

大成养老目标日期 2040 三年持有期混合型  
基金中基金（FOF）  
2022 年中期报告

2022 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

送出日期：2022 年 8 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2022 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	19
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>46</b>
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48
7.6 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	48

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	48
7.8 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贵金属投资明细 .....	48
7.9 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 .....	48
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	48
7.12 本报告期投资基金情况 .....	49
7.13 投资组合报告附注 .....	52
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>53</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	53
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	54
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>54</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>54</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	54
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	55
10.4 基金投资策略的改变 .....	55
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 .....	55
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	55
10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	55
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	55
10.9 其他重大事件 .....	58
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>58</b>
11.1 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 .....	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	58
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>58</b>
12.1 备查文件目录 .....	58
12.2 存放地点 .....	59
12.3 查阅方式 .....	59

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	大成养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金（FOF）	
基金简称	大成养老 2040 三年持有混合（FOF）	
基金主代码	007297	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 6 月 27 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	
报告期末基金份额总额	160,321,098.85 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	大成养老 2040 三年持有混合（FOF）A	大成养老 2040 三年持有混合（FOF）C
下属分级基金的交易代码	007297	007298
报告期末下属分级基金的份额总额	148,375,625.67 份	11,945,473.18 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金是采用目标日期策略的基金中基金，目标日期为 2040 年 12 月 31 日。本基金在严格控制风险的前提下，通过科学的大类资产配置，投资于多种具有不同风险收益特征的基金等金融工具，并随着目标日期的临近逐步降低本基金整体的风险收益水平，以寻求基金资产的长期稳健增值。目标日期到期后，本基金将在严格控制风险的前提下，力争获得长期稳定的投资收益。
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	本基金业绩比较基准： $X \times \text{沪深 300 指数收益率} + (1-X) \times \text{上证国债指数收益率}$ （基金合同生效之日至 2030.12.31， $X=50\%$ ；2031.1.1-2035.12.31， $X=45\%$ ；2036.1.1-2040.12.31， $X=30\%$ ；2041.1.1 起， $X=15\%$ ）
风险收益特征	本基金为混合型基金中基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金、股票型基金中基金，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。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		大成基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	段皓静	秦一楠
	联系电话	0755-83183388	010-66060069
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com

客户服务电话	4008885558	95599
传真	0755-83199588	010-68121816
注册地址	广东省深圳市南山区海德三道 1236 号大成基金总部大厦 5 层、 27-33 层	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址	广东省深圳市南山区海德三道 1236 号大成基金总部大厦 5 层、 27-33 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	518054	100031
法定代表人	吴庆斌	谷澍

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.dcfund.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	大成基金管理有限公司	广东省深圳市南山区海德三道 1236 号大成基金总部大厦 5 层、 27-33 层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据 和指标	报告期(2022 年 01 月 01 日-2022 年 06 月 30 日)	
	大成养老 2040 三年持有混合 (FOF) A	大成养老 2040 三年持有混合 (FOF) C
本期已实现收益	-33,360,015.88	-3,112,697.18
本期利润	-50,902,978.56	-4,691,326.68
加权平均基金份 额本期利润	-0.2075	-0.2087
本期加权平均净 值利润率	-16.51%	-16.78%
本期基金份额净 值增长率	-14.21%	-14.38%
3.1.2 期末数据 和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)	

期末可供分配利润	30,800,105.00	2,292,945.40
期末可供分配基金份额利润	0.2076	0.1920
期末基金资产净值	183,453,840.49	14,593,053.83
期末基金份额净值	1.2364	1.2216
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2022 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	23.64%	22.16%

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. 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数 (为期末余额，不是当期发生数)。

## 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

大成养老 2040 三年持有混合 (FOF) A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	3.60%	0.47%	4.84%	0.53%	-1.24%	-0.06%
过去三个月	0.19%	0.94%	3.78%	0.72%	-3.59%	0.22%
过去六个月	-14.21%	0.94%	-3.45%	0.73%	-10.76%	0.21%
过去一年	-13.23%	0.82%	-4.78%	0.62%	-8.45%	0.20%
过去三年	23.63%	0.89%	16.71%	0.63%	6.92%	0.26%

