

# 大成科创主题混合型证券投资基金（LOF）

## 2026 年第 2 季度报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 7 月 21 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 07 月 20 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 2026 年 04 月 01 日起至 06 月 30 日止。

§2 基金产品概况

|            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
|------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 大成科创主题混合（LOF）                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| 场内简称       | 科创大成 LOF                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 基金主代码      | 501079                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 交易代码       | 501079                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 基金运作方式     | 上市契约型开放式（LOF）                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| 基金合同生效日    | 2019 年 7 月 18 日                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 报告期末基金份额总额 | 235,128,255.93 份                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 投资目标       | 本基金将灵活运用多种投资策略，通过充分挖掘科技创新相关上市公司的投资机会以及债券投资，力争为基金份额持有人创造长期稳健的投资回报。                                                                                                                                                                                                                                  |
| 投资策略       | 封闭运作期届满转型后基金的投资策略<br>（1）大类资产配置策略：本基金通过定性分析与定量分析相结合的方法分析全球宏观经济、各主要经济体及行业的基本面和资本市场发展趋势，综合考量宏观经济发展前景，评估各类资产的预期收益与风险，合理确定本基金在股票、债券、现金等各类别资产上的投资比例，并随着各类资产风险收益特征的相对变化，适时做出动态调整。<br>（2）股票投资策略：本基金的股票策略采取“自上而下”与“自下而上”相结合的积极管理策略。（3）债券投资策略；（4）资产支持证券投资策略；（5）股指期货投资策略；（6）国债期货投资策略；（7）固定收益投资策略；（8）存托凭证投资策略。 |
| 业绩比较基准     | 中国战略新兴产业成份指数收益率*90%+中债-国债总                                                                                                                                                                                                                                                                         |

|                 |                                            |                  |
|-----------------|--------------------------------------------|------------------|
|                 | 全价(1-3 年)指数收益率*10%                         |                  |
| 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基金和债券型基金，低于股票型基金。 |                  |
| 基金管理人           | 大成基金管理有限公司                                 |                  |
| 基金托管人           | 中国建设银行股份有限公司                               |                  |
| 下属分级基金的基金简称     | 大成科创主题混合 (LOF) A                           | 大成科创主题混合 (LOF) C |
| 下属分级基金的场内简称     | 科创大成 LOF                                   | -                |
| 下属分级基金的交易代码     | 501079                                     | 016198           |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 199,800,874.66 份                           | 35,327,381.27 份  |

注：本基金业绩比较基准自 2026 年 6 月 1 日起由原“中国战略新兴产业成份指数收益率×60%+中债综合全价指数收益率×40%”变更为“中国战略新兴产业成份指数收益率\*90%+中债-国债总全价(1-3 年)指数收益率\*10%”。

§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（2026 年 4 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日） |                  |
|-----------------|---------------------------------------|------------------|
|                 | 大成科创主题混合 (LOF) A                      | 大成科创主题混合 (LOF) C |
| 1. 本期已实现收益      | 182,855,608.89                        | 11,188,651.28    |
| 2. 本期利润         | 598,823,504.31                        | 27,161,621.39    |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 3.3608                                | 3.6469           |
| 4. 期末基金资产净值     | 1,267,316,537.79                      | 218,952,091.86   |
| 5. 期末基金份额净值     | 6.3429                                | 6.1978           |

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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认购或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

大成科创主题混合 (LOF) 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 | 111.71% | 2.94%     | 40.40%     | 1.87%         | 71.31% | 1.07% |
| 过去六个月 | 115.54% | 2.72%     | 37.32%     | 1.53%         | 78.22% | 1.19% |

