

大成內需增長混合型證券投資基金

2021 年中期報告

2021 年 6 月 30 日

本報告並不構成購買組成本摘要內容的任何基金單位之邀請。只有基於現時招募說明書及香港說明文件（或同等文件）及最近之財務報告所作之認購方為有效。本報告可能包含本基金若干並未獲認可在香港發售或分銷之股份類別。投資者應注意，本報告內若干資料以綜合方法表述，因此當中包括並未在香港註冊的股份類別之資產。

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金託管人：中國銀行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 31 日

大成內需增長混合型證券投資基金（“本基金”）

2021年未經審核半年度報告

向香港投資者提供的資料

本基金乃依據中港基金互認安排已獲香港證券及期貨事務監察委員會（下稱“香港證監會”）之認可可在香港公開發售的內地基金。

香港證監會認可不等於對該產品作出推介或認許，亦不是對該產品的商業利弊或表現作出保證，更不代表該產品適合所有投資者，或認許該產品適合任何個別投資者或任何類別的投資者。

基金的過往業績並不代表其未來表現。投資涉及風險，投資者在作出投資決定前應仔細閱讀招募說明書、招募說明書摘要、香港說明文件、產品資料概要、財務報告或其更新。

本基金只有 H 類別份額可供香港投資者認購。

請注意，於本招募說明書摘要，除大成內需增長混合型證券投資基金外，所有其他基金並無於香港獲認可及不會供香港居民認購。

有關本基金的任何查詢，投資者可以郵寄（地址為香港康樂廣場1號怡和大廈3516-3519室）、電話（+ 852 3765 6788）或電子郵件（enquiry@dcfund.com.hk）聯絡香港代表。

大成國際資產管理有限公司

香港代表

二〇二一年八月三十一日

§ 1 重要提示及目錄

1.1 重要提示

基金管理人的董事會、董事保證本報告所載資料不存在虛假記載、誤導性陳述或重大遺漏，並對其內容的真實性、準確性和完整性承擔個別及連帶的法律責任。本中期報告已經三分之二以上獨立董事簽字同意，並由董事長簽發。

基金託管人中國銀行股份有限公司根據本基金合同規定，於 2021 年 8 月 30 日複核了本報告中的財務指標、淨值表現、利潤分配情況、財務會計報告、投資組合報告等內容，保證複核內容不存在虛假記載、誤導性陳述或者重大遺漏。

基金管理人承諾以誠實信用、勤勉盡責的原則管理和運用基金資產，但不保證基金一定盈利。

基金的過往業績並不代表其未來表現。投資有風險，投資者在作出投資決策前應仔細閱讀本基金的招募說明書及其更新。

本報告財務資料未經審計。

本報告期自 2021 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目錄

§ 1 重要提示及目錄	3
1.1 重要提示	3
1.2 目錄	4
§ 2 基金簡介	6
2.1 基金基本情況	6
2.2 基金產品說明	6
2.3 基金管理人和基金託管人	6
2.4 資訊披露方式	7
2.5 其他相關資料	7
§ 3 主要財務指標和基金淨值表現	7
3.1 主要會計數據和財務指標	7
3.2 基金淨值表現	8
§ 4 管理人報告	11
4.1 基金管理人及基金經理情況	11
4.2 管理人對報告期內本基金運作遵規守信情況的說明	14
4.3 管理人對報告期內公平交易情況的專項說明	14
4.4 管理人對報告期內基金的投資策略和業績表現的說明	14
4.5 管理人對宏觀經濟、證券市場及行業走勢的簡要展望	15
4.6 管理人對報告期內基金估值程序等事項的說明	15
4.7 管理人對報告期內基金利潤分配情況的說明	16
4.8 報告期內管理人對本基金持有人數或基金資產淨值預警情形的說明	16
§ 5 託管人報告	16
5.1 報告期內本基金託管人遵規守信情況聲明	16
5.2 託管人對報告期內本基金投資運作遵規守信、淨值計算、利潤分配等情況的說明	16
5.3 託管人對本中期報告中財務資訊等內容的真實、準確和完整發表意見	17
§ 6 半年度財務會計報告（未經審計）	17
6.1 資產負債表	17
6.2 利潤表	18
6.3 所有者權益（基金淨值）變動表	19
6.4 報表附註	21
§ 7 投資組合報告	41
7.1 期末基金資產組合情況	41
7.2 報告期末按行業分類的股票投資組合	41
7.3 期末按公允價值佔基金資產淨值比例大小排序的所有股票投資明細	42
7.4 報告期內股票投資組合的重大變動	45
7.5 期末按債券品種分類的債券投資組合	46
7.6 期末按公允價值佔基金資產淨值比例大小排序的前五名債券投資明細	46
7.7 期末按公允價值佔基金資產淨值比例大小排序的所有資產支援證券投資明細	46
7.8 報告期末按公允價值佔基金資產淨值比例大小排序的前五名貴金屬投資明細	47

7.9 期末按公允價值佔基金資產淨值比例大小排序的前五名權證投資明細	47
7.10 報告期末本基金投資的股指期貨交易情況說明	47
7.11 報告期末本基金投資的國債期貨交易情況說明	47
7.12 投資組合報告附註	47
§ 8 基金份額持有人資訊	48
8.1 期末基金份額持有人戶數及持有人結構	48
8.2 期末基金管理人的從業人員持有本基金的情況	49
8.3 期末基金管理人的從業人員持有本開放式基金份額總量區間情況	49
§ 9 開放式基金份額變動	49
§ 10 重大事件揭示	50
10.1 基金份額持有人大會決議	50
10.2 基金管理人、基金託管人的專門基金託管部門的重大人事變動	50
10.3 涉及基金管理人、基金財產、基金託管業務的訴訟	50
10.4 基金投資策略的改變	50
10.5 為基金進行審計的會計師事務所情況	50
10.6 管理人、託管人及其高級管理人員受稽查或處罰等情況	50
10.7 基金租用證券公司交易單元的有關情況	50
10.8 其他重大事件	53
§ 11 影響投資者決策的其他重要資訊	53
11.1 報告期內單一投資者持有基金份額比例達到或超過 20% 的情況	53
11.2 影響投資者決策的其他重要資訊	53
§ 12 備查檔案目錄	53
12.1 備查檔案目錄	53
12.2 存放地點	54
12.3 查閱方式	54
§ 13 補充披露(只供香港派發)	55
13.1 補充披露 1: 期末基金資產組合情況	55
13.2 補充披露 2: 投資組合變動表	58

§ 2 基金簡介

2.1 基金基本情況

基金名稱	大成內需增長混合型證券投資基金	
基金簡稱	大成內需增長混合	
基金主代碼	090015	
基金運作方式	契約型開放式	
基金合同生效日	2011 年 6 月 14 日	
基金管理人	大成基金管理有限公司	
基金託管人	中國銀行股份有限公司	
報告期末基金份額總額	79,744,799.37 份	
基金合同存續期	不定期	
下屬分級基金的基金簡稱	大成內需增長混合 A	大成內需增長混合 H
下屬分級基金的交易代碼	090015	960018
報告期末下屬分級基金的份額總額	63,458,623.47 份	16,286,175.90 份

2.2 基金產品說明

投資目標	本基金主要投資於受益於內需增長的行業中的優質上市公司，力爭充分分享中國經濟增長以及經濟結構轉型帶來的投資收益，追求基金資產的長期穩健增值。
投資策略	<p>本基金採用積極主動的投資策略。以宏觀經濟和政策研究為基礎，通過影響證券市場整體運行的內外部因素分析，實施大類資產配置；分析以內需增長為重要推動力的中國經濟轉型進程中的政策導向與經濟結構調整的特點，研究國內消費需求以及與之緊密關聯的投資需求的增長規律，結合經濟周期與產業變遷路徑的分析，實施行業配置；以相關的投資主題和內需增長受益行業為線索，通過公司基本面的考量，精選優質上市公司股票，力求實現基金資產的長期穩健增值。</p> <p>為有效控制投資風險，本基金將根據風險管理的原則適度進行股指期貨投資，股指期貨投資將根據風險管理的原則，以套期保值為目的，並按照中國金融期貨交易所套期保值管理的有關規定執行，對沖系統性風險和某些特殊情況下的流動性風險等。</p>
業績比較基準	80%×滬深 300 指數+20%×中證綜合債券指數
風險收益特徵	本基金為混合型基金，基金的風險與預期收益都要低於股票型基金、高於債券型基金和貨幣市場基金，屬於證券投資基金中較高風險、較高預期收益的品種。

2.3 基金管理人和基金託管人

項目	基金管理人	基金託管人
名稱	大成基金管理有限公司	中國銀行股份有限公司

資訊披露 負責人	姓名	趙冰	許俊
	聯繫電話	0755-83183388	010-66594319
	電子郵箱	office@dcfund.com.cn	fcid@bankofchina.com
客戶服務電話		4008885558	95566
傳真		0755-83199588	010-66594942
註冊地址		深圳市福田區深南大道 7088 號招商銀行大廈 32 層	北京市西城區復興門內大街 1 號
辦公地址		深圳市福田區深南大道 7088 號招商銀行大廈 32 層	北京市西城區復興門內大街 1 號
郵遞區號		518040	100818
法定代表人		吳慶斌	劉連舸

2.4 資訊披露方式

本基金選定的資訊披露報紙名稱	《中國證券報》
登載基金中期報告正文的管理人互聯網網址	www.dcfund.com.cn
基金中期報告備置地點	基金管理人及基金託管人住所

2.5 其他相關資料

項目	名稱	辦公地址
註冊登記機構	大成基金管理有限公司	深圳市福田區深南大道 7088 號招商銀行大廈 32 層

§ 3 主要財務指標和基金淨值表現

3.1 主要會計數據和財務指標

金額單位：人民幣元

3.1.1 期間數據 和指標	報告期(2021 年 1 月 1 日-2021 年 6 月 30 日)	
	大成內需增長混合 A	大成內需增長混合 H
本期已實現收益	43,016,479.81	11,384,882.67
本期利潤	14,924,184.53	738,789.34
加權平均基金份 額本期利潤	0.2403	0.0444
本期加權平均淨 值利潤率	4.69%	0.87%
本期基金份額淨 值增長率	4.78%	4.76%

3.1.2 期末數據 和指標	報告期末(2021 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利潤	206,050,703.35	52,849,886.89
期末可供分配基金份額利潤	3.2470	3.2451
期末基金資產淨值	339,425,255.62	87,078,277.68
期末基金份額淨值	5.349	5.347
3.1.3 累計期末 指標	報告期末(2021 年 6 月 30 日)	
基金份額累計淨值增長率	434.90%	168.15%

註：1、本期已實現收益指基金本期利息收入、投資收益、其他收入（不含公允價值變動收益）扣除相關費用後的餘額，本期利潤為本期已實現收益加上本期公允價值變動收益。

2、期末可供分配利潤，採用期末資產負債表中未分配利潤與未分配利潤中已實現部分的孰低數（為期末餘額，不是當期發生數）。

3、所述基金業績指標不包括持有人認購或交易基金的各項費用，計入費用後實際收益水平要低於所列數字。

4、根據我公司 2015 年 7 月 22 日《關於大成內需增長混合型證券投資基金增設基金份額類別並相應修改基金合同的公告》，自 2015 年 7 月 22 日起，大成內需增長混合型證券投資基金增設 H 類基金份額。本報告關於 H 類份額的指標計算起始日為 H 類份額的初始申購確認日。

3.2 基金淨值表現

3.2.1 基金份額淨值增長率及其與同期業績比較基準收益率的比較

大成內需增長混合 A

階段	份額淨值增長率①	份額淨值增長率標準差②	業績比較基準收益率③	業績比較基準收益率標準差④	①－③	②－④
過去一個月	-2.23%	1.03%	-1.57%	0.64%	-0.66%	0.39%
過去三個月	11.41%	1.40%	3.07%	0.78%	8.34%	0.62%

