

大成颐享稳健养老目标一年持有期混合型  
发起式基金中基金（FOF）  
2024 年第 2 季度报告

2024 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：中国邮政储蓄银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 7 月 19 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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 07 月 18 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 2024 年 04 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

|            |  |
|------------|--|
| 基金简称       | 大成颐享稳健养老目标一年持有混合发起式（FOF）   |
| 基金主代码      | 016197   |
| 基金运作方式     | 契约型开放式   |
| 基金合同生效日    | 2022 年 8 月 30 日  |
| 报告期末基金份额总额 | 52,356,526.81 份  |
| 投资目标       | 在严格控制风险的前提下，本基金运用动态资产配置策略，以定量和定性相结合的方法，通过积极主动的投资管理追求基金资产的长期稳健增值。   |
| 投资策略       | 本基金力争通过合理判断市场走势，合理配置基金、股票、债券等投资工具的比例，通过定量和定性相结合的方法精选具有不同风险收益特征的基金，力争实现基金资产的稳定回报。   |
| 业绩比较基准     | 中证 800 指数收益率*20%+恒生指数收益率（使用估值汇率调整）*5%+中债综合指数收益率*75%  |
| 风险收益特征     | 本基金为混合型基金中基金，目标风险系列 FOF 产品中，风险系列根据不同风险程度划分为三档，分别是稳健、均衡、积极。本基金以风险控制为产品主要导向，定位为较为稳健的 FOF 产品。本基金相对股票型基金、股票型基金中基金和一般的混合型基金其预期风险较小，但高于债券型基金、债券型基金中基金、货币市场基金及货币型基金中基金。本基金若投资港股通标的股票，则需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。 |
| 基金管理人      | 大成基金管理有限公司   |

|                 |                           |                           |
|-----------------|---------------------------|---------------------------|
| 基金托管人           | 中国邮政储蓄银行股份有限公司            |                           |
| 下属分级基金的基金简称     | 大成颐享稳健养老目标一年持有混合发起式（FOF）A | 大成颐享稳健养老目标一年持有混合发起式（FOF）Y |
| 下属分级基金的交易代码     | 016197                    | 019795                    |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 51,899,653.38份            | 456,873.43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（2024年4月1日-2024年6月30日） |                           |
|-----------------|---------------------------|---------------------------|
|                 | 大成颐享稳健养老目标一年持有混合发起式（FOF）A | 大成颐享稳健养老目标一年持有混合发起式（FOF）Y |
| 1. 本期已实现收益      | 340,314.61                | 2,580.15                  |
| 2. 本期利润         | 571,210.71                | 198.90                    |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0113                    | 0.0006                    |
| 4. 期末基金资产净值     | 50,659,227.46             | 446,757.25                |
| 5. 期末基金份额净值     | 0.9761                    | 0.9779                    |

注：1、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。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或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。

#### 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

大成颐享稳健养老目标一年持有混合发起式（FOF）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 | 1.01%  | 0.19%     | 0.56%      | 0.18%         | 0.45%  | 0.01%  |
| 过去六个月 | 2.10%  | 0.21%     | 1.84%      | 0.24%         | 0.26%  | -0.03% |
| 过去一年  | -1.77% | 0.22%     | -0.24%     | 0.23%         | -1.53% | -0.01% |
| 自基金合同 | -2.39% | 0.20%     | -0.88%     | 0.24%         | -1.51% | -0.04% |

