

安信创新先锋混合型发起式证券投资基金 2021 年第 2 季度报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：安信基金管理有限责任公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 7 月 20 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 7 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 2021 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 安信创新先锋混合发起 |
| 基金主代码 | 010237 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2020 年 10 月 30 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 166,242,877.34 份 |
| 投资目标 | 本基金在深入的基本面研究的基础上，通过精选具有持续创新能力的上市公司，力争实现基金资产的长期稳健增值。 |
| 投资策略 | 本基金将基于各项重要的经济指标分析宏观经济趋势，结合货币财政政策形势、行业发展状况、证券市场走势等综合分析，主动判断所处经济周期和市场时机，进行积极的资产配置。本基金将根据各类资产风险收益特征的相对变化，对未来各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估，制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。本基金在契合创新先锋主题的基础上，通过定性和定量相结合的方法，重点关注在行业内的竞争优势明显且具备较好成长性的上市公司，在充分研究公司的商业模式、核心竞争力、管理层、治理水平、成长空间、所在行业的发展前景和竞争格局等的背景下，结合估值水平和企业基本面等相关指标，精选出具备投资潜力的个股。债券投资策略方面，通过比较不同券种之间的收益率水平、流动性、信用风险等因素评估债券的内在投资价值，灵活运用多种策略进行债券组合的配置。衍生品投资策略方面，本基金在 |

| | | |
|-----------------|--|-----------------|
| | 严格遵守相关法律法规情况下，合理利用股指期货等衍生工具做套保或套利投资。投资的原则是控制投资风险、稳健增值。其中股指期货以对冲持仓现货波动风险为主要原则。资产支持证券投资策略方面，本着风险调整后收益最大化的原则，确定资产支持证券类别资产的合理配置比例，保证本金相对安全和基金资产流动性，以期获得长期稳定收益。融资业务策略方面，在条件许可的情况下，基金管理人可在不改变本基金既有投资目标、策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，根据相关法律法规，参与融资业务，以提高投资效率及进行风险管理。 | |
| 业绩比较基准 | 中证 800 指数收益率*60%+中债总指数(全价)收益率*30%+恒生指数收益率(使用估值汇率折算)*10% | |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金通过港股通投资于香港证券市场，会面临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。 | |
| 基金管理人 | 安信基金管理有限责任公司 | |
| 基金托管人 | 招商银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 安信创新先锋混合发起 A | 安信创新先锋混合发起 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 010237 | 010238 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 126,769,931.15 份 | 39,472,946.19 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（2021 年 4 月 1 日-2021 年 6 月 30 日） | |
|-----------------|-------------------------------------|---------------|
| | 安信创新先锋混合发起 A | 安信创新先锋混合发起 C |
| 1. 本期已实现收益 | 12,082,398.14 | 3,676,263.71 |
| 2. 本期利润 | 25,760,318.81 | 7,956,236.07 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.1626 | 0.1616 |
| 4. 期末基金资产净值 | 138,885,415.30 | 43,099,693.06 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.0956 | 1.0919 |

注：1、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；

2、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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

安信创新先锋混合发起 A

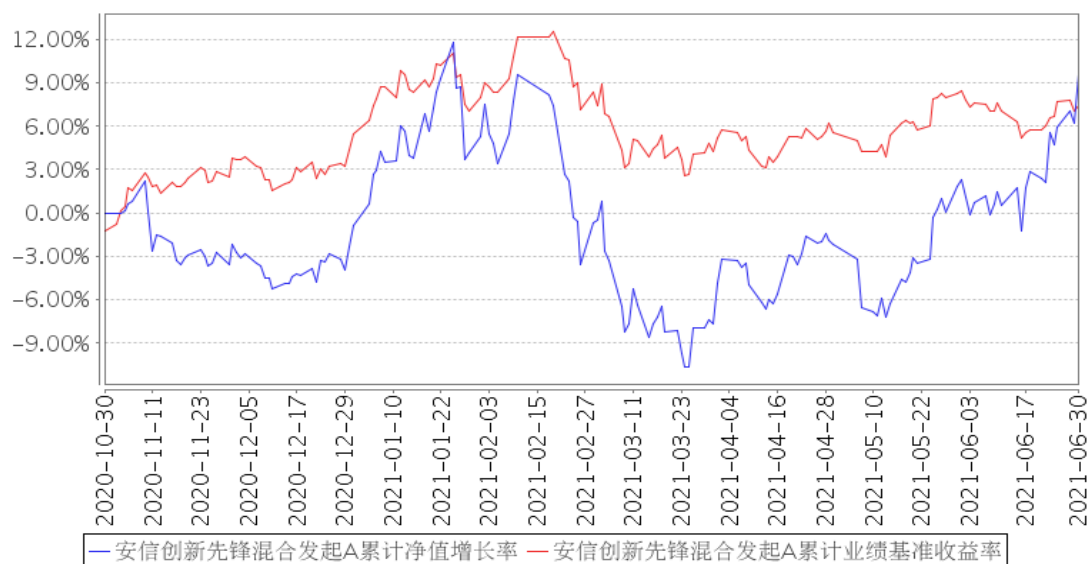
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 18.64% | 1.39% | 2.99% | 0.58% | 15.65% | 0.81% |
| 过去六个月 | 10.54% | 1.64% | 1.79% | 0.80% | 8.75% | 0.84% |
| 自基金合同生效起至今 | 9.56% | 1.47% | 7.39% | 0.76% | 2.17% | 0.71% |

