

大成內需增長混合型證券投資基金

2022 年中期報告

2022 年 6 月 30 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

送出日期：2022 年 8 月 30 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 2022 年 8 月 29 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 2022 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目錄

§ 1 重要提示及目錄	2
1.1 重要提示	2
1.2 目錄	3
§ 2 基金簡介	5
2.1 基金基本情況	5
2.2 基金產品說明	5
2.3 基金管理人和基金託管人	5
2.4 資訊披露方式	6
2.5 其他相關資料	6
§ 3 主要財務指標和基金淨值表現	6
3.1 主要會計數據和財務指標	6
3.2 基金淨值表現	7
§ 4 管理人報告	10
4.1 基金管理人及基金經理情況	10
4.2 管理人對報告期內本基金運作遵規守信情況的說明	13
4.3 管理人對報告期內公平交易情況的專項說明	13
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	14
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 淨資產（基金淨值）變動表	19
6.4 報表附註	23
§ 7 投資組合報告	49
7.1 期末基金資產組合情況	49
7.2 報告期末按行業分類的股票投資組合	50
7.3 期末按公允價值占基金資產淨值比例大小排序的所有股票投資明細	50
7.4 報告期內股票投資組合的重大變動	52
7.5 期末按債券品種分類的債券投資組合	53
7.6 期末按公允價值占基金資產淨值比例大小排序的前五名債券投資明細	53

7.7 期末按公允價值占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	54
7.8 報告期末按公允價值占基金資產淨值比例大小排序的前五名貴金屬投資明細	54
7.9 期末按公允價值占基金資產淨值比例大小排序的前五名權證投資明細	54
7.10 本基金投資股指期貨的投資政策	54
7.11 報告期末本基金投資的國債期貨交易情況說明	54
7.12 投資組合報告附註	54
§ 8 基金份額持有人資訊	55
8.1 期末基金份額持有人戶數及持有人結構	55
8.2 期末基金管理人的從業人員持有本基金的情況	55
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	56
§ 9 開放式基金份額變動	56
§ 10 重大事件揭示	56
10.1 基金份額持有人大會決議	56
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	56
10.3 涉及基金管理人、基金財產、基金託管業務的訴訟	57
10.4 基金投資策略的改變	57
10.5 為基金進行審計的會計師事務所情況	57
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	57
10.7 基金租用證券公司交易單元的有關情況	57
10.8 其他重大事件	59
§ 11 影響投資者決策的其他重要資訊	60
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	60
11.2 影響投資者決策的其他重要資訊	60
§ 12 備查檔案目錄	60
12.1 備查檔案目錄	60
12.2 存放地點	60
12.3 查閱方式	61

§ 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	68,609,082.91 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	57,395,255.76 份	11,213,827.15 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	段皓靜	許俊
	聯繫電話	0755-83183388	95566
	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		廣東省深圳市南山區海德三道 1236 號大成基金總部大廈 5 層、 27-33 層	北京市西城區複興門內大街 1 號
辦公地址		廣東省深圳市南山區海德三道 1236 號大成基金總部大廈 5 層、 27-33 層	北京市西城區複興門內大街 1 號
郵遞區號		518054	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	廣東省深圳市南山區海德三道 1236 號大成基金總部大廈 5 層、 27-33 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(2022 年 01 月 01 日-2022 年 06 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	-10,082,833.18	-2,167,323.22
本期利潤	-11,591,552.85	-3,313,064.84
加權平均基金份 額本期利潤	-0.2079	-0.2847
本期加權平均淨 值利潤率	-4.78%	-6.54%
本期基金份額淨 值增長率	-4.18%	-4.22%

3.1.2 期末數據 和指標	報告期末(2022 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利潤	190,433,917.08	37,177,998.88
期末可供分配基金份額利潤	3.3179	3.3154
期末基金資產淨值	272,607,065.45	53,232,836.13
期末基金份額淨值	4.750	4.747
3.1.3 累計期末 指標	報告期末(2022 年 6 月 30 日)	
基金份額累計淨值增長率	375.00%	138.06%

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）扣除相關費用和信用減值損失後的餘額，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	11.14%	1.16%	7.65%	0.86%	3.49%	0.30%
過去三個月	14.76%	1.47%	5.26%	1.14%	9.50%	0.33%
過去六個月	-4.18%	1.51%	-6.92%	1.16%	2.74%	0.35%

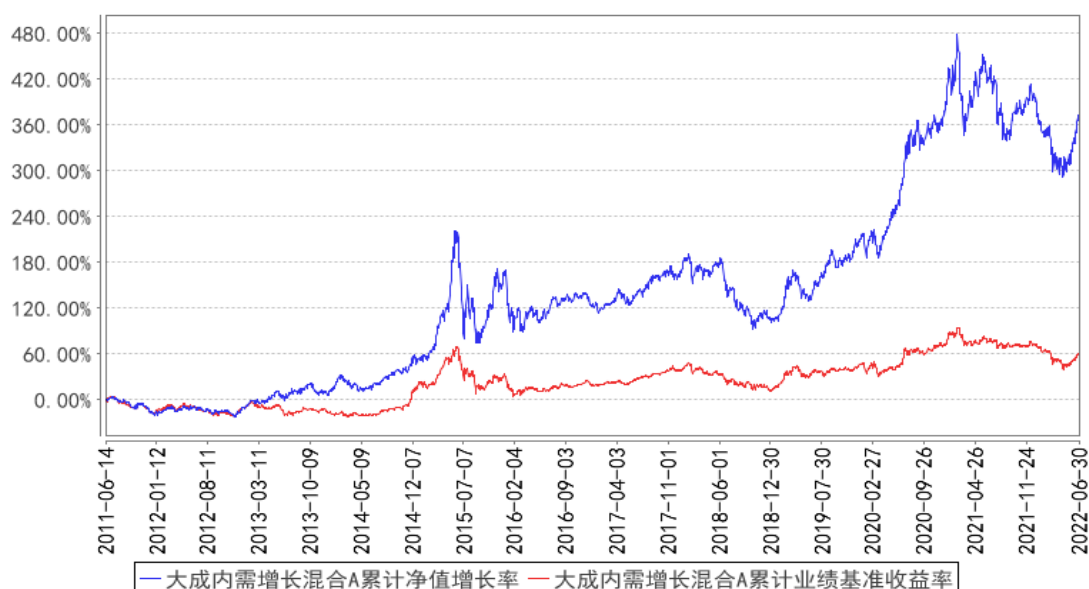
過去一年	-11.20%	1.49%	-10.37%	1.00%	-0.83%	0.49%
過去三年	91.38%	1.46%	17.55%	1.01%	73.83%	0.45%
自基金合同生效起 至今	375.00%	1.60%	61.04%	1.14%	313.96 %	0.46%

