

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 2020 年第 2 季度报告

2020 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：2020 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 2020 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 2020 年 04 月 10 日（基金合同生效日）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	科创平安（扩位简称：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	封闭运作期投资策略： 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。 转为上市开放式基金（LOF）后的投资策略： 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。
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（2020年4月10日-2020年6月30日）
1. 本期已实现收益	2,528,702.40
2. 本期利润	35,548,134.83
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1738
4. 期末基金资产净值	240,105,384.68
5. 期末基金份额净值	1.1738

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. 本基金合同于2020年4月10日生效，截至本报告期末本基金成立未满一季度。

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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
自基金合同生效起至今	17.38%	0.96%	12.94%	0.96%	4.44%	0.00%

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，截至本报告期末基金成立未满半年；
- 2、截止报告期末，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		
张俊生	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	-	14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、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。
李化松	权益投资	2020年4月15日	-	14年	李化松先生，北京大学硕士。先后担任国

	中心投资 董事总经理，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	日			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，现任权益投资中心投 资董事总经理，同时担任平安智慧中国灵 活配置混合型证券投资基金、平安核心优 势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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《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》和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，没有损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

2020 年二季度，全球疫情的影响开始逐渐稳定，市场进入基本面逐渐复苏的验证阶段。新兴

成长和价值成长类资产的估值水平比较合理。

我们在这两类资产之间保持均衡配置，整个季度基本维持了这一配置水平。

我们坚持自下而上的选股策略，所选股票都是长期看好的、基本面优秀的公司，公司有较强的 alpha，并且可能因为疫情获得更快成长。

同时，我们结合年报季报的情况，检验了我们的持股，可喜的是，大部分公司的基本面是符合甚至超出预期的。

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 1.1738 元；本报告期基金份额净值增长率为 17.38%，业绩比较基准收益率为 12.94%。

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量不满 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	221,517,019.61	90.71
	其中：股票	221,517,019.61	90.71
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	22,010,453.40	9.01
8	其他资产	673,938.50	0.28
9	合计	244,201,411.51	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	209,454,420.14	87.23
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	5,132,897.47	2.14
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	655,200.00	0.27
J	金融业	—	—
K	房地产业	4,689,398.00	1.95
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	1,233,024.00	0.51
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	352,080.00	0.15
S	综合	—	—
	合计	221,517,019.61	92.26

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	300014	亿纬锂能	375,286	17,957,435.10	7.48
2	002475	立讯精密	331,122	17,003,114.70	7.08
3	300567	精测电子	192,400	13,131,300.00	5.47
4	002311	海大集团	237,010	11,279,305.90	4.70
5	000858	五粮液	64,300	11,003,016.00	4.58
6	000661	长春高新	25,100	10,926,030.00	4.55
7	000568	泸州老窖	115,800	10,551,696.00	4.39
8	000636	风华高科	318,700	9,302,853.00	3.87
9	300326	凯利泰	307,400	8,945,340.00	3.73
10	002695	煌上煌	346,500	8,738,730.00	3.64

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末无债券投资情况。

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。

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：本基金本报告期末未持有国债期货投资。

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

西藏比邻医疗科技产业中心（有限合伙）（以下简称“西藏比邻”）于2020年4月24日收到深圳证券交易所《关于对西藏比邻医疗科技产业中心（有限合伙）给予通报批评处分的决定》（以

下简称“决定”)。决定指出公司存在以下违法行为:2019年8月28日至9月25日,西藏比邻通过集中竞价方式减持精测电子股份合计136.7万股,交易金额合计7,070.29万元,但未提前3个交易日通知精测电子减持意向和拟减持数量并予以公告,违反了其作出的承诺。上述违反了违反了《创业板股票上市规则(2018年11月修订)》第1.4条、第11.11.1条,《上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》第三条以及《创业板上市公司规范运作指引(2015年修订)》第4.1.4条的规定。本基金管理人对该公司进行了深入的了解和分析,认为该事项对公司的盈利情况暂不会造成重大不利影响。我们对该证券的投资严格执行内部投资决策流程,符合法律法规和公司制度的规定。

广东风华高新科技股份有限公司(以下简称“公司”)于2019年11月25日收到中国证券监督管理委员会广东监管局《行政处罚决定书》(以下简称“决定”)(文件编号:[2019]13号)。决定指出公司存在以下违法行为:一、披露的信息存在虚假记载;二、未及时披露董事会及监事会决议。上述违反了违反了《信息披露管理办法》第二条第一款的规定,以及《证券法》第六十三条的规定,构成《证券法》第一百九十三条第一款所述的信息披露违法行为。本基金管理人对该公司进行了深入的了解和分析,认为该事项对公司的盈利情况暂不会造成重大不利影响。我们对该证券的投资严格执行内部投资决策流程,符合法律法规和公司制度的规定。

上海凯利泰医疗科技股份有限公司(以下简称“公司”)于2020年5月10日收到深交所《关于对上海凯利泰医疗科技股份有限公司股东Ultra Tempo Limited的监管函》(以下简称“决定”)(文件编号:创业板监管函(2020)第64号)。指出公司股东Ultra Tempo Limited存在以下违规行为:Ultra Tempo Limited在持股比例累计变动达到5%时,未能按照《证券法》《上市公司收购管理办法》等规定停止卖出凯利泰股份并履行报告、公告义务,在履行报告和信息披露义务前也未停止卖出凯利泰股票。上述违反了《创业板股票上市规则(2014年11月修订)》《创业板股票上市规则(2018年11月修订)》第1.4条、第2.1条、第11.8.1条的规定。本基金管理人对该公司进行了深入的了解和分析,认为该事项对公司的盈利情况暂不会造成重大不利影响。我们对该证券的投资严格执行内部投资决策流程,符合法律法规和公司制度的规定。

报告期内,本基金投资的前十名证券的其余证券的发行主体没有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、处罚的情况。

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	76,744.04
2	应收证券清算款	594,946.56
3	应收股利	—
4	应收利息	2,247.90
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	673,938.50

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不存在流通受限的情况。

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

基金合同生效日(2020年4月10日)基金 份额总额	204,557,249.85
基金合同生效日起至报告期期末基金 总申购份额	—
减：基金合同生效日起至报告期期末基 金总赎回份额	—
基金合同生效日起至报告期期末基金 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

注：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设立的文件
- (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) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- (5) 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 2020 年第 2 季度报告原文

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

2020 年 7 月 21 日