

大成沪深 300 指数证券投资基金 2021 年第 3 季度报告

2021 年 9 月 30 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

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 10 月 27 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 10 月 26 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 07 月 01 日起至 09 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	大成沪深 300 指数	
基金主代码	519300	
前端交易代码	519300	
后端交易代码	519301	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2006 年 4 月 6 日	
报告期末基金份额总额	1,196,683,405.26 份	
投资目标	通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，实现指数投资偏离度和跟踪误差的最小化。在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。	
投资策略	本基金采用被动式指数投资策略。原则上，股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合、复制标的指数，并原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。	
业绩比较基准	沪深 300 指数	
风险收益特征	本基金为指数基金，是风险中等、获得证券市场平均收益率的产品。	
基金管理人	大成基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	大成沪深 300 指数 A	大成沪深 300 指数 C
下属分级基金的交易代码	519300	007096
报告期末下属分级基金的份额总额	1,191,929,540.97 份	4,753,864.29 份

§ 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）	
	大成沪深 300 指数 A	大成沪深 300 指数 C
1. 本期已实现收益	61,019,014.21	205,008.73
2. 本期利润	-75,164,500.60	-166,279.92
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0598	-0.0387
4. 期末基金资产净值	1,377,208,445.68	5,475,592.20
5. 期末基金份额净值	1.1554	1.1518

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 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

大成沪深 300 指数 A

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	-4.76%	1.09%	-6.85%	1.20%	2.09%	-0.11%
过去六个月	-1.75%	0.97%	-3.60%	1.10%	1.85%	-0.13%
过去一年	7.88%	1.06%	6.08%	1.21%	1.80%	-0.15%
过去三年	48.15%	1.24%	41.51%	1.35%	6.64%	-0.11%
过去五年	56.02%	1.10%	49.58%	1.20%	6.44%	-0.10%
自基金合同生效起至今	303.52%	1.62%	341.10%	1.71%	-37.58%	-0.09%

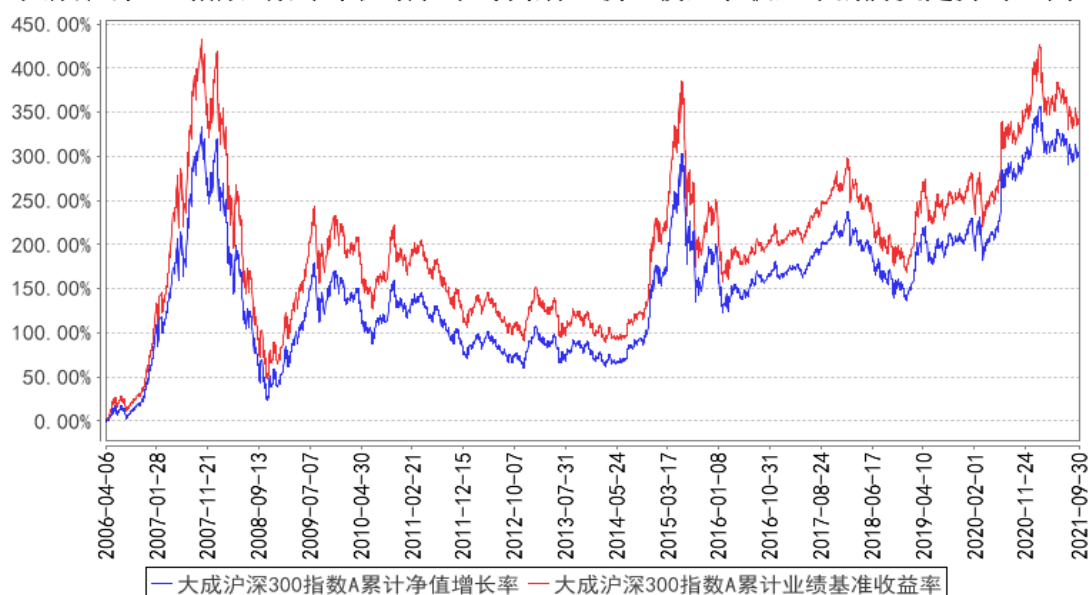
大成沪深 300 指数 C

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
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

