

达诚成长先锋混合型证券投资基金

2020 年第 4 季度报告

2020 年 12 月 31 日

基金管理人：达诚基金管理有限公司

基金托管人：中信证券股份有限公司

报告送出日期：2021 年 1 月 22 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。

基金托管人中信证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 1 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 2020 年 10 月 27 日（基金合同生效日）起至 2020 年 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	达诚成长先锋混合	
基金主代码	010301	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 10 月 27 日	
报告期末基金份额总额	280,321,755.18 份	
投资目标	本基金在力争控制投资组合风险的前提下，追求基金资产的稳健增值。	
投资策略	本基金主要投资策略有资产配置策略、股票投资策略、固定收益投资策略、可转换债券投资策略、资产支持证券投资策略、衍生产品投资策略等。	
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×70%+恒生指数收益率（按估值汇率折算）×5%+中债-综合指数（全价）收益率×25%	
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。	
基金管理人	达诚基金管理有限公司	
基金托管人	中信证券股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	达诚成长先锋混合 A	达诚成长先锋混合 C
下属分级基金的交易代码	010301	010302
报告期末下属分级基金的份额总额	158,247,403.49 份	122,074,351.69 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（2020 年 10 月 27 日-2020 年 12 月 31 日）	
	达诚成长先锋混合 A	达诚成长先锋混合 C
1. 本期已实现收益	-760,985.98	-630,720.62
2. 本期利润	9,226,126.50	7,071,328.03
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0583	0.0579
4. 期末基金资产净值	167,473,529.99	129,145,679.72
5. 期末基金份额净值	1.0583	1.0579

注：1、上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；

2、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；

3、本基金合同于 2020 年 10 月 27 日生效，截至本报告期末基金成立未满一季度。

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

达诚成长先锋混合 A

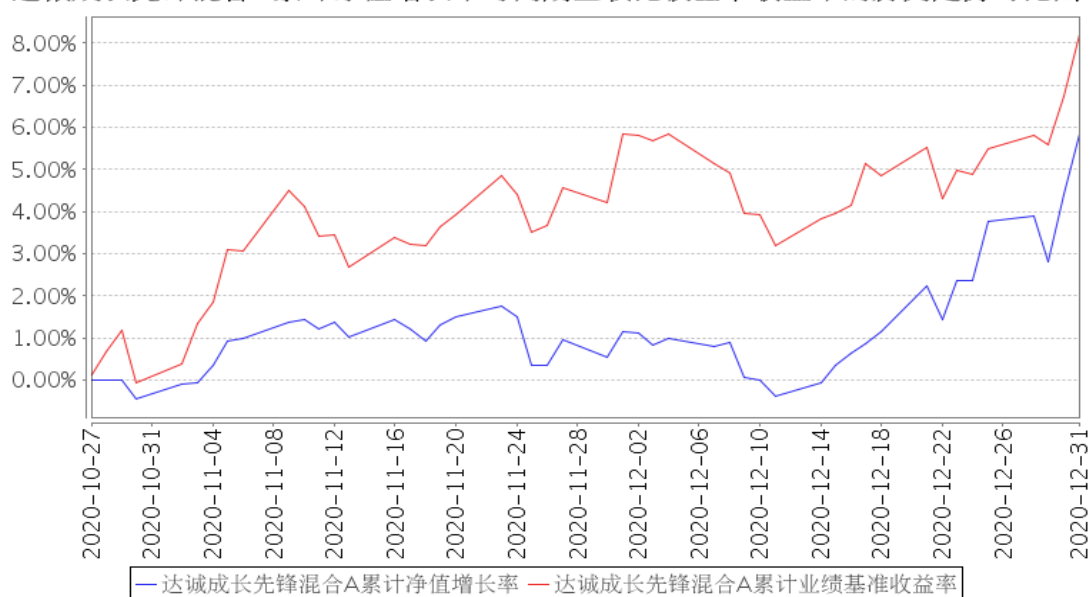
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
自基金合同生效起至今	5.83%	0.56%	8.19%	0.68%	-2.36%	-0.12%

