

国联安科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基 金

2022 年第 3 季度报告

2022 年 9 月 30 日

基金管理人：国联安基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年十月二十六日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年10月25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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 国联安科创3年灵活配置混合 |
| 场内简称 | 科创国联 |
| 基金主代码 | 501096 |
| 交易代码 | 501096 |
| 基金运作方式 | 契约型 |
| 基金合同生效日 | 2020年3月20日 |
| 报告期末基金份额总额 | 556,025,745.68份 |
| 投资目标 | 在严格控制风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的稳健回报。 |
| 投资策略 | 本基金投资策略的核心在于重点关注并跟踪具备较强盈利能力和可持续成长能力的科技创新主题上市公司，挖掘其中具备核心竞争优势的个股，通过积极的股票选择，采取以合理价格买入的投资方式，通过上市公司价值的回归 |

| | |
|--------|---|
| | 或兑现，实现基金资产的长期稳定增值。 |
| 业绩比较基准 | 中国战略新兴产业成份指数收益率×50%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×10%+中债综合指数收益率×40% |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，理论上其预期风险和预期收益水平高于债券型基金及货币市场基金，低于股票型基金。 |
| 基金管理人 | 国联安基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 |

注：本基金合同生效后的前三年为封闭运作期。在封闭运作期内，本基金不办理申购与赎回业务。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），基金名称调整为“国联安科技创新混合型证券投资基金（LOF）”，并接受场外、场内申购赎回。

§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7月1日-2022年9月30日) |
| 1.本期已实现收益 | -21,908,395.30 |
| 2.本期利润 | -12,924,214.51 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0232 |
| 4.期末基金资产净值 | 550,528,119.15 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.9901 |

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，包含停牌股票按公允价值调整的影响；

2、上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，例如，开放式基金的申购赎回费等，计入费用后实际收益要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

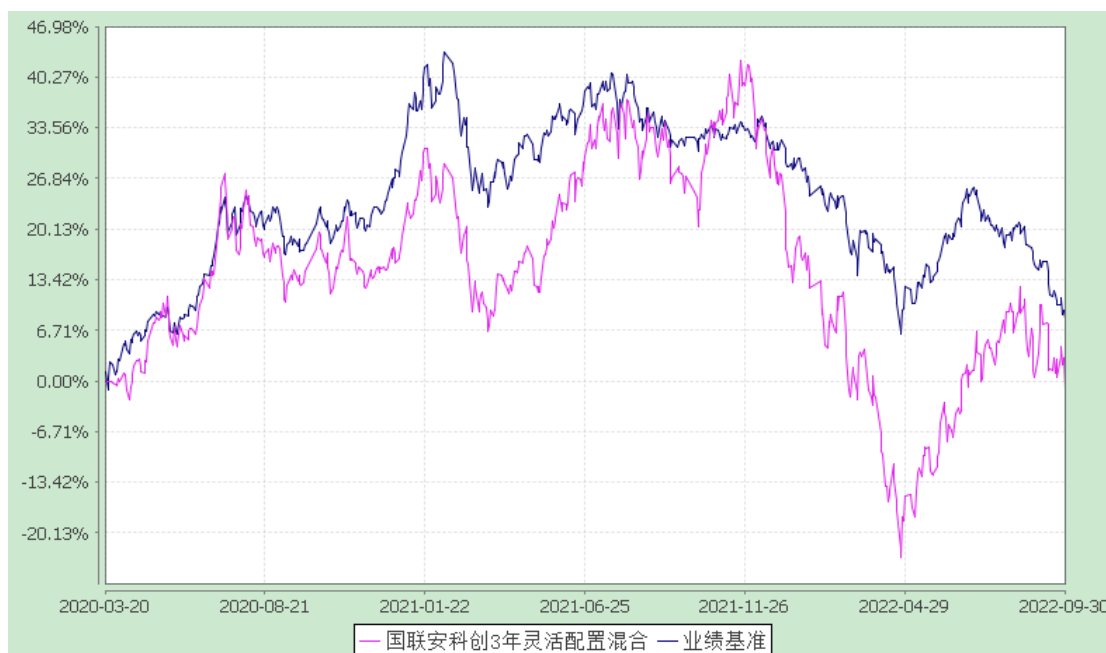
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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 | -2.30% | 2.01% | -13.19% | 0.75% | 10.89% | 1.26% |
| 过去六个月 | 1.01% | 2.22% | -8.58% | 0.96% | 9.59% | 1.26% |
| 过去一年 | -22.14% | 2.06% | -18.27% | 0.90% | -3.87% | 1.16% |
| 过去三年 | - | - | - | - | - | - |
| 过去五年 | - | - | - | - | - | - |
| 自基金合同生效起至今 | -0.99% | 1.65% | 8.19% | 0.93% | -9.18% | 0.72% |

注：上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。

3.2.2 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

国联安科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金
 累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 (2020年3月20日至2022年9月30日)



- 注：1、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×50%+中债综合指数收益率×40%+恒生指数收益率(使用估值汇率折算)×10%；
- 2、本基金基金合同于2020年3月20日生效；
- 3、本基金建仓期为自基金合同生效之日起的6个月，建仓期结束时各项资产配置符合合同约定；
- 4、上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。

