

平安科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合  
型证券投资基金  
2021 年第 3 季度报告

2021 年 9 月 30 日

基金管理人：平安基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 10 月 27 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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年10月26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2021年07月01日起至09月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	平安科技创新3年封闭混合
场内简称	科创平安（扩位证券简称：平安科技创新）
基金主代码	501099
基金运作方式	契约型开放式。本基金合同生效后的前3年为封闭运作期。在封闭运作期内，本基金不办理申购、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）。
基金合同生效日	2020年4月10日
报告期末基金份额总额	204,557,249.85份
投资目标	在严格控制风险的前提下，充分利用公司投资研究优势，精选投资标的，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>封闭运作期投资策略：</p> <p>本基金在封闭运作期内既可以在二级市场买卖股票，也可以参与科创板的新股投资及战略配售等。本基金重点关注科技创新股票的投资机会，通过自下而上的深度挖掘，精选个股。</p> <p>转为上市开放式基金（LOF）后的投资策略：</p> <p>在大类资产配置过程中，本基金将对宏观经济、国家政策、资金面和市场情绪等可能影响证券市场的重要因素进行研究。通过综合考虑相关类别资产的风险收益水平及市场走势，结合经济、金融的政策调整、环境改变及其发展趋势，动态调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例，优化投资组合。</p>
业绩比较基准	中国战略新兴产业成份指数收益率×65%+恒生指数收益率（经汇率估值调整）×15%+中债总指数收益率×20%。

风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。本基金将投资港股通标的股票，需承担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。本基金可投资于科创板上市的股票，除了需要承担与证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临投资科创板股票的特殊风险。
基金管理人	平安基金管理有限公司
基金托管人	平安银行股份有限公司

### § 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（2021年7月1日-2021年9月30日）
1. 本期已实现收益	43,665,359.58
2. 本期利润	-10,517,591.51
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0514
4. 期末基金资产净值	373,096,556.39
5. 期末基金份额净值	1.8239

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. 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

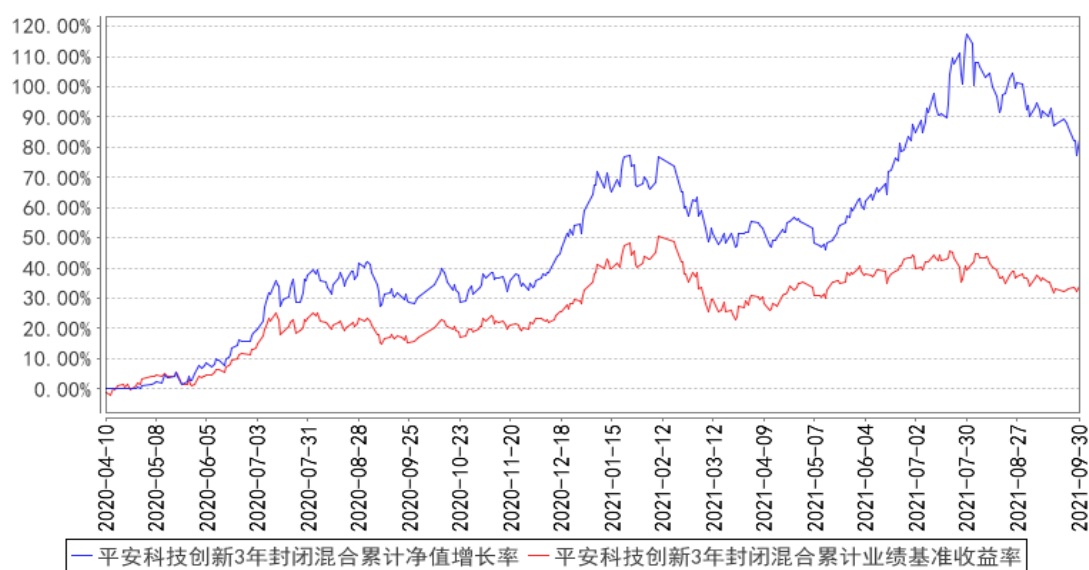
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-2.74%	2.15%	-7.16%	1.21%	4.42%	0.94%
过去六个月	19.96%	1.85%	4.67%	1.14%	15.29%	0.71%
过去一年	39.92%	1.78%	14.55%	1.26%	25.37%	0.52%
自基金合同 生效起至今	82.39%	1.70%	33.89%	1.22%	48.50%	0.48%

##### 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

平安科技创新3年封闭混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势图



注：1、本基金合同于 2020 年 04 月 10 日生效；

2、按照本基金的基金合同规定，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，截至报告期末本基金已完成建仓，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

### 3.3 其他指标

注：本基金本报告期内无其他指标。

## § 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		
李化松	公司总经理助理兼权益投资总监，平安科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2020年4月15日	-	15年	李化松先生，北京大学硕士。先后担任国信证券有限责任公司经济研究所分析师、华宝兴业基金管理有限公司研究部分析师、嘉实基金管理有限公司研究部高级研究员、基金经理。2018年3月加入平安基金管理有限公司，现任公司总经理助理兼权益投资总监，同时担任平安智慧中国灵活配置混合型证券投资基金、平安高端制造混合型证券投资基金、平安匠心优选混合型证券投资基金、平安科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、平安研究睿选混合型证券投资基金、

