

# 大成內需增長混合型證券投資基金

## 2021 年年度報告

2021 年 12 月 31 日

此（等）報告並不構成購買組成本檔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（如有）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，本經審核年度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：2022 年 3 月 29 日

大成內需增長混合型證券投資基金（“本基金”）

2021 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本基金的招募說明書及其更新。

本基金只有 H 類別份額可供香港投資者認購。

大成國際資產管理有限公司

香港代表

二〇二二年三月二十九日

## § 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。本年度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 2022 年 03 月 28 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。

本報告財務資料已經審計。普華永道中天會計師事務所(特殊普通合夥)為本基金出具了無保留意見的審計報告，請投資者注意閱讀。

本報告期自 2021 年 01 月 01 日起至 12 月 31 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、基金淨值表現及利潤分配情況	7
3.1 主要會計數據和財務指標	7
3.2 基金淨值表現	9
3.3 過去三年基金的利潤分配情況	12
§ 4 管理人報告	12
4.1 基金管理人及基金經理情況	12
4.2 管理人對報告期內本基金運作遵規守信情況的說明	15
4.3 管理人對報告期內公平交易情況的專項說明	16
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	16
4.5 管理人對宏觀經濟、證券市場及行業走勢的簡要展望	17
4.6 管理人內部有關本基金的監察稽核工作情況	18
4.7 管理人對報告期內基金估值程序等事項的說明	19
4.8 管理人對報告期內基金利潤分配情況的說明	20
4.9 管理人對會計師事務所出具非標準審計報告所涉相關事項的說明	20
4.10 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	20
§ 5 託管人報告	20
5.1 報告期內本基金託管人遵規守信情況聲明	20
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	20
5.3 託管人對本年度報告中財務資訊等內容的真實、準確和完整發表意見	20
§ 6 審計報告	20
§ 7 年度財務報表	22
7.1 資產負債表	22
7.2 利潤表	23
7.3 所有者權益（基金淨值）變動表	25
7.4 報表附註	26
§ 8 投資組合報告	51
8.1 期末基金資產組合情況	51

8.2 報告期末按行業分類的股票投資組合 .....	52
8.3 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 .....	53
8.4 報告期內股票投資組合的重大變動 .....	56
8.5 期末按債券品種分類的債券投資組合 .....	58
8.6 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 .....	59
8.7 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 .....	59
8.8 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 .....	59
8.9 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 .....	59
8.10 報告期末本基金投資的股指期貨交易情況說明 .....	59
8.11 報告期末本基金投資的國債期貨交易情況說明 .....	59
8.12 投資組合報告附註 .....	59
<b>§ 9 基金份額持有人資訊 .....</b>	<b>60</b>
9.1 期末基金份額持有人戶數及持有人結構 .....	60
9.2 期末基金管理人的從業人員持有本基金的情況 .....	61
9.3 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 .....	61
9.4 期末兼任私募資產管理計畫投資經理的基金經理本人及其直系親屬持有本人管理的產品情況 .....	61
<b>§ 10 開放式基金份額變動 .....</b>	<b>61</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>62</b>
11.1 基金份額持有人大會決議 .....	62
11.2 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 .....	62
11.3 涉及基金管理人、基金財產、基金託管業務的訴訟 .....	62
11.4 基金投資策略的改變 .....	62
11.5 為基金進行審計的會計師事務所情況 .....	62
11.6 管理人、託管人及其高級管理人員受稽查或處罰等情況 .....	63
11.7 基金租用證券公司交易單元的有關情況 .....	63
11.8 其他重大事件 .....	65
<b>§ 12 影響投資者決策的其他重要資訊 .....</b>	<b>66</b>
12.1 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 .....	66
12.2 影響投資者決策的其他重要資訊 .....	66
<b>§ 13 備查檔案目錄 .....</b>	<b>67</b>
13.1 備查檔案目錄 .....	67
13.2 存放地點 .....	67
13.3 查閱方式 .....	67
<b>§ 14 補充披露(只供香港派發) .....</b>	<b>67</b>
14.1 補充披露 1: 期末基金資產組合情況 .....	67
14.2 補充披露 2: 投資組合變動表 .....	71

## § 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	68,083,232.51 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	55,492,658.28 份	12,590,574.23 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	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。
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	010-66596688
	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》
登載基金年度報告正文的管理人互聯網網址	www.dcfund.com.cn
基金年度報告備置地點	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
會計師事務所	普華永道中天會計師事務所 (特殊普通合夥)	上海市浦東新區東育路 588 號前灘中心 42 樓
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、基金淨值表現及利潤分配情況

### 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	2021 年		2020 年		2019 年	
	大成內需增長混合 A	大成內需增長混合 H	大成內需增長混合 A	大成內需增長混合 H	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	57,845,816.06	14,683,009.55	69,797,524.17	2,272,638.90	121,329,280.80	628,691.42
本期利潤	-11,720,175.04	-5,623,999.39	156,984,489.03	7,787,044.55	147,389,002.87	743,493.57
加權平均基金份額	-0.1933	-0.3766	1.9184	2.3396	1.0423	0.9841

本期利潤						
本期加權平均淨值利潤率	-3.89%	-7.55%	50.66%	55.33%	40.74%	38.41%
本期基金份額淨值增長率	-2.90%	-2.90%	66.07%	66.04%	49.01%	49.01%
3.1.2 期末數據和指標	2021 年末		2020 年末		2019 年末	
期末可供分配利潤	194,140,059.70	44,032,706.87	169,533,500.70	23,602,446.62	203,763,079.11	972,801.13
期末可供分配基金份額利潤	3.4985	3.4973	2.5594	2.5590	1.7091	1.7096
期末基金資產淨值	275,085,306.81	62,399,551.95	338,128,364.38	47,077,575.32	366,438,766.74	1,749,228.97
期末基金份額淨值	4.957	4.956	5.105	5.104	3.074	3.074
3.1.3 累計期末指標	2021 年末		2020 年末		2019 年末	
基金份額累計	395.70%	148.55%	410.50%	155.97%	207.40%	54.16%



淨值 增長 率						
---------------	--	--	--	--	--	--

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

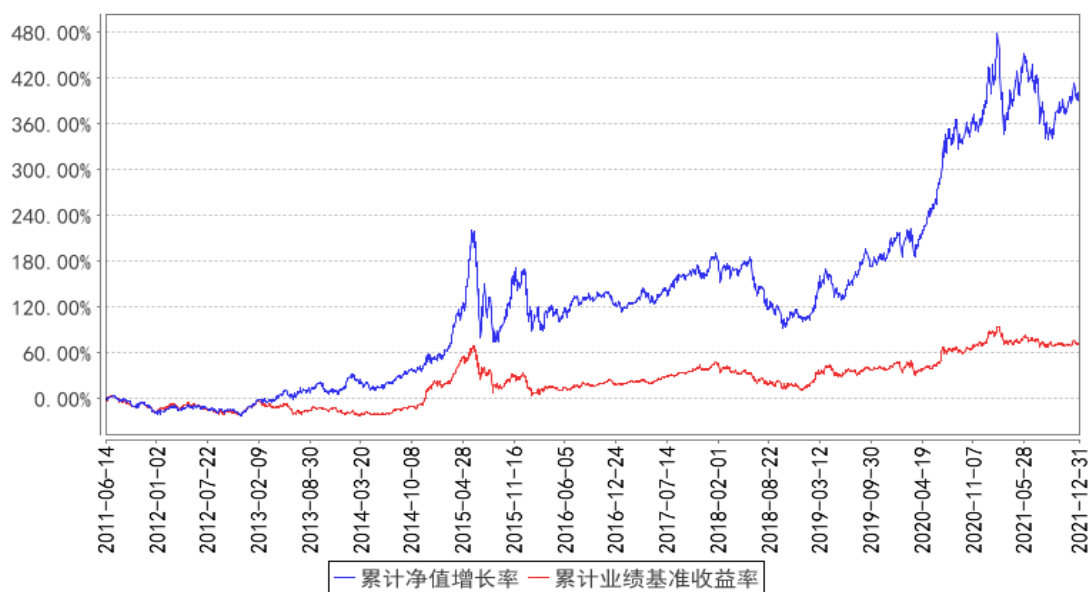
階段	份額淨值增長率①	份額淨值增長率標準差②	業績比較基準收益率③	業績比較基準收益率標準差④	①－③	②－④
過去三個月	4.42%	1.03%	1.50%	0.63%	2.92%	0.40%
過去六個月	-7.33%	1.48%	-3.70%	0.82%	-3.63%	0.66%
過去一年	-2.90%	1.62%	-2.94%	0.94%	0.04%	0.68%
過去三年	140.28%	1.47%	53.94%	1.03%	86.34%	0.44%
過去五年	122.39%	1.37%	45.67%	0.96%	76.72%	0.41%
自基金合同生效起至今	395.70%	1.60%	73.03%	1.14%	322.67%	0.46%

大成內需增長混合 H

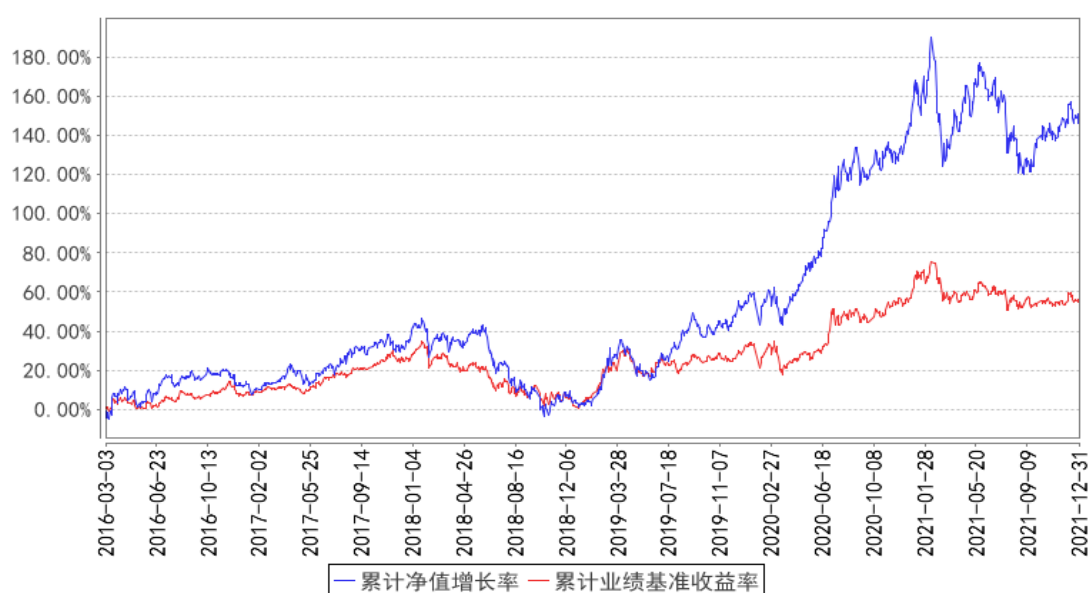
階段	份額淨值增長率①	份額淨值增長率標準差②	業績比較基準收益率③	業績比較基準收益率標準差④	①－③	②－④
過去三個月	4.45%	1.03%	1.50%	0.63%	2.95%	0.40%
過去六個月	-7.31%	1.48%	-3.70%	0.82%	-3.61%	0.66%
過去一年	-2.90%	1.62%	-2.94%	0.94%	0.04%	0.68%
過去三年	140.23%	1.47%	53.94%	1.03%	86.29%	0.44%
過去五年	122.24%	1.37%	45.67%	0.96%	76.57%	0.41%
自基金合同生效起至今	148.55%	1.36%	56.14%	0.93%	92.41%	0.43%