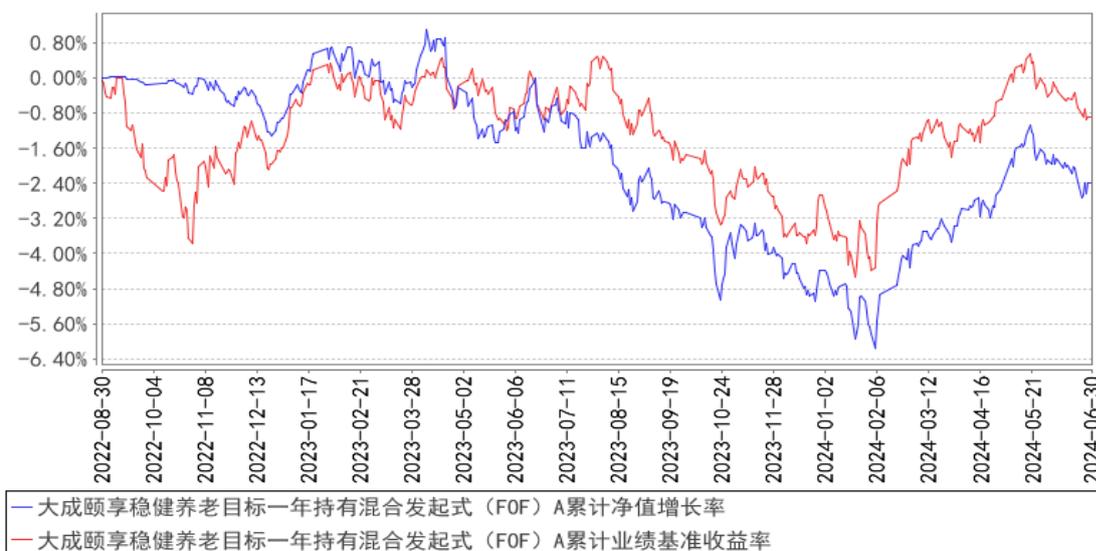
|       |  |  |  |  |  |  |
|-------|--|--|--|--|--|--|
| 生效起至今 |  |  |  |  |  |  |
|-------|--|--|--|--|--|--|

大成颐享稳健养老目标一年持有混合发起式（FOF）Y

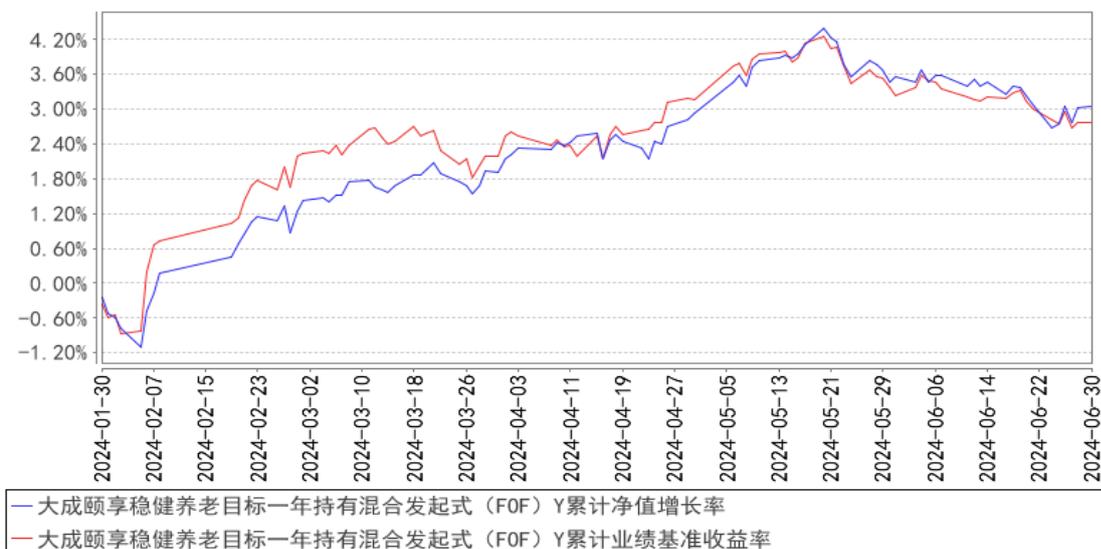
| 阶段         | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③   | ②—④    |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去三个月      | 1.11%  | 0.19%     | 0.56%      | 0.18%         | 0.55% | 0.01%  |
| 自基金合同生效起至今 | 3.05%  | 0.20%     | 2.77%      | 0.23%         | 0.28% | -0.03% |