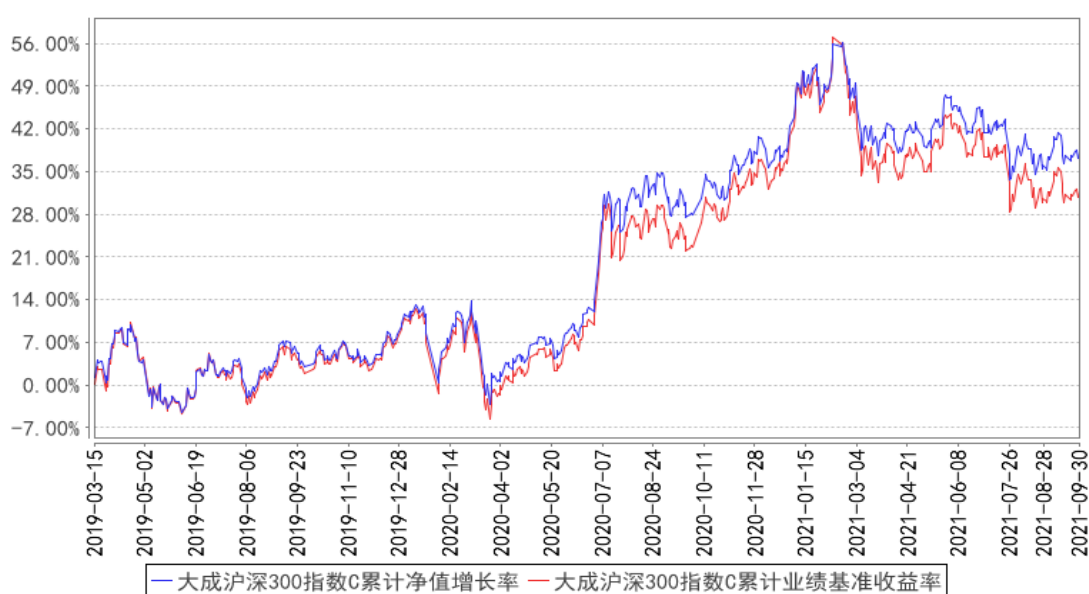
				④		
过去三个月	-4.79%	1.09%	-6.85%	1.20%	2.06%	-0.11%
过去六个月	-1.79%	0.97%	-3.60%	1.10%	1.81%	-0.13%
过去一年	7.77%	1.06%	6.08%	1.21%	1.69%	-0.15%
自基金合同生效起至今	37.97%	1.19%	31.58%	1.30%	6.39%	-0.11%

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

大成沪深300指数A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



大成沪深300指数C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、本基金于 2019 年 3 月 11 日起增设 C 类份额。

2、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		
苏秉毅	本基金基金经理， 指数与期货投资部（筹）副总监	2016 年 3 月 4 日	-	17 年	经济学硕士。2004 年 9 月至 2008 年 5 月就职于华夏基金管理有限公司基金运作部。2008 年加入大成基金管理有限公司，曾担任规划发展部高级产品设计师、数量与指数投资部总监助理，现任指数与期货投资部（筹）副总监。2012 年 8 月 28 日至 2014 年 1 月 23 日任大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2014 年 1 月 24 日至 2014 年 2 月 17 日任大成健康产业股票型证券投资基金基金经理。2012 年 2 月 9 日至 2014 年 9 月 11 日任深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金及大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2012 年 8 月 24 日起任中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2013 年 1 月 1 日至 2015 年 8 月 25 日任大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理。2013 年 2 月 7 日起任大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2015 年 6 月 5 日起任大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2015 年 6 月 29 日至 2020 年 11 月 13 日任大成中证互联网金融指数分级证券投资基金基金经理。2016 年 3 月 4 日起任大成核心双动力混合型证券投资基金、大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理。2018 年 6 月 26 日起任大成景恒混合型证券投资基金基金经理。2021 年 4 月 23 日起任大成智惠量化多策略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
张钟玉	本基金基	2015 年 8 月 26	2021 年 9 月	11 年	会计学硕士。2010 年 7 月加入大成基金