### 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

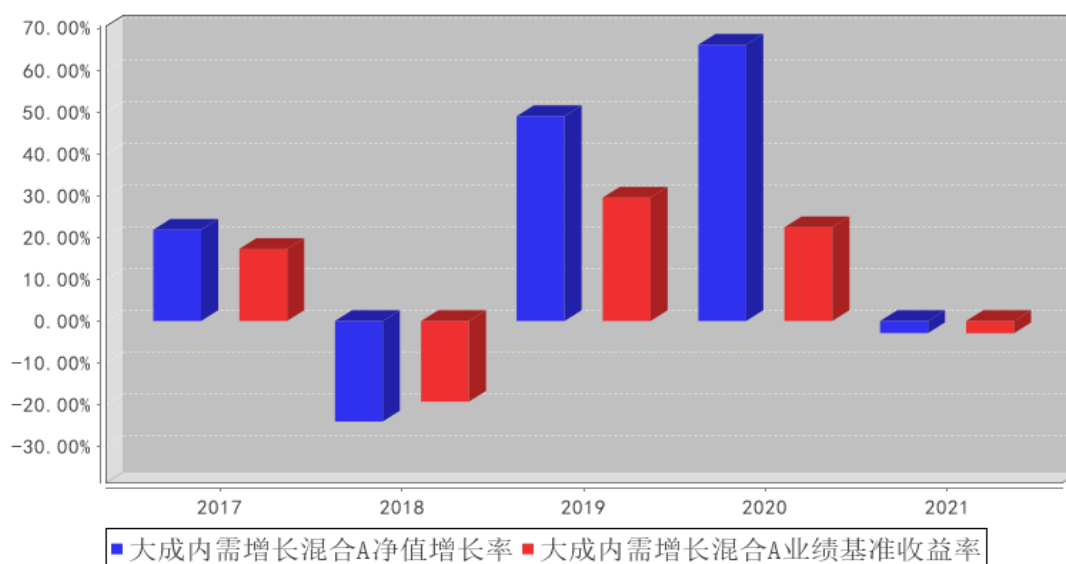


註：1、本基金合同規定，基金管理人應當自基金合同生效之日起六個月內使基金的投資組合比例符合基金合同的約定。建倉期結束時，本基金的投資組合比例符合基金合同的約定。

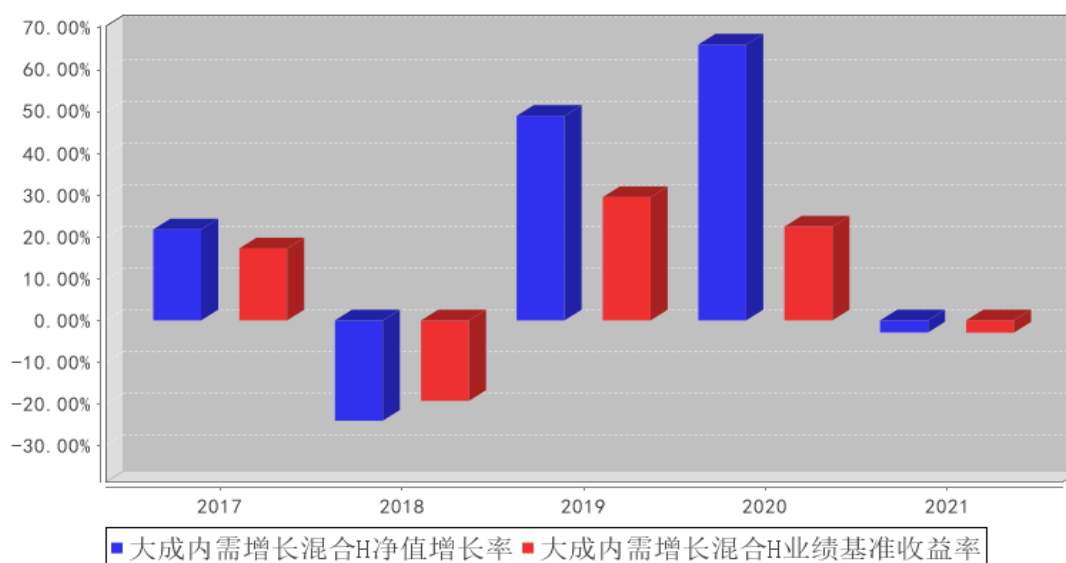
2、本基金於 2015 年 7 月 2 日基金名稱由“大成內需增長股票型證券投資基金”變更為“大成內需增長混合型證券投資基金”。

### 3.2.3 過去五年基金每年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基金每年淨值增長率與同期業績比較基準收益率的對比圖



大成內需增長混合H基金每年淨值增長率與同期業績比較基準收益率的對比圖



註：合同生效當年按實際存續期計算，不按整個自然年度進行折算

### 3.3 過去三年基金的利潤分配情況

本基金過去三年未進行利潤分配

## § 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，註冊資本為2億元人民幣，註冊地為深圳。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%)。公司業務資質齊全，是全國同時具有境內、境外社保基金管理人資格和基本養老保險基金管理人資格的四家基金公司之一，全面涵蓋公募基金、機構投資、海外投資、財富管理、養老金管理、私募股權投資等業務，旗下大成國際資產管理公司具備QFII、RQFII等資格。

歷經22年的發展，大成基金形成了以長期投資能力為核心競爭優勢，打造了一支具有良好職業素養和豐富經驗的資產管理隊伍。目前已形成權益、固定收益、量化投資、商品期貨、境外投資、大類資產配置等六大投資團隊，全面覆蓋各類投資領域。

#### 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	<p>上海交通大學經濟學碩士。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。2021 年 12 月 10 日起任大成悅享生活混合型證券投資基金基金經理。具有基金從業資格。國籍：中國</p>
孫丹	本基金基金經理助理	2020 年 7 月 6 日	-	13 年	<p>美國德克薩斯 A&amp;M 大學經濟學碩士。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、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</p>

					<p>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基金經理助理。2021 年 4 月 19 日至 2021 年 8 月 4 日任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、大成景興信用債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</p>
--	--	--	--	--	---

					<p>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 生命周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 日至 2021 年 11 月 26 日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。具有基金從業資格。國籍：中國</p>
--	--	--	--	--	--

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

#### 4.1.4 基金經理薪酬機制

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 公平交易制度和控制方法

根據《證券投資基金管理公司公平交易制度指導意見》的規定，公司制訂了《大成基金管理有限公司公平交易制度》、《大成基金管理有限公司異常交易監控與報告制度》。公司旗下投資組合嚴格按照制度的規定，參與股票、債券的一級市場申購、二級市場交易等投資管理活動，內容包括授權、研究分析、投資決策、交易執行、業績評估等與投資管理活動相關的各個環節。研究部負責提供投資研究支援，投資部門負責投資決策，交易管理部負責實施交易並即時監控，監察稽核部負責事前監督、事中檢查和事後稽核，風險管理部負責對交易情況進行合理性分析，通過多部門的協作互控，保證了公平交易的可操作、可稽核和可持續。

### 4.3.2 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，針對同一基金經理管理的多個投資組合及公私募兼任基金經理管理的多個投資組合的投資交易行為加強了公平交易監測與分析，包括對不同時間窗下（同日、3 日、5 日、10 日）反向交易和同向交易價差監控的分析。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投資策略差異、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价格差異較大，同時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。

#### 4.3.2.1 增加執行的基金經理公平交易制度執行情況及公平交易管理情況

無。

### 4.3.3 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存在 4 筆同日反向交易，原因為流動性需要或合規比例調整。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 11 筆同日反向交易，原因為流動性需要或合規比例調整。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

在疫情反覆影響下，2021 年經濟環境並不好，股票市場行業間的分化極大，新能源、周期等



行業上漲幅度超過 50%，而前兩年漲幅過大的大消費、醫藥行業則出現了 10% 左右的下跌，行業間出現了超過 50% 收益率的差距。

新能源行業的上漲一部分歸功於基本面（基本面確實很強勁，電動車滲透率進一步提升，風光已步入平價階段），另外一部分則是情緒；周期行業的大幅上漲一部分來自估值修復（此前估值確實較低），一部分來自上遊價格的大幅上漲。大消費和醫藥為何出現了一定回調？回調處於意料之中，大消費行業經過 3-4 年的上漲，估值已經較高，定價已經極為充分，難以找到低估的資產；醫藥行業除了估值高以外，還面臨醫保控費的巨大壓力，醫保控費將長期成為醫藥行業的核心影響因素。

本基金 2021 年主要投資於大消費和醫藥行業，聚焦於高端白酒、免稅等大消費資產和部分醫藥資產，堅持自下而上精選個股，經歷了較大波動，部分重倉公司受到疫情反覆影響有所下跌，本基金較少投資於新能源和周期行業。

#### 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 4.957 元，本報告期基金份額淨值增長率為-2.90%，同期業績比較基準收益率為-2.94%；截至本報告期末大成內需增長混合 H 的基金份額淨值為 4.956 元，本報告期基金份額淨值增長率為-2.90%，同期業績比較基準收益率為-2.94%。

#### 4.5 管理人對宏觀經濟、證券市場及行業走勢的簡要展望

2022 年股票市場行業間的表現會相對比較均衡，再次出現 2021 年行業間極大分化的機率很低。

作為 2021 年的強勢板塊，新能源板塊和周期板塊的大幅上漲很難說沒有情緒的因素，當然 2022 年新能源終端的基本面大機率繼續強勁，但產業鏈有諸多環節，每個環節所面臨的競爭格局和議價能力不盡相同，因此我認為會出現較大分化，競爭格局好的環節和增長的細分環節仍將產生牛股，而部分競爭格局不好或者產業鏈受損環節則需要迴避。

作為 2021 年回調的大消費和醫藥行業，雖然 21 年回調了 10% 左右，目前的估值算可以接受但仍然說不上特別便宜，尤其部分醫藥資產在面臨醫保控費下對未來的預期需要重新估計，因此我們在投資大消費的醫藥資產的市場仍然需要仔細計算下行風險和上行空間，盡量在具備估值性價比的時候買入。

長期而言，仍然看好大消費資產，源自人性底層的消費升級的慾望永遠不會消失，消費升級永遠存在，這是大消費行業持續發展的源動力，部分子行業具備較好的消費升級屬性，比如高端白酒、啤酒；部分子行業仍處於較快增長期，比如醫美、國潮服飾化妝品、食品工業化等；中短

期而言，大消費行業中部分子行業有很強的韌性，比如高端白酒；食品板塊相對於 2021 年的低基數，2022 年將有較好的增長；此外，豬周期值得重點關注。

醫藥行業估值仍然略偏高，在估值回歸合理水平之後，在充分評估醫保控費的影響之下可以挑選出一部分長期不錯的資產，老齡化依然是醫藥需求的最大影響因素，長期需求沒問題，只是需要充分評估醫保影響和估值水平。

本基金 2022 年除了繼續聚焦大消費和醫藥資產，還將擴大一部分範圍至新能源汽車及製造業，堅持自下而上精選個股，力求為持有人創造超額收益。

#### 4.6 管理人內部有關本基金的監察稽核工作情況

本報告期內，依據相關的法律法規、基金合同以及內部監察稽核制度，本基金管理人對本基金運作、內部管理、制度執行及遵規守法情況進行了監察稽核。內部監察稽核的重點是：國家法律法規及行業監管規則的執行情況；基金合同的遵守情況；內部規章制度的執行情況；資訊管制和保密工作落實情況；員工職業操守規範情況，目的是規範基金財產的運作，防範和控制投資風險，確保經營業務的穩健運行和受託資產的安全完整，維護本基金份額持有人的合法權益。

（一）根據最新的法律法規、規章、規範性檔案，本基金管理人及時制定了相應的公司制度，並對現有制度進行不斷修訂和完善，確保本基金管理人內控制度的適時性、全面性和合法合規性。同時，為保障制度的適時性，避免部分內控制度、業務規則與業務發展不相適應，報告期內本基金管理人組織各部門對內部管理制度作了進一步梳理和完善。

（二）全面加強風險監控，不斷提高基金業務風險管理水平。為督促各部門完善並落實各項內控措施，公司嚴格執行風險控制管理員制度，健全內控工作協調機制及監督機制，並進一步加強投資風險數量化評價能力及事前風險防範能力，有效防範相關業務風險。同時，公司嚴格執行投資報備制度，建立了基金從業人員證券投資管理監控資訊系統，將投資報備工作納入常態。

