

建信科技创新混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告

2020 年 12 月 31 日

基金管理人：建信基金管理有限责任公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 1 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 1 月 19 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 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	建信科技创新混合	
基金主代码	008962	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 2 月 17 日	
报告期末基金份额总额	404,755,603.59 份	
投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，积极挖掘科创板所蕴含的投资机会，重点投资科创板股票，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。	
投资策略	本基金采取“自上而下”的方式进行大类资产配置，根据对宏观经济、市场面、政策面等因素进行定量与定性相结合的分析研究，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。	
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）*20%+中证综合债指数收益率*30%	
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，其预期风险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	建信基金管理有限责任公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	建信科技创新混合 A	建信科技创新混合 C
下属分级基金的交易代码	008962	008963
报告期末下属分级基金的份额总额	385,030,894.62 份	19,724,708.97 份

§ 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 10 月 1 日-2020 年 12 月 31 日）	
	建信科技创新混合 A	建信科技创新混合 C
1. 本期已实现收益	55,608,896.96	2,676,371.61
2. 本期利润	123,112,461.50	5,813,809.92
3. 加权平均基金份额本期利润	0.2833	0.2847
4. 期末基金资产净值	506,639,488.82	25,841,710.25
5. 期末基金份额净值	1.3158	1.3101

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 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

建信科技创新混合 A

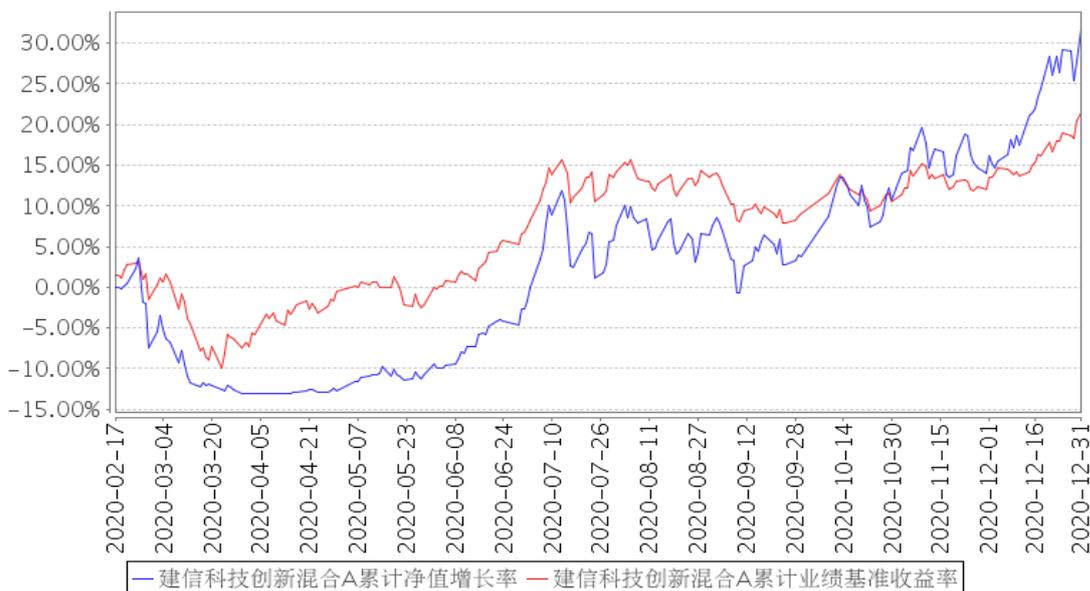
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	26.74%	1.72%	11.44%	0.80%	15.30%	0.92%
过去六个月	35.22%	1.78%	13.92%	0.94%	21.30%	0.84%
自基金合同生效起至今	31.58%	1.55%	21.45%	1.06%	10.13%	0.49%