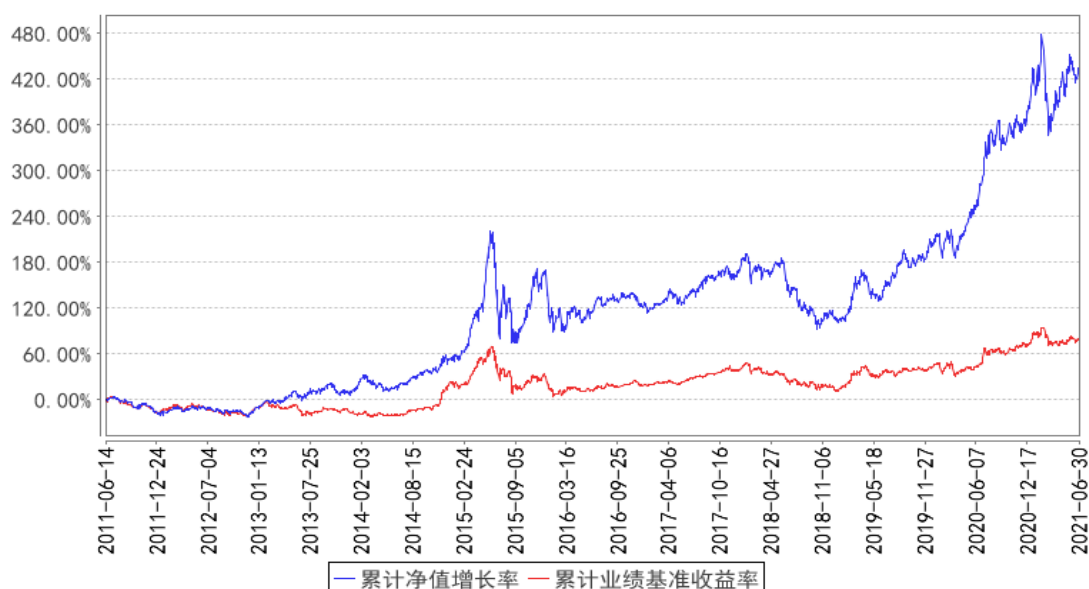
過去六個月	4.78%	1.77%	0.79%	1.05%	3.99%	0.72%
過去一年	37.83%	1.59%	20.99%	1.07%	16.84%	0.52%
過去三年	113.11%	1.47%	42.79%	1.09%	70.32%	0.38%
自基金合同生效起 至今	434.90%	1.61%	79.68%	1.15%	355.22 %	0.46%

大成內需增長混合 H

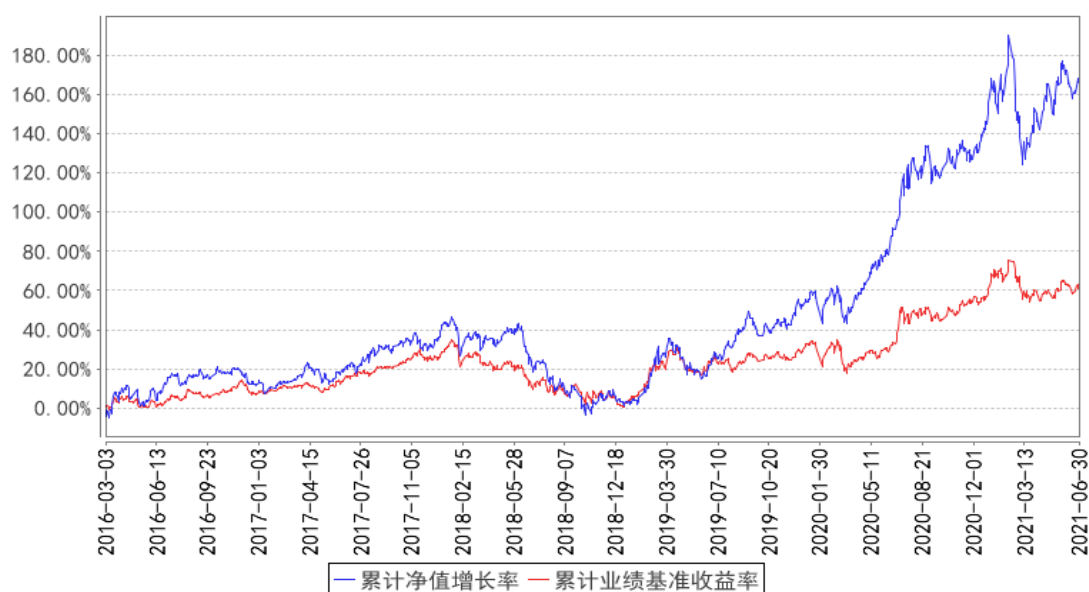
階段	份額淨 值增長 率①	份額淨值 增長率標 準差②	業績比較基 準收益率③	業績比較基準 收益率標準差 ④	①－③	②－④
過去一個月	-2.27%	1.02%	-1.57%	0.64%	-0.70%	0.38%
過去三個月	11.37%	1.40%	3.07%	0.78%	8.30%	0.62%
過去六個月	4.76%	1.77%	0.79%	1.05%	3.97%	0.72%
過去一年	37.84%	1.59%	20.99%	1.07%	16.85%	0.52%
過去三年	113.03%	1.47%	42.79%	1.09%	70.24%	0.38%
自基金合同生效起 至今	168.15%	1.35%	62.14%	0.94%	106.01 %	0.41%

3.2.2 自基金合同生效以來基金份額累計淨值增長率變動及其與同期業績比較基準收益率變動的比較

大成內需增長混合A累計淨值增長率與同期業績比較基準收益率的歷史走勢對比圖



大成內需增長混合H累計淨值增長率與同期業績比較基準收益率的歷史走勢對比圖



註：1、本基金合同規定，基金管理人應當自基金合同生效之日起六個月內使基金的投資組合比例符合基金合同的約定。建倉期結束時，本基金的投資組合比例符合基金合同的約定。

2、本基金於 2015 年 7 月 2 日基金名稱由“大成內需增長股票型證券投資基金”變更為“大成內需增長混合型證券投資基金”。

§ 4 管理人報告

4.1 基金管理人及基金經理情況

4.1.1 基金管理人及其管理基金的經驗

大成基金管理有限公司經中國證監會證監基金字[1999]10 號文批准，於 1999 年 4 月 12 日正式成立，是中國證監會批准成立的首批十家基金管理公司之一，註冊資本 2 億元人民幣，註冊地廣東省深圳市。目前公司由三家股東組成，分別為中泰信託有限責任公司(50%)、光大證券股份有限公司(25%)、中國銀河投資管理有限公司(25%)。主要業務是公募基金的募集、銷售和管理，還具有全國社保基金投資管理、基本養老保險投資管理、受託管理保險資金、保險保障基金投資管理、特定客戶資產管理和 QDII 業務資格。

經過二十二年的穩健發展，公司形成了強大穩固的綜合實力。公司旗下基金產品齊全、風格多樣，構建了涵蓋股票型基金、混合型基金、指數型基金、債券型基金和貨幣市場基金的完備產品線。截至 2021 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 9 隻 ETF 及 3 隻 ETF 聯接基金，8 隻 QDII 基金及 107 只開放式證券投資基金。

4.1.2 基金經理（或基金經理小組）及基金經理助理簡介

姓名	職務	任本基金的基金經理（助理）期限		證券從業年限	說明
		任職日期	離任日期		
張燁	本基金基金經理	2019 年 9 月 29 日	-	11 年	經濟學碩士。2010 年 3 月至 2011 年 9 月任鵬華基金管理有限公司研究部研究員。2011 年 9 月加入大成基金管理有限公司，曾擔任研究部研究員、基金經理助理。2017 年 9 月 26 日至 2021 年 5 月 26 日任大成國企改革靈活配置混合型證券投資基金基金經理。2019 年 9 月 29 日起任大成內需增長混合型證券投資基金基金經理。2021 年 5 月 24 日起任大成消費精選股票型證券投資基金基金經理。具有基金從業資格。國籍：中國
孫丹	本基金基金經理助理	2020 年 7 月 6 日	-	13 年	經濟學碩士。2008 年至 2012 年任景順長城產品開發部產品經理。2012 年至 2014 年任華夏基金機構債券投資部研究員。2014 年 5 月加入大成基金管理有限公司，曾擔任固定收益總部信用策略及宏觀利率研究員、大成景輝靈活配置混合型證券投資基金、大成景榮保本混合型證券投資基金、大成景興信用債債券型證券投資基金、大成景秀靈活配置混合型證券投資基金、

					<p>大成景源靈活配置混合型證券投資基金基金經理助理，現任固定收益總部總監助理。2018 年 3 月 12 日起任大成策略回報混合型證券投資基金、大成創新成長混合型證券投資基金（LOF）、大成積極成長混合型證券投資基金、大成精選增值混合型證券投資基金、大成景陽領先混合型證券投資基金、大成競爭優勢混合型證券投資基金、大成藍籌穩健證券投資基金、大成優選混合型證券投資基金（LOF）基金經理助理。2020 年 7 月 1 日起任大成價值增長證券投資基金、大成多策略靈活配置混合型證券投資基金（LOF）、大成一帶一路靈活配置混合型證券投資基金、大成內需增長混合型證券投資基金、大成睿景靈活配置混合型證券投資基金、大成盛世精選靈活配置混合型證券投資基金、大成國企改革靈活配置混合型證券投資基金、大成行業輪動混合型證券投資基金、大成靈活配置混合型證券投資基金、大成產業升級股票型證券投資基金（LOF）、大成健康產業混合型證券投資基金、大成正向回報靈活配置混合型證券投資基金、大成國家安全主題靈活配置混合型證券投資基金、大成新銳產業混合型證券投資基金、大成消費主題混合型證券投資基金基金經理助理。2020 年 11 月 6 日起任大成科技消費股票型證券投資基金、大成科創主題 3 年封閉運作靈活配置混合型證券投資基金、大成中小盤混合型證券投資基金（LOF）、大成睿享混合型證券投資基金、大成行業先鋒混合型證券投資基金基金經理助理。2021 年 2 月 1 日起任大成企業能力驅動混合型證券投資基金、大成優選升級一年持有期混合型證券投資基金、大成成長進取混合型證券投資基金基金經理助理。2021 年 2 月 22 日起任大成恒享春曉一年定期開放混合型證券投資基金基金經理助理。2021 年 4 月 19 日起任大成民穩增長混合型證券投資基金、大成恒享混合型證券投資基金基金經理助理。2021 年 7 月 29 日起任大成產業趨勢混合型證券投資基金、大成投資嚴選六個月持有期混合型證券投資基金基金經理助理。2017 年 5 月 8 日起任大成景尚靈活配置混合型證券投資基金、大成景興信</p>
--	--	--	--	--	--

					<p>用債券型證券投資基金基金經理。2017 年 5 月 8 日至 2019 年 10 月 31 日任大成景榮債券型證券投資基金（原大成景榮保本混合型證券投資基金轉型）基金經理。2017 年 5 月 31 日至 2020 年 10 月 20 日任大成惠裕定期開放純債券型證券投資基金基金經理。2017 年 6 月 2 日至 2018 年 11 月 19 日任大成景祿靈活配置混合型證券投資基金基金經理。2017 年 6 月 2 日至 2018 年 12 月 8 日任大成景源靈活配置混合型證券投資基金基金經理。2017 年 6 月 2 日至 2019 年 6 月 15 日任大成景秀靈活配置混合型證券投資基金。2017 年 6 月 6 日至 2019 年 9 月 29 日任大成惠明定期開放純債券型證券投資基金基金經理。2018 年 3 月 14 日至 2018 年 11 月 30 日任大成景輝靈活配置混合型證券投資基金基金經理。2018 年 3 月 14 日至 2018 年 11 月 30 日任大成景沛靈活配置混合型證券投資基金基金經理。2018 年 3 月 14 日至 2018 年 7 月 20 日任大成景裕靈活配置混合型證券投資基金基金經理。2018 年 3 月 14 日起任大成財富管理 2020 生命週期證券投資基金基金經理。2019 年 7 月 31 日至 2020 年 5 月 23 日任大成景豐債券型證券投資基金（LOF）基金經理。2020 年 2 月 27 日至 2021 年 4 月 13 日任大成景泰純債券型證券投資基金基金經理。2020 年 3 月 5 日至 2021 年 4 月 14 日任大成恒享混合型證券投資基金基金經理。2020 年 3 月 31 日至 2021 年 4 月 14 日任大成民穩增長混合型證券投資基金基金經理。2020 年 4 月 26 日起任大成景瑞穩健配置混合型證券投資基金基金經理。2020 年 8 月 21 日至 2021 年 5 月 18 日任大成景和債券型證券投資基金基金經理。2020 年 9 月 3 日起任大成匯享一年持有期混合型證券投資基金基金經理。2020 年 9 月 23 日起任大成尊享 18 個月定期開放混合型證券投資基金基金經理。2020 年 11 月 16 日起任大成卓享一年持有期混合型證券投資基金基金經理。2020 年 11 月 18 日起任大成豐享回報混合型證券投資基金基金經理。2021 年 4 月 22 日起任大成安享得利六個月持有期混合型證券投資基金基金經理。具有基金從業資</p>
--	--	--	--	--	---

					格。國籍：中國
--	--	--	--	--	---------

註：1、任職日期、離任日期為本基金管理人作出決定之日。

2、證券從業年限的計算標準遵從行業協會《證券業從業人員資格管理辦法》的相關規定。

4.1.3 期末兼任私募資產管理計劃投資經理的基金經理同時管理的產品情況

無

4.2 管理人對報告期內本基金運作遵規守信情況的說明

報告期內，本基金管理人嚴格遵守《證券法》、《證券投資基金法》等有關法律法規及基金合同、基金招募說明書等有關基金法律檔案的規定，以取信於市場、取信於社會投資公眾為宗旨，本著誠實信用、勤勉盡責的原則管理和運用基金資產，在規範基金運作和嚴格控制投資風險的前提下，為基金份額持有人謀求最大利益，無損害基金份額持有人利益的行為。

