

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 2020 年第 3 季度报告

2020 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：2020 年 10 月 28 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 2020 年 10 月 27 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 2020 年 7 月 1 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
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（2020 年 7 月 1 日-2020 年 9 月 30 日）
1. 本期已实现收益	196,134,763.22
2. 本期利润	98,432,923.54
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1140
4. 期末基金资产净值	1,568,313,600.42
5. 期末基金份额净值	1.8168

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。

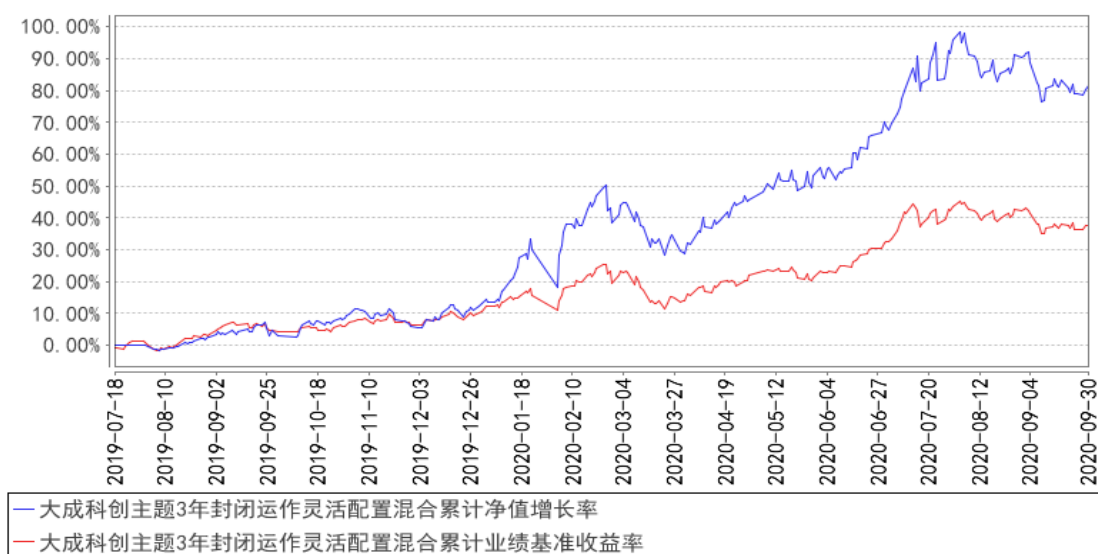
3.2 基金净值表现

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	份额净值增长率①	份额净值增长率 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	6.69%	1.86%	4.16%	1.10%	2.53%	0.76%
过去六个月	40.72%	1.71%	20.92%	0.97%	19.80%	0.74%
过去一年	76.22%	1.83%	32.14%	1.03%	44.08%	0.80%
自基金合同 生效起至今	81.68%	1.69%	37.77%	0.97%	43.91%	0.72%

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：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		
谢家乐	本基金基金经理	2019年8月6日	-	8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，曾担任研究部研究员、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。2020年4月29日起任大成科技创新混合型证券投资基金基金经理。2020年7月16日起任大成创业板两年定期开放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	-	10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、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 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金。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。

4.1.1 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

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

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

报告期内，基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。基金管理人运用统计分析方法和工具，对旗下所有投资组合连续 4 个季度的日内、3 日内及 5 日内股票及债券交易同向交易价差进行分析。分析结果表明：债券交易同向交易频率较低；部分股票同向交易溢价率较大主要来源于市场因素（如个股当日价格振幅较高）及组合经理交易时机选择，即投资组合成交时间不一致以及成交价格的日内较大变动导致个别些组合间的成交价格差异较大，但结合交易价差专项统计分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

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存在 3 笔同日反向交易，原因为流动性需要或合规比例调整。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存在 3 笔同日反向交易，原因为流动性需要。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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2020 年三季度以来，在疫情逐渐控制，经济出现复苏迹象的背景下，宏观经济和货币流动性都出现一些边际变化，对二级市场也产生一定影响，出现较显著的结构性的轮动和切换。

回顾期间的组合操作，一方面我们基于估值的历史和横向对比，对部分集中持仓进行调整，另一方面，我们进一步挖掘并配置了创新驱动的新兴产业方向上的优质标的，一定程度地丰富了持仓方向。

以上两类操作，更多基于我们对创新成长的长期方向的学习和思考，也符合我们“契合时代特征，发现稳健长牛行业，理解长期化公司”的研究框架，这个思考和组合动态优化的过程将长期进行。

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 1.8168 元；本报告期基金份额净值增长率为 6.69%，业绩比较基准收益率为 4.16%。

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	1,188,188,613.79	75.52
	其中：股票	1,188,188,613.79	75.52
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	384,109,789.89	24.41
8	其他资产	1,013,894.94	0.06

9	合计	1,573,312,298.62	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	1,042,717,167.92	66.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	13,029.12	0.00
F	批发和零售业	8,023,707.55	0.51
G	交通运输、仓储和邮政业	64,069.26	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	941,219.04	0.06
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	87,872,023.94	5.60
M	科学研究和技术服务业	14,813.40	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	112,287.60	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	48,430,295.96	3.09
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,188,188,613.79	75.76

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	002179	中航光电	2,462,114	113,995,878.20	7.27
2	300628	亿联网络	1,777,815	107,220,022.65	6.84
3	601877	正泰电器	3,106,830	94,043,744.10	6.00
4	601888	中国中免	394,151	87,872,023.94	5.60
5	688029	南微医学	374,278	87,206,774.00	5.56
6	000860	顺鑫农业	1,377,520	82,871,603.20	5.28
7	688180	君实生物	1,081,081	71,491,886.53	4.56

8	300487	蓝晓科技	1,289,128	69,316,412.56	4.42
9	300595	欧普康视	1,081,182	67,271,144.04	4.29
10	600079	人福医药	1,892,408	60,973,385.76	3.89

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

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查的，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中，没有投资于超出基金合同规定的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	976,711.98
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	37,182.96
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,013,894.94

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

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	688180	君实生物	71,491,886.53	4.56	战略配售

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	863,221,127.56
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	863,221,127.56

§ 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。

9.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

9.3 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

2020 年 10 月 28 日