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

大成颐享稳健养老目标一年持有混合发起式（FOF）A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



大成颐享稳健养老目标一年持有混合发起式（FOF）Y累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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、本基金自2023年10月23日起增设Y类基金份额类别。Y类的净值增长率和业绩比较基准收益率自2024年1月30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 |        |  |
| 陈志伟 | 本基金基金经理 | 2023年8月4日   | -    | 8年     | 北京大学经济学硕士、香港大学金融学硕士。2011年7月至2014年2月任华润深国投信托有限公司证券投资部经理。2014年2月至2016年6月任方正东亚信托有限公司对冲基金部总监。2016年6月至2020年4月任鹏华资产管理有限公司投资管理部高级研究员。2020年5月至2023年6月任生命保险资产管理有限公司组合管理部投资经理。2023年6月加入大成基金管理有限公司，现任大类资产配置部基金经理。2023年8月4日起任大成颐享稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金经理。2024年3月14日起任大成养老目标日期2040三年持有期混合型基金中基金（FOF）、大成丰华稳健六个月持有期混合型发起式 |

|    |                            |                |                |     |  |
|----|----------------------------|----------------|----------------|-----|--|
|    |                            |                |                |     | 基金中基金（FOF）、大成颐禧积极养老目标五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国  |
| 吴翰 | 本基金基金经理，<br>大类资产配置部副<br>总监 | 2022年8月30<br>日 | 2024年5月<br>15日 | 24年 | 浙江大学管理学博士。2000年12月至2002年6月任广东证券股份有限公司（现安信证券）研究发展中心高级研究员。2002年6月至2010年7月历任国投瑞银基金管理有限公司产品及业务拓展部高级经理、主管。2010年7月至2014年8月先后担任大成基金管理有限公司产品研发与金融工程部首席产品设计师、副总监。2014年9月至2015年4月任上海源实资产管理有限公司助理总经理。2015年4月至2017年3月先后担任大成基金管理有限公司产品研发与金融工程部副总监、数量与指数投资部副总监。2017年3月至2021年9月历任国投瑞银基金管理有限公司专户投资部投资经理、资产配置部基金经理。2021年9月至2024年5月就职于大成基金管理有限公司，曾担任大类资产配置部副总监。2022年8月2日至2024年5月15日任大成丰华稳健六个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金经理。2022年8月30日至2024年5月15日任大成颐享稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金经理。2023年2月13日至2024年5月15日任大成养老目标日期2040三年持有期混合型基金中基金（FOF）基金经理。2023年4月19日至2023年7月14日任大成兴享平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金经理。2023年6月29日至2024年5月15日任大成颐禧积极养老目标五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金经理。具有基金从业资格。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中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》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合规守信情况的说明

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连续 4 个季度的日内、3 日内、5 日内及 10 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，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。公司旗下投资组合间存在证券同日反向交易，但不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的情形。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

二季度国内经济环境相对稳定，政策预期变化较大。6 月份，中国制造业 PMI 为 49.5%，与上月持平；非制造业商务活动指数和综合 PMI 产出指数均为 50.5%，分别比上月下降 0.6 和 0.5 个百分点。在打击资金空转、叫停手工补息背景下，金融数据表现为 5 月 M1 同比下降 4.2%，M2 同比增长 7%，剔除这些因素，也反映社会融资需求偏弱。经济整体结构呈现生产强、需求弱的特征，需求中出口、制造业投资较强，对经济形成支撑，房地产投资、消费等偏弱运行。政策层面较为积极，4 月政治局会议提出要坚持乘势而上，避免前紧后松，切实巩固和增强经济回升向好态势，要靠前发力有效落实已经确定的宏观政策，实施好积极的财政政策和稳健的货币政策，要统筹研

究消化存量房产和优化增量住房的政策措施，抓紧构建房地产发展新模式，促进房地产高质量发展。5 月份各地地产政策持续优化，也带来了房地产市场的积极变化。4 月份新“国九条”的发布也给资本市场带来了新的变化和机遇。从长期看，新“国九条”的落实有利于提升上市公司质量，有利于建设“以投资者为本”的资本市场，提升了国内资本市场的投资价值。海外方面，虽然宏观经济有所波动，但总体平稳，上半年全球 PMI 指数维持在 53 左右的水平。加拿大央行、欧洲央行于 6 月份开启降息，也标志着主要发达经济体央行结束加息周期，进入降息周期。美国经济的韧性更强，美联储进入宽松周期的节奏更靠后，但预计年底也将开启降息。

