

# 大成高新技术产业股票型证券投资基金 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	大成高新技术产业股票
基金主代码	000628
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 2 月 3 日
报告期末基金份额总额	804,653,312.96 份
投资目标	本基金主要投资于高新技术产业相关上市公司，通过精选个股和风险控制，力求为基金份额持有人获取超过业绩比较基准的收益。
投资策略	<p>（一）大类资产配置 本基金采取“自上而下”的方式进行大类资产配置，根据对宏观经济、市场面、政策面等因素进行定量与定性相结合的分析研究，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。</p> <p>（二）股票投资策略 1、高新技术产业的界定：根据本基金管理人自身的研究、券商研究机构的研究等，本基金将 28 个申银万国一级行业中的计算机、电子、传媒、通信、机械设备、电气设备、国防军工、汽车和化工归为高新技术产业。本基金将沪深两市从事高新技术产业的上市公司定义为高新技术产业上市公司，具体包括以下两类公司：（1）主营业务属于高新技术产业的公司（2）当前非主营业务提供的产品或服务隶属于高新技术产业，且未来这些产品或服务有望成为主要利润来源的公司。未来，由于科学技术发展、产业结构升级等因素，高新技术产业的外延将会逐渐扩大或发生变化，本基金将视实际情况调整上述对高新技术产业相</p>

	关股票的识别及认定。如因基金管理人界定高新技术产业的方法调整或者原高新技术产业类上市公司经营发生变化不再属于高新技术产业,本基金将在三十个工作日之内进行调整。2、个股投资策略 本基金将采取“自下而上”的方式,依靠定量与定性相结合的方法进行个股选择。3、港股投资策略 本基金所投资香港市场股票标的除适用上述股票投资策略外,还关注:1)香港股票市场制度与内地股票市场存在的差异对股票投资价值的影响,比如行业分布、交易制度、市场流动性、投资者结构、市场波动性、涨跌停限制、估值与盈利回报等方面;2)人民币与港币之间的汇兑比率变化情况。(三)股指期货投资策略(四)国债期货投资策略(五)资产支持证券投资策略(六)融资买入股票策略(七)其它投资策略	
业绩比较基准	中证 700 指数收益率×80% +恒生指数收益率×10% +中证综合债指数收益率×10%	
风险收益特征	本基金是股票型基金,其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金与混合型基金,属于风险水平较高的基金。本基金主要投资于高新技术产业股票,其风险高于全市场范围内投资的股票型基金。	
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	大成高新技术产业股票 A	大成高新技术产业股票 C
下属分级基金的交易代码	000628	011066
报告期末下属分级基金的份额总额	723,964,142.40 份	80,689,170.56 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)	
	大成高新技术产业股票 A	大成高新技术产业股票 C
1. 本期已实现收益	127,676,327.13	12,181,473.26
2. 本期利润	150,898,347.58	11,626,355.64
3. 加权平均基金份额本期利润	0.2180	0.1747
4. 期末基金资产净值	2,527,335,596.24	280,858,295.77
5. 期末基金份额净值	3.491	3.481

