大成消费主题混合型证券投资基金
2023 年第 2 季度报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 7 月 20 日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 07 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 04 月 01 日起至 06 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	大成消费主题混合	
基金主代码	090016	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014 年 3 月 25 日	
报告期末基金份额总额	527,140,756.55 份	
投资目标	本基金主要投资于消费行业相关的优质上市公司，在严格控制风险的前提下，力争为投资者创造超越业绩比较基准的长期资本增值。	
投资策略	本基金采用主动投资策略。以宏观经济分析和政策研究为基础，通过分析影响中国证券市场整体运行的内外部因素，实施大类资产配置；分析各个消费子行业在中国经济转型不同阶段行业景气度变化情况和发展趋势，实施行业配置；在各个行业内通过对公司基本面的考量，精选优质上市公司股票，构建投资组合。	
业绩比较基准	中证内地消费主题指数×80%＋中证综合债券指数×20%。	
风险收益特征	本基金属于混合型基金，风险与收益水平低于股票型基金，高于债券型基金与货币市场基金。	
基金管理人	大成基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	大成消费主题混合 A	大成消费主题混合 C
下属分级基金的交易代码	090016	017773
报告期末下属分级基金的份额总额	432,968,911.30 份	94,171,845.25 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2023 年 4 月 1 日-2023 年 6 月 30 日）	
	大成消费主题混合 A	大成消费主题混合 C
1.本期已实现收益	9,742,449.00	710,339.97
2.本期利润	-54,159,956.80	-21,397,269.56
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1183	-0.1765
4.期末基金资产净值	834,196,451.65	181,288,994.39
5.期末基金份额净值	1.927	1.925

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

大成消费主题混合 A

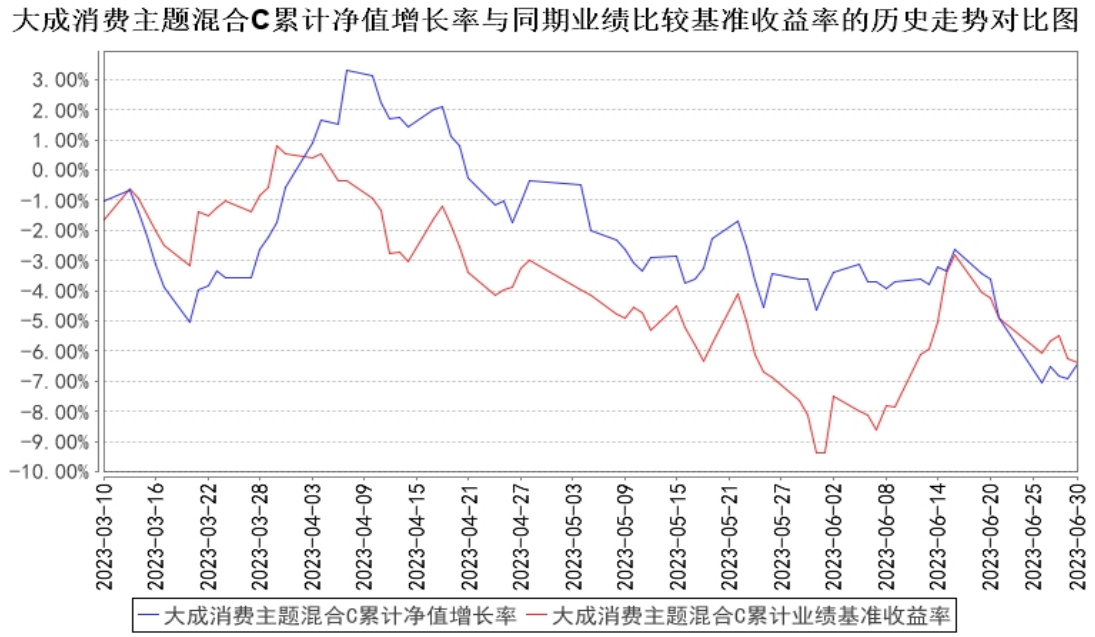
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-5.72%	0.75%	-6.87%	0.81%	1.15%	-0.06%
过去六个月	0.52%	0.79%	-4.98%	0.86%	5.50%	-0.07%
过去一年	-4.37%	0.99%	-15.25%	1.01%	10.88%	-0.02%
过去三年	48.92%	1.35%	3.86%	1.24%	45.06%	0.11%
过去五年	122.77%	1.35%	36.17%	1.26%	86.60%	0.09%
自基金合同生效起至今	136.52%	1.62%	154.06%	1.28%	-17.54%	0.34%

大成消费主题混合 C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标	①－③	②－④

				准差④		
过去三个月	-5.87%	0.75%	-6.87%	0.81%	1.00%	-0.06%
自基金合同生效起至今	-6.42%	0.76%	-6.37%	0.82%	-0.05%	-0.06%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、本基金合同规定,基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时,本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

2、本基金于 2014 年 3 月 25 日由大成中证内地消费主题指数证券投资基金转型而来，2015 年 7 月 3 日基金名称由大成消费主题股票型证券投资基金变更为大成消费主题混合型证券投资基金。

3、本基金自 2023 年 3 月 9 日起增设 C 类基金份额类别，C 类的净值增长率和业绩比较基准收益率自 2023 年 3 月 10 日有份额之日开始计算。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
齐炜中	本基金基金经理	2020 年 2 月 3 日	-	11 年	英国约克大学金融学硕士。2012 年 7 月加入大成基金管理有限公司，曾担任研究部研究员、行业研究主管、大成积极成长混合型证券投资基金基金经理助理，现任股票投资部总监助理。2020 年 2 月 3 日起任大成消费主题混合型证券投资基金、大成景阳领先混合型证券投资基金基金经理。2021 年 3 月 17 日起任大成一带一路灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2021 年 6 月 21 日起任大成蓝筹稳健证券投资基金基金经理。2022 年 11 月 18 日起任大成消费机遇混合型证券投资基金基金经理。2023 年 4 月 25 日起任大成新兴活力混合型证券投资基金基金经理。2023 年 6 月 13 日起任大成至诚鑫选混合型证券投资基金基金经理。具备基金从业资格。国籍：中国