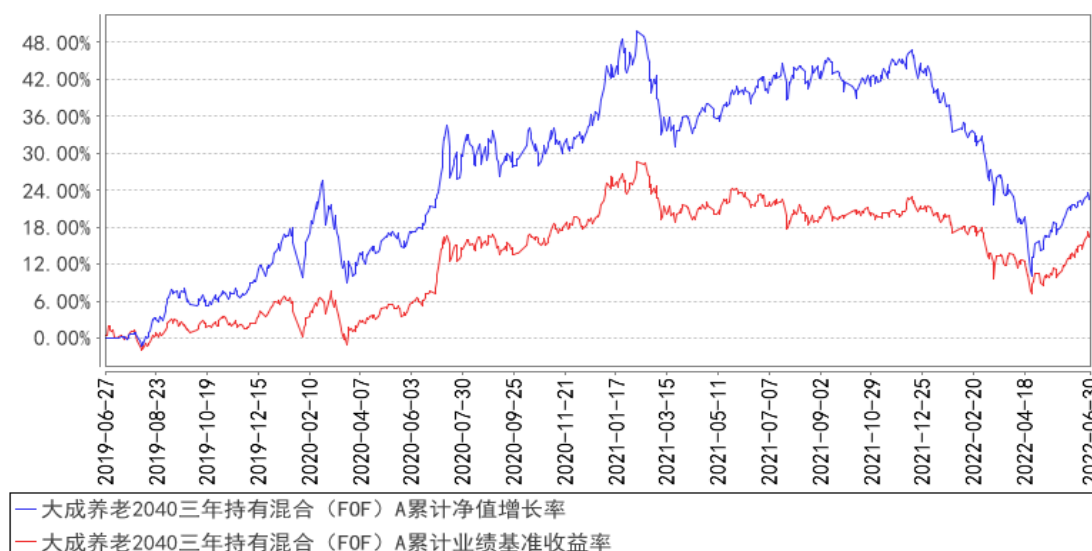
自基金合同生效起 至今	23.64%	0.89%	17.20%	0.63%	6.44%	0.26%
----------------	--------	-------	--------	-------	-------	-------

大成养老 2040 三年持有混合 (FOF) C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	3.57%	0.47%	4.84%	0.53%	-1.27%	-0.06%
过去三个月	0.09%	0.94%	3.78%	0.72%	-3.69%	0.22%
过去六个月	-14.38%	0.94%	-3.45%	0.73%	-10.93%	0.21%
过去一年	-13.58%	0.82%	-4.78%	0.62%	-8.80%	0.20%
过去三年	22.15%	0.89%	16.71%	0.63%	5.44%	0.26%
自基金合同生效起 至今	22.16%	0.89%	17.20%	0.63%	4.96%	0.26%

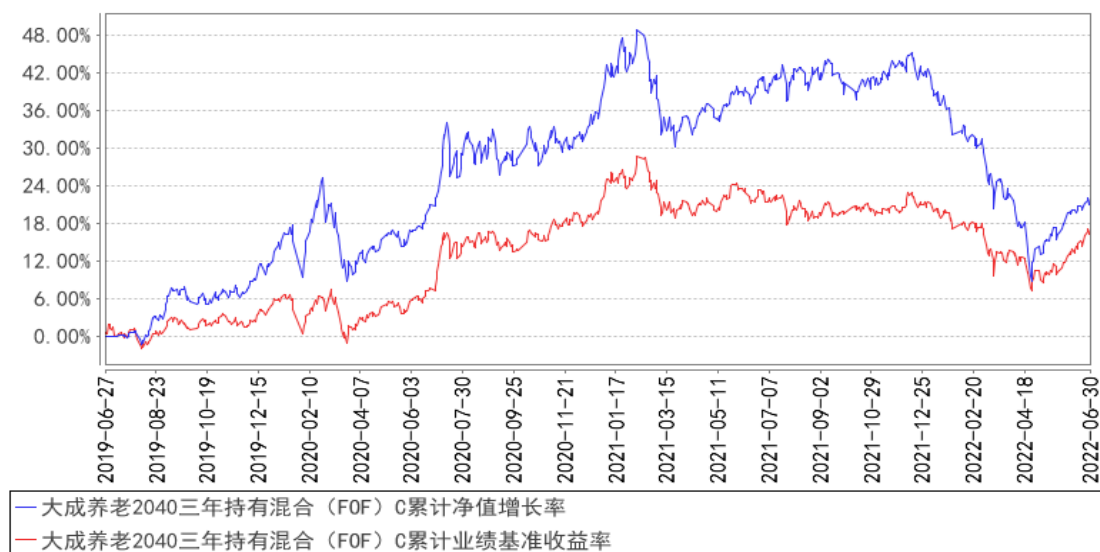
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