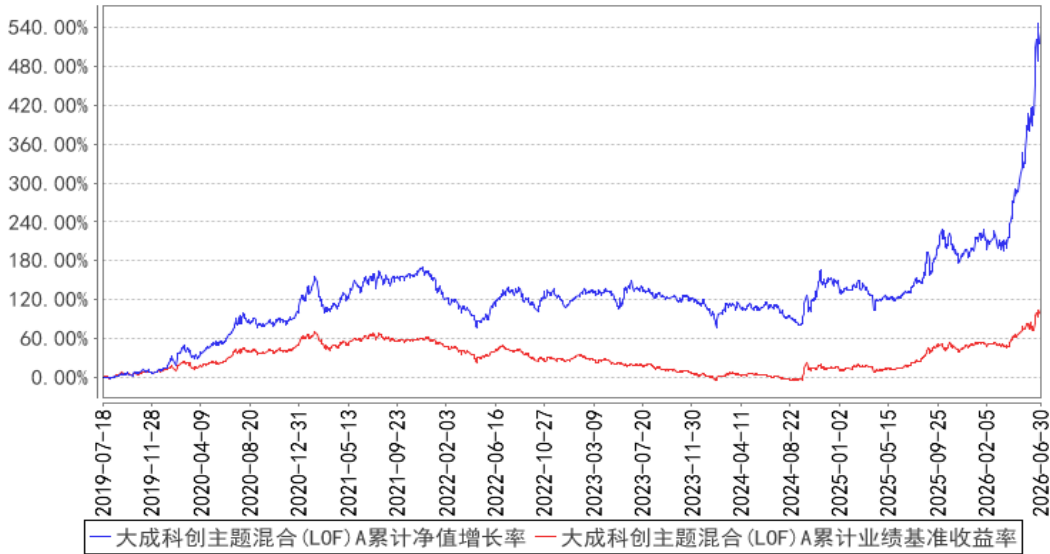
|            |         |       |         |       |         |       |
|------------|---------|-------|---------|-------|---------|-------|
| 过去一年       | 172.74% | 2.36% | 74.61%  | 1.36% | 98.13%  | 1.00% |
| 过去三年       | 167.26% | 1.86% | 71.50%  | 1.16% | 95.76%  | 0.70% |
| 过去五年       | 148.66% | 1.71% | 24.77%  | 1.06% | 123.89% | 0.65% |
| 自基金合同生效起至今 | 534.29% | 1.69% | 105.12% | 1.05% | 429.17% | 0.64% |

大成科创主题混合 (LOF) C

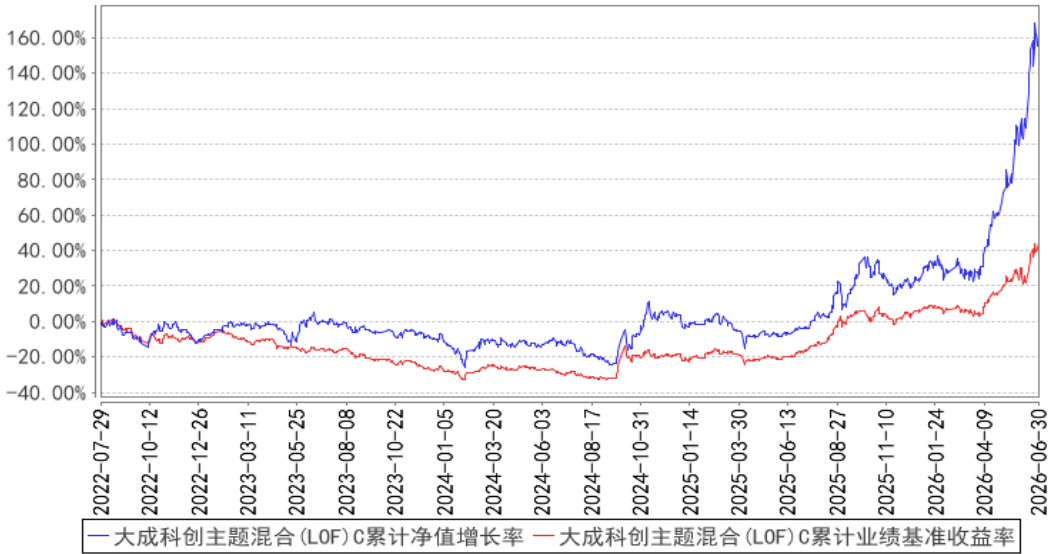
| 阶段         | 净值增长率①  | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③     | ②－④   |
|------------|---------|-----------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去三个月      | 111.43% | 2.94%     | 40.40%     | 1.87%         | 71.03%  | 1.07% |
| 过去六个月      | 114.93% | 2.72%     | 37.32%     | 1.53%         | 77.61%  | 1.19% |
| 过去一年       | 171.16% | 2.36%     | 74.61%     | 1.36%         | 96.55%  | 1.00% |
| 过去三年       | 162.51% | 1.86%     | 71.50%     | 1.16%         | 91.01%  | 0.70% |
| 自基金合同生效起至今 | 163.13% | 1.76%     | 44.69%     | 1.08%         | 118.44% | 0.68% |

