

华安科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金

2021 年第 3 季度报告

2021 年 9 月 30 日

基金管理人：华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：二〇二一年十月二十七日

§ 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 10 月 25 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 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	华安科创主题混合
场内简称	科创混合
基金主代码	501073
交易代码	501073
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 6 月 11 日
报告期末基金份额总额	988,565,281.49 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	本基金采取相对灵活的资产配置策略。 本基金采用多因素分析框架，从宏观经济环境、政策因素、市场利率水平、资金供求因素、市场投资价值等方面，采取定量与定性相结合的分析方法，对证券市场投资机会与

	风险进行综合研判。 本基金管理人根据多因素框架的分析结果，给出股票、债券和货币市场工具等资产投资机会的整体评估，作为资产配置的重要依据。基金管理人将根据股市、债市等的相对风险收益预期，调整股票、债券和货币市场工具等资产的配置比例。 本基金依托于基金管理人的投资研究平台，紧密跟踪科创板企业所处行业，努力探寻具备长期价值增长潜力的科创板上市公司。采用定性分析与定量分析相结合、自上而下与自下而上相结合、书面资料与实地调研相结合的方式，系统地审视与判断投资机遇。
业绩比较基准	（一）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×40%+中债综合指数收益率×60%。 （二）封闭运作期届满转为开放式运作后 本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率×20%+中债综合指数收益率×80%。
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与货币市场基金，低于股票型基金。
基金管理人	华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

§ 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 7 月 1 日-2021 年 9 月 30 日)
1. 本期已实现收益	-2,764,216.10

2. 本期利润	-37,332,614.49
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0378
4. 期末基金资产净值	1,155,231,968.84
5. 期末基金份额净值	1.1686

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（例如：封闭式基金交易佣金，开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），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 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	-3.13%	0.75%	-2.75%	0.66%	-0.38%	0.09%
过去六个月	2.02%	0.56%	4.81%	0.64%	-2.79%	-0.08%
过去一年	5.69%	0.43%	9.61%	0.72%	-3.92%	-0.29%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	16.86%	0.30%	49.46%	0.67%	-32.60%	-0.37%

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

华安科创主题 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
 (2019 年 6 月 11 日至 2021 年 9 月 30 日)



§ 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		
谢昌旭	本基金的基金经理	2019-06-11	-	9 年	硕士研究生，9 年基金及相关行业从业经验。曾任融通基金管理有限公司研究员、平安养老保险股份有限公司权益投资经理。2018 年 9 月加入华安基金，2018 年 10 月起，担任华安新丝路主题股票型证券投资基金的基金经理。2019 年 3 月起，同时担任华安双核驱动混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 6 月起，同时担任华安科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 11 月至 2021 年 8 月，同时担任华安安华灵活配置

					混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 11 月至 2021 年 3 月,同时担任华安文体健康主题灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 4 月起,同时担任华安医疗创新混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 7 月至 2021 年 8 月,同时担任华安安禧灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
朱才敏	本基金的基金经理	2021-03-08	-	14 年	金融工程硕士,具有基金从业资格证书,14 年基金行业从业经历。2007 年 7 月应届生毕业进入华安基金,历任金融工程部风险管理、产品经理、固定收益部研究员、基金经理助理等职务。2014 年 11 月至 2017 年 7 月,同时担任华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金、华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金、华安月安鑫短期理财债券型证券投资基金的基金经理。2014 年 11 月起,同时担任华安汇财通货币市场基金、华安双债添利债券型证券投资基金的基金经理。2015 年 5 月起同时担任华安新回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 4 月至 2018 年 10 月,同时担任华安安禧保本混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 10 月起,同时担任华安安禧灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 9 月至 2018 年 1 月,同时担任华安新财富灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 11 月至 2017 年 12 月,同时担任