从资产表现上来看，二季度，国内权益资产表现偏弱，主要指数先涨后跌，沪深 300 指数下跌 2.14%，港股表现较强，恒生指数上涨 7.12%。风格上二季度和一季度差别不大，大盘价值表现最强，大盘成长表现较弱，小微盘股的流动性风险再次凸显。公用事业、银行、煤炭等稳定板块延续强势的表现，成长板块里面，电子板块表现较好。国内债市表现稳定，10 年国债收益率较 3 月末继续下行。海外市场表现震荡，美股科技板块表现较强，纳斯达克指数上涨超过 8%，欧洲股市受选举事件影响表现较差。商品表现较好，但波动加大，黄金、铜等有色品种 4 月份大涨后回落，原油价格宽幅震荡。

具体到本基金的投资运作上，二季度在判断 A 股下行风险不大的情况下小幅提升了中枢配置比例，在结构上在价值风格基础小幅增加了科技成长基金的配置，并小幅增加了港股的配置。商品的仓位小幅波动，整体变化不大。变化较大的是减持了转债资产的仓位，主要是因为部分转债上市公司的信用风险暴露，转债的投资逻辑发生变化，投资难度增加，在海外资产上，维持了海外权益资产的仓位基本不变，结构上做了小幅调整，小幅增加了 QDII 债基的配置。从效果上来看，由于高波动资产仓位提升，产品的波动率有所提升，但对净值的贡献并没有显现。

本基金定位为稳健类风格，通过多资产多策略的配置实现较低回撤、适中收益的目标。本基金按照积极型资产配置策略，识别并适应市场环境的变化，保持战略资产配置的基本稳定，并根据市场变化战术性调整组合结构，在同等风险情况下选择预期收益较高的资产类别，在同等预期收益的情况下选择风险较低的资产类别，并通过选取优质基金产品表达配置观点。本基金属于养老型产品，目标是要帮助投资者实现养老需求，这需要在一定时间尺度内战胜通胀，实现稳定增值。本基金将致力于实现绝对收益目标，发挥资产配置的优势，以更广阔的视野寻找相关度低、预期收益较好的资产及策略进行组合配置。后续基金管理人将继续深化在大类资产和策略上的研究，争取为投资人实现绝对收益。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成颐享稳健养老目标一年持有混合发起式（FOF）A 的基金份额净值为

0.9761元，本报告期基金份额净值增长率为1.01%，同期业绩比较基准收益率为0.56%；截至本报告期末大成颐享稳健养老目标一年持有混合发起式（FOF）Y的基金份额净值为0.9779元，本报告期基金份额净值增长率为1.11%，同期业绩比较基准收益率为0.56%。

#### 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              | -             | -            |
|    | 其中：股票             | -             | -            |
| 2  | 基金投资              | 38,265,604.07 | 74.40        |
| 3  | 固定收益投资            | 4,067,230.32  | 7.91         |
|    | 其中：债券             | 4,067,230.32  | 7.91         |
|    | 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      | 448,835.25    | 0.87         |
| 8  | 其他资产              | 8,649,370.13  | 16.82        |
| 9  | 合计                | 51,431,039.77 | 100.00       |

注：截至报告期末，本基金因规模变动导致基金投资于经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金的资产比例被动低于基金资产的80%。

### 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

无。

#### 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

无。

## 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|--------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 2,006,837.26 | 3.93         |
| 2  | 央行票据      | -            | -            |
| 3  | 金融债券      | -            | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -            | -            |
| 4  | 企业债券      | -            | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -            | -            |
| 6  | 中期票据      | -            | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | 2,060,393.06 | 4.03         |
| 8  | 同业存单      | -            | -            |
| 9  | 其他        | -            | -            |
| 10 | 合计        | 4,067,230.32 | 7.96         |

## 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

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 数量（张）  | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|--------|--------------|--------------|
| 1  | 019740 | 24 国债 09 | 20,000 | 2,006,837.26 | 3.93         |
| 2  | 110076 | 华海转债     | 1,500  | 162,903.49   | 0.32         |
| 3  | 118034 | 晶能转债     | 1,500  | 146,434.68   | 0.29         |
| 4  | 127041 | 弘亚转债     | 1,000  | 115,205.89   | 0.23         |
| 5  | 110082 | 宏发转债     | 1,000  | 111,719.18   | 0.22         |

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   | 11,507.79    |
| 2  | 应收证券清算款 | 1,135,200.00 |
| 3  | 应收股利    | 0.06         |
| 4  | 应收利息    | -            |
| 5  | 应收申购款   | 7,501,190.73 |
| 6  | 其他应收款   | 1,471.55     |
| 7  | 其他      | -            |
| 8  | 合计      | 8,649,370.13 |

