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2020年第1季度报告

2020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：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2020年4月22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2020年4月21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1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金产品情况

基金简称	大成深证成长40ETF联接
基金主代码	090012
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年12月21日
报告期末基金份额总额	148,330,446.81份
投资目标	通过投资于深证成长40交易型开放式指数证券投资基金，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金以深证成长40ETF作为其主要投资标的，方便特定的客户群通过本基金投资深证成长40ETF。本基金并不参与深证成长40ETF的管理。 本基金主要以一级市场申购的方式投资于目标ETF，获取基金份额净值上涨带来的收益；在目标ETF基金份额二级市场交易流动性较好的情况下，也可以通过二级市场买卖目标ETF的基金份额。
业绩比较基准	深证成长40价格指数×95%＋银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属股票基金，预期风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，紧密跟踪标的指数，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
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

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	深证成长40交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	159906

基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2010年12月21日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011年02月23日
基金管理人名称	大成基金管理有限公司
基金托管人名称	中国农业银行股份有限公司

2.1.2 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求与标的指数相似的投资回报。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。　当预期指数成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为深证成长40价格指数。如果指数编制单位变更或停止深证成长40价格指数的编制及发布，或深证成长40价格指数由其他指数替代，或由于指数编制方法等重大变更导致深证成长40价格指数不宜继续作为标的指数，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，并履行适当程序后，变更本基金的标的指数。
风险收益特征	本基金属股票基金，预期风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

§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1月1日-2020年3月31日）
1.本期已实现收益	1,300,097.13
2.本期利润	7,496,012.19
3.加权平均基金份额本期利润	0.0530
4.期末基金资产净值	157,463,428.55
5.期末基金份额净值	1.062

注:1、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。

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	7.16%	2.31%	7.69%	2.38%	-0.53%	-0.07%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

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		
张钟玉	本基金基金经理	2015 年 5 月 23 日	-	10 年	会计学硕士。2010 年 7 月加入大成基金管理有限公司，曾担任研究部研究员、数量与指数投资部数量分析师、基金经理助理。2015 年 2

					月28日起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日起任深证成长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及大成中证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日起任大成沪深300指数证券投资基金基金经理。2019年9月26日起任大成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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

2020年一季度国内外经济增长受全球新冠疫情影响严重。中国是较早出现疫情的国家，由于中国疫情防控措施及时有效，至3月中旬国内疫情流行高峰已经基本过去。2月下旬之后全球疫情出现加速扩散趋势，海外每日确诊人数仍在增长，疫情的高峰还未出现。受疫情冲击影响，今年1-2月经济供需两弱，1季度经济或出现零增甚至负增。但3月以来，随着国内疫情逐渐得到控制，复工逐渐展开，工业生产有望回升。一季度全球股票市场遭遇重挫，A股表现相对坚韧，沪深300下跌10.0%，创业板指上涨4.1%。行业方面，受疫情影响较小的医药、TMT、农林牧渔、食品饮料等表现相对较好，受疫情防控停工措施影响较大的煤炭、有色、钢铁、金融、房地产等周期性板块跌幅较大。

报告期内我们严格遵守基金合同约定，保持目标ETF份额不低于基金资产净值的90%，使联接基金和目标ETF的走势基本一致，力争实现紧密跟踪标的指数的投资目标。

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1.062元；本报告期基金份额净值增长率为7.16%,业绩比较基准收益率为7.69%。

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	1,392,033.00	0.88
	其中：股票	1,392,033.00	0.88
2	基金投资	144,963,000.00	91.72
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	10,975,255.43	6.94
8	其他资产	726,737.91	0.46
9	合计	158,057,026.34	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	930,886.80	0.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	21,071.00	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	85,032.00	0.05
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	282,504.20	0.18
J	金融业	-	-
K	房地产业	9,212.00	0.01
L	租赁和商务服务业	38,280.00	0.02
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	25,047.00	0.02
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,392,033.00	0.88

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	300760	迈瑞医疗	500	130,850.00	0.08
2	002475	立讯精密	3,370	128,599.20	0.08
3	000661	长春高新	200	109,600.00	0.07
4	002352	顺丰控股	1,800	85,032.00	0.05
5	002555	三七互娱	2,400	78,384.00	0.05
6	300122	智飞生物	1,100	74,129.00	0.05
7	300136	信维通信	1,700	58,344.00	0.04
8	300253	卫宁健康	2,600	54,522.00	0.03
9	300383	光环新网	2,100	50,253.00	0.03
10	002384	东山精密	2,400	49,464.00	0.03

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 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	大成深证成长40ETF	股票型	交易型开放式(ETF)	大成基金管理有限公司	144,963,000.00	92.06

5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

5.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11.1 本期国债期货投资政策

无。

5.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.11.3 本期国债期货投资评价

无。

5.12 投资组合报告附注

5.12.1 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。

5.12.2 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。

5.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	22,171.48
2	应收证券清算款	12,703.33
3	应收股利	-
4	应收利息	2,287.01
5	应收申购款	689,576.09
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	726,737.91

5.12.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.12.6 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	141,020,596.75
报告期期间基金总申购份额	53,814,883.91
减:报告期期间基金总赎回份额	46,505,033.85
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	148,330,446.81

§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深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金的文件；

2、《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合同》；

3、《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办公住所。

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4月22日