	金经理	日	2 日	管理有限公司, 先后担任研究部研究员、数量与指数投资部数量分析师、基金经理助理、基金经理。2015 年 2 月 28 日至 2021 年 9 月 2 日任大成核心双动力混合型证券投资基金基金经理(更名前为大成核心双动力股票型证券投资基金)。2015 年 5 月 23 日至 2021 年 9 月 2 日任深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2015 年 8 月 26 日至 2021 年 9 月 2 日任大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理。2019 年 9 月 26 日至 2021 年 9 月 2 日任大成 MSCI 中国 A 股质优价值 100 交易型开放式指数证券投资基金、大成 MSCI 中国 A 股质优价值 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。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。

4.1.1 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间连续 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, 针对同一基金经理管理的多个投资组合及公私募兼任基金经理管理的多个投资组合的投资交易行为加强了公平交易监测与分析, 包括对不同时间窗下(同日、3 日、5 日、10 日)反向交易和同向交易价差监控的分析。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投资策略差异、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，同时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 2 笔同日反向交易，原因为组合合规比例调整。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 4 笔同日反向交易，原因为流动性需要或合规比例调整。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

三季度，疫情依旧阻碍着全球经济的复苏，对供需两端的冲击仍在发酵，大宗商品剧烈上涨，同时经济并无太大起色，滞胀的阴影渐行渐近。尽管这已成为摆在各国面前的现实问题，但疫情冲击尚未散去，宽松难以退出，商品供应一时之间也无法扩大，通胀还看不到消退的迹象。此外，对于清洁能源的追求，又对传统能源构成压制，进一步加剧了能源短缺。

受宏观环境及国际形势的影响，股票市场三季度也是跌宕起伏，虽然从整体来看，宽基指数总体波动并不算大，但内部结构分化严重，板块走势差异极大。在能源冲击的背景下，本季度市场焦点主要集中在上游资源类的板块，煤炭、电力、有色、钢铁、化工等板块表现出色，而去年风光无限的消费类板块则表现乏力。同样是大盘宽基指数，老白马权重相对较高的沪深 300 指数本季度下跌 6.85%，而资源股权重相对较高的上证指数则仅下跌 0.64%，板块行情差异可见一斑。

本基金标的指数沪深 300 指数下跌 6.85%。三季度，本基金申购赎回和份额交易情况均较为平稳。本基金基本保持满仓运作，严格根据标的指数成分股调整以及权重的变化及时调整投资组合。各项操作与指标均符合基金合同的要求。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成沪深 300 指数 A 的基金份额净值为 1.1554 元，本报告期基金份额净值增长率为-4.76%；截至本报告期末大成沪深 300 指数 C 的基金份额净值为 1.1518 元，本报告期基金份额净值增长率为-4.79%。同期业绩比较基准收益率为-6.85%。

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	1,280,882,502.85	92.49
	其中：股票	1,280,882,502.85	92.49
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	50,070,000.00	3.62
	其中：债券	50,070,000.00	3.62
	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	50,284,272.09	3.63
8	其他资产	3,609,696.74	0.26
9	合计	1,384,846,471.68	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资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	14,211,524.98	1.03
B	采矿业	32,514,494.71	2.35
C	制造业	673,914,044.11	48.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	27,040,399.43	1.96
E	建筑业	21,720,909.64	1.57
F	批发和零售业	8,271,843.80	0.60
G	交通运输、仓储和邮政业	38,154,640.14	2.76
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	43,746,700.96	3.16
J	金融业	318,371,045.31	23.03
K	房地产业	28,491,166.03	2.06
L	租赁和商务服务业	21,742,217.76	1.57
M	科学研究和技术服务业	25,241,602.60	1.83
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	1,318,144.00	0.10
Q	卫生和社会工作	17,131,047.24	1.24
R	文化、体育和娱乐业	4,319,987.68	0.31