达诚成长先锋混合 C

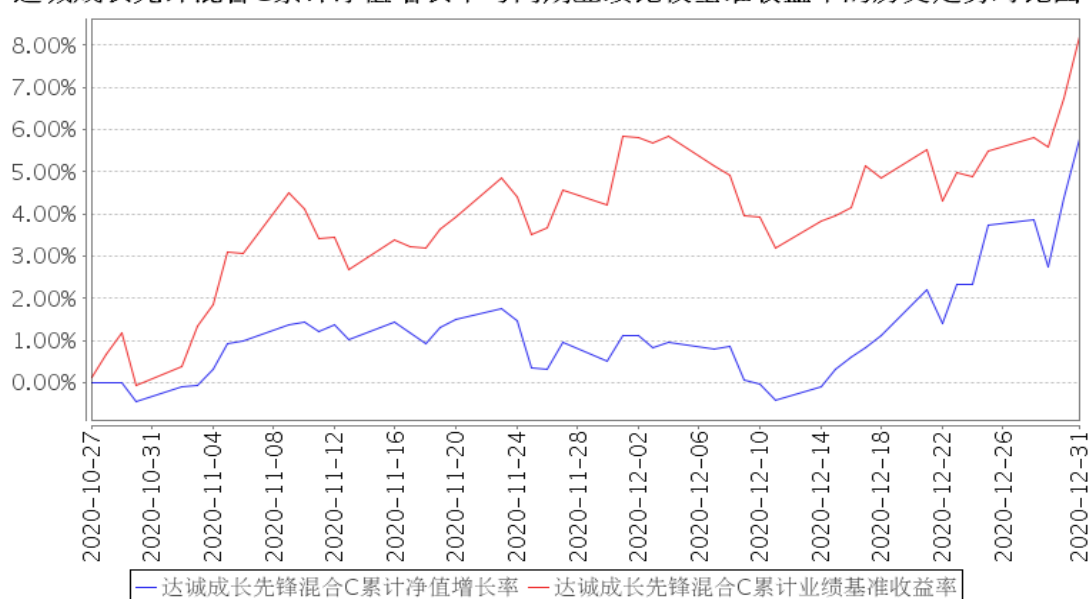
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
自基金合同生效起至今	5.79%	0.56%	8.19%	0.68%	-2.40%	-0.12%

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

达诚成长先锋混合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



达诚成长先锋混合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：本基金合同生效之日为 2020 年 10 月 27 日，截至本报告期末，基金成立未满 6 个月；
 本基金建仓期为本基金合同生效之日（2020 年 10 月 27 日）起 6 个月，截止本报告期末，本基金尚处于建仓期中。

§ 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		

王超伟	本基金的基金经理，首席投资官、副总经理、投资总监。	2020 年 10 月 27 日	-	12 年	王超伟先生，历任国泰君安证券股份有限公司证券及衍生品投资总部投资经理、证券投资部高级投资经理；国联安基金管理有限公司权益投资部投资副总监兼基金经理、公司投资决策委员会委员；金鹰基金管理有限公司总经理助理兼投资总监、公司投资决策委员会副主席。
-----	---------------------------	------------------	---	------	--

注：1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离职日期”为根据公司决议确定的解聘日期；

2、非首任基金经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；

3、证券从业的含义遵从行业协会《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合规守信情况的说明

本报告期内，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、中国证监会和本基金基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

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中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，建立了健全、有效的公平交易制度体系，贯穿分工授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查等各业务环节。基金管理人通过完善各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控，公平对待旗下管理的所有投资组合。

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参与交易所公开竞价交易中，未发生同日反向交易中成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。未发现不公平交易和利益输送的情况。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2020 年是极不平凡的一年。疫情的影响贯穿全年。但是证券市场却表现良好，各大指数全部上涨，其中以创业板指数的涨幅为最大。创业板指数全年上涨超过 60%。全年来看，行业轮动特

征也非常明晰，一季度科技板块表现最优，二三季度医药消费板块表现强势，四季度新能源等板块表现强劲。市场的走势基本按照经济基本面的变化和投资人预期的变化在运行。从经济基本面上来看，全年流动性整体宽松，疫情也催生了一批优势行业。所谓危中有机，疫情的影响也带给投资者不少正收益的机会。