大成內需增長混合 H

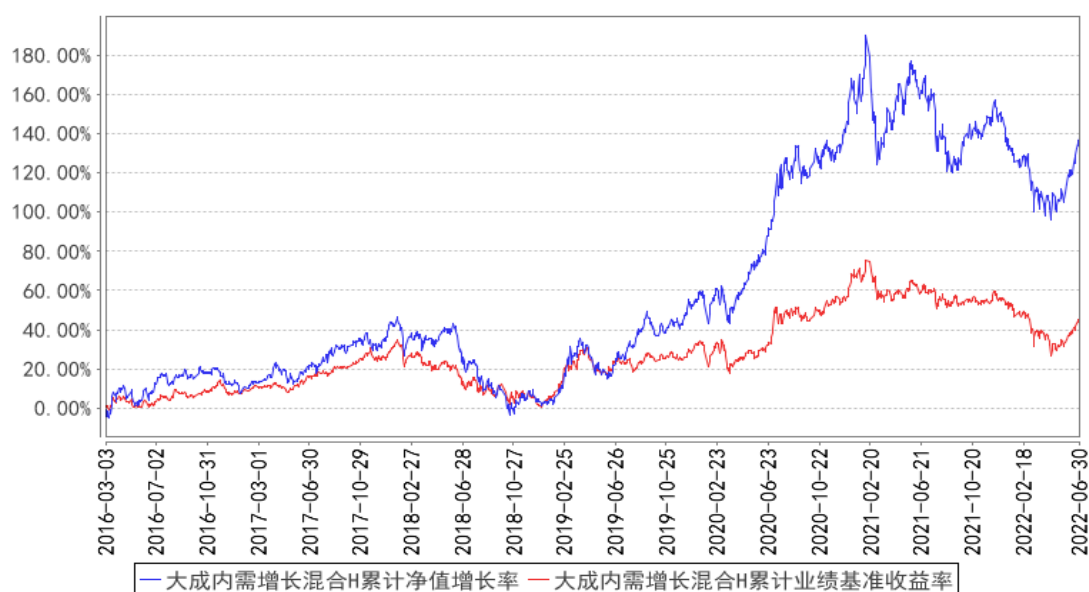
階段	份額淨 值增長 率①	份額淨值 增長率標 準差②	業績比較基 準收益率③	業績比較基準 收益率標準差 ④	①—③	②—④
過去一個月	11.09%	1.16%	7.65%	0.86%	3.44%	0.30%
過去三個月	14.72%	1.47%	5.26%	1.14%	9.46%	0.33%
過去六個月	-4.22%	1.51%	-6.92%	1.16%	2.70%	0.35%
過去一年	-11.22%	1.49%	-10.37%	1.00%	-0.85%	0.49%
過去三年	91.18%	1.46%	17.55%	1.01%	73.63%	0.45%
自基金合同生效起 至今	138.06%	1.37%	45.32%	0.95%	92.74%	0.42%

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H類基金份額於2016年3月3日初次確認申購。

2、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有關約定。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。

3、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 23 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	—	12 年	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
孫丹	本基金基金經理助理，固定收益總部副總監	2020 年 7 月 6 日	—	14 年	美國德克薩斯 A&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

				<p>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、固定收益總部總監助理，現任固定收益總部副總監。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</p>
--	--	--	--	---

					<p>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。2022 年 4 月 15 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助理。2022 年 4 月 21 日起任大成聚優成長混合型證券投資基金、大成新能源混合型發起式證券投資基金、大成致遠優勢一年持有期混合型證券投資基金、大成景氣精選六個月持有期混合型證券投資基金、大成核心趨勢混合型證券投資基金、大成創新趨勢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基金經理。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。</p>
--	--	--	--	--	---

					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。2022 年 3 月 11 日起任大成民享安盈一年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
--	--	--	--	--	---

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，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 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 1 筆同日反向交易，原因為投資策略需要。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

中國經濟結構的轉型調整開始進入深水區，長期看好的方向主要包括消費升級相關的大消費板塊，受益於老齡化的醫藥板塊、受益於能源革命的新能源板塊及高端製造業，隨著基金經理能力圈的逐步擴展，本基金 2022 年上半年投資範圍較此前有所擴展和延伸，上半年以大消費板塊和醫藥板塊為底倉，包括高端及次高端白酒、食品、免稅、醫美、醫藥 CDMO 等，增配了新能源板塊和製造業板塊一些相關個股，整體倉位保持相對穩定，運行期間根據公司基本面和估值水平對組合持倉進行動態調整。

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 4.750 元，本報告期基金份額淨值增長率為-4.18%，同期業績比較基準收益率為-6.92%；截至本報告期末大成內需增長混合 H 的基金份額淨值為 4.747 元，本報告期基金份額淨值增長率為-4.22%，同期業績比較基準收益率為-6.92%。

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。長期：經濟調結構的大方向沒有變化，未來 20 年較為重要的因素即能源革命、消費升級、高端製造及老齡化。

短期：經濟目前整體處於疫後復蘇的進程中，大部分行業不可避免或多或少受到了疫情的影響，上半年市場的深度回調已經充分反映了疫情的負面影響，目前經濟和市場均處於修復中。

在上半年的疫情影響下，我們仍然關注到了部分行業表現出了極強的需求韌性，比如新能源汽車滲透率進一步提升，比如風電光伏裝機需求依然強勁，比如白酒行業的集中度提升仍在繼續，高端及次高端白酒仍在保持穩健增長，比如國貨國潮依然在引領消費趨勢，比如部分醫美龍頭在拉新量急劇減少的情況下還能通過老客複購維持不錯的增長，比如全球的創新藥行業仍在保持增長且訂單仍然在持續向中國轉移等等。

同時目前經濟受到了地產的拖累，在長期的轉型目標中，地產未來扮演的角色將越來越弱，地產行業也將進一步整合，信用程度最高的龍頭將長期受益於集中度提升，而在地產整體長期趨於下行的背景下，地產產業鏈將會面臨較為嚴峻的挑戰，將同時面臨市場萎縮和競爭加劇的問題。

未來持續看好的方向仍為消費升級、新能源及醫藥三大方向，消費升級代表的是人對美好生活極致追求的體現，新能源則是人類曆史上非常重要的一次能源革命，例如 2025 年新能源車滲透率極有可能超過 50%甚至 60%，電池技術層出不窮不斷迭代，而老齡化則是中國在未來 30 年逃脫不了必須面對的一個難題。

基金經理將持續在上述方向內挖掘優秀公司力求為持有人創造超額收益。

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、固定收益總部、研究部、指數與期貨投資部、大類資產配置部、權益專戶投資部、國際業務部、交易管理部、風險管理部、監察稽核部、基金運營部指定人員組成。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七名投資組合經理。

股票投資部、固定收益總部、研究部、指數與期貨投資部、大類資產配置部、權益專戶投資部、國際業務部、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交易的債券品種的估值數據，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：2022 年 6 月 30 日

單位：人民幣元

資 產	附註號	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
資 產：			
銀行存款	6.4.7.1	46,573,713.46	47,492,999.03
結算備付金		222,696.02	411,574.89
存出保證金		38,373.01	60,103.84
交易性金融資產	6.4.7.2	285,490,385.72	296,929,673.34
其中：股票投資		285,490,385.72	296,916,712.34
基金投資		—	—
債券投資		—	12,961.00
資產支援證券投資		—	—
貴金屬投資		—	—
其他投資		—	—
衍生金融資產	6.4.7.3	—	—
買入返售金融資產	6.4.7.4	—	—
債權投資	6.4.7.5	—	—
其中：債券投資		—	—
資產支援證券投資		—	—
其他投資		—	—
其他債權投資	6.4.7.6	—	—
其他權益工具投資	6.4.7.7	—	—
應收清算款		—	—
應收股利		—	—
應收申購款		119,507.30	144,360.13
遞延所得稅資產		—	—
其他資產	6.4.7.8	—	5,196.32
資產總計		332,444,675.51	345,043,907.55
負債和淨資產	附註號	本期末	上年度末

