

# 大成內需增長混合型證券投資基金

## 2023 年年度報告

2023 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: 2024 年 3 月 29 日

大成內需增長混合型證券投資基金（“本基金”）

2023 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

二〇二四年三月二十九日

## § 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 2024 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 2023 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目錄

<b>§ 1 重要提示及目錄</b>	<b>3</b>
1.1 重要提示	3
1.2 目錄	4
<b>§ 2 基金簡介</b>	<b>6</b>
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
<b>§ 3 主要財務指標、基金淨值表現及利潤分配情況</b>	<b>7</b>
3.1 主要會計數據和財務指標	7
3.2 基金淨值表現	10
3.3 過去三年基金的利潤分配情況	14
<b>§ 4 管理人報告</b>	<b>14</b>
4.1 基金管理人及基金經理情況	14
4.2 管理人對報告期內本基金運作遵規守信情況的說明	17
4.3 管理人對報告期內公平交易情況的專項說明	18
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	19
4.5 管理人對宏觀經濟、證券市場及行業走勢的簡要展望	19
4.6 管理人內部有關本基金的監察稽核工作情況	20
4.7 管理人對報告期內基金估值程序等事項的說明	20
4.8 管理人對報告期內基金利潤分配情況的說明	21
4.9 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	21
<b>§ 5 託管人報告</b>	<b>21</b>
5.1 報告期內本基金託管人遵規守信情況聲明	21
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	22
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	22
<b>§ 6 審計報告</b>	<b>22</b>
<b>§ 7 年度財務報表</b>	<b>24</b>
7.1 資產負債表	24
7.2 利潤表	25
7.3 淨資產變動表	27
7.4 報表附註	28
<b>§ 8 投資組合報告</b>	<b>64</b>
8.1 期末基金資產組合情況	64
8.2 報告期末按行業分類的股票投資組合	65
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	65
8.4 報告期內股票投資組合的重大變動	68

8.5 期末按債券品種分類的債券投資組合 .....	70
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 .....	70
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 .....	70
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 .....	70
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 .....	70
8.10 本基金投資股指期貨的投資政策 .....	71
8.11 報告期末本基金投資的國債期貨交易情況說明 .....	71
8.12 投資組合報告附註 .....	71
<b>§ 9 基金份額持有人資訊 .....</b>	<b>72</b>
9.1 期末基金份額持有人戶數及持有人結構 .....	72
9.2 期末基金管理人的從業人員持有本基金的情況 .....	72
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 .....	72
9.4 期末兼任私募資產管理計劃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 .....	73
<b>§ 10 開放式基金份額變動 .....</b>	<b>73</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>73</b>
11.1 基金份額持有人大會決議 .....	73
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 .....	73
11.3 涉及基金管理人、基金財產、基金託管業務的訴訟 .....	74
11.4 基金投資策略的改變 .....	74
11.5 為基金進行審計的會計師事務所情況 .....	74
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 .....	74
11.7 基金租用證券公司交易單元的有關情況 .....	74
11.8 其他重大事件 .....	77
<b>§ 12 影響投資者決策的其他重要資訊 .....</b>	<b>79</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 .....	79
12.2 影響投資者決策的其他重要資訊 .....	79
<b>§ 13 備查檔案目錄 .....</b>	<b>80</b>
13.1 備查檔案目錄 .....	80
13.2 存放地點 .....	80
13.3 查閱方式 .....	80
<b>§ 14 補充披露(只供香港派發) .....</b>	<b>80</b>
14.1 補充披露 1: 期末基金資產組合情況 .....	80
14.2 補充披露 2: 投資組合變動表 .....	83

## § 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	66,650,095.21 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	大成內需增長混合 C
下屬分級基金的交易代碼	090015	960018	019255
報告期末下屬分級基金的份額總額	55,029,595.43 份	11,617,980.25 份	2,519.53 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	段皓靜	許俊
	聯繫電話	0755-83183388	010-66596688
	電子郵箱	office@dcfund.com.cn	fxjd_hq@bank-of-china.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	葛海蛟

## 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	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、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 期間數據和指標	2023 年		2023 年 9 月 27 日(基金合同生效日)–2023 年 12 月 31 日	2022 年			2021 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	大成內需增長混合 A	大成內需增長混合 H	大成內需	大成內需增長混合 A	大成內需增長混合 H	大成內需

			C			增 長 混 合 C			增 長 混 合 C
本期已實現收益	- 35,839,48 3.47	- 5,075,02 9.02	- 517.8 6	- 16,751,81 2.46	- 3,265,56 2.73	-	57,845,81 6.06	14,683,0 09.55	-
本期利潤	- 39,309,75 6.59	- 6,376,84 0.41	- 468.1 0	- 35,135,50 4.87	- 8,023,97 3.15	-	- 11,720,17 5.04	- 5,623,99 9.39	-
加權平均基金份額本期利潤	-0.4903	-0.5556	- 0.188 8	-0.5375	-0.7037	-	-0.1933	-0.3766	-
本期加權平均淨值利潤率	-11.56%	-13.33%	- 4.96%	-12.29%	-16.02%	-	-3.89%	-7.55%	-
本期基	-12.60%	-12.58%	- 4.69%	-12.55%	-12.59%	-	-2.90%	-2.90%	-



金 份 額 淨 值 增 長 率									
3.1 .2 期 末 數 據 和 指 標	2023 年末			2022 年末			2021 年末		
期 末 可 供 分 配 利 潤	152,575,0 13.02	32,178,0 05.78	6,971 .44	328,144,6 41.87	35,016,0 70.63	—	194,140,0 59.70	44,032,7 06.87	—
期 末 可 供 分 配 基 金 份 額 利 潤	2.7726	2.7697	2.767 0	3.2173	3.2140	—	3.4985	3.4973	—
期 末 基 金 資 產 淨 值	208,505,1 51.35	43,992,2 29.55	9,531 .90	442,131,1 56.48	47,194,9 45.78	—	275,085,3 06.81	62,399,5 51.95	—

期 末 基 金 份 額 淨 值	3.789	3.787	3.783	4.335	4.332	—	4.957	4.956	—
3.1 .3 累 計 期 末 指 標	2023 年末			2022 年末			2021 年末		
基 金 份 額 累 計 淨 值 增 長 率	278.90%	89.92%	— 4.69%	333.50%	117.25%	—	395.70%	148.55%	—

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。

## 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	①—③	②—④
----	--------------	---------------------	--------------------	----------------------	-----	-----

				④		
過去三個月	-3.91%	0.74%	-5.37%	0.63%	1.46%	0.11%
過去六個月	-13.16%	0.72%	-8.22%	0.68%	-4.94%	0.04%
過去一年	-12.60%	0.77%	-8.22%	0.68%	-4.38%	0.09%
過去三年	-25.78%	1.27%	-25.98%	0.89%	0.20%	0.38%
過去五年	83.66%	1.33%	17.40%	0.97%	66.26%	0.36%
自基金合同生效 起至今	278.90%	1.53%	31.95%	1.10%	246.95%	0.43%

大成內需增長混合 H

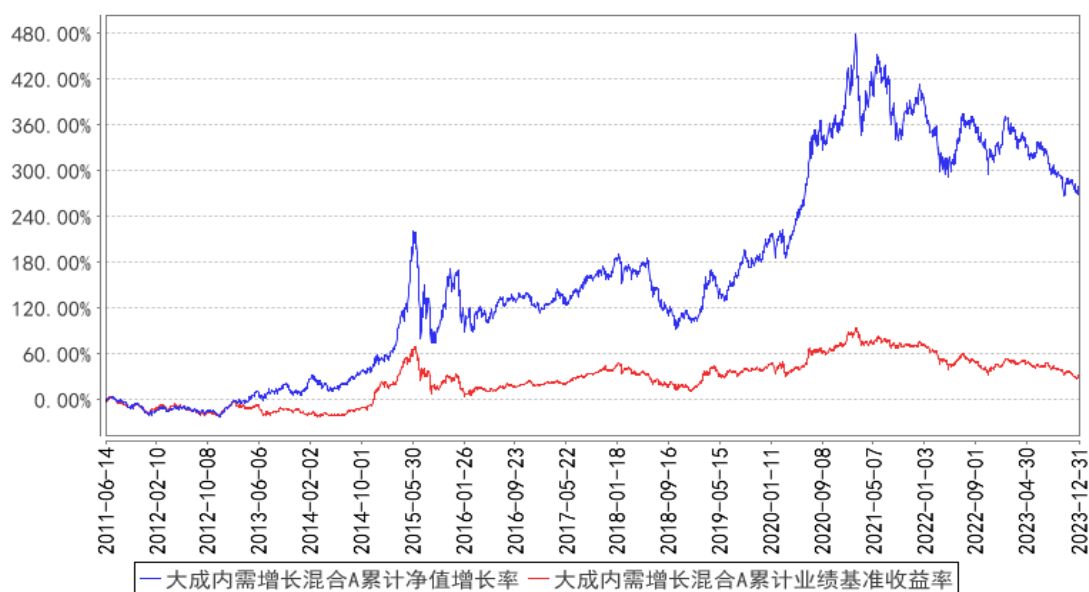
階段	份額淨值 增長率①	份額淨值 增長率標 準差②	業績比較 基準收益 率③	業績比較 基準收益 率標準差 ④	①－③	②－④
過去三個月	-3.86%	0.74%	-5.37%	0.63%	1.51%	0.11%
過去六個月	-13.08%	0.72%	-8.22%	0.68%	-4.86%	0.04%
過去一年	-12.58%	0.77%	-8.22%	0.68%	-4.36%	0.09%
過去三年	-25.80%	1.28%	-25.98%	0.89%	0.18%	0.39%
過去五年	83.57%	1.33%	17.40%	0.97%	66.17%	0.36%
自基金合同生效 起至今	89.92%	1.29%	19.07%	0.91%	70.85%	0.38%

大成內需增長混合 C

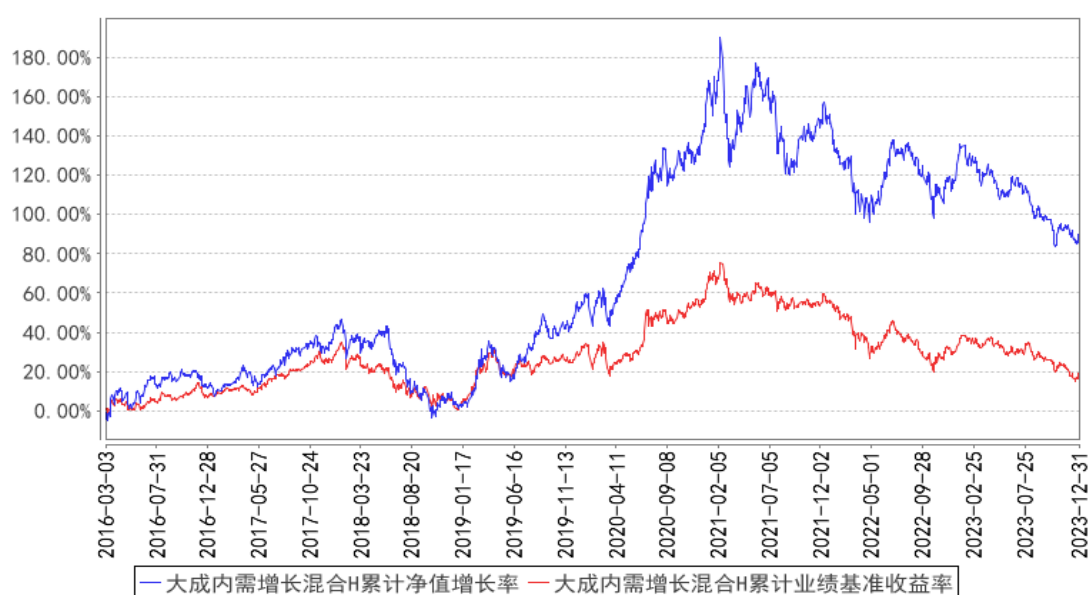
階段	份額淨值 增長率①	份額淨值 增長率標 準差②	業績比較 基準收益 率③	業績比較 基準收益 率標準差 ④	①－③	②－④
過去三個月	-4.06%	0.74%	-5.37%	0.63%	1.31%	0.11%
自基金合同生效 起至今	-4.69%	0.74%	-5.57%	0.62%	0.88%	0.12%