（三）日常監察和專項監察相結合，確保監察稽核的有效性和深入性。本年度，公司繼續對本基金銷售、宣傳等方面的材料、協議及其他法律資料等進行了嚴格審查，對本基金各項投資比例、投資許可權、基金交易、股票投資限制、股票庫維護等方面進行即時監察，同時，還專門針對基金投資交易（包括公平交易、轉債投資、投資許可權、投資比例、流動性風險、基金重倉股等）、基金運營（基金頭寸、基金結算、登記清算等）、網上交易、基金銷售等進行專項監察。通過日常監察，保證了公司監察的全面性、即時性，通過專項監察，及時發現並糾正了業務中的潛在風險，加強了業務部門和人員的風險意識，從而較好地預防了風險的發生。

（四）加強了對投資管理人員通訊工具在交易時間的集中管理，定期或不定期的對投資管理人員的網路即時通訊記錄、電話錄音等進行抽查，有效的防範了各種形式的利益輸送行為。

（五）以多種方式加強合規教育與培訓，提高全公司的合規守法意識。及時向全公司傳達與基金相關的法律法規，並要求公司各部門貫徹到日常工作中。公司監察稽核部通過解答各業務部門提出的法律問題，提供法律依據，對於較為重大疑難法律事項及時諮詢公司外部律師或監管部門，避免了業務發展中的盲目性，及時防範風險，維護了基金份額持有人的利益。

#### 4.7 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、權益專戶投資部、指數與期貨投資部、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、權益專戶投資部、指數與期貨投資部、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。

#### 4.8 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。

#### 4.9 管理人對會計師事務所出具非標準審計報告所涉相關事項的說明

無。

#### 4.10 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 託管人對本年度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 審計報告

審計報告標題	審計報告
審計報告收件人	大成內需增長混合型證券投資基金全體基金份額持有人
審計意見	（一）我們審計的內容 我們審計了大成內需增長混合型證券投資基金（以下簡

	<p>稱“大成內需增長混合基金”)的財務報表,包括2021年12月31日的資產負債表,2021年度的利潤表和所有者權益(基金淨值)變動表以及財務報表附註。</p> <p>(二)我們的意見</p> <p>我們認為,後附的財務報表在所有重大方面按照企業會計準則和在財務報表附註中所列示的中國證券監督管理委員會(以下簡稱“中國證監會”)、中國證券投資基金業協會(以下簡稱“中國基金業協會”)發布的有關規定及允許的基金行業實務操作編製,公允反映了大成內需增長混合基金2021年12月31日的財務狀況以及2021年度的經營成果和基金淨值變動情況。</p>
形成審計意見的基礎	<p>我們按照中國註冊會計師審計準則的規定執行了審計工作。審計報告的“註冊會計師對財務報表審計的責任”部分進一步闡述了我們在這些準則下的責任。我們相信,我們獲取的審計證據是充分、適當的,為發表審計意見提供了基礎。</p> <p>按照中國註冊會計師職業道德規則,我們獨立於大成內需增長混合基金,並履行了職業道德方面的其他責任。</p>
管理層和治理層對財務報表的責任	<p>大成內需增長混合基金的基金管理人大成基金管理有限公司(以下簡稱“基金管理人”)管理層負責按照企業會計準則和中國證監會、中國基金業協會發布的有關規定及允許的基金行業實務操作編製財務報表,使其實現公允反映,並設計、執行和維護必要的內部控制,以使財務報表不存在由於舞弊或錯誤導致的重大錯報。</p> <p>在編製財務報表時,基金管理人管理層負責評估大成內需增長混合基金的持續經營能力,披露與持續經營相關的事項(如適用),並運用持續經營假設,除非基金管理人管理層計劃清算大成內需增長混合基金、終止運營或別無其他現實的選擇。</p> <p>基金管理人治理層負責監督大成內需增長混合基金的財務報告過程。</p>
註冊會計師對財務報表審計的責任	<p>我們的目標是對財務報表整體是否不存在由於舞弊或錯誤導致的重大錯報獲取合理保證,並出具包含審計意見的審計報告。合理保證是高水平的保證,但並不能保證按照審計準則執行的審計在某一重大錯報存在時總能發現。錯報可能由於舞弊或錯誤導致,如果合理預期錯報單獨或匯總起來可能影響財務報表使用者依據財務報表作出的經濟決策,則通常認為錯報是重大的。</p> <p>在按照審計準則執行審計工作的過程中,我們運用職業判斷,並保持職業懷疑。同時,我們也執行以下工作:</p> <p>(一) 識別和評估由於舞弊或錯誤導致的財務報表重大錯報風險;設計和實施審計程序以應對這些風險,並獲取充分、適當的審計證據,作為發表審計意見的基礎。由於舞弊可能涉及串通、偽造、故意遺漏、虛假陳述或凌駕於內部控制之上,未能發現由於舞弊導致的重大錯報的風險高於未能發現由於錯誤導致的重大錯報的風險。</p>

	<p>(二) 了解與審計相關的內部控制，以設計恰當的審計程序，但目的並非對內部控制的有效性發表意見。</p> <p>(三) 評價基金管理人管理層選用會計政策的恰當性和作出會計估計及相關披露的合理性。</p> <p>(四) 對基金管理人管理層使用持續經營假設的恰當性得出結論。同時，根據獲取的審計證據，就可能導致對大成內需增長混合基金持續經營能力產生重大疑慮的事項或情況是否存在重大不確定性得出結論。如果我們得出結論認為存在重大不確定性，審計準則要求我們在審計報告中提請報表使用者注意財務報表中的相關披露；如果披露不充分，我們應當發表非無保留意見。我們的結論基於截至審計報告日可獲得的資訊。然而，未來的事項或情況可能導致大成內需增長混合基金不能持續經營。</p> <p>(五) 評價財務報表的總體列報(包括披露)、結構和內容，並評價財務報表是否公允反映相關交易和事項。</p> <p>我們與基金管理人治理層就計劃的審計範圍、時間安排和重大審計發現等事項進行溝通，包括溝通我們在審計中識別出的值得關注的內部控制缺陷。</p>	
會計師事務所的名稱	普華永道中天會計師事務所(特殊普通合夥)	
註冊會計師的姓名	張振波	趙鈺
會計師事務所的地址	上海市浦東新區東育路 588 號前灘中心 42 樓	
審計報告日期	2022 年 3 月 28 日	

## § 7 年度財務報表

### 7.1 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 12 月 31 日

單位：人民幣元

資 產	附註號	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>資 產：</b>			
銀行存款	7.4.7.1	47,492,999.03	39,676,198.32
結算備付金		411,574.89	152,859.63
存出保證金		60,103.84	51,352.92
交易性金融資產	7.4.7.2	296,929,673.34	344,455,852.02
其中：股票投資		296,916,712.34	344,333,886.40
基金投資		—	—
債券投資		12,961.00	121,965.62
資產支援證券投資		—	—
貴金屬投資		—	—
衍生金融資產	7.4.7.3	—	—
買入返售金融資產	7.4.7.4	—	—

應收證券清算款		-	1,895,077.12
應收利息	7.4.7.5	5,196.32	4,359.01
應收股利		-	-
應收申購款		144,360.13	300,352.55
遞延所得稅資產		-	-
其他資產	7.4.7.6	-	-
資產總計		345,043,907.55	386,536,051.57
<b>負債和所有者權益</b>	<b>附註號</b>	<b>本期末 2021 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2020 年 12 月 31 日</b>
<b>負債：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融負債		-	-
衍生金融負債	7.4.7.3	-	-
賣出回購金融資產款		-	-
應付證券清算款		6,414,480.83	-
應付贖回款		181,075.41	459,955.73
應付管理人報酬		438,752.81	466,647.18
應付託管費		73,125.45	77,774.51
應付銷售服務費		-	-
應付交易費用	7.4.7.7	257,302.80	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	7.4.7.8	194,311.49	185,900.89
負債合計		7,559,048.79	1,330,111.87
<b>所有者權益：</b>			
實收基金	7.4.7.9	68,083,232.51	75,462,125.33
未分配利潤	7.4.7.10	269,401,626.25	309,743,814.37
所有者權益合計		337,484,858.76	385,205,939.70
負債和所有者權益總計		345,043,907.55	386,536,051.57

註：報告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份額總額 68,083,232.51 份，其中大成內需增長混合 A 基金份額總額為 55,492,658.28 份，基金份額淨值 4.957 元。大成內需增長混合 H 基金份額總額為 12,590,574.23 份，基金份額淨值 4.956 元。

## 7.2 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 12 月 31 日

單位：人民幣元

項 目	附註號	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年	上年度可比期間 2020 年 1 月 1 日至 2020 年
-----	-----	------------------------------	-----------------------------------

		12 月 31 日	12 月 31 日
一、收入		-7,779,515.79	172,658,510.79
1. 利息收入		187,772.11	213,060.74
其中：存款利息收入	7.4.7.11	187,727.43	213,048.93
債券利息收入		44.68	11.81
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)		81,678,946.53	79,540,057.02
其中：股票投資收益	7.4.7.12	78,997,979.55	77,070,744.00
基金投資收益		-	-
債券投資收益	7.4.7.13	94,406.84	-
資產支援證券投資收益		-	-
貴金屬投資收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	2,586,560.14	2,469,313.02
3. 公允價值變動收益(損失以“-”號填列)	7.4.7.17	-89,873,000.04	92,701,370.51
4. 匯兌收益(損失以“-”號填列)		-	-
5. 其他收入(損失以“-”號填列)	7.4.7.18	226,765.61	204,022.52
減：二、費用		9,564,658.64	7,886,977.21
1. 管理人報酬	7.4.10.2.1	5,653,766.46	4,858,894.65
2. 託管費	7.4.10.2.2	942,294.34	809,815.86
3. 銷售服務費		-	-
4. 交易費用	7.4.7.19	2,733,992.40	2,000,220.59
5. 利息支出		-	-
其中：賣出回購金融資產支出		-	-
6. 稅金及附加		0.17	0.08
7. 其他費用	7.4.7.20	234,605.27	218,046.03
三、利潤總額(虧損總額以“-”號填列)		-17,344,174.43	164,771,533.58
減：所得稅費用		-	-
四、淨利潤(淨虧損以“-”號填列)		-17,344,174.43	164,771,533.58



## 7.3 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 12 月 31 日

單位：人民幣元

項目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 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）	-	-17,344,174.43	-17,344,174.43
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）	-7,378,892.82	-22,998,013.69	-30,376,906.51
其中：1. 基金申購款	39,345,456.28	164,223,919.77	203,569,376.05
2. 基金贖回款	-46,724,349.10	-187,221,933.46	-233,946,282.56
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）	68,083,232.51	269,401,626.25	337,484,858.76
項目	上年度可比期間 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 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）	-	164,771,533.58	164,771,533.58
三、本期基金份額交易產生的基	-44,331,006.88	-103,422,582.71	-147,753,589.59

金淨值變動數 (淨值減少以 “-”號填列)			
其中：1. 基金申 購款	46,311,695.17	137,269,765.41	183,581,460.58
2. 基金贖 回款	-90,642,702.05	-240,692,348.12	-331,335,050.17
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)	75,462,125.33	309,743,814.37	385,205,939.70

報表附註為財務報表的組成部分。

本報告 7.1 至 7.4 財務報表由下列負責人簽署：

譚曉岡

溫智敏

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

## 7.4 報表附註

### 7.4.1 基金基本情況

大成內需增長混合型證券投資基金(以下簡稱“本基金”)經中國證券監督管理委員會(以下簡稱“中國證監會”)證監許可[2011]第 609 號《關於核准大成內需增長股票型證券投資基金募集的批覆》核准，由大成基金管理有限公司依照《中華人民共和國證券投資基金法》和《大成內需增長股票型證券投資基金基金合同》負責公開募集。本基金為契約型開放式，存續期限不定，首次設立募集不包括認購資金利息共募集人民幣 1,429,782,326.29 元，業經普華永道中天會計師事務所有限公司普華永道中天驗字(2011)第 235 號驗資報告予以驗證。經向中國證監會備案，《大成內需增長股票型證券投資基金基金合同》於 2011 年 6 月 14 日正式生效，基金合同生效日的基金份額總額為 1,429,930,353.67 份基金份額，其中認購資金利息摺合 148,027.38 份基金份額。本基金的基金管理人為大成基金管理有限公司，基金託管人為中國銀行股份有限公司。

根據 2014 年中國證監會令第 104 號《公開募集證券投資基金運作管理辦法》，大成內需增長股票型證券投資基金於 2015 年 7 月 2 日公告後更名為大成內需增長混合型證券投資基金。