建信科技创新混合 C

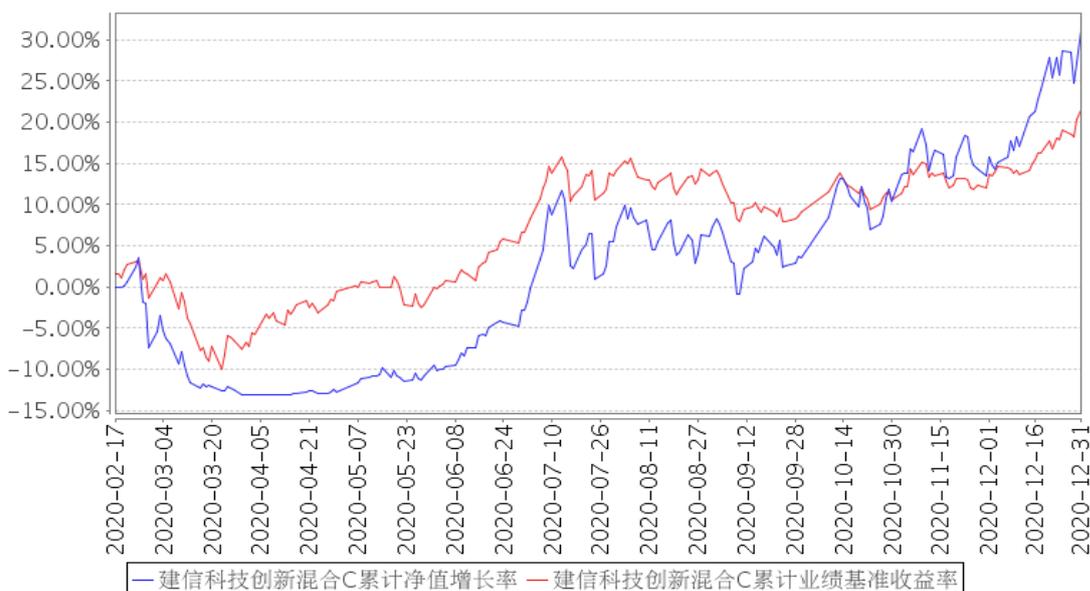
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	26.58%	1.72%	11.44%	0.80%	15.14%	0.92%
过去六个月	34.88%	1.78%	13.92%	0.94%	20.96%	0.84%
自基金合同生效起至今	31.01%	1.55%	21.45%	1.06%	9.56%	0.49%

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

建信科技创新混合A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



建信科技创新混合C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：本基金基金合同于 2020 年 2 月 17 日生效，截至报告期末未满一年。本基金建仓期为 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同相关规定。

3.3 其他指标

无。

§ 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		
黄斐玉	本基金的基金经理	2020年2月17日	-	6年	黄斐玉先生，硕士。曾在摩托罗拉（中国）和中国空间技术研究院担任工程师；2010年11月至2014年9月在联想集团研发中心担任业务主管；2014年9月在招商证券研究发展中心担任计算机行业分析师；2016年11月至今在建信基金研究部历任计算机行业、电子行业研究员、基金经理。2020年2月17日起任建信科技创新混合型证券投资基金的基金经理；2020年3月26日起任建信科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
邵卓	权益投资部副总经理，本基金的基金经理	2020年4月14日	-	10年	邵卓先生，权益投资部副总经理，硕士。2006年4月至2006年12月任明基（西门子）移动通信研发中心软件工程师；2007年2月至2010年7月任IBM中国软件实验室软件工程师；2010年7月加入广发证券公司，任计算机行业研究员。邵卓于2011年9月加入我公司研究部，历任研究部研究员、研究主管，权益投资部基金经理、权益投资部联席投资官兼研究部首席研究官、权益投资部副总经理。2015年3月24日起任建信信息产业股票型证券投资基金的基金经理；2015年5月22日起任建信创新中国混合型证券投资基金的基金经理；2017年12月19日起任建信安心保本三号混合型证券投资基金的基金经理，该基金于2018年1月11日起转型为建信裕利灵活配置混合型证券投资基金，邵卓继续担任该基金的基金经理；2020年4月14日起任建信科技创新混合型证券投资基金的基金经理；2020年7月17日起任建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金、建信中小盘先锋股票型证券投资基金的基金经理。
姚锦	权益投资部首席策略官，本基金的基金经理	2020年2月17日	-	16年	姚锦女士，权益投资部首席策略官，博士。曾任天津通广三星电子有限公司工程师，2004年5月至2011年5月任天弘基金管理公司研究员、研究部副主管、研究部主管、投资部副总经理兼研究总监等职，2009年3月17日至2011年3月3

				<p>日担任天弘永利债券型证券投资基金基金经理；2009 年 12 月 17 日至 2011 年 5 月 5 日任天弘周期策略股票型证券投资基金基金经理。历任建信基金管理公司研究部首席策略分析师、权益投资部副总经理兼研究部首席策略分析师、权益投资部总经理、基金经理。2012 年 2 月 17 日起任建信优选成长混合型证券投资基金的基金经理；2012 年 8 月 14 日至 2014 年 3 月 6 日任建信社会责任股票型证券投资基金的基金经理；2014 年 1 月 20 日起任建信保本混合型证券投资基金的基金经理，该基金于 1 月 23 日起转型为建信积极配置混合型证券投资基金，姚锦继续担任该基金的基金经理；2017 年 6 月 9 日至 2018 年 9 月 12 日任建信核心精选混合型证券投资基金的基金经理；2018 年 1 月 24 日至 2020 年 11 月 9 日任建信龙头企业股票型证券投资基金的基金经理；2020 年 2 月 17 日起任建信科技创新混合型证券投资基金的基金经理；2020 年 3 月 26 日起任建信科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	---

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

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

在本报告期内，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，严格遵守了《证券法》、《证券投资基金法》、其他有关法律法规的规定和《建信科技创新混合型证券投资基金基金合同》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