					华安新希望灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 12 月起，同时担任华安新泰利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月起，同时担任华安睿安定期开放混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 5 月起，同时担任华安鼎信 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2019 年 7 月至 2021 年 3 月，同时担任华安日日鑫货币市场基金的基金经理。2019 年 8 月至 2021 年 3 月，同时担任华安年年丰一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月起，同时担任华安科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、华安添颐混合型发起式证券投资基金的基金经理。2021 年 7 月起，同时担任华安添和一年持有期债券型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日，即以公告日为准。证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，将各投资组合在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括：在研究环节，研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中，使用晨会发言、邮件发送、登录在研究报告管理系统中等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节，公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略，制定并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节，公司实行强制公平交易机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。（1）交易所二级市场业务，遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则，实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。（2）交易所一级市场业务，投资组合经理按意愿独立进行业务申报，集中交易部以投资组合名义对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签，则按实际中签情况以价格优先、比例分配原则进行分配。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在合规监察员监督参与下，进行公平协商分配。（3）银行间市场业务遵循指令时间优先原则，先到先询价的控制原则。通过内部共同的 iwind 群，发布询价需求和结果，做到信息公开。若是多个投资组合进行一级市场投标，则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向，交易员以此进行投标，以确保中签结果与投资组合投标意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在风险管理部投资监督参与下，进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节，公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上市交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。本报告期内，公司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

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司风险管理部会同基金投资、交易部门讨论制定了各类投资组合针对股票、债券、回购等投资品种在交易所及银行间的同日反向交易控制规则，并在投资系统中进行了设置，实现了完全的系统控制。

同时加强了对各类投资组合间的同日反向交易的监控与隔日反向交易的检查；风险管理部开发了同向交易分析系统，对相关同向交易指标进行持续监控，并定期对组合间的同向交易行为进行了重点分析。本报告期内，因组合流动性管理或投资策略调整需要，除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，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% 的次数为 1 次，未出现异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年三季度，中国经济呈现逐步回落的态势，社融增速、固定资产投资持续下行，消费受到疫情和居民收入预期影响恢复较为缓慢，由于供需失衡部分工业品出现大幅上涨，部分政策引发了投资者对一些商业模式较好的行业长期逻辑的担忧，从流动性来看金融市场整体呈现较为宽松的状态。三季度股票市场整体表现为震荡的态势，但行业分化巨大，上证综指下跌 0.64%，沪深 300 下跌 6.85%，创业板则下跌 6.69%。行业方面，采掘、公用事业、有色金属、钢铁、化工等板块表现较好，而医药、休闲服务、食品饮料、传媒、家电等行业表现较为落后。

报告期内本基金重点投资了新能源、人工智能、创新药及创新药产业链、半导体、医疗器械、计算机等方向的优秀公司。债券方面，本基金主要配置科创主题相关发行人发行的信用债，保持组合高等级信用债策略，动态调整组合久期和杠杆水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 9 月 30 日，本基金份额净值为 1.1686 元，本报告期份额净值增长率为-3.13%，同期业绩比较基准增长率为-2.75%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2021 年四季度，我们认为中国经济增长趋于平稳，系统性风险不大。在此轮疫情中，中国制造业的优势得到持续体现，很多细分行业的龙头公司竞争优势持续扩大，民族自信心得到了极大增强。疫情也带来了其他长周期的趋势改变或者进一步加强，我们预期未来还将持续。政府政策主要着力于提高经济长期潜在增长率，如共同富裕、碳中和、双循环等都对经济长期增长都有着极其深远的影响，主要是为了支持经济转型升级、持续创新和长期可持续高质量发展，这些将对有持续成长能力的行业和公司带来持续的正面作用。就科技行业而言，我们认为新能源、人工智能、创新药及创新药产业链、半导体、5G 应用、云

计算、高端医疗器械、自动化等细分行业还有较大成长空间，中期发展态势也较为良好。从估值来看，当前股票市场的估值分化较大，成长性较好的新兴产业估值处于偏高的状态，对未来的成长性有一定透支，但长期来看一些细分行业中的优秀公司成长空间仍然比较大。