大成养老2040三年持有混合 (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





大成养老2040三年持有混合（FOF）C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：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。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

大成基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1999]10号文批准，于1999年4月12日正式成立，是中国证监会批准成立的首批十家基金管理公司之一，注册资本为2亿元人民币，注册地为深圳。目前公司由三家股东组成，分别为中泰信托有限责任公司(50%)、光大证券股份有限公司(25%)、中国银河投资管理有限公司(25%)。公司业务资质齐全，是全国同时具有境内、境外社保基金管理人资格和基本养老保险基金管理人资格的四家基金公司之一，全面涵盖公募基金、机构投资、海外投资、财富管理、养老金管理、私募股权投资等业务，旗下大成国际资产管理公司具备QFII、RQFII等资格。

历经23年的发展，大成基金形成了以长期投资能力为核心竞争优势，打造了一支具有良好职业素养和丰富经验的资产管理队伍。目前已形成权益、固定收益、量化投资、商品期货、境外投资、大类资产配置等六大投资团队，全面覆盖各类投资领域。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
尚琼	本基金基	2019年6	-	12年	北京大学经济学硕士。2010年7月至2011

	金经理	月 27 日			年 5 月任中银基金管理有限公司产品设计分析师。2011 年 5 月加入大成基金管理有限公司，历任产品研发与金融工程部产品设计师、数量与指数投资部高级数量分析师、大类资产配置部投资经理，现任大类资产配置部基金经理。2019 年 6 月 27 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）基金经理。2020 年 6 月 17 日起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。具有基金从业资格。国籍：中国
鲁速	本基金基金经理	2021 年 8 月 3 日	-	11 年	荷兰伊拉斯姆斯大学理学硕士。2011 年 1 月至 2013 年 6 月任 Citco 基金管理公司 FoHF 分析师。2013 年 6 月至 2015 年 6 月任工商银行（欧洲）资金部资金经理。2015 年 8 月至 2021 年 6 月任长城证券股份有限公司量化投资部投资经理。2021 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。2021 年 8 月 3 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。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。

3、尚琼女士自 2022 年 8 月 3 日起不再担任本基金基金经理职务。上述事项已按法规要求及公司相关制度办理，变更流程合法合规。

#### 4.1.3 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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。基金管理人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，基金管理人旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。主动投资组合间股票交易存在 1 笔同日反向交易，原因为投资策略需要。主动型投资组合与指数型投资组合之间或指数型投资组合之间存在股票同日反向交易，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股当日成交量 5% 的情形；主动投资组合间债券交易存在 2 笔同日反向交易，原因为流动性需要或合规比例调整。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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年受俄乌冲突，能源危机和经济下行的多重影响，全球大类资产波动率大幅抬升，当前大部分资产的隐含波动率处在历史最高分位数区间，尤其是利率的隐含波动率位于过去 10 年的高位。国内股票市场在上半年同样经历了大幅波动，在产业政策和复工复产的作用下，新能源和汽车产业链的股票有较好的表现。

本基金上半年在仓位方面变化不大，主要是结构上从超配上游资源类的基金到加配成长风格基金，当前维持比较均衡的配置比例。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成养老 2040 三年持有混合（FOF）A 的基金份额净值为 1.2364 元，本报告期基金份额净值增长率为-14.21%，同期业绩比较基准收益率为-3.45%；截至本报告期末大成养老 2040 三年持有混合（FOF）C 的基金份额净值为 1.2216 元，本报告期基金份额净值增长率为-14.38%，同期业绩比较基准收益率为-3.45%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