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

大成科创主题混合(LOF)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



大成科创主题混合(LOF)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、自 2022 年 7 月 18 日起，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正式转型为大成科创主题混合型证券投资基金（LOF），基金名称相应变更为“大成科创主题混合型证券投资基金（LOF）”。

3、本基金自 2022 年 7 月 18 日起增设 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自 2022 年 7 月 29 日 C 类有份额起开始计算。

§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 |        |                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 郭玮羚 | 本基金基金经理 | 2026 年 1 月 13 日 | —    | 11 年   | 对外经济贸易大学金融硕士。2015 年 7 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，现任股票投资部基金经理。2021 年 1 月 26 日至 2023 年 6 月 2 日任大成行业轮动混合型证券投资基金基金经理。2021 年 1 月 26 日起任大成科技创新混合型证券投资基金基金经理。2026 年 1 月 13 日起任大成科创主题混合型证券投资基金（LOF）、大成互联网思维混合型证券投资基金、大成领先动力混合型证券投资基金基金经理。2026 年 4 月 17 日起任大成竞先成长混合型证 |

|  |  |  |  |  |                          |
|--|--|--|--|--|--------------------------|
|  |  |  |  |  | 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中国证监会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》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《中华人民共和国证券投资基金法》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，公司严格执行了公平交易的原则和制度。公司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、5 日内及 10 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，公司旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。公司旗下投资组合间存在证券同日反向交易，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证券当日成交量 5% 的情形。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

2 季度组合依然围绕 AI 基建投资，在 2 季度我们观察的新的变化主要集中在以下几个方面

1、2 季度有更多的细分产业链环节出现了供应紧张涨价的情况，比如电子布，CCL，钴针，

载板，各类存储芯片，被动元件等，本基金 2 季度布局了部分产业链的龙头，也一度获得了有不错的相对收益，但是这些涨价品种近期回撤也比较大，给净值带来了很大的影响，值得反思。这类周期性涨价品种在价格快速上涨的阶段随着股价快速上涨对于后续价格的敏感性也在快速变高，股价变得非常脆弱，从控制回撤的角度应该及时降低持仓的风险暴露；

2、从模型性能提升和变现效率的角度看，并没有看到放缓的迹象，AI 类云业务的回收期在缩短，算力的紧张持续，不过依然需要通过更多的融资手段来扩大云计算的规模，这确实增加了整个系统的脆弱性；