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 公允价值（元）    | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|------------|--------------|
| 1  | 110076 | 华海转债 | 162,903.49 | 0.32         |
| 2  | 118034 | 晶能转债 | 146,434.68 | 0.29         |
| 3  | 127041 | 弘亚转债 | 115,205.89 | 0.23         |
| 4  | 110082 | 宏发转债 | 111,719.18 | 0.22         |
| 5  | 123113 | 仙乐转债 | 110,000.00 | 0.22         |
| 6  | 127056 | 中特转债 | 109,338.55 | 0.21         |
| 7  | 110073 | 国投转债 | 108,239.67 | 0.21         |

|    |        |       |            |      |
|----|--------|-------|------------|------|
| 8  | 127083 | 山路转债  | 106,796.79 | 0.21 |
| 9  | 113633 | 科沃转债  | 106,746.85 | 0.21 |
| 10 | 123108 | 乐普转2  | 106,245.75 | 0.21 |
| 11 | 123168 | 惠云转债  | 105,879.32 | 0.21 |
| 12 | 113641 | 华友转债  | 101,467.01 | 0.20 |
| 13 | 111003 | 聚合转债  | 60,217.12  | 0.12 |
| 14 | 127070 | 大中转债  | 58,949.25  | 0.12 |
| 15 | 128136 | 立讯转债  | 57,099.52  | 0.11 |
| 16 | 128135 | 洽洽转债  | 56,762.53  | 0.11 |
| 17 | 113652 | 伟22转债 | 56,555.79  | 0.11 |
| 18 | 127031 | 洋丰转债  | 56,251.10  | 0.11 |
| 19 | 110089 | 兴发转债  | 56,189.52  | 0.11 |
| 20 | 127026 | 超声转债  | 55,906.99  | 0.11 |
| 21 | 118024 | 冠宇转债  | 54,826.99  | 0.11 |
| 22 | 113627 | 太平转债  | 54,004.66  | 0.11 |
| 23 | 113584 | 家悦转债  | 53,101.29  | 0.10 |
| 24 | 110081 | 闻泰转债  | 49,551.12  | 0.10 |

#### 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 基金中基金

#### 6.1 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基金投资明细

| 序号 | 基金代码   | 基金名称      | 运作方式   | 持有份额（份）      | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） | 是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金 |
|----|--------|-----------|--------|--------------|--------------|--------------|------------------------|
| 1  | 002086 | 大成景安短融债券E | 契约型开放式 | 2,802,172.80 | 3,662,720.07 | 7.17         | 是                      |
| 2  | 003280 | 鹏华丰恒债券    | 契约型开放式 | 2,218,080.69 | 2,457,189.79 | 4.81         | 否                      |
| 3  | 007014 | 嘉合磐泰短债债券A | 契约型开放式 | 2,139,959.80 | 2,391,619.07 | 4.68         | 否                      |
| 4  | 006947 | 华宝中短债债券A  | 契约型开放式 | 1,921,375.33 | 2,251,467.61 | 4.41         | 否                      |
| 5  | 008846 | 大成民稳增     | 契约型开放  | 1,817,014.47 | 2,195,680.29 | 4.30         | 是                      |

|    |        |                    |        |              |              |      |   |
|----|--------|--------------------|--------|--------------|--------------|------|---|
|    |        | 长混合 A              | 式      |              |              |      |   |
| 6  | 008383 | 招商安心收益债券 A         | 契约型开放式 | 1,079,123.58 | 2,046,773.69 | 4.00 | 否 |
| 7  | 007360 | 易方达中短期美元债债券(QDII)A | 契约型开放式 | 1,636,042.78 | 1,842,511.38 | 3.61 | 否 |
| 8  | 007361 | 易方达中短期美元债债券(QDII)C | 契约型开放式 | 1,658,296.75 | 1,840,046.07 | 3.60 | 否 |
| 9  | 011658 | 汇添富中高等级信用债券 A      | 契约型开放式 | 1,572,096.19 | 1,756,660.28 | 3.44 | 否 |
| 10 | 005754 | 平安短债债券 A           | 契约型开放式 | 1,311,981.82 | 1,588,941.18 | 3.11 | 否 |