本基金从开始运作以来，一直保持稳健的风格。建仓过程循序渐进，投资方向也很明确，基本围绕行业景气度去选择要配置的行业和个股。从四季度看，新能源、化工等行业保持高景气。本基金也围绕着这些板块做布局，抓住了不少投资机会。同时标的选择也是以行业内绩优大市值龙头标的为主。基金管理人将本着稳健第一的原则，努力为投资人获取正收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末达诚成长先锋混合 A 基金份额净值为 1.0583 元，本报告期份额净值增长率为 5.83%；达诚成长先锋混合 C 基金份额净值为 1.0579 元，本报告期份额净值增长率为 5.79%，同期业绩比较基准增长率为 8.19%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 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	254,860,158.78	85.67
	其中：股票	254,860,158.78	85.67
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	42,633,766.64	14.33
8	其他资产	6,278.31	0.00
9	合计	297,500,203.73	100.00

注：本基金本报告期末通过深港通交易机制投资的港股市值为人民币 32,249,119.88 元，占基金资产净值比例 10.87%。

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	3,716,000.00	1.25
C	制造业	182,810,322.66	61.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	12,425,000.00	4.19
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	8,823,000.00	2.97
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,716.24	0.01
J	金融业	14,818,000.00	5.00
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	—	—
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	222,611,038.90	75.05

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（%）
基础材料	—	—
消费者非必需品	4,958,942.88	1.67
消费者常用品	—	—
能源	—	—
金融	—	—
医疗保健	—	—
工业	—	—
信息技术	18,578,361.36	6.26
电信服务	—	—
公用事业	—	—

地产建筑业	8,711,815.64	2.94
合计	32,249,119.88	10.87

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	601668	中国建筑	2,500,000	12,425,000.00	4.19
2	601012	隆基股份	120,000	11,064,000.00	3.73
3	002271	东方雨虹	250,000	9,700,000.00	3.27
4	603659	璞泰来	80,000	8,991,200.00	3.03
5	002352	顺丰控股	100,000	8,823,000.00	2.97
6	002311	海大集团	119,914	7,854,367.00	2.65
7	601877	正泰电器	200,000	7,832,000.00	2.64
8	300059	东方财富	250,000	7,750,000.00	2.61
9	600426	华鲁恒升	200,000	7,460,000.00	2.52
10	002142	宁波银行	200,000	7,068,000.00	2.38

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末无债券投资。

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

本基金本报告期末无债券投资。

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

本基金本报告期末无资产支持证券投资。

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

本基金本报告期末无贵金属投资。

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

本基金本报告期末无权证投资。

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

本基金本报告期末无股指期货投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内无股指期货投资。

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

本基金本报告期内无国债期货投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内无国债期货投资。

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

报告期内基金投资的前十名证券发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内收到公开谴责、处罚。

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，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	—
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	6,278.31
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	6,278.31

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末无处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票无流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	达诚成长先锋混合 A	达诚成长先锋混合 C
基金合同生效日基金份额总额	158,247,403.49	122,074,351.69
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	—	—
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	—	—
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	—	—
报告期期末基金份额总额	158,247,403.49	122,074,351.69

注：1、本基金合同生效日为 2020 年 10 月 27 日。

2、总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 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	达诚成长先锋混合 A	达诚成长先锋混合 C
基金合同生效日管理人持有的本基金份额	—	2,000,720.00
基金合同生效日起至报告期期末买入/申购总份额	—	—
基金合同生效日起至报告期期末卖出/赎回总份额	—	—
报告期期末管理人持有的本基金份额	—	2,000,720.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	—	1.64

注：1、本基金合同生效日为 2020 年 10 月 27 日。

2、总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

3、基金管理人持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金的基金管理人于本报告期末运用固有资金投资本基金。

§ 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

本基金本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

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) 中国证监会准予达诚成长先锋混合型证券投资基金募集注册文件
- (2) 达诚成长先锋混合型证券投资基金基金合同
- (3) 达诚成长先锋混合型证券投资基金托管协议
- (4) 法律意见书
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所

9.3 查阅方式

- (1) 投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件
- (2) 投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人网站 www.integrity-funds.com 或客服电话 021-60581258。

达诚基金管理有限公司

2021 年 1 月 22 日