### 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

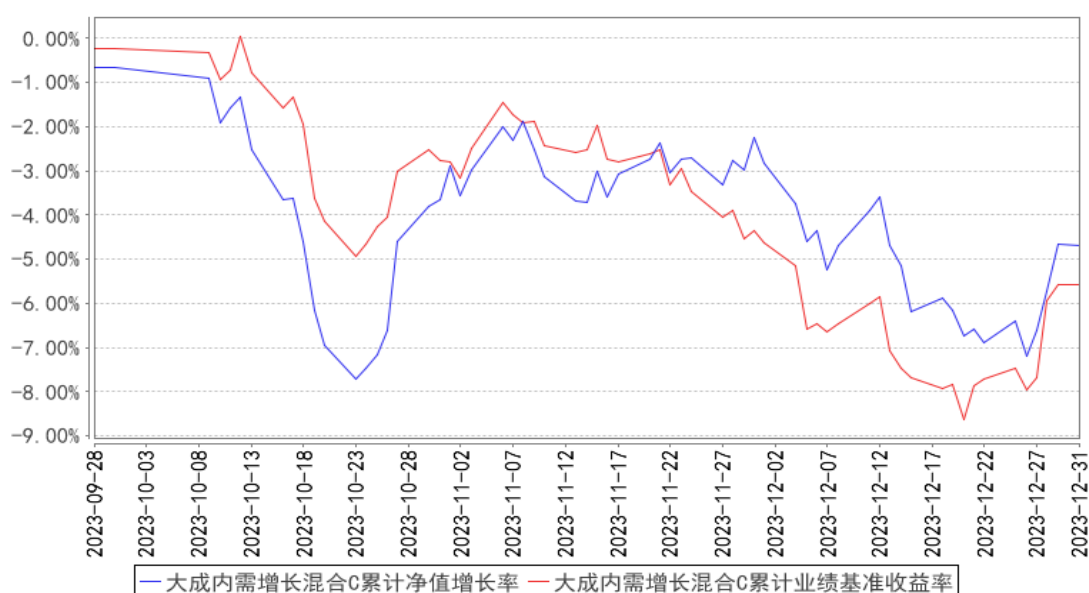
大成內需增長混合A累計淨值增長率與同期業績比較基準收益率的歷史走勢對比圖



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



大成內需增長混合C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。

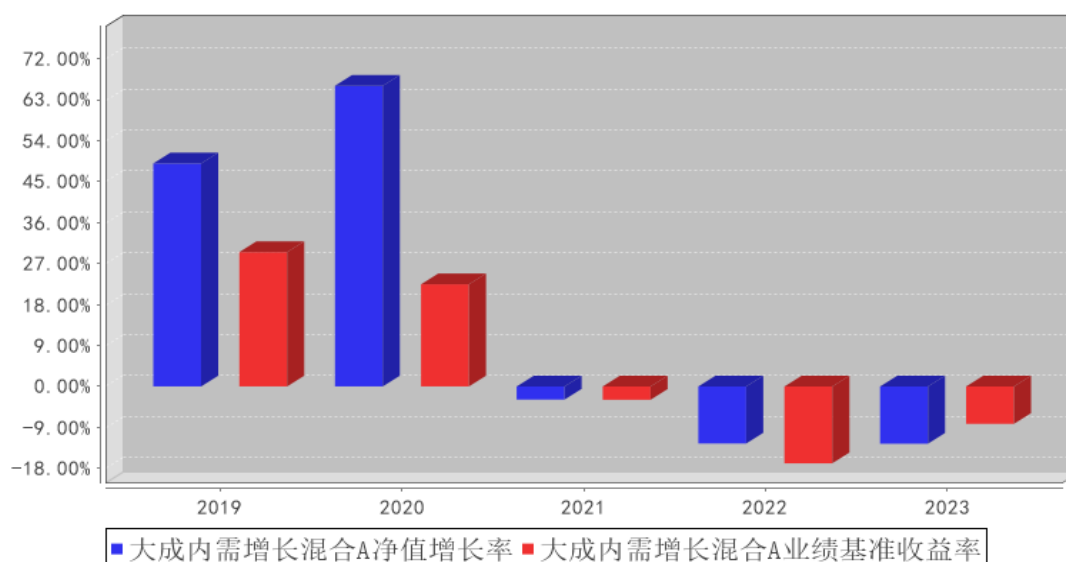
2、本基金於 2015 年 7 月 2 日基金名稱由“大成內需增長股票型證券投資基金”變更為“大成內需增長混合型證券投資基金”。

3、本基金自 2016 年 2 月 22 日起增設 H 類基金份額類別，H 類的淨值增長率和業績比較基準收益率自 2016 年 3 月 3 日有份額之日開始計算。

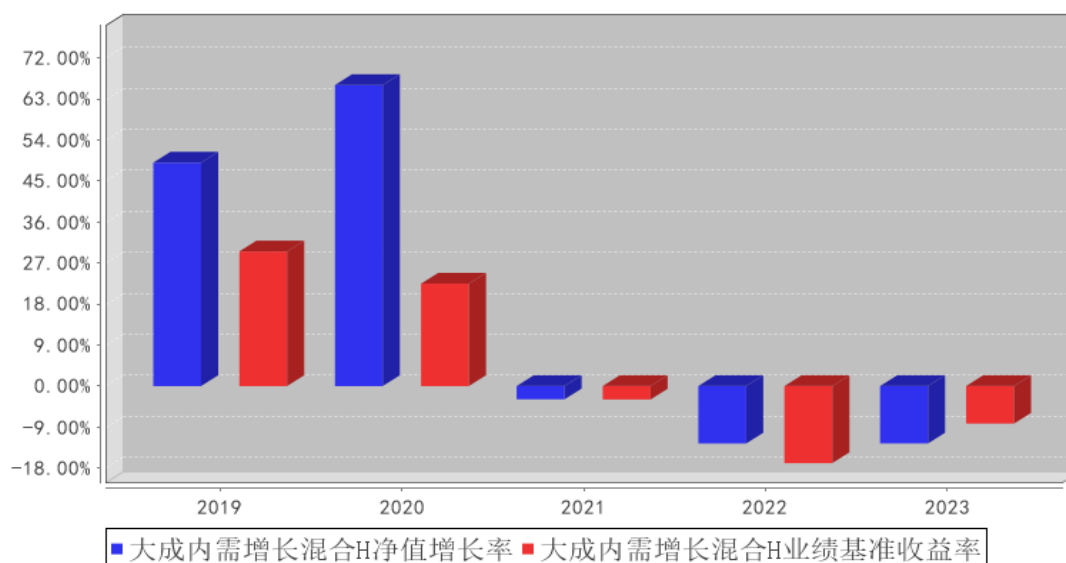
4、本基金自 2023 年 9 月 27 日起增設 C 類基金份額類別，C 類的淨值增長率和業績比較基準收益率自 2023 年 9 月 28 日有份額之日開始計算。

### 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

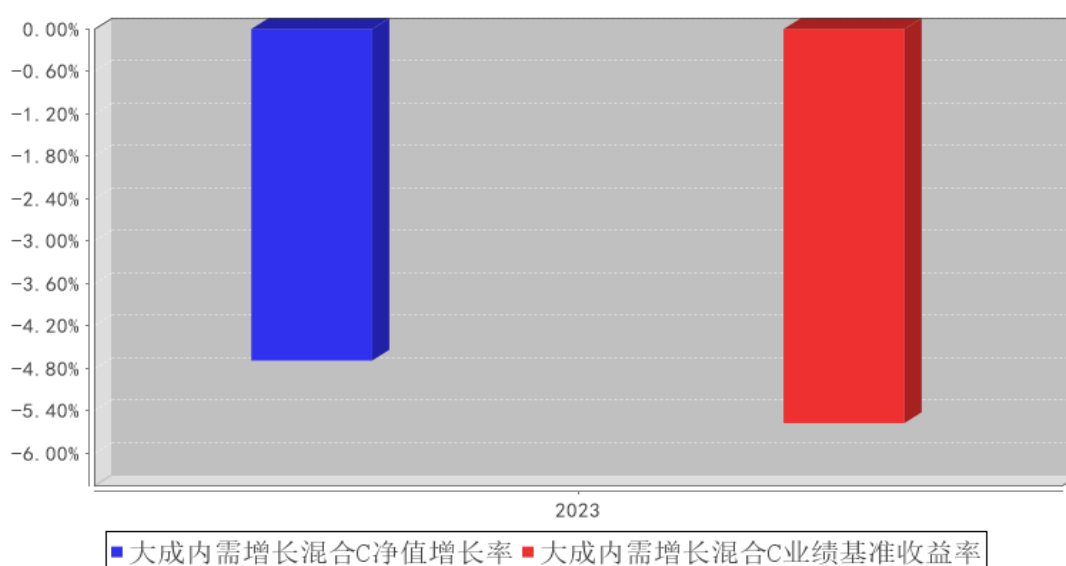
大成內需增長混合A基金每年淨值增長率與同期業績比較基準收益率的對比圖



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



大成內需增長混合C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

無。

## § 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成立於 1999 年 4 月 12 日，註冊資本人民幣 2 億元，是中國首批獲准成立的“老十家”基金管理公司之一。公司總部位於深圳，同時設置了北方、華東和南方營銷總

部，在北京、上海等地開設有 5 家分公司。2009 年，公司在香港設立大成國際資產管理有限公司，大力拓展國際業務；2013 年，設立大成創新資本管理有限公司，開拓專戶及專項管理業務。公司業務資質齊全，全面覆蓋公募基金、機構投資、海外投資、財富管理、養老金管理等業務，還受全國社會保障基金理事會委託管理部分社保基金和基本養老保險基金。旗下大成國際資產管理公司具備 QFII、RQFII 等資格，是首批首家完成備案的能夠提供港股通投資顧問服務的香港機構。歷經二十餘年的磨礪和沉澱，大成基金形成了以長期投資能力為核心的競爭優勢，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。公司目前已形成權益投資、固收投資、指數與期貨投資、跨境投資、混合資產投資、大類資產配置六大投資團隊，全面覆蓋各類投資領域，綜合實力不斷提升，各項業務迅猛發展，管理資產種類位居同業前列。

#### 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	—	13 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
方銳	本基金基金經理助理	2023 年 4 月 26 日	—	7 年	北京大學經濟學碩士。2015 年 7 月至 2016 年 11 月就職於中國人民銀行深圳市中心支行，任貨幣信貸管理處科員。2016 年 11 月加入大成基金管理有限公司，先後擔任固定收益總部助理研究員、基金經理助理、基金經理。2020 年 9 月 7 日起任大成彭博農發行債券 1-3 年指數證券投資基金、大成景旭純債債券型證券投資基金基金經理。2020 年 10 月 30 日至 2024 年 1 月 17 日任大成中債 1-3 年國開行債券指數證券投資基金基金經理。2021 年 6 月 4 月起任大成安誠債券型證券投資基金基金經理。2022 年 6 月 2 日起任大成景盈債券型證券投資基金基金經理。2022

