

大成沪深 300 指数增强型发起式证券投资
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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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 增强发起式	
基金主代码	010908	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 2 月 23 日	
报告期末基金份额总额	322,489,927.15 份	
投资目标	本基金为增强型股票指数基金，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 8.0%。	
投资策略	本基金在指数化投资的基础上通过数量化模型进行投资组合优化，在控制与业绩比较基准偏离风险的前提下，力争获得超越标的指数的投资收益。	
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%	
风险收益特征	本基金是股票型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。	
基金管理人	大成基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	大成沪深 300 增强发起式 A	大成沪深 300 增强发起式 C
下属分级基金的交易代码	010908	010909
报告期末下属分级基金的份额总额	91,388,180.59 份	231,101,746.56 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）	
	大成沪深 300 增强发起式 A	大成沪深 300 增强发起式 C
1. 本期已实现收益	-388,112.01	-2,700,982.56
2. 本期利润	-4,269,028.31	-10,036,117.92
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0449	-0.0480
4. 期末基金资产净值	87,426,030.87	220,549,076.54
5. 期末基金份额净值	0.9566	0.9543

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 增强发起式 A

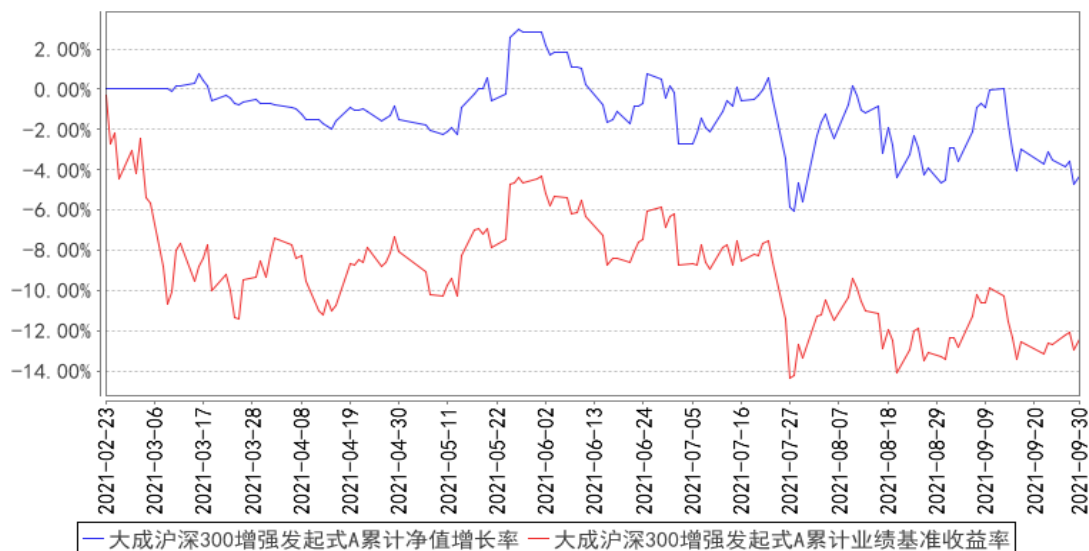
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-4.50%	1.15%	-6.49%	1.14%	1.99%	0.01%
过去六个月	-3.64%	0.93%	-3.38%	1.04%	-0.26%	-0.11%
自基金合同生效起至今	-4.34%	0.85%	-12.39%	1.17%	8.05%	-0.32%