综上所述，我们对 2021 年四季度股票市场具有结构性机会，我们将重点投资所看好的科技领域中成长空间大、竞争优势突出的优秀公司，从中选择风险收益比高的投资标的构建投资组合。债券操作上，我们将动态调整组合杠杆水平和久期，甄选科创主题相关发行主体，维持高信用等级策略。本基金将秉承稳健、专业的投资理念，勤勉尽责地维护持有人利益。

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	467,153,782.93	39.82
	其中：股票	467,153,782.93	39.82
2	固定收益投资	618,740,500.00	52.75
	其中：债券	618,740,500.00	52.75
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	77,405,876.49	6.60
7	其他各项资产	9,727,075.25	0.83
8	合计	1,173,027,234.67	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	18,116.82	0.00
B	采矿业	—	—
C	制造业	375,121,532.83	32.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,346,430.18	0.55
E	建筑业	38,297.80	0.00
F	批发和零售业	36,632.93	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	36,013.42	0.00
H	住宿和餐饮业	40,233.44	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	28,877,525.38	2.50
J	金融业	—	—
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	49,946,379.82	4.32
N	水利、环境和公共设施管理业	42,766.49	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	5,544,881.20	0.48
R	文化、体育和娱乐业	1,104,972.62	0.10
S	综合	—	—
	合计	467,153,782.93	40.44

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	300750	宁德时代	107,100	56,305,683.00	4.87
2	603259	药明康德	179,250	27,389,400.00	2.37
3	002371	北方华创	73,700	26,951,353.00	2.33

4	300363	博腾股份	223,200	21,262,032.00	1.84
5	002460	赣锋锂业	128,965	21,013,557.10	1.82
6	002049	紫光国微	99,100	20,493,880.00	1.77
7	002812	恩捷股份	68,300	19,132,196.00	1.66
8	600460	士兰微	306,600	17,503,794.00	1.52
9	601012	隆基股份	175,435	14,469,878.80	1.25
10	002594	比亚迪	53,800	13,423,638.00	1.16

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	10,048,000.00	0.87
	其中：政策性金融债	10,048,000.00	0.87
4	企业债券	306,534,500.00	26.53
5	企业短期融资券	100,425,000.00	8.69
6	中期票据	201,733,000.00	17.46
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	618,740,500.00	53.56

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	102001129	20 中国中药 MTN001	900,000	90,477,000.00	7.83
2	101801149	18 中电国际 MTN001	600,000	60,510,000.00	5.24
3	1980190	19 广铁绿色债 02	500,000	50,350,000.00	4.36
4	155263	19 国科 01	500,000	50,300,000.00	4.35

5	012100947	21 长沙轨 交 SCP001	500,000	50,200,000.00	4.35
---	-----------	--------------------	---------	---------------	------

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

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

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

本基金本报告期末投资股指期货。若本基金投资股指期货，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于流动性好、交易活跃的股指期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，首先将基于对证券市场总体行情的判断和组合风险收益的分析确定投资时机以及套期保值的类型（多头套期保值或空头套期保值），并根据风险资产投资（或拟投资）的总体规模和风险系数决定股指期货的投资比例；其次，本基金将在综合考虑证券市场和期货市场运行趋势以及股指期货流动性、收益性、风险特征和估值水平的基础上进行投资品种选择，以对冲风险资产组合的系统性风险和流动性风险。

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

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

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。

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 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 本基金投资的前十名股票中，不存在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	108,035.79
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	9,619,039.46
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	9,727,075.25

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

本基金本报告期末未持有存在流通受限情况的股票。

§ 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	988,565,281.49
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	—
本报告期末基金份额总额	988,565,281.49

§ 7 影响投资者决策的其他重要信息

7.1 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 备查文件目录

8.1 备查文件目录

- 1、《华安科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

8.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网站
<http://www.huaan.com.cn>。

8.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

华安基金管理有限公司
二〇二一年十月二十七日