					<p>年 7 月 27 日任大成惠興一年定期開放債券型發起式證券投資基金基金經理。2022 年 12 月 4 日起任大成穩益 90 天滾動持有債券型證券投資基金基金經理。2023 年 8 月 25 日起任大成景信債券型證券投資基金基金經理。2023 年 10 月 27 日起任大成穩安 60 天滾動持有債券型證券投資基金基金經理。2023 年 11 月 9 日起任大成景熙利率債債券型證券投資基金基金經理。具備基金從業資格。國籍：中國</p>
孫丹	本基金基金經理助理，混合資產投資部副總監	2020 年 7 月 6 日	2023 年 4 月 26 日	15 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、基金經理助理、固定收益總部總監助理、固定收益總部副總監，現任混合資產投資部副總監。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 生命周期證券投資基金基金經理。2019 年 7 月 31 日至 2020 年 5 月</p>



					<p>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 日至 2023 年 8 月 31 日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 日至 2023 年 3 月 24 日任大成尊享 18 個月持有期混合型發起式證券投資基金（原大成尊享 18 個月定期開放混合型證券投資基金轉型）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。2023 年 2 月 24 日起任大成盛享一年持有期混合型證券投資基金基金經理。2023 年 11 月 2 日起任大成元豐多利債券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中國證監會《證券基金經營機構董事、監事、高級管理人員及從業人員監督管理辦法》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，公司嚴格執行了公平交易的原則和制度。公司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價格差異較大，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，公司旗下所有投資組合未發現存在異常交易行為。公司旗下所有投資組合參與的交易所公開競價，未發生成交較少的單邊交易量超過該股當日成交量 5% 的股票同日反向交易；主動投資組合間債券交易存在 1 筆同日反向交易，原因為流動性需要。投資組合間相鄰交易日反向交易的市場成交比例、成交均價等交易結果數據表明該類交易不對市場產生重大影響，無異常。

## 4.4 管理人對報告期內基金的投資策略和業績表現的說明

### 4.4.1 報告期內基金投資策略和運作分析

經濟環境：2023 年國內地產銷售持續低迷，宏觀經濟持續面臨較大壓力，隨著樓價下跌和居民收入下降，居民消費能力和動力進一步受到壓制，在總需求受到壓制的情形下，整個內需經濟的迴圈陷入負向。

市場表現：A 股在經歷了 2020 開始的 2 年牛市行情之後，2022 年-2023 年進入持續調整期，2023 年滬深 300 指數下跌 11.38%。

基金投資回顧：本基金 2023 年主要投資的方向包括大消費板塊和醫藥板塊，細分方向包括白酒、食品、免稅、醫美、醫藥等，獲取超額收益的方向主要為醫藥。醫藥反腐之後，本基金對醫藥板塊進行了加倉，在 4 季度獲取了一些超額收益；由於消費形式嚴峻，對大消費行業尤其是部分白酒和食品進行了減倉。

本人一直認為不斷學習是基金經理實現自我迭代的唯一路徑，本人的能力圈也在持續有計劃地擴張。本基金也一直秉承在能力圈所及的範圍內精選個股的原則，儘力為投資人創造更大的超額收益。

### 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 3.789 元，本報告期基金份額淨值增長率為-12.60%，同期業績比較基準收益率為-8.22%；截至本報告期末大成內需增長混合 H 的基金份額淨值為 3.787 元，本報告期基金份額淨值增長率為-12.58%，同期業績比較基準收益率為-8.22%；截至本報告期末大成內需增長混合 C 的基金份額淨值為 3.783 元，本報告期基金份額淨值增長率為-4.69%，同期業績比較基準收益率為-5.57%。

## 4.5 管理人對宏觀經濟、證券市場及行業走勢的簡要展望

2024 年目前看可能延續 2023 年的行情，除非有較強的刺激經濟的政策出台。另一方面，我們也看到 A 股的整體估值已經到了較低的水平，下跌空間已經不大。

看好的方向包括：1) 醫藥：醫藥在過去 2 年已經經歷了較大幅度的調整，估值水平已經下降到了相對合理的水平，而老齡化的大趨勢才剛剛拉開序幕，在這個趨勢下，發病率將有較大幅度的提升，因此長期需求仍看好。此外，醫保集采已經大部分落地，集采之後報表出清的公司可以重新迎來穩定的量的增長，可挖掘機會很多；創新藥的研發也有諸多突破，國內創新藥研發的水平已經在國際佔有一席之地；2) 利潤能夠維持住、估值水平合理的高股息資產。目前的經濟增速已經不支援遍地的成長股，在經濟增速持續降檔的長周期裡，未來將考慮逐步提升估值水平合理的高股息類資產的佔比。

#### 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。估值委員會由公司各投研部門、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八名投資組合經理。

各投研部門、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。

#### 4.8 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 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”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	<p>(一) 我們審計的內容</p> <p>我們審計了大成內需增長混合型證券投資基金(以下簡稱“大成內需增長混合基金”)的財務報表,包括 2023 年 12 月 31 日的資產負債表,2023 年度的利潤表和淨資產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 2023 年 12 月 31 日的財務狀況以及 2023 年度的經營成果和淨資產變動情況。</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>
其他資訊	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”)管理層對其他資訊負責。其他資訊包括大成內需增長混合基金 2023 年年度報告中涵蓋的資訊,但不包括財務報表和我們的審計報告。

	<p>我們對財務報表發表的審計意見不涵蓋其他資訊，我們也不對其他資訊發表任何形式的鑒證結論。</p> <p>結合我們對財務報表的審計，我們的責任是閱讀其他資訊，在此過程中，考慮其他資訊是否與財務報表或我們在審計過程中了解到的情況存在重大不一致或者似乎存在重大錯報。基於我們已經執行的工作，如果我們確定其他資訊存在重大錯報，我們應當報告該事實。在這方面，我們無任何事項需要報告。</p>
管理層和治理層對財務報表的責任	<p>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</p>

	<p>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	陳熹	徐翹楚
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	2024 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：2023 年 12 月 31 日

單位：人民幣元

資 產	附註號	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>資 產：</b>			
貨幣資金	7.4.7.1	47,770,203.72	74,933,094.12
結算備付金		394,447.65	1,586,081.17
存出保證金		109,819.64	100,720.31
交易性金融資產	7.4.7.2	205,045,727.19	422,029,029.61
其中：股票投資		205,045,727.19	422,029,029.61
基金投資		—	—
債券投資		—	—
資產支援證券投資		—	—
貴金屬投資		—	—
其他投資		—	—
衍生金融資產	7.4.7.3	—	—
買入返售金融資產	7.4.7.4	—	—
債權投資	7.4.7.5	—	—
其中：債券投資		—	—
資產支援證券投資		—	—
其他投資		—	—
其他債權投資	7.4.7.6	—	—
其他權益工具投資	7.4.7.7	—	—
應收清算款		138,581.29	—
應收股利		—	—
應收申購款		51,023.84	62,830.10



遞延所得稅資產		-	-
其他資產	7.4.7.8	-	-
資產總計		253,509,803.33	498,711,755.31
負債和淨資產	附註號	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<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		-	-
應付清算款		-	7,725,424.18
應付贖回款		245,897.07	164,782.76
應付管理人報酬		256,812.48	619,205.51
應付託管費		42,802.07	103,200.91
應付銷售服務費		4.82	-
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	7.4.7.9	457,374.09	773,039.69
負債合計		1,002,890.53	9,385,653.05
<b>淨資產：</b>			
實收基金	7.4.7.10	66,650,095.21	112,889,841.80
未分配利潤	7.4.7.12	185,856,817.59	376,436,260.46
淨資產合計		252,506,912.80	489,326,102.26
負債和淨資產總計		253,509,803.33	498,711,755.31

註： 報告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份額總額 66,650,095.21 份。其中大成內需增長 A 類基金份額總額為 55,029,595.43 份，基金份額淨值 3.789 元；大成內需增長 H 類基金份額總額為 11,617,980.25 份，基金份額淨值 3.787 元；大成內需增長 C 類基金份額總額為 2,519.53 份，基金份額淨值 3.783 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

單位：人民幣元

項 目	附註號	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期間 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
<b>一、營業總收入</b>		-39,097,924.00	-37,090,391.98
1. 利息收入		216,416.02	198,900.33
其中：存款利息收入	7.4.7.13	216,416.02	198,900.33

債券利息收入		-	-
資產支援證券利息收入		-	-
買入返售金融資產收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投資收益（損失以“-”填列）		-34,841,431.04	-14,199,410.94
其中：股票投資收益	7.4.7.14	-40,613,698.07	-17,533,959.68
基金投資收益		-	-
債券投資收益	7.4.7.15	-	102,020.55
資產支援證券投資收益	7.4.7.16	-	-
貴金屬投資收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	5,772,267.03	3,232,528.19
其他投資收益		-	-
3. 公允價值變動收益（損失以“-”號填列）	7.4.7.20	-4,772,034.75	-23,142,102.83
4. 匯兌收益（損失以“-”號填列）		-	-
5. 其他收入（損失以“-”號填列）	7.4.7.21	299,125.77	52,221.46
<b>減：二、營業總支出</b>		6,589,141.10	6,069,086.04
1. 管理人報酬	7.4.10.2.1	5,447,920.48	5,003,309.56
其中：暫估管理人報酬		-	-
2. 託管費	7.4.10.2.2	907,986.71	833,884.90
3. 銷售服務費	7.4.10.2.3	14.82	-
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	7.4.7.22	-	-
7. 稅金及附加		-	0.22
8. 其他費用	7.4.7.23	233,219.09	231,891.36
<b>三、利潤總額（虧損總額以“-”號填列）</b>		-45,687,065.10	-43,159,478.02
減：所得稅費用		-	-
<b>四、淨利潤（淨虧損以“-”號填列）</b>		-45,687,065.10	-43,159,478.02
<b>五、其他綜合收益的稅後淨額</b>		-	-
<b>六、綜合收益總額</b>		-45,687,065.10	-43,159,478.02

### 7.3 淨資產變動表

會計主體：大成內需增長混合型證券投資基金

本報告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

單位：人民幣元

項目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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	112,889,841.80	-	376,436,260.46	489,326,102.26
二、本期期初淨資產	112,889,841.80	-	376,436,260.46	489,326,102.26
三、本期增減變動額(減少以“-”號填列)	-46,239,746.59	-	- 190,579,442.87	-236,819,189.46
(一)、綜合收益總額	-	-	-45,687,065.10	-45,687,065.10
(二)、本期基金份額交易產生的淨資產變動數(淨資產減少以“-”號填列)	-46,239,746.59	-	- 144,892,377.77	-191,132,124.36
其中：1. 基金申購款	15,079,186.90	-	51,387,949.08	66,467,135.98
2. 基金贖回款	-61,318,933.49	-	- 196,280,326.85	-257,599,260.34
(三)、本期向基金份額持有人分配利潤產生的淨資產變動(淨資產減少以“-”號填列)	-	-	-	-
四、本期期末淨資產	66,650,095.21	-	185,856,817.59	252,506,912.80
項目	上年度可比期間 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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	68,083,232.51	-	269,401,626.25	337,484,858.76
二、本期期初淨資產	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)	44,806,609.29	-	107,034,634.21	151,841,243.50

號填列)				
(一)、綜合收益總額	-	-	-43,159,478.02	-43,159,478.02
(二)、本期基金份額交易產生的淨資產變動數(淨資產減少以“-”號填列)	44,806,609.29	-	150,194,112.23	195,000,721.52
其中：1. 基金申購款	58,037,416.00	-	194,184,846.43	252,222,262.43
2. 基金贖回款	-13,230,806.71	-	-43,990,734.20	-57,221,540.91
(三)、本期向基金份額持有人分配利潤產生的淨資產變動(淨資產減少以“-”號填列)	-	-	-	-
四、本期期末淨資產	112,889,841.80	-	376,436,260.46	489,326,102.26

