

大成科创主题混合型证券投资基金 (LOF)

2026 年第 3 季度报告

2026 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2026 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026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2026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	183,999,278.98 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 (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。 (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	150,401,406.82 份	33,597,872.16 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 7 月 1 日 - 2026 年 9 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	-25,045,976.92	-10,118,067.00
2.本期利润	-347,758,086.59	-89,215,695.83
3.加权平均基金份额本期利润	-2.1701	-2.0666
4.期末基金资产净值	652,458,479.26	142,200,009.59
5.期末基金份额净值	4.3381	4.2324

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	-31.61%	3.33%	-26.89%	2.79%	-4.72%	0.54%
过去六个月	44.80%	3.27%	2.64%	2.44%	42.16%	0.83%
过去一年	36.65%	2.77%	-0.12%	1.91%	36.77%	0.86%
过去三年	94.46%	2.09%	34.62%	1.41%	59.84%	0.68%

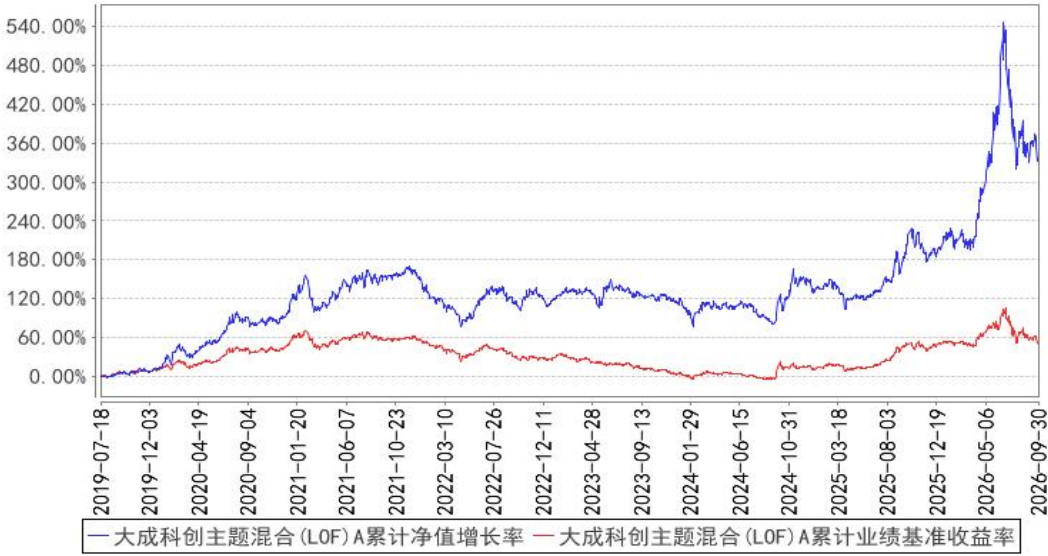
过去五年	69.86%	1.83%	-4.54%	1.22%	74.40%	0.61%
过去七年	320.77%	1.80%	43.84%	1.18%	276.93%	0.62%
自基金合同生效起至今	333.81%	1.78%	49.96%	1.16%	283.85%	0.62%

大成科创主题混合(LOF)C

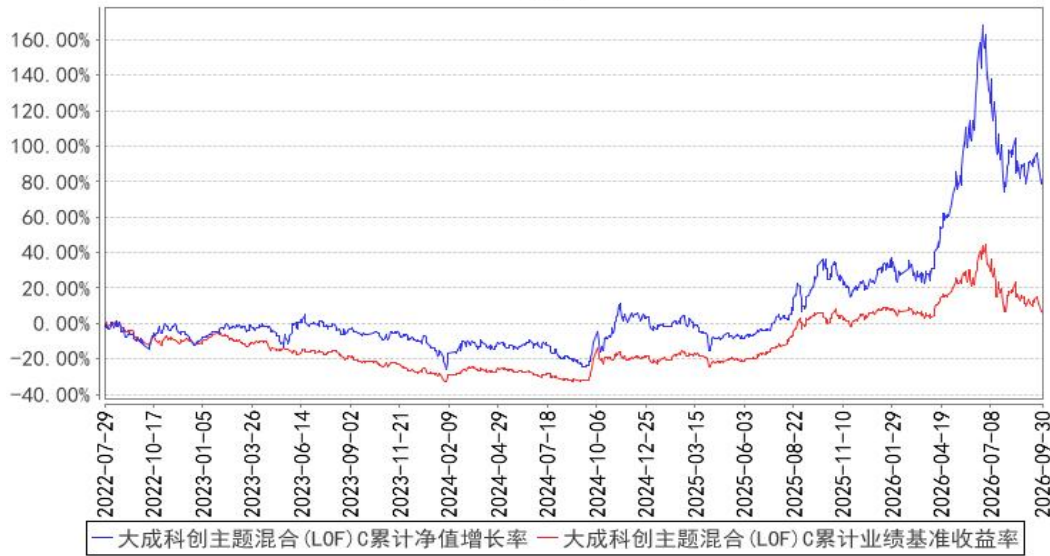
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	① - ③	② - ④
过去三个月	-31.71%	3.33%	-26.89%	2.79%	-4.82%	0.54%
过去六个月	44.38%	3.27%	2.64%	2.44%	41.74%	0.83%
过去一年	35.85%	2.77%	-0.12%	1.91%	35.97%	0.86%
过去三年	90.98%	2.09%	34.62%	1.41%	56.36%	0.68%
自基金合同生效起至今	79.69%	1.90%	5.78%	1.27%	73.91%	0.63%