### 6.1.1 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公开募集基础设施证券投资基金投资明细

无。

### 6.1.2 报告期末基金持有的全部公开募集基础设施证券投资基金情况

无。

### 6.2 当期交易及持有基金产生的费用

| 项目                   | 本期费用 2024 年 4 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | 其中：交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用 |
|----------------------|--------------------------------------|---------------------------------|
| 当期交易基金产生的申购费(元)      | 479.64                               | -                               |
| 当期交易基金产生的赎回费(元)      | 355.60                               | -                               |
| 当期持有基金产生的应支付销售服务费(元) | 12,166.83                            | 4,080.11                        |
| 当期持有基金产生的应支付管理费(元)   | 62,502.02                            | 17,412.42                       |
| 当期持有基金产生的应支付托管费(元)   | 14,070.67                            | 3,133.58                        |
| 当期交易基金产生的交易费(元)      | 745.73                               | 21.11                           |
| 当期交易基金产生的转换费(元)      | 83.66                                | 83.66                           |

### 6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

## §7 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                        | 大成颐享稳健养老目标一年持有混合发起式（FOF）A | 大成颐享稳健养老目标一年持有混合发起式（FOF）Y |
|---------------------------|---------------------------|---------------------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 52,921,554.60             | 62,795.18                 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 7,704,312.76              | 394,078.25                |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 8,726,213.98              | -                         |
| 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               | 51,899,653.38             | 456,873.43                |

## §8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

| 项目                       | 大成颐享稳健养老目标一年持有混合发起式（FOF）A | 大成颐享稳健养老目标一年持有混合发起式（FOF）Y |
|--------------------------|---------------------------|---------------------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额         | 20,551,482.78             | -                         |
| 报告期期间买入/申购总份额            | 3,624,733.99              | -                         |
| 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         | 24,176,216.77             | -                         |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 46.18                     | -                         |

### 8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

| 序号 | 交易方式 | 交易日期       | 交易份额(份)      | 交易金额(元)      | 适用费率(%) |
|----|------|------------|--------------|--------------|---------|
| 1  | 申购   | 2024-04-01 | 3,624,733.99 | 3,500,000.00 | -       |
| 合计 |      |            | 3,624,733.99 | 3,500,000.00 |         |

注：1、申购或者购买基金份额的，金额为正；赎回或者卖出基金份额的，金额为负。

2、合计数以绝对值填列。

3、红利发放为期间合计数。

4、本基金相关费率均依照法律文件规定收取。

## §9 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目        | 持有份额总数        | 持有份额占基金总份额比例(%) | 发起份额总数        | 发起份额占基金总份额比例(%) | 发起份额承诺持有期限 |
|-----------|---------------|-----------------|---------------|-----------------|------------|
| 基金管理人固有资金 | 24,176,216.77 | 46.18           | 10,000,138.90 | 19.10           | 3年         |

|             |               |       |               |       |    |
|-------------|---------------|-------|---------------|-------|----|
| 基金管理人高级管理人员 | 10,000.13     | 0.02  | -             | -     | -  |
| 基金经理等人员     | 297,142.43    | 0.57  | -             | -     | -  |
| 基金管理人股东     | -             | -     | -             | -     | -  |
| 其他          | -             | -     | -             | -     | -  |
| 合计          | 24,483,359.33 | 46.76 | 10,000,138.90 | 19.10 | 3年 |

## §10 影响投资者决策的其他重要信息

### 10.1 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

| 投资者类别   | 报告期内持有基金份额变化情况 |                         |               |              | 报告期末持有基金情况 |               |          |
|---|----------------|-------------------------|---------------|--------------|------------|---------------|----------|
|   | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额          | 申购份额         | 赎回份额       | 持有份额          | 份额占比 (%) |
| 机构  | 1              | 20240401-20240630       | 20,551,482.78 | 3,624,733.99 | -          | 24,176,216.77 | 46.18    |
| 产品特有风险  |                |                         |               |              |            |               |          |
| 当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金净值剧烈波动的风险，甚至有可能引起基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。 |                |                         |               |              |            |               |          |

### 10.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立大成颐享稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）的文件；

2、《大成颐享稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同》；

3、《大成颐享稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）托管协议》；

4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；

5、本报告期内在规定报刊上披露的各种公告原稿。

### 11.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

### 11.3 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

2024 年 7 月 19 日