国内经济领先海外经济率先进入复苏区间，随着后续经济不断企稳，消费，医药等跟经济相关性比较强的行业也将赢来修复行情。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人指导基金估值业务的领导小组为公司估值委员会，公司估值委员会主要负责估值政策和估值程序的制定、修订以及执行情况的监督。估值委员会由股票投资部、固定收益总部、研究部、指数与期货投资部、大类资产配置部、权益专户投资部、国际业务部、交易管理部、风险管理部、监察稽核部、基金运营部指定人员组成。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历，估值委员会成员中包括七名投资组合经理。

股票投资部、固定收益总部、研究部、指数与期货投资部、大类资产配置部、权益专户投资部、国际业务部、风险管理部负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；提出合理的数量分析模型对需要进行估值测算或者调整的投资品种进行公允价值定价与计量；定期对估值政策和程序进行评价，以保证其持续适用；交易管理部负责关注相关投资品种的流动性状况，协助反馈其市场交易信息；基金运营部负责日常的基金资产的估值业务，执行基金估值政策，并负责与托管行沟通估值调整事项；监察稽核部负责审核估值政策和程序的一致性，监督估值委员会工作流程中的风险控制，并负责估值调整事项的信息披露工作。

本基金的日常估值程序由基金运营部基金估值核算人员执行，并与托管银行的估值结果核对一致。基金估值政策的议定和修改采用集体讨论机制，投资组合经理作为估值小组成员，对持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的职业敏感，向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论。对需采用特别估值程序的证券，基金管理人及时启动特别估值程序，由估值委员会讨论议定特别估值方案并与托管行沟通后由基金运营部具体执行。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。截止报告期末本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间交易的债券品种的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人严格按照本基金基金合同的规定进行收益分配。本报告期内本基金无收益分配事项。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人——大成基金管理有限公司 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，大成基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，大成基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

### § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：大成养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金（FOF）

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	54,809,041.96	19,089,787.50
结算备付金		799,763.32	1,169,675.75
存出保证金		162,144.98	36,439.23
交易性金融资产	6.4.7.2	258,492,448.44	367,039,277.90
其中：股票投资		-	13,670,091.36

基金投资		258,492,448.44	333,227,186.54
债券投资		-	20,142,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	6,000,000.00
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		18,575,691.64	-
应收股利		569.26	7,533,925.00
应收申购款		6,072.90	2,783.14
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	11,294.23	563,875.46
资产总计		332,857,026.73	401,435,763.98
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年6月30日</b>	<b>上年度末 2021年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	13,321,347.67
应付赎回款		134,262,633.57	-
应付管理人报酬		233,245.43	315,945.16
应付托管费		35,478.65	40,367.88
应付销售服务费		8,689.17	10,990.53
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	270,085.59	190,273.77
负债合计		134,810,132.41	13,878,925.01
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	160,321,098.85	269,130,402.48
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	37,725,795.47	118,426,436.49
净资产合计		198,046,894.32	387,556,838.97
负债和净资产总计		332,857,026.73	401,435,763.98

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额总额 160,321,098.85 份，其中大成养老 2040 三年持有混合（FOF）A 基金份额总额为 148,375,625.67 份，基金份额净值 1.2364 元。大成养老 2040 三年持有混合（FOF）C 基金份额总额为 11,945,473.18 份，基金份额净值 1.2216 元。

## 6.2 利润表

会计主体：大成养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金（FOF）

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-53,645,647.94	13,240,927.33
1. 利息收入		92,468.95	391,229.48
其中：存款利息收入	6.4.7.13	83,327.17	110,058.92
债券利息收入		-	185,269.19
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		9,141.78	95,901.37
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-34,673,747.62	6,702,990.05
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-9,790,015.62	-1,687,366.56
基金投资收益	6.4.7.15	-26,181,491.07	8,051,228.24
债券投资收益	6.4.7.16	144,406.78	-30,540.00
资产支持证券投资	6.4.7.17	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.18	-	-
衍生工具收益	6.4.7.19	-	-
股利收益	6.4.7.20	1,153,352.29	369,668.37
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	-19,121,592.18	6,133,190.53
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.22	57,222.91	13,517.27
<b>减：二、营业总支出</b>		1,948,657.30	3,001,860.79
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,552,582.54	1,824,566.27