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

範瑛

梁靖

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。

根據本基金的基金管理人於 2023 年 9 月 25 日發布的《關於大成內需增長混合型證券投資基金增設 C 類基金份額並相應修訂基金合同和託管協議的公告》，自 2023 年 9 月 27 日起，本基金在現有 A 類和 H 類基金份額的基礎上增設 C 類份額。C 類基金份額為從本類別基金資產中計提銷售服務費，但不收取申購費用的基金份額。本基金 A 類基金份額、C 類基金份額和 H 類基金份額分別設置基金代碼並分別計算基金份額淨值。

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 2024 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、《資產管理產品相關會計處理規定》及其他相關規定（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 2023 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 2023 年 12 月 31 日的財務狀況以及 2023 年度的經營成果和淨資產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

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、金融負債或權益工具。

##### (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和資產支援證券投資，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。

### 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或資產支援證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。

本基金考慮在資產負債表日無須付出不必要的額外成本和努力即可獲得的有關過去事項、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。

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。

#### 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、資產支援證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。

本基金髮行的份額作為可回售工具具備以下特徵：(1) 賦予基金份額持有人在基金清算時按比例份額獲得該基金淨資產的權利，這裡所指基金淨資產是扣除所有優先於該基金份額對基金資產要求權之後的剩餘資產；這裡所指按比例份額是清算時將基金的淨資產分拆為金額相等的單位，並且將單位金額乘以基金份額持有人所持有的單位數量；(2) 該工具所屬的類別次於其他所有工具類別，即本基金份額在歸屬於該類別前無須轉換為另一種工具，且在清算時對基金資產沒有優先於其他工具的要求權；(3) 該工具所屬的類別中（該類別次於其他所有工具類別），所有工具具有相同的特徵（例如它們必須都具有可回售特徵，並且用於計算回購或贖回價格的公式或其他方法都相同）；(4) 除了發行方應當以現金或其他金融資產回購或贖回該基金份額的合同義務外，該工具不滿足金融負債定義中的任何其他特徵；(5) 該工具在存續期內的預計現金流量總額，應當實質上基於該基金存續期內基金的損益、已確認淨資產的變動、已確認和未確認淨資產的公允價值變動（不包括本基金的任何影響）。

可回售工具，是指根據合同約定，持有方有權將該工具回售給發行方以獲取現金或其他金融資產的權利，或者在未來某一不確定事項發生或者持有方死亡或退休時，自動回售給發行方的金融工具。

本基金沒有同時具備下列特徵的其他金融工具或合同：(1) 現金流量總額實質上基於基金的損益、已確認淨資產的變動、已確認和未確認淨資產的公允價值變動（不包括該基金或合同的任何影響）；(2) 實質上限制或固定了上述工具持有方所獲得的剩餘回報。

本基金將實收基金分類為權益工具，列報於淨資產。

#### 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淨資產比例計算的金額。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淨資產比例計算的金額。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。債券投資和資產支援證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和資產支援證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扣除按票面利率(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後的淨額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。

#### 7.4.4.10 費用的確認和計量

本基金的管理人報酬、託管費和銷售服務費在費用涵蓋期間按基金合同約定的費率和計算方法確認。

以攤餘成本計量的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淨資產轉出。

#### 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、債券投資和資產支援證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(可轉換債券和可交換債券除外)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》及中國基金業協會中基協字[2022]566 號《關於發布〈關於固定收益品種的估值處理標準〉的通知》之附件《關於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(可轉換債券和可交換債券除外)，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

本基金本報告期未發生會計政策變更。

##### 7.4.5.2 會計估計變更的說明

本基金本報告期未發生會計估計變更。

##### 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 日前取得的基金、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基金份額淨值、非貨物期貨結算價格作為買入價計算銷售額。

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

(3) 對於內地投資者持有的基金類別，對基金取得的企業債券利息收入，應由發行債券的企業在向基金支付利息時代扣代繳 20% 的個人所得稅。對基金從上市公司取得的股息紅利所得，持股期限在 1 個月以內(含 1 個月)的，其股息紅利所得全額計入應納稅所得額；持股期限在 1 個月以上至 1 年(含 1 年)的，暫減按 50% 計入應納稅所得額；持股期限超過 1 年的，暫免徵收個人所得稅。對基金持有的上市公司限售股，解禁後取得的股息、紅利收入，按照上述規定計算納稅，持股時間自解禁日起計算；解禁前取得的股息、紅利收入繼續暫減按 50% 計入應納稅所得額。上述所得統一適用 20% 的稅率計征個人所得稅。

對於香港市場投資者通過基金互認持有的基金類別，對基金取得的企業債券利息收入，應由

發行債券的企業在向該內地基金分配利息時按照 7% 的稅率代扣代繳所得稅。對基金從上市公司取得的股息紅利所得，應由內地上市公司向該內地基金分配股息紅利時按照 10% 的稅率代扣代繳所得稅。

(4) 基金賣出股票按 0.1% 的稅率繳納股票交易印花稅，買入股票不徵收股票交易印花稅。根據財政部、國家稅務總局公告 2023 年第 39 號《關於減半徵收證券交易印花稅的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，證券交易印花稅實施減半徵收。

(5) 本基金的城市維護建設稅、教育費附加和地方教育費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 貨幣資金

單位：人民幣元

項目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	47,770,203.72	74,933,094.12
等於：本金	47,765,495.96	74,926,695.66
加：應計利息	4,707.76	6,398.46
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	47,770,203.72	74,933,094.12

##### 7.4.7.2 交易性金融資產

單位：人民幣元

項目	本期末 2023 年 12 月 31 日			
	成本	應計利息	公允價值	公允價值變動
股票	205,101,294.19	—	205,045,727.19	-55,567.00
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		205,101,294.19	-	205,045,727.19	-55,567.00
項目	上年度末 2022 年 12 月 31 日				
		成本	應計利息	公允價值	公允價值變動
股票		417,312,561.86	-	422,029,029.61	4,716,467.75
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		417,312,561.86	-	422,029,029.61	4,716,467.75

#### 7.4.7.3 衍生金融資產/負債

##### 7.4.7.3.1 衍生金融資產/負債期末餘額

無。

##### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期貨合約情況

無。

##### 7.4.7.3.3 期末基金持有的黃金衍生品情況

無。

#### 7.4.7.4 買入返售金融資產

##### 7.4.7.4.1 各項買入返售金融資產期末餘額

無。

##### 7.4.7.4.2 期末買斷式逆回購交易中取得的債券

無。

##### 7.4.7.4.3 按預期信用損失一般模型計提減值準備的說明

無。

## 7.4.7.5 債權投資

## 7.4.7.5.1 債權投資情況

無。

## 7.4.7.5.2 債權投資減值準備計提情況

無。

## 7.4.7.6 其他債權投資

## 7.4.7.6.1 其他債權投資情況

無。

## 7.4.7.6.2 其他債權投資減值準備計提情況

無。

## 7.4.7.7 其他權益工具投資

## 7.4.7.7.1 其他權益工具投資情況

無。

## 7.4.7.7.2 報告期末其他權益工具投資情況

無。

## 7.4.7.8 其他資產

無。

## 7.4.7.9 其他負債

單位：人民幣元

項目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
應付券商交易單元保證金	—	—
應付贖回費	452.78	320.73
應付證券出借違約金	—	—
應付交易費用	267,621.31	583,418.96
其中：交易所市場	267,621.31	583,418.96
銀行間市場	—	—
應付利息	—	—
預提費用	189,300.00	189,300.00
合計	457,374.09	773,039.69

## 7.4.7.10 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
----	--

	基金份額（份）	賬面金額
上年度末	101,994,993.20	101,994,993.20
本期申購	12,110,030.82	12,110,030.82
本期贖回（以“-”號填列）	-59,075,428.59	-59,075,428.59
基金拆分/份額折算前	-	-
基金拆分/份額折算調整	-	-
本期申購	-	-
本期贖回（以“-”號填列）	-	-
本期末	55,029,595.43	55,029,595.43

## 大成內需增長混合 H

項目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份額（份）	賬面金額
上年度末	10,894,848.60	10,894,848.60
本期申購	2,966,636.55	2,966,636.55
本期贖回（以“-”號填列）	-2,243,504.90	-2,243,504.90
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	11,617,980.25	11,617,980.25

## 大成內需增長混合 C

項目	本期 2023 年 9 月 27 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份額（份）	賬面金額
上年度末	-	-
本期申購	2,519.53	2,519.53
本期贖回（以“-”號填列）	-	-
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	2,519.53	2,519.53

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)。

## 7.4.7.11 其他綜合收益

無。

## 7.4.7.12 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
上年度末	328,144,641.87	11,991,521.41	340,136,163.28



本期期初	328,144,641.87	11,991,521.41	340,136,163.28
本期利潤	-35,839,483.47	-3,470,273.12	-39,309,756.59
本期基金份額交易產生的變動數	-139,730,145.38	-7,620,705.39	-147,350,850.77
其中：基金申購款	38,105,474.10	3,260,675.46	41,366,149.56
基金贖回款	-177,835,619.48	-10,881,380.85	-188,717,000.33
本期已分配利潤	-	-	-
本期末	152,575,013.02	900,542.90	153,475,555.92

## 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	35,016,070.63	1,284,026.55	36,300,097.18
本期期初	35,016,070.63	1,284,026.55	36,300,097.18
本期利潤	-5,075,029.02	-1,301,811.39	-6,376,840.41
本期基金份額交易產生的變動數	2,236,964.17	214,028.36	2,450,992.53
其中：基金申購款	9,206,364.21	807,954.84	10,014,319.05
基金贖回款	-6,969,400.04	-593,926.48	-7,563,326.52
本期已分配利潤	-	-	-
本期末	32,178,005.78	196,243.52	32,374,249.30

## 大成內需增長混合 C

項目	已實現部分	未實現部分	未分配利潤合計
上年度末	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利潤	-517.86	49.76	-468.10
本期基金份額交易產生的變動數	7,489.30	-8.83	7,480.47
其中：基金申購款	7,489.30	-8.83	7,480.47
基金贖回款	-	-	-
本期已分配利潤	-	-	-
本期末	6,971.44	40.93	7,012.37

## 7.4.7.13 存款利息收入

單位：人民幣元

項目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期間 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	202,189.91	189,041.65
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	12,315.28	9,068.01
其他	1,910.83	790.67
合計	216,416.02	198,900.33

## 7.4.7.14 股票投資收益

## 7.4.7.14.1 股票投資收益項目構成

單位：人民幣元

項目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期間 2022年1月1日至2022年12 月31日
股票投資收益——買賣 股票差價收入	-40,613,698.07	-17,533,959.68
股票投資收益——贖回 差價收入	-	-
股票投資收益——申購 差價收入	-	-
股票投資收益——證券 出借差價收入	-	-
合計	-40,613,698.07	-17,533,959.68

## 7.4.7.14.2 股票投資收益——買賣股票差價收入

單位：人民幣元

項目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期間 2022年1月1日至2022年 12月31日
賣出股票成交總 額	1,223,617,662.65	736,160,655.69
減：賣出股票成本 總額	1,260,838,162.54	751,309,811.21
減：交易費用	3,393,198.18	2,384,804.16
買賣股票差價收 入	-40,613,698.07	-17,533,959.68

## 7.4.7.14.3 股票投資收益——證券出借差價收入

無。

## 7.4.7.15 債券投資收益

## 7.4.7.15.1 債券投資收益項目構成

單位：人民幣元

項目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期間 2022年1月1日至2022年12月 31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	-	101,970.40

券到期兌付) 差價收入		
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

#### 7.4.7.15.2 債券投資收益——買賣債券差價收入

單位：人民幣元

項目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期間 2022年1月1日至2022年12月 31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