为了公平对待投资人，保护投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，公司根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》、《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部制度，制定和修订了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》、《公司防范内幕交易管理办法》、《利益冲突管理办法》等风险

管控制度。公司使用的交易系统中设置了公平交易模块，一旦出现不同基金同时买卖同一证券时，系统自动切换至公平交易模块进行操作，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金管理人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的 5% 的情况有 3 次，原因是投资组合投资策略需要，未导致不公平交易和利益输送。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2020 年四季度，A 股各板块普遍上涨。单季度看，有色、电力设备新能源、食品饮料、汽车、家电等行业涨幅居前，传媒、商贸零售、通信等行业下跌较多表现相对较差。新能源和食品饮料，分别成为市场中成长和价值风格的焦点板块。新能源行业中，光伏发电的平价前景，电动车新车销量渗透率不断走高等，都呈现出短期行业数据、中期产业逻辑、长期市场空间共振的情况，成为市场对成长风格最认同的方向。食品饮料的必选消费属性以及白酒的涨价逻辑，是长期投资逻辑下最有吸引力的板块之一，也成为四季度涨幅最大的板块之一。

本基金的配置思路，主要是自上而下的策略判断和自下而上选股相结合，通过寻找和筛选行业以及个股的基本面变化，来争取实现超额收益。四季度组合仓位变化不大，结构上提高了对新能源板块的配置比例，为组合带来一定的超额收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金 A 净值增长率 26.74%，波动率 1.72%，本报告期本基金 C 净值增长率 26.58%，波动率 1.72%；业绩比较基准收益率 11.44%，波动率 0.80%。

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	499,290,177.41	88.03
	其中：股票	499,290,177.41	88.03
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	336,918.19	0.06

	其中：债券	336,918.19	0.06
	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	66,035,961.85	11.64
8	其他资产	1,504,072.31	0.27
9	合计	567,167,129.76	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 26,474,207.02 元，占期末基金资产净值比例为 4.97%。

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	390,560,758.78	73.35
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	19,998.88	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	26,037,675.20	4.89
J	金融业	18,375,147.21	3.45
K	房地产业	8,975.14	0.00
L	租赁和商务服务业	31,648,876.47	5.94
M	科学研究和技术服务业	15,649.20	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	203,672.01	0.04
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	5,945,217.50	1.12
S	综合	-	-
	合计	472,815,970.39	88.79

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（%）
------	-----------	--------------

Materials 材料	-	-
Consumer Staples 日常生活消费品	-	-
Consumer Discretionary 非日常消费品	26,474,207.02	4.97
Energy 能源	-	-
Financials 金融	-	-
Health Care 医疗保健	-	-
Industrials 工业	-	-
Real Estate 房地产	-	-
Information Technology 信息技术	-	-
Telecommunication Services 通讯服务	-	-
Utilities 公用事业	-	-
合计	26,474,207.02	4.97

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	002709	天赐材料	272,500	28,285,500.00	5.31
2	00175 HG	吉利汽车	1,187,000	26,474,207.02	4.97
3	601888	中国中免	87,483	24,709,573.35	4.64
4	688017	绿的谐波	157,276	23,040,934.00	4.33
5	002984	森麒麟	717,607	18,220,041.73	3.42
6	002475	立讯精密	310,100	17,402,812.00	3.27
7	300677	英科医疗	100,700	16,932,705.00	3.18
8	300059	东方财富	537,444	16,660,764.00	3.13
9	600438	通威股份	395,700	15,210,708.00	2.86
10	600887	伊利股份	327,400	14,526,738.00	2.73

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）	336,918.19	0.06
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	336,918.19	0.06

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	128136	立讯转债	1,486	188,989.48	0.04
2	113038	隆 20 转债	720	126,928.80	0.02
3	113616	韦尔转债	210	20,999.91	0.00

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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

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

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

本基金该报告期内投资前十名证券的发行主体未披露被监管部门立案调查和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未超出基金合同规定的投资范围。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	693,469.41
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,402.55
5	应收申购款	802,200.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,504,072.31

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

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

项目	建信科技创新混合 A	建信科技创新混合 C
----	------------	------------

报告期期初基金份额总额	520,721,390.01	22,921,246.60
报告期期间基金总申购份额	32,808,634.82	12,414,759.19
减:报告期期间基金总赎回份额	168,499,130.21	15,611,296.82
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	385,030,894.62	19,724,708.97

注:如有相应情况,申购含红利再投、转换入份额及金额,赎回含转换出份额及金额。

§ 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

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

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

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. 中国证监会批准建信科技创新混合型证券投资基金设立的文件;
2. 《建信科技创新混合型证券投资基金基金合同》;
3. 《建信科技创新混合型证券投资基金招募说明书》;
4. 《建信科技创新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. 报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。也可在支付工本费后，在合理时间内取得上述文件的复印件。

建信基金管理有限责任公司

2021 年 1 月 21 日