					平安低碳经济混合型证券投资基金、平安稳健增长混合型证券投资基金、平安兴鑫回报一年定期开放混合型证券投资基金、平安均衡优选1年持有期混合型证券投资基金基金经理。
翟森	平安科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2020年12月29日	-	6年	翟森先生，北京大学计算机应用技术硕士。曾担任深圳前海大宇资本管理有限公司研究员。2016年6月加入平安基金管理有限公司，曾担任研究中心行业研究员，现担任平安科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、平安灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
张俊生	权益投资中心投资副总监，平安科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2020年4月10日	2021年8月26日	15年	张俊生先生，中国科学技术大学管理科学与工程专业硕士，曾先后担任广东发展银行政策分析主任、鹏华基金管理有限公司研究员、信达澳银基金管理有限公司高级研究员、基金经理助理、基金经理，深圳昱昇富德资产管理有限公司合伙人兼投资总监，上海华信证券有限责任公司权益投资部总经理。2018年10月加入平安基金管理有限公司，现任权益投资中心投资副总监。同时担任平安鼎泰灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、平安鼎越灵活配置混合型证券投资基金、平安科技创新混合型证券投资基金基金经理。

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确认的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确认的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》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》等有关法律法规、中国证监会和本基金基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

### 4.3 公平交易专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《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。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

报告期内，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 报告期内基金的投资策略和运作分析

回顾三季度，进行了一定幅度的调仓，主要涉及到基本面发生变化的个股，如半导体、新能源板块内的配置调整，在大类板块配置上并没有发生明显变化。基金目前始终坚持在科技相关领域进行配置，聚焦于电子、半导体、通信、计算机、新能源、军工等方向。从景气度方向出发，精选优质个股。在科技行业之间进行相对均衡的配置。

近期基金净值经历了一定调整，主要与近期全产业链上游涨价超预期后，市场面临较大的滞胀压力有关，基金重点的投资领域也出现了板块性的调整。但展望四季度，我们仍然对科技相关领域内的结构性机会保持乐观。

重点板块而言：半导体前期已经经历了比较大的调整，细分环节上半导体设备的国产化程度正在加速，并且半导体行业的短期基本面仍然保持高位景气，我们仍然认为在后续仍然有阶段性的表现；新能源板块由于短期面临上游原材料涨价缺电等不确定性的影响，近期也出现了一定的调整，后续投资中将避免成本端受损的相关领域，继续精选个股。

下一阶段，全球面临较大的滞胀压力，市场投资难度大幅度加大，但在全球流动性宽松的背景下，我们仍然认为具备高景气度的科技板块如新能源、半导体、军工产业链仍然是未来最值得投资的方向，我们会维持在相关产业链的重点布局。具体到投资标的，我们会对产业链的上下游环节进一步梳理，会根据具体环节的景气变化和业绩估值匹配度，会对组合做适度的调整。

### 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1.8239元，本报告期基金份额净值增长率为-2.74%，业绩比较基准收益率为-7.16%。

### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内未出现连续20个工作日基金份额持有人数低于200人、基金资产净值低于5,000万元的情形。

## § 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	296,716,483.72	66.47
	其中：股票	296,716,483.72	66.47
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	52,000,000.00	11.65
	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	76,300,405.57	17.09
8	其他资产	21,400,610.23	4.79
9	合计	446,417,499.52	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为15,484,561.07元，占净值比例4.15%。

### 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	12,350.52	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	234,520,155.84	62.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	17,258,408.24	4.63
E	建筑业	7,096,478.39	1.90
F	批发和零售业	110,705.04	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	3,345.12	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	22,112,694.16	5.93
J	金融业	-	-
K	房地产业	8,705.25	0.00

L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	32,194.84	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	76,885.25	0.02
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	281,231,922.65	75.38

## 5.2.2 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（%）
原材料	-	-
周期性消费品	-	-
非周期性消费品	-	-
能源	-	-
金融	-	-
医疗	-	-
工业	-	-
地产业	-	-
信息科技	5,851,946.60	1.57
电信服务	-	-
公用事业	9,632,614.47	2.58
合计	15,484,561.07	4.15

注：以上分类采用全球行业分类标准。

## 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	002371	北方华创	49,700	18,174,793.00	4.87
2	300750	宁德时代	33,800	17,769,674.00	4.76
3	002241	歌尔股份	318,500	13,727,350.00	3.68
4	002415	海康威视	233,400	12,837,000.00	3.44
5	300604	长川科技	262,700	12,546,552.00	3.36
6	688036	传音控股	82,783	11,672,403.00	3.13
7	688536	思瑞浦	18,025	11,501,932.75	3.08
8	688037	芯源微	45,755	11,168,795.50	2.99
9	603290	斯达半导	27,400	11,168,788.00	2.99
10	600884	杉杉股份	303,300	10,406,223.00	2.79

## 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投资。

#### 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投资。

##### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期无股指期货投资。

#### 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

本基金本报告期无国债期货投资。

##### 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：本基金本报告期无国债期货投资。

##### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期无国债期货投资。

#### 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没有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。

### 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中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	577,635.02
2	应收证券清算款	20,815,537.92
3	应收股利	-
4	应收利息	7,437.29
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	21,400,610.23

### 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：本基金本报告期末前十名股票中无流通受限的股票。

### 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

报告期期初基金份额总额	204,557,249.85
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（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	204,557,249.85

## § 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：无。

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：无。

## § 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：无。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》和相关基金基金合同的约定，经与基金托管人协商一致，并报中国证券监督管理委员会备案，平安基金管理有限公司（以下简称“本公司”）对本基金就引入侧袋机制事宜修订基金合同、托管协议等法律文件。修订自 2021 年 7 月 23 日起正式生效。有关详细信息参见本公司于 2021 年 7 月 23 日发布的《平安基金管理有限公司关于公司旗下部分基金根据《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》修改基金合同部分条款的公告》。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

(1) 中国证监会准予平安科技创新 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) 平安科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同

(3) 平安科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金托管协议

(4) 法律意见书

(5) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

### 9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所

### 9.3 查阅方式

(1) 投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件

(2) 投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人平安基金管理有限公司，客户服务热线：4008004800（免长途话费）

平安基金管理有限公司

2021年10月27日