大成沪深 300 增强发起式 C

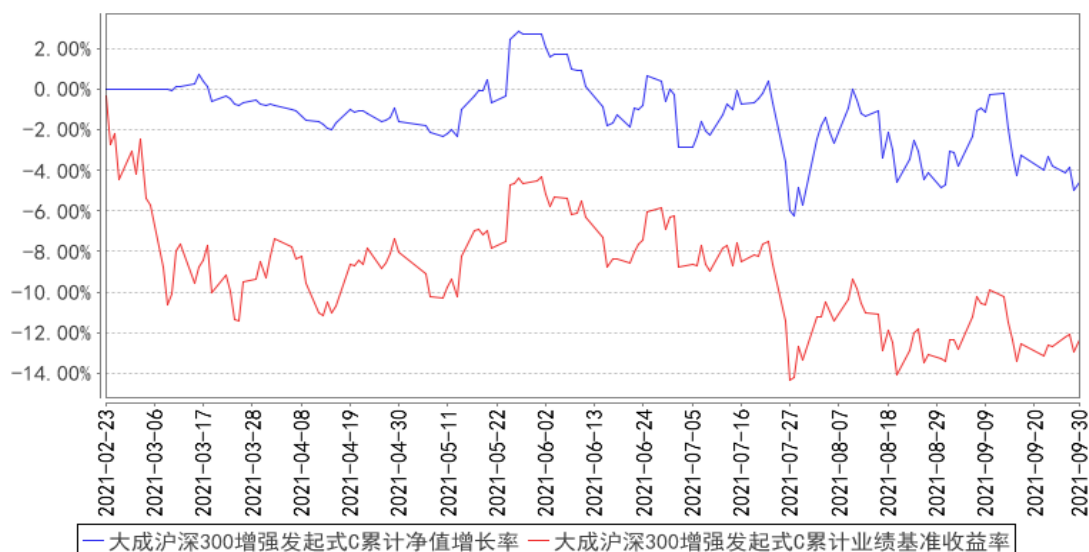
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-4.60%	1.15%	-6.49%	1.14%	1.89%	0.01%
过去六个月	-3.83%	0.93%	-3.38%	1.04%	-0.45%	-0.11%
自基金合同生效起至今	-4.57%	0.85%	-12.39%	1.17%	7.82%	-0.32%

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增强发起式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增强发起式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、本基金合同生效日为 2021 年 2 月 23 日，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2、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。

§ 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	说明
----	----	-------------	------	----

		任职日期	离任日期	年限	
夏高	本基金基金经理	2021 年 2 月 23 日	-	10 年	工学博士。2011 年 1 月至 2012 年 5 月就职于博时基金管理有限公司，任股票投资部投资分析员。2012 年 7 月加入大成基金管理有限公司，曾担任数量与指数投资部高级数量分析师、基金经理助理，现任指数与期货投资部（筹）总监助理。2014 年 12 月 6 日起任大成中证红利指数证券投资基金基金经理。2015 年 6 月 29 日至 2020 年 11 月 13 日担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 2 月 3 日起任大成中证 360 互联网+大数据 100 指数型证券投资基金基金经理。2017 年 3 月 21 日至 2021 年 4 月 27 日任大成智慧量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2020 年 9 月 18 日起任大成动态量化配置策略混合型证券投资基金、大成绝对收益策略混合型发起式证券投资基金基金经理。2021 年 2 月 23 日起任大成沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金经理。2021 年 4 月 29 日起任大成中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数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

2021 年三季度，市场出现显著的结构分化行情。从市值分化上看，上证综指和沪深 300 指数为代表的大盘蓝筹股呈现震荡和下跌的走势；以中证 500 指数为代表的中盘股和以中证 1000 指数为代表的小盘股，则走出震荡攀升的行情。从行业分化上看，煤炭、有色金属、钢铁、电力、化工和新能源等受益于产品价格上涨、景气度提升的行业表现抢眼，而保险、消费者服务、医药、食品饮料和家电等受消费增速低迷影响的行业跌幅居前。整体来看，在本季度，上证综指下跌 0.64%，沪深 300 指数下跌 6.85%，中证 500 指数上涨 4.34%，中证 1000 指数上涨 4.54%。本基金按照价值、成长、盈利、盈利增长和低波动等风格进行较为均衡的配置，在本季度跑赢业绩比较基准。

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 增强发起式 A 的基金份额净值为 0.9566 元，本报告期基金份额净值增长率为-4.50%；截至本报告期末大成沪深 300 增强发起式 C 的基金份额净值为 0.9543 元，本报告期基金份额净值增长率为-4.60%。同期业绩比较基准收益率为-6.49%。