4.3 管理人對報告期內公平交易情況的專項說明

4.3.1 公平交易制度的執行情況

報告期內，基金管理人嚴格執行了公平交易的原則和制度。基金管理人運用統計分析方法和工具，對旗下所有投資組合間連續 4 個季度的日內、3 日內及 5 日內股票及債券交易同向交易價差進行分析。分析結果表明：債券交易同向交易頻率較低；部分股票同向交易溢價率較大主要來源於市場因素（如個股當日價格振幅較高）及組合經理交易時機選擇，即投資組合成交時間不一致以及成交價格的日內較大變動導致個別些組合間的成交價格差異較大，但結合交易價差專項統計分析，未發現違反公平交易原則的異常情況。

4.3.2 異常交易行為的專項說明

報告期內，基金管理人旗下所有投資組合未發現存在異常交易行為。主動投資組合間股票交易不存在同日反向交易。主動型投資組合與指數型投資組合之間或指數型投資組合之間存在股票同日反向交易，但不存在參與交易所公開競價同日反向交易成交較少的單邊交易量超過該股當日成交量 5% 的情形；主動投資組合間債券交易存在 2 筆同日反向交易，原因為流動性需要。投資組合間相鄰交易日反向交易的市場成交比例、成交均價等交易結果數據表明該類交易不對市場產生重大影響，無異常。

4.4 管理人對報告期內基金的投資策略和業績表現的說明

4.4.1 報告期內基金投資策略和運作分析

二季度大消費類資產經歷了較大幅度的下跌，新能源及科技資產有較大幅度上漲，本基金主要配置大消費及醫藥類資產，少部分配置科技股和製造業，堅持自下而上選股，二季度淨值有較大幅度回撤

目前時點應當如何看待大消費板塊的回調？我們跟蹤到近期大消費板塊基本面並沒有出現惡化，我們認為：1）大消費板塊的回調主要是由於前期估值過高，有消化估值的需求；2）市場風格因素導致資金更偏好於科技、新能源及部分製造業板塊。

4.4.2 報告期內基金的業績表現

截至本報告期末大成內需增長混合 A 的基金份額淨值為 5.349 元，本報告期基金份額淨值增長率為 4.78%，同期業績比較基準收益率為 0.79%；截至本報告期末大成內需增長混合 H 的基金份額淨值為 5.347 元，本報告期基金份額淨值增長率為 4.76%，同期業績比較基準收益率為 0.79%。

4.5 管理人對宏觀經濟、證券市場及行業走勢的簡要展望

我們仍然看好大消費及醫藥行業，我們依然認為消費升級的浪潮才剛剛開始。我們認為長期存在投資機會的方向包括：1）白酒行業仍處於 高端/次高端 擴容的超長上行周期當中；啤酒處於消費升級的初期階段，目前啤酒的消費升級正在加速；2）食品工業化處於爆發初期階段，生活節奏不斷加快將帶來持續的在外就餐需求，食品工業化有利於全方位提高餐飲的效率，而餐飲連鎖化將加速食品工業化的進程；3）醫美行業處於爆發初期，未來仍將有數倍甚至 10 倍空間；4）老齡化是未來 30 年最重要的問題，帶來的藥品和醫藥服務需求仍然非常大；創新藥的研發浪潮仍在持續，中國正在越來越快的加入這個浪潮當中來；5）國潮興起，而且國潮可以體現在各種消費子板塊，比如化妝品、運動/時尚服飾，還包括汽車電動化和智能化等；6）新興消費趨勢不斷湧現

除了上述這些星辰大海的方向之外，我們還關注：1）集中度可以持續提升的方向，比如家居行業的龍頭企業；2）估值已經較低但仍有穩定增長的子行業裡的龍頭公司，比如調味品、乳業等

我們仍然非常看好大消費及醫藥行業的長期空間，希望持有人放長眼光靜待收穫。

4.6 管理人對報告期內基金估值程序等事項的說明

本基金管理人指導基金估值業務的領導小組為公司估值委員會，公司估值委員會主要負責估值政策和估值程序的制定、修訂以及執行情況的監督。估值委員會由股票投資部、研究部、固定收益總部、數量與指數投資部、大類資產配置部、交易管理部、風險管理部、基金運營部、監察稽核部指定人員組成。公司估值委員會的相關成員均具備相應的專業勝任能力和相關工作經歷，估值委員會成員中包括五名投資組合經理。

股票投資部、研究部、固定收益總部、數量與指數投資部、大類資產配置部、風險管理部負責關注相關投資品種的動態，評判基金持有的投資品種是否處於不活躍的交易狀態或者最近交易日後經濟環境發生了重大變化或證券發行機構發生了影響證券價格的重大事件，從而確定估值日

需要進行估值測算或者調整的投資品種；提出合理的數量分析模型對需要進行估值測算或者調整的投資品種進行公允價值定價與計量；定期對估值政策和程序進行評價，以保證其持續適用；交易管理部負責關注相關投資品種的流動性狀況，協助反饋其市場交易資訊；基金運營部負責日常的基金資產的估值業務，執行基金估值政策，並負責與託管行溝通估值調整事項；監察稽核部負責審核估值政策和程序的一致性，監督估值委員會工作流程中的風險控制，並負責估值調整事項的資訊披露工作。

本基金的日常估值程序由基金運營部基金估值核算人員執行，並與託管銀行的估值結果核對一致。基金估值政策的議定和修改採用集體討論機制，投資組合經理作為估值小組成員，對持倉證券的交易情況、資訊披露情況保持應有的職業敏感，向估值委員會提供估值參考資訊，參與估值政策討論。對需採用特別估值程序的證券，基金管理人及時啟動特別估值程序，由估值委員會討論議定特別估值方案並與託管行溝通後由基金運營部具體執行。

本基金管理人參與估值流程各方之間不存在任何重大利益衝突。截止報告期末本基金管理人已與中央國債登記結算有限責任公司及中證指數有限公司簽署服務協議，由中央國債登記結算有限責任公司按約定提供銀行間同業市場的估值數據，由中證指數有限公司按約定提供交易所交易的債券品種的估值數據和流通受限股票的折扣率數據。

4.7 管理人對報告期內基金利潤分配情況的說明

本基金管理人嚴格按照本基金基金合同的規定進行收益分配。本報告期內本基金無收益分配事項。

4.8 報告期內管理人對本基金持有人數或基金資產淨值預警情形的說明

無。

§ 5 託管人報告

5.1 報告期內本基金託管人遵規守信情況聲明

本報告期內，中國銀行股份有限公司（以下稱“本託管人”）在大成內需增長混合型證券投資基金（以下稱“本基金”）的託管過程中，嚴格遵守《證券投資基金法》及其他有關法律法規、基金合同和託管協議的有關規定，不存在損害基金份額持有人利益的行為，完全盡職盡責地履行了應盡的義務。

5.2 託管人對報告期內本基金投資運作遵規守信、淨值計算、利潤分配等情況的說明

本報告期內，本託管人根據《證券投資基金法》及其他有關法律法規、基金合同和託管協議的規定，對本基金管理人的投資運作進行了必要的監督，對基金資產淨值的計算、基金份額申購

贖回價格的計算以及基金費用開支等方面進行了認真地複核，未發現本基金管理人存在損害基金份額持有人利益的行為。

5.3 託管人對本中期報告中財務資訊等內容的真實、準確和完整發表意見

本報告中的財務指標、淨值表現、收益分配情況、財務會計報告（註：財務會計報告中的“金融工具風險及管理”、“關聯方承銷證券”、“關聯方證券出借”部分未在託管人複核範圍內）、投資組合報告等數據真實、準確和完整。

§ 6 半年度財務會計報告（未經審計）

6.1 資產負債表

會計主體：大成內需增長混合型證券投資基金

報告截止日：2021 年 6 月 30 日

單位：人民幣元

資 產	附註號	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
資 產：			
銀行存款	6.4.3.1	52,179,550.99	39,676,198.32
結算備付金		959,305.73	152,859.63
存出保證金		66,369.89	51,352.92
交易性金融資產	6.4.3.2	367,734,541.07	344,455,852.02
其中：股票投資		367,734,541.07	344,333,886.40
基金投資		—	—
債券投資		—	121,965.62
資產支援證券投資		—	—
貴金屬投資		—	—
衍生金融資產	6.4.3.3	—	—
買入返售金融資產	6.4.3.4	—	—
應收證券清算款		8,109,020.75	1,895,077.12
應收利息	6.4.3.5	4,652.97	4,359.01
應收股利		—	—
應收申購款		158,826.28	300,352.55
遞延所得稅資產		—	—
其他資產	6.4.3.6	—	—
資產總計		429,212,267.68	386,536,051.57
負債和所有者權益	附註號	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
負 債：			
短期借款		—	—
交易性金融負債		—	—
衍生金融負債	6.4.3.3	—	—

賣出回購金融資產款		-	-
應付證券清算款		961,561.69	-
應付贖回款		591,213.20	459,955.73
應付管理人報酬		520,702.82	466,647.18
應付託管費		86,783.77	77,774.51
應付銷售服務費		-	-
應付交易費用	6.4.3.7	451,102.88	139,833.21
應交稅費		-	0.35
應付利息		-	-
應付利潤		-	-
遞延所得稅負債		-	-
其他負債	6.4.3.8	97,370.02	185,900.89
負債合計		2,708,734.38	1,330,111.87
所有者權益：			
實收基金	6.4.3.9	79,744,799.37	75,462,125.33
未分配利潤	6.4.3.10	346,758,733.93	309,743,814.37
所有者權益合計		426,503,533.30	385,205,939.70
負債和所有者權益總計		429,212,267.68	386,536,051.57

註：報告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份額總額 79,744,799.37 份，其中大成內需增長混合 A 基金份額總額為 63,458,623.47 份，基金份額淨值 5.349 元。大成內需增長混合 H 基金份額總額為 16,286,175.90 份，基金份額淨值 5.347 元。

6.2 利潤表

會計主體：大成內需增長混合型證券投資基金

本報告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

單位：人民幣元

項 目	附註號	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期間 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		20,670,947.11	74,160,130.68
1. 利息收入		99,129.05	126,480.63
其中：存款利息收入	6.4.3.11	99,121.84	126,480.63
債券利息收入		7.21	-
資產支援證券利息收入		-	-
買入返售金融資產收入		-	-
證券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投資收益（損失以“-”填列）		59,182,067.44	36,964,797.57
其中：股票投資收益	6.4.3.12	57,441,301.57	35,048,339.33

基金投資收益	-	-	-
債券投資收益	6.4.3.13	18,949.05	-
資產支援證券投資收益		-	-
貴金屬投資收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	1,721,816.82	1,916,458.24
3. 公允價值變動收益（損失以“-”號填列）	6.4.7.17	-38,738,388.61	36,984,544.83
4. 匯兌收益（損失以“-”號填列）		-	-
5. 其他收入（損失以“-”號填列）	6.4.7.18	128,139.23	84,307.65
減：二、費用		5,007,973.24	4,244,890.85
1. 管理人報酬	6.4.10.2.1	3,015,674.89	2,304,722.74
2. 託管費	6.4.10.2.2	502,612.47	384,120.53
3. 銷售服務費		-	-
4. 交易費用	6.4.7.19	1,374,602.58	1,446,698.76
5. 利息支出		-	-
其中：賣出回購金融資產支出		-	-
6. 稅金及附加		0.04	-
7. 其他費用	6.4.7.20	115,083.26	109,348.82
三、利潤總額（虧損總額以“-”號填列）		15,662,973.87	69,915,239.83
減：所得稅費用		-	-
四、淨利潤（淨虧損以“-”號填列）		15,662,973.87	69,915,239.83

6.3 所有者權益（基金淨值）變動表

會計主體：大成內需增長混合型證券投資基金

本報告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

單位：人民幣元

項目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	實收基金	未分配利潤	所有者權益合計
一、期初所有者權益（基金淨值）	75,462,125.33	309,743,814.37	385,205,939.70
二、本期經營活動產生的基金淨值變動數（本期利潤）	-	15,662,973.87	15,662,973.87
三、本期基金份	4,282,674.04	21,351,945.69	25,634,619.73

額交易產生的基金淨值變動數 (淨值減少以“-”號填列)			
其中：1. 基金申購款	30,358,612.77	129,914,314.66	160,272,927.43
2. 基金贖回款	-26,075,938.73	-108,562,368.97	-134,638,307.70
四、本期向基金份額持有人分配利潤產生的基金淨值變動(淨值減少以“-”號填列)	-	-	-
五、期末所有者權益(基金淨值)	79,744,799.37	346,758,733.93	426,503,533.30
項目	上年度可比期間 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	實收基金	未分配利潤	所有者權益合計
一、期初所有者權益(基金淨值)	119,793,132.21	248,394,863.50	368,187,995.71
二、本期經營活動產生的基金淨值變動數(本期利潤)	-	69,915,239.83	69,915,239.83
三、本期基金份額交易產生的基金淨值變動數 (淨值減少以“-”號填列)	-35,801,847.59	-76,365,436.10	-112,167,283.69
其中：1. 基金申購款	19,612,240.97	44,316,223.47	63,928,464.44
2. 基金贖回款	-55,414,088.56	-120,681,659.57	-176,095,748.13
四、本期向基金份額持有人分配利潤產生的基金淨值變動(淨值減少以“-”號填列)	-	-	-
五、期末所有者權益(基金淨值)	83,991,284.62	241,944,667.23	325,935,951.85