安信创新先锋混合发起 C

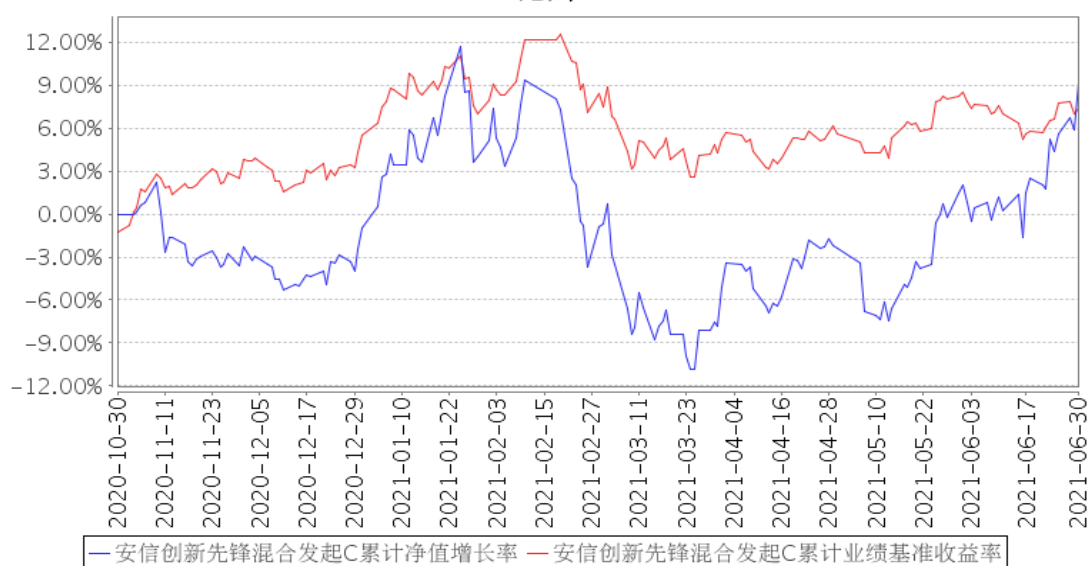
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 18.49% | 1.39% | 2.99% | 0.58% | 15.50% | 0.81% |
| 过去六个月 | 10.26% | 1.64% | 1.79% | 0.80% | 8.47% | 0.84% |
| 自基金合同生效起至今 | 9.19% | 1.47% | 7.39% | 0.76% | 1.80% | 0.71% |

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

安信创新先锋混合发起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



安信创新先锋混合发起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：1、本基金基金合同生效日为 2020 年 10 月 30 日，截止至报告期末本基金合同生效未满一年。