2. 托管费	6.4.10.2.2	227,679.27	240,468.01
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	55,692.34	61,419.86
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.23	-	-
7. 税金及附加		-	2.52
8. 其他费用	6.4.7.24	112,703.15	875,404.13
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-55,594,305.24	10,239,066.54
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-55,594,305.24	10,239,066.54
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-55,594,305.24	10,239,066.54

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：大成养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金（FOF）

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	269,130,402.48	-	118,426,436.49	387,556,838.97
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	269,130,402.48	-	118,426,436.49	387,556,838.97
三、本期增减变动额（减）	-108,809,303.63	-	-80,700,641.02	-189,509,944.65



少以“-”号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	-55,594,305.24	-55,594,305.24
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-108,809,303.63	-	-25,106,335.78	-133,915,639.41
其中:1.基金申购款	279,569.55	-	67,424.61	346,994.16
2.基金赎回款	-109,088,873.18	-	-25,173,760.39	-134,262,633.57
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	160,321,098.85	-	37,725,795.47	198,046,894.32
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			

	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	266,725,152.17	-	102,812,916.68	369,538,068.85
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期初净资产(基金净值)	266,725,152.17	-	102,812,916.68	369,538,068.85
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	1,382,593.87	-	10,843,321.75	12,225,915.62
(一)、综合收益总额	-	-	10,239,066.54	10,239,066.54
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	1,382,593.87	-	604,255.21	1,986,849.08
其中:1. 基金申购款	1,382,593.87	-	604,255.21	1,986,849.08
2. 基金赎回款	-	-	-	-
(三)、本期向基金份额	-	-	-	-

额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	268,107,746.04	-	113,656,238.43	381,763,984.47

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>谭晓冈</u>	<u>范瑛</u>	<u>孙蕊</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

大成养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金 (FOF) (以下简称“本基金”), 系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]594 号文“关于准予大成养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金 (FOF) 注册的批复”的核准, 由大成基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金合同》作为发起人向社会公开募集, 募集期结束经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明(2019)验字第 60469430\_H03 号验资报告后, 向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2019 年 6 月 27 日生效。本基金为契约型开放式, 存续期限不定。

本基金募集期间为 2019 年 4 月 29 日至 2019 年 6 月 24 日, 首次发售募集的有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币 222,350,475.33 元, 折合 222,350,475.33 份基金份额; 有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币 142,165.43 元, 折合 142,165.43 份基金份额。其中 A 类份额已收到的首次发售募集的有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币

202,567,905.12 元，折合 202,567,905.12 份基金份额，有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币 135,373.84 元，折合 135,373.84 份基金份额；C 类份额已收到的首次发售募集的有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币 19,782,570.21 元，折合 19,782,570.21 份基金份额，有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币 6,791.59 元，折合 6,791.59 份基金份额。以上收到的实收基金共计人民币 222,492,640.76 元，折合 222,492,640.76 份基金份额。本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司，注册登记机构为本基金管理人，基金托管人为中国农业银行股份有限公司（以下简称“中国农业银行”）。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，主要包括经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金（含 QDII 基金、香港互认基金），以及境内依法发行上市的股票（含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券、可交换债券等）、货币市场工具、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集的证券投资基金（含 QDII 基金、香港互认基金）的比例不低于基金资产的 80%；本基金投资于股票、股票型基金、混合型基金和商品基金（含商品期货基金和黄金 ETF）的比例合计不超过基金资产的 60%；本基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为  $X \times$  沪深 300 指数收益率 +  $(1-X) \times$  上证国债指数收益率。

自基金合同生效之日起至 2030 年 12 月 31 日，本基金的业绩比较基准为  $50\% \times$  沪深 300 指数收益率 +  $50\% \times$  上证国债指数收益率；

自 2031 年 1 月 1 日至 2035 年 12 月 31 日，本基金的业绩比较基准为  $45\% \times$  沪深 300 指数收益率 +  $55\% \times$  上证国债指数收益率；

自 2036 年 1 月 1 日至 2040 年 12 月 31 日，本基金的业绩比较基准为  $30\% \times$  沪深 300 指数收益率 +  $70\% \times$  上证国债指数收益率；

自 2041 年 1 月 1 日起，本基金的业绩比较基准为  $15\% \times$  沪深 300 指数收益率 +  $85\% \times$  上证国债指数收益率。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

