大成创业板两年定期开放混合型证券投资基金
2021年第1季度报告

2021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：2021年4月22日

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 04 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 2021 年 01 月 01 日起至 03 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	大成创业板两年定开混合
场内简称	创业大成
基金主代码	160926
交易代码	160926
基金运作方式	上市契约型、定期开放式
基金合同生效日	2020 年 7 月 16 日
报告期末基金份额总额	2,976,875,391.34 份
投资目标	本基金主要投资于创业板上市公司的股票，在严格控制风险和保持良好流动性的前提下，灵活运用多种投资策略进行积极的组合优化，力争实现超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金重点关注创业板股票的投资机会，通过自下而上深度挖掘，精选个股。
业绩比较基准	创业板综合指数收益率×60%+恒生综合指数收益率×10%+中债综合全价指数收益率×30%。
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本基金和债券型基金，低于股票型基金。本基金若投资港股通标的票，则需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。 封闭期内，本基金可以通过战略配售投资创业板股票，由此产生的投资风险与价格波动由投资者自行承担。同时，采用战略配售方式参与股票投资，通常有一定限售期，因此，本基金投资面临限售期内标的无法交易的风

	险。	
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	大成创业板两年定开混合 A	大成创业板两年定开混合 C
下属分级基金的场内简称	创业大成	-
下属分级基金的交易代码	160926	009798
报告期末下属分级基金的份额总额	2,480,449,707.14 份	496,425,684.20 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 1 月 1 日-2021 年 3 月 31 日）	
	大成创业板两年定开混合 A	大成创业板两年定开混合 C
1.本期已实现收益	209,349,535.23	41,230,950.23
2.本期利润	-304,097,764.00	-61,276,020.06
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1226	-0.1234
4.期末基金资产净值	2,671,581,425.13	533,171,286.24
5.期末基金份额净值	1.0771	1.0740

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

大成创业板两年定开混合 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	-10.22%	2.04%	-4.49%	1.13%	-5.73%	0.91%
过去六个月	9.55%	1.67%	0.41%	1.06%	9.14%	0.61%
自基金合同生效起至今	7.71%	1.55%	-2.16%	1.15%	9.87%	0.40%

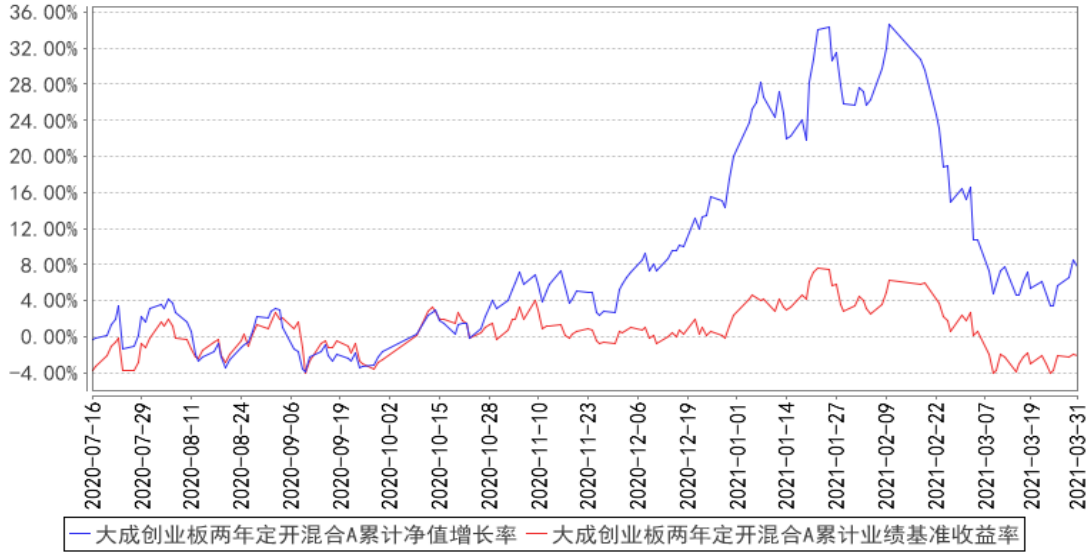
大成创业板两年定开混合 C

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	-10.31%	2.04%	-4.49%	1.13%	-5.82%	0.91%
过去六个月	9.32%	1.67%	0.41%	1.06%	8.91%	0.61%
自基金合同	7.40%	1.55%	-2.16%	1.15%	9.56%	0.40%

