# 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

# 2020 年第 4 季度报告

2020年12月31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: 二〇二一年一月二十二日

# §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2021年1月21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                    | 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                  | 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       |  |  |
| 机次日仁                    | 在严格控制风险的前提下,力争获得超越业绩比较基准的 |  |  |
| 投资目标                    | 稳健回报。                     |  |  |
|                         | 本基金投资策略的核心在于重点关注并跟踪具备较强盈  |  |  |
| Let Mer felle u.f.      | 利能力和可持续成长能力的科技创新主题上市公司,挖掘 |  |  |
| 投资策略<br>                | 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。            |
|--------|-------------------------------|
|        | 中国战略新兴产业成份指数收益率×50%+恒生指数收益    |
| 业绩比较基准 | 率(使用估值汇率折算)×10%+中债综合指数收益率×40% |
| 日仍此处此江 | 本基金为混合型基金,理论上其预期风险和预期收益水平     |
| 风险收益特征 | 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

| <b>主西时夕</b> 化标  | 报告期                      |
|-----------------|--------------------------|
| 主要财务指标          | (2020年10月1日-2020年12月31日) |
| 1. 本期已实现收益      | 5, 720, 930. 70          |
| 2. 本期利润         | 23, 343, 425. 98         |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0420                   |
| 4. 期末基金资产净值     | 662, 527, 888. 69        |
| 5. 期末基金份额净值     | 1. 1915                  |

- 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<br>率标准差<br>② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | 1)-(3)   | 2-4    |
|----------------|---------|-------------------|--------------------|---------------------------|----------|--------|
| 过去三个月          | 3. 64%  | 1. 08%            | 10. 14%            | 0.74%                     | -6. 50%  | 0. 34% |
| 过去六个月          | 4. 08%  | 1. 23%            | 13.01%             | 0.87%                     | -8.93%   | 0.36%  |
| 过去一年           | _       | -                 | -                  | _                         | _        | _      |
| 过去三年           | _       | -                 | -                  | _                         | _        | _      |
| 过去五年           | -       | _                 | -                  | _                         | _        | _      |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 19. 15% | 1. 19%            | 30. 28%            | 0.87%                     | -11. 13% | 0. 32% |

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 2020 年 12 月 31 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。截至报告期末,本基金成立不满一年;
- 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

| 地友 | TII 夕                 | 任本基金的基     | 基金经理期限 | 证券从业年            | 2A BB  |
|----|-----------------------|------------|--------|------------------|--|
| 姓名 | 姓名   职务   —— 任        | 任职日期       | 离任日期   | 限                | 说明   |
| 潘明 | 本基金<br>理 任 安 动 票<br>型 | 2020-03-20 | _      | 11年(自<br>2009年起) | 潘明先生,硕士研究生。<br>1996年6月至1998年6月<br>在计算机科学公司担任咨<br>询师;1998年8月至2005<br>年5月在摩托罗拉公司担任<br>高级行政工程师;2003年1<br>月至2003年12月在扎克斯 |

券投资 投资管理公司担任投资分 基金基 析师; 2004年4月至2005 金经 年5月在短剑投资公司担任 理、国 执行董事; 2005 年 5 月至 联安优 2009 年 7 月在指导资本公 司担任基金经理兼大宗商 选行业 品研究总监: 2009年8月至 混合型 证券投 2010 年 3 月在海通证券股 资基金 份有限公司担任投资经理; 基金经 2010年1月至2013年1月 理。 在 GCS 母基金公司、GCS 有 限公司、GCS 有限责任合伙 公司担任独立董事; 2010 年 3 月至 2012 年 10 月在光 大证券资产管理有限公司 担任投资经理助理; 2012 年 10 月至 2013 年 12 月在 光大证券资产管理有限公 司担任投资经理。2013年 12 月起加入国联安基金管 理有限公司,担任基金经理 助理。现任权益投资部副总 监。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。

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。

#### 4.2 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未发现有超过该证券当日成交量 5%的情况。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

2020年四季度 A 股市场加速上涨,尤其在最后两个月。TMT 板块分化严重,电气设备板块上涨近 30%,大幅跑赢沪深 300,但传统的电子、计算机、通信和传媒行业板块全部跑输沪深 300,传媒板块跌幅更超过 6%。电气设备中的新能源汽车和光伏主题表现靓丽,电子中的半导体和品牌消费电子主题涨幅靠前。四季度,本基金加大了对动力电池和半导体的配置,降低了对计算机、传媒和通信的配置。

电动汽车可能在过去几十年里首次在全球汽车市场里创造指数级增长,这可能也是中国新势力弯道超车的历史性机遇。在半导体领域,目前功率半导体等产业的景气度高,带来涨

价压力,但技术推动带来的创新是通缩的,因此涨价大概率只是短期现象。本基金将关注 TMT 行业可能的春季躁动,同时从长期稳定的科技投资价值观角度出发,坚持站在科技创新 中正确的一边,也就是拥抱带来"破坏性"创造的行业和公司,并规避被创造性破坏的行业 和公司。

