

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
2022 年第 2 季度报告

2022 年 6 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：2022 年 7 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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 07 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 2022 年 04 月 01 日起至 06 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	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（2022年4月1日-2022年6月30日）
1. 本期已实现收益	-20,445,867.59
2. 本期利润	27,198,809.74
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1330
4. 期末基金资产净值	328,650,854.92
5. 期末基金份额净值	1.6066

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

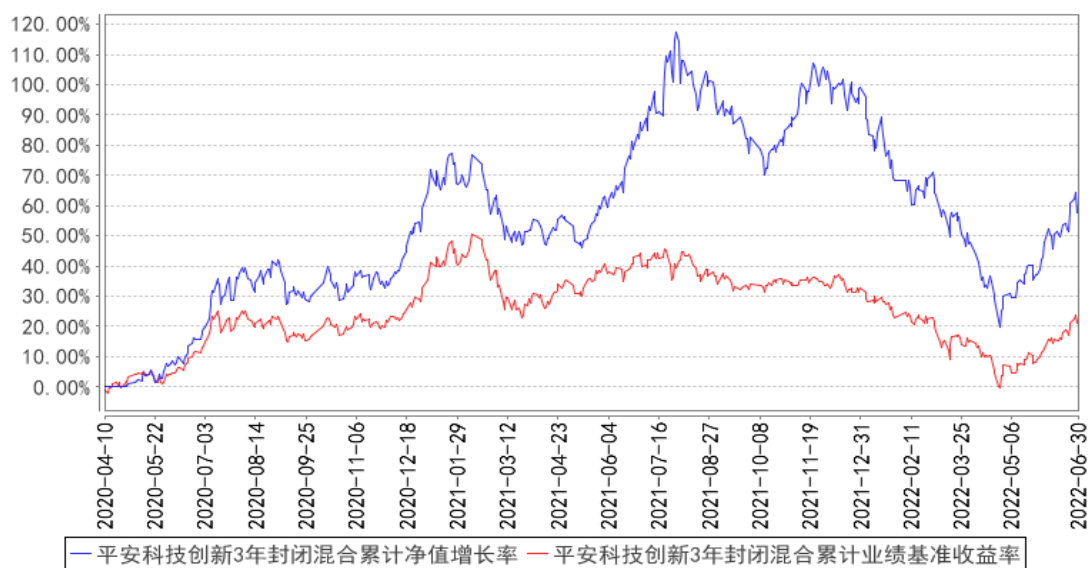
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	9.02%	2.05%	6.74%	1.50%	2.28%	0.55%
过去六个月	-19.36%	2.02%	-7.67%	1.46%	-11.69%	0.56%
过去一年	-14.33%	1.95%	-14.94%	1.24%	0.61%	0.71%
自基金合同 生效起至今	60.66%	1.77%	22.67%	1.23%	37.99%	0.54%

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对比图



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。

§ 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	-	16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。
----	-------------------------------	-------------	---	----	--

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

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
李化松	公募基金	7	10,623,749,755.59	2018年08月10日
	私募资产管理计划	1	102,894,301.31	2022年05月23日
	其他组合	-	-	-
	合计	8	10,726,644,056.90	-

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

回顾二季度，市场前期面临了较大的压力，出现了较大幅度的调整，市场充分演绎并暴露了从全球宏观环境到国内疫情影响的悲观的预期。近期市场也在充沛的流动性以及国内经济在全球经济中的比较优势下出现一定的反弹。总而言之，今年是近年来少有的波动率较大且市场备受宏观层面影响的一年。

我们在二季度重点配置方向为电子元器件、半导体、军工、汽车智能化以及新能源相关的科技成长方向。这其中由于电子元器件以及半导体属于受宏观经济影响较大的行业，对个股的甄选难以抗拒行业贝塔性的调整，今年上半年基金净值的损失有较大部分源自于该板块的负面影响。但我们相信个股的价值终将在拉长的时间维度上得以验证，行业贝塔以及宏观的波动只是个股价值中最小的变量的因素。

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1.6066元，本报告期基金份额净值增长率为9.02%，业绩比较基准收益率为6.74%。

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	294,015,435.05	87.30
	其中：股票	294,015,435.05	87.30
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	35,809,583.39	10.63
8	其他资产	6,946,402.68	2.06
9	合计	336,771,421.12	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187438.49元，占净值比例0.06%。

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	287,838,550.87	87.58
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	5,252,344.00	1.60
F	批发和零售业	82,624.46	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	14,977.44	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	392,664.76	0.12
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	51,900.68	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	183,983.51	0.06
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	10,950.84	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	293,827,996.56	89.40

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	187,438.49	0.06
能源	-	-
金融	-	-

医疗	-	-
工业	-	-
地产业	-	-
信息技术	-	-
电信服务	-	-
公用事业	-	-
合计	187,438.49	0.06

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	002475	立讯精密	633,900	21,419,481.00	6.52
2	002129	TCL 中环	238,500	14,045,265.00	4.27
3	600522	中天科技	587,500	13,571,250.00	4.13
4	688385	复旦微电	200,853	13,093,607.07	3.98
5	300750	宁德时代	22,800	12,175,200.00	3.70
6	600456	宝钛股份	185,100	10,994,940.00	3.35
7	002291	星期六	539,700	10,664,472.00	3.24
8	600316	洪都航空	351,700	10,635,408.00	3.24
9	688326	经纬恒润	71,154	10,447,150.14	3.18
10	000768	中航西飞	336,200	10,183,498.00	3.10

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库以外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	566,632.54
2	应收证券清算款	6,379,770.14
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	6,946,402.68

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

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	688326	经纬恒润	172,950.30	0.05	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

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

无。

§ 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，客户服务电话：4008004800（免长途话费）

平安基金管理有限公司

2022 年 7 月 21 日