根據基金管理人大成基金管理有限公司於 2015 年 7 月 22 日發布的《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及修訂基金合同的公告》，自 2015 年 7 月 22 日起，對大成內需

增長混合型證券投資基金增設 H 類基金份額。根據修訂後的《大成內需增長混合型證券投資基金基金合同》的相關規定，本基金根據銷售地區的不同設置 A 類份額和 H 類份額，兩類基金份額單獨設置基金代碼，並分別公布基金份額單位淨值。A 類份額在中國大陸地區進行銷售，H 類份額根據中港兩地基金互認安排在香港地區進行銷售，兩類份額之間不能相互轉換。

根據《中華人民共和國證券投資基金法》和《大成內需增長混合型證券投資基金基金合同》的有關規定，本基金的投資範圍為具有較好流動性的金融工具，包括國內依法發行交易的股票（含中小板、創業板及其他經中國證監會核准上市的股票）、存托憑證、債券、權證、股指期貨及法律、法規或監管機構允許基金投資的其他金融工具（但須符合中國證監會的相關規定）。本基金股票資產、存托憑證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、存托憑證投資於受益於內需增長的行業中的優質企業。本基金投資業績比較基準為：滬深 300 指數×80%+中證綜合債券指數×20%。

本財務報表由本基金的基金管理人大成基金管理有限公司於 2022 年 3 月 28 日批准報出。

#### 7.4.2 會計報表的編製基礎

本基金的財務報表按照財政部於 2006 年 2 月 15 日及以後期間頒布的《企業會計準則—基本準則》、各項具體會計準則及相關規定（以下合稱“企業會計準則”）、中國證監會頒布的《證券投資基金資訊披露 XBRL 模板第 3 號〈年度報告和中期報告〉》、中國證券投資基金業協會（以下簡稱“中國基金業協會”）頒布的《證券投資基金會計核算業務指引》、《大成內需增長混合型證券投資基金基金合同》和在財務報表附註 7.4.4 所列示的中國證監會、中國基金業協會發布的有關規定及允許的基金行業實務操作編製。

本財務報表以持續經營為基礎編製。

#### 7.4.3 遵循企業會計準則及其他有關規定的聲明

本基金 2021 年度財務報表符合企業會計準則的要求，真實、完整地反映了本基金 2021 年 12 月 31 日的財務狀況以及 2021 年度的經營成果和基金淨值變動情況等有關資訊。

#### 7.4.4 重要會計政策和會計估計

##### 7.4.4.1 會計年度

本基金會計年度為西曆 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 記賬本位幣

本基金的記賬本位幣為人民幣。

#### 7.4.4.3 金融資產和金融負債的分類

##### (1) 金融資產的分類

金融資產於初始確認時分類為：以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產、應收款項、可供出售金融資產及持有至到期投資。金融資產的分類取決於本基金對金融資產的持有意圖和持有能力。本基金現無金融資產分類為可供出售金融資產及持有至到期投資。

本基金目前以交易目的持有的股票投資、債券投資和衍生工具分類為以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產。除衍生工具所產生的金融資產在資產負債表中以衍生金融資產列示外，以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產在資產負債表中以交易性金融資產列示。

本基金持有的其他金融資產分類為應收款項，包括銀行存款、買入返售金融資產和其他各類應收款項等。應收款項是指在活躍市場中沒有報價、回收金額固定或可確定的非衍生金融資產。

##### (2) 金融負債的分類

金融負債於初始確認時分類為：以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融負債及其他金融負債。本基金目前暫無金融負債分類為以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融負債。本基金持有的其他金融負債包括賣出回購金融資產款和其他各類應付款項等。

#### 7.4.4.4 金融資產和金融負債的初始確認、後續計量和終止確認

金融資產或金融負債於本基金成為金融工具合同的一方時，按公允價值在資產負債表內確認。以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產，取得時發生的相關交易費用計入當期損益；對於支付的價款中包含的債券起息日或上次除息日至購買日止的利息，單獨確認為應收項目。應收款項和其他金融負債的相關交易費用計入初始確認金額。

對於以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產，按照公允價值進行後續計量；對於應收款項和其他金融負債採用實際利率法，以攤餘成本進行後續計量。

金融資產滿足下列條件之一的，予以終止確認：(1) 收取該金融資產現金流量的合同權利終止；(2) 該金融資產已轉移，且本基金將金融資產所有權上幾乎所有的風險和報酬轉移給轉入方；或者(3) 該金融資產已轉移，雖然本基金既沒有轉移也沒有保留金融資產所有權上幾乎所有的風險和報酬，但是放棄了對該金融資產控制。

金融資產終止確認時，其賬面價值與收到的對價的差額，計入當期損益。

當金融負債的現時義務全部或部分已經解除時，終止確認該金融負債或義務已解除的部分。終止確認部分的賬面價值與支付的對價之間的差額，計入當期損益。

#### 7.4.4.5 金融資產和金融負債的估值原則

本基金持有的股票投資、債券投資和衍生工具按如下原則確定公允價值並進行估值：

(1) 存在活躍市場的金融工具按其估值日的市場交易價格確定公允價值；估值日無交易且最近交易日後未發生影響公允價值計量的重大事件的，按最近交易日的市場交易價格確定公允價值。有充足證據表明估值日或最近交易日的市場交易價格不能真實反映公允價值的，應對市場交易價格進行調整，確定公允價值。與上述投資品種相同，但具有不同特徵的，應以相同資產或負債的公允價值為基礎，並在估值技術中考慮不同特徵因素的影響。特徵是指對資產出售或使用的限制等，如果該限制是針對資產持有者的，那麼在估值技術中不應將該限製作為特徵考慮。此外，基金管理人不應考慮因大量持有相關資產或負債所產生的溢價或折價。

(2) 當金融工具不存在活躍市場，採用在當前情況下適用並且有足夠可利用數據和其他資訊支援的估值技術確定公允價值。採用估值技術時，優先使用可觀察輸入值，只有在無法取得相關資產或負債可觀察輸入值或取得不切實可行的情況下，才可以使用不可觀察輸入值。

(3) 如經濟環境發生重大變化或證券發行人發生影響金融工具價格的重大事件，應對估值進行調整並確定公允價值。

#### 7.4.4.6 金融資產和金融負債的抵銷

本基金持有的資產和承擔的負債基本為金融資產和金融負債。當本基金 1) 具有抵銷已確認金額的法定權利且該種法定權利現在是可執行的；且 2) 交易雙方準備按淨額結算時，金融資產與金融負債按抵銷後的淨額在資產負債表中列示。

#### 7.4.4.7 實收基金

實收基金為對外發行基金份額所募集的總金額在扣除損益平準金分攤部分後的餘額。由於申購和贖回引起的實收基金變動分別於基金申購確認日及基金贖回確認日認列。上述申購和贖回分別包括基金轉換所引起的轉入基金的實收基金增加和轉出基金的實收基金減少。

#### 7.4.4.8 損益平準金

損益平準金包括已實現平準金和未實現平準金。已實現平準金指在申購或贖回基金份額時，申購或贖回款項中包含的按累計未分配的已實現損益佔基金淨值比例計算的金額。未實現平準金指在申購或贖回基金份額時，申購或贖回款項中包含的按累計未實現損益佔基金淨值比例計算的金額。損益平準金於基金申購確認日或基金贖回確認日認列，並於期末全額轉入未分配利潤/(累計虧損)。

#### 7.4.4.9 收入/(損失)的確認和計量

股票投資在持有期間應取得的現金股利扣除由上市公司代扣代繳的個人所得稅後的淨額確認

為投資收益。債券投資在持有期間應取得的按票面利率或者發行價計算的利息扣除在適用情況下由債券發行企業代扣代繳的個人所得稅及由基金管理人繳納的增值稅後的淨額確認為利息收入。

以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產在持有期間的公允價值變動確認為公允價值變動損益；於處置時，其處置價格與初始確認金額之間的差額確認為投資收益，其中包括從公允價值變動損益結轉的公允價值累計變動額。

應收款項在持有期間確認的利息收入按實際利率法計算，實際利率法與直線法差異較小的則按直線法計算。

#### 7.4.4.10 費用的確認和計量

本基金的管理人報酬和託管費在費用涵蓋期間按基金合同約定的費率和計算方法逐日確認。

其他金融負債在持有期間確認的利息支出按實際利率法計算，實際利率法與直線法差異較小的則按直線法計算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一類別的每一基金份額享有同等分配權。本基金收益以現金形式分配，但基金份額持有人可選擇現金紅利或將現金紅利按分紅除權日的基金份額淨值自動轉為基金份額進行再投資。若期末未分配利潤中的未實現部分為正數，包括基金經營活動產生的未實現損益以及基金份額交易產生的未實現平準金等，則期末可供分配利潤的金額為期末未分配利潤中的已實現部分；若期末未分配利潤的未實現部分為負數，則期末可供分配利潤的金額為期末未分配利潤，即已實現部分相抵未實現部分後的餘額。

經宣告的擬分配基金收益於分紅除權日從所有者權益轉出。

#### 7.4.4.12 分部報告

本基金以內部組織結構、管理要求、內部報告制度為依據確定經營分部，以經營分部為基礎確定報告分部並披露分部資訊。經營分部是指本基金內同時滿足下列條件的組成部分：（1）該組成部分能夠在日常活動中產生收入、發生費用；（2）本基金的基金管理人能夠定期評價該組成部分的經營成果，以決定向其配置資源、評價其業績；（3）本基金能夠取得該組成部分的財務狀況、經營成果和現金流量等有關會計資訊。如果兩個或多個經營分部具有相似的經濟特徵，並且滿足一定條件的，則合并為一個經營分部。

本基金目前以一個單一的經營分部運作，不需要披露分部資訊。

#### 7.4.4.13 其他重要的會計政策和會計估計

根據本基金的估值原則和中國證監會允許的基金行業估值實務操作，本基金確定以下類別股票投資和債券投資的公允價值時採用的估值方法及其關鍵假設如下：（1）對於證券交易所

上市的股票和債券，若出現重大事項停牌或交易不活躍(包括漲跌停時的交易不活躍)等情況，本基金根據中國證監會公告[2017]13 號《中國證監會關於證券投資基金估值業務的指導意見》，根據具體情況採用《關於發布中基協(AMAC)基金行業股票估值指數的通知》提供的指數收益法、市盈率法、現金流量折現法等估值技術進行估值。

(2)對於在鎖定期內的非公開發行股票、首次公開發行股票時公司股東公開發售股份、通過大宗交易取得的帶限售期的股票等流通受限股票，根據中國基金業協會中基協發[2017]6 號《關於發布〈證券投資基金投資流通受限股票估值指引(試行)〉的通知》之附件《證券投資基金投資流通受限股票估值指引(試行)》(以下簡稱“指引”)，按估值日在證券交易所上市交易的同一股票的公允價值扣除中證指數有限公司根據指引所獨立提供的該流通受限股票剩餘限售期對應的流動性折扣後的價值進行估值。

(3)對於在證券交易所上市或掛牌轉讓的固定收益品種(可轉換債券、可交換債券和私募債券除外)及在銀行間同業市場交易的固定收益品種，根據中國證監會公告[2017]13 號《中國證監會關於證券投資基金估值業務的指導意見》及《中國證券投資基金業協會估值核算工作小組關於 2015 年 1 季度固定收益品種的估值處理標準》採用估值技術確定公允價值。本基金持有的證券交易所上市或掛牌轉讓的固定收益品種(可轉換債券、可交換債券和私募債券除外)，按照中證指數有限公司所獨立提供的估值結果確定公允價值。本基金持有的銀行間同業市場固定收益品種按照中債金融估值中心有限公司所獨立提供的估值結果確定公允價值。

#### 7.4.5 會計政策和會計估計變更以及差錯更正的說明

##### 7.4.5.1 會計政策變更的說明

財政部於 2017 年頒布了修訂後的《企業會計準則第 14 號—收入》，本基金於 2021 年 1 月 1 日起執行。本基金在編製 2021 年度財務報表時已採用該準則，該準則的採用未對本基金財務報表產生重大影響。