		2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
負 債：			
短期借款		-	-
交易性金融負債		-	-
衍生金融負債	6.4.7.3	-	-
賣出回購金融資產款		-	-
應付清算款		5,359,024.35	6,414,480.83
應付贖回款		446,481.82	181,075.41
應付管理人報酬		366,644.76	438,752.81
應付託管費		61,107.45	73,125.45
應付銷售服務費		-	-
應付投資顧問費		-	-
應交稅費		-	-
應付利潤		-	-
遞延所得稅負債		-	-
其他負債	6.4.7.9	371,515.55	451,614.29
負債合計		6,604,773.93	7,559,048.79
淨資產：			
實收基金	6.4.7.10	68,609,082.91	68,083,232.51
其他綜合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利潤	6.4.7.12	257,230,818.67	269,401,626.25
淨資產合計		325,839,901.58	337,484,858.76
負債和淨資產總計		332,444,675.51	345,043,907.55

註： 報告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份額總額 68,609,082.91 份，其中大成內需增長混合 A 基金份額總額為 57,395,255.76 份，基金份額淨值 4.750 元。大成內需增長混合 H 基金份額總額為 11,213,827.15 份，基金份額淨值 4.747 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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

單位：人民幣元

項 目	附註號	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期間 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、營業總收入		-12,243,572.43	20,670,947.11
1. 利息收入		79,706.67	99,129.05
其中：存款利息收入	6.4.7.13	79,706.67	99,121.84
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）		-9,692,534.93	59,182,067.44
其中：股票投資收益	6.4.7.14	-11,301,454.63	57,441,301.57
基金投資收益		-	-
債券投資收益	6.4.7.15	102,020.55	18,949.05
資產支援證券投資收益	6.4.7.16	-	-
貴金屬投資收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	1,506,899.15	1,721,816.82
以攤餘成本計量的金融資產終止確認產生的收益		-	-
其他投資收益		-	-
3. 公允價值變動收益（損失以“-”號填列）	6.4.7.20	-2,654,461.29	-38,738,388.61
4. 匯兌收益（損失以“-”號填列）		-	-
5. 其他收入（損失以“-”號填列）	6.4.7.21	23,717.12	128,139.23
減：二、營業總支出		2,661,045.26	5,007,973.24
1. 管理人報酬	6.4.10.2.1	2,183,284.67	3,015,674.89
2. 託管費	6.4.10.2.2	363,880.73	502,612.47
3. 銷售服務費	6.4.10.2.3	-	-
4. 投資顧問費		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：賣出回購金融資產支出		-	-
6. 信用減值損失	6.4.7.22	-	-
7. 稅金及附加		0.22	0.04
8. 其他費用	6.4.7.23	113,879.64	1,489,685.84
三、利潤總額（虧損總額以“-”號填列）		-14,904,617.69	15,662,973.87
減：所得稅費用		-	-
四、淨利潤（淨虧損以“-”號填列）		-14,904,617.69	15,662,973.87
五、其他綜合收益的稅後淨額		-	-
六、綜合收益總額		-14,904,617.69	15,662,973.87

6.3 淨資產（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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

單位：人民幣元

項目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	實收基金	其他綜合收益	未分配利潤	淨資產合計
一、上期 期 末 淨 資 產 (基 金 淨 值)	68,083,232.51	—	269,401,626.25	337,484,858.76
加：會計 政 策 變 更	—	—	—	—
前 期 差 錯 更 正	—	—	—	—
其 他	—	—	—	—
二、本期 期 初 淨 資 產 (基 金 淨 值)	68,083,232.51	—	269,401,626.25	337,484,858.76
三、本期 增 減 變 動 額 (減 少 以 “— ” 號 填 列)	525,850.40	—	-12,170,807.58	-11,644,957.18
(一)、 綜 合 收 益 總 額	—	—	-14,904,617.69	-14,904,617.69
(二)、 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)	525,850.40	—	2,733,810.11	3,259,660.51
其中：1. 基 金 申 購 款	6,742,128.05	—	23,384,850.36	30,126,978.41
2 . 基 金 贖 回 款	-6,216,277.65	—	-20,651,040.25	-26,867,317.90

(三)、 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)	-	-	-	-
(四)、 其他綜 合收益 結轉留 存收益	-	-	-	-
四、本期 期末淨 資產(基 金淨值)	68,609,082.91	-	257,230,818.67	325,839,901.58
項目	上年度可比期間 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	實收基金	其他綜合收益	未分配利潤	淨資產合計
一、上期 期末淨 資產(基 金淨值)	75,462,125.33	-	309,743,814.37	385,205,939.70
加:會計 政策變 更	-	-	-	-
前期差 錯更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期 期初淨 資產(基 金淨值)	75,462,125.33	-	309,743,814.37	385,205,939.70
三、本期 增減變 動額(減 少以“-” 號填列)	4,282,674.04	-	37,014,919.56	41,297,593.60

(一)、 綜合收益總額	-	-	15,662,973.87	15,662,973.87
(二)、 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)	4,282,674.04	-	21,351,945.69	25,634,619.73
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
(三)、 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)	-	-	-	-
(四)、 其他綜合收益 結轉留存收益	-	-	-	-
四、本期 期末淨資產(基 金淨值)	79,744,799.37	-	346,758,733.93	426,503,533.30

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：

譚曉岡範瑛孫蕊

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 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、存托憑證占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%。

6.4.2 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 6.4.4 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。

6.4.3 遵循企業會計準則及其他有關規定的聲明

本基金 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期間的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 2022 年 6 月 30 日的財務狀況以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期間的經營成果和淨資產變動情況等有關資訊。

6.4.4 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

除下文中涉及的變更外，本基金本報告期所採用的其他會計政策、會計估計與最近一期年度會計報表所採用的會計政策、會計估計一致。

6.4.4.1 金融資產和金融負債的分類

新金融工具準則

金融工具，是指形成一方的金融資產並形成其他方的金融負債或權益工具的合同。當本基金成為金融工具合同的一方時，確認相關的金融資產或金融負債。

(1) 金融資產

金融資產於初始確認時分類為：以攤餘成本計量的金融資產、以公允價值計量且其變動計入其他綜合收益的金融資產及以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產。金融資產的分類取決於本基金管理金融資產的業務模式和金融資產的合同現金流量特徵。本基金現無金融資產分類為以公允價值計量且其變動計入其他綜合收益的金融資產。

債務工具

本基金持有的債務工具是指從發行方角度分析符合金融負債定義的工具，分別採用以下兩種方式進行計量：

以攤餘成本計量：

本基金管理以攤餘成本計量的金融資產的業務模式為以收取合同現金流量為目標，且以攤餘成本計量的金融資產的合同現金流量特徵與基本借貸安排相一致，即在特定日期產生的現金流量，僅為對本金和以未償付本金金額為基礎的利息的支付。本基金持有的以攤餘成本計量的金融資產主要為銀行存款、買入返售金融資產和其他各類應收款項等。