#### 7.4.7.15.3 債券投資收益——贖回差價收入

無。

#### 7.4.7.15.4 債券投資收益——申購差價收入

無。

#### 7.4.7.16 資產支援證券投資收益

##### 7.4.7.16.1 資產支援證券投資收益項目構成

無。

##### 7.4.7.16.2 資產支援證券投資收益——買賣資產支援證券差價收入

無。

##### 7.4.7.16.3 資產支援證券投資收益——贖回差價收入

無。

##### 7.4.7.16.4 資產支援證券投資收益——申購差價收入

無。

## 7.4.7.17 貴金屬投資收益

## 7.4.7.17.1 貴金屬投資收益項目構成

無。

## 7.4.7.17.2 貴金屬投資收益——買賣貴金屬差價收入

無。

## 7.4.7.17.3 貴金屬投資收益——贖回差價收入

無。

## 7.4.7.17.4 貴金屬投資收益——申購差價收入

無。

## 7.4.7.18 衍生工具收益

## 7.4.7.18.1 衍生工具收益——買賣權證差價收入

無。

## 7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投資收益

無。

## 7.4.7.19 股利收益

單位：人民幣元

項目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期間 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
股票投資產生的股利收益	5,772,267.03	3,232,528.19
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	5,772,267.03	3,232,528.19

## 7.4.7.20 公允價值變動收益

單位：人民幣元

項目名稱	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期間 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
1. 交易性金融資產	-4,772,034.75	-23,142,102.83
股票投資	-4,772,034.75	-23,139,141.83
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	-4,772,034.75	-23,142,102.83

#### 7.4.7.21 其他收入

單位：人民幣元

項目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期間 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
基金贖回費收入	297,001.46	50,663.83
基金轉換費收入	2,124.31	1,557.63
合計	299,125.77	52,221.46

註：1. 本基金 A 類份額和 C 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 類份額和 C 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。

#### 7.4.7.22 信用減值損失

無。

#### 7.4.7.23 其他費用

單位：人民幣元

項目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期間 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
審計費用	60,000.00	60,000.00
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	16,019.09	14,391.36
賬戶維護費	37,200.00	37,200.00
其他	-	300.00
合計	233,219.09	231,891.36

#### 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、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
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
中銀國際證券股份有限公司（“中銀國際證券”）	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。

## 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 2023年1月1日至2023年12月 31日		上年度可比期間 2022年1月1日至2022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	14,773,519.80	0.65	118,962,291.90	7.36

## 7.4.10.1.2 債券交易

無。

## 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 2023年1月1日至2023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	13,610.24	0.65	—	—

關聯方名稱	上年度可比期間 2022年1月1日至2022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	108,620.32	7.31	49.77	0.01

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 2023年1月1日至2023年 12月31日	上年度可比期間 2022年1月1日至2022 年12月31日
當期發生的基金應支付的管理費	5,447,920.48	5,003,309.56
其中：應支付銷售機構的客戶維 護費	1,538,257.96	1,559,809.44
應支付基金管理人的淨管理費	3,909,662.52	3,443,500.12

註：自2022年1月1日至2023年7月9日止，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。

根據基金管理人大成基金於2023年7月8日發布的《大成基金管理有限公司關於調低旗下部分基金費率並修訂基金合同的公告》，自2023年7月10日起，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1.20%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×1.20%/當年天數。

##### 7.4.10.2.2 基金託管費

單位：人民幣元

項目	本期 2023年1月1日至2023年 12月31日	上年度可比期間 2022年1月1日至2022 年12月31日
當期發生的基金應支付的託管費	907,986.71	833,884.90

註：自2022年1月1日至2023年7月9日止，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。

根據基金管理人大成基金於 2023 年 7 月 8 日發布的《大成基金管理有限公司關於調低旗下部分基金費率並修訂基金合同的公告》，自 2023 年 7 月 10 日起，支付基金託管人的託管費按前一日基金資產淨值 0.20% 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×0.20%/當年天數。

#### 7.4.10.2.3 銷售服務費

單位：人民幣元

獲得銷售服務費的各關聯方名稱	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	當期發生的基金應支付的銷售服務費			
	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 C	合計
大成基金	-	-	14.82	14.82
合計	-	-	14.82	14.82
獲得銷售服務費的各關聯方名稱	上年度可比期間 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			
	當期發生的基金應支付的銷售服務費			
	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 C	合計
合計	-	-	-	-

註：支付基金銷售機構的銷售服務費按前一日 C 類基金份額的基金資產淨值 0.60% 的年費率計提，逐日累計至每月月底，按月支付給大成基金，再由大成基金計算並支付給各基金銷售機構。其計算公式為：

日銷售服務費＝前一日 C 類基金份額的基金資產淨值×0.60%/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

份額單位：份

項目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	本期 2023 年 9 月 27 日（基 金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
	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 C
基金合同生效日 （2011 年 6 月 14 日） 持有的基金份額	-	-	-
報告期初持有的基金 份額	-	-	0.00
報告期間申購/買入 總份額	-	-	2,519.53
報告期間因拆分變動 份額	-	-	-
減：報告期間贖回/賣 出總份額	-	-	0.00
報告期末持有的基金 份額	-	-	2,519.53
報告期末持有的基金 份額 佔基金總份額比例	-	-	0.00%
項目	上年度可比期間 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期間 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期間 -
	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 C
基金合同生效日 （2011 年 6 月 14 日） 持有的基金份額	-	-	-
報告期初持有的基金 份額	-	-	-
報告期間申購/買入 總份額	-	-	-
報告期間因拆分變動 份額	-	-	-
減：報告期間贖回/賣 出總份額	-	-	-

報告期末持有的基金份額	-	-	-
報告期末持有的基金份額 佔基金總份額比例	-	-	-

註：1. 期間申購/買入總份額含紅利再投(如有)、轉換入份額(如有)，期間贖回/賣出總份額含轉換出份額(如有)。

2. 基金管理人大成基金投資本基金適用的交易費率與本基金法律檔案規定一致。

#### 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期間 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	47,770,203.72	202,189.91	74,933,094.12	189,041.65

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

金額單位：人民幣元

本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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：股/張）	總金額
-	-	-	-	-	-
上年度可比期間 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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：股/張）	總金額
光大證券	001268	聯合精密	網下發行	409	7,873.25
中銀國際證券	600938	中國海油	網下發行	120,005	1,296,054.00

#### 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（2023 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	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
001239	永達股份	2023 年 12 月 4 日	6 個月	新股 鎖 定	12.05	19.92	189	2,277.45	3,764.88	-
001306	夏廈精密	2023 年 11 月 9 日	6 個月	新股 鎖 定	53.63	75.36	48	2,574.24	3,617.28	-
001326	聯域股份	2023 年 11 月 1 日	6 個月	新股 鎖 定	41.18	48.64	92	3,788.56	4,474.88	-
001358	興欣新材	2023 年 12 月 14 日	6 個月	新股 鎖 定	41.00	44.16	73	2,993.00	3,223.68	-
301251	威爾高	2023 年 8 月 30 日	6 個月	新股 鎖 定	28.88	34.59	263	7,595.44	9,097.17	-
301261	恒工精密	2023 年 6 月 29 日	6 個月	新股 鎖 定	36.90	50.85	198	7,306.20	10,068.30	-
301371	敷爾佳	2023 年 7 月 24 日	6 個月	新股 鎖 定	55.68	37.58	218	12,138.24	8,192.44	-
301381	賽維時	2023 年 7 月 5 日	6 個月	新股 鎖 定	20.45	29.69	571	11,676.95	16,952.99	-

	代	日		定						
301413	安培龍	2023年12月11日	6個月	新股鎖定	33.25	58.19	164	5,453.00	9,543.16	-
301418	協昌科技	2023年8月10日	6個月	新股鎖定	51.88	50.20	189	9,805.32	9,487.80	-
301421	波長光電	2023年8月16日	6個月	新股鎖定	29.38	59.37	332	9,754.16	19,710.84	-
301459	豐茂股份	2023年12月6日	6個月	新股鎖定	31.90	39.84	208	6,635.20	8,286.72	-
301468	博盈特焊	2023年7月12日	6個月	新股鎖定	47.58	30.22	441	20,982.78	13,327.02	-
301487	盟固利	2023年8月1日	6個月	新股鎖定	5.32	40.96	867	4,612.44	35,512.32	-
301489	思泉新材	2023年10月16日	6個月	新股鎖定	41.66	64.11	128	5,332.48	8,206.08	-
301498	乖寶寵物	2023年8月9日	6個月	新股鎖定	39.99	38.81	306	12,236.94	11,875.86	-
301505	蘇州規劃	2023年7月12日	6個月	新股鎖定	26.35	35.81	194	5,111.90	6,947.14	-
301507	民生健康	2023年8月24日	6個月	新股鎖定	10.00	15.85	851	8,510.00	13,488.35	-
301509	金凱生	2023年7月26日	6個月	新股鎖	56.56	62.23	232	13,121.92	14,437.36	-

	科	日		定						
301511	德福科技	2023年8月8日	6個月	新股鎖定	28.00	22.67	477	13,356.00	10,813.59	-
301516	中遠通	2023年12月1日	6個月	新股鎖定	6.87	15.51	604	4,149.48	9,368.04	-
301517	陝西華達	2023年10月9日	6個月	新股鎖定	26.87	43.69	185	4,970.95	8,082.65	-
301525	儒競科技	2023年8月23日	6個月	新股鎖定	99.57	81.46	99	9,857.43	8,064.54	-
301528	多浦樂	2023年8月17日	6個月	新股鎖定	71.80	68.91	128	9,190.40	8,820.48	-
301529	福賽科技	2023年8月31日	6個月	新股鎖定	36.60	37.88	165	6,039.00	6,250.20	-
301548	崇德科技	2023年9月11日	6個月	新股鎖定	66.80	58.99	94	6,279.20	5,545.06	-
301558	三態股份	2023年9月21日	6個月	新股鎖定	7.33	13.40	1,070	7,843.10	14,338.00	-
301559	中集環科	2023年9月26日	6個月	新股鎖定	24.22	18.24	331	8,016.82	6,037.44	-
301566	達利凱普	2023年12月22日	6個月	新股鎖定	8.90	22.14	576	5,126.40	12,752.64	-
301568	思泰克	2023年11月21日	6個月	新股鎖	23.23	35.58	246	5,714.58	8,752.68	-

		日		定						
301578	辰奕智能	2023年12月21日	6個月	新股鎖定	48.94	68.32	118	5,774.92	8,061.76	-
601083	錦江航運	2023年11月28日	6個月	新股鎖定	11.25	11.07	405	4,556.25	4,483.35	-
603004	鼎龍科技	2023年12月20日	6個月	新股鎖定	16.80	31.19	142	2,385.60	4,428.98	-
603062	麥加芯彩	2023年10月31日	6個月	新股鎖定	58.08	57.81	44	2,555.52	2,543.64	-
603075	熱威股份	2023年9月1日	6個月	新股鎖定	23.10	23.31	119	2,748.90	2,773.89	-
603119	浙江榮泰	2023年7月21日	6個月	新股鎖定	15.32	23.87	196	3,002.72	4,678.52	-
603193	潤本股份	2023年10月9日	6個月	新股鎖定	17.38	16.66	176	3,058.88	2,932.16	-
603231	索寶蛋白	2023年12月6日	6個月	新股鎖定	21.29	21.53	118	2,512.22	2,540.54	-
603270	金帝股份	2023年8月25日	6個月	新股鎖定	21.77	29.58	157	3,417.89	4,644.06	-
603273	天元智能	2023年10月16日	6個月	新股鎖定	9.50	18.97	178	1,691.00	3,376.66	-
603275	眾辰科	2023年8月16日	6個月	新股鎖	49.97	39.70	97	4,847.09	3,850.90	-