S	综合	-	-
	合计	1,276,189,768.39	92.30

5.2.2 报告期末积极投资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	12,350.52	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,972,995.37	0.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	20,183.39	0.00
F	批发和零售业	61,969.47	0.00
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	1,567,471.83	0.11
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	15,224.88	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	38,613.78	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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	3,925.22	0.00
S	综合	-	-
	合计	4,692,734.46	0.34

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

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 报告期末指数投资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	600519	贵州茅台	40,458	74,038,140.00	5.35
2	600036	招商银行	800,342	40,377,253.90	2.92
3	601318	中国平安	792,657	38,332,892.52	2.77
4	000858	五粮液	125,489	27,531,031.71	1.99
5	601012	隆基股份	272,481	22,474,232.88	1.63

6	000333	美的集团	317,708	22,112,476.80	1.60
7	300059	东方财富	543,715	18,687,484.55	1.35
8	603259	药明康德	117,787	17,997,853.60	1.30
9	002415	海康威视	307,442	16,909,310.00	1.22
10	601166	兴业银行	918,715	16,812,484.50	1.22

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	601728	中国电信	394,011	1,556,343.45	0.11
2	688187	时代电气	23,197	1,008,837.53	0.07
3	688728	格科微	23,033	563,617.51	0.04
4	688772	珠海冠宇	12,960	187,012.80	0.01
5	688766	普冉股份	704	169,896.32	0.01

5.3.3 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

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	50,070,000.00	3.62
	其中：政策性金融债	50,070,000.00	3.62
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	50,070,000.00	3.62

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	210301	21 进出 01	500,000	50,070,000.00	3.62

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

1. 本基金投资的前十名证券之一招商银行（600036.SH）的发行主体招商银行股份有限公司于

2021 年 5 月 17 日因为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字（2021）16 号）。招商银行为本基金跟踪标的指数的成份股。

2. 本基金投资的前十名证券之一 21 进出 01（210301.IB）的发行主体中国进出口银行于 2021 年 7 月 13 日因违规投资企业股权等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字（2021）31 号）。本基金认为，对中国进出口银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

3. 本基金投资的前十名证券之一兴业银行（601166.SH）的发行主体兴业银行股份有限公司于 2021 年 8 月 13 日因违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定，受到中国人民银行处罚（银罚字（2021）26 号）。兴业银行为本基金跟踪标的指数的成份股。

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

无。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	141,609.96
2	应收证券清算款	1,741,014.78
3	应收股利	-
4	应收利息	736,355.14
5	应收申购款	990,716.86
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,609,696.74

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

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五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	601728	中国电信	1,556,343.45	0.11	新股锁定
2	688187	时代电气	1,008,837.53	0.07	新股锁定
3	688728	格科微	563,617.51	0.04	新股锁定
4	688772	珠海冠宇	187,012.80	0.01	新股未上市
5	688766	普冉股份	169,896.32	0.01	新股锁定

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

项目	大成沪深 300 指数 A	大成沪深 300 指数 C
报告期期初基金份额总额	1,309,570,873.80	3,690,575.60
报告期期间基金总申购份额	42,461,954.33	4,781,107.29
减：报告期期间基金总赎回份额	160,103,287.16	3,717,818.60
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	1,191,929,540.97	4,753,864.29

§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

2021 年 9 月 3 日，召开公司 2021 年第四次临时股东会审议通过选举陈勇先生担任公司股东监事，许国平先生不再担任公司股东监事、监事会主席；

2021 年 9 月 3 日，召开公司第七届监事会第六次会议审议通过选举陈勇先生担任公司第七届监事会主席。

§ 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沪深 300 指数证券投资基金的文件；
- 2、《大成沪深 300 指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成沪深 300 指数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、本报告期内在规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

2021 年 10 月 27 日