以公允價值計量且其變動計入當期損益：

本基金將持有的未劃分為以攤餘成本計量的債務工具，以公允價值計量且其變動計入當期損益。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主要為債券投資，在資產負債表中以交易性金融資產列示。

權益工具

權益工具是指從發行方角度分析符合權益定義的工具。本基金將對其沒有控制、共同控制和重大影響的權益工具(主要為股票投資)按照公允價值計量且其變動計入當期損益，在資產負債表中列示為交易性金融資產。

(2) 金融負債

金融負債於初始確認時分類為以攤餘成本計量的金融負債和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。本基金持有的以攤餘成本計量的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。

(3) 衍生金融工具

本基金將持有的衍生金融工具以公允價值計量且其變動計入當期損益，在資產負債表中列示為衍生金融資產/負債。

原金融工具準則(截至 2021 年 12 月 31 日前適用的原金融工具準則)

本基金於 2022 年 1 月 1 日起執行新金融工具準則，但選擇不重述比較資訊。因此，比較資訊繼續適用本基金以前年度的如下會計政策。

(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。

6.4.4.2. 金融資產和金融負債的初始確認、後續計量和終止確認

新金融工具準則

金融資產或金融負債在初始確認時以公允價值計量。對於以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產和金融負債，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，確認為應計利息，包含在交易性金融資產的賬面價值中。對於其他類別的金融資產和金融負債，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。

本基金對於以攤餘成本計量的金融資產，以預期信用損失為基礎確認損失準備。

本基金考慮有關過去事項、當前狀況以及對未來經濟狀況的預測等合理且有依據的資訊，以發生違約的風險為權重，計算合同應收的現金流量與預期能收到的現金流量之間差額的現值的機率加權金額，確認預期信用損失。

於每個資產負債表日，本基金對於處於不同階段的金融工具的預期信用損失分別進行計量。金融工具自初始確認後信用風險未顯著增加的，處於第一階段，本基金按照未來 12 個月內的預期信用損失計量損失準備；金融工具自初始確認後信用風險已顯著增加但尚未發生信用減值的，處於第二階段，本基金按照該工具整個存續期的預期信用損失計量損失準備；金融工具自初始確認後已經發生信用減值的，處於第三階段，本基金按照該工具整個存續期的預期信用損失計量損失準備。

對於在資產負債表日具有較低信用風險的金融工具，本基金假設其信用風險自初始確認後並未顯著增加，認定為處於第一階段的金融工具，按照未來 12 個月內的預期信用損失計量損失準備。

本基金對於處於第一階段和第二階段的金融工具，按照其未扣除減值準備的賬面餘額和實際利率計算利息收入。對於處於第三階段的金融工具，按照其賬面餘額減已計提減值準備後的攤餘成本和實際利率計算利息收入。

對於其他各類應收款項，無論是否存在重大融資成分，本基金均按照整個存續期的預期信用

損失計量損失準備。

本基金將計提或轉回的損失準備計入當期損益。

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。

原金融工具準則(截至 2021 年 12 月 31 日前適用的原金融工具準則)

本基金於 2022 年 1 月 1 日起執行新金融工具準則，但選擇不重述比較資訊。因此，比較資訊繼續適用本基金以前年度的如下會計政策。

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。

6.4.4.3 收入/(損失)的確認和計量

新金融工具準則

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(對於貼現債為按發行價計算的利率)或合同利率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投資收益。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扣除相關交易費用及在適用情況下由基金管理人繳納的增值稅後的淨額確認為投資收益，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。

原金融工具準則(截至 2021 年 12 月 31 日前適用的原金融工具準則)

本基金於 2022 年 1 月 1 日起執行新金融工具準則，但選擇不重述比較資訊。因此，比較資訊繼續適用本基金以前年度的如下會計政策。

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扣除在適用情況下由基金管理人繳納的增值稅後的淨額確認為投資收益，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。

6.4.5 會計政策和會計估計變更以及差錯更正的說明

6.4.5.1 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 22 號——金融工具確認和計量》、《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》及《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”)，財政部、中國銀行保險監督管理委員會於 2020 年 12 月 30 日發布了《關於進一步貫徹落實新金融工具相關會計準則的通知》，公募證券投資基金自 2022 年 1 月 1 日起執行新金融工具準則。此外，中國證監會於 2022 年頒布了修訂後的《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〉》，本基金的基金管理人已採用上述準則及通知編製本基金 2022 年度財務報表，對本基金財務報表的影響列示如下：

(a) 金融工具

根據新金融工具準則的相關規定，本基金對於首次執行該準則的累積影響數調整 2022 年年初留存收益以及財務報表其他相關項目金額，2021 年度的比較財務報表未重列。於 2021 年 12 月 31

日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均沒有指定為以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產。

(i) 於 2022 年 1 月 1 日，本財務報表中金融資產和金融負債按照原金融工具準則和新金融工具準則的規定進行分類和計量的結果對比表：

原金融工具準則下以攤餘成本計量的金融資產為銀行存款、結算備付金、存出保證金、應收利息和應收申購款，金額分別為 47,492,999.03 元、411,574.89 元、60,103.84 元、5,196.32 元和 144,360.13 元。新金融工具準則下以攤餘成本計量的金融資產為銀行存款、結算備付金、存出保證金、其他資產-應收利息和應收申購款，金額分別為 47,497,981.05 元、411,760.09 元、60,130.84 元、0.00 元和 144,360.13 元。

原金融工具準則下以公允價值計量且其變動計入當期損益計量的金融資產為交易性金融資產，金額為 296,929,673.34 元。新金融工具準則下以公允價值計量且其變動計入當期損益計量的金融資產為交易性金融資產，金額為 296,929,675.44 元。

原金融工具準則下以攤餘成本計量的金融負債為應付證券清算款、應付贖回款、應付管理人報酬、應付託管費、應付交易費用和其他負債-其他應付款，金額分別為 6,414,480.83 元、181,075.41 元、438,752.81 元、73,125.45 元、257,302.80 元和 311.49 元。新金融工具準則下以攤餘成本計量的金融負債為應付清算款、應付贖回款、應付管理人報酬、應付託管費、其他負債-應付交易費用和其他負債-其他應付款，金額分別為 6,414,480.83 元、181,075.41 元、438,752.81 元、73,125.45 元、257,302.80 元和 311.49 元。

i) 於 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的“銀行存款”、“結算備付金”、“存出保證金”、“交易性金融資產”、“買入返售金融資產”、“賣出回購金融資產款”等對應的應計利息餘額均列示在“應收利息”或“應付利息”科目中。於 2022 年 1 月 1 日，本基金根據新金融工具準則下的計量類別，將上述應計利息分別轉入“銀行存款”、“結算備付金”、“存出保證金”、“交易性金融資產”、“買入返售金融資產”、“賣出回購金融資產款”等科目項下列示，無期初留存收益影響。

(b) 修訂後的《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〉》

根據中國證監會於 2022 年頒布的修訂後的《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〉》，本基金的基金管理人在編製本財務報表時調整了部分財務報表科目的列報和披露，這些調整未對本基金財務報表產生重大影響。