	技	日		定						
603276	恒興新材	2023年9月18日	6個月	新股鎖定	25.73	24.88	115	2,958.95	2,861.20	-
603296	華勤技術	2023年8月1日	6個月	新股鎖定	80.80	77.75	162	13,089.60	12,595.50	-
603373	安邦護衛	2023年12月13日	6個月	新股鎖定	19.10	34.75	88	1,680.80	3,058.00	-
688450	光格科技	2023年7月17日	6個月	新股鎖定	53.09	36.42	167	8,866.03	6,082.14	-
688549	中巨芯	2023年8月30日	6個月	新股鎖定	5.18	8.09	1,701	8,811.18	13,761.09	-
688573	信宇人	2023年8月9日	6個月	新股鎖定	23.68	28.80	285	6,748.80	8,208.00	-
688591	泰凌微	2023年8月18日	6個月	新股鎖定	24.98	28.02	447	11,166.06	12,524.94	-
688610	埃科光電	2023年7月10日	6個月	新股鎖定	73.33	51.00	275	20,165.75	14,025.00	-
688627	精智達	2023年7月11日	6個月	新股鎖定	46.77	87.72	222	10,382.94	19,473.84	-
688648	中郵科技	2023年11月6日	6個月	新股鎖定	15.18	21.43	303	4,599.54	6,493.29	-
688651	盛邦安	2023年7月19日	6個月	新股鎖	39.90	46.05	178	7,102.20	8,196.90	-

	全	日		定						
688652	京儀裝備	2023年11月22日	6個月	新股鎖定	31.95	52.25	204	6,517.80	10,659.00	-
688653	康希通信	2023年11月10日	6個月	新股鎖定	10.50	15.99	569	5,974.50	9,098.31	-
688657	浩辰軟體	2023年9月25日	6個月	新股鎖定	103.40	78.23	62	6,410.80	4,850.26	-
688702	盛科通信	2023年9月6日	6個月	新股鎖定	42.66	48.18	175	7,465.50	8,431.50	-
688716	中研股份	2023年9月13日	6個月	新股鎖定	29.66	36.39	195	5,783.70	7,096.05	-
688717	艾羅能源	2023年12月26日	6個月	新股未上市	55.66	55.66	3,288	183,010.08	183,010.08	-
688717	艾羅能源	2023年12月26日	1個月內(含)	新股未上市	55.66	55.66	1,409	78,424.94	78,424.94	-
688720	艾森股份	2023年11月29日	6個月	新股鎖定	28.03	49.84	165	4,624.95	8,223.60	-

註：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。其中基金參與網下申購獲得的新股中需要限售的部分或作為戰略投資者參與配售獲得的新股，在新股上市後的約定期限內不能自由轉讓；基金參與網上申購獲配的新股，從新股獲配日至新股上市日之間不能自由轉讓。

#### 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

#### 7.4.12.3.1 銀行間市場債券正回購

無。

#### 7.4.12.3.2 交易所市場債券正回購

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股份有限公司，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。信用等級評估以內部信用評級為主，外部信用評級為輔。內部債券信用評級主要考察發行人的經營風險、財務風險和流動性風險，以及信用產品的條款和擔保人的情況等。此外，本基金的基金管理人根據信用產品的內部評級，通過單只信用產品投資佔基金資產淨值的比例及佔發行量的比例進行控制，通過分散化投資以分散信用風險。

本期末，本基金無債券投資(上年度末：同)。

#### 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風險, 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風險。利率敏感性金融工具均面臨由於市場利率上升而導致公允價值下降的風險, 其中浮動利率類金融工具還面臨每個付息期間結束根據市場利率重新定價時對於未來現金流影響的風險。

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

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

##### 7.4.13.4.1.1 利率風險敞口

單位: 人民幣元

本期末 2023 年 12 月 31 日	1 年以內	1-5 年	5 年以上	不計息	合計
資產					
貨幣資金	47,770,203.72	-	-	-	47,770,203.72
結算備付金	394,447.65	-	-	-	394,447.65
存出保證金	109,819.64	-	-	-	109,819.64
交易性金融資產	-	-	-	205,045,727.19	205,045,727.19
應收申購款	-	-	-	51,023.84	51,023.84
應收清算款	-	-	-	138,581.29	138,581.29
資產總計	48,274,471.01	-	-	205,235,332.32	253,509,803.33
負債					
應付贖回款	-	-	-	245,897.07	245,897.07
應付管理人報酬	-	-	-	256,812.48	256,812.48
應付託管費	-	-	-	42,802.07	42,802.07
應付銷售服務費	-	-	-	4.82	4.82
其他負債	-	-	-	457,374.09	457,374.09
負債總計	-	-	-	1,002,890.53	1,002,890.53
利率敏感度缺口	48,274,471.01	-	-	204,232,441.79	252,506,912.80
上年度末	1 年以內	1-5 年	5 年以上	不計息	合計

2022 年 12 月 31 日					
資產					
貨幣資金	74,933,094.12	-	-	-	74,933,094.12
結算備付金	1,586,081.17	-	-	-	1,586,081.17
存出保證金	100,720.31	-	-	-	100,720.31
交易性金融資產	-	-	-	422,029,029.61	422,029,029.61
應收申購款	-	-	-	62,830.10	62,830.10
資產總計	76,619,895.60	-	-	422,091,859.71	498,711,755.31
負債					
應付贖回款	-	-	-	164,782.76	164,782.76
應付管理人報酬	-	-	-	619,205.51	619,205.51
應付託管費	-	-	-	103,200.91	103,200.91
應付清算款	-	-	-	7,725,424.18	7,725,424.18
其他負債	-	-	-	773,039.69	773,039.69
負債總計	-	-	-	9,385,653.05	9,385,653.05
利率敏感度缺口	76,619,895.60	-	-	-412,706,206.66	489,326,102.26

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，本基金未持有交易性債券投資（上年度末：同），因此市場利率的變動對於本基金淨資產無重大影響（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。

#### 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、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 2023 年 12 月 31 日		上年度末 2022 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	205,045,727.19	81.20	422,029,029.61	86.25
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	205,045,727.19	81.20	422,029,029.61	86.25

#### 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		
分析	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（2023 年 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	業績比較基準上升 5%	11,171,064.37	27,711,885.09
	業績比較基準下降 5%	-11,171,064.37	-27,711,885.09

#### 7.4.14 公允價值

##### 7.4.14.1 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。

##### 7.4.14.2 持續的以公允價值計量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一層次	204,275,299.50	416,338,056.95
第二層次	261,435.02	—
第三層次	508,992.67	5,690,972.66
合計	205,045,727.19	422,029,029.61

###### 7.4.14.2.2 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的公允價值應屬第二層次還是第三層次。

##### 7.4.14.2.3 第三層次公允價值餘額及變動情況

###### 7.4.14.2.3.1 第三層次公允價值餘額及變動情況

單位：人民幣元

項目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融資產		合計
	債券投資	股票投資	
期初餘額	—	5,690,972.66	5,690,972.66

當期購買	—	—	—
當期出售/結算	—	—	—
轉入第三層次	—	1,309,368.79	1,309,368.79
轉出第三層次	—	7,851,809.75	7,851,809.75
當期利得或損失總額	—	1,360,460.97	1,360,460.97
其中：計入損益的利得或損失	—	1,360,460.97	1,360,460.97
計入其他綜合收益的利得或損失	—	—	—
期末餘額	—	508,992.67	508,992.67
期末仍持有的第三層次金融資產計入本期損益的未實現利得或損失的變動——公允價值變動損益	—	107,643.00	107,643.00
項目	上年度可比期間 2022年1月1日至2022年12月31日		
	交易性金融資產		合計
	債券投資	股票投資	
期初餘額	—	—	—
當期購買	—	4,688,431.68	4,688,431.68
當期出售/結算	—	—	—
轉入第三層次	—	2,114,812.78	2,114,812.78
轉出第三層次	—	1,557,052.01	1,557,052.01
當期利得或損失總額	—	444,780.21	444,780.21
其中：計入損益的利得或損失	—	444,780.21	444,780.21
計入其他綜合收益的利得或損失	—	—	—
期末餘額	—	5,690,972.66	5,690,972.66
期末仍持有的第三層次金融資產計入本期損益的未實現利得或損失的變動——公允價值變動損益	—	-240,143.04	-240,143.04

註：於本期末，本基金持有的第三層次的交易性金融資產均為證券交易所上市交易但尚在限售期內的股票投資（上年度末：同）。

於本期，本基金從第三層次轉出的交易性金融資產均為限售期結束可正常交易的股票投資（上年度可比期間：同）。

計入損益的利得或損失分別計入利潤表中的公允價值變動損益、投資收益等項目。

## 7.4.14.2.3.2 使用重要不可觀察輸入值的第三層次公允價值計量的情況

單位：人民幣元

項目	本期末公允價值	採用的估值技術	不可觀察輸入值		
			名稱	範圍/加權平均值	與公允價值之間的關係
證券交易所上市但尚在限售期內的股票	508,992.67	平均價格亞式期權模型	預期波動率	0.1462-2.1988	負相關
項目	上年度末公允價值	採用的估值技術	不可觀察輸入值		
			名稱	範圍/加權平均值	與公允價值之間的關係
證券交易所上市但尚在限售期內的股票	5,690,972.66	平均價格亞式期權模型	預期波動率	0.1891-2.4756	負相關

## 7.4.14.3 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）。

## 7.4.14.4 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。

## 7.4.15 有助於理解和分析會計報表需要說明的其他事項

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	205,045,727.19	80.88
	其中：股票	205,045,727.19	80.88
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	—	—



	產		
7	銀行存款和結算備付金合計	48,164,651.37	19.00
8	其他各項資產	299,424.77	0.12
9	合計	253,509,803.33	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	4,126,342.00	1.63
B	採礦業	—	—
C	製造業	183,493,175.05	72.67
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	7,802,152.99	3.09
G	交通運輸、倉儲和郵政業	9,580,729.35	3.79
H	住宿和餐飲業	—	—
I	資訊傳輸、軟體和資訊技術服務業	33,322.66	0.01
J	金融業	—	—
K	房地產業	—	—
L	租賃和商務服務業	3,058.00	0.00
M	科學研究和技術服務業	6,947.14	0.00
N	水利、環境和公共設施管理業	—	—
O	居民服務、修理和其他服務業	—	—
P	教育	—	—
Q	衛生和社會工作	—	—
R	文化、體育和娛樂業	—	—
S	綜合	—	—
	合計	205,045,727.19	81.20

### 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	14,500	25,027,000.00	9.91
2	600276	恒瑞醫藥	312,600	14,138,898.00	5.60