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，

本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行了公平交易的原则和制度。公司运用统计分析方法和工具，对旗下所有投资组合间连续 4 个季度的日内、3 日内及 5 日内股票及债券交易同向交易价差进行分析，针对同一基金经理管理的多个投资组合及公私募兼任基金经理管理的多个投资组合的投资交易行为加强了公平交易监测与分析，包括对不同时间窗下（同日、3 日、5 日、10 日）反向交易和同向交易价差监控的分析。分析结果表明：债券交易同向交易频率较低；部分股票同向交易溢价率较大主要来源于投资策略差异、市场因素（如个股当日价格振幅较高）及组合经理交易时机选择，即投资组合成交时间不一致以及成交价格的日内较大变动导致个别些组合间的成交价格差异较大，同时结合交易价差专项统计分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价，未发生成交较少的单边交易量超过该股当日成交量 5%的股票同日反向交易；主动投资组合间债券交易未发生同日反向交易。投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响，无异常。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

进入二季度，市场由年初对经济复苏乐观的预期转向对经济悲观，以致于市场一度对长期需求担心，导致在二季度市场出现较为分化的行情，以 AI 为代表的创新技术和以优质且低估值央企为代表的“中特估”公司表现较好，而其他与经济相关度高的行业回调较大。二季度，上证指数下跌 2.16%，沪深 300 下跌 5.15%，创业板指下跌 7.69%。从行业看，二季度涨幅居前的行业有通信、传媒、公用事业、机械设备、家用电器等 ，跌幅居前的行业有商贸零售、美容护理、食品饮料、农林牧渔、建筑材料、基础化工、社会服务、钢铁、有色金属、房地产、交通运输等。

我们的投资目标是希望能够找到持续长大的优质公司，以合理的价格买入并分享其价值增长的收益。市场短期对经济及行业的长期需求悲观，也会一定程度影响公司远期经营实现的确定性，导致组合在二季度出现较大回撤。回到本基金操作上，我们仍然保持高仓位运作，也仍然是基于我们的核心框架在积累公司并动态的评估风险。我们对具备核心能力且风险释放充分的公司做了进一步增持。在创新相关领域，我们保持了充分开放心态和足够的重视程度，对部分风险收益特

征不够合适的品种也做了一定的收益确认。我们仍然对精力投入持乐观态度。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成消费主题混合 A 的基金份额净值为 1.927 元，本报告期基金份额净值增长率为-5.72%，同期业绩比较基准收益率为-6.87%;大成消费主题混合 C 的基金份额净值为 1.925 元，本报告期基金份额净值增长率为-5.87%，同期业绩比较基准收益率为-6.87%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	948,893,986.06	87.01
	其中：股票	948,893,986.06	87.01
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	138,851,097.67	12.73
8	其他资产	2,804,813.68	0.26
9	合计	1,090,549,897.41	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	92,271,815.22	9.09
B	采矿业	-	-
C	制造业	759,163,666.87	74.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	2,375.51	0.00
F	批发和零售业	28,242,004.54	2.78
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-

H	住宿和餐饮业	46,375,131.80	4.57
I	信息传输、软件和信息技术服务业	22,815,209.26	2.25
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	23,782.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	948,893,986.06	93.44

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	003006	百亚股份	5,173,600	89,399,808.00	8.80
2	600195	中牧股份	6,717,575	78,461,276.00	7.73
3	600887	伊利股份	2,521,998	71,422,983.36	7.03
4	300761	立华股份	3,858,290	71,108,284.70	7.00
5	600276	恒瑞医药	1,387,220	66,447,838.00	6.54
6	300760	迈瑞医疗	164,400	49,287,120.00	4.85
7	002332	仙琚制药	3,582,600	47,469,450.00	4.67
8	605108	同庆楼	1,388,477	46,375,131.80	4.57
9	002853	皮阿诺	2,623,515	45,386,809.50	4.47
10	600519	贵州茅台	26,800	45,318,800.00	4.46

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明

细

无。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	423,915.25
2	应收证券清算款	2,011,578.23
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	369,320.20
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	2,804,813.68

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	大成消费主题混合 A	大成消费主题混合 C
报告期期初基金份额总额	446,995,209.47	10,129,322.73
报告期期间基金总申购份额	74,846,892.73	171,828,873.18
减:报告期期间基金总赎回份额	88,873,190.90	87,786,350.66
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	432,968,911.30	94,171,845.25

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

项目	大成消费主题混合 A	大成消费主题混合 C

报告期期初管理人持有的本基金份额	-	4,861.45
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	-	4,861.45
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	-	0.00

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立大成中证内地消费主题指数证券投资基金的文件；

2、中国证监会《关于大成中证内地消费主题指数证券投资基金基金份额持有人大会决议备案的回函》；

3、《大成消费主题股票型证券投资基金变更基金名称、基金类别以及修订基金合同部分条款的公告》

4、《大成消费主题混合型证券投资基金基金合同》；

5、《大成消费主题混合型证券投资基金托管协议》；

6、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；

7、本报告期内在规定报刊上披露的各种公告原稿。

9.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，或登录本基金管理人网站 http://www.dcfund.com.cn 进行查阅。

大成基金管理有限公司

2023 年 7 月 20 日