##### 7.4.5.2 會計估計變更的說明

本基金本報告期末發生會計估計變更。

##### 7.4.5.3 差錯更正的說明

本基金在本報告期間無須說明的會計差錯更正。

#### 7.4.6 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。

#### 7.4.7 重要財務報表項目的說明

##### 7.4.7.1 銀行存款

單位：人民幣元

項目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	47,492,999.03	39,676,198.32
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	47,492,999.03	39,676,198.32

##### 7.4.7.2 交易性金融資產

單位：人民幣元

項目		本期末 2021 年 12 月 31 日		
		成本	公允價值	公允價值變動
股票		269,061,102.76	296,916,712.34	27,855,609.58
貴金屬投資-金交所黃金合約		—	—	—
債券	交易所市場	10,000.00	12,961.00	2,961.00
	銀行間市場	—	—	—
	合計	10,000.00	12,961.00	2,961.00
資產支援證券		—	—	—
基金		—	—	—
其他		—	—	—
合計		269,071,102.76	296,929,673.34	27,858,570.58
項目		上年度末 2020 年 12 月 31 日		
		成本	公允價值	公允價值變動
股票		226,628,381.40	344,333,886.40	117,705,505.00
貴金屬投資-金交所黃金合約		—	—	—
債券	交易所市場	95,900.00	121,965.62	26,065.62
	銀行間市場	—	—	—
	合計	95,900.00	121,965.62	26,065.62
資產支援證券		—	—	—
基金		—	—	—

其他	-	-	-
合計	226,724,281.40	344,455,852.02	117,731,570.62

#### 7.4.7.3 衍生金融資產/負債

無。

#### 7.4.7.4 買入返售金融資產

無。

#### 7.4.7.5 應收利息

單位：人民幣元

項目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
應收活期存款利息	4,982.02	4,254.71
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	185.20	68.80
應收債券利息	2.10	12.40
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	27.00	23.10
合計	5,196.32	4,359.01

#### 7.4.7.6 其他資產

無。

#### 7.4.7.7 應付交易費用

單位：人民幣元

項目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
交易所市場應付交易費用	257,302.80	139,833.21
銀行間市場應付交易費用	-	-
合計	257,302.80	139,833.21

#### 7.4.7.8 其他負債

單位：人民幣元

項目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
應付券商交易單元保證金	-	-
應付贖回費	311.49	900.89

應付證券出借違約金	-	-
預提費用	194,000.00	185,000.00
合計	194,311.49	185,900.89

## 7.4.7.9 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 12 月 31 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	23,723,349.18	23,723,349.18
本期贖回（以“-”號填列）	-34,469,384.66	-34,469,384.66
-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	55,492,658.28	55,492,658.28

大成內需增長混合 H

項目	本期	
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 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	15,622,107.10	15,622,107.10
本期贖回（以“-”號填列）	-12,254,964.44	-12,254,964.44
-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	12,590,574.23	12,590,574.23

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)。

## 7.4.7.10 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	57,845,816.06	-69,565,991.10	-11,720,175.04
本期基金份額交易產生的變動數	-33,239,257.06	-7,337,589.99	-40,576,847.05
其中：基金申購款	72,746,336.15	24,417,094.65	97,163,430.80
基金贖回款	-105,985,593.21	-31,754,684.64	-137,740,277.85
本期已分配利潤	-	-	-
本期末	194,140,059.70	25,452,588.83	219,592,648.53

## 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	14,683,009.55	-20,307,008.94	-5,623,999.39
本期基金份額交易產生的變動數	5,747,250.70	11,831,582.66	17,578,833.36
其中：基金申購款	43,038,024.26	24,022,464.71	67,060,488.97
基金贖回款	-37,290,773.56	-12,190,882.05	-49,481,655.61
本期已分配利潤	-	-	-
本期末	44,032,706.87	5,776,270.85	49,808,977.72

## 7.4.7.11 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 12 月 31 日	上年度可比期間 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	175,317.91	203,030.69
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	10,961.38	8,610.46
其他	1,448.14	1,407.78
合計	187,727.43	213,048.93

## 7.4.7.12 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 12 月 31 日	上年度可比期間 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
賣出股票成交總額	915,610,038.50	692,461,364.63
減：賣出股票成本總額	836,612,058.95	615,390,620.63
買賣股票差價收入	78,997,979.55	77,070,744.00

## 7.4.7.13 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 12 月 31 日	上年度可比期間 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
賣出債券（、債轉股及債券到期兌付）成交總額	403,363.22	-
減：賣出債券（、債轉股及債券到期兌付）成本總額	308,900.00	-
減：應收利息總額	56.38	-
買賣債券差價收入	94,406.84	-

## 7.4.7.14 貴金屬投資收益

無。

## 7.4.7.15 衍生工具收益

無。

## 7.4.7.16 股利收益

單位：人民幣元

項目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期間 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
股票投資產生的股利收益	2,586,560.14	2,469,313.02
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	2,586,560.14	2,469,313.02

## 7.4.7.17 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 12 月 31 日	上年度可比期間 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
1. 交易性金融資產	-89,873,000.04	92,701,370.51
股票投資	-89,849,895.42	92,675,304.89
債券投資	-23,104.62	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	-89,873,000.04	92,701,370.51

## 7.4.7.18 其他收入

單位：人民幣元

項目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期間 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
----	--	---

基金贖回費收入	213,172.30	186,790.22
基金轉換費收入	13,593.31	17,232.30
合計	226,765.61	204,022.52

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 A 類份額的轉換費由申購補差費和轉出基金的贖回費兩部分構成，其中不低於贖回費的 25% 歸入轉出基金的基金資產。

#### 7.4.7.19 交易費用

單位：人民幣元

項目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期間 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
交易所市場交易費用	2,733,992.40	2,000,220.59
銀行間市場交易費用	-	-
合計	2,733,992.40	2,000,220.59

#### 7.4.7.20 其他費用

單位：人民幣元

項目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期間 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
審計費用	65,000.00	65,000.00
資訊披露費	120,000.00	120,000.00
證券出借違約金	-	-
銀行劃款手續費	16,905.27	13,846.03
賬戶維護費	31,500.00	18,000.00
其他	1,200.00	1,200.00
合計	234,605.27	218,046.03

#### 7.4.8 或有事項、資產負債表日後事項的說明

##### 7.4.8.1 或有事項

無。

##### 7.4.8.2 資產負債表日後事項

無。

#### 7.4.9 關聯方關係

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
中泰信託有限責任公司	基金管理人的股東

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
中國銀河投資管理有限公司	基金管理人的股東
大成國際資產管理有限公司（“大成國際”）	基金管理人的子公司、基金香港代理人
大成創新資本管理有限公司（“大成創新資本”）	基金管理人的合營企業

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。

#### 7.4.10 本報告期及上年度可比期間的關聯方交易

##### 7.4.10.1 通過關聯方交易單元進行的交易

##### 7.4.10.1.1 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12月31日		上年度可比期間 2020年1月1日至2020年12月31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	115,331,835.36	6.47	52,688,334.21	4.26

##### 7.4.10.1.2 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12月31日		上年度可比期間 2020年1月1日至2020年12月31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	28.48	—	—

##### 7.4.10.1.3 債券回購交易

無。

##### 7.4.10.1.4 權證交易

無。

##### 7.4.10.1.5 應支付關聯方的備金

金額單位：人民幣元

關聯方名稱	本期 2021年1月1日至2021年12月31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	105,102.00	6.47	7,076.23	2.75
關聯方名稱	上年度可比期間 2020年1月1日至2020年12月31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	48,012.93	4.26	—	—

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。

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。

#### 7.4.10.2 關聯方報酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理費

單位：人民幣元

項目	本期 2021年1月1日至2021年12 月31日	上年度可比期間 2020年1月1日至2020年 12月31日
當期發生的基金應支付的管理費	5,653,766.46	4,858,894.65
其中：支付銷售機構的客戶維護費	1,835,916.84	1,847,977.40

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。

##### 7.4.10.2.2 基金託管費

單位：人民幣元

項目	本期 2021年1月1日至2021年12 月31日	上年度可比期間 2020年1月1日至2020年 12月31日
當期發生的基金應支付的託管費	942,294.34	809,815.86

註：支付基金託管人中國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。

#### 7.4.10.3 與關聯方進行銀行間同業市場的債券(含回購)交易

無。



## 7.4.10.4 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

## 7.4.10.4.1 與關聯方通過約定申報方式進行的適用固定期限費率的證券出借業務的情況

無。

## 7.4.10.4.2 與關聯方通過約定申報方式進行的適用市場化期限費率的證券出借業務的情況

無。

## 7.4.10.5 各關聯方投資本基金的情況

## 7.4.10.5.1 報告期內基金管理人運用固有資金投資本基金的情況

無。

## 7.4.10.5.2 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。

## 7.4.10.6 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 12 月 31 日		上年度可比期間 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 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	47,492,999.03	175,317.91	39,676,198.32	203,030.69

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。

## 7.4.10.7 本基金在承銷期內參與關聯方承銷證券的情況

無。

## 7.4.10.8 其他關聯交易事項的說明

無。

## 7.4.11 利潤分配情況

無。

## 7.4.12 期末(2021 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限證券

## 7.4.12.1 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

## 7.4.12.1.1 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
300774	倍杰特	2021 年 7 月 26 日	2022 年 02 月 16 日	新股鎖定	4.57	21.08	444	2,029.08	9,359.52	-
300854	中蘭環保	2021 年 9 月 8 日	2022 年 3 月 16 日	新股鎖定	9.96	27.29	203	2,021.88	5,539.87	-
301020	密封科技	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	新股鎖定	10.64	30.44	421	4,479.44	12,815.24	-
301021	英諾雷射	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	新股鎖定	9.46	41.43	290	2,743.40	12,014.70	-
301025	讀客文化	2021 年 7 月 6 日	2022 年 01 月 24 日	新股鎖定	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	-
301026	浩通科技	2021 年 7 月 8 日	2022 年 1 月 17 日	新股鎖定	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19	-
301027	華藍集團	2021 年 7 月 8 日	2022 年 01 月 19 日	新股鎖定	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	-
301028	東亞機械	2021 年 7 月 12 日	2022 年 1 月 20 日	新股鎖定	5.31	13.50	733	3,892.23	9,895.50	-
301029	怡合達	2021 年 7 月 14 日	2022 年 1 月 24 日	新股鎖定	14.14	89.87	462	6,532.68	41,519.94	-
301030	仕淨科技	2021 年 7 月 15 日	2022 年 1 月 24 日	新股鎖定	6.10	31.52	242	1,476.20	7,627.84	-
301032	新柴股份	2021 年 7 月 15 日	2022 年 1 月 24 日	新股鎖定	4.97	12.51	513	2,549.61	6,417.63	-
301033	邁普醫學	2021 年 7 月 15 日	2022 年 1 月 26 日	新股鎖定	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	-
301035	潤豐股份	2021 年 7 月 21 日	2022 年 1 月 28 日	新股鎖定	22.04	56.28	483	10,645.32	27,183.24	-
301036	雙樂	2021 年	2022 年	新股鎖	23.38	29.93	205	4,792.90	6,135.65	-

	股份	7月21日	02月16日	定						
301037	保立佳	2021年7月21日	2022年2月7日	新股鎖定	14.82	24.26	193	2,860.26	4,682.18	-
301040	中環海陸	2021年7月26日	2022年2月7日	新股鎖定	13.57	38.51	241	3,270.37	9,280.91	-
301046	能輝科技	2021年8月10日	2022年2月17日	新股鎖定	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	-
301048	金鷹重工	2021年8月11日	2022年02月28日	新股鎖定	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28	-
301049	超越科技	2021年8月17日	2022年2月24日	新股鎖定	19.34	32.92	196	3,790.64	6,452.32	-
301050	雷電微力	2021年8月17日	2022年2月24日	新股鎖定	60.64	234.74	57	3,456.48	13,380.18	-
301053	遠信工業	2021年8月25日	2022年3月1日	新股鎖定	11.87	28.78	155	1,839.85	4,460.90	-
301055	張小泉	2021年8月26日	2022年3月7日	新股鎖定	6.90	21.78	355	2,449.50	7,731.90	-
301056	森赫股份	2021年8月27日	2022年3月7日	新股鎖定	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	-
301057	匯隆新材	2021年8月31日	2022年3月9日	新股鎖定	8.03	19.02	218	1,750.54	4,146.36	-
301059	金三江	2021年9月3日	2022年3月14日	新股鎖定	8.09	19.30	259	2,095.31	4,998.70	-
301062	上海艾錄	2021年9月7日	2022年3月14日	新股鎖定	3.31	17.01	523	1,731.13	8,896.23	-
301063	海鍋股份	2021年9月9日	2022年3月24日	新股鎖定	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	-
301066	萬事利	2021年9月13日	2022年3月22日	新股鎖定	5.24	22.84	344	1,802.56	7,856.96	-