6.4.6 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。

6.4.7 重要財務報表項目的說明

6.4.7.1 銀行存款

單位：人民幣元

項目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	46,573,713.46
等於：本金	46,569,798.49
加：應計利息	3,914.97
減：壞賬準備	—
定期存款	—
等於：本金	—
加：應計利息	—
減：壞賬準備	—
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	—
等於：本金	—
加：應計利息	—
減：壞賬準備	—
合計	46,573,713.46

6.4.7.2 交易性金融資產

單位：人民幣元

項目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	應計利息	公允價值	公允價值變動
股票	260,286,276.43	—	285,490,385.72	25,204,109.29
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	260,286,276.43	—	285,490,385.72	25,204,109.29

6.4.7.3 衍生金融資產/負債

6.4.7.3.1 衍生金融資產/負債期末餘額

無。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期貨合約情況

無。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黃金衍生品情況

無。

6.4.7.4 買入返售金融資產

6.4.7.4.1 各項買入返售金融資產期末餘額

無。

6.4.7.4.2 期末買斷式逆回購交易中取得的債券

無。

6.4.7.4.3 按預期信用損失一般模型計提減值準備的說明

無。

6.4.7.5 債權投資

6.4.7.5.1 債權投資情況

無。

6.4.7.5.2 債權投資減值準備計提情況

無。

6.4.7.6 其他債權投資

6.4.7.6.1 其他債權投資情況

無。

6.4.7.6.2 其他債權投資減值準備計提情況

無。

6.4.7.7 其他權益工具投資

6.4.7.7.1 其他權益工具投資情況

無。

6.4.7.7.2 報告期末其他權益工具投資情況

無。

6.4.7.8 其他資產

無。

6.4.7.9 其他負債

單位：人民幣元

項目	本期末 2022 年 6 月 30 日
應付券商交易單元保證金	—
應付贖回費	294.35
應付證券出借違約金	—
應付交易費用	272,661.05
其中：交易所市場	272,661.05
銀行間市場	—
應付利息	—
預提費用	98,560.15
合計	371,515.55

6.4.7.10 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份額（份）	賬面金額
上年度末	55,492,658.28	55,492,658.28
本期申購	6,478,239.92	6,478,239.92
本期贖回（以“-”號填列）	-4,575,642.44	-4,575,642.44
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	57,395,255.76	57,395,255.76
-----	---------------	---------------

大成內需增長混合 H

項目	本期	
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份額 (份)	賬面金額
上年度末	12,590,574.23	12,590,574.23
本期申購	263,888.13	263,888.13
本期贖回 (以“-”號填列)	-1,640,635.21	-1,640,635.21
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	11,213,827.15	11,213,827.15

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)。

6.4.7.11 其他綜合收益

無。

6.4.7.12 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
本期期初	194,140,059.70	25,452,588.83	219,592,648.53
本期利潤	-10,082,833.18	-1,508,719.67	-11,591,552.85
本期基金份額交易產生的變動數	6,376,690.56	834,023.45	7,210,714.01
其中：基金申購款	21,724,222.93	789,673.65	22,513,896.58
基金贖回款	-15,347,532.37	44,349.80	-15,303,182.57
本期已分配利潤	-	-	-
本期末	190,433,917.08	24,777,892.61	215,211,809.69

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
本期期初	44,032,706.87	5,776,270.85	49,808,977.72
本期利潤	-2,167,323.22	-1,145,741.62	-3,313,064.84
本期基金份額交易產生的變動數	-4,687,384.77	210,480.87	-4,476,903.90
其中：基金申購款	873,133.98	-2,180.20	870,953.78
基金贖回款	-5,560,518.75	212,661.07	-5,347,857.68
本期已分配利潤	-	-	-
本期末	37,177,998.88	4,841,010.10	42,019,008.98

6.4.7.13 存款利息收入

單位：人民幣元

項目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	75,842.84
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	3,501.77
其他	362.06
合計	79,706.67

6.4.7.14 股票投資收益

6.4.7.14.1 股票投資收益——買賣股票差價收入

單位：人民幣元

項目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
賣出股票成交總額	335,630,780.16
減：賣出股票成本總額	345,918,552.57
減：交易費用	1,013,682.22
買賣股票差價收入	-11,301,454.63

6.4.7.14.2 股票投資收益——證券出借差價收入

無。

6.4.7.15 債券投資收益

6.4.7.15.1 債券投資收益項目構成

單位：人民幣元

項目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
債券投資收益——利息收入	50.15
債券投資收益——買賣債券（債轉股及債券到期兌付）差價收入	101,970.40
債券投資收益——贖回差價收入	—
債券投資收益——申購差價收入	—
合計	102,020.55

6.4.7.15.2 債券投資收益——買賣債券差價收入

單位：人民幣元

項目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
賣出債券（債轉股及債券到期兌付）成交總額	510,025.00

減：賣出債券（債轉股及債券到期兌付）成本總額	408,000.00
減：應計利息總額	54.09
減：交易費用	0.51
買賣債券差價收入	101,970.40

6.4.7.16 資產支援證券投資收益

無。

6.4.7.17 貴金屬投資收益

無。

6.4.7.17.1 衍生工具收益——其他投資收益

無。

6.4.7.18 股利收益

單位：人民幣元

項目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投資產生的股利收益	1,506,899.15
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	1,506,899.15

6.4.7.19 公允價值變動收益

單位：人民幣元

項目名稱	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1. 交易性金融資產	-2,654,461.29
股票投資	-2,651,500.29
債券投資	-2,961.00
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	-2,654,461.29

6.4.7.20 其他收入

單位：人民幣元

項目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金贖回費收入	22,806.26
基金轉換費收入	910.86
合計	23,717.12

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。

6.4.7.21 信用減值損失

無。

6.4.7.22 其他費用

單位：人民幣元

項目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
審計費用	29,752.78
資訊披露費	59,507.37
證券出借違約金	—
銀行劃款手續費	5,719.49
賬戶維護費	18,600.00
其他	300.00
合計	113,879.64

6.4.7.23 分部報告

無。

6.4.8 或有事項、資產負債表日後事項的說明

6.4.8.1 或有事項

無。

6.4.8.2 資產負債表日後事項

無。

6.4.9 關聯方關係

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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、註冊登記機構、基金銷售機構
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
中銀國際證券股份有限公司（“中銀國際”）	基金託管人的關聯子公司

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。

6.4.10 本報告期及上年度可比期間的關聯方交易

無。

6.4.10.1 通過關聯方交易單元進行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金額單位：人民幣元

關聯方名稱	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期間 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	成交金額	占當期股票 成交總額的比例 (%)	成交金額	占當期股票 成交總額的比例 (%)
光大證券	98,089,099.18	14.71	107,567,663.25	11.92

6.4.10.1.2 債券交易

金額單位：人民幣元

關聯方名稱	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期間 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	成交金額	占當期債券 成交總額的比例 (%)	成交金額	占當期債券 成交總額的比例 (%)
光大證券	-	-	114,869.02	100.00

6.4.10.1.3 債券回購交易

無。

6.4.10.1.4 權證交易

無。

6.4.10.1.5 應支付關聯方的備金

金額單位：人民幣元

關聯方名稱	本期 2022年1月1日至2022年6月30日			
	當期 備金	占當期備金總量 的比例（%）	期末應付備金餘 額	占期末應付備金 總額的比例（%）
光大證券	89,391.32	14.65	-	-
關聯方名稱	上年度可比期間 2021年1月1日至2021年6月30日			
	當期 備金	占當期備金總量 的比例（%）	期末應付備金餘 額	占期末應付備金 總額的比例（%）
光大證券	98,025.77	11.92	-	-