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法》、《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

三季度科技成长板块跌幅大，科创50指数下跌30.7%，创业板指数下跌27.8%，本基金此前

重仓 AI 科技硬件，在三季度表现糟糕，我们反思其中的原因主要是 AI 产业经过上半年的高速发展，预期较为乐观，而忽视了发展过程中阶段性的潜在风险。产业在三季度发生的一些变化带来了较大的分歧，这其中包括全球头部模型公司收入增速在激烈的竞争背景下发生阶段性放缓，中美就 AI 硬件制造发生贸易摩擦的可能性加大，存储等瓶颈环节价格大幅上涨后推高项目投入成本，对于企业的预期回报率形成负面压制。

目前 AI 模型仍然处在快速发展阶段，场景不断打开，投资支出还在持续增长，新的技术迭代也在持续推进，头部模型公司收入阶段性增速放缓，但云厂的收入增速还在加速中，这其中份额变化值得重视。未来关于算力制造的贸易摩擦不可避免，具备全球化生产能力的公司会在竞争中获益。关于资本开支的增速放缓担忧，我们认为确实很难长期一直保持加速状态，增速放缓是必然，甚至可能会发生阶段性的下滑，但我们预期全球依然会保持一个较大的总开支规模，其中的开支结构变化存在潜在的投资机会，新的技术迭代从 0 到 1 到 10 的过程值得被重视。

经过三季度的调整，市场修正了部分预期，部分个股的性价比提升。三季度我们对于纯涨价推动的品种减仓较多，标的选择更偏于在技术创新和份额提升上有优势，同时估值相对更合理的品种。未来我们会更加重视在新的技术和新的场景变化下的投资机会。同时会在更多行业中做配置，使组合更加均衡。

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 4.3381 元，本报告期基金份额净值增长率为-31.61%，同期业绩比较基准收益率为-26.89%；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 4.2324 元，本报告期基金份额净值增长率为-31.71%，同期业绩比较基准收益率为-26.89%。

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	725,419,932.05	90.94
	其中：股票	725,419,932.05	90.94
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	71,169,350.33	8.92
8	其他资产	1,070,691.26	0.13
9	合计	797,659,973.64	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	39,069.96	0.00
C	制造业	658,980,599.97	82.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	278,238.60	0.04
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	16,918,272.16	2.13
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	486,841.04	0.06
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	48,716,910.32	6.13
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	725,419,932.05	91.29

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	002463	沪电股份	647,335	75,045,546.55	9.44
2	300502	新易盛	190,118	73,955,902.00	9.31
3	300308	中际旭创	88,100	71,223,564.00	8.96
4	002916	深南电路	190,710	71,136,737.10	8.95
5	688498	源杰科技	32,460	52,357,980.00	6.59
6	600183	生益科技	398,200	51,750,072.00	6.51
7	603259	药明康德	271,940	45,506,439.60	5.73
8	600150	中国船舶	995,387	38,919,631.70	4.90
9	603268	松发股份	147,400	31,493,484.00	3.96
10	688825	长鑫科技	378,225	18,300,930.93	2.30

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	753,916.52
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	316,774.74
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,070,691.26

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	688825	长鑫科技	5,799,934.95	0.73	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	199,800,874.66	35,327,381.27
报告期期间基金总申购份额	26,162,625.28	43,059,697.79
减:报告期期间基金总赎回份额	75,562,093.12	44,789,206.90
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	150,401,406.82	33,597,872.16

§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

2026 年 9 月 1 日，公司召开大成基金管理有限公司第九届董事会第五次会议，审议通过《关于姚余栋先生辞去公司副总经理职务的议案》，同意姚余栋先生自董事会决议作出之日起辞去公司副总经理职务。

§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 10 月 27 日