3	300122	智飛生物	173,800	10,620,918.00	4.21
4	603056	德邦股份	661,800	9,576,246.00	3.79
5	300037	新宙邦	189,200	8,949,160.00	3.54
6	002422	科倫藥業	285,400	8,290,870.00	3.28
7	600690	海爾智家	393,500	8,263,500.00	3.27
8	300723	一品紅	263,800	7,869,154.00	3.12
9	301015	百洋醫藥	216,700	7,770,862.00	3.08
10	688278	特寶生物	143,738	7,524,684.30	2.98
11	600809	山西汾酒	31,900	7,360,287.00	2.91
12	688029	南微醫學	73,330	7,098,344.00	2.81
13	000568	瀘州老窖	39,221	7,037,031.82	2.79
14	688677	海泰新光	130,660	6,955,031.80	2.75
15	600660	福耀玻璃	177,100	6,621,769.00	2.62
16	000063	中興通訊	208,127	5,511,202.96	2.18
17	600201	生物股份	492,400	5,303,148.00	2.10
18	300760	邁瑞醫療	17,300	5,027,380.00	1.99
19	300677	英科醫療	212,000	4,952,320.00	1.96
20	002737	葵花藥業	185,700	4,824,486.00	1.91
21	688266	澤璟製藥	83,751	4,433,777.94	1.76
22	300498	溫氏股份	205,700	4,126,342.00	1.63
23	600535	天士力	220,600	3,754,612.00	1.49
24	300573	興齊眼藥	18,900	3,445,848.00	1.36
25	688513	苑東生物	45,277	2,887,767.06	1.14
26	603369	今世緣	58,200	2,837,250.00	1.12
27	300049	福瑞股份	58,500	2,550,015.00	1.01
28	002997	瑞鵬模具	75,100	2,502,332.00	0.99
29	688290	景業智能	51,630	2,466,365.10	0.98
30	600200	江蘇吳中	278,800	2,291,736.00	0.91
31	600060	海信視像	108,700	2,271,830.00	0.90
32	300705	九典製藥	41,100	1,365,753.00	0.54
33	688176	亞虹醫藥	50,747	547,052.66	0.22
34	688717	艾羅能源	4,697	261,435.02	0.10
35	603004	鼎龍科技	1,417	50,328.98	0.02
36	301487	盟固利	867	35,512.32	0.01
37	301421	波長光電	332	19,710.84	0.01
38	688627	精智達	222	19,473.84	0.01
39	301381	賽維時代	571	16,952.99	0.01
40	301509	金凱生科	232	14,437.36	0.01
41	301558	三態股份	1,070	14,338.00	0.01
42	688610	埃科光電	275	14,025.00	0.01
43	688549	中巨芯	1,701	13,761.09	0.01
44	301507	民生健康	851	13,488.35	0.01
45	301468	博盈特焊	441	13,327.02	0.01

46	301566	達利凱普	576	12,752.64	0.01
47	603296	華勤技術	162	12,595.50	0.00
48	688591	泰凌微	447	12,524.94	0.00
49	301498	乖寶寵物	306	11,875.86	0.00
50	688631	萊斯資訊	336	11,844.00	0.00
51	301511	德福科技	477	10,813.59	0.00
52	688652	京儀裝備	204	10,659.00	0.00
53	301261	恒工精密	198	10,068.30	0.00
54	301413	安培龍	164	9,543.16	0.00
55	301418	協昌科技	189	9,487.80	0.00
56	301516	中遠通	604	9,368.04	0.00
57	688653	康希通信	569	9,098.31	0.00
58	301251	威爾高	263	9,097.17	0.00
59	301528	多浦樂	128	8,820.48	0.00
60	301568	思泰克	246	8,752.68	0.00
61	688702	盛科通信	175	8,431.50	0.00
62	301459	豐茂股份	208	8,286.72	0.00
63	688720	艾森股份	165	8,223.60	0.00
64	688573	信宇人	285	8,208.00	0.00
65	301489	思泉新材	128	8,206.08	0.00
66	688651	盛邦安全	178	8,196.90	0.00
67	301371	敷爾佳	218	8,192.44	0.00
68	301517	陝西華達	185	8,082.65	0.00
69	301525	儒競科技	99	8,064.54	0.00
70	301578	辰奕智能	118	8,061.76	0.00
71	301170	錫南科技	250	7,607.50	0.00
72	688716	中研股份	195	7,096.05	0.00
73	300804	廣康生化	226	6,974.36	0.00
74	301505	蘇州規劃	194	6,947.14	0.00
75	688648	中郵科技	303	6,493.29	0.00
76	301529	福賽科技	165	6,250.20	0.00
77	688450	光格科技	167	6,082.14	0.00
78	301559	中集環科	331	6,037.44	0.00
79	301548	崇德科技	94	5,545.06	0.00
80	688657	浩辰軟體	62	4,850.26	0.00
81	603119	浙江榮泰	196	4,678.52	0.00
82	603270	金帝股份	157	4,644.06	0.00
83	601083	錦江航運	405	4,483.35	0.00
84	001326	聯域股份	92	4,474.88	0.00
85	603275	眾辰科技	97	3,850.90	0.00
86	001239	永達股份	189	3,764.88	0.00
87	001306	夏廈精密	48	3,617.28	0.00
88	603273	天元智能	178	3,376.66	0.00

89	001358	興欣新材	73	3,223.68	0.00
90	603373	安邦護衛	88	3,058.00	0.00
91	603193	潤本股份	176	2,932.16	0.00
92	603276	恒興新材	115	2,861.20	0.00
93	603075	熱威股份	119	2,773.89	0.00
94	603062	麥加芯彩	44	2,543.64	0.00
95	603231	索寶蛋白	118	2,540.54	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	603129	春風動力	29,232,654.69	5.97
2	603529	愛瑪科技	25,793,692.40	5.27
3	300760	邁瑞醫療	24,211,457.00	4.95
4	600276	恒瑞醫藥	23,806,732.33	4.87
5	002737	葵花藥業	23,413,809.38	4.78
6	603439	貴州三力	22,829,226.00	4.67
7	600031	三一重工	20,915,923.97	4.27
8	000651	格力電器	20,590,997.58	4.21
9	600572	康恩貝	20,160,191.00	4.12
10	300723	一品紅	20,068,088.93	4.10
11	603606	東方電纜	19,155,654.00	3.91
12	688111	金山辦公	18,927,893.24	3.87
13	300750	寧德時代	18,893,757.20	3.86
14	301093	華蘭股份	18,813,681.28	3.84
15	600941	中國移動	18,332,061.22	3.75
16	000063	中興通訊	18,265,605.45	3.73
17	002424	貴州百靈	18,005,522.00	3.68
18	601615	明陽智能	17,661,720.98	3.61
19	300037	新宙邦	17,194,706.60	3.51
20	688036	傳音控股	15,839,754.83	3.24
21	603259	藥明康德	15,486,399.93	3.16
22	000913	錢江摩托	15,467,514.00	3.16
23	300286	安科瑞	14,765,181.74	3.02
24	000938	紫光股份	14,701,835.40	3.00
25	688236	春立醫療	14,576,782.48	2.98
26	002946	新乳業	14,181,381.01	2.90
27	603899	晨光股份	13,768,323.00	2.81
28	300274	陽光電源	13,680,146.00	2.80
29	300498	溫氏股份	12,498,218.90	2.55
30	601318	中國平安	12,289,969.94	2.51
31	301263	泰恩康	12,208,233.00	2.49

32	600887	伊利股份	12,135,512.00	2.48
33	603668	天馬科技	11,832,539.00	2.42
34	300122	智飛生物	11,188,141.00	2.29
35	603517	絕味食品	10,909,676.08	2.23
36	603056	德邦股份	10,829,963.54	2.21
37	000100	TCL 科技	10,619,533.00	2.17
38	603279	景津裝備	10,230,161.51	2.09
39	600938	中國海油	10,199,238.00	2.08
40	688566	吉貝爾	10,154,894.20	2.08
41	600885	宏發股份	10,065,963.18	2.06

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	300750	寧德時代	36,606,947.90	7.48
2	000063	中興通訊	33,909,527.10	6.93
3	000568	瀘州老窖	31,633,673.48	6.46
4	603129	春風動力	30,670,240.25	6.27
5	600887	伊利股份	30,419,920.89	6.22
6	300274	陽光電源	29,663,886.21	6.06
7	600031	三一重工	26,572,282.50	5.43
8	600519	貴州茅台	24,919,015.20	5.09
9	603668	天馬科技	24,664,290.00	5.04
10	000596	古井貢酒	22,961,945.46	4.69
11	600941	中國移動	22,346,041.00	4.57
12	603439	貴州三力	21,486,516.00	4.39
13	300760	邁瑞醫療	21,449,736.72	4.38
14	603529	愛瑪科技	21,203,656.50	4.33
15	600276	恒瑞醫藥	19,688,164.99	4.02
16	000651	格力電器	19,527,586.83	3.99
17	603259	藥明康德	19,287,940.38	3.94
18	603606	東方電纜	19,125,047.15	3.91
19	688036	傳音控股	18,182,422.59	3.72
20	301093	華蘭股份	18,019,485.00	3.68
21	300498	溫氏股份	17,793,503.00	3.64
22	002424	貴州百靈	17,570,369.00	3.59
23	002737	葵花藥業	17,366,916.24	3.55
24	688111	金山辦公	17,286,991.83	3.53
25	601888	中國中免	17,282,816.00	3.53
26	300896	愛美客	17,263,326.55	3.53
27	600572	康恩貝	16,991,089.00	3.47
28	000938	紫光股份	16,600,728.28	3.39

29	000100	TCL 科技	15,379,993.00	3.14
30	688236	春立醫療	14,795,531.57	3.02
31	601615	明陽智能	14,794,775.44	3.02
32	300761	立華股份	13,926,978.88	2.85
33	000858	五糧液	13,553,708.00	2.77
34	301263	泰恩康	13,498,227.40	2.76
35	002946	新乳業	13,435,720.98	2.75
36	601318	中國平安	12,914,054.00	2.64
37	002853	皮阿諾	12,837,315.38	2.62
38	000913	錢江摩托	12,729,237.00	2.60
39	603899	晨光股份	12,113,854.76	2.48
40	300723	一品紅	11,804,303.00	2.41
41	300308	中際旭創	11,531,299.00	2.36
42	688223	晶科能源	11,248,668.28	2.30
43	002158	漢鐘精機	10,745,228.00	2.20
44	601138	工業富聯	10,491,211.00	2.14
45	600938	中國海油	10,217,925.00	2.09
46	688566	吉貝爾	10,060,081.80	2.06
47	300558	貝達藥業	9,996,555.00	2.04
48	600600	青島啤酒	9,984,852.10	2.04

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	1,048,626,894.87
賣出股票收入（成交）總額	1,223,617,662.65

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

無。

#### 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

無。

#### 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 本基金投資股指期貨的投資政策

無。

## 8.11 報告期末本基金投資的國債期貨交易情況說明

## 8.11.1 本期國債期貨投資政策

無。

## 8.11.2 本期國債期貨投資評價

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	109,819.64
2	應收清算款	138,581.29
3	應收股利	—
4	應收利息	—
5	應收申購款	51,023.84
6	其他應收款	—
7	待攤費用	—
8	其他	—
9	合計	299,424.77

## 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	11,436	4,811.96	2,448,936.53	4.45	52,580,658.90	95.55
大成內需 增長混合 H	11	1,056,180.02	11,617,980.25	100.00	0.00	0.00
大成內需 增長混合 C	1	2,519.53	2,519.53	100.00	0.00	0.00
合計	11,448	5,821.99	14,069,436.31	21.11	52,580,658.90	78.89

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	19,369.39	0.0352
	大成內需增長混合 H	—	—
	大成內需增長混合 C	—	—
	合計	19,369.39	0.0291

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	大成內需增長混合 A	0
	大成內需增長混合 H	0



部門負責人持有本開放式基金	大成內需增長混合 C	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	0~10
	大成內需增長混合 H	0
	大成內需增長混合 C	0
	合計	0~10

#### 9.4 期末兼任私募資產管理計劃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	大成內需增長混合 C
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	101,994,993.20	10,894,848.60	—
本報告期基金總申購份額	12,110,030.82	2,966,636.55	2,519.53
減：本報告期基金總贖回份額	59,075,428.59	2,243,504.90	—
本報告期基金拆分變動份額	—	—	—
本報告期期末基金份額總額	55,029,595.43	11,617,980.25	2,519.53

### § 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

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

理有限公司第八屆董事會第二次會議審議通過並履行必要程序，自 2023 年 3 月 25 日起，溫智敏先生因個人原因辭去公司副總經理職務。聘請石國武先生擔任公司副總經理，任期自公司八屆二次董事會決議作出之日起，至本屆董事會任期屆滿之日止。

## 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

本報告期內無涉及本基金管理人、基金財產、基金託管業務的訴訟事項。

### 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)，本年度應支付的審計費用為 60,000.00 元整。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

