

国联安匠心科技 1 个月滚动持有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	国联安匠心科技 1 个月滚动持有混合
基金主代码	011599
交易代码	011599
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 5 月 18 日
报告期末基金份额总额	90,484,000.76 份
投资目标	在严格控制基金资产投资风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的稳健回报。
投资策略	本基金所指科技主题企业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，主要服务于符合国家战略、突破关键核心技术、市场认可度高的科技创新企业。相关的行业或产业主要有：信息技术领域、高端装备领域、新材料、新能源领域、节能环保领域、生物医

	<p>药领域及其他相关领域。同时，本基金将对科技企业的发展进行密切跟踪，随着科学技术的不断发展，相关上市公司的范围也会相应改变。在履行适当必要的程序后，本基金将根据实际情况调整科技主题的界定标准。</p> <p>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。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数×75%+上证国债指数×25%
风险收益特征	本基金属于混合型证券投资基金，通常预期风险与预期收益水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。本基金将投资港股通标的股票，需承担港股市场股价波动较大的风险、汇率风险、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险以及境外市场的风险等风险。
基金管理人	国联安基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

§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 7 月 1 日-2022 年 9 月 30 日)
1.本期已实现收益	-2,133,760.11
2.本期利润	-2,178,032.32
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0240
4.期末基金资产净值	70,752,055.85
5.期末基金份额净值	0.7819

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，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

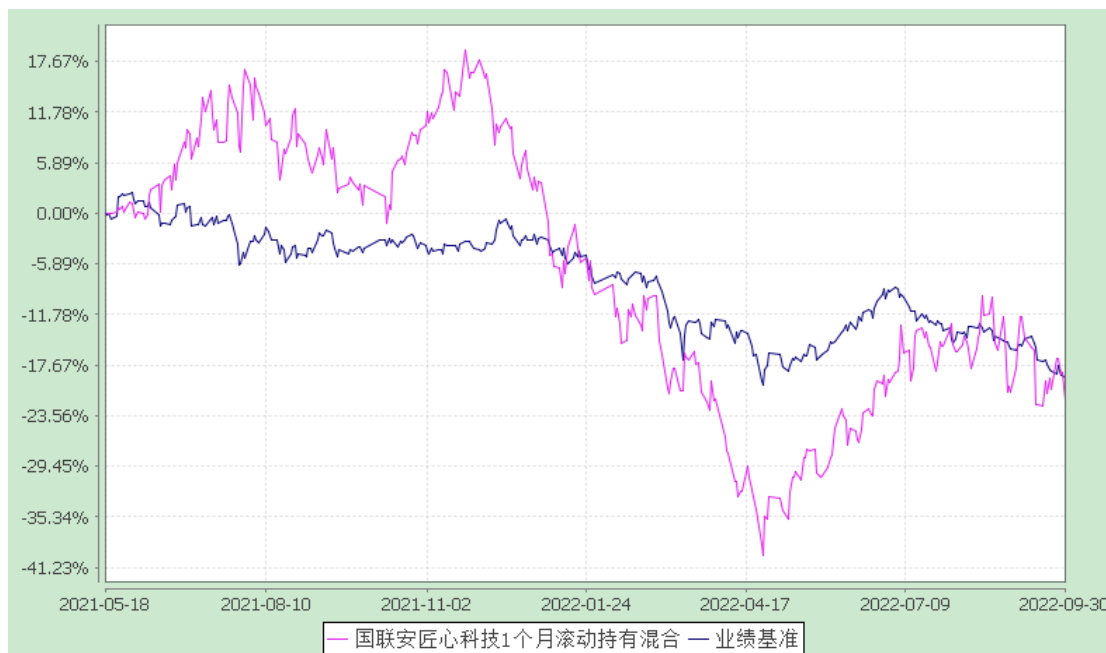
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-2.95%	2.71%	-11.29%	0.67%	8.34%	2.04%
过去六个月	-0.03%	2.64%	-6.83%	0.89%	6.80%	1.75%
过去一年	-24.30%	2.36%	-15.70%	0.88%	-8.60%	1.48%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-21.81%	2.25%	-19.17%	0.87%	-2.64%	1.38%

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

国联安匠心科技 1 个月滚动持有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
 (2021 年 5 月 18 日至 2022 年 9 月 30 日)



- 注：1、本基金业绩比较基准为沪深300指数*75%+上证国债指数*25%；
- 2、本基金基金合同于2021年5月18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。建仓期结束距离本报告期末未满一年，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	2021-05-18	-	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

	资基金 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、 国联安 气候变 化责任 投资混 合型证 券投资 基金基 金经 理。			资经理，GCS 母基金公司、GCS 有限公司、GCS 有限 责任合伙公司独立董事，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。
--	--	--	--	---

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》、《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，本基金增配微逆储能和碳化硅等。

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-2.95%，同期业绩比较基准收益率为-11.29%。

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	66,115,034.09	92.03
	其中：股票	66,115,034.09	92.03
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	5,133,745.58	7.15
8	其他各项资产	589,588.00	0.82
9	合计	71,838,367.67	100.00

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 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	64,160,812.25	90.68
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	1,954,221.84	2.76
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	66,115,034.09	93.45

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末本基金未持有港股通股票。

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	5,217	5,729,778.93	8.10
2	688072	拓荆科技	18,164	5,421,954.00	7.66
3	688063	派能科技	13,364	5,345,600.00	7.56
4	605117	德业股份	12,100	5,084,541.00	7.19
5	688348	昱能科技	8,176	5,041,975.68	7.13
6	300274	阳光电源	42,500	4,701,350.00	6.64
7	002920	德赛西威	30,600	4,221,270.00	5.97
8	300438	鹏辉能源	55,500	4,169,160.00	5.89
9	688223	晶科能源	240,883	4,015,519.61	5.68
10	603606	东方电缆	57,100	3,981,583.00	5.63

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本报告期末本基金未持有债券。

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

本报告期末本基金未持有债券。

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持有股指期货，没有相关投资政策。

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	23,723.89
2	应收证券清算款	564,922.46
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	941.65
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	589,588.00

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末本基金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

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

本报告期期初基金份额总额	90,426,775.24
报告期期间基金总申购份额	1,468,157.06
减：报告期期间基金总赎回份额	1,410,931.54
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	90,484,000.76

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	2022年7月1日至2022年9月30日	40,000,800.00	-	-	40,000,800.00	44.21%
产品特有风险							
(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。 (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。

(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。

§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匠心科技 1 个月滚动持有混合型证券投资基金发行及募集的文件
- 2、《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合同》
- 3、《国联安匠心科技 1 个月滚动持有混合型证券投资基金招募说明书》
- 4、《国联安匠心科技 1 个月滚动持有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