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。

6.4.10.2 關聯方報酬

6.4.10.2.1 基金管理費

單位：人民幣元

項目	本期 2022年1月1日至2022年6 月30日	上年度可比期間 2021年1月1日至2021年 6月30日
當期發生的基金應支付的管理費	2,183,284.67	3,015,674.89
其中：支付銷售機構的客戶維護費	737,713.35	927,092.11

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。

6.4.10.2.2 基金託管費

單位：人民幣元

項目	本期 2022年1月1日至2022年6 月30日	上年度可比期間 2021年1月1日至2021年 6月30日
當期發生的基金應支付的託管費	363,880.73	502,612.47

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。

6.4.10.2.3 銷售服務費

無。

6.4.10.3 與關聯方進行銀行間同業市場的債券(含回購)交易

無。

6.4.10.4 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

6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 各關聯方投資本基金的情況

6.4.10.5.1 報告期內基金管理人運用固有資金投資本基金的情況

無。

6.4.10.5.2 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。

6.4.10.6 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期間 2021 年 1 月 1 日至 2021 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	46,573,713.46	75,842.84	52,179,550.99	93,532.79

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。

6.4.10.7 本基金在承銷期內參與關聯方承銷證券的情況

金額單位：人民幣元

本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

關聯方名稱	證券代碼	證券名稱	發行方式	基金在承銷期內買入	
				數量（單位： 張）	總金額
中銀國際證券	600938	中國海油	網下發行	120,005	1,296,054.00
光大證券	001268	聯合精密	網下發行	409	7,873.25
上年度可比期間 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日					
關聯方名稱	證券代碼	證券名稱	發行方式	基金在承銷期內買入	
				數量（單位： 張）	總金額
-	-	-	-	-	-

6.4.10.8 其他關聯交易事項的說明

無。

6.4.11 利潤分配情況

無。

6.4.12 期末(2022 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限證券

6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 受限證券類別：股票										
證券代碼	證券名稱	成功認購日	受限期	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
301117	佳緣科技	2022 年 1 月 7 日	6 個月	新股鎖定	46.80	54.44	243	11,372.40	13,228.92	-
301139	元道通信	2022 年 6 月 30 日	1 個月內（含）	新股未上市	38.46	38.46	3,153	121,264.38	121,264.38	-
301139	元道通信	2022 年 6 月 30 日	6 個月	新股鎖定	38.46	38.46	351	13,499.46	13,499.46	-
301148	嘉戎技術	2022 年 4 月 14 日	6 個月	新股鎖定	38.39	23.90	335	12,860.65	8,006.50	-
301150	中一科技	2022 年 4 月 14 日	6 個月	新股鎖定	163.56	82.76	120	13,084.80	9,931.20	2022-6-10 每股送 0.5 股
301153	中科江南	2022 年 5 月 10 日	6 個月	新股鎖定	33.68	43.98	284	9,565.12	12,490.32	-

301162	國能 日新	2022 年 4 月 19 日	6 個月	新股鎖 定	45.13	54.11	272	12,275.36	14,717.92	-
301163	宏德 股份	2022 年 4 月 11 日	6 個月	新股鎖 定	26.27	32.33	277	7,276.79	8,955.41	-
301196	唯科 科技	2022 年 1 月 4 日	6 個月	新股鎖 定	64.08	37.52	111	7,112.88	4,164.72	-
301200	大族 數控	2022 年 2 月 18 日	6 個月	新股鎖 定	76.56	51.92	172	13,168.32	8,930.24	-
301207	華蘭 疫苗	2022 年 2 月 10 日	6 個月	新股鎖 定	56.88	56.42	163	9,271.44	9,196.46	-
301216	萬凱 新材	2022 年 3 月 21 日	6 個月	新股鎖 定	35.68	29.84	332	11,845.76	9,906.88	-
301217	銅冠 銅箔	2022 年 1 月 20 日	6 個月	新股鎖 定	17.27	14.83	954	16,475.58	14,147.82	-
301219	騰遠 鋅業	2022 年 3 月 10 日	6 個月	新股鎖 定	173.98	87.82	86	8,351.04	7,552.52	2022-5-24 每股送 0.8 股
301222	浙江 恒威	2022 年 3 月 2 日	6 個月	新股鎖 定	33.98	28.96	289	9,820.22	8,369.44	-
301228	實樸 檢測	2022 年 1 月 21 日	6 個月	新股鎖 定	20.08	20.34	373	7,489.84	7,586.82	-
301248	傑創 智能	2022 年 4 月 13 日	6 個月	新股鎖 定	39.07	29.87	336	13,127.52	10,036.32	-
301258	富士 萊	2022 年 3 月 21 日	6 個月	新股鎖 定	48.30	41.68	181	8,742.30	7,544.08	-
301268	銘利 達	2022 年 3 月 29 日	6 個月	新股鎖 定	28.50	34.87	330	9,405.00	11,507.10	-
301279	金道 科技	2022 年 4 月 6 日	6 個月	新股鎖 定	31.20	22.81	253	7,893.60	5,770.93	-
301288	清研 環境	2022 年 4 月	6 個月	新股鎖 定	19.09	19.98	452	8,628.68	9,030.96	-

		14 日								
600938	中國海油	2022 年 4 月 14 日	6 個月	新股鎖定	10.80	15.86	84,004	907,243.20	1,332,303.44	-
688237	超卓航科	2022 年 6 月 24 日	1 個月內(含)	新股未上市	41.27	41.27	2,624	108,292.48	108,292.48	-
688322	奧比中光	2022 年 6 月 30 日	1 個月內(含)	新股未上市	30.99	30.99	4,461	138,246.39	138,246.39	-

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。

6.4.12.2 期末持有的暫時停牌等流通受限股票

無。

6.4.12.3 期末債券正回購交易中作為抵押的債券

6.4.12.3.1 銀行間市場債券正回購

無。

6.4.12.3.2 交易所市場債券正回購

無。

6.4.12.4 期末參與轉融通證券出借業務的證券

無。

6.4.13 金融工具風險及管理

6.4.13.1 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。

6.4.13.2 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：未持有除國債、央行票據和政策性金融債以外的債

券)。

6.4.13.3 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。

6.4.13.3.1 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占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。

6.4.13.4 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風險，包括利率風險、外匯風險和其他價格風險。

6.4.13.4.1 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、存出保證金和債券投資等。

6.4.13.4.1.1 利率風險敞口

單位：人民幣元

本期末 2022 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	46,573,713.46	-	-	-	46,573,713.46
結算備付金	222,696.02	-	-	-	222,696.02
存出保證金	38,373.01	-	-	-	38,373.01
交易性金融資產	-	-	-	285,490,385.72	285,490,385.72
應收申購款	-	-	-	119,507.30	119,507.30
資產總計	46,834,782.49	-	-	285,609,893.02	332,444,675.51
負債					
應付贖回款	-	-	-	446,481.82	446,481.82
應付管理人報酬	-	-	-	366,644.76	366,644.76
應付託管費	-	-	-	61,107.45	61,107.45
應付清算款	-	-	-	5,359,024.35	5,359,024.35
其他負債	-	-	-	371,515.55	371,515.55
負債總計	-	-	-	6,604,773.93	6,604,773.93
利率敏感度缺口	46,834,782.49	-	-	279,005,119.09	325,839,901.58
上年度末 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
應收申購款	-	-	-	144,360.13	144,360.13
其他資產	-	-	-	5,196.32	5,196.32
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

