

# 大成科创主题混合型证券投资基金（LOF） 2024 年第 1 季度报告

2024 年 3 月 31 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：2024 年 4 月 19 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2024年04月18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2024年01月01日起至03月31日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	大成科创主题混合（LOF）	
场内简称	科创大成 LOF	
基金主代码	501079	
交易代码	501079	
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）	
基金合同生效日	2019年7月18日	
报告期末基金份额总额	448,228,742.73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	
下属分级基金的基金简称	大成科创主题混合(LOF)A	大成科创主题混合(LOF)C
下属分级基金的场内简称	科创大成 LOF	-
下属分级基金的交易代码	501079	016198

报告期末下属分级基金的份额总额	360,407,336.11份	87,821,406.62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（2024年1月1日-2024年3月31日）	
	大成科创主题混合(LOF)A	大成科创主题混合(LOF)C
1. 本期已实现收益	-35,861,490.35	-8,858,540.40
2. 本期利润	-56,413,698.55	-14,101,556.90
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.1518	-0.1566
4. 期末基金资产净值	746,336,808.62	180,112,938.87
5. 期末基金份额净值	2.0708	2.0509

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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

大成科创主题混合(LOF)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	-6.29%	1.72%	-1.39%	1.02%	-4.90%	0.70%
过去六个月	-7.18%	1.39%	-6.43%	0.88%	-0.75%	0.51%
过去一年	-9.60%	1.37%	-17.56%	0.79%	7.96%	0.58%
过去三年	-0.73%	1.40%	-29.08%	0.88%	28.35%	0.52%
自基金合同生效起至今	107.08%	1.51%	4.24%	0.94%	102.84%	0.57%

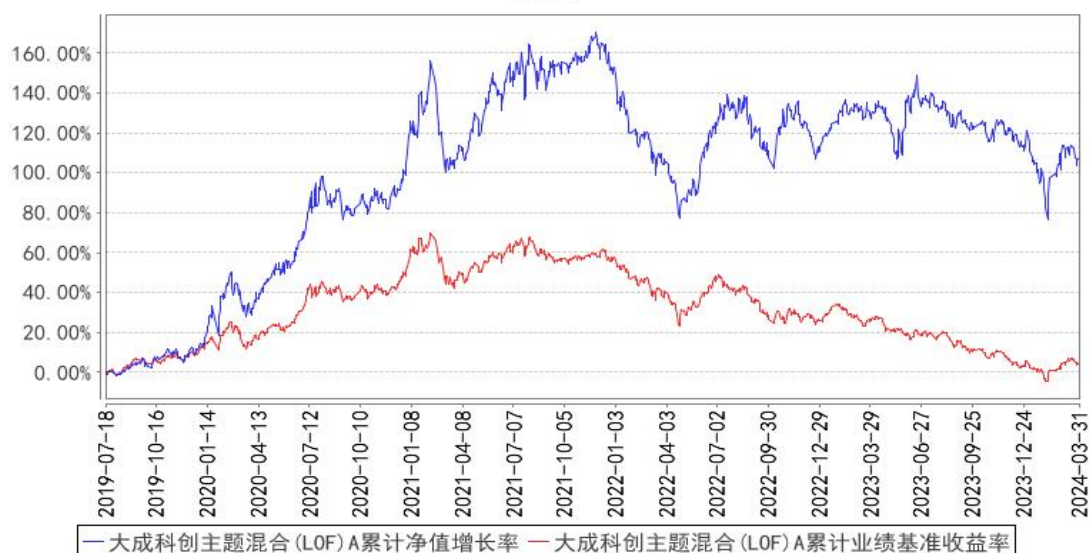
大成科创主题混合(LOF)C

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	-6.42%	1.72%	-1.39%	1.02%	-5.03%	0.70%
过去六个月	-7.45%	1.39%	-6.43%	0.88%	-1.02%	0.51%
过去一年	-10.14%	1.37%	-17.56%	0.79%	7.42%	0.58%
自基金合同 生效起至今	-12.93%	1.33%	-26.47%	0.80%	13.54%	0.53%

### 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

大成科创主题混合(LOF)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



大成科创主题混合(LOF)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。

2、自2022年7月18日起，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正式转型为大成科创主题混合型证券投资基金（LOF），基金名称相应变更为“大成科创主题混合型证券投资基金（LOF）”。