報表附註為財務報表的組成部分。

本報告 6.1 至 6.4 財務報表由下列負責人簽署：

譚曉岡

周立新

劉亞林

基金管理人負責人

主管會計工作負責人

會計機構負責人

6.4 報表附註

6.4.1 本報告期所採用的會計政策、會計估計與最近一期年度報告相一致的說明

本報告期所採用的會計政策、會計估計與最近一期年度報告相一致。

6.4.2 稅項

根據財政部、國家稅務總局財稅[2002]128 號《關於開放式證券投資基金有關稅收問題的通知》、財稅[2008]1 號《關於企業所得稅若干優惠政策的通知》、財稅[2012]85 號《關於實施上市公司股息紅利差別化個人所得稅政策有關問題的通知》、財稅[2015]101 號《關於上市公司股息紅利差別化個人所得稅政策有關問題的通知》、財稅[2015]125 號《關於內地與香港基金互認有關稅收政策的通知》、財稅[2016]36 號《關於全面推開營業稅改徵增值稅試點的通知》、財稅[2016]46 號《關於進一步明確全面推開營改增試點金融業有關政策的通知》、財稅[2016]70 號《關於金融機構同業往來等增值稅政策的補充通知》、財稅[2016]140 號《關於明確金融 房地產開發 教育 輔助服務等增值稅政策的通知》、財稅[2017]2 號《關於資管產品增值稅政策有關問題的補充通知》、財稅[2017]56 號《關於資管產品增值稅有關問題的通知》、財稅[2017]90 號《關於租入固定資產進項稅額抵扣等增值稅政策的通知》及其他相關財稅法規和實務操作，主要稅項列示如下：

(1) 資管產品運營過程中發生的增值稅應稅行為，以資管產品管理人為增值稅納稅人。資管產品管理人運營資管產品過程中發生的增值稅應稅行為，暫適用簡易計稅方法，按照 3% 的徵收率繳納增值稅。對資管產品在 2018 年 1 月 1 日前運營過程中發生的增值稅應稅行為，未繳納增值稅的，不再繳納；已繳納增值稅的，已納稅額從資管產品管理人以後月份的增值稅應納稅額中抵減。

對證券投資基金管理人運用基金買賣股票、債券的轉讓收入免徵增值稅，對國債、地方政府債以及金融同業往來利息收入亦免徵增值稅。資管產品管理人運營資管產品提供的貸款服務，以 2018 年 1 月 1 日起產生的利息及利息性質的收入為銷售額。資管產品管理人運營資管產品轉讓 2017 年 12 月 31 日前取得的非貨物期貨，可以選擇按照實際買入價計算銷售額，或者以 2017 年最後一個交易日的非貨物期貨結算價格作為買入價計算銷售額。

(2) 對基金從證券市場中取得的收入，包括買賣股票、債券的差價收入，股票的股息、紅利收入，債券的利息收入及其他收入，暫不徵收企業所得稅。

(3) 對於內地投資者持有的基金類別，對基金取得的企業債券利息收入，應由發行債券的企業在向基金支付利息時代扣代繳 20% 的個人所得稅。對基金從上市公司取得的股息紅利所得，持股

期限在 1 個月以內(含 1 個月)的，其股息紅利所得全額計入應納稅所得額；持股期限在 1 個月以上至 1 年(含 1 年)的，暫減按 50%計入應納稅所得額；持股期限超過 1 年的，暫免徵收個人所得稅。對基金持有的上市公司限售股，解禁後取得的股息、紅利收入，按照上述規定計算納稅，持股時間自解禁日起計算；解禁前取得的股息、紅利收入繼續暫減按 50%計入應納稅所得額。上述所得統一適用 20%的稅率計征個人所得稅。

對於香港市場投資者通過基金互認持有的基金類別，對基金取得的企業債券利息收入，應由發行債券的企業在向該內地基金分配利息時按照 7%的稅率代扣代繳所得稅。對基金從上市公司取得的股息紅利所得，應由內地上市公司向該內地基金分配股息紅利時按照 10%的稅率代扣代繳所得稅。

(4) 基金賣出股票按 0.1%的稅率繳納股票交易印花稅，買入股票不徵收股票交易印花稅。

(5) 本基金的城市維護建設稅、教育費附加和地方教育附加等稅費按照實際繳納增值稅額的適用比例計算繳納。

6.4.3 重要財務報表項目的說明

6.4.3.1 銀行存款

單位：人民幣元

項目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	52,179,550.99
定期存款	—
其中：存款期限 1 個月以內	—
存款期限 1-3 個月	—
存款期限 3 個月以上	—
其他存款	—
合計	52,179,550.99

6.4.3.2 交易性金融資產

單位：人民幣元

項目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允價值	公允價值變動
股票	288,741,359.06	367,734,541.07	78,993,182.01
貴金屬投資-金交所黃金合約	—	—	—
債券	交易所市場	—	—
	銀行間市場	—	—
	合計	—	—

資產支援證券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合計	288,741,359.06	367,734,541.07	78,993,182.01

6.4.3.3 衍生金融資產/負債

無。

6.4.3.4 買入返售金融資產

無。

6.4.3.5 應收利息

單位：人民幣元

項目	本期末 2021 年 6 月 30 日
應收活期存款利息	4,237.62
應收定期存款利息	-
應收其他存款利息	-
應收結算備付金利息	388.44
應收債券利息	-
應收資產支援證券利息	-
應收買入返售證券利息	-
應收申購款利息	-
應收黃金合約拆借孳息	-
應收出借證券利息	-
其他	26.91
合計	4,652.97

6.4.3.6 其他資產

無。

6.4.3.7 應付交易費用

單位：人民幣元

項目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市場應付交易費用	451,102.88
銀行間市場應付交易費用	-
合計	451,102.88

6.4.3.8 其他負債

單位：人民幣元

項目	本期末 2021 年 6 月 30 日
----	------------------------

應付券商交易單元保證金	-
應付贖回費	1, 130. 17
應付證券出借違約金	-
預提費用	96, 239. 85
合計	97, 370. 02

6. 4. 3. 9 實收基金

金額單位：人民幣元

大成內需增長混合 A

項目	本期	
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份額（份）	賬面金額
上年度末	66, 238, 693. 76	66, 238, 693. 76
本期申購	15, 646, 558. 85	15, 646, 558. 85
本期贖回（以“-”號填列）	-18, 426, 629. 14	-18, 426, 629. 14
-基金拆分/份額折算前	-	-
基金拆分/份額折算調整	-	-
本期申購	-	-
本期贖回（以“-”號填列）	-	-
本期末	63, 458, 623. 47	63, 458, 623. 47

大成內需增長混合 H

項目	本期	
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份額（份）	賬面金額
上年度末	9, 223, 431. 57	9, 223, 431. 57
本期申購	14, 712, 053. 92	14, 712, 053. 92
本期贖回（以“-”號填列）	-7, 649, 309. 59	-7, 649, 309. 59
-基金拆分/份額折算前	-	-
基金拆分/份額折算調整	-	-
本期申購	-	-
本期贖回（以“-”號填列）	-	-
本期末	16, 286, 175. 90	16, 286, 175. 90

註：申購含紅利再投份額(如有)、轉換入份額(如有)；贖回含轉換出份額(如有)。

6. 4. 3. 10 未分配利潤

單位：人民幣元

大成內需增長混合 A

項目	已實現部分	未實現部分	未分配利潤合計
上年度末	169, 533, 500. 70	102, 356, 169. 92	271, 889, 670. 62
本期利潤	43, 016, 479. 81	-28, 092, 295. 28	14, 924, 184. 53
本期基金份額 交易產生的變動數	-6, 499, 277. 16	-4, 347, 945. 84	-10, 847, 223. 00

其中：基金申購款	45,808,979.47	20,615,237.49	66,424,216.96
基金贖回款	-52,308,256.63	-24,963,183.33	-77,271,439.96
本期已分配利潤	-	-	-
本期末	206,050,703.35	69,915,928.80	275,966,632.15

大成內需增長混合 H

項目	已實現部分	未實現部分	未分配利潤合計
上年度末	23,602,446.62	14,251,697.13	37,854,143.75
本期利潤	11,384,882.67	-10,646,093.33	738,789.34
本期基金份額交易產生的變動數	17,862,557.60	14,336,611.09	32,199,168.69
其中：基金申購款	39,982,783.70	23,507,314.00	63,490,097.70
基金贖回款	-22,120,226.10	-9,170,702.91	-31,290,929.01
本期已分配利潤	-	-	-
本期末	52,849,886.89	17,942,214.89	70,792,101.78

6.4.3.11 存款利息收入

單位：人民幣元

項目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	93,532.79
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
結算備付金利息收入	5,203.26
其他	385.79
合計	99,121.84

6.4.3.12 股票投資收益

單位：人民幣元

項目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
賣出股票成交總額	452,439,777.88
減：賣出股票成本總額	394,998,476.31
買賣股票差價收入	57,441,301.57

6.4.3.13 債券投資收益

單位：人民幣元

項目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
----	----------------------------

賣出債券（、債轉股及債券到期兌付）成交總額	114,869.02
減：賣出債券（、債轉股及債券到期兌付）成本總額	95,900.00
減：應收利息總額	19.97
買賣債券差價收入	18,949.05

6.4.3.14 貴金屬投資收益

無。

6.4.3.15 衍生工具收益

無。

6.4.3.16 股利收益

單位：人民幣元

項目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投資產生的股利收益	1,721,816.82
其中：證券出借權益補償收入	—
基金投資產生的股利收益	—
合計	1,721,816.82

6.4.3.17 公允價值變動收益

單位：人民幣元

項目名稱	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融資產	-38,738,388.61
股票投資	-38,712,322.99
債券投資	-26,065.62
資產支援證券投資	—
基金投資	—
貴金屬投資	—
其他	—
2. 衍生工具	—
權證投資	—
3. 其他	—
減：應稅金融商品公允價值變動產生的預估增值稅	—
合計	-38,738,388.61

6.4.3.18 其他收入

單位：人民幣元

項目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金贖回費收入	118,885.18

基金轉換費收入	9,254.05
合計	128,139.23

註：1. 本基金 A 類份額的贖回費率按持有期間遞減，不低於贖回費總額的 25% 歸入基金資產，H 類份額的贖回費率為 0.13%，贖回費全部歸入基金資產。

2. 本基金的轉換費由申購補差費和轉出基金的贖回費兩部分構成，其中 A 類份額轉出基金的不低於贖回費的 25% 歸入轉出基金的基金資產，H 類份額轉出基金的贖回費全部歸入轉出基金的基金資產。

6.4.3.19 交易費用

單位：人民幣元

項目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市場交易費用	1,374,602.58
銀行間市場交易費用	—
合計	1,374,602.58

6.4.3.20 其他費用

單位：人民幣元

項目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
審計費用	32,232.48
資訊披露費	59,507.37
證券出借違約金	—
銀行劃款手續費	9,243.41
賬戶維護費	13,500.00
其他	600.00
合計	115,083.26

6.4.3.21 分部報告

無。

6.4.4 或有事項、資產負債表日後事項的說明

6.4.4.1 或有事項

無。

6.4.4.2 資產負債表日後事項

無。

6.4.5 關聯方關係

6.4.5.1 本報告期存在控制關係或其他重大利害關係的關聯方發生變化的情況

本基金本報告期存在控制關係或者其他重大利害關係的關聯方未發生變化。

6.4.5.2 本報告期與基金髮生關聯交易的各關聯方

關聯方名稱	與本基金的關係
大成基金管理有限公司（“大成基金”）	基金管理人、基金銷售機構、註冊登記機構
中國銀行股份有限公司（“中國銀行”）	基金託管人、基金銷售機構
光大證券股份有限公司（“光大證券”）	基金管理人的股東、基金銷售機構

註：下述關聯交易均在正常業務範圍內按一般商業條款訂立。

6.4.6 本報告期及上年度可比期間的關聯方交易

無。

6.4.6.1 通過關聯方交易單元進行的交易

6.4.6.1.1 股票交易

金額單位：人民幣元

關聯方名稱	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期間 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	成交金額	佔當期股票 成交總額的比例 (%)	成交金額	佔當期股票 成交總額的比例 (%)
光大證券	107,567,663.25	11.92	48,294,757.49	5.31

6.4.6.1.2 債券交易

金額單位：人民幣元

關聯方名稱	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期間 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	成交金額	佔當期債券 成交總額的比例 (%)	成交金額	佔當期債券 成交總額的比例 (%)
光大證券	114,869.02	100.00	—	—