# 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3.64%,同期业绩比较基准收益率为10.14%。

# 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               | 332,173,917.28 | 50.05        |
|    | 其中: 股票             | 332,173,917.28 | 50.05        |
| 2  | 基金投资               | -              | -            |
| 3  | 固定收益投资             | 93,723,018.32  | 14.12        |
|    | 其中:债券              | 93,723,018.32  | 14.12        |
|    | 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 | 1              | -            |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计       | 234,536,777.08 | 35.34        |
| 8  | 其他各项资产             | 3,222,641.90   | 0.49         |
| 9  | 合计                 | 663,656,354.58 | 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<br>比例(%) |
|----|------------------|-------------------|------------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | _                 |                  |
| В  | 采矿业              | _                 | _                |
| С  | 制造业              | 216, 594, 360. 38 | 32. 69           |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | _                 | _                |
| Е  | 建筑业              | _                 | _                |
| F  | 批发和零售业           | _                 | _                |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | _                 | _                |
| Н  | 住宿和餐饮业           | _                 | _                |
| Ι  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 77, 046, 606. 90  | 11. 63           |
| J  | 金融业              | 3, 044, 200. 00   | 0.46             |
| 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    | -                 | _                |
| 0  | 居民服务、修理和其他服务业    | _                 | _                |
| Р  | 教育               | _                 | -                |
| Q  | 卫生和社会工作          | _                 | _                |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | 35, 488, 750. 00  | 5. 36            |
| S  | 综合               |                   | _                |
|    | 合计               | 332, 173, 917. 28 | 50. 14           |

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投资。

# 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

| D D | 肌蛋化粒   | 肌面力粉 | ₩ <b>, 旱, / ロ</b> /L \ | 八五八唐(二)          | 占基金资产净 |
|-----|--------|------|------------------------|------------------|--------|
| 序号  | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股)                  | 公允价值(元)          | 值比例(%) |
| 1   | 300750 | 宁德时代 | 111, 409               | 39, 116, 813. 99 | 5. 90  |
| 2   | 300782 | 卓胜微  | 63, 380                | 36, 160, 825. 20 | 5. 46  |
| 3   | 300413 | 芒果超媒 | 489, 500               | 35, 488, 750. 00 | 5. 36  |
| 4   | 600845 | 宝信软件 | 500, 900               | 34, 552, 082. 00 | 5. 22  |
| 5   | 300661 | 圣邦股份 | 117, 173               | 30, 910, 237. 40 | 4.67   |
| 6   | 300014 | 亿纬锂能 | 292, 708               | 23, 855, 702. 00 | 3.60   |
| 7   | 002371 | 北方华创 | 128, 193               | 23, 169, 602. 82 | 3. 50  |
| 8   | 688200 | 华峰测控 | 44, 880                | 16, 764, 026. 40 | 2. 53  |
| 9   | 688111 | 金山办公 | 39, 026                | 16, 039, 686. 00 | 2.42   |
| 10  | 603501 | 韦尔股份 | 64, 300                | 14, 859, 730. 00 | 2. 24  |

# 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| ri I | /丰. A. L. T.Y. | Λ Δ ΙΔ ΙΕ ( Ξ )  | 占基金资产净值 |
|------|----------------|------------------|---------|
| 序号   | 债券品种           | 公允价值(元)          | 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)     | 93, 723, 018. 32 | 14. 15  |
| 8    | 同业存单           | -                | _       |
| 9    | 其他             | -                | _       |
| 10   | 合计             | 93, 723, 018. 32 | 14. 15  |

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)   占基金贷产净 |  | 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 | 128112 | 歌尔转 2 | 220, 905 | 35, 329, 336. 65 | 5. 33  |
| 2 | 123058 | 欣旺转债  | 128, 121 | 19, 967, 657. 85 | 3. 01  |
| 3 | 110051 | 中天转债  | 159, 990 | 19, 077, 207. 60 | 2. 88  |
| 4 | 113577 | 春秋转债  | 165, 590 | 18, 973, 302. 20 | 2.86   |
| 5 | 128136 | 立讯转债  | 1, 498   | 190, 515. 64     | 0.03   |

# 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, 或在本报告编制目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   | 85, 115. 62     |
| 2  | 应收证券清算款 | 2, 961, 663. 02 |
| 3  | 应收股利    | _               |
| 4  | 应收利息    | 175, 863. 26    |
| 5  | 应收申购款   | _               |
| 6  | 其他应收款   | _               |
| 7  | 待摊费用    | _               |
| 8  | 其他      | _               |
| 9  | 合计      | 3, 222, 641. 90 |

# 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  | 128112 | 歌尔转 2 | 35, 329, 336. 65 | 5. 33        |
| 2  | 110051 | 中天转债  | 19, 077, 207. 60 | 2.88         |

| 3 113577 | 春秋转债 | 18, 973, 302. 20 | 2.86 |
|----------|------|------------------|------|
|----------|------|------------------|------|

# 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  | 556, 025, 745. 68 |  |  |
|---------------|-------------------|--|--|
| 报告期基金总申购份额    | -                 |  |  |
| 减: 报告期基金总赎回份额 | -                 |  |  |
| 报告期基金拆分变动份额   | -                 |  |  |
| 本报告期期末基金份额总额  | 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

|        | 报告期内持有基金份额变化情况 |                                |                          |       | 报告期末持有基金情况 |               |         |
|--------|----------------|--------------------------------|--------------------------|-------|------------|---------------|---------|
| 投资者 类别 | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过<br>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              | 2020年10月1日<br>至2020年12月<br>31日 | 199, 99<br>9, 000.<br>00 | -     | _          | 199, 999, 000 | 35. 97% |
| 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 二〇二一年一月二十二日