§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 | | |
| 潘明 | 本基金基金经理、兼任国联安科技动力股票型证券投资 | 2020-03-20 | - | 13年（自2009年起） | 潘明先生,硕士研究生。曾任计算机科学公司咨询师,摩托罗拉公司高级行政工程师,扎克斯投资管理公司投资分析师,短剑投资公司执行董事,指导资本公司基金经理兼大宗商品研究总监,海通证券股份有限公司投 |

| | | | | |
|--|--|--|--|--|
| | <p>基金基金经理、国联安优选行业混合型证券投资基金基金经理、国联安匠心科技1个月滚动持有混合型证券投资基金基金经理、国联安气候变化责任投资混合型证券投资基金基金经理。</p> | | | <p>资经理，GCS母基金公司、GCS有限公司、GCS有限责任公司独立董事，光大证券资产管理有限公司投资经理助理、投资经理。2013年12月起加入国联安基金管理有限公司，历任基金经理助理，基金经理、权益投资部总监等职。2014年2月起担任国联安优选行业混合型证券投资基金的基金经理；2015年4月至2018年7月兼任国联安德盛红利混合型证券投资基金的基金经理；2015年4月至2017年2月兼任国联安主题驱动混合型证券投资基金的基金经理；2016年1月起兼任国联安科技动力股票型证券投资基金的基金经理；2020年3月起兼任国联安科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2021年5月起兼任国联安匠心科技1个月滚动持有混合型证券投资基金的基金经理；2022年9月起兼任国联安气候变化责任投资混合型证券投资基金的基金经理。</p> |
|--|--|--|--|--|

注：1、基金经理的任职日期和离职日期以公司对外公告为准；

2、证券从业年限的统计标准为证券行业的工作经历年限。

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 |
|----|----------|---------|------------------|------------|
| 潘明 | 公募基金 | 5.00 | 2,944,404,798.35 | 2014-02-15 |
| | 私募资产管理计划 | 1.00 | 242,255,547.01 | 2022-08-01 |
| | 其他组合 | 0.00 | 0.00 | 0 |
| | 合计 | 6.00 | 3,186,660,345.36 | |

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《中华人民共和国证券投资基金法》、《国联安科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规、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财产，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无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

本基金管理人遵照相应法律法规和内部规章，制定并完善了《国联安基金管理有限公司公平交易制度》(以下简称“公平交易制度”)，用以规范包括投资授权、研究分析、投资决策、交易执行以及投资管理过程中涉及的实施效果与业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

本报告期内，本基金管理人严格执行公平交易制度的规定，公平对待不同投资组合，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和投资决策等方面均享有平等机会；在交易环节严格按照时间优先，价格优先的原则执行指令；如遇指令价位相同或指令价位不同但市场条件都满足时，及时执行交易系统中的公平交易模块；采用公平交易分析系统对不同投资组合的交易价差进行定期分析；对投资流程独立稽核等。

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同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的交易次数为 1 次，发生原因是为了满足产品合同中相关投资比例的限制要求。公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的无法解释的异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度，市场在流动性宽松环境下慢性调整，沪深 300 和中信 TMT 指数都有不小的跌幅。市场围绕能源主线，在旧能源和新能源之间轮动切换。科技行业的结构性阿尔法主要来自电子的半导体零部件、电新的微逆储能、计算机的信创和通信的海风海缆。本基金在报告期内跑赢沪深 300 和中信 TMT 指数。基于对三季度业绩和下半年细分行业景气度的预判，本基金增配碳化硅、半导体设备零部件和微逆储能等。半导体零部件、海风海缆、光伏和动力电池是转债配置的主要方向。

全球正进入一个很多人没有经历过的状态：海外通胀高企、货币紧缩、欧美经济衰退概率加大、地缘冲突持续；国内疫情继续散发，扰动经济复苏。科技行业从全球化到区域化的趋势有所加速。在逆全球化、科技遏制和反遏制时代中，半导体行业的成长属性越来越强，周期属性越来越弱。能源安全是户用光伏和储能快速发展的中长期刺激因素。本基金将逐步加大对改变气候变化相关的科技领域的研究和投资。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金的份额净值增长率为-2.30%，同期业绩比较基准收益率为-13.19%。

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 | 439,662,797.08 | 79.38 |
| | 其中：股票 | 439,662,797.08 | 79.38 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 79,473,636.49 | 14.35 |
| | 其中：债券 | 79,473,636.49 | 14.35 |
| | 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 | 34,380,851.55 | 6.21 |
| 8 | 其他各项资产 | 382,893.19 | 0.07 |

| | | | |
|---|----|----------------|--------|
| 9 | 合计 | 553,900,178.31 | 100.00 |
|---|----|----------------|--------|

注：1、由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

2、报告期末，本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为2,471,291.86元，占基金资产净值的比例为0.45%。

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 | 420,824,144.76 | 76.44 |
| 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 | 16,367,360.46 | 2.97 |
| 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 | 437,191,505.22 | 79.41 |