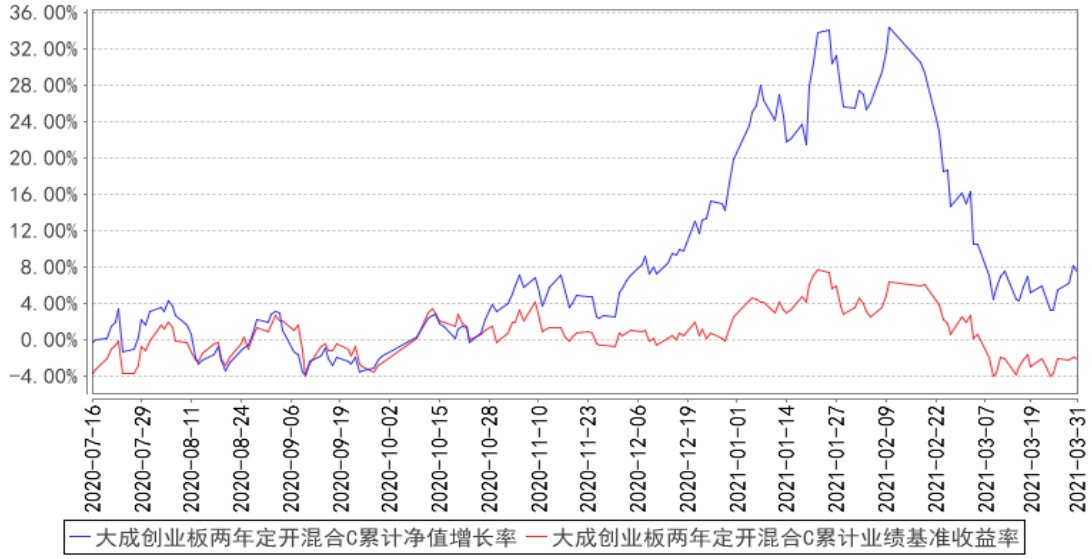
生效起至今						

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

大成创业板两年定开混合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



大成创业板两年定开混合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 2020 年 7 月 16 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		
邹建	本基金基金经理	2021 年 1 月 26 日	-	5 年	工学硕士。2016 年 7 月加入大成基金管理有限公司，先后担任研究部研究员、基金经理助理、基金经理，期间曾担任大成创新成长混合型证券投资基金(LOF)、大成高新技术产业股票型证券投资基金、大成创业板两年定期开放混合型证券投资基金、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、大成科技创新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、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。2021 年 1 月 26 日起任大成科技消费股票型证券投资基金、大成创业板两年定期开放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
谢家乐	本基金基金经理	2020 年 7 月 16 日	-	9 年	工学硕士。曾担任华泰证券股份有限公司研究所研究员。2014 年 6 月加入大成基金管理有限公司，曾担任研究部研究员、大成睿景灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理。2019 年 8 月 6 日至 2020 年 11 月 13 日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。2019 年 8 月 6 日起任大成科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2020 年 4 月 29 日起任大成科技创新混合型证券投资基金基金经理。2020 年 7 月 16 日起任大成创业板两年定期开放混合型证券投资基金基金经理。2020 年 11 月 30 日起任大成成长进取混合型证券投资基金基金经理。具备基金从业资格。国籍：中国
徐彦	本基金基金经理，公司首席权益投资官	2020 年 7 月 16 日	-	15 年	管理学硕士。2006 年 9 月至 2007 年 7 月任职于中国东方资产管理公司。2007 年 7 月至 2018 年 9 月任职于大成基金管理有限公司，先后担任研究员、研究主管，2012 年 10 月起历任大成策略回报、大成竞争优势、大成高新技术和大成景阳领先混合型证券投资基金基金经理。2018 年 10 月至 2019 年 7 月任正心谷创