6.4.6.1.3 債券回購交易

無。

6.4.6.1.4 權證交易

無。

6.4.6.1.5 應支付關聯方的傭金

金額單位：人民幣元

關聯方名稱	本期 2021年1月1日至2021年6月30日			
	當期 備金	佔當期備金總量 的比例 (%)	期末應付備金餘 額	佔期末應付備金 總額的比例 (%)
光大證券	98,025.77	11.92	-	-
關聯方名稱	上年度可比期間 2020年1月1日至2020年6月30日			
	當期 備金	佔當期備金總量 的比例 (%)	期末應付備金餘 額	佔期末應付備金 總額的比例 (%)
光大證券	44,009.11	5.31	39,613.27	12.48

註：1. 上述備金參考市場價格經本基金的基金管理人與對方協商確定，以扣除由中國證券登記結算有限責任公司收取的證管費和經手費的淨額列示。

2. 該類備金協議的服務範圍還包括備金收取方為本基金提供的證券投資研究成果和市場資訊服務等。

6.4.6.2 關聯方報酬

6.4.6.2.1 基金管理費

單位：人民幣元

項目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期間 2020年1月1日至2020年6月30日
當期發生的基金應支付的管理費	3,015,674.89	2,304,722.74
其中：支付銷售機構的客戶維護費	927,092.11	903,332.78

註：支付基金管理人大成基金的管理人報酬按前一日基金資產淨值 1.50%的年費率計提，逐日累計至每月月底，按月支付。其計算公式為：

日管理人報酬＝前一日基金資產淨值 × 1.50% / 當年天數。

6.4.6.2.2 基金託管費

單位：人民幣元

項目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期間 2020年1月1日至2020年6月30日
當期發生的基金應支付的託管費	502,612.47	384,120.53

註：支付基金託管人中國農業銀行的託管費按前一日基金資產淨值 0.25%的年費率計提，逐日累計至每月月底，按月支付。其計算公式為：

日託管費＝前一日基金資產淨值 × 0.25% / 當年天數。

6.4.6.3 與關聯方進行銀行間同業市場的債券(含回購)交易

無。

6.4.6.4 報告期內轉融通證券出借業務發生重大關聯交易事項的說明

無。

6.4.6.5 各關聯方投資本基金的情況

6.4.6.5.1 報告期內基金管理人運用固有資金投資本基金的情況

無。

6.4.6.5.2 報告期末除基金管理人之外的其他關聯方投資本基金的情況

無。

6.4.6.6 由關聯方保管的銀行存款餘額及當期產生的利息收入

單位：人民幣元

關聯方名稱	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期間 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	期末餘額	當期利息收入	期末餘額	當期利息收入
中國銀行	52,179,550.99	93,532.79	51,252,136.17	118,673.89

註：本基金由基金託管人保管的銀行存款，按銀行約定利率計息。

6.4.6.7 本基金在承銷期內參與關聯方承銷證券的情況

無。

6.4.6.8 其他關聯交易事項的說明

無。

6.4.7 利潤分配情況

無。

6.4.8 期末(2021 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限證券

6.4.8.1 因認購新發/增發證券而於期末持有的流通受限證券

金額單位：人民幣元

6.4.8.1.1 受限證券類別：股票

證券代碼	證券名稱	成功認購日	可流通日	流通受限類型	認購價格	期末估值單價	數量 (單位：股)	期末成本總額	期末估值總額	備註
300614	百川暢銀	2021 年 5 月 18 日	2021 年 11 月 25 日	新股鎖定	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300926	博俊科技	2020 年 12 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股鎖定	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300927	江天化學	2020 年 12 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股鎖定	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300929	華騏環保	2021 年 1 月 12 日	2021 年 7 月 20 日	新股鎖定	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300932	三友聯眾	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 22 日	新股鎖定	24.69	31.71	492	12,147.48	15,601.32	-
300933	中辰股份	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 22 日	新股鎖定	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
300937	藥易購	2021 年 1 月 20 日	2021 年 7 月 27 日	新股鎖定	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
300940	南極光	2021 年 1 月 27 日	2021 年 8 月 3 日	新股鎖定	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300941	創識科技	2021 年 2 月 2 日	2021 年 8 月 9 日	新股鎖定	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06	-
300942	易瑞生物	2021 年 2 月 2 日	2021 年 8 月 9 日	新股鎖定	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300943	春暉智控	2021 年 2 月 3 日	2021 年 8 月 10 日	新股鎖定	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300945	曼卡龍	2021 年 2 月 3 日	2021 年 8 月 10 日	新股鎖定	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-

300950	德固特	2021 年 2 月 24 日	2021 年 9 月 3 日	新股鎖 定	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
300952	恒輝 安防	2021 年 3 月 3 日	2021 年 9 月 13 日	新股鎖 定	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
300953	震裕 科技	2021 年 3 月 11 日	2021 年 9 月 22 日	新股鎖 定	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
300955	嘉亨 家化	2021 年 3 月 16 日	2021 年 9 月 24 日	新股鎖 定	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300956	英力 股份	2021 年 3 月 16 日	2021 年 9 月 27 日	新股鎖 定	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
300957	貝泰 妮	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 27 日	新股鎖 定	47.33	251.96	217	10,270.61	54,675.32	-
300958	建工 修複	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 29 日	新股鎖 定	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300960	通業 科技	2021 年 3 月 22 日	2021 年 9 月 29 日	新股鎖 定	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300961	深水 海納	2021 年 3 月 23 日	2021 年 9 月 30 日	新股鎖 定	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300962	中金 輻照	2021 年 3 月 29 日	2021 年 10 月 11 日	新股鎖 定	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300963	中洲 特材	2021 年 3 月 30 日	2021 年 10 月 11 日	新股鎖 定	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
300966	共同 藥業	2021 年 3 月 31 日	2021 年 10 月 11 日	新股鎖 定	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300967	曉鳴 股份	2021 年 4 月 2 日	2021 年 10 月 13 日	新股鎖 定	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300968	格林 精密	2021 年 4 月 6 日	2021 年 10 月 15 日	新股鎖 定	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-
300971	博亞 精工	2021 年 4 月 7 日	2021 年 10 月	新股鎖 定	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-

			15 日							
300973	立高食品	2021 年 4 月 8 日	2021 年 10 月 15 日	新股鎖 定	28.28	115.71	150	4,242.00	17,356.50	-
300975	商絡電子	2021 年 4 月 14 日	2021 年 10 月 21 日	新股鎖 定	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300978	東箭科技	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	新股鎖 定	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300981	中紅醫療	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	新股鎖 定	48.59	90.39	121	5,879.39	10,937.19	-
300982	蘇文電能	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	新股鎖 定	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300986	志特新材	2021 年 4 月 21 日	2021 年 11 月 1 日	新股鎖 定	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300991	創益通	2021 年 5 月 12 日	2021 年 11 月 22 日	新股鎖 定	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300992	泰福泵業	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 25 日	新股鎖 定	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
300993	玉馬遮陽	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 24 日	新股鎖 定	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300995	奇德新材	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 26 日	新股鎖 定	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
300996	普聯軟體	2021 年 5 月 26 日	2021 年 12 月 3 日	新股鎖 定	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300997	歡樂家	2021 年 5 月 26 日	2021 年 12 月 2 日	新股鎖 定	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
300998	寧波方正	2021 年 5 月 25 日	2021 年 12 月 2 日	新股鎖 定	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301002	崧盛股份	2021 年 5 月 27 日	2021 年 12 月 7 日	新股鎖 定	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
301007	德邁	2021 年	2021 年	新股鎖	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-

	仕	6月4日	12月 16日	定						
301009	可靠 股份	2021年 6月8日	2021年 12月 17日	新股鎖 定	12.54	27.89	801	10,044.54	22,339.89	-
301010	晶雪 節能	2021年 6月9日	2021年 12月 20日	新股鎖 定	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301011	華立 科技	2021年 6月9日	2021年 12月 17日	新股鎖 定	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
301012	揚電 科技	2021年 6月15 日	2021年 12月 22日	新股鎖 定	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
301013	利和 興	2021年 6月21 日	2021年 12月 29日	新股鎖 定	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-
301015	百洋 醫藥	2021年 6月22 日	2021年 12月 30日	新股鎖 定	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
301016	雷爾 偉	2021年 6月23 日	2021年 12月 30日	新股鎖 定	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
301020	密封 科技	2021年 6月28 日	2021年 7月6 日	新股未 上市	10.64	10.64	4,210	44,794.40	44,794.40	-
301021	英諾 雷射	2021年 6月28 日	2021年 7月6 日	新股未 上市	9.46	9.46	2,899	27,424.54	27,424.54	-
605162	新中 港	2021年 6月29 日	2021年 7月7 日	新股未 上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
688087	英科 再生	2021年 6月30 日	2021年 7月9 日	新股未 上市	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
688226	威騰 電氣	2021年 6月28 日	2021年 7月7 日	新股未 上市	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
688239	航宇 科技	2021年 6月25 日	2021年 7月5 日	新股未 上市	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-
688269	凱立 新材	2021年 6月1日	2021年 12月9 日	新股鎖 定	18.94	100.92	1,941	36,762.54	195,885.72	-

688499	利元亨	2021 年 6 月 23 日	2021 年 7 月 1 日	新股未 上市	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-
688628	優利德	2021 年 1 月 22 日	2021 年 8 月 2 日	新股鎖 定	19.11	32.62	2,789	53,297.79	90,977.18	-
688630	芯碁 微裝	2021 年 3 月 25 日	2021 年 10 月 8 日	新股鎖 定	15.23	58.42	3,397	51,736.31	198,452.74	-
688696	極米 科技	2021 年 2 月 23 日	2021 年 9 月 3 日	新股鎖 定	133.73	780.24	429	57,370.17	334,722.96	-
688700	東威 科技	2021 年 6 月 7 日	2021 年 12 月 15 日	新股鎖 定	9.41	38.46	3,049	28,691.09	117,264.54	-

註：1. 根據《上海證券交易所科創板股票公開發行自律委員會促進科創板初期企業平穩發行行業倡導建議》，本基金獲配的科創板股票如經抽籤方式確定需要鎖定的，鎖定期限為自發行人股票上市之日起 6 個月。根據《上海證券交易所科創板上市公司股東以向特定機構投資者詢價轉讓和配售方式減持股份實施細則》，基金通過詢價轉讓受讓的股份，在受讓後 6 個月內不得轉讓。

2. 根據《深圳證券交易所創業板首次公開發行證券發行與承銷業務實施細則》，發行人和主承銷商可以採用搖號限售方式或比例限售方式，安排基金通過網下發行獲配的部分創業板股票設置不低於 6 個月的限售期。

3. 基金可使用以基金名義開設的股票賬戶，選擇網上或者網下一種方式進行新股申購。本基金參與網下申購獲得的新股，在新股上市之前及上市之後的約定期限(若有)內不得轉讓；本基金參與網上申購獲得的新股，在新股上市之前不得轉讓。

6.4.8.2 期末持有的暫時停牌等流通受限股票

無。

6.4.8.3 期末債券正回購交易中作為抵押的債券

無。

6.4.8.4 期末參與轉融通證券出借業務的證券

無。

6.4.9 金融工具風險及管理

6.4.9.1 風險管理政策和組織架構

本基金是混合型基金，其預期收益及風險水平高於貨幣市場基金和債券型基金，低於股票型基金，屬於中高收益風險特徵的基金。本基金投資的金融工具主要包括股票投資。本基金在日常經營活動中面臨的與這些金融工具相關的風險主要包括信用風險、流動性風險及市場風險。本基金的基金管理人從事風險管理的主要目標是爭取將以上風險控制在限定的範圍之內，使本基金在風險和收益之間取得最佳的平衡以實現“風險和收益相匹配”的風險收益目標。

本基金的基金管理人奉行全面風險管理體系的建設，建立了以由高層監控(合規與風險管理委員會、公司投資風險控制委員會)、專業監控(監察稽核部、風險管理部)、部門互控、崗位自控構成的風險管理架構體系。本基金的基金管理人在董事會下設立合規與風險管理委員會，對公司整體運營風險進行監督，監督風險控制措施的執行；在管理層層面設立投資風險控制委員會，通過定期會議討論涉及投資風險的重大議題，形成正式決議提交投委會；在業務操作層面，監察稽核部履行合規控制職責，通過定期、不定期檢查內控制度的執行情況、對重大風險點以專項稽核的方式確保公司內控制度、流程得到貫徹執行。風險管理部履行風險量化評估分析職責。

本基金的基金管理人對於金融工具的風險管理方法主要是通過定性分析和定量分析的方法去估測各種風險產生的可能損失。從定性分析的角度出發，判斷風險損失的嚴重程度和出現同類風險損失的頻度。而從定量分析的角度出發，根據本基金的投資目標，結合基金資產所運用金融工具特徵通過特定的風險量化指標、模型，日常的量化報告，確定風險損失的限度和相應置信程度，及時可靠地對各種風險進行監督、檢查和評估，並通過相應決策，將風險控制在可承受的範圍內。