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

大成高新技术产业股票 A

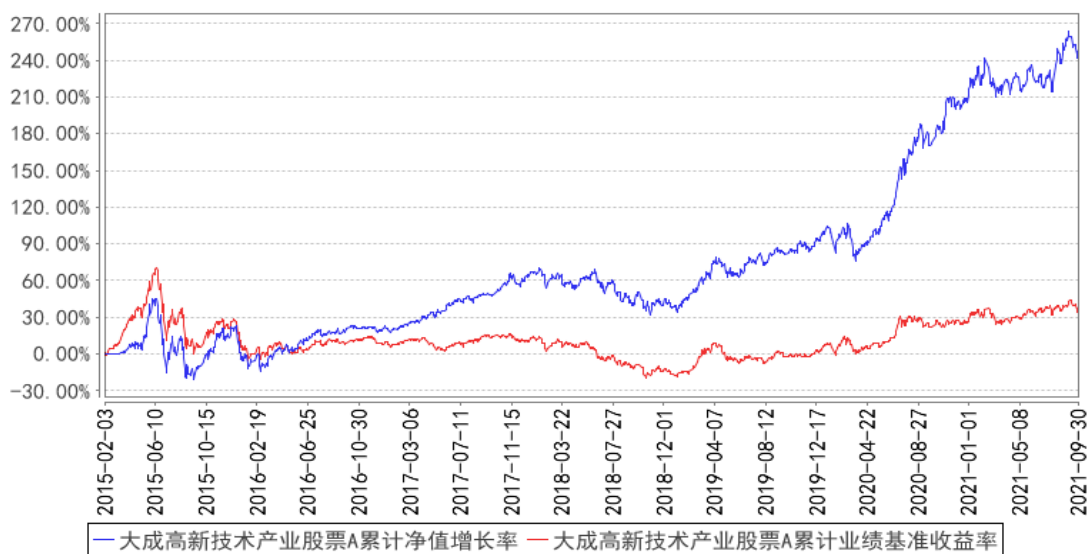
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	6.21%	1.09%	-0.86%	1.03%	7.07%	0.06%
过去六个月	8.52%	0.98%	7.48%	0.90%	1.04%	0.08%
过去一年	28.25%	1.09%	11.45%	1.00%	16.80%	0.09%
过去三年	132.42%	1.24%	48.39%	1.19%	84.03%	0.05%
过去五年	188.99%	1.13%	24.56%	1.06%	164.43%	0.07%
自基金合同生效起至今	249.10%	1.61%	35.88%	1.36%	213.22%	0.25%

大成高新技术产业股票 C

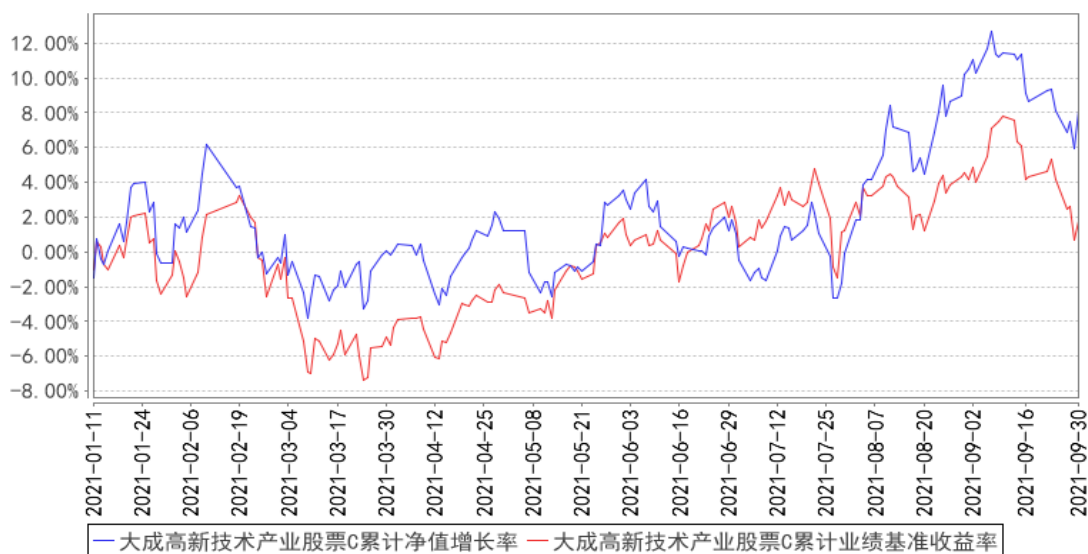
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	6.13%	1.09%	-0.86%	1.03%	6.99%	0.06%
过去六个月	8.31%	0.97%	7.48%	0.90%	0.83%	0.07%
自基金合同生效起至今	8.11%	1.10%	1.74%	1.02%	6.37%	0.08%