其他負債	-	-	-	451,614.29	451,614.29
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

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。

6.4.13.4.1.2 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：0.0038%），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）。

6.4.13.4.2 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风险。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。

6.4.13.4.3 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风险。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占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。

6.4.13.4.3.1 其他價格風險敞口

金額單位：人民幣元

項目	本期末 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	公允價值	占基金資產淨值比例（%）	公允價值	占基金資產淨值比例（%）
交易性金融資產—股票投資	285,490,385.72	87.62	296,916,712.34	87.98
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	285,490,385.72	87.62	296,916,712.34	87.98

6.4.13.4.3.2 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（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
分析	1. 業績比較基準上升 5%	19,154,013.11	19,345,565.23
	2. 業績比較基準下降 5%	-19,154,013.11	-19,345,565.23

6.4.14 公允價值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持續的以公允價值計量的金融工具

6.4.14.2.1 各層次金融工具的公允價值

單位：人民幣元

公允價值計量結果所屬的層次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一層次	283,595,705.01	295,626,693.53
第二層次	381,302.71	1,302,979.81
第三層次	1,513,378.00	—
合計	285,490,385.72	296,929,673.34

6.4.14.2.2 公允價值所屬層次間的重大變動

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、債券和基金的公允價值應屬第二層次還是第三層次。

6.4.14.3 非持續的以公允價值計量的金融工具的說明

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）。

6.4.14.4 不以公允價值計量的金融工具的相關說明

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。

6.4.15 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	占基金總資產的比例（%）
1	權益投資	285,490,385.72	85.88
	其中：股票	285,490,385.72	85.88
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	46,796,409.48	14.08
8	其他各項資產	157,880.31	0.05
9	合計	332,444,675.51	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）	占基金資產淨值比例（%）
A	農、林、牧、漁業	4,082,325.00	1.25
B	採礦業	5,638,980.89	1.73
C	製造業	245,025,097.75	75.20
D	電力、熱力、燃氣及水生產和供應業	—	—
E	建築業	—	—
F	批發和零售業	—	—
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	185,237.32	0.06
J	金融業	—	—
K	房地產業	7,006,698.00	2.15
L	租賃和商務服務業	13,794,089.00	4.23
M	科學研究和技術服務業	9,605,863.82	2.95
N	水利、環境和公共設施管理業	8,006.50	0.00
O	居民服務、修理和其他服務業	—	—
P	教育	—	—
Q	衛生和社會工作	144,087.44	0.04
R	文化、體育和娛樂業	—	—
S	綜合	—	—
	合計	285,490,385.72	87.62

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 期末按公允價值占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）	占基金資產淨值比例（%）
----	------	------	-------	---------	--------------

1	600519	貴州茅台	14,920	30,511,400.00	9.36
2	300750	寧德時代	40,900	21,840,600.00	6.70
3	000568	瀘州老窖	79,121	19,506,491.34	5.99
4	600031	三一重工	703,400	13,406,804.00	4.11
5	600809	山西汾酒	37,900	12,309,920.00	3.78
6	300896	愛美客	18,855	11,313,188.55	3.47
7	002304	洋河股份	61,100	11,190,465.00	3.43
8	601888	中國中免	46,900	10,924,417.00	3.35
9	600600	青島啤酒	98,200	10,204,944.00	3.13
10	603259	藥明康德	92,300	9,598,277.00	2.95
11	300760	邁瑞醫療	29,202	9,146,066.40	2.81
12	600887	伊利股份	225,700	8,791,015.00	2.70
13	000063	中興通訊	328,027	8,374,529.31	2.57
14	600690	海爾智家	299,000	8,210,540.00	2.52
15	605080	浙江自然	120,300	7,685,967.00	2.36
16	601877	正泰電器	211,300	7,560,314.00	2.32
17	601615	明陽智能	218,600	7,388,680.00	2.27
18	600048	保利發展	401,300	7,006,698.00	2.15
19	600549	廈門鎢業	321,300	6,946,506.00	2.13
20	603799	華友鈷業	70,160	6,708,699.20	2.06
21	600438	通威股份	109,100	6,530,726.00	2.00
22	000333	美的集團	106,200	6,413,418.00	1.97
23	002706	良信股份	380,100	6,283,053.00	1.93
24	688223	晶科能源	405,888	6,059,907.84	1.86
25	600938	中國海油	330,805	5,638,980.89	1.73
26	300274	陽光電源	48,700	4,784,775.00	1.47
27	603348	文燦股份	80,200	4,298,720.00	1.32
28	688297	中無人機	76,820	4,085,287.60	1.25
29	300761	立華股份	102,700	4,082,325.00	1.25
30	300751	邁為股份	6,400	3,141,760.00	0.96
31	002027	分眾傳媒	426,400	2,869,672.00	0.88
32	300850	新強聯	21,500	1,914,145.00	0.59
33	600763	通策醫療	826	144,087.44	0.04
34	688322	奧比中光	4,461	138,246.39	0.04
35	301139	元道通信	3,504	134,763.84	0.04
36	688237	超卓航科	2,624	108,292.48	0.03
37	601089	福元醫藥	1,749	36,816.45	0.01
38	301162	國能日新	272	14,717.92	0.00
39	301217	銅冠銅箔	954	14,147.82	0.00
40	301117	佳緣科技	243	13,228.92	0.00
41	301153	中科江南	284	12,490.32	0.00
42	301268	銘利達	330	11,507.10	0.00

43	001268	聯合精密	409	11,337.48	0.00
44	301248	傑創智能	336	10,036.32	0.00
45	301150	中一科技	120	9,931.20	0.00
46	301216	萬凱新材	332	9,906.88	0.00
47	301207	華蘭疫苗	163	9,196.46	0.00
48	301288	清研環境	452	9,030.96	0.00
49	301163	宏德股份	277	8,955.41	0.00
50	301200	大族數控	172	8,930.24	0.00
51	301222	浙江恒威	289	8,369.44	0.00
52	301148	嘉戎技術	335	8,006.50	0.00
53	301228	實樸檢測	373	7,586.82	0.00
54	301219	騰遠鈷業	86	7,552.52	0.00
55	301258	富士萊	181	7,544.08	0.00
56	301190	善水科技	315	7,474.95	0.00
57	301279	金道科技	253	5,770.93	0.00
58	301196	唯科科技	111	4,164.72	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	占期初基金資產淨值比例(%)
1	000333	美的集團	14,379,150.65	4.26
2	300850	新強聯	12,591,305.00	3.73
3	600031	三一重工	12,262,458.00	3.63
4	603218	日月股份	11,028,560.60	3.27
5	002304	洋河股份	9,975,386.00	2.96
6	601877	正泰電器	9,262,653.00	2.74
7	603799	華友鈷業	9,054,318.77	2.68
8	000002	萬科 A	8,828,488.00	2.62
9	600048	保利發展	8,783,132.00	2.60
10	605499	東鵬飲料	8,761,467.20	2.60
11	688223	晶科能源	7,981,331.18	2.36
12	000858	五糧液	7,936,204.27	2.35
13	002706	良信股份	7,795,460.00	2.31
14	600690	海爾智家	7,789,555.00	2.31
15	605080	浙江自然	7,617,859.00	2.26
16	300750	寧德時代	7,531,967.00	2.23
17	600549	廈門鈳業	7,296,697.37	2.16
18	000568	瀘州老窖	7,204,803.00	2.13
19	600298	安琪酵母	7,176,629.00	2.13
20	603259	藥明康德	6,292,036.00	1.86