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

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（%） |
|---------|--------------|--------------|
| 消费者非必需品 | 2,471,291.86 | 0.45 |
| 合计 | 2,471,291.86 | 0.45 |

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

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 | 688032 | 禾迈股份 | 38,958 | 42,787,181.82 | 7.77 |
| 2 | 688072 | 拓荆科技 | 135,990 | 40,593,015.00 | 7.37 |
| 3 | 300666 | 江丰电子 | 386,600 | 35,636,788.00 | 6.47 |
| 4 | 688063 | 派能科技 | 88,305 | 35,322,000.00 | 6.42 |
| 5 | 688348 | 昱能科技 | 56,721 | 34,978,706.28 | 6.35 |
| 6 | 002371 | 北方华创 | 120,400 | 33,519,360.00 | 6.09 |
| 7 | 002920 | 德赛西威 | 240,800 | 33,218,360.00 | 6.03 |
| 8 | 688800 | 瑞可达 | 212,251 | 27,592,630.00 | 5.01 |
| 9 | 688234 | 天岳先进 | 225,924 | 24,334,274.04 | 4.42 |
| 10 | 688052 | 纳芯微 | 54,373 | 16,367,360.46 | 2.97 |

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 | - | - |
| 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） | 79,473,636.49 | 14.44 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |

| | | | |
|----|----|---------------|-------|
| 10 | 合计 | 79,473,636.49 | 14.44 |
|----|----|---------------|-------|

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

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 | 123123 | 江丰转债 | 90,070 | 16,798,573.21 | 3.05 |
| 2 | 110056 | 亨通转债 | 122,250 | 16,780,570.89 | 3.05 |
| 3 | 128095 | 恩捷转债 | 53,030 | 16,221,797.09 | 2.95 |
| 4 | 110085 | 通22转债 | 116,430 | 14,890,931.28 | 2.70 |
| 5 | 113053 | 隆22转债 | 119,770 | 14,781,764.02 | 2.69 |

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

本报告期末本基金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

本报告期末本基金未持有贵金属。

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

本报告期末本基金未持有权证。

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

本报告期末本基金未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期末本基金未投资股指期货。若本基金投资股指期货，在股指期货投资上，本基金以套期保值为目标，在控制风险的前提下，谨慎适当参与股指期货的投资。本基金在进行股指期货投资中，将分析股指期货的收益性、流动性及风险特征，主要选择流动性好、交易

活跃的期货合约，通过研究现货和期货市场的发展趋势，运用定价模型对其进行合理估值，谨慎利用股指期货，调整投资组合的风险暴露，及时调整投资组合仓位，以降低组合风险、提高组合的运作效率。

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

本报告期末本基金未持有国债期货，没有相关投资政策。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本报告期末本基金未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本报告期末本基金未持有国债期货，没有相关投资评价。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本报告期内，经查询上海证券交易所、深圳证券交易所等机构公开信息披露平台，本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 本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股票。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 91,792.19 |
| 2 | 应收证券清算款 | 291,101.00 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 382,893.19 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|-------|---------------|--------------|
| 1 | 123123 | 江丰转债 | 16,798,573.21 | 3.05 |
| 2 | 110056 | 亨通转债 | 16,780,570.89 | 3.05 |
| 3 | 128095 | 恩捷转债 | 16,221,797.09 | 2.95 |
| 4 | 110085 | 通22转债 | 14,890,931.28 | 2.70 |
| 5 | 113053 | 隆22转债 | 14,781,764.02 | 2.69 |

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末本基金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

| | |
|----------------|----------------|
| 本报告期初基金份额总额 | 556,025,745.68 |
| 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 | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 556,025,745.68 |

注：总申购份额包含本报告期内发生的转换入和红利再投资份额；总赎回份额包含本报告期内发生的转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期内，本基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金。

§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

| 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 | 期初份 | 申购份 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |

| | | | | | | | |
|---|---|---------------------------------|----------------|---|---|----------------|--------|
| | | 例达到或者超过 20%的时间区间 | 额 | 额 | | | |
| 机构 | 1 | 2022 年 7 月 1 日至 2022 年 9 月 30 日 | 199,999,000.00 | - | - | 199,999,000.00 | 35.97% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| <p>(1) 持有份额比例较高的投资者（“高比例投资者”）大额赎回时易使本基金发生巨额赎回或连续巨额赎回，中小投资者可能面临赎回申请需要与高比例投资者按同比例部分延期办理的风险，赎回款项延期获得。</p> <p>(2) 基金净值大幅波动的风险 高比例投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动；若高比例投资者赎回的基金份额收取赎回费，相应的赎回费用按约定将部分或全部归入基金资产，可能对基金资产净值造成较大波动。</p> <p>(3) 基金规模较小导致的风险 高比例投资者赎回后，可能导致基金规模较小，从而使得基金投资及运作管理的难度增加。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。</p> | | | | | | | |

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准国联安科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金发行及募集的文件
- 2、《国联安科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《国联安科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
- 4、《国联安科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 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

中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 9 楼

9.3 查阅方式

网址：www.cpicfunds.com

国联安基金管理有限公司

二〇二二年十月二十六日