3、前沿新技术在推进过程中有所延期，我们看到一些更实用的成熟技术可能有更长的生命周期，一些过度乐观定价的前沿技术面临回调压力；

4、国产的模型进展迅速，国内相关的资本开支增速加速，不管逻辑还是存储的扩产规划都很大，不过股价也已经领先反应此趋势；

综上，我们对接下来的行情谨慎乐观，市场对于 AI 基建的各个环节挖掘和定价较为充分，这增加了获得超额收益的难度，但同时资本市场又呈现出对短时的订单或者业绩敏感，对于长期的趋势定价不足的情况。另外 AI 与非 AI 产业的定价割裂极大，对非 AI 产业机会的发现可能开始变得更加重要。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成科创主题混合(LOF)A 的基金份额净值为 6.3429 元，本报告期基金份额净值增长率为 111.71%，同期业绩比较基准收益率为 40.40%；截至本报告期末大成科创主题混合(LOF)C 的基金份额净值为 6.1978 元，本报告期基金份额净值增长率为 111.43%，同期业绩比较基准收益率为 40.40%。

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   | 1,356,606,186.88 | 87.23        |
|    | 其中：股票  | 1,356,606,186.88 | 87.23        |
| 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      | 170,142,075.48   | 10.94  |
| 8 | 其他资产              | 28,433,117.73    | 1.83   |
| 9 | 合计                | 1,555,181,380.09 | 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              | 36,149.82        | 0.00         |
| C  | 制造业              | 1,347,033,237.56 | 90.63        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 430,241.16       | 0.03         |
| E  | 建筑业              | —                | —            |
| F  | 批发和零售业           | 9,094,820.00     | 0.61         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 1,583.46         | 0.00         |
| 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              | —                | —            |
| 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       | 10,154.88        | 0.00         |
| 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               | 1,356,606,186.88 | 91.28        |

### 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 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  | 300502 | 新易盛  | 232,853   | 141,341,771.00 | 9.51         |
| 2  | 300308 | 中际旭创 | 109,300   | 138,811,000.00 | 9.34         |
| 3  | 688498 | 源杰科技 | 61,347    | 115,700,442.00 | 7.78         |
| 4  | 600183 | 生益科技 | 660,700   | 114,565,380.00 | 7.71         |
| 5  | 002463 | 沪电股份 | 700,100   | 106,975,280.00 | 7.20         |
| 6  | 603986 | 兆易创新 | 127,983   | 104,306,145.00 | 7.02         |
| 7  | 600176 | 中国巨石 | 1,290,900 | 94,080,792.00  | 6.33         |
| 8  | 301526 | 国际复材 | 1,825,200 | 85,182,084.00  | 5.73         |
| 9  | 002916 | 深南电路 | 177,110   | 81,098,669.00  | 5.46         |
| 10 | 688300 | 联瑞新材 | 209,124   | 51,109,905.60  | 3.44         |

#### 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没有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约定的备选股票库

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   | 403,223.68    |
| 2  | 应收证券清算款 | —             |
| 3  | 应收股利    | —             |
| 4  | 应收利息    | —             |
| 5  | 应收申购款   | 28,029,894.05 |
| 6  | 其他应收款   | —             |
| 7  | 其他      | —             |
| 8  | 合计      | 28,433,117.73 |

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                        | 大成科创主题混合(LOF)A | 大成科创主题混合(LOF)C |
|---------------------------|----------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 153,746,040.05 | 3,371,859.09   |
| 报告期期间基金总申购份额              | 82,293,204.78  | 41,829,632.58  |
| 减:报告期期间基金总赎回份额            | 36,238,370.17  | 9,874,110.40   |
| 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               | 199,800,874.66 | 35,327,381.27  |

§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

经大成基金管理有限公司 2026 年第一次临时股东会及公司九届四次监事会审议通过，同意选举郭向东先生为公司第九届监事会股东代表监事，监事会主席，任期自 2026 年 4 月 30 日之日起计算，与公司第九届监事会剩余任期一致。自郭向东先生的监事任职生效之日起，陈勇先生将不再担任公司监事、监事会主席职务。

§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科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金的文件；
- 2、《大成科创主题混合型证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3、《大成科创主题混合型证券投资基金（LOF）托管协议》；
- 4、《关于大成科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金封闭运作期届满、增加 C 类基金份额并相应修订基金合同及托管协议的公告》；
- 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

2026 年 7 月 21 日