6.4.9.2 信用風險

信用風險是指基金在交易過程中因交易對手未履行合約責任，或者基金所投資證券之發行人出現違約、拒絕支付到期本息等情況，導致基金資產損失和收益變化的風險。

本基金的基金管理人在交易前對交易對手的資信狀況進行了充分的評估。本基金的銀行存款存放在本基金的託管行中國銀行，因而與銀行存款相關的信用風險不重大。本基金在交易所進行的交易均以中國證券登記結算有限責任公司為交易對手完成證券交收和款項清算，違約風險可能性很小；在銀行間同業市場進行交易前均對交易對手進行信用評估並對證券交割方式進行限制以控制相應的信用風險。

本基金的基金管理人建立了信用風險管理流程，通過對投資品種信用等級評估來控制證券發行人的信用風險，且通過分散化投資以分散信用風險。

於本期末，本基金無債券投資（上年度末：持有除國債、央行票據和政策性金融債以外的債券佔比為 0.03）。

6.4.9.3 流動性風險

流動性風險是指基金在履行與金融負債有關的義務時遇到資金短缺的風險。本基金的流動性風險一方面來自於基金份額持有人可隨時要求贖回其持有的基金份額，另一方面來自於投資品種所處的交易市場不活躍而帶來的變現困難或因投資集中而無法在市場出現劇烈波動的情況下以合理的價格變現。

6.4.9.3.1 報告期內本基金組合資產的流動性風險分析

本基金的基金管理人嚴格按照《公開募集證券投資基金運作管理辦法》及《公開募集開放式證券投資基金流動性風險管理規定》等有關法規的要求建立健全開放式基金流動性風險管理的內部控制體系，審慎評估各類資產的流動性，針對性制定流動性風險管理措施，對本基金組合資產的流動性風險進行管理。本基金的基金管理人採用監控基金組合資產持倉集中度指標、逆回購交易的到期日與交易對手的集中度、流動性受限資產比例、基金組合資產中 7 個工作日可變現資產的可變現價值以及壓力測試等方式防範流動性風險。並於開放日對本基金的申購贖回情況進行監控，保持基金投資組合中的可用現金頭寸與之相匹配，確保本基金資產的變現能力與投資者贖回需求的匹配與平衡。本基金的基金管理人在基金合同中設計了巨額贖回條款，約定在非常情況下贖回申請的處理方式，控制因開放申購贖回模式帶來的流動性風險，有效保障基金持有人利益。於本期末，本基金持有的流動性受限資產的估值佔基金資產淨值的比例未超過 15%。

本基金主要投資於交易所及銀行間市場內交易的證券，除在附註“期末本基金持有的流通受限證券”中列示的部分基金資產流通暫時受限制外(如有)，其餘均能及時變現。此外，本基金可通過賣出回購金融資產方式借入短期資金應對流動性需求，其上限一般不超過基金持有的債券資產的公允價值。除附註“期末債券正回購交易中作為抵押的債券”中列示的賣出回購金融資產款餘額(如有)將在 1 個月內到期且計息外，本基金於資產負債表日所持有的金融負債的合約約定剩餘到期日均為一年以內且一般不計息，可贖回基金份額淨值無固定到期日且不計息，因此賬面餘額一般即為未折現的合約到期現金流量。

6.4.9.4 市場風險

市場風險是指基金所持金融工具的公允價值或未來現金流量因所處市場各類價格因素的變動而發生波動的風險，包括利率風險、外匯風險和其他價格風險。

6.4.9.4.1 利率風險

利率風險是指金融工具的公允價值或現金流量受市場利率變動而發生波動的風險。利率敏感性金融工具均面臨由於市場利率上升而導致公允價值下降的風險，其中浮動利率類金融工具還面臨每個付息期間結束根據市場利率重新定價時對於未來現金流影響的風險。

本基金的基金管理人定期對本基金面臨的利率敏感性缺口進行監控，並通過調整投資組合的久期等方法對上述利率風險進行管理。

本基金持有及承擔的大部分金融資產和金融負債不計息，因此本基金的收入及經營活動的現金流量在很大程度上獨立於市場利率變化。本基金持有的利率敏感性資產主要為銀行存款、結算備付金和存出保證金等。

6.4.9.4.1.1 利率風險敞口

單位：人民幣元

本期末 2021 年 6 月 30 日	1 年以內	1-5 年	5 年以上	不計息	合計
資產					
銀行存款	52,179,550.99	-	-	-	52,179,550.99
結算備付金	959,305.73	-	-	-	959,305.73
存出保證金	66,369.89	-	-	-	66,369.89
交易性金融資產	-	-	-	367,734,541.07	367,734,541.07
應收利息	-	-	-	4,652.97	4,652.97
應收申購款	-	-	-	158,826.28	158,826.28
應收證券清算款	-	-	-	8,109,020.75	8,109,020.75
資產總計	53,205,226.61	-	-	376,007,041.07	429,212,267.68
負債					
應付贖回款	-	-	-	591,213.20	591,213.20
應付管理人報酬	-	-	-	520,702.82	520,702.82
應付託管費	-	-	-	86,783.77	86,783.77
應付證券清算款	-	-	-	961,561.69	961,561.69
應付交易費用	-	-	-	451,102.88	451,102.88
其他負債	-	-	-	97,370.02	97,370.02
負債總計	-	-	-	2,708,734.38	2,708,734.38
利率敏感度缺口	53,205,226.61	-	-	373,298,306.69	426,503,533.30
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以內	1-5 年	5 年以上	不計息	合計
資產					
銀行存款	39,676,198.32	-	-	-	39,676,198.32
結算備付金	152,859.63	-	-	-	152,859.63
存出保證金	51,352.92	-	-	-	51,352.92

交易性金融資產	-	-	121,965.62	344,333,886.40	344,455,852.02
應收利息	-	-	-	4,359.01	4,359.01
應收申購款	29.82	-	-	300,322.73	300,352.55
應收證券清算款	-	-	-	1,895,077.12	1,895,077.12
資產總計	39,880,440.69	-	121,965.62	346,533,645.26	386,536,051.57
負債					
應付贖回款	-	-	-	459,955.73	459,955.73
應付管理人報酬	-	-	-	466,647.18	466,647.18
應付託管費	-	-	-	77,774.51	77,774.51
應付交易費用	-	-	-	139,833.21	139,833.21
應交稅費	-	-	-	0.35	0.35
其他負債	-	-	-	185,900.89	185,900.89
負債總計	-	-	-	1,330,111.87	1,330,111.87
利率敏感度缺口	39,880,440.69	-	121,965.62	345,203,533.39	385,205,939.70

註：表中所示為本基金資產及負債的賬面價值，並按照合約規定的利率重新定價日或到期日孰早者予以分類。

6.4.9.4.1.2 利率風險的敏感性分析

於本期末，本基金未持有交易性債券投資（上年度末：0.03%），因此市場利率的變動對於本基金資產淨值無重大影響（上年度末：同）。

6.4.9.4.2 外匯風險

外匯風險是指金融工具的公允價值或未來現金流量因外匯匯率變動而發生波動的風險。本基金的所有資產及負債以人民幣計價，因此無重大外匯風險。

6.4.9.4.3 其他價格風險

其他價格風險是指基金所持金融工具的公允價值或未來現金流量因除市場利率和外匯匯率以外的市場價格因素變動而發生波動的風險。本基金主要投資於證券交易所上市或銀行間同業市場交易的股票和債券，所面臨的其他價格風險來源於單個證券發行主體自身經營情況或特殊事項的影響，也可能來源於證券市場整體波動的影響。

本基金的基金管理人在構建和管理投資組合的過程中，採用“自上而下為主、自下而上為輔”的策略，通過對中國經濟轉型重要推動力的內需增長的外部環境條件、政策導向、實現路徑與推動作用的分析，結合證券市場運行情況，做出資產配置及組合構建的決定；通過對單個證券的定性分析及定量分析，選擇符合基金合同約定範圍的投資品種進行投資。本基金的基金管理人定期結合宏觀及微觀環境的變化，對投資策略、資產配置、投資組合進行修正，來主動應對可能發生的市場價格風險。

本基金通過投資組合的分散化降低其他價格風險。本基金投資組合中股票資產佔基金資產淨值的比例範圍為 60%-95%；債券、資產支援證券、債券逆回購等固定收益類資產和現金投資比例範圍為基金資產淨值的 5%-40%；現金（不包括結算備付金、存出保證金、應收申購款等）或到期日在一年以內的政府債券的比例不低於基金資產淨值的 5%；權證、股指期貨及其他金融工具的投資比例依照法律法規或監管機構的規定執行；本基金將 80%以上的股票資產投資於受益於內需增長的行業中的優質企業。此外，本基金的基金管理人每日對本基金所持有的證券價格實施監控，定期運用多種定量方法對基金進行風險度量，包括 VaR(Value at Risk) 指標等來測試本基金面臨的潛在價格風險，及時可靠地對風險進行跟蹤和控制。

6.4.9.4.3.1 其他價格風險敞口

金額單位：人民幣元

項目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允價值	佔基金資產淨值比例 (%)	公允價值	佔基金資產淨值比例 (%)
交易性金融資產—股票投資	367,734,541.07	86.22	344,333,886.40	89.39
交易性金融資產—基金投資	—	—	—	—
交易性金融資產—貴金屬投資	—	—	—	—
衍生金融資產—權證投資	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合計	367,734,541.07	86.22	344,333,886.40	89.39

6.4.9.4.3.2 其他價格風險的敏感性分析

假設	除業績比較基準以外的其他市場變數保持不變		
	相關風險變數的變動	對資產負債表日基金資產淨值的影響金額（單位：人民幣元）	
		本期末（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
分析	1. 業績比較基準上升 5%	30,931,898.64	20,535,588.95
	2. 業績比較基準下	-30,931,898.64	-20,535,588.95

	降 5%		
--	------	--	--

6.4.10 有助於理解和分析會計報表需要說明的其他事項

無。

§ 7 投資組合報告

7.1 期末基金資產組合情況

金額單位：人民幣元

序號	項目	金額	佔基金總資產的比例 (%)
1	權益投資	367,734,541.07	85.68
	其中：股票	367,734,541.07	85.68
2	基金投資	—	—
3	固定收益投資	—	—
	其中：債券	—	—
	資產支援證券	—	—
4	貴金屬投資	—	—
5	金融衍生品投資	—	—
6	買入返售金融資產	—	—
	其中：買斷式回購的買入返售金融資產	—	—
7	銀行存款和結算備付金合計	53,138,856.72	12.38
8	其他各項資產	8,338,869.89	1.94
9	合計	429,212,267.68	100.00

7.2 報告期末按行業分類的股票投資組合

7.2.1 報告期末按行業分類的境內股票投資組合

金額單位：人民幣元

代碼	行業類別	公允價值（元）	佔基金資產淨值比例 (%)
A	農、林、牧、漁業	5,850.78	0.00
B	採礦業	—	—
C	製造業	336,328,782.37	78.86
D	電力、熱力、燃氣及水生產和供應業	13,020.39	0.00
E	建築業	14,356.93	0.00
F	批發和零售業	58,149.86	0.01
G	交通運輸、倉儲和郵政業	—	—
H	住宿和餐飲業	4,823,665.00	1.13
I	資訊傳輸、軟體和資訊技術服務業	42,333.89	0.01
J	金融業	34,721.10	0.01
K	房地產業	10,095.90	0.00

L	租賃和商務服務業	26,168,720.00	6.14
M	科學研究和技術服務業	—	—
N	水利、環境和公共設施管理業	35,554.25	0.01
O	居民服務、修理和其他服務業	—	—
P	教育	199,290.60	0.05
Q	衛生和社會工作	—	—
R	文化、體育和娛樂業	—	—
S	綜合	—	—
	合計	367,734,541.07	86.22

7.2.2 報告期末按行業分類的港股通投資股票投資組合

無。

7.3 期末按公允價值佔基金資產淨值比例大小排序的所有股票投資明細

金額單位：人民幣元

序號	股票代碼	股票名稱	數量（股）	公允價值（元）	佔基金資產淨值比例（%）
1	600519	貴州茅台	17,900	36,814,930.00	8.63
2	000858	五糧液	113,700	33,870,093.00	7.94
3	000568	瀘州老窖	125,113	29,519,161.22	6.92
4	601888	中國中免	87,200	26,168,720.00	6.14
5	300760	邁瑞醫療	52,302	25,107,575.10	5.89
6	300896	愛美客	27,655	21,816,476.40	5.12
7	600079	人福醫藥	596,400	16,860,228.00	3.95
8	000333	美的集團	233,300	16,650,621.00	3.90
9	603392	萬泰生物	56,395	14,616,456.10	3.43
10	600887	伊利股份	308,700	11,369,421.00	2.67
11	603187	海容冷鏈	257,040	11,021,875.20	2.58
12	603345	安井食品	41,100	10,440,222.00	2.45
13	300871	回盛生物	235,750	9,194,250.00	2.16
14	688036	傳音控股	42,759	8,958,010.50	2.10
15	002311	海大集團	107,800	8,796,480.00	2.06
16	300363	博騰股份	104,200	8,765,304.00	2.06
17	603816	顧家家居	103,800	8,021,664.00	1.88
18	300357	我武生物	123,200	7,899,584.00	1.85
19	600600	青島啤酒	66,100	7,644,465.00	1.79
20	603020	愛普股份	389,200	7,266,364.00	1.70
21	603518	錦泓集團	271,900	6,710,492.00	1.57
22	603008	喜臨門	164,000	5,413,640.00	1.27
23	600882	妙可藍多	71,100	4,962,780.00	1.16
24	600754	錦江酒店	84,700	4,823,665.00	1.13