301068	大地海洋	2021 年 9 月 16 日	2022 年 3 月 28 日	新股鎖 定	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	-
301072	中捷精工	2021 年 9 月 22 日	2022 年 3 月 29 日	新股鎖 定	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-
301078	孩子王	2021 年 9 月 30 日	2022 年 4 月 14 日	新股鎖 定	5.77	12.14	756	4,362.12	9,177.84	-
301079	邵陽液壓	2021 年 10 月 11 日	2022 年 4 月 19 日	新股鎖 定	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-
301083	百勝智能	2021 年 10 月 13 日	2022 年 4 月 21 日	新股鎖 定	9.08	14.21	416	3,777.28	5,911.36	-
301088	戎美股份	2021 年 10 月 19 日	2022 年 4 月 28 日	新股鎖 定	33.16	24.67	274	9,085.84	6,759.58	-
301089	拓新藥業	2021 年 10 月 20 日	2022 年 4 月 27 日	新股鎖 定	19.11	67.93	220	4,204.20	14,944.60	-
301091	深城交	2021 年 10 月 20 日	2022 年 4 月 29 日	新股鎖 定	36.50	31.31	332	12,118.00	10,394.92	-
301092	爭光股份	2021 年 10 月 21 日	2022 年 5 月 5 日	新股鎖 定	36.31	35.52	218	7,915.58	7,743.36	-
301093	華蘭股份	2021 年 10 月 21 日	2022 年 5 月 5 日	新股鎖 定	58.08	49.85	201	11,674.08	10,019.85	-
301111	粵萬年青	2021 年 11 月 30 日	2022 年 6 月 7 日	新股鎖 定	10.48	36.68	379	3,971.92	13,901.72	-
301118	恒光股份	2021 年 11 月 9 日	2022 年 5 月 18 日	新股鎖 定	22.70	49.02	315	7,150.50	15,441.30	-
301126	達嘉維康	2021 年 11 月 30 日	2022 年 6 月 7 日	新股鎖 定	12.37	19.23	662	8,188.94	12,730.26	-
301149	隆華新材	2021 年 11 月 3 日	2022 年 5 月 10 日	新股鎖 定	10.07	16.76	1,199	12,073.93	20,095.24	-
301188	力諾特玻	2021 年 11 月 4 日	2022 年 5 月 11 日	新股鎖 定	13.00	20.48	647	8,411.00	13,250.56	-

		日	日							
301190	善水科技	2021 年 12 月 17 日	2022 年 6 月 24 日	新股鎖 定	27.85	27.46	315	8,772.75	8,649.90	-
688075	安旭生物	2021 年 11 月 10 日	2022 年 5 月 18 日	新股鎖 定	78.28	128.77	2,674	209,320.72	344,330.98	-
688257	新銳股份	2021 年 10 月 19 日	2022 年 4 月 27 日	新股鎖 定	62.30	61.10	1,933	120,425.90	118,106.30	-
688280	精進電動	2021 年 10 月 19 日	2022 年 4 月 27 日	新股鎖 定	13.78	13.63	9,332	128,594.96	127,195.16	-
688707	振華新材	2021 年 9 月 6 日	2022 年 3 月 14 日	新股鎖 定	11.75	47.16	5,745	67,503.75	270,934.20	-

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。

#### 7.4.12.2 期末持有的暫時停牌等流通受限股票

無。

#### 7.4.12.3 期末債券正回購交易中作為抵押的債券

無。

#### 7.4.12.4 期末參與轉融通證券出借業務的證券

無。

### 7.4.13 金融工具風險及管理

#### 7.4.13.1 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。

#### 7.4.13.2 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人中國銀行，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 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的除國債、央行票據和 策性金融債以外的債券佔基金資產淨值的比例為 0.0038%(2020 年 12 月 31 日：0.03%)。

#### 7.4.13.3 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。

#### 7.4.13.3.1 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。

#### 7.4.13.4 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风险，包括利率風險、外匯風險和其他價格風險。

##### 7.4.13.4.1 利率風險

利率風險是指金融工具的公允價值或未來現金流量受市場利率變動而發生波動的风险。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、存出保證金和債券投資等。

## 7.4.13.4.1.1 利率風險敞口

單位：人民幣元

本期末 2021 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	47,492,999.03	-	-	-	47,492,999.03
結算備付金	411,574.89	-	-	-	411,574.89
存出保證金	60,103.84	-	-	-	60,103.84
交易性金融資產	-	-	12,961.00	296,916,712.34	296,929,673.34
應收利息	-	-	-	5,196.32	5,196.32
應收申購款	-	-	-	144,360.13	144,360.13
資產總計	47,964,677.76	-	12,961.00	297,066,268.79	345,043,907.55
負債					
應付贖回款	-	-	-	181,075.41	181,075.41
應付管理人報酬	-	-	-	438,752.81	438,752.81
應付託管費	-	-	-	73,125.45	73,125.45
應付證券清算款	-	-	-	6,414,480.83	6,414,480.83
應付交易費用	-	-	-	257,302.80	257,302.80
其他負債	-	-	-	194,311.49	194,311.49
負債總計	-	-	-	7,559,048.79	7,559,048.79
利率敏感度缺口	47,964,677.76	-	12,961.00	289,507,220.00	337,484,858.76
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。



#### 7.4.13.4.1.2 利率風險的敏感性分析

於本期末，本基金持有的交易性債券投資公允價值佔基金資產淨值的比例為 0.0038% (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)。

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他價格風險敞口

金額單位：人民幣元

項目	本期末 2021 年 12 月 31 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	296,916,712.34	87.98	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	296,916,712.34	87.98	344,333,886.40	89.39

#### 7.4.13.4.3.2 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 12 月 31 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
分析	1. 業績比較基準上升 5%	19,345,565.23	20,535,588.95
	2. 業績比較基準下降 5%	-19,345,565.23	-20,535,588.95

#### 7.4.14 有助於理解和分析會計報表需要說明的其他事項

##### (1) 公允價值

##### (a) 金融工具公允價值計量的方法

公允價值計量結果所屬的層次，由對公允價值計量整體而言具有重要意義的輸入值所屬的最低層次決定：

第一層次：相同資產或負債在活躍市場上未經調整的報價。

第二層次：除第一層次輸入值外相關資產或負債直接或間接可觀察的輸入值。

第三層次：相關資產或負債的不可觀察輸入值。

##### (b) 持續的以公允價值計量的金融工具

##### (i) 各層次金融工具公允價值

於本期末，本基金持有的以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產中屬於第一層次的餘額為 295,626,693.53 元，屬於第二層次的餘額為 1,302,979.81 元，無屬於第三層次的餘額（上年度末：第一層次 342,204,945.21 元，第二層次 2,250,906.81 元，無第三層次）。

##### (ii) 公允價值所屬層次間的重大變動

本基金以導致各層次之間轉換的事項發生日為確認各層次之間轉換的時點。

對於證券交易所上市的股票和債券，若出現重大事項停牌、交易不活躍(包括漲跌停時的交易不活躍)、或屬於非公開發行等情況，本基金不會於停牌日至交易恢復活躍日期間、交易不活躍期間及限售期間將相關股票和債券的公允價值列入第一層次；並根據估值調整中採用的不可觀察輸入值對於公允價值的影響程度，確定相關股票和債券公允價值應屬第二層次還是第三層次。

(iii) 第三層次公允價值餘額和本期變動金額

無。

(c) 非持續的以公允價值計量的金融工具

於本期末，本基金未持有非持續的以公允價值計量的金融資產(上年度末：同)。

(d) 不以公允價值計量的金融工具

不以公允價值計量的金融資產和負債主要包括應收款項和其他金融負債，其賬面價值與公允價值相差很小。

(2) 根據財政部發布的《企業會計準則第 22 號—金融工具確認計量》、《企業會計準則第 23 號—金融資產轉移》、《企業會計準則第 24 號—套期會計》和《企業會計準則第 37 號—金融工具列報》(以下合稱“新金融工具準則”)相關銜接規定，以及財政部、銀保監會於 2020 年 12 月 30 日發布的《關於進一步貫徹落實新金融工具相關會計準則的通知》，公募證券投資基金應當自 2022 年 1 月 1 日起執行新金融工具準則。截至 2021 年 12 月 31 日，本基金已完成了執行新金融工具準則對財務報表潛在影響的評估。鑒於本基金業務的性質，新金融工具準則預期不會對本基金的財務狀況和經營成果產生重大影響。

本基金將自 2022 年 1 月 1 日起追溯執行相關新規定，並採用準則允許的實務簡便方法，調整期初所有者權益，2021 年的比較數據將不作重述。

(3) 除公允價值和執行新金融工具準則外，截至資產負債表日本基金無需要說明的其他重要事項。

## § 8 投資組合報告

### 8.1 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	296,916,712.34	86.05
	其中：股票	296,916,712.34	86.05
2	基金投資	—	—
3	固定收益投資	12,961.00	0.00

	其中：債券	12,961.00	0.00
	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	47,904,573.92	13.88
8	其他各項資產	209,660.29	0.06
9	合計	345,043,907.55	100.00

## 8.2 報告期末按行業分類的股票投資組合

### 8.2.1 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	7,923,084.00	2.35
B	採礦業	—	—
C	製造業	241,407,210.22	71.53
D	電力、熱力、燃氣及水生產和供應業	—	—
E	建築業	23,328.03	0.01
F	批發和零售業	42,666.28	0.01
G	交通運輸、倉儲和郵政業	—	—
H	住宿和餐飲業	—	—
I	資訊傳輸、軟體和資訊技術服務業	1,384,837.74	0.41
J	金融業	—	—
K	房地產業	1,650,950.00	0.49
L	租賃和商務服務業	23,959,572.00	7.10
M	科學研究和技術服務業	9,282,283.92	2.75
N	水利、環境和公共設施管理業	37,143.71	0.01
O	居民服務、修理和其他服務業	—	—
P	教育	—	—
Q	衛生和社會工作	11,167,730.00	3.31
R	文化、體育和娛樂業	37,906.44	0.01
S	綜合	—	—
	合計	296,916,712.34	87.98

### 8.2.2 報告期末按行業分類的港股通投資股票投資組合

無。

## 8.3 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	13,720	28,126,000.00	8.33
2	601888	中國中免	109,200	23,959,572.00	7.10
3	000858	五糧液	95,100	21,174,966.00	6.27
4	300750	寧德時代	29,500	17,346,000.00	5.14
5	000568	瀘州老窖	45,521	11,556,416.27	3.42
6	603882	金域醫學	98,800	11,003,356.00	3.26
7	600887	伊利股份	245,200	10,165,992.00	3.01
8	300896	愛美客	18,855	10,108,354.05	3.00
9	688036	傳音控股	63,984	10,039,089.60	2.97
10	600600	青島啤酒	91,400	9,048,600.00	2.68
11	603187	海容冷鏈	161,260	7,651,787.00	2.27
12	300760	邁瑞醫療	19,402	7,388,281.60	2.19
13	600809	山西汾酒	22,900	7,231,362.00	2.14
14	600079	人福醫藥	307,700	6,929,404.00	2.05
15	603392	萬泰生物	29,795	6,599,592.50	1.96
16	300363	博騰股份	72,405	6,476,627.25	1.92
17	002415	海康威視	121,600	6,362,112.00	1.89
18	605080	浙江自然	84,400	6,313,120.00	1.87
19	002568	百潤股份	99,700	5,965,051.00	1.77
20	300979	華利集團	60,291	5,368,913.55	1.59
21	000063	中興通訊	148,200	4,964,700.00	1.47
22	002612	朗姿股份	156,500	4,962,615.00	1.47
23	002036	聯創電子	171,300	4,155,738.00	1.23
24	603486	科沃斯	23,800	3,592,610.00	1.06
25	002714	牧原股份	65,600	3,500,416.00	1.04
26	603259	藥明康德	29,300	3,474,394.00	1.03
27	000661	長春高新	11,100	3,012,540.00	0.89
28	301080	百普賽斯	13,200	2,786,916.00	0.83
29	002991	甘源食品	35,500	2,708,650.00	0.80
30	601012	隆基股份	30,900	2,663,580.00	0.79
31	300498	溫氏股份	136,700	2,632,842.00	0.78
32	603345	安井食品	13,900	2,373,842.00	0.70
33	603799	華友鈷業	21,100	2,327,541.00	0.69
34	002372	偉星新材	92,200	2,242,304.00	0.66
35	688105	諾唯贊	18,787	1,991,422.00	0.59
36	300791	仙樂健康	45,800	1,909,860.00	0.57
37	002311	海大集團	25,000	1,832,500.00	0.54
38	002041	登海種業	69,400	1,789,826.00	0.53

