# 大成策略回报混合型证券投资基金

## 2019年第二季度报告

基金管理人:大成基金管理有限公司
基金托管人:中国光大银行股份有限公司
报告送出日期:2019年7月18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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年7月17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2019年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 大成策略回报混合 |
| 基金主代码 | 090007 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2008年11月26日 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,771,447,564.70份 |
| 投资目标 | 追求基金资产的长期稳健增值,兼顾当期收益;同时,实施积极的分红政策,回报投资者。 |
| 投资策略 | 本基金在控制风险的前提下,采取趋势投资策略进行总体资产配置;在行业配置、个股投资上分别实施行业轮动投资策略、核心-卫星策略、价值投资策略、买入并持有策略,以期在承担中高风险的前提下获取尽可能高的投资收益;同时,强调收益管理,实施收益管理策略,以期在增长期及时锁定收益,制度性的减少未来可能的下跌风险,增加投资总收益。 |
| 业绩比较基准 | 80%×沪深300指数+20%×中债综合指数 |
| 风险收益特征 | 本基金属于风险收益水平适中的混合型基金品种,其长期平均的预期收益和风险低于股票基金,高于债券基金和货币市场基金。 |
| 基金管理人 | 大成基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国光大银行股份有限公司 |

§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(2019年4月1日-2019年6月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 13,168,750.13 |
| 2.本期利润 | -102,418,669.23 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0576 |
| 4.期末基金资产净值 | 1,723,575,621.24 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.973 |

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。

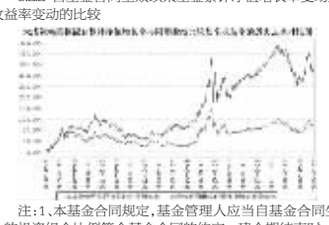
2、所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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 | -6.08% | 1.40% | -0.72% | 1.22% | -5.36% | 0.18% |

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



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、本基金业绩比较基准自2015年9月14日起由原"沪深300指数×80%+中信全债指数×20%"变更为"沪深300指数×80%+中债综合指数×20%"。

3、本基金于2015年7月22日起由大成策略回报股票型证券投资基金更名为大成策略回报混合型证券投资基金。

§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 | | |
| 侯春燕 | 本基金基金经理 | 2018年9月7日 | - | 9年 | 经济学硕士。2010年6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。2015年12月9日起任大成蓝筹稳健证券投资基金基金经理,2017年1月10日至2019年1月10日任大成消费主题混合型证券投资基金、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,2017年12月1日至2019年1月10日任大成新锐产业混合型证券投资基金基金经理。2018年9月7日起任大成策略回报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。

4.2 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

公司风险管理部定期对公司旗下所有投资组合间同向交易、反向交易等可能存在异常交易的行为进行分析。2019年2季度公司旗下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%的交易情形;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;投资组合间虽然存在同向交易行为,但结合交易价差分布统计分析和潜在利益输送金额统计结果表明投资组合间不存在利益输送的可能性。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

从持仓构成上分析,目前本组合二季度持仓行业主要集中在医药、汽车、电子、机械、食品饮料、旅游和银行地产。二季度回顾主要有三点:一是汽车和电子行业复苏进度低于预期,股价表现较弱;二是医药中的部分个股经营方面遭遇短期压力、下跌幅度较大;三是组合二季度增持了航空和酒店,选择这两个方向是看好消费升级以及行业竞争格局的优化,但因为二季度经济下行压力加大,导致这两个板块短期内下跌较多。

本组合长期坚持的投资主线包括:一、制造业升级,包括核心零部件的进口替代以及技术升级推动的效率提升;二、人口结构中主力群体(30-40岁、60岁以上老人)相关的消费,包括旅游消费和医药等;三、低估值的金融地产中仍具备成长能力的公司。接下来仍将坚持这几条主线寻找标的。与此同时会对目前持仓个股的风险收益比不断评估做出调整,以期为持有人在下半年获得比较好的收益。

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0.973元;本报告期基金份额净值增长率为-6.08%,业绩比较基准收益率为-0.72%。

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 | 1,459,472,565.34 | 84.13 |
| | 其中:股票 | 1,459,472,565.34 | 84.13 |
| 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 | 273,868,981.29 | 15.79 |
| 8 | 其他资产 | 1,443,133.91 | 0.08 |
| 9 | 合计 | 1,734,784,680.54 | 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 | 1,495,362.00 | 0.09 |
| B | 采矿业 | 43,948,484.19 | 2.55 |
| C | 制造业 | 785,719,133.32 | 45.59 |
| 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 | 47,243,689.80 | 2.74 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 96,380,374.26 | 5.59 |
| H | 住宿和餐饮业 | 84,625,488.76 | 4.91 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 39,603.76 | 0.00 |
| J | 金融业 | 108,783,887.11 | 6.31 |
| K | 房地产业 | 113,904,455.40 | 6.61 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 5,954,916.00 | 0.35 |
| 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 | 64,860,567.68 | 3.76 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 106,516,603.06 | 6.18 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 1,459,472,565.34 | 84.68 |