25	002612	朗姿股份	84,200	4,548,484.00	1.07
26	300750	寧德時代	7,900	4,224,920.00	0.99
27	605089	味知香	38,800	3,376,376.00	0.79
28	300979	華利集團	22,100	2,517,190.00	0.59
29	603517	絕味食品	25,865	2,180,160.85	0.51
30	300957	貝泰妮	7,717	2,092,350.32	0.49
31	600779	水井坊	16,400	2,072,140.00	0.49
32	603877	太平鳥	21,000	1,120,980.00	0.26
33	688690	納微科技	3,477	408,547.50	0.10
34	688696	極米科技	429	334,722.96	0.08
35	002607	中公教育	9,540	199,290.60	0.05
36	688630	芯碁微裝	3,397	198,452.74	0.05
37	688269	凱立新材	1,941	195,885.72	0.05
38	605499	東鵬飲料	632	158,505.60	0.04
39	300999	金龍魚	1,439	122,257.44	0.03
40	688700	東威科技	3,049	117,264.54	0.03
41	688628	優利德	2,789	90,977.18	0.02
42	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.02
43	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.01
44	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
45	688585	上緯新材	4,922	52,173.20	0.01
46	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.01
47	300919	中偉股份	247	40,261.00	0.01
48	601528	瑞豐銀行	2,230	34,721.10	0.01
49	301021	英諾雷射	2,899	27,424.54	0.01
50	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.01
51	300900	廣聯航空	615	22,988.70	0.01
52	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.01
53	300911	億田智能	309	21,407.52	0.01
54	001206	依依股份	321	20,389.92	0.00
55	300941	創識科技	399	19,926.06	0.00
56	301015	百洋醫藥	462	17,939.46	0.00
57	300973	立高食品	150	17,356.50	0.00
58	300884	狄耐克	644	17,310.72	0.00
59	688226	威騰電氣	2,693	17,289.06	0.00
60	300932	三友聯眾	492	15,601.32	0.00
61	300982	蘇文電能	317	14,356.93	0.00
62	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
63	001208	華菱線纜	1,754	13,558.42	0.00
64	300940	南極光	307	13,317.66	0.00
65	300614	百川暢銀	329	13,285.02	0.00
66	300937	藥易購	244	13,105.24	0.00

67	301013	利和興	471	12,768.81	0.00
68	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
69	603171	稅友股份	637	12,230.40	0.00
70	300997	歡樂家	928	12,110.40	0.00
71	300909	匯創達	275	11,852.50	0.00
72	300892	品渥食品	256	11,745.28	0.00
73	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
74	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
75	300918	南山智尚	1,063	11,065.83	0.00
76	300981	中紅醫療	121	10,937.19	0.00
77	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
78	300996	普聯軟體	241	10,177.43	0.00
79	300917	特發服務	365	10,095.90	0.00
80	300922	天秦裝備	287	9,996.21	0.00
81	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
82	300962	中金輻照	576	9,429.12	0.00
83	300952	恒輝安防	340	9,207.20	0.00
84	301016	雷爾偉	275	9,069.50	0.00
85	300966	共同藥業	286	9,020.44	0.00
86	300945	曼卡龍	474	8,949.12	0.00
87	300961	深水海納	394	8,695.58	0.00
88	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
89	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
90	300958	建工修複	300	8,166.00	0.00
91	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
92	300978	東箭科技	593	8,064.80	0.00
93	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
94	300993	玉馬遮陽	410	7,908.90	0.00
95	300971	博亞精工	245	6,931.05	0.00
96	300991	創益通	254	6,733.54	0.00
97	300927	江天化學	217	6,531.70	0.00
98	300975	商絡電子	492	6,410.76	0.00
99	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
100	301011	華立科技	175	5,922.00	0.00
101	300943	春暉智控	255	5,867.55	0.00
102	300967	曉鳴股份	507	5,850.78	0.00
103	300929	華驕環保	183	5,407.65	0.00
104	300960	通業科技	234	5,396.04	0.00
105	605011	杭州熱電	525	4,662.00	0.00
106	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
107	301007	德邁仕	303	4,375.32	0.00
108	300998	寧波方正	201	4,285.32	0.00

109	301012	揚電科技	170	4,124.20	0.00
110	300992	泰福泵業	200	4,064.00	0.00
111	301010	晶雪節能	218	3,838.98	0.00

7.4 報告期內股票投資組合的重大變動

7.4.1 累計買入金額超出期初基金資產淨值 2%或前 20 名的股票明細

金額單位：人民幣元

序號	股票代碼	股票名稱	本期累計買入金額	佔期初基金資產淨值比例(%)
1	000568	瀘州老窖	39,183,951.01	10.17
2	000661	長春高新	28,232,527.00	7.33
3	300896	愛美客	20,116,503.76	5.22
4	002612	朗姿股份	15,900,158.00	4.13
5	002311	海大集團	15,373,982.40	3.99
6	600809	山西汾酒	14,091,189.70	3.66
7	601966	玲瓏輪胎	13,937,920.50	3.62
8	603020	愛普股份	13,193,225.00	3.42
9	600887	伊利股份	11,968,647.00	3.11
10	601058	賽輪輪胎	11,769,471.17	3.06
11	600079	人福醫藥	11,681,285.00	3.03
12	603392	萬泰生物	11,318,299.30	2.94
13	603187	海容冷鏈	10,651,782.56	2.77
14	300871	回盛生物	10,334,483.50	2.68
15	603816	顧家家居	10,089,633.55	2.62
16	300357	我武生物	9,835,377.55	2.55
17	603345	安井食品	9,655,856.00	2.51
18	600872	中炬高新	8,946,312.00	2.32
19	603369	今世緣	8,777,399.00	2.28
20	300122	智飛生物	8,650,888.00	2.25
21	300363	博騰股份	8,625,366.00	2.24
22	600882	妙可藍多	8,599,529.00	2.23

註：本項中“本期累計買入金額”按買入成交金額（成交單價乘以成交數量）填列，不考慮相關交易費用。

7.4.2 累計賣出金額超出期初基金資產淨值 2%或前 20 名的股票明細

金額單位：人民幣元

序號	股票代碼	股票名稱	本期累計賣出金額	佔期初基金資產淨值比例(%)
1	000661	長春高新	24,651,482.40	6.40
2	000860	順鑫農業	23,182,921.84	6.02
3	002612	朗姿股份	15,759,601.00	4.09
4	002624	完美世界	14,761,723.00	3.83
5	600276	恒瑞醫藥	14,487,145.91	3.76
6	603369	今世緣	14,407,019.00	3.74

7	600809	山西汾酒	14,217,493.88	3.69
8	601888	中國中免	13,889,610.00	3.61
9	002475	立訊精密	12,273,242.46	3.19
10	601966	玲瓏輪胎	12,198,957.67	3.17
11	002821	凱萊英	11,747,188.00	3.05
12	601058	賽輪輪胎	11,619,722.04	3.02
13	603517	絕味食品	10,969,310.55	2.85
14	300015	愛爾眼科	10,684,747.99	2.77
15	600305	恒順醋業	9,943,809.26	2.58
16	600872	中炬高新	9,520,111.00	2.47
17	300896	愛美客	8,874,372.48	2.30
18	600079	人福醫藥	8,763,913.93	2.28
19	300973	立高食品	8,487,736.83	2.20
20	600885	宏發股份	8,327,870.02	2.16
21	300760	邁瑞醫療	8,148,471.00	2.12
22	300122	智飛生物	8,079,624.58	2.10
23	688029	南微醫學	7,811,705.46	2.03

註：本項中“本期累計賣出金額”按賣出成交金額（成交單價乘以成交數量）填列，不考慮相關交易費用。

7.4.3 買入股票的成本總額及賣出股票的收入總額

單位：人民幣元

買入股票成本（成交）總額	457,111,453.97
賣出股票收入（成交）總額	452,439,777.88

註：本項中“買入股票的成本(成交)總額”及“賣出股票的收入(成交)總額”均按買賣成交金額（成交單價乘以成交數量）填列，不考慮相關交易費用。

7.5 期末按債券品種分類的債券投資組合

無。

7.6 期末按公允價值佔基金資產淨值比例大小排序的前五名債券投資明細

無。

7.7 期末按公允價值佔基金資產淨值比例大小排序的所有資產支援證券投資明細

無。

7.8 報告期末按公允價值佔基金資產淨值比例大小排序的前五名貴金屬投資明細

無。

7.9 期末按公允價值佔基金資產淨值比例大小排序的前五名權證投資明細

本基金本報告期末未持有權證。

7.10 報告期末本基金投資的股指期貨交易情況說明

無。

7.11 報告期末本基金投資的國債期貨交易情況說明

無。

7.12 投資組合報告附註

7.12.1 基金投資的前十名證券的發行主體本期是否出現被監管部門立案調查，或在報告編製日前一年內受到公開譴責、處罰的情形

本基金投資的前十名證券的發行主體本期未出現被監管部門立案調查，或在報告編製日前一年內受到公開譴責、處罰的情形。

7.12.2 基金投資的前十名股票是否超出基金合同規定的備選股票庫

本基金投資的前十名股票未超出基金合同規定的備選股票庫

7.12.3 期末其他各項資產構成

單位：人民幣元

序號	名稱	金額
1	存出保證金	66,369.89
2	應收證券清算款	8,109,020.75
3	應收股利	—
4	應收利息	4,652.97
5	應收申購款	158,826.28
6	其他應收款	—
7	待攤費用	—
8	其他	—
9	合計	8,338,869.89

7.12.4 期末持有的處於转股期的可轉換債券明細

無。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情況的說明

無。

7.12.6 投資組合報告附註的其他文字描述部分

由於四捨五入原因，分項之和與合計可能有尾差。

§ 8 基金份額持有人資訊

8.1 期末基金份額持有人戶數及持有人結構

份額單位：份

份額級別	持有人戶數（戶）	戶均持有的基金份額	持有人結構			
			機構投資者		個人投資者	
			持有份額	佔總份額比例（%）	持有份額	佔總份額比例（%）
大成內需增長混合 A	15,298	4,148.16	4,568,711.44	7.20	58,889,912.03	92.80
大成內需增長混合 H	11	1,480,561.45	16,286,175.90	100.00	—	—
合計	15,309	5,209.01	20,854,887.34	26.15	58,889,912.03	73.85

註：1、上述機構/個人投資者持有份額佔總份額比例的計算中，對分級份額，比例的分母採用各自級別的份額，對合計數，比例的分母採用下屬分級基金份額的合計數（即期末基金份額總額）。

2、持有人戶數為有效戶數，即存量份額大於零的賬戶。

8.2 期末基金管理人的從業人員持有本基金的情況

項目	份額級別	持有份額總數（份）	佔基金總份額比例（%）
基金管理人所有從業人員持有本基金	大成內需增長混合 A	7,132.83	0.0112
	大成內需增長混合 H	0.00	0.0000
	合計	7,132.83	0.0089

註：上述佔基金總份額比例的計算中，對分級份額，比例的分母採用各自級別的份額，對合計數，比例的分母採用下屬分級基金份額的合計數（即期末基金份額總額）。

8.3 期末基金管理人的從業人員持有本開放式基金份額總量區間情況

項目	份額級別	持有基金份額總量的數量區間（萬份）
本公司高級管理人員、基金投資和研究部門負責人持有本開放式基金	大成內需增長混合 A	0~10
	大成內需增長混合 H	0
	合計	0~10
本基金基金經理持有本開放式基金	大成內需增長混合 A	0
	大成內需增長混合 H	0
	合計	0

§ 9 開放式基金份額變動

單位：份

項目	大成內需增長混合 A	大成內需增長混合 H
基金合同生效日 （2011 年 6 月 14 日） 基金份額總額	1,429,930,353.67	—
本報告期期初基金份額總額	66,238,693.76	9,223,431.57
本報告期基金總申購份額	15,646,558.85	14,712,053.92
減：本報告期基金總贖回份額	18,426,629.14	7,649,309.59
本報告期基金拆分變動份額（份額減少以“-”填列）	—	—
本報告期期末基金份額	63,458,623.47	16,286,175.90