39	002475	立訊精密	34,239	1,684,558.80	0.50
40	601966	玲瓏輪胎	45,700	1,670,335.00	0.49
41	600223	魯商發展	124,600	1,650,950.00	0.49
42	301087	可孚醫療	20,500	1,617,655.00	0.48
43	603989	艾華集團	35,400	1,465,560.00	0.43
44	601238	廣汽集團	94,800	1,440,012.00	0.43
45	300253	衛寧健康	81,900	1,372,644.00	0.41
46	600195	中牧股份	103,100	1,347,517.00	0.40
47	601633	長城汽車	24,600	1,194,084.00	0.35
48	605339	南僑食品	31,800	1,059,576.00	0.31
49	002865	鈞達股份	14,400	1,008,000.00	0.30
50	603859	能科科技	25,200	1,000,188.00	0.30
51	688005	容百科技	7,765	897,478.70	0.27
52	688310	邁得醫療	17,658	813,680.64	0.24
53	603279	景津環保	16,700	774,546.00	0.23
54	000625	長安汽車	43,400	659,246.00	0.20
55	601636	旗濱集團	36,100	617,310.00	0.18
56	002270	華明裝備	60,800	602,528.00	0.18
57	003021	兆威機電	6,200	495,070.00	0.15
58	600702	捨得酒業	1,900	431,870.00	0.13
59	300957	貝泰妮	2,117	407,056.76	0.12
60	605499	東鵬飲料	2,200	400,048.00	0.12
61	688075	安旭生物	2,674	344,330.98	0.10
62	688707	振華新材	5,745	270,934.20	0.08
63	300595	歐普康視	4,300	246,691.00	0.07
64	688269	凱立新材	1,941	242,625.00	0.07
65	688190	雲路股份	1,632	193,359.36	0.06
66	600872	中炬高新	4,500	170,865.00	0.05
67	600763	通策醫療	826	164,374.00	0.05
68	688280	精進電動	9,332	127,195.16	0.04
69	688257	新銳股份	1,933	118,106.30	0.03
70	301029	怡合達	462	41,519.94	0.01
71	300390	天華超淨	400	32,400.00	0.01
72	603230	內蒙新華	1,140	29,491.80	0.01
73	301035	潤豐股份	483	27,183.24	0.01
74	300982	蘇文電能	317	23,328.03	0.01
75	301149	隆華新材	1,199	20,095.24	0.01
76	001296	長江材料	310	18,376.80	0.01
77	300997	歡樂家	928	16,082.24	0.00
78	300614	百川暢銀	329	15,792.00	0.00
79	301118	恒光股份	315	15,441.30	0.00
80	301089	拓新藥業	220	14,944.60	0.00

81	301046	能輝科技	290	14,207.10	0.00
82	301015	百洋醫藥	462	13,998.60	0.00
83	301111	粵萬年青	379	13,901.72	0.00
84	301050	雷電微力	57	13,380.18	0.00
85	301188	力諾特玻	647	13,250.56	0.00
86	301020	密封科技	421	12,815.24	0.00
87	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.00
88	301126	達嘉維康	662	12,730.26	0.00
89	300996	普聯軟體	386	12,193.74	0.00
90	301013	利和興	471	12,104.70	0.00
91	301021	英諾雷射	290	12,014.70	0.00
92	300993	玉馬遮陽	410	11,771.10	0.00
93	301048	金鷹重工	843	10,925.28	0.00
94	301002	崧盛股份	201	10,813.80	0.00
95	301011	華立科技	175	10,535.00	0.00
96	301091	深城交	332	10,394.92	0.00
97	301093	華蘭股份	201	10,019.85	0.00
98	301028	東亞機械	733	9,895.50	0.00
99	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.00
100	301040	中環海陸	241	9,280.91	0.00
101	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00
102	301062	上海艾錄	523	8,896.23	0.00
103	301190	善水科技	315	8,649.90	0.00
104	301012	揚電科技	170	8,608.80	0.00
105	301025	讀客文化	403	8,414.64	0.00
106	300991	創益通	254	8,359.14	0.00
107	301066	萬事利	344	7,856.96	0.00
108	301092	爭光股份	218	7,743.36	0.00
109	301055	張小泉	355	7,731.90	0.00
110	301030	仕淨科技	242	7,627.84	0.00
111	301016	雷爾偉	275	7,128.00	0.00
112	301088	戎美股份	274	6,759.58	0.00
113	300998	寧波方正	201	6,699.33	0.00
114	301033	邁普醫學	108	6,476.76	0.00
115	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
116	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
117	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
118	301036	雙樂股份	205	6,135.65	0.00
119	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
120	301007	德邁仕	303	6,035.76	0.00
121	301083	百勝智能	416	5,911.36	0.00
122	300854	中蘭環保	203	5,539.87	0.00

123	301063	海鍋股份	153	5,524.83	0.00
124	300995	奇德新材	191	5,292.61	0.00
125	301059	金三江	259	4,998.70	0.00
126	301027	華藍集團	286	4,761.90	0.00
127	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
128	301053	遠信工業	155	4,460.90	0.00
129	301057	匯隆新材	218	4,146.36	0.00
130	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
131	301079	邵陽液壓	140	3,474.80	0.00

## 8.4 報告期內股票投資組合的重大變動

### 8.4.1 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	43,023,620.07	11.17
2	000661	長春高新	31,644,571.00	8.21
3	600809	山西汾酒	27,826,339.30	7.22
4	300896	愛美客	26,679,676.52	6.93
5	300750	寧德時代	25,703,348.00	6.67
6	600887	伊利股份	22,183,552.00	5.76
7	002612	朗姿股份	21,704,363.77	5.63
8	002311	海大集團	17,072,408.40	4.43
9	603345	安井食品	16,988,685.00	4.41
10	601966	玲瓏輪胎	15,638,033.50	4.06
11	603259	藥明康德	14,903,824.78	3.87
12	600079	人福醫藥	14,659,124.00	3.81
13	603187	海容冷鏈	13,935,917.36	3.62
14	300363	博騰股份	13,799,443.80	3.58
15	600600	青島啤酒	13,298,723.00	3.45
16	603020	愛普股份	13,193,225.00	3.42
17	002036	聯創電子	12,612,429.84	3.27
18	300979	華利集團	12,358,212.53	3.21
19	603392	萬泰生物	12,286,487.30	3.19
20	600872	中炬高新	11,890,147.00	3.09
21	300357	我武生物	11,865,015.36	3.08
22	601058	賽輪輪胎	11,769,471.17	3.06
23	603882	金域醫學	11,081,596.00	2.88
24	600754	錦江酒店	11,008,596.00	2.86
25	300871	回盛生物	10,334,483.50	2.68
26	603816	顧家家居	10,089,633.55	2.62
27	688036	傳音控股	9,519,501.41	2.47
28	600779	水井坊	9,242,887.00	2.40



29	600763	通策醫療	9,100,595.88	2.36
30	300390	天華超淨	8,892,538.20	2.31
31	601888	中國中免	8,842,108.12	2.30
32	603369	今世緣	8,777,399.00	2.28
33	300122	智飛生物	8,650,888.00	2.25
34	300595	歐普康視	8,626,071.48	2.24
35	600882	妙可藍多	8,599,529.00	2.23
36	600060	海信視像	8,522,907.49	2.21
37	002568	百潤股份	8,232,563.36	2.14
38	000063	中興通訊	8,067,663.00	2.09
39	603877	太平鳥	7,971,519.00	2.07
40	601567	三星醫療	7,914,145.00	2.05
41	003021	兆威機電	7,767,231.05	2.02

註：本期累計買入金額指買入成交金額（成交單價乘以成交數量），不考慮相關交易費用。

#### 8.4.2 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	000568	瀘州老窖	29,928,194.76	7.77
2	300760	邁瑞醫療	27,791,360.04	7.21
3	000661	長春高新	24,651,482.40	6.40
4	000860	順鑫農業	23,182,921.84	6.02
5	300896	愛美客	20,838,034.08	5.41
6	600809	山西汾酒	20,708,400.88	5.38
7	002612	朗姿股份	19,931,925.00	5.17
8	600079	人福醫藥	18,507,713.93	4.80
9	601888	中國中免	17,410,335.00	4.52
10	000333	美的集團	17,120,413.21	4.44
11	002311	海大集團	15,969,817.28	4.15
12	600519	貴州茅台	15,382,180.40	3.99
13	002624	完美世界	14,761,723.00	3.83
14	600276	恒瑞醫藥	14,487,145.91	3.76
15	603369	今世緣	14,407,019.00	3.74
16	002475	立訊精密	14,062,859.91	3.65
17	603517	絕味食品	13,141,507.20	3.41
18	603345	安井食品	13,119,427.00	3.41
19	600872	中炬高新	12,741,652.77	3.31
20	300357	我武生物	12,428,456.10	3.23
21	601966	玲瓏輪胎	12,198,957.67	3.17
22	002036	聯創電子	11,764,253.00	3.05
23	002821	凱萊英	11,747,188.00	3.05
24	601058	賽輪輪胎	11,619,722.04	3.02

25	603020	愛普股份	11,562,408.00	3.00
26	600887	伊利股份	10,830,483.00	2.81
27	300015	愛爾眼科	10,684,747.99	2.77
28	603259	藥明康德	10,497,077.80	2.73
29	600779	水井坊	10,376,760.28	2.69
30	600305	恒順醋業	9,943,809.26	2.58
31	688036	傳音控股	9,556,250.21	2.48
32	300750	寧德時代	9,509,288.00	2.47
33	600882	妙可藍多	9,148,799.07	2.38
34	600754	錦江酒店	8,999,570.00	2.34
35	300390	天華超淨	8,984,599.00	2.33
36	600763	通策醫療	8,898,591.00	2.31
37	603816	顧家家居	8,562,885.20	2.22
38	300595	歐普康視	8,538,902.40	2.22
39	003021	兆威機電	8,521,246.28	2.21
40	300973	立高食品	8,507,562.33	2.21
41	603392	萬泰生物	8,339,510.40	2.16
42	600885	宏發股份	8,327,870.02	2.16
43	300363	博騰股份	8,244,391.00	2.14
44	300871	回盛生物	8,226,577.30	2.14
45	300122	智飛生物	8,079,624.58	2.10
46	000858	五糧液	8,068,484.40	2.09
47	688029	南微醫學	7,811,705.46	2.03

註：本期累計賣出金額指賣出成交金額（成交單價乘以成交數量），不考慮相關交易費用。

#### 8.4.3 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	879,044,780.31
賣出股票收入（成交）總額	915,610,038.50

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。

#### 8.5 期末按債券品種分類的債券投資組合

金額單位：人民幣元

序號	債券品種	公允價值	佔基金資產淨值比例（%）
1	國家債券	-	-
2	央行票據	-	-
3	金融債券	-	-
	其中：政策性金融債	-	-
4	企業債券	-	-
5	企業短期融資券	-	-