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	264,303,713.99	82.74
	其中：股票	264,303,713.99	82.74
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	41,274,624.44	12.92
8	其他资产	13,877,709.89	4.34
9	合计	319,456,048.32	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	-	-
B	采矿业	8,382,042.00	2.72
C	制造业	139,683,666.60	45.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,697,550.00	0.88
E	建筑业	9,756,000.00	3.17
F	批发和零售业	1,691,734.04	0.55
G	交通运输、仓储和邮政业	5,508,864.00	1.79
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	72,717,483.40	23.61
K	房地产业	8,507,138.00	2.76
L	租赁和商务服务业	12,747,728.00	4.14
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	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-

S	综合	-	-
	合计	261,692,206.04	84.97

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	830,827.64	0.27
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	54,186.03	0.02
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	1,677,437.80	0.54
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	29,906.38	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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	3,925.22	0.00
S	综合	-	-
	合计	2,611,507.95	0.85

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	600036	招商银行	336,659	16,984,446.55	5.51
2	300122	智飞生物	88,800	14,118,312.00	4.58
3	600809	山西汾酒	44,040	13,894,620.00	4.51
4	600030	中信证券	541,900	13,699,232.00	4.45
5	000725	京东方 A	2,601,000	13,135,050.00	4.26

6	000100	TCL 科技	1,870,300	11,708,078.00	3.80
7	601939	建设银行	1,734,900	10,357,353.00	3.36
8	300059	东方财富	288,940	9,930,867.80	3.22
9	601668	中国建筑	2,032,500	9,756,000.00	3.17
10	600309	万华化学	81,000	8,646,750.00	2.81

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	0.51
2	688076	诺泰生物	4,984	266,893.20	0.09
3	688296	和达科技	2,173	80,487.92	0.03
4	688772	珠海冠宇	5,472	78,960.96	0.03
5	688697	纽威数控	5,837	71,328.14	0.02

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

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

代码	名称	持仓量 (买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动 (元)	风险说明
IF2110	IF2110	16	23,357,760.00	227,100.00	-
公允价值变动总额合计 (元)					227,100.00
股指期货投资本期收益 (元)					-488,815.50
股指期货投资本期公允价值变动 (元)					206,575.50

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示，单位为手。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，参与股指期货的投资。此外，本基金还将运用股指期货来管理特殊情况下的流动性风险，如预期大额申购赎回、大量分红等。

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建设银行（601939.SH）的发行主体中国建设银行股份有限公司于 2021 年 8 月 13 日因占压财政存款或者资金等，受到中国人民银行处罚（银罚字（2021）22 号）。建设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。

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

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	2,903,153.38
2	应收证券清算款	9,803,246.05
3	应收股利	-
4	应收利息	2,497.08
5	应收申购款	1,168,813.38
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,877,709.89

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	0.51	新股锁定
2	688076	诺泰生物	266,893.20	0.09	新股锁定
3	688296	和达科技	80,487.92	0.03	新股锁定
4	688772	珠海冠宇	78,960.96	0.03	新股未上市
5	688697	纽威数控	71,328.14	0.02	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 增强发起式 A	大成沪深 300 增强发起式 C
报告期期初基金份额总额	100,905,151.75	194,209,181.24
报告期期间基金总申购份额	2,286,348.67	104,247,202.21
减：报告期期间基金总赎回份额	11,803,319.83	67,354,636.89
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	91,388,180.59	231,101,746.56

§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

单位：份

项目	大成沪深 300 增强发起式 A	大成沪深 300 增强发起式 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	10,000,000.00	-
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	10,000,000.00	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	3.10	-

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	3.10	10,000,000.00	3.10	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	110.07	0.00	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-

合计	10,000,110.07	3.10	10,000,000.00	3.10	3 年
----	---------------	------	---------------	------	-----

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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。

9.2 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。

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立大成沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金的文件；
- 2、《大成沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成沪深 300 指数增强型发起式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。

10.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

10.3 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