2、本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

§ 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 | | |
| 谭珏娜 | 本基金的基金经理 | 2020 年 10 月 30 日 | - | 15.0 年 | 谭珏娜女士，经济学学士。历任招商证券股份有限公司国际业务部业务助理、安信证券股份有限公司证券投资部内部风险控制员、交易员，安信基金管理有限责任公司运营部交易员、特定资产管理部投资经理助理、投资银行部投资经理、研究部研究员。现任安信基金管理有限责任公司权益投资部基金经理。曾任安信工业 4.0 主题沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理，安信中国制造 2025 沪港深灵活配置混合型证券投资基金、安信合作创新主题沪港深灵活配置混合型证券投资基金、安信新回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。现任安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金的基金经理助理，安信工业 4.0 主题沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金、安信创新先锋混合型发起式证券投资基 |

| | | | | | |
|-----|----------|----------------|---|-------|--|
| | | | | | 金的基金经理。 |
| 张天麒 | 本基金的基金经理 | 2021 年 2 月 3 日 | - | 4.0 年 | 张天麒先生，会计学硕士。历任新疆前海联合基金管理有限公司研究发展部研究员，安信基金管理有限责任公司研究部研究员，现任安信基金管理有限责任公司研究部研究员兼基金经理助理。曾任安信创新先锋混合型发起式证券投资基金的基金经理助理。现任安信创新先锋混合型发起式证券投资基金的基金经理。 |

注：1、此处的“任职日期”、“离任日期”根据公司决定的公告（生效）日期填写。

2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

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

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

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》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规、监管部门的相关规定及基金合同的约定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有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

本报告期内，本基金管理人严格执行《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，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易不存在成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

今年上半年，本基金坚持深耕科技行业，重点布局了电子行业（包括半导体），同时对新能源、医药做了少量布局。从布局思路上来讲，我们从行业景气度和产业趋势出发，深入调研，并

进行比较分析，筛选出成长性好、性价比高的品种。因此，我们主要精选了半导体设备/材料、新能源上游供应链、VR 供应链的相关标的，获取了较好的收益。其中，半导体板块的投资取得了较好的收益，对组合的贡献较大，新能源行业标的的收益兑现的时间过早，给组合的贡献一般。虽然目前市场的一些赛道比较火热，但我们还是会控制面向单一行业的风险敞口，不会让某一个单一行业的持仓占比过高，尽可能在做好风险控制和回撤控制。展望下半年，市场难免会有颠簸，但我们判断短期市场风格仍然会在成长这一侧，我们会尽可能把握机会。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金 A 类基金份额净值为 1.0956 元，本报告期基金份额净值增长率为 18.64%；截至本报告期末本基金 C 类基金份额净值为 1.0919 元，本报告期基金份额净值增长率为 18.49%；同期业绩比较基准收益率为 2.99%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金为发起式基金，且基金合同生效未满 3 年，故报告期不存在需要说明的情况。

§ 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 | 165,121,695.76 | 85.37 |
| | 其中：股票 | 165,121,695.76 | 85.37 |
| 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 | 16,247,718.49 | 8.40 |
| 8 | 其他资产 | 12,040,583.48 | 6.23 |
| 9 | 合计 | 193,409,997.73 | 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 | 11,290.28 | 0.01 |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 143,204,182.78 | 78.69 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 13,020.39 | 0.01 |
| E | 建筑业 | 25,371.37 | 0.01 |
| F | 批发和零售业 | 46,404.58 | 0.03 |
| 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 | 6,516,398.54 | 3.58 |
| J | 金融业 | 34,721.10 | 0.02 |
| K | 房地产业 | 10,095.90 | 0.01 |
| L | 租赁和商务服务业 | 2,130.30 | 0.00 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 35,742.75 | 0.02 |
| 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 | 149,899,357.99 | 82.37 |

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（%） |
|----------|---------------|--------------|
| 房地产 | 1,004,270.63 | 0.55 |
| 非日常生活消费品 | 3,138,231.32 | 1.72 |
| 工业 | 1,672,172.93 | 0.92 |
| 金融 | 224,661.60 | 0.12 |
| 日常消费品 | 421,323.71 | 0.23 |
| 通讯服务 | 413,543.76 | 0.23 |
| 信息技术 | 6,945,438.32 | 3.82 |
| 医疗保健 | 920,089.10 | 0.51 |
| 原材料 | 482,606.40 | 0.27 |
| 合计 | 15,222,337.77 | 8.36 |