#### 11.6.1 管理人及其高級管理人員受稽查或處罰等情況

本報告期內，基金管理人及其相關高級管理人員無受稽查或處罰等情況。

#### 11.6.2 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，本基金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(%)	
華泰證券	1	507,856,119.98	22.46	467,905.42	22.42	—
東方證券	1	476,136,842.06	21.06	438,670.45	21.02	—
國投證券	2	224,583,275.52	9.93	207,781.87	9.96	—
華福證券	1	180,573,615.40	7.99	167,210.25	8.01	—

中信建投證券	1	141,286,814 .16	6.25	130,325.28	6.24	—
招商證券	3	135,766,999 .57	6.00	125,077.28	5.99	—
中金公司	2	119,649,855 .72	5.29	110,224.57	5.28	—
摩根大通	1	89,796,693. 09	3.97	82,730.51	3.96	—
國海證券	1	85,209,449. 83	3.77	79,748.41	3.82	—
中金財富	2	66,621,162. 74	2.95	62,351.85	2.99	—
開源證券	1	49,254,736. 65	2.18	45,491.48	2.18	—
財信證券	1	44,827,218. 57	1.98	41,401.94	1.98	—
國泰君安	1	37,496,928. 32	1.66	35,098.10	1.68	—
長江證券	2	37,222,557. 32	1.65	34,553.09	1.66	—
國信證券	1	27,547,595. 88	1.22	25,381.17	1.22	—
光大證券	2	14,773,519. 80	0.65	13,610.24	0.65	—
中信證券	3	13,041,237. 92	0.58	10,526.23	0.50	—
西部證券	1	9,679,536.2 3	0.43	9,060.38	0.43	本期 報告 新增 1 個
渤海證券	0	—	—	—	—	本期 報告 退租 1 個
長城證券	1	—	—	—	—	—
東海證券	1	—	—	—	—	—
東吳證券	2	—	—	—	—	本期 報告 新增 1 個
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	-	-	-	-	-
海通證券	2	-	-	-	-	-
恒泰證券	1	-	-	-	-	-
華寶證券	1	-	-	-	-	-
華林證券	1	-	-	-	-	-
華西證券	1	-	-	-	-	-
華鑫證券	1	-	-	-	-	-
江海證券	1	-	-	-	-	-
民生證券	1	-	-	-	-	-
平安證券	1	-	-	-	-	-
申萬宏源	1	-	-	-	-	-
太平洋證券	1	-	-	-	-	-
萬聯證券	1	-	-	-	-	-
西南證券	1	-	-	-	-	-
湘財證券	1	-	-	-	-	-
中國銀河證券	1	-	-	-	-	-
中信證券華南	1	-	-	-	-	-
中郵證券	2	-	-	-	-	本期報告新增 2 個

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。

## 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

無。

## 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	2023 年 12 月 29 日
2	大成基金管理有限公司關於旗下部分基金增加珠海盈米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	2023 年 12 月 19 日
3	大成基金管理有限公司關於旗下部分基金增加北京匯成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	2023 年 12 月 11 日
4	大成基金管理有限公司關於終止和諧保險銷售有限公司辦理旗下基金相關銷售業務的公告	中國證監會基金電子披露網站、規定報刊及本公司網站	2023 年 11 月 29 日
5	大成基金管理有限公司關於旗下部分基金增加貴州銀行股份有限公司為代銷機構的公告	中國證監會基金電子披露網站、規定報刊及本公司網站	2023 年 11 月 22 日
6	大成基金管理有限公司關於旗下部分基金增加上海基煜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	2023 年 11 月 6 日
7	大成內需增長混合型證券投資基金 2023 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	2023 年 10 月 25 日
8	大成基金管理有限公司關於旗下部分基金增加京東肯特瑞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	2023 年 10 月 19 日
9	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	2023 年 9 月 27 日
10	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	2023 年 9 月 27 日
11	大成內需增長混合型證券投資基金(C 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	2023 年 9 月 27 日
12	大成內需增長混合型證券投資基金基金合同	中國證監會基金電子披露網站、規定報刊及本公司網站	2023 年 9 月 25 日
13	關於大成內需增長混合型證券投資基金增設 C 類基金份額並相應修訂基金合同和託管協議的公告	中國證監會基金電子披露網站、規定報刊及本公司網站	2023 年 9 月 25 日

14	大成內需增長混合型證券投資基金託管協議	中國證監會基金電子披露網站、規定報刊及本公司網站	2023 年 9 月 25 日
15	大成基金管理有限公司關於終止鳳凰金信（海口）基金銷售有限公司辦理旗下基金相關銷售業務的公告	中國證監會基金電子披露網站、規定報刊及本公司網站	2023 年 9 月 6 日
16	大成內需增長混合型證券投資基金 2023 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	2023 年 8 月 30 日
17	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	2023 年 8 月 26 日
18	大成內需增長混合型證券投資基金 2023 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	2023 年 7 月 20 日
19	大成基金管理有限公司關於旗下部分基金增加上海大智慧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	2023 年 7 月 19 日
20	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	2023 年 7 月 14 日
21	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	2023 年 7 月 13 日
22	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	2023 年 7 月 8 日
23	大成內需增長混合型證券投資基金託管協議	中國證監會基金電子披露網站、規定報刊及本公司網站	2023 年 7 月 8 日
24	大成內需增長混合型證券投資基金基金合同	中國證監會基金電子披露網站、規定報刊及本公司網站	2023 年 7 月 8 日
25	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	2023 年 7 月 8 日
26	大成基金管理有限公司關於調低旗下部分基金費率並修訂基金合同的公告	中國證監會基金電子披露網站、規定報刊及本公司網站	2023 年 7 月 8 日
27	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	2023 年 6 月 30 日
28	大成基金管理有限公司關於旗下部分基金增加上海中歐財富基金銷售	中國證監會基金電子披露網站、規定報刊及本	2023 年 5 月 24 日

	有限公司為銷售機構的公告	公司網站	
29	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	2023 年 4 月 27 日
30	大成內需增長混合型證券投資基金 2023 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	2023 年 4 月 21 日
31	大成內需增長混合型證券投資基金 2022 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	2023 年 3 月 30 日
32	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	2023 年 3 月 27 日
33	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	2023 年 3 月 27 日
34	大成基金管理有限公司關於養老金客戶通過直銷櫃檯申購旗下基金費率優惠的公告	中國證監會基金電子披露網站、規定報刊及本公司網站	2023 年 3 月 24 日
35	大成基金管理有限公司關於旗下部分基金增加深圳前海微眾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	2023 年 2 月 23 日
36	大成內需增長混合型證券投資基金 2022 年第 4 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	2023 年 1 月 18 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

投資者類別	報告期內持有基金份額變化情況					報告期末持有基金情況	
	序號	持有基金份額比例達到或者超過 20% 的時間區間	期初份額	申購份額	贖回份額	持有份額	份額佔比 (%)
機構	1	20230101-20230804	22,685,325.49	0.00	22,685,325.49	0.00	0.00
產品特有風險							
當基金份額持有人佔比過於集中時，可能會因某單一基金份額持有人大額贖回而引發基金淨值劇烈波動的风险，甚至有可能引起基金的流動性風險，基金管理人可能無法及時變現基金資產以應對基金份額持有人的贖回申請，基金份額持有人可能無法及時贖回持有的全部基金份額。							

### 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 补充披露(只供香港派發)

### 14.1 补充披露 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% )		
貴州茅台	14,500	25,027,000.00
恒瑞醫藥	312,600	14,138,898.00
智飛生物	173,800	10,620,918.00
德邦股份	661,800	9,576,246.00
新宙邦	189,200	8,949,160.00
科倫藥業	285,400	8,290,870.00



海爾智家	393,500	8,263,500.00
一品紅	263,800	7,869,154.00
百洋醫藥	216,700	7,770,862.00
特寶生物	143,738	7,524,684.30
山西汾酒	31,900	7,360,287.00
南微醫學	73,330	7,098,344.00
瀘州老窖	39,221	7,037,031.82
海泰新光	130,660	6,955,031.80
福耀玻璃	177,100	6,621,769.00
中興通訊	208,127	5,511,202.96
生物股份	492,400	5,303,148.00
邁瑞醫療	17,300	5,027,380.00
英科醫療	212,000	4,952,320.00
葵花藥業	185,700	4,824,486.00
澤璟製藥	83,751	4,433,777.94
溫氏股份	205,700	4,126,342.00
天士力	220,600	3,754,612.00
興齊眼藥	18,900	3,445,848.00
苑東生物	45,277	2,887,767.06
今世緣	58,200	2,837,250.00
福瑞股份	58,500	2,550,015.00
瑞鵬模具	75,100	2,502,332.00
景業智能	51,630	2,466,365.10
江蘇吳中	278,800	2,291,736.00
海信視像	108,700	2,271,830.00
九典製藥	41,100	1,365,753.00
亞虹醫藥	50,747	547,052.66
艾羅能源	4,697	261,435.02
鼎龍科技	1,417	50,328.98
盟固利	867	35,512.32
波長光電	332	19,710.84
精智達	222	19,473.84
賽維時代	571	16,952.99
金凱生科	232	14,437.36
三態股份	1,070	14,338.00
埃科光電	275	14,025.00
中巨芯	1,701	13,761.09
民生健康	851	13,488.35
博盈特焊	441	13,327.02
達利凱普	576	12,752.64
華勤技術	162	12,595.50
泰凌微	447	12,524.94
乖寶寵物	306	11,875.86

萊斯資訊	336	11,844.00
德福科技	477	10,813.59
京儀裝備	204	10,659.00
恒工精密	198	10,068.30
安培龍	164	9,543.16
協昌科技	189	9,487.80
中遠通	604	9,368.04
康希通信	569	9,098.31
威爾高	263	9,097.17
多浦樂	128	8,820.48
思泰克	246	8,752.68
盛科通信	175	8,431.50
豐茂股份	208	8,286.72
艾森股份	165	8,223.60
信宇人	285	8,208.00
思泉新材	128	8,206.08
盛邦安全	178	8,196.90
敷爾佳	218	8,192.44
陝西華達	185	8,082.65
儒競科技	99	8,064.54
辰奕智能	118	8,061.76
錫南科技	250	7,607.50
中研股份	195	7,096.05
廣康生化	226	6,974.36
蘇州規劃	194	6,947.14
中郵科技	303	6,493.29
福賽科技	165	6,250.20
光格科技	167	6,082.14
中集環科	331	6,037.44
崇德科技	94	5,545.06
浩辰軟體	62	4,850.26
浙江榮泰	196	4,678.52
金帝股份	157	4,644.06
錦江航運	405	4,483.35
聯域股份	92	4,474.88
眾辰科技	97	3,850.90
永達股份	189	3,764.88
夏廈精密	48	3,617.28
天元智能	178	3,376.66
興欣新材	73	3,223.68
安邦護衛	88	3,058.00
潤本股份	176	2,932.16
恒興新材	115	2,861.20

熱威股份	119	2,773.89
麥加芯彩	44	2,543.64
索寶蛋白	118	2,540.54
合計	5,543,167.00	205,045,727.19
( 2 ) 債券投資		
合計		0
( 3 ) 買入返售金融資產		
交易所市場買入返售金融 資產		0
銀行間市場買入返售金融 資產		0
合計		0
總投資資產		205,045,727.19
銀行存款和結算備付金合 計		48,164,651.37
其他各項資產		299,424.77
合計		253,509,803.33

## 14.2 补充披露 2：投資組合變動表

序號	項目	佔基金總資產的比例 ( % )	佔基金總資產的比例 ( % )
		2023 年 12 月 31 日	2022 年 12 月 31 日
1	股票	80.88	84.62

2	債券	0.00	0.00
3	買入返售金融資產	0.00	0.00

大成基金管理有限公司

2024 年 3 月 29 日