額總額

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份額持有人大會決議

報告期內無基金份額持有人大會決議。

10.2 基金管理人、基金託管人的專門基金託管部門的重大人事變動

一、基金管理人的重大人事變動

基金管理人報告期內無重大人事變動。

二、基金託管人的基金託管部門的重大人事變動

本報告期內，無涉及本基金託管人的專門基金託管部門的重大人事變動。

10.3 涉及基金管理人、基金財產、基金託管業務的訴訟

本報告期內沒有涉及本基金管理人、基金財產、基金託管業務的訴訟事項。

10.4 基金投資策略的改變

基金投資策略在本報告期內沒有重大改變。

10.5 為基金進行審計的會計師事務所情況

本基金聘任的為本基金審計的會計師事務所為普華永道中天會計師事務所(特殊普通合夥)，該事務所自基金合同生效日起為本基金提供審計服務至今。

10.6 管理人、託管人及其高級管理人員受稽查或處罰等情況

本報告期內，基金管理人、託管人的託管業務部門及其相關高級管理人員無受稽查或處罰等情況。

10.7 基金租用證券公司交易單元的有關情況

10.7.1 基金租用證券公司交易單元進行股票投資及備金支付情況

金額單位：人民幣元

券商名稱	交易單元數量	股票交易		應支付該券商的備金		備註
		成交金額	佔當期股票成交總額的比例	備金	佔當期備金總量的比例	
摩根大通	1	167,991,137.58	18.61%	153,091.13	18.61%	—
中金財富	2	166,531,270.66	18.45%	151,754.16	18.45%	—
華泰證券	2	116,177,499.42	12.87%	105,876.09	12.87%	—

光大證券	2	107,567,663.25	11.92%	98,025.77	11.92%	—
長江證券	2	94,213,599.30	10.44%	85,860.72	10.44%	—
萬聯證券	1	74,251,796.53	8.23%	67,673.01	8.23%	—
渤海證券	1	73,841,688.66	8.18%	67,292.08	8.18%	—
申萬宏源	1	61,648,599.04	6.83%	56,182.13	6.83%	—
安信證券	2	40,489,173.23	4.49%	36,893.17	4.48%	—
財信證券	1	—	—	—	—	—
長城證券	1	—	—	—	—	—
東方證券	1	—	—	—	—	—
東海證券	1	—	—	—	—	—
東吳證券	1	—	—	—	—	—
東興證券	1	—	—	—	—	—
東莞證券	1	—	—	—	—	—
方正證券	1	—	—	—	—	—
廣發證券	1	—	—	—	—	—
廣州證券	1	—	—	—	—	—
國都證券	1	—	—	—	—	—
國海證券	1	—	—	—	—	—
國泰君安	1	—	—	—	—	—
國信證券	1	—	—	—	—	—
海通證券	2	—	—	—	—	—
恒泰證券	1	—	—	—	—	—
華寶證券	1	—	—	—	—	—
華福證券	1	—	—	—	—	—
華林證券	1	—	—	—	—	—
華西證券	1	—	—	—	—	—
華鑫證券	1	—	—	—	—	—
江海證券	1	—	—	—	—	—
開源證券	1	—	—	—	—	—

民生證券	1	-	-	-	-	-
平安證券	1	-	-	-	-	-
太平洋證券	1	-	-	-	-	-
西南證券	1	-	-	-	-	-
湘財證券	1	-	-	-	-	-
招商證券	3	-	-	-	-	-
中國銀河證券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中信建投證券	1	-	-	-	-	-
中信證券	2	-	-	-	-	-

註：根據中國證監會頒布的《關於完善證券投資基金交易席位制度有關問題的通知》（證監基金字[2007]48 號）的有關規定，本公司制定了租用證券公司交易單元的選擇標準和程序。租用證券公司交易單元的選擇標準主要包括：（一）財務狀況良好，最近一年無重大違規行為；（二）經營行為規範，內控制度健全，能滿足各投資組合運作的保密性要求；（三）研究實力較強，能提供包括研究報告、路演服務、協助進行上市公司調研等研究服務；（四）具備各投資組合運作所需的高效、安全的通訊條件，有足夠的交易和清算能力，滿足各投資組合證券交易需要；（五）能提供投資組合運作、管理所需的其他券商服務；（六）相關基金合同、資產管理合同以及法律法規規定的其他條件。租用證券公司交易單元的程序：首先根據租用證券公司交易單元的選擇標準形成《券商服務評價表》，然後根據評分高低進行選擇基金交易單元。本報告期內本基金租用證券公司交易單元的變更情況如下：本報告期內本基金新增交易單元：摩根大通。本報告期內本基金退租交易單元：中泰證券。

10.7.2 基金租用證券公司交易單元進行其他證券投資的情況

金額單位：人民幣元

券商名稱	債券交易		債券回購交易		權證交易	
	成交金額	佔當期債券成交總額的比例	成交金額	佔當期債券回購成交總額的比例	成交金額	佔當期權證成交總額的比例
光大證券	114,869.02	100.00%	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序號	公告事項	法定披露方式	法定披露日期
1	關於提請投資者及時更新已過期身份證件或者身份證明檔案的公告	中國證監會基金電子披露網站、規定報刊及本公司網站	2021 年 6 月 30 日
2	大成基金管理有限公司關於旗下部分基金增加海銀基金銷售有限公司為銷售機構的公告	中國證監會基金電子披露網站、規定報刊及本公司網站	2021 年 5 月 27 日
3	大成基金管理有限公司關於旗下部分基金增加寧波銀行股份有限公司為銷售機構的公告	中國證監會基金電子披露網站、規定報刊及本公司網站	2021 年 5 月 13 日
4	大成內需增長混合型證券投資基金 2021 年第 1 季度報告	中國證監會基金電子披露網站、規定報刊及本公司網站	2021 年 4 月 22 日
5	大成基金管理有限公司關於旗下部分基金增加江蘇銀行股份有限公司為銷售機構的公告	中國證監會基金電子披露網站、規定報刊及本公司網站	2021 年 4 月 12 日
6	大成內需增長混合型證券投資基金 2020 年年度報告	中國證監會基金電子披露網站、規定報刊及本公司網站	2021 年 3 月 30 日
7	大成基金管理有限公司提醒投資者謹防金融詐騙的公告	中國證監會基金電子披露網站、規定報刊及本公司網站	2021 年 3 月 23 日
8	大成基金管理有限公司關於旗下部分基金增加鼎信匯金（北京）投資管理有限公司為銷售機構的公告	中國證監會基金電子披露網站、規定報刊及本公司網站	2021 年 3 月 11 日
9	大成內需增長混合型證券投資基金第四季度報告	中國證監會基金電子披露網站、規定報刊及本公司網站	2021 年 1 月 22 日

§ 11 影響投資者決策的其他重要資訊

11.1 報告期內單一投資者持有基金份額比例達到或超過 20%的情況

無。

11.2 影響投資者決策的其他重要資訊

無。

§ 12 備查檔案目錄

12.1 備查檔案目錄

- 1、中國證監會批准設立大成內需增長混合型證券投資基金的檔案；

- 2、《大成內需增長混合型證券投資基金基金合同》；
- 3、《大成內需增長混合型證券投資基金託管協議》；
- 4、大成基金管理有限公司批准檔案、營業執照、公司章程；
- 5、本報告期內在規定報刊上披露的各種公告原稿。
- 6、《大成內需增長股票型證券投資基金變更基金名稱、基金類別以及修訂基金合同部分條款的公告》。

12.2 存放地點

備查檔案存放在本基金管理人和託管人的住所。

12.3 查閱方式

投資者可在營業時間免費查閱，或登錄本基金管理人網站 <http://www.dcfund.com.cn> 進行查閱。

大成基金管理有限公司

2021 年 8 月 31 日

§ 13 补充披露(只供香港派發)

13.1 补充披露 1：期末基金资产组合情况

名稱	數量（股）	公允價值（人民幣元）
（1）股票投資		
上市投資		
中國（100%）		
貴州茅臺	17,900	36,814,930.00
五糧液	113,700	33,870,093.00
瀘州老窖	125,113	29,519,161.22
中國中免	87,200	26,168,720.00
邁瑞醫療	52,302	25,107,575.10
愛美客	27,655	21,816,476.40
人福醫藥	596,400	16,860,228.00
美的集團	233,300	16,650,621.00
萬泰生物	56,395	14,616,456.10
伊利股份	308,700	11,369,421.00
海容冷鏈	257,040	11,021,875.20
安井食品	41,100	10,440,222.00
回盛生物	235,750	9,194,250.00
傳音控股	42,759	8,958,010.50
海大集團	107,800	8,796,480.00
博騰股份	104,200	8,765,304.00
顧家家居	103,800	8,021,664.00
我武生物	123,200	7,899,584.00
青島啤酒	66,100	7,644,465.00
愛普股份	389,200	7,266,364.00
錦泓集團	271,900	6,710,492.00
喜臨門	164,000	5,413,640.00
妙可藍多	71,100	4,962,780.00
錦江酒店	84,700	4,823,665.00
朗姿股份	84,200	4,548,484.00
寧德時代	7,900	4,224,920.00
味知香	38,800	3,376,376.00
華利集團	22,100	2,517,190.00
絕味食品	25,865	2,180,160.85
貝泰妮	7,717	2,092,350.32
水井坊	16,400	2,072,140.00
太平鳥	21,000	1,120,980.00

納微科技	3,477	408,547.50
極米科技	429	334,722.96
中公教育	9,540	199,290.60
芯碁微裝	3,397	198,452.74
凱立新材	1,941	195,885.72
東鵬飲料	632	158,505.60
金龍魚	1,439	122,257.44
東威科技	3,049	117,264.54
優利德	2,789	90,977.18
利元亨	2,149	83,488.65
航宇科技	4,926	56,550.48
英科再生	2,469	54,219.24
上緯新材	4,922	52,173.20
密封科技	4,210	44,794.40
中偉股份	247	40,261.00
瑞豐銀行	2,230	34,721.10
英諾鐳射	2,899	27,424.54
震裕科技	240	23,964.00
廣聯航空	615	22,988.70
可靠股份	801	22,339.89
億田智能	309	21,407.52
依依股份	321	20,389.92
創識科技	399	19,926.06
百洋醫藥	462	17,939.46
立高食品	150	17,356.50
狄耐克	644	17,310.72
威騰電氣	2,693	17,289.06
三友聯眾	492	15,601.32
蘇文電能	317	14,356.93
格林精密	1,162	14,025.34
華菱線纜	1,754	13,558.42
南極光	307	13,317.66
百川暢銀	329	13,285.02
藥易購	244	13,105.24
利和興	471	12,768.81
易瑞生物	443	12,634.36
稅友股份	637	12,230.40
歡樂家	928	12,110.40
匯創達	275	11,852.50
品渥食品	256	11,745.28
中辰股份	1,112	11,609.28
崧盛股份	201	11,581.62

南山智尚	1, 063	11, 065. 83
中紅醫療	121	10, 937. 19
嘉亨家化	232	10, 688. 24
普聯軟體	241	10, 177. 43
特發服務	365	10, 095. 90
天秦裝備	287	9, 996. 21
英力股份	371	9, 571. 80
中金輻照	576	9, 429. 12
恒輝安防	340	9, 207. 20
雷爾偉	275	9, 069. 50
共同藥業	286	9, 020. 44
曼卡龍	474	8, 949. 12
深水海納	394	8, 695. 58
德固特	219	8, 569. 47
新中港	1, 377	8, 358. 39
建工修復	300	8, 166. 00
志特新材	264	8, 070. 48
東箭科技	593	8, 064. 80
博俊科技	359	7, 969. 80
玉馬遮陽	410	7, 908. 90
博亞精工	245	6, 931. 05
創益通	254	6, 733. 54
江天化學	217	6, 531. 70
商絡電子	492	6, 410. 76
中洲特材	283	6, 364. 67
華立科技	175	5, 922. 00
春暉智控	255	5, 867. 55
曉鳴股份	507	5, 850. 78
華驕環保	183	5, 407. 65
通業科技	234	5, 396. 04
杭州熱電	525	4, 662. 00
奇德新材	191	4, 454. 12
德邁仕	303	4, 375. 32
寧波方正	201	4, 285. 32
揚電科技	170	4, 124. 20
泰福泵業	200	4, 064. 00
晶雪節能	218	3, 838. 98
合計	3, 984, 803	367, 734, 541. 07
(2) 債券投資		
合計		0
(3) 買入返售金融資產		

交易所市場買入返售金融資產		0
銀行間市場買入返售金融資產		0
合計		0
總投資資產		367,734,541.07
銀行存款和結算備付金合計		53,205,226.61
其他各項資產		8,272,500.00
合計		429,212,267.68

13.2 补充披露 2：投資組合變動表

序號	項目	佔基金總資產的比例 (%) 2021 年 06 月 30 日	佔基金總資產的比例 (%) 2020 年 12 月 31 日
1	股票	86.22	83.53
2	債券	0.00	0.00
3	買入返售金融資產	0.00	0.00