#### 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

大成高新技术产业股票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



大成高新技术产业股票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 2020 年 12 月 28 日起，大成高新技术产业股票型证券投资基金增设收取销售服务费的 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从 C 类开始有份额之日开始计算。

## § 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		

刘旭	本基金基金经理，股票投资部总监	2015 年 7 月 29 日	-	10 年	管理学硕士。2009 年至 2010 年在毕马威华振会计师事务所任审计师。2011 年 2 月至 2013 年 5 月任广发证券研究所研究员。2013 年 5 月加入大成基金管理有限公司，曾担任研究部研究员、基金经理助理、股票投资部副总监，现任股票投资部总监。2015 年 7 月 29 日起任大成高新技术产业股票型证券投资基金基金经理。2016 年 8 月 20 日至 2021 年 3 月 17 日任大成创新成长混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理。2019 年 12 月 24 日起任大成优势企业混合型证券投资基金基金经理。2020 年 6 月 5 日起任大成睿裕六个月持有期股票型证券投资基金基金经理。2020 年 8 月 11 日起任大成睿鑫股票型证券投资基金基金经理。2021 年 3 月 15 日起任大成核心价值甄选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。

#### 4.1.1 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

降低三季度涨幅较大标的持仓比重，寻找更具性价比标的，来维持组合整体估值吸引力。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成高新技术产业股票 A 的基金份额净值为 3.491 元，本报告期基金份额净值增长率为 6.21%；截至本报告期末大成高新技术产业股票 C 的基金份额净值为 3.481 元，本报告期基金份额净值增长率为 6.13%。同期业绩比较基准收益率为-0.86%。

#### 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	2,364,630,843.64	83.28
	其中：股票	2,364,630,843.64	83.28
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	461,717,574.74	16.26

8	其他资产	13,092,875.91	0.46
9	合计	2,839,441,294.29	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	153,503.82	0.01
B	采矿业	84,592,330.40	3.01
C	制造业	2,278,796,696.93	81.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	17,529.21	0.00
E	建筑业	28,483.92	0.00
F	批发和零售业	68,723.91	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	84,400.56	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	125,009.92	0.00
J	金融业	160,873.04	0.01
K	房地产业	8,705.25	0.00
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	57,629.88	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	465,779.21	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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	40,574.30	0.00
S	综合	-	-
	合计	2,364,600,240.35	84.20

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
通信服务	-	-
非日常生活消费品	30,603.29	0.00
日常消费品	-	-
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	-	-
工业	-	-
信息技术	-	-
原材料	-	-
房地产	-	-
公用事业	-	-



合计	30,603.29	0.00
----	-----------	------

### 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	601877	正泰电器	4,832,699	273,530,763.40	9.74
2	002884	凌霄泵业	12,348,505	267,468,618.30	9.52
3	603187	海容冷链	6,001,363	243,655,337.80	8.68
4	002372	伟星新材	13,723,231	231,785,371.59	8.25
5	603989	艾华集团	6,746,138	218,642,332.58	7.79
6	600519	贵州茅台	112,797	206,418,510.00	7.35
7	600690	海尔智家	7,887,522	206,258,700.30	7.34
8	002879	长缆科技	7,508,648	145,067,079.36	5.17
9	603279	景津环保	4,237,161	139,063,624.02	4.95
10	605080	浙江自然	2,136,660	132,472,920.00	4.72

#### 5.3.2 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

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，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	391,274.93
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	-
4	应收利息	77,473.41
5	应收申购款	12,624,127.57
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,092,875.91

#### 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 开放式基金份额变动

单位：份

项目	大成高新技术产业股票 A	大成高新技术产业股票 C
报告期期初基金份额总额	667,816,888.24	68,407,890.51
报告期期间基金总申购份额	282,137,808.65	18,821,458.03
减：报告期期间基金总赎回份额	225,990,554.49	6,540,177.98
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	723,964,142.40	80,689,170.56

### § 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

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高新技术产业股票型证券投资基金的文件；
- 2、《大成高新技术产业股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成高新技术产业股票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