

大成科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合
型证券投资基金
2019 年第 3 季度报告

2019 年 9 月 30 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2019 年 10 月 23 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 2019 年 10 月 22 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 2019 年 7 月 18 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	大成科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合
场内简称	科创大成
基金主代码	501079
交易代码	501079
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	2019 年 7 月 18 日
报告期末基金份额总额	863, 221, 127. 56 份
投资目标	本基金将灵活运用多种投资策略，通过充分挖掘科技创新相关上市公司的投资机会以及债券投资，力争为基金份额持有人创造长期稳健的投资回报。
投资策略	在封闭运作期内，本基金主要包括资产配置策略、战略配售策略、固定收益投资策略及其他策略等。
业绩比较基准	中国战略新兴产业成份指数收益率×60%+中债综合全价指数收益率×40%
风险收益特征	本基金是混合型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。 本基金封闭运作期内可以投资战略配售股票，需参与并接受发行人战略配售股票，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	大成基金管理有限公司
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（2019年7月18日-2019年9月30日）
1. 本期已实现收益	7,111,649.70
2. 本期利润	26,741,376.11
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0310
4. 期末基金资产净值	889,962,503.67
5. 期末基金份额净值	1.0310

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 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
自基金合同 生效起至今	3.10%	0.70%	4.26%	0.66%	-1.16%	0.04%

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

大成科创主题3年封闭运作灵活配置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、本基金合同生效日为2019年7月18日，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2、本基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起六个月内为建仓期。截至本报告期末，本基金仍处于建仓期。

§ 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		
谢家乐	本基金基金经理	2019年8月6日	-	7年	工学硕士。曾担任华泰证券股份有限公司研究所研究员。2014年6月加入大成基金管理有限公司，历任研究部助理研究员、研究员。2017年2月20日起任大成睿景灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理。2019年8月6日起任大成国家安全

					主题灵活配置混合型证券投资基金、大成科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金经理。具备基金从业资格。国籍：中国
李博	本基金基金经理，股票投资部副总监	2019年7月18日	-	9年	工学硕士。2009年9月至2010年8月就职于韩国SK Telecom首尔总部。2010年8月至2011年5月就职于国信证券任研究员。2011年5月起加入大成基金管理有限公司，曾担任电子行业、互联网传媒行业分析师、大成内需增长股票型证券投资基金基金经理助理、股票投资部总监助理，现任股票投资部副总监。2015年4月21日起任大成互联网思维混合型证券投资基金基金经理。2015年8月26日至2019年9月29日任大成内需增长混合型证券投资基金基金经

					理。2016 年 11 月 4 日起任大成精选增值混合型证券投资基金基金经理。2019 年 7 月 18 日起任大成科创主题封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国
--	--	--	--	--	--

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，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

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定，公司制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》、《大成基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。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，内容包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等与投资管理活动相关的各个环节。研究部负责提供投资研究支持，投资部门负责投资决策，交易管理部负责实施交易并实时监控，监察稽核部负责事前监督、事中检查和事后稽核，风险管理部负责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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，基金管理人旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。主动投资组合间股票交易不存在同日反向交易。主动型投资组合与指数型投资组合之间或指数型投资组合之间存在股票

同日反向交易，但不存在参与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股当日成交量5%的情形；主动投资组合间债券交易不存在同日反向交易。投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响，无异常。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾三季度，科创板成立后，第一批个股获得较大幅度上涨，本产品成立于7月中下旬，科创板个股方面，主要把握了估值合理，长期成长空间较大，管理较为优秀的标。同时，市场整体，特别是科技方向的相关板块和标的，受到华为事件影响的短期压制，导致产品净值短期受到一定回调压力。考虑到5G带动的科技创新和华为事件带来的各行业的国产化趋势，长期布局了估值较合理，经营能力得到持续验证的确定性科创类标的。

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1.0310元；本报告期基金份额净值增长率为3.10%，业绩比较基准收益率为4.26%。

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	586,298,900.59	65.69
	其中：股票	586,298,900.59	65.69
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	304,004,662.29	34.06
8	其他资产	2,192,435.97	0.25
9	合计	892,495,998.85	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	418,823,849.31	47.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,139,240.40	0.24
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	21,975,642.68	2.47
J	金融业	67,908,744.20	7.63
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	57,385,604.80	6.45
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	18,065,819.20	2.03
S	综合	-	-
	合计	586,298,900.59	65.88

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

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	002353	杰瑞股份	2,294,214	61,966,720.14	6.96
2	688029	南微医学	432,583	57,602,752.28	6.47
3	002008	大族激光	1,312,900	46,673,595.00	5.24
4	002475	立讯精密	1,434,652	38,391,287.52	4.31
5	603259	药明康德	438,694	38,034,769.80	4.27
6	600183	生益科技	1,421,784	35,459,292.96	3.98
7	600030	中信证券	1,512,500	34,001,000.00	3.82
8	601688	华泰证券	1,774,200	33,869,478.00	3.81
9	603983	丸美股份	522,350	30,975,355.00	3.48

10	603755	日辰股份	595,776	26,690,764.80	3.00
----	--------	------	---------	---------------	------

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。

本基金投资的前十名证券的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	188,527.11
2	应收证券清算款	1,955,576.60
3	应收股利	-
4	应收利息	48,332.26
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,192,435.97

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 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

6.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

6.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§ 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。

7.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据我司发布的《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经大成基金管理有限公司第六届董事会第三十五次会议审议通过，自 2019 年 9 月 12 日起，陈翔凯先生不再担任公司副总经理职务。具体详见公司相关公告。

§ 8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立大成科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金的文件；
- 2、《大成科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；
- 5、本报告期内指定报刊上披露的各种公告原稿。

8.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

8.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，或登录本基金管理人网站 <http://www.dcfund.com.cn> 进行查

阅。

大成基金管理有限公司

2019 年 10 月 23 日