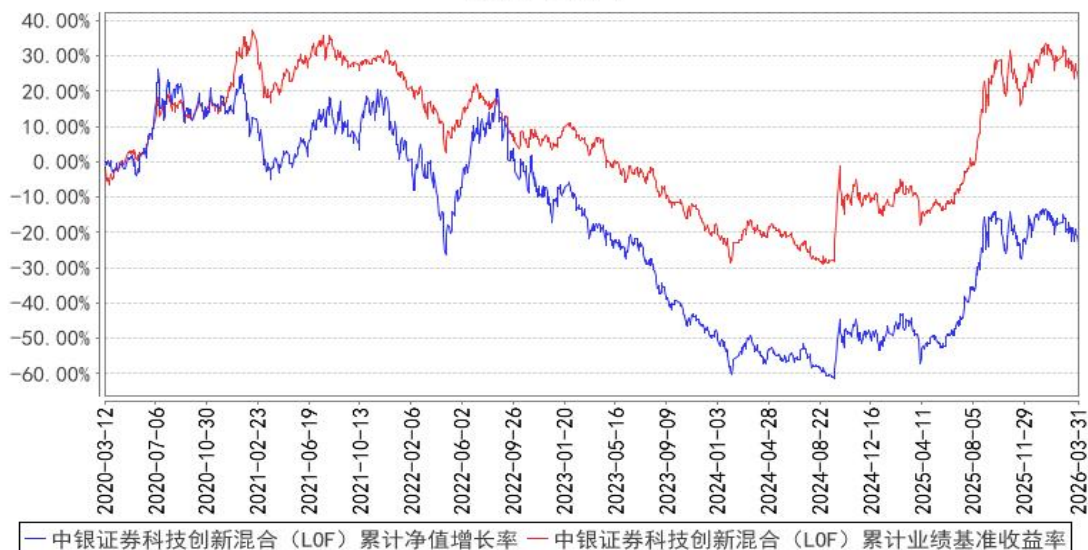
| 阶段 | 净值增长率 ① | 净值增长率 标准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较基 准收益率标 准差④ | ①-③ | ②-④ |
|-------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月 | -8.24% | 2.04% | -3.11% | 1.30% | -5.13% | 0.74% |
| 过去六个月 | -8.76% | 2.27% | -3.97% | 1.45% | -4.79% | 0.82% |
| 过去一年 | 50.46% | 2.47% | 36.49% | 1.47% | 13.97% | 1.00% |

| | | | | | | |
|----------------|---------|-------|--------|-------|---------|-------|
| 过去三年 | -6.16% | 2.18% | 17.01% | 1.39% | -23.17% | 0.79% |
| 过去五年 | -22.14% | 2.06% | 2.45% | 1.20% | -24.59% | 0.86% |
| 自基金合同 生效起至今 | -23.40% | 1.96% | 23.31% | 1.17% | -46.71% | 0.79% |

注：自基金成立至2023年3月12日，本基金业绩比较基准为中国战略新兴产业成份指数收益率*55%+中债综合全价指数收益率*45%。自2023年3月13日起，本基金业绩比较基准为中国战略新兴产业成份指数收益率*80%+中债综合全价指数收益率*20%。

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

中银证券科技创新混合（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：1. 本基金合同于2020年3月12日生效。

3.3 其他指标

注：无。

§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 | | |
| 林博程 | 本基金的基金经理 | 2021年12月29日 | - | 12年 | 林博程，硕士研究生，中国国籍，已取得证券、基金从业资格。2013年9月至2014年4月任职于招商证券股份有限公司，担任银行业分析师；2014年4月至2015年 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---|
| | | | | | 10 月任职于华泰证券股份有限公司，担任银行业分析师；2015 年 10 月至 2021 年 7 月任职于申万菱信基金管理有限公司，担任基金经理；2021 年 7 月加入中银国际证券股份有限公司，历任中银证券优势成长混合型证券投资基金基金经理，现任中银证券科技创新混合型证券投资基金（LOF）、中银证券精选行业股票型证券投资基金、中银证券价值精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。 |
|--|--|--|--|--|---|

注：1、上述任职日期为根据公司确定的聘用日期，离任日期为根据公司确定的解聘日期；首任基金经理的任职日期为基金合同生效日期；

2、证券从业的涵义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》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

注：无

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了保证公司管理的不同投资组合得到公平对待，保护投资者合法权益，本基金管理人根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规，建立了《资产管理业务公平交易管理办法》、《资产管理业务异常交易监控与报告管理办法》等公平交易相关制度体系。公司旗下投资组合严格按照制度的规定，参与股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，主要包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关环节。研究团队负责提供投资研究支持，投资团队负责投资决策，交易室负责实施交易并实时监控，投资监督团队负责事前监督、事中检查和事后稽核，对交易情况进行合理性分析。通过多部门的协作互控，保证了公平交易的可操作、可稽核和可持续。

