

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 2021 年第 2 季度报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：建信基金管理有限责任公司

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 16 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	建信科技创新 3 年封闭混合
场内简称	科创建信
基金主代码	501098
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 3 月 26 日
报告期末基金份额总额	309,165,510.61 份
投资目标	在严格控制风险的前提下，追求超过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	本基金在宏观经济分析基础上，结合政策面、市场资金面、证券市场运行情况、香港市场变化情况等因素，积极把握市场发展趋势，根据经济周期不同阶段各类资产市场表现变化情况，对股票、债券和现金等大类资产投资比例进行战略配置和调整，以规避或分散市场风险，提高基金风险调整后的收益。
业绩比较基准	中国战略新兴产业成份指数收益率*50%+中证综合债指数收益率*45%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×5%
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	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	23,784,084.49
2. 本期利润	79,915,030.73
3. 加权平均基金份额本期利润	0.2585
4. 期末基金资产净值	448,560,818.14
5. 期末基金份额净值	1.4509

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。

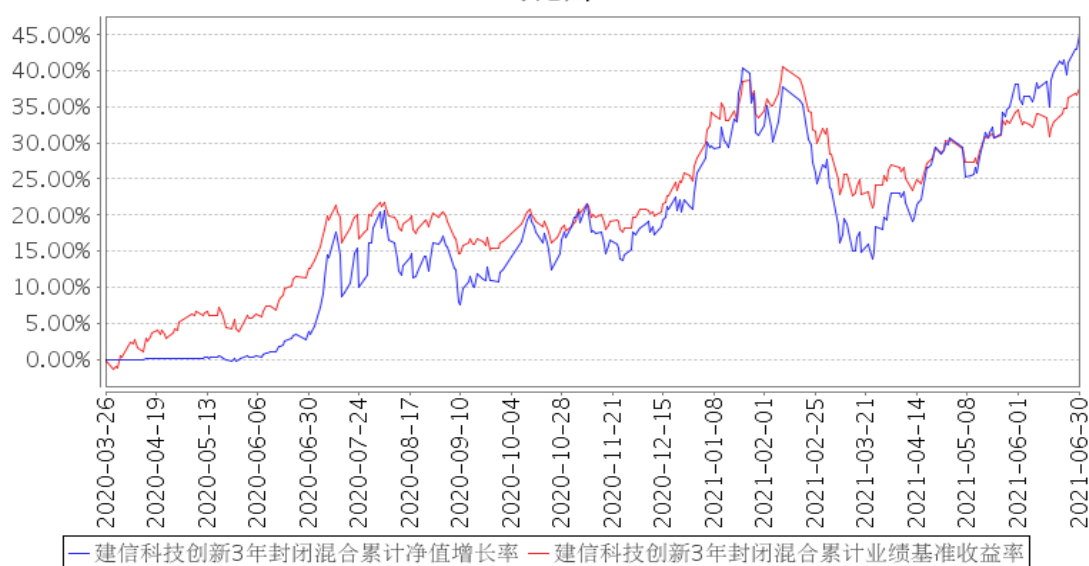
3.2 基金净值表现

3.2.1 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	21.68%	1.24%	10.26%	0.78%	11.42%	0.46%
过去六个月	15.21%	1.53%	7.61%	1.04%	7.60%	0.49%
过去一年	39.82%	1.53%	22.19%	0.95%	17.63%	0.58%
自基金合同 生效起至今	45.09%	1.36%	37.56%	0.90%	7.53%	0.46%