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 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 | 603501 | 韦尔股份 | 59,598 | 19,190,556.00 | 10.55 |
| 2 | 300782 | 卓胜微 | 29,560 | 15,888,500.00 | 8.73 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|---------------|------|
| 3 | 002371 | 北方华创 | 41,500 | 11,511,270.00 | 6.33 |
| 4 | 688012 | 中微公司 | 66,721 | 11,070,348.32 | 6.08 |
| 5 | 600460 | 士兰微 | 189,400 | 10,672,690.00 | 5.86 |
| 6 | 300115 | 长盈精密 | 444,653 | 9,159,851.80 | 5.03 |
| 7 | 002241 | 歌尔股份 | 214,000 | 9,146,360.00 | 5.03 |
| 8 | 002415 | 海康威视 | 117,640 | 7,587,780.00 | 4.17 |
| 9 | 300327 | 中颖电子 | 75,500 | 6,434,865.00 | 3.54 |
| 10 | 300124 | 汇川技术 | 83,300 | 6,185,858.00 | 3.40 |

5.3.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

本基金本报告期末未持有全国中小企业股份转让系统挂牌股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末持有债券。

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

本基金本报告期末持有债券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理原则，以套期保值、对冲投资组合的系统性风险为目的，优先选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。基于本基金的个股精选配置，在系统性风险积累较大时，通过适当的股指期货头寸对冲系统性风险，力争获取个股的超额收益和对冲组合的绝对收益。

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

本基金的国债期货投资根据风险管理原则，以套期保值为目的，以对冲风险为主。国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现资产的长期稳定增值。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

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

报告期内本基金投资的前十名证券除长盈精密（股票代码：300115 SZ）、汇川技术（股票代码：300124 SZ）、韦尔股份（股票代码：603501 SH）外其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2020 年 7 月 30 日，深圳市长盈精密技术股份有限公司因违规经营、涉嫌违反法律法规被深圳市市场监管局宝安监管局查封、扣押【深市监宝监强字（2020）0003791 号、深市监宝监解字（2020）0001297 号】。

2021 年 5 月 18 日，深圳市汇川技术股份有限公司因未依法履行职责被广东省通信管理局责令改正。

2021 年 5 月 6 日，上海韦尔半导体股份有限公司因未及时披露公司重大事件被上海证监局警示【沪证监决[2021]67 号】。

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

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | 11,883,850.16 |
| 3 | 应收股利 | 84,114.17 |
| 4 | 应收利息 | 3,262.90 |
| 5 | 应收申购款 | 69,356.25 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 12,040,583.48 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末持有债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|----------------|--------------|----------|
| 1 | 600460 | 士兰微 | 10,672,690.00 | 5.86 | 重大事项停牌 |

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 | 安信创新先锋混合发起 A | 安信创新先锋混合发起 C |
|---------------------------|----------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 167,723,361.67 | 53,358,386.61 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 1,285,643.43 | 1,296,210.90 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 42,239,073.95 | 15,181,651.32 |
| 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 | 126,769,931.15 | 39,472,946.19 |

§ 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

单位：份

| 项目 | 安信创新先锋混合发起 A | 安信创新先锋混合发起 C |
|------------------|--------------|---------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | - | 10,000,472.22 |
| 报告期期间买入/申购总份额 | - | - |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | - | - |

| | | |
|--------------------------|---|---------------|
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | - | 10,000,472.22 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%) | - | 6.02 |

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目 | 持有份额总数 | 持有份额占基金总份额比例(%) | 发起份额总数 | 发起份额占基金总份额比例(%) | 发起份额承诺持有期限 |
|-------------|---------------|-----------------|---------------|-----------------|------------|
| 基金管理人固有资金 | 10,000,472.22 | 6.02 | 10,000,472.22 | 6.02 | 3年 |
| 基金管理人高级管理人员 | - | - | - | - | - |
| 基金经理等人员 | - | - | - | - | - |
| 基金管理人股东 | - | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - | - |
| 合计 | 10,000,472.22 | 6.02 | 10,000,472.22 | 6.02 | - |

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予安信创新先锋混合型发起式证券投资基金募集的文件；
- 2、《安信创新先锋混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信创新先锋混合型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、《安信创新先锋混合型发起式证券投资基金招募说明书》；
- 5、中国证监会要求的其它文件。

10.2 存放地点

本基金管理人和基金托管人的住所。

10.3 查阅方式

上述文件可在安信基金管理有限责任公司互联网站上查阅，或者在营业时间内到安信基金管理有限责任公司查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人安信基金管理有限责任公司。

客户服务电话：4008-088-088

网址：<http://www.essencefund.com>

安信基金管理有限责任公司

2021 年 7 月 20 日