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 | 600340 | 华夏幸福 | 3,497,220 | 113,904,455.40 | 6.61 |
| 2 | 300144 | 宋城演艺 | 4,602,139 | 106,493,496.46 | 6.18 |
| 3 | 601166 | 兴业银行 | 5,737,073 | 104,931,065.17 | 6.09 |
| 4 | 600887 | 伊利股份 | 2,943,911 | 98,356,066.51 | 5.71 |
| 5 | 300408 | 三环集团 | 3,797,292 | 73,857,329.40 | 4.29 |
| 6 | 300124 | 汇川技术 | 2,903,049 | 66,508,852.59 | 3.86 |
| 7 | 002044 | 美年健康 | 5,213,872 | 64,860,567.68 | 3.76 |
| 8 | 601111 | 中国国航 | 6,721,500 | 64,324,755.00 | 3.73 |
| 9 | 601633 | 长城汽车 | 7,766,438 | 64,228,442.26 | 3.73 |
| 10 | 002236 | 大华股份 | 4,377,253 | 63,657,713.56 | 3.69 |

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。

本基金投资的前十名证券的发行主体本出现本期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 | 545,242.18 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 56,255.70 |
| 5 | 应收申购款 | 841,636.03 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 1,443,133.91 |

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

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 1,962,121,716.49 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 130,758,529.79 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 321,432,681.58 |
| 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 | 1,771,447,564.70 |

§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

根据我司于2019年7月6日发布的《大成基金管理有限公司高级管理人员变更公告》,经大成基金管理有限公司第六届董事会第三十三次会议审议通过,自2019年7月6日起,公司总经理由罗登攀变更为谭晓冈。具体详见公司相关公告。

§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策略回报股票型证券投资基金的文件;

2、《大成策略回报股票型证券投资基金变更基金名称、基金类别以及修订基金合同部分条款的公告》;

3、《大成策略回报混合型证券投资基金基金合同》;

4、《大成策略回报混合型证券投资基金托管协议》;

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

2019年7月18日

# 大成产业升级股票型证券投资基金(LOF)

## 2019年第二季度报告

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:2019年7月18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2019年7月17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2019年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 大成产业升级股票(LOF) |
| 场内简称 | 大成产业 |
| 基金主代码 | 160919 |
| 交易代码 | 160919 |
| 基金运作方式 | 上市契约型开放式(LOF) |
| 基金合同生效日 | 2014年12月26日 |
| 报告期末基金份额总额 | 165,116,888.34份 |
| 投资目标 | 本基金围点投资于与产业升级主题相关的行业和企业,在严格控制风险的前提下,力争把握标的行业投资机会实现基金资产的长期稳健增值。 |
| 投资策略 | 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。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率×80%+中证综合债券指数收益率×20% |
| 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。 |
| 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 |

§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(2019年4月1日-2019年6月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | -1,991,389.49 |
| 2.本期利润 | -10,893,444.13 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0650 |
| 4.期末基金资产净值 | 200,522,941.19 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.214 |

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(不含公允价值变动损益)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。

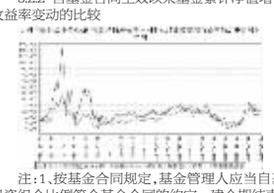
2、所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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 | -5.16% | 1.71% | -0.72% | 1.22% | -4.44% | 0.49% |

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



注:1、按基金合同规定,基金管理人应当自基金转型之日起6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、截至报告期末,本基金投资的绝味食品(603517.SH)与绝味转债(113529.SH)因当日市值波动导致投资于同一家公司发行的证券的比例被动超标。除此之外,报告期内本基金的其他各项投资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 | | |
| 李林益 | 本基金基金经理 | 2015年7月7日 | - | 8年 | 工学硕士。2011年6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。2015年12月9日起任大成产业升级股票型证券投资基金(LOF)基金经理,2017年9月12日起任大成价值增长证券投资基金基金经理。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

公司风险管理部定期对公司旗下所有投资组合间同向交易、反向交易等可能存在异常交易的行为进行分析。2019年2季度公司旗下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%的交易情形;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;投资组合间虽然存在同向交易行为,但结合交易价差分布统计分析和潜在利益输送金额统计结果表明投资组合间不存在利益输送的可能性。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

过去一个季度,外部环境的变化复杂难判,内部进入金融风险攻坚战关键阶段。伴随着标志性事件的发生,资产价格总体上随之大幅震荡。本基金秉持在剧变中寻找属于未来的机会,自上而下判大势,自下而上选个股,成功把握了一系列投资机会。剧烈震荡的市场环境,对于选股型基金经理,也带来了组合净值回撤相对较大。未来本基金将继续秉持精选个股、做时间的朋友,力争为持有人创造持续、超额回报。

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1.214元;本报告期基金份额净值增长率为-5.16%,业绩比较基准收益率为-0.72%。

