

中银证券科技创新 3 年封闭运作灵活配置 混合型证券投资基金 2021 年第 2 季度报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：中银国际证券股份有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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	中银证券科技创新 3 年封闭混合
场内简称	BOCI 科创 扩位简称：中银证券科技创新
基金主代码	501095
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 3 月 12 日
报告期末基金份额总额	884,675,264.70 份
投资目标	在严格控制风险的前提下，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	<p>本基金将通过跟踪考量通常的宏观经济变量（包括 GDP 增长率、CPI 走势、M2 的绝对水平和增长率、利率水平与走势等）以及各项国家政策（包括财政、货币、税收、汇率政策等）来判断经济周期目前的位置以及未来将发展的方向，在此基础上对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。</p> <p>封闭运作期内，本基金在投资股票时，将根据市场整体估值水平评估系统性风险，同时根据个股估值水平（中证 800 指数的市净率 P/B）决定股票资产的投资比例。</p> <p>本基金通过自上而下及自下而上相结合的方式，密切关注科技创新前沿，挖掘优质的上市公司，构建股票投资组合。针对科创板，本基金将从上市公司的成长性、科技研发能力、公司治理结构、估值水平等方面对科技创新主题的上市公司进行综合评价。</p> <p>本基金所指科技创新主题相关证券主要是指坚持面向世界科技前沿、面向经济主战场、面向国家重大需求的科技创新，主要投资于包括符合国家战略、突破关键核心技术、市场认可度高，属于新一代信息技</p>

	术、高端装备、新材料、新能源、节能环保以及生物医药等高新技术产业和战略性新兴产业，属于互联网、大数据、云计算、人工智能和制造业深度融合等方面的科技创新上市公司。
业绩比较基准	封闭运作期内，本基金的业绩比较基准为：中国战略新兴产业成份指数收益率*55%+中债综合全价指数收益率*45% 封闭运作期届满转型后，本基金的业绩比较基准为：中国战略新兴产业成份指数收益率*80%+中债综合全价指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，其预期风险和预期收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。本基金封闭运作期内将参与科创板发行人战略配售股票投资，由此产生的投资风险与价格波动由投资者自行承担。
基金管理人	中银国际证券股份有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

§ 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（2021年4月1日-2021年6月30日）
1. 本期已实现收益	-36,057,782.38
2. 本期利润	117,786,575.88
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1331
4. 期末基金资产净值	988,090,842.56
5. 期末基金份额净值	1.1169

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

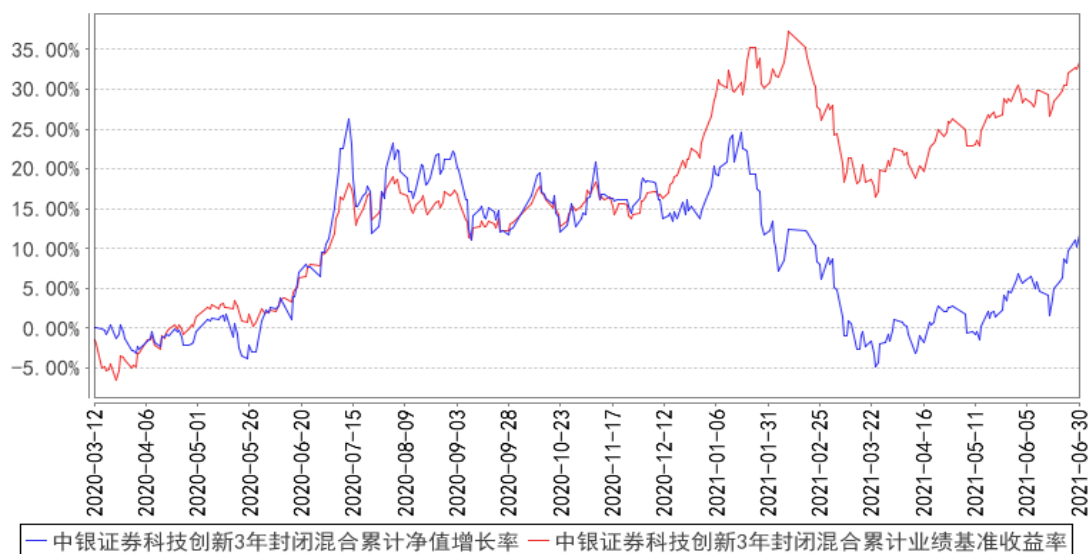
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	13.53%	1.12%	10.87%	0.83%	2.66%	0.29%
过去六个月	-3.40%	1.41%	7.21%	1.12%	-10.61%	0.29%
过去一年	1.99%	1.45%	22.18%	1.01%	-20.19%	0.44%