3、本基金自2022年7月18日起增设C类基金份额类别，C类的净值增长率和业绩比较基准收益率自2022年7月29日C类有份额起开始计算。

## §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		
王帅	本基金基金经理	2023年6月1日	-	7年	上海交通大学硕士。2017年3月至2019年9月任广发证券股份有限公司发展研究中心研究员。2019年9月加入大成基金管理有限公司，曾任大成中小盘混合型证券投资基金（LOF）、大成盛世精选灵活配置混合型证券投资基金、大成行业先锋混合型证券投资基金、大成科技消费股票型证券投资基金基金经理助理，现任股票投资部基金经理。2021年12月1日至2023年7月25日任大成蓝筹稳健证券投资基金基金经理。2022年11月27日起任大成互联网思维混合型证券投资基金基金经理。2023年6月1日起任大成科创主题混合型证券投资基金（LOF）基金经理。2023年9月27日起任大成国家安全主题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中国证监会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》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，公司严格执行了公平交易的原则和制度。公司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、5 日内及 10 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，公司旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。公司旗下投资组合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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2024 年 1 季度市场先跌后涨，经历波动后，市场不同行业的表现分化较大，科技板块内部亦是如此，电子、计算机等板块调整幅度较大，受益于 AI 算力的持续投入，通信板块则表现不俗。

我认为市场经历波动后已经不再位于“拐点”区间，而是进入了趋势内。这不是一个轻松的判断，这意味着过去一两年间社会层面的很多讨论正在清晰并逐步融入社会的共识中，也意味着行情将不可避免的出现分化，更意味着符合时代特征的资产将会迎来趋势性的行情。因此，我对市场并不悲观，反而我自身的认知水平是否能够适应时代和市场才是真正的挑战。回归到细节，在投资的选择上，一方面，我认为要更加重视供给格局，无论是中国具备定价权的产业环节，还是 AI 浪潮中的弄潮儿；另一方面，提升国内科技产业在全球产业分工环节中的话语权是发展的必然需求，应当更加关注国产化的深水区、新质生产力。

回归到细节，基金经理维持对显示产业链的看好，无论是大尺寸 LCD 还是小尺寸 OLED；基金经理也看好 AI 为科技产业带来的积极变化，包括自动驾驶，我们将见证整车市场格局的巨大变化；

基金经理 2024 年 1 季度期间也增加了半导体设备板块的配置，特别是产品力强、具有产品线持续延伸能力、供给格局理想的龙头企业。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成科创主题混合（LOF）A 的基金份额净值为 2.0708 元，本报告期基金份额净值增长率为-6.29%，同期业绩比较基准收益率为-1.39%；截至本报告期末大成科创主题混合（LOF）C 的基金份额净值为 2.0509 元，本报告期基金份额净值增长率为-6.42%，同期业绩比较基准收益率为-1.39%。

#### 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	774,722,600.10	83.17
	其中：股票	774,722,600.10	83.17
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,181.74	0.00
	其中：债券	1,181.74	0.00
	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	155,199,590.38	16.66
8	其他资产	1,581,895.09	0.17
9	合计	931,505,267.31	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	651,468,058.35	70.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应	23,581,880.24	2.55

	业		
E	建筑业	2,218.44	0.00
F	批发和零售业	38,581.04	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	14,413.45	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	99,390,315.53	10.73
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	33,451.36	0.00
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	172,436.29	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	21,245.40	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	774,722,600.10	83.62

## 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 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	000100	TCL 科技	19,950,574	93,169,180.58	10.06
2	000725	京东方 A	22,288,871	90,492,816.26	9.77
3	688012	中微公司	485,832	72,534,717.60	7.83
4	002475	立讯精密	2,440,800	71,783,928.00	7.75
5	688378	奥来德	1,805,494	60,845,147.80	6.57
6	600707	彩虹股份	6,036,456	44,367,951.60	4.79
7	600050	中国联通	8,821,050	41,194,303.50	4.45
8	600941	中国移动	352,200	37,248,672.00	4.02
9	002387	维信诺	4,477,400	35,863,974.00	3.87
10	688401	路维光电	1,319,772	34,274,478.84	3.70

注：截至报告期末，本基金投资的一家公司发行的证券 TCL 科技（000100.SZ）因市值波动导致投资比例被动超标。

## 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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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）	1,181.74	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,181.74	0.00

### 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	113055	成银转债	10	1,181.74	0.00

### 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没有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	240,075.20
2	应收证券清算款	1,266,346.10
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	75,473.79
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,581,895.09

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	113055	成银转债	1,181.74	0.00

#### 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

项目	大成科创主题混合(LOF)A	大成科创主题混合(LOF)C
报告期期初基金份额总额	384,865,934.74	93,233,793.98
报告期期间基金总申购份额	5,870,447.35	1,850,505.05
减：报告期期间基金总赎回份额	30,329,045.98	7,262,892.41

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	360,407,336.11	87,821,406.62

## §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

单位：份

项目	大成科创主题混合(LOF)A	大成科创主题混合(LOF)C
报告期期初管理人持有的本基金份额	-	4,345.56
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	-	4,345.56
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	-	0.00

### 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、《大成科创主题混合型证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3、《大成科创主题混合型证券投资基金（LOF）托管协议》；
- 4、《关于大成科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金封闭运作期届满、增加 C 类基金份额并相应修订基金合同及托管协议的公告》；
- 5、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；
- 6、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

2024 年 4 月 19 日