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 | 178,732,365.94 | 88.13 |
| | 其中:股票 | 178,732,365.94 | 88.13 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 4,192,164.50 | 2.07 |
| | 其中:债券 | 4,192,164.50 | 2.07 |
| | 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 | 19,607,263.27 | 9.67 |
| 8 | 其他资产 | 271,753.25 | 0.13 |
| 9 | 合计 | 202,803,547.06 | 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 | 32,238,407.34 | 16.08 |
| B | 采矿业 | 5,664,780.39 | 2.83 |
| C | 制造业 | 107,183,519.02 | 53.45 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 6,481,142.24 | 3.23 |
| F | 批发和零售业 | 65,344.00 | 0.03 |
| 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 | 7,910,466.32 | 3.94 |
| J | 金融业 | 13,494,382.94 | 6.73 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 5,671,217.09 | 2.83 |
| 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 | 23,106.60 | 0.01 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 178,732,365.94 | 89.13 |

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 | 002311 | 海大集团 | 521,229 | 16,105,976.10 | 8.03 |
| 2 | 603517 | 绝味食品 | 409,080 | 15,917,302.80 | 7.94 |
| 3 | 002714 | 牧原股份 | 265,592 | 15,614,153.68 | 7.79 |
| 4 | 000876 | 新希望 | 828,002 | 14,382,394.74 | 7.17 |
| 5 | 600332 | 白云山 | 279,200 | 11,438,824.00 | 5.70 |
| 6 | 300498 | 温氏股份 | 253,131 | 9,077,277.66 | 4.53 |
| 7 | 002179 | 中航光电 | 269,750 | 9,025,835.00 | 4.50 |
| 8 | 002916 | 深南电路 | 86,040 | 8,769,196.80 | 4.37 |
| 9 | 300699 | 光威复材 | 242,197 | 7,919,841.90 | 3.95 |
| 10 | 300770 | 新媒股份 | 90,500 | 7,828,250.00 | 3.90 |

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) | 4,192,164.50 | 2.09 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 4,192,164.50 | 2.09 |

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 | 113529 | 绝味转债 | 32,510 | 4,192,164.50 | 2.09 |

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

本基金为提高投资效率更好地达到本基金的投资目标,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与股指期货投资。

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。

5.11.2 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 | 263,047.82 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 7,116.44 |
| 5 | 应收申购款 | 1,588.99 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 271,753.25 |

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

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 169,264,807.59 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 479,110.36 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 4,627,029.61 |
| 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 | 165,116,888.34 |

§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

根据我司于2019年7月6日发布的《大成基金管理有限公司高级管理人员变更公告》,经大成基金管理有限公司第六届董事会第三十三次会议审议通过,自2019年7月6日起,公司总经理由罗登攀变更为谭晓冈。具体详见公司相关公告。

§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产业升级股票型证券投资基金(LOF)的文件;

2、《大成产业升级股票型证券投资基金(LOF)基金合同》;

3、《大成产业升级股票型证券投资基金(LOF)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

2019年7月18日

# 大成创新成长混合型证券投资基金(LOF)

## 2019年第二季度报告

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:2019年7月18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2019年7月17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2019年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 大成创新成长混合(LOF) |
| 场内简称 | 大成创新 |
| 基金主代码 | 160910 |
| 交易代码 | 160910 |
| 基金运作方式 | 上市契约型开放式(LOF) |
| 基金合同生效日 | 2007年6月12日 |
| 报告期末基金份额总额 | 2,204,345,883.10份 |
| 投资目标 | 在控制风险和保证流动性的前提下,超越业绩比较基准,寻求基金资产的长期稳健增值。 |
| 投资策略 | 本基金以股票投资为主,采用积极的投资策略,精选具备持续增长能力,价格处于合理区间的优质股票构建投资组合;本基金以固定收益品种投资为轴,确保投资组合具有良好的流动性。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数×70%+中国债券总指数×30% |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金,风险收益水平高于货币市场基金和债券型基金,属于中高风险的证券投资基金品种。 |
| 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 |

§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(2019年4月1日-2019年6月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 78,629,616.64 |
| 2.本期利润 | 28,967,897.31 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0116 |
| 4.期末基金资产净值 | 2,318,135,869.26 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.052 |

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 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 | 1.84% | 1.36% | -0.58% | 1.06% | 2.42% | 0.30% |

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

注:1.按基金合同规定,大成创新成长混合型证券投资基金(LOF)自基金合同生效(暨基金转型)之日2007年6月12日起三个月内为建仓期。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. 本基金于自2007年6月12日起由景博证券投资基金转型为大成创新成长混合型证券投资基金(LOF)。

§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 | 2016年8月20日 | - | 8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,曾担任大成策略回报股票型证券投资基金、大成策略回报混合型证券投资基金、大成竞争优势混合型证券投资基金、大成竞争优势混合型证券投资基金、大成高新技术产业股票型证券投资基金基金经理助理。现任股票投资部总监助理,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日起任大成创新成长混合型证券投资基金(LOF)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

公司风险管理部定期对公司旗下所有投资组合间同向交易、反向交易等可能存在异常交易的行为进行分析。2019年2季度公司旗下主动投资组合间