6	中期票據	-	-
7	可轉債（可交換債）	12,961.00	0.00
8	同業存單	-	-
9	其他	-	-
10	合計	12,961.00	0.00

#### 8.6 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

金額單位：人民幣元

序號	債券代碼	債券名稱	數量（張）	公允價值	佔基金資產淨值比例（%）
1	113633	科沃轉債	100	12,961.00	-

#### 8.7 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。

#### 8.8 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。

#### 8.9 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

無。

#### 8.10 報告期末本基金投資的股指期貨交易情況說明

無。

#### 8.11 報告期末本基金投資的國債期貨交易情況說明

無。

#### 8.12 投資組合報告附註

##### 8.12.1 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沒有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。

##### 8.12.2 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。

##### 8.12.3 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	60,103.84
2	應收證券清算款	—
3	應收股利	—
4	應收利息	5,196.32
5	應收申購款	144,360.13
6	其他應收款	—
7	待攤費用	—
8	其他	—
9	合計	209,660.29

#### 8.12.4 期末持有的處於轉股期的可轉換債券明細

無。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情況的說明

無。

#### 8.12.6 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。

### § 9 基金份額持有人資訊

#### 9.1 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	14,798	3,750.01	19,452.69	0.04	55,473,205.59	99.96
大成內需 增長混合 H	11	1,144,597.66	12,590,574.23	100.00	—	—
合計	14,809	4,597.42	12,610,026.92	18.52	55,473,205.59	81.48

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。

## 9.2 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	7,637.32	0.0138
	大成內需增長混合 H	0.00	0.0000
	合計	7,637.32	0.0112

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）。

## 9.3 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

## 9.4 期末兼任私募資產管理計畫投資經理的基金經理本人及其直系親屬持有本人管理的產品情況

無。

## § 10 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	23,723,349.18	15,622,107.10

份額		
減：本報告期基金總贖回份額	34,469,384.66	12,254,964.44
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總額	55,492,658.28	12,590,574.23

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份額持有人大會決議

無。

### 11.2 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

1. 2021 年 9 月 3 日，經大成基金管理有限公司 2021 年第四次臨時股東會審議通過，選舉陳勇先生擔任公司股東監事，許國平先生不再擔任公司股東監事。

2. 2021 年 9 月 3 日，經大成基金管理有限公司第七屆監事會第六次會議審議通過，選舉陳勇先生擔任公司第七屆監事會監事會主席。

#### 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。

### 11.3 涉及基金管理人、基金財產、基金託管業務的訴訟

無。

### 11.4 基金投資策略的改變

本基金投資策略在本報告期內沒有重大改變。

### 11.5 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），本年度支付的審計費用為 65,000.00 元。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。

## 11.6 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。

## 11.7 基金租用證券公司交易單元的有關情況

## 11.7.1 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	
長江證券	2	285,620,953.71	16.03%	260,288.85	16.03%	—
東方證券	1	230,478,719.89	12.93%	210,042.42	12.93%	—
東莞證券	1	188,960,103.39	10.60%	172,202.78	10.60%	—
摩根大通	1	167,991,137.58	9.43%	153,091.13	9.43%	—
中金財富	2	166,531,270.66	9.35%	151,754.16	9.34%	—
華泰證券	1	116,177,499.42	6.52%	105,876.09	6.52%	—
光大證券	2	115,331,835.36	6.47%	105,102.00	6.47%	—
中金公司	2	102,669,036.22	5.76%	93,561.93	5.76%	—
萬聯證券	1	74,251,796.53	4.17%	67,673.01	4.17%	—
渤海證券	1	73,841,688.66	4.14%	67,292.08	4.14%	—
中信建投證券	1	66,166,906.63	3.71%	60,297.91	3.71%	—
申萬宏源	1	61,648,599.04	3.46%	56,182.13	3.46%	—
安信證券	2	48,950,851.19	2.75%	44,603.60	2.75%	—
華西證券	1	32,700,776.26	1.84%	29,802.96	1.84%	—
招商證券	3	25,796,448.31	1.45%	23,507.12	1.45%	—
海通證券	2	20,854,679.36	1.17%	19,004.64	1.17%	—

開源證券	1	4,035,475.03	0.23%	3,677.69	0.23%	—
財信證券	1	—	—	—	—	—
長城證券	1	—	—	—	—	—
東海證券	1	—	—	—	—	—
東吳證券	1	—	—	—	—	—
東興證券	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	—	—	—	—	—
恒泰證券	1	—	—	—	—	—
華寶證券	1	—	—	—	—	—
華福證券	1	—	—	—	—	—
華林證券	1	—	—	—	—	—
華鑫證券	1	—	—	—	—	—
江海證券	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	—	—	—	—	—
中國銀河證券	1	—	—	—	—	—
中信證券	3	—	—	—	—	—

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。

報告期內租用交易單元變更情況，新增交易單元：摩根大通、中信證券。退出交易單元：中泰證券、華泰證券。

### 11.7.2 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
東方證券	288,494.20	71.52%	-	-	-	-
光大證券	114,869.02	28.48%	-	-	-	-

### 11.8 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	關於再次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 12 月 31 日
2	關於旗下部分公開募集證券投資基金可投資北京證券交易所股票及相關風險提示的公告	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 11 月 16 日
3	關於終止晉城銀行股份有限公司辦理本公司旗下基金銷售業務的公告	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 11 月 12 日
4	大成內需增長混合型證券投資基金 2021 年第 3 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 10 月 27 日
5	大成基金管理有限公司旗下 122 只公募基金 2021 年中期報告提示性公告	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 08 月 31 日
6	大成內需增長混合型證券投資基金 2021 年中期報告	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 08 月 31 日
7	大成內需增長混合型證券投資基金(A 類份額)基金產品資料概要更新	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 08 月 27 日
8	大成基金管理有限公司關於變更分紅方式業務規則的公告	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 08 月 14 日
9	大成內需增長混合型證券投資基金 2021 年第 2 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 07 月 21 日

10	大成內需增長混合型證券投資基金更新招募說明書	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 07 月 14 日
11	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 06 月 30 日
12	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 05 月 27 日
13	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 05 月 13 日
14	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 04 月 22 日
15	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 04 月 12 日
16	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 03 月 30 日
17	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 03 月 23 日
18	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 03 月 11 日
19	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 01 月 22 日

## § 12 影響投資者決策的其他重要資訊

### 12.1 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。

### 12.2 影響投資者決策的其他重要資訊

無。

## § 13 備查檔案目錄

### 13.1 備查檔案目錄

- 1、中國證監會批准設立大成內需增長股票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》。

### 13.2 存放地點

備查檔案存放在本基金管理人和託管人的住所。

### 13.3 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。

## § 14 補充披露(只供香港派發)

### 14.1 補充披露 1：期末基金資產組合情況

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	13,720	28,126,000.00
中國中免	109,200	23,959,572.00
五糧液	95,100	21,174,966.00
寧德時代	29,500	17,346,000.00
瀘州老窖	45,521	11,556,416.27
金城醫學	98,800	11,003,356.00
伊利股份	245,200	10,165,992.00
愛美客	18,855	10,108,354.05
傳音控股	63,984	10,039,089.60

青島啤酒	91,400	9,048,600.00
海容冷鏈	161,260	7,651,787.00
邁瑞醫療	19,402	7,388,281.60
山西汾酒	22,900	7,231,362.00
人福醫藥	307,700	6,929,404.00
萬泰生物	29,795	6,599,592.50
博騰股份	72,405	6,476,627.25
海康威視	121,600	6,362,112.00
浙江自然	84,400	6,313,120.00
百潤股份	99,700	5,965,051.00
華利集團	60,291	5,368,913.55
中興通訊	148,200	4,964,700.00
朗姿股份	156,500	4,962,615.00
聯創電子	171,300	4,155,738.00
科沃斯	23,800	3,592,610.00
牧原股份	65,600	3,500,416.00
藥明康德	29,300	3,474,394.00
長春高新	11,100	3,012,540.00
百普賽斯	13,200	2,786,916.00
甘源食品	35,500	2,708,650.00
隆基股份	30,900	2,663,580.00
溫氏股份	136,700	2,632,842.00
安井食品	13,900	2,373,842.00
華友鈷業	21,100	2,327,541.00
偉星新材	92,200	2,242,304.00
諾唯贊	18,787	1,991,422.00
仙樂健康	45,800	1,909,860.00
海大集團	25,000	1,832,500.00
登海種業	69,400	1,789,826.00
立訊精密	34,239	1,684,558.80
玲瓏輪胎	45,700	1,670,335.00
魯商發展	124,600	1,650,950.00
可孚醫療	20,500	1,617,655.00
艾華集團	35,400	1,465,560.00
廣汽集團	94,800	1,440,012.00
衛甯健康	81,900	1,372,644.00
中牧股份	103,100	1,347,517.00
長城汽車	24,600	1,194,084.00
南僑食品	31,800	1,059,576.00
鈞達股份	14,400	1,008,000.00
能科科技	25,200	1,000,188.00
容百科技	7,765	897,478.70

邁得醫療	17,658	813,680.64
景津環保	16,700	774,546.00
長安汽車	43,400	659,246.00
旗濱集團	36,100	617,310.00
華明裝備	60,800	602,528.00
兆威機電	6,200	495,070.00
捨得酒業	1,900	431,870.00
貝泰妮	2,117	407,056.76
東鵬飲料	2,200	400,048.00
安旭生物	2,674	344,330.98
振華新材	5,745	270,934.20
歐普康視	4,300	246,691.00
凱立新材	1,941	242,625.00
雲路股份	1,632	193,359.36
中炬高新	4,500	170,865.00
通策醫療	826	164,374.00
精進電動	9,332	127,195.16
新銳股份	1,933	118,106.30
怡合達	462	41,519.94
天華超淨	400	32,400.00
內蒙新華	1,140	29,491.80
潤豐股份	483	27,183.24
蘇文電能	317	23,328.03
隆華新材	1,199	20,095.24
長江材料	310	18,376.80
歡樂家	928	16,082.24
百川暢銀	329	15,792.00
恒光股份	315	15,441.30
拓新藥業	220	14,944.60
能輝科技	290	14,207.10
百洋醫藥	462	13,998.60
粵萬年青	379	13,901.72
雷電微力	57	13,380.18
力諾特玻	647	13,250.56
密封科技	421	12,815.24
浩通科技	203	12,734.19
達嘉維康	662	12,730.26
普聯軟體	386	12,193.74
利和興	471	12,104.70
英諾鐳射	290	12,014.70
玉馬遮陽	410	11,771.10
金鷹重工	843	10,925.28

崧盛股份	201	10,813.80
華立科技	175	10,535.00
深城交	332	10,394.92
華蘭股份	201	10,019.85
東亞機械	733	9,895.50
倍傑特	444	9,359.52
中環海陸	241	9,280.91
孩子王	756	9,177.84
上海艾錄	523	8,896.23
善水科技	315	8,649.90
揚電科技	170	8,608.80
讀客文化	403	8,414.64
創益通	254	8,359.14
萬事利	344	7,856.96
爭光股份	218	7,743.36
張小泉	355	7,731.90
仕淨科技	242	7,627.84
雷爾偉	275	7,128.00
戎美股份	274	6,759.58
寧波方正	201	6,699.33
邁普醫學	108	6,476.76
超越科技	196	6,452.32
新柴股份	513	6,417.63
森赫股份	572	6,343.48
雙樂股份	205	6,135.65
中捷精工	181	6,047.21
德邁仕	303	6,035.76
百勝智能	416	5,911.36
中蘭環保	203	5,539.87
海鍋股份	153	5,524.83
奇德新材	191	5,292.61
金三江	259	4,998.70
華藍集團	286	4,761.90
保立佳	193	4,682.18
遠信工業	155	4,460.90
匯隆新材	218	4,146.36
大地海洋	144	4,086.72
邵陽液壓	140	3,474.80
合計	3,785,699	296,916,712.34
(2) 債券投資		
科沃轉債	100	12,961.00

合計	100	12,961.00
(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		296,929,673.34
銀行存款和結算備付金合計		47,904,573.92
其他各項資產		209,660.29
合計		345,043,907.55

#### 14.2 補充披露 2：投資組合變動表

序號	項目	占基金總資產的比例 (%) 2021 年 12 月 31 日	占基金總資產的比例 (%) 2020 年 12 月 31 日
1	股票	86.05	89.08
2	債券	0.00	0.03
3	買入返售金融資產	0.00	0.00

大成基金管理有限公司

2022 年 3 月 29 日