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：本报告期，本基金投资组合比例符合基金合同要求。

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		
姚锦	权益投资部首席策略官，本基金的基金经理	2020年3月26日	—	17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 日至 2021 年 3 月 4 日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。
黄斐玉	本基金的基金经理	2020 年 3 月 26 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 日至 2021 年 3 月 4 日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。
姜锋	权益投资部副总经理，本基金的基金经理	2020 年 4 月 14 日	-	13 年	姜锋先生，权益投资部副总经理，硕士。2007 年 7 月加入本公司，历任研究员、基金经理、资深基金经理、权益投资部执行投资官、权益投资部副总经理。2011 年 7 月 11 日起任建信优势动力股票型证券投资基金的基金经理，该基金于 2013 年 3 月 19 日起转型为建信优势动力混合型证券投资基金（LOF），姜锋继续担任该基金的基金经理；2014 年 3 月 21 日起任建信健康民生混合型证券投资基金的基金经理；2015 年 4 月 22 日起任建信环保产业股票型证券投资基金的基金经理；2020 年 4 月 14 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。

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 3 年封闭运作灵活配置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

本报告期内未出现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。本报告期，未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2021 年二季度国内资本市场震荡上行。具体来看，沪深 300 指数上涨 3.48%，万得全 A 上涨 8.99%，创业板指上涨 26.05%；以创业板和科创板为代表的高成长公司在反弹中明显占优。分行业来看，以电动车产业链、创新药、半导体为代表的成长赛道方向领涨，受制于价格拖累的养殖和政策抑制的房地产表现相对落后。领涨行业中电力设备及新能源上涨 31.38%，电子上涨 23.77%，医药上涨 17.41%；表现落后的行业中农林牧渔下跌 8.48%，房地产下跌 7.59%。

经济层面，国内经济保持复苏态势，制造业景气度优于消费和投资；国际经济随着疫苗的接种稳步回升，资源品供需矛盾对物价形成压力；政策层面，国内货币政策缓慢向常态回归，国际上需要关注物价回升对宏观政策的影响。二季度市场受益于稳定的流动性和靓丽的一季报出现反弹，本基金保持了中性仓位，加仓香港市场中有特点的电子和医药公司，根据业绩展望调整了部分科创板公司的持仓。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率 21.68%，波动率 1.24%，业绩比较基准收益率 10.26%，波动率 0.78%。

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	332,568,642.92	60.96
	其中：股票	332,568,642.92	60.96
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	89,700,000.00	16.44
	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	123,206,722.73	22.58
8	其他资产	108,181.32	0.02
9	合计	545,583,546.97	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 11,520,064.39 元，占期末基金资产净值比例为 2.57%。

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	0.00
B	采矿业	—	—
C	制造业	226,177,430.99	50.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	11,014.44	0.00
F	批发和零售业	89,166.82	0.02
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	85,266,261.80	19.01
J	金融业	8,777,846.70	1.96
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	676,801.45	0.15

N	水利、环境和公共设施管理业	25,745.66	0.01
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	321,048,578.53	71.57

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	—	—
Energy 能源	—	—
Financials 金融	—	—
Health Care 医疗保健	4,016,366.95	0.90
Industrials 工业	—	—
Real Estate 房地产	—	—
Information Technology 信息技术	7,503,697.44	1.67
Telecommunication Services 通讯服务	—	—
Utilities 公用事业	—	—
合计	11,520,064.39	2.57

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	688099	晶晨股份	204,967	22,997,297.40	5.13
2	300750	宁德时代	42,300	22,622,040.00	5.04
3	002415	海康威视	300,000	19,350,000.00	4.31
4	300124	汇川技术	250,744	18,620,249.44	4.15
5	688301	奕瑞科技	50,251	14,070,280.00	3.14
6	688608	恒玄科技	43,086	13,654,384.26	3.04
7	300760	迈瑞医疗	27,779	13,335,308.95	2.97
8	688005	容百科技	110,010	13,333,212.00	2.97
9	300496	中科创达	84,800	13,318,688.00	2.97
10	688169	石头科技	9,881	12,459,941.00	2.78

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

无。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

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

无。

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	83,112.82
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	25,068.50
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	108,181.32

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

报告期期初基金份额总额	309,165,510.61
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	309,165,510.61

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 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、《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基金合同》；
- 3、《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招募说明书》；
- 4、《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 7 月 20 日