自基金合同 生效起至今	11.69%	1.38%	33.43%	0.98%	-21.74%	0.40%
----------------	--------	-------	--------	-------	---------	-------

注：业绩比较基准=中国战略新兴产业成份指数收益率*55%+中债综合全价指数收益率*45%。

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

中银证券科技创新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 3 月 12 日生效；

2. 按照基金合同约定，自基金成立日起 6 个月为建仓期，截止本报告期末，基金已完成建仓但报告期末距建仓结束不满一年，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：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		
张少华	本基金的基金经理	2021 年 6 月 8 日	-	21 年	张少华，硕士研究生，中国国籍，已取得证券、基金从业资格。1999 年 7 月至 2003 年 12 月任职于申银万国证券股份有限公司，历任研究员、研究员（中级）、经理助理；2004 年 1 月至 2019 年 10 月任职于申万菱信基金管理有限公司，历任风险管理部经理、副总监、总监，投资管理部

					基金经理、副总监、总监，公司副总经理；2019年10月加入中银国际证券股份有限公司，现任资产管理板块副总经理兼基金管理部总经理及中银证券优选行业龙头混合型证券投资基金、中银证券精选行业股票型证券投资基金、中银证券科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
阳桦	本基金基金经理	2020年3月12日	2021年6月8日	10年	阳桦，硕士研究生，已于2021年6月离职。2008年7月至2009年6月任职于富邦证券（上海代表处），担任行业研究员；2009年7月至2010年6月任职于中山证券有限责任公司，担任行业研究员；2010年6月加入中银国际证券股份有限公司，担任行业研究员、投资经理，历任中银证券价值精选灵活配置混合型证券投资基金、中银证券祥瑞混合型证券投资基金基金经理，现任中银证券科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、中银证券中证500交易型开放式指数证券投资基金、中银证券中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中银证券创业板交易型开放式指数证券投资基金、中银证券创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。

注：1、上述任职日期为根据公司确定的聘用日期，离任日期为根据公司确定的解聘日期；首任基金经理的任职日期为基金合同生效日期；

2、证券从业的涵义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》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

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
-	公募基金	0	-	-
	私募资产管理计划	0	-	-
	其他组合	0	-	-
	合计	0	-	-

注：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

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募

说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了保证公司管理的不同投资组合得到公平对待，保护投资者合法权益，本基金管理人根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规，建立了基金管理业务、资产管理业务公平交易管理办法、研究与交易部交易室异常交易监控与报告管理办法等公平交易相关制度体系。公司旗下投资组合严格按照制度的规定，参与股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，主要包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关环节。研究团队负责提供投资研究支持，投资团队负责投资决策，交易室负责实施交易并实时监控，投资监督团队负责事前监督、事中检查和事后稽核，对交易情况进行合理性分析。通过多部门的协作互控，保证了公平交易的可操作、可稽核和可持续。

公司一直严格遵循公平交易相关规章制度，执行严格的公平交易行为。在严格方针指导下，报告期内，未出现任何异常关联交易以及与禁止交易对手间的交易行为。

报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗口下（如：1日内、3日内、5日内）公司管理的不同投资组合向交易开展交易价差分析。分析结果表明，本报告期内公司对各投资组合公平对待，不存在利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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交易中，未发生同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量5%的情况。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

春节之后的调整在3月中下旬企稳震荡至今。七月是中国的大日子，很多博弈的资金认为在此之前市场风险很小，抓紧时间抢跑是很多资金五六月份操作的心态。而最终展现的行情是结构化的。2021年的二季度，市场呈现出结构性行情。沪深300指数维持窄幅横盘震荡格局。成长风格表现突出，如半导体行业、新能源及新能源车产业链、双创指数、生物医药等表现较好。结构性行情不但表现在不同的行业之间，在部分行业内也较为明显的存在。比如白酒，茅、五、沪等

高端白酒反弹乏力，而次高端白酒股价绝大部分在二季度接近或创出年内新高。机构核心持仓股也是如此，在五六月愈发分化，三月以来大幅反弹的核心资产大多处于高度景气行业，业绩预期上调或稳定。相反，业绩可能存在瑕疵的前期基金重仓股表现平平。