					新资本研究团队负责人。2019年8月至2021年2月任大成基金管理有限公司股票投资部总监。2021年2月任公司首席权益投资官。2019年12月30日起任大成睿享混合型证券投资基金、大成景阳领先混合型证券投资基金、大成竞争优势混合型证券投资基金基金经理。2020年3月20日起任大成策略回报混合型证券投资基金基金经理。2020年7月16日起任大成创业板两年定期开放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

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。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，即投资组合成交时间不一致以及成交价格的日内较大变动导致个别些组合间的成交价格差异较大，但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存在2笔同日反向交易，原因为流动性需要。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

市场在一季度发生了较大波动，本产品根据估值与基本面进展的偏离程度对组合仓位结构进行了调整，同时在持续研究的科技、消费、医药和高端制造等领域发掘了个别符合投资框架标准的新公司。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成创业板两年定开混合A的基金份额净值为1.0771元，本报告期基金份额净值增长率为-10.22%；截至本报告期末大成创业板两年定开混合C的基金份额净值为1.0740元，本报告期基金份额净值增长率为-10.31%。同期业绩比较基准收益率为-4.49%。

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	2,860,080,160.51	82.80
	其中：股票	2,860,080,160.51	82.80
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	559,741,603.75	16.20
8	其他资产	34,532,386.14	1.00
9	合计	3,454,354,150.40	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	273,003,057.51	8.52
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,419,650,568.34	75.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	107,410.44	0.00
E	建筑业	15,677.16	0.00
F	批发和零售业	22,688,271.45	0.71
G	交通运输、仓储和邮政业	22,275.46	0.00
H	住宿和餐饮业	36,802,050.00	1.15
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,351,117.08	0.07
J	金融业	15,360,677.13	0.48
K	房地产业	108,331.32	0.00
L	租赁和商务服务业	15,426,432.00	0.48
M	科学研究和技术服务业	8,028,184.38	0.25
N	水利、环境和公共设施管理业	644,176.61	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	223,446.22	0.01
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,794,431,675.10	87.20

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（%）
原材料	13,737,251.46	0.43
非日常生活消费品	-	-
日常消费品	-	-
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	51,911,233.95	1.62
工业	-	-
信息技术	-	-
通信服务	-	-
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	65,648,485.41	2.05

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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	720,578	287,589,885.58	8.97
2	300628	亿联网络	4,214,514	284,962,619.38	8.89
3	300124	汇川技术	3,173,784	271,390,269.84	8.47
4	300151	昌红科技	8,945,582	257,006,570.86	8.02
5	300595	欧普康视	2,085,462	188,004,399.30	5.87
6	300087	荃银高科	7,491,229	181,212,829.51	5.65
7	300750	宁德时代	350,180	112,817,490.60	3.52
8	300119	瑞普生物	3,814,000	105,418,960.00	3.29
9	000100	TCL科技	11,265,546	105,220,199.64	3.28
10	300470	中密控股	2,017,105	90,562,071.90	2.83

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

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	6,274,038.04
2	应收证券清算款	28,020,291.74
3	应收股利	-
4	应收利息	167,943.24
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	70,113.12
8	其他	-
9	合计	34,532,386.14

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

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	300470	中密控股	54,647,662.50	1.71	非公开流通受限
2	300628	亿联网络	35,834,400.00	1.12	大宗交易流通受限

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	大成创业板两年定开混合 A	大成创业板两年定开混合 C
报告期期初基金份额总额	2,480,449,707.14	496,425,684.20
报告期期间基金总申购份额	-	-
减:报告期期间基金总赎回份额	-	-
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	2,480,449,707.14	496,425,684.20

§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创业板两年定期开放混合型证券投资基金的文件；

2、《大成创业板两年定期开放混合型证券投资基金基金合同》；

3、《大成创业板两年定期开放混合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 4 月 22 日