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	占期初基金資產淨值比例(%)
1	000858	五糧液	23,632,806.38	7.00
2	601888	中國中免	18,356,402.95	5.44
3	603882	金域醫學	14,115,556.10	4.18
4	300850	新強聯	12,157,554.80	3.60
5	603218	日月股份	11,239,071.20	3.33
6	605499	東鵬飲料	9,489,699.00	2.81
7	688036	傳音控股	9,118,342.16	2.70
8	002714	牧原股份	7,738,694.00	2.29
9	000333	美的集團	7,621,120.00	2.26
10	002612	朗姿股份	7,513,544.00	2.23
11	000002	萬科 A	7,498,923.00	2.22
12	600298	安琪酵母	7,390,109.00	2.19
13	603392	萬泰生物	6,731,088.60	1.99
14	603345	安井食品	6,681,203.00	1.98
15	300724	捷佳偉創	6,569,525.00	1.95
16	603799	華友鈷業	6,033,452.00	1.79
17	603187	海容冷鏈	6,016,334.20	1.78
18	688032	禾邁股份	6,016,166.25	1.78
19	300979	華利集團	5,908,400.53	1.75
20	600079	人福醫藥	5,850,861.00	1.73

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	337,143,726.24
賣出股票收入（成交）總額	335,630,780.16

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 期末按公允價值占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 期末按公允價值占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占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 期末按公允價值占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 本基金投資股指期貨的投資政策

無。

7.11 報告期末本基金投資的國債期貨交易情況說明

7.11.1 本期國債期貨投資政策

無。

7.11.2 本期國債期貨投資評價

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

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	38,373.01
2	應收清算款	—
3	應收股利	—
4	應收利息	—
5	應收申購款	119,507.30
6	其他應收款	—
7	待攤費用	—
8	其他	—

9	合計	157,880.31
---	----	------------

7.12.4 期末持有的處於轉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	13,908	4,126.78	2,141,988.59	3.73	55,253,267.17	96.27
大成內需 增長混合 H	11	1,019,438.83	11,213,827.15	100.00	—	—
合計	13,919	4,929.17	13,355,815.74	19.47	55,253,267.17	80.53

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）	占基金總份額比例（%）
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	8,341.28	0.0145
	大成內需增長混合 H	0.00	0.0000

	合計	8,341.28	0.0122
--	----	----------	--------

註：上述占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
	大成內需增長混合 H	0
	合計	0
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	55,492,658.28	12,590,574.23
本報告期基金總申購份額	6,478,239.92	263,888.13
減：本報告期基金總贖回份額	4,575,642.44	1,640,635.21
本報告期基金拆分變動份額	—	—
本報告期期末基金份額總額	57,395,255.76	11,213,827.15

§ 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

1. 根據我司發布的《大成基金管理有限公司關於高級管理人員變更的公告》，經大成基金

管理有限公司第七屆董事會第十四次會議審議通過並履行必要程序，自 2022 年 4 月 15 日起，周立新先生因工作安排離任公司副總經理。具體事宜詳見公司公告。

2. 根據我司發布的《大成基金管理有限公司關於高級管理人員變更的公告》，經大成基金管理有限公司第七屆董事會第十五次會議審議通過並履行必要程序，自 2022 年 6 月 1 日起，趙冰女士擔任公司副總經理，段皓靜女士擔任公司督察長。自同日起趙冰女士離任公司督察長。具體事宜詳見公司公告。

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

無。

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	占當期股票成交總額的比例(%)	備金	占當期備金總額的比例(%)	
長江證券	2	360,252,811.94	54.02	329,581.98	54.01	—
開源證券	1	143,109,020.49	21.46	131,139.58	21.49	—
光大證券	2	98,089,099.18	14.71	89,391.32	14.65	—
申萬宏源	1	65,384,874.71	9.80	60,076.39	9.85	—

中信證券	3	29,905.00	0.00	14.20	0.00	-
安信證券	2	-	-	-	-	-
渤海證券	1	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
華泰證券	1	-	-	-	-	-
華西證券	1	-	-	-	-	-
華鑫證券	1	-	-	-	-	-
江海證券	1	-	-	-	-	-
民生證券	1	-	-	-	-	-
摩根大通	1	-	-	-	-	-
平安證券	1	-	-	-	-	-
太平洋證券	1	-	-	-	-	-
萬聯證券	1	-	-	-	-	-
西南證券	1	-	-	-	-	-
湘財證券	1	-	-	-	-	-
招商證券	3	-	-	-	-	-
中國銀河證券	1	-	-	-	-	-
中金財富	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中信建投證券	1	-	-	-	-	-
中信證券華南	1	-	-	-	-	-

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: 無。本報告期內本基金退租交易單元: 無。

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	占當期債券成交總額的比例 (%)	成交金額	占當期債券回購成交總額的比例 (%)	成交金額	占當期權證成交總額的比例 (%)
長江證券	510,025.00	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	2022 年 06 月 30 日
2	大成基金管理有限公司關於旗下部分基金增加泰信財富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	2022 年 06 月 28 日
3	大成基金管理有限公司關於旗下基金投資關聯方承銷證券的公告	中國證監會基金電子披露網站、規定報刊及本公司網站	2022 年 06 月 25 日
4	大成基金管理有限公司關於高級管理人員變更的公告	中國證監會基金電子披露網站、規定報刊及本公司網站	2022 年 06 月 02 日
5	大成內需增長混合型證券投資基金 2022 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	2022 年 04 月 22 日
6	大成基金管理有限公司關於旗下基金投資關聯方承銷證券的公告	中國證監會基金電子披露網站、規定報刊及本公司網站	2022 年 04 月 16 日
7	大成基金管理有限公司關於高級管理	中國證監會基金電子披	2022 年 04 月 16 日

	人員變更的公告	露網站、規定報刊及本公司網站	
8	大成內需增長混合型證券投資基金 2021 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	2022 年 03 月 29 日
9	大成基金管理有限公司關於旗下部分基金增加北京中植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	2022 年 03 月 25 日
10	大成基金管理有限公司關於公司固有資金擬申購旗下偏股型公募基金的公告	中國證監會基金電子披露網站、規定報刊及本公司網站	2022 年 01 月 27 日
11	大成基金管理有限公司關於旗下部分基金增加中信百信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	2022 年 01 月 25 日
12	大成內需增長混合型證券投資基金 2021 年第四季度報告	中國證監會基金電子披露網站、規定報刊及本公司網站	2022 年 01 月 21 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

2022 年 8 月 30 日