由于春节后的调整不是由于A股上市公司基本面恶化导致的，在一轮跌幅可观的调整之后，后续维持震荡态势的可能性大，稳中求进，市场有望底部逐步提高。后续再要大跌，可能触发的原因国外如美联储正式结束宽松货币政策、国内如房价、通胀持续超预期干扰到央行的政策取向等。基金经理将紧紧围绕科技创新主题进行投资，基金经理战略性看好诸如新能源、新能源汽车、半导体产业、生物医药、消费电子等方向。

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 1.1169 元；本报告期基金份额净值增长率为 13.53%，业绩比较基准收益率为 10.87%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金报告期内不存在连续二十个工作日基金持有人数低于 200 人或基金资产净值低于 5000 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	777,571,821.88	78.29
	其中：股票	777,571,821.88	78.29
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	262,000.00	0.03
	其中：债券	262,000.00	0.03
	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	207,336,967.41	20.88
8	其他资产	8,032,924.17	0.81
9	合计	993,203,713.46	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	33,198.70	0.00
B	采矿业	398,228.00	0.04
C	制造业	687,936,711.45	69.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	11,014.44	0.00
F	批发和零售业	95,577.58	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	9,014.76	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,790,675.70	1.60
J	金融业	34,721.10	0.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	11,028,675.00	1.12
M	科学研究和技术服务业	31,945,456.13	3.23
N	水利、环境和公共设施管理业	17,050.08	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	30,271,498.94	3.06
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	777,571,821.88	78.69

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投资股票。

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	000063	中兴通讯	2,101,077	69,818,788.71	7.07
2	300433	蓝思科技	2,150,095	63,234,293.95	6.40
3	603501	韦尔股份	150,000	48,300,000.00	4.89
4	603986	兆易创新	220,036	41,344,764.40	4.18
5	002466	天齐锂业	585,400	36,306,508.00	3.67
6	002475	立讯精密	724,966	33,348,436.00	3.38
7	300750	宁德时代	61,600	32,943,680.00	3.33
8	603259	药明康德	204,007	31,945,456.13	3.23
9	601012	隆基股份	345,500	30,694,220.00	3.11

10	300014	亿纬锂能	274,200	28,497,606.00	2.88
----	--------	------	---------	---------------	------

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

注：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

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）	262,000.00	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	262,000.00	0.03

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	113050	南银转债	2,620	262,000.00	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

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投资。

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。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。

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

本基金投资范围未包括国债期货，无相关投资政策。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金投资范围未包括国债期货，无投资评价。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

本报告编制日前一年以内，本基金持有的“韦尔股份”的发行主体上海韦尔半导体股份有限公司于2021年4月28日收到中国证券监督管理委员会上海监管局的《关于上海韦尔半导体股份有限公司采取出具警示函措施的决定》（沪证监决〔2021〕67号）。上海韦尔半导体股份有限公司于2019年1月17日完成深圳市芯能投资有限公司（以下简称“芯能投资”）、深圳市芯力投资有限公司（以下简称“芯力投资”）100%股权的收购，收购价款合计16.87亿元。其中，芯能投资、芯力投资主要资产分别为其持有的北京豪威科技有限公司6.31%股权、4.24%股权。2019年7月，上海韦尔半导体股份有限公司与兴业银行签订借款合同，借款金额为10亿元，借款期限为2019年7月5日至2024年7月4日，借款用途为用于支付（或置换）芯能投资和芯力投资100%股权的股权并购款。上海韦尔半导体股份有限公司以持有的芯能投资、芯力投资100%股权及芯能投资、芯力投资持有的北京豪威科技有限公司10.55%股权提供质押担保。上述质押资产的账面值约占最近一期经审计总资产37%。上海韦尔半导体股份有限公司对于上述资产质押情况未及时在临时公告中披露，直至2020年4月10日才在2019年年度报告中披露。中国证券监督管理委员会上海监管局决定对其采取出具警示函的监管措施。

本基金管理人将密切跟踪相关进展，在严格遵守法律法规和基金合同基础上进行投资决策。

本基金投资的前十名证券的其他发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年以内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	471,690.51
2	应收证券清算款	7,523,086.18
3	应收股利	-
4	应收利息	38,147.48
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,032,924.17

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：本基金本报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	884,675,264.70
报告期期间基金总申购份额	-
减：报告期期间基金总赎回份额	-
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	884,675,264.70

§ 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：本报告期内基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 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

注：本基金本报告期内单一投资者持有基金份额比例未有达到或超过 20%的情况。

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、中国证监会准予本基金募集注册的文件
- 2、基金合同
- 3、托管协议
- 4、法律意见书
- 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

除第 6 项在基金托管人处外，其余文件均在基金管理人的住所。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

中银国际证券股份有限公司

2021年7月20日