公司一直严格遵循公平交易相关规章制度，执行严格的公平交易行为。在严格方针指导下，报告期内，未出现任何异常关联交易以及与禁止交易对手间的交易行为。

报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗口下（如：1 日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合向交易开展交易价差分析。分析结果表明，本报告期内公司对各投资组合公平对待，不存在利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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交易中，未发生同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量 5%的情况。

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运作分析

一季度指数冲高回落，期间指数向上突破后受国际形势等影响有所回落。一季度从行业上看煤炭、石油石化、公用事业和建筑建材等涨幅靠前，非银、商贸零售、美容护理和计算机等行业下跌较多，热点轮动持续，人工智能方向中光模块表现较好，新能源方向中电气设备和光伏逆变器表现较好。

投资策略上我们更注重成长空间大且有基本面支撑的行业和公司的投资价值，同时本轮以人工智能为代表的新一轮科技进步具备较好的持续性且在多个领域都有广阔的应用空间，能够带来相关产业景气的持续和未来业绩的兑现，此外部分成长板块的产业趋势也在逐渐明朗，因此报告期内，我们持续围绕成长方向进行深度研究和挖掘，并结合上市公司情况通过对未来各主要行业政策趋势、景气周期、估值与业绩增速等的仔细对比，在保持成长股投资策略不变的基础上对整体组合的配置结构进行优化。站在长期投资回报的角度，结合当前政策趋势、国际环境和产业格局，我们通过自上而下与自下而上相结合的研究分析，选取当前成长空间广阔且确定性高、在国际或国内市场竞争优势明显的科技创新行业作为组合的重要持仓，例如海内外人工智能算力、人工智能应用、国产半导体、新能源、人形机器人、医药创新药等，并结合市场热点优选各相关行业和细分领域的龙头公司进行投资，以期给投资人带来长期成长。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.7660 元；本报告期基金份额净值增长率为-8.24%，业绩比较基准收益率为-3.11%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金报告期内不存在连续二十个工作日基金持有人数低于 200 人或基金资产净值低于 5000

万元的情形。

§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 | 316,369,105.06 | 91.31 |
| | 其中：股票 | 316,369,105.06 | 91.31 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 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 | 27,410,548.60 | 7.91 |
| 8 | 其他资产 | 2,680,010.00 | 0.77 |
| 9 | 合计 | 346,459,663.66 | 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 | 262,493,355.06 | 76.11 |
| 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 | 47,254,750.00 | 13.70 |
| 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 | 5,712,000.00 | 1.66 |
| S | 综合 | 909,000.00 | 0.26 |
| | 合计 | 316,369,105.06 | 91.73 |

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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 | 300502 | 新易盛 | 75,000 | 33,213,000.00 | 9.63 |
| 2 | 688498 | 源杰科技 | 23,934 | 24,064,200.96 | 6.98 |
| 3 | 300308 | 中际旭创 | 35,000 | 19,929,350.00 | 5.78 |
| 4 | 300394 | 天孚通信 | 60,000 | 18,096,000.00 | 5.25 |
| 5 | 002384 | 东山精密 | 170,000 | 17,561,000.00 | 5.09 |
| 6 | 300476 | 胜宏科技 | 50,000 | 12,550,000.00 | 3.64 |
| 7 | 688521 | 芯原股份 | 45,000 | 9,103,500.00 | 2.64 |
| 8 | 688062 | 迈威生物 | 250,000 | 9,002,500.00 | 2.61 |
| 9 | 002624 | 完美世界 | 500,000 | 8,785,000.00 | 2.55 |
| 10 | 688195 | 腾景科技 | 30,000 | 8,116,200.00 | 2.35 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：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

注：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

注：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

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

注：本基金本报告期末未持有权证投资。

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

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。

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

本基金投资范围未包括国债期货，无相关投资政策。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金投资范围未包括国债期货，无相关投资评价。

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

报告期内基金投资的前十名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。

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

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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 338,897.62 |
| 2 | 应收证券清算款 | 2,277,555.50 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 63,556.88 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 2,680,010.00 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：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

注：本基金本报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---------------------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 477,330,614.69 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 5,620,955.71 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 32,696,887.90 |
| 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 | 450,254,682.50 |

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§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

注：本报告期内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

注：本报告期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

注：本基金本报告期内单一投资者持有基金份额比例未有达到或超过 20%的情况。

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、中国证监会准予本基金募集注册的文件
- 2、基金合同
- 3、托管协议
- 4、法律意见书
- 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

基金管理人和基金托管人的办公场所。

9.3 查阅方式

投资者可以在开放时间内至基金管理人或基金托管人住所免费查阅，也可登录基金管理人基金网站 www.bocifunds.com 查阅。

中银国际证券股份有限公司

2026 年 4 月 21 日