除下文会计政策变更的说明中涉及的变更外，本基金报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

##### 一、金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

##### （1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及贷款和应收款项；

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为股票、债券和衍生工具等投资。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、结算备付金、买入返售金融资产和各类应收款项等。

##### （2）金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。

本基金持有的金融负债均划分为其他金融负债，主要包括卖出回购金融资产款和各类应付款

项等。

## 二、金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

### 初始确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产取得时发生的相关交易费用计入当期损益；应收款项及其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

### 后续计量

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产采用公允价值进行后续计量。在持有该类金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；应收款项及其他金融负债采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量，其摊销或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

### 终止确认

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

### 金融资产转移

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

## 三、收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及应由管理人缴纳的增值税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日

计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及应由管理人缴纳的增值税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 基金投资收益/（损失）于卖出/赎回基金成交日确认，并按卖出/赎回基金成交金额与其成本的差额扣除应由基金管理人缴纳的增值税后的净额入账；

(8) 衍生工具收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额扣除应由基金管理人缴纳的增值税后的净额入账；

(9) 股利收益于除息日确认，股票股利按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；基金红利按基金管理人宣告的分红派息比例计算的金额确认；

(10) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(11) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

#### 新金融工具准则

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

在首次执行日，原金融资产账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产账面价值的调节如下所述：

	账面价值
<b>银行存款</b>	
2021年12月31日，按原金融工具准则列示的余额	19,089,787.50
重分类：转入自应收利息	2,964.81
重新计量：预期信用损失准备	-
2022年1月1日，按新金融工具准则列示的余额	19,092,752.31
<b>结算备付金</b>	
2021年12月31日，按原金融工具准则列示的余额	1,169,675.75
重分类：转入自应收利息	526.40
重新计量：预期信用损失准备	-
2022年1月1日，按新金融工具准则列示的余额	1,170,202.15
<b>存出保证金</b>	
2021年12月31日，按原金融工具准则列示的余额	36,439.23
重分类：转入自应收利息	16.40
重新计量：预期信用损失准备	-
2022年1月1日，按新金融工具准则列示的余额	36,455.63
<b>交易性金融资产</b>	
2021年12月31日，按原金融工具准则列示的余额	367,039,277.90
重分类：转入自应收利息	554,279.45
2022年1月1日，按新金融工具准则列示的余额	367,593,557.35
<b>买入返售金融资产</b>	
2021年12月31日，按原金融工具准则列示的余额	6,000,000.00
重分类：转入自应收利息	-
重新计量：预期信用损失准备	-



2022年1月1日, 按新金融工具准则列示的余额	6,000,000.00
<b>应收利息</b>	
2021年12月31日, 按原金融工具准则列示的余额	557,787.06
重分类: 转出至银行存款	-2,964.81
重分类: 转出至结算备付金	-526.40
重分类: 转出至存出保证金	-16.40
重分类: 转出至交易性金融资产	-554,279.45
重分类: 转出至买入返售金融资产	-
重分类: 转出至应收申购款	-
重分类: 转出至其他资产	-
2022年1月1日, 按新金融工具准则列示的余额	不适用
<b>应收申购款</b>	
2021年12月31日, 按原金融工具准则列示的余额	2,783.14
重分类: 转入自应收利息	-
重新计量: 预期信用损失准备	-
2022年1月1日, 按新金融工具准则列示的余额	2,783.14
<b>其他资产</b>	
2021年12月31日, 按原金融工具准则列示的余额	6,088.40
重分类: 转入自应收利息	-
重新计量: 预期信用损失准备	-
2022年1月1日, 按新金融工具准则列示的余额	6,088.40
<b>卖出回购金融资产款</b>	
2021年12月31日, 按原金融工具准则列示的余额	-
重分类: 转入自应付利息	-
2022年1月1日, 按新金融工具准则列示的余额	-
<b>应付利息</b>	
2021年12月31日, 按原金融工具准则列示的余额	-
重分类: 转出至卖出回购金融资产款	-
2022年1月1日, 按新金融工具准则列示的余额	不适用

#### 6.4.6 税项

##### 1、印花税

证券(股票)交易印花税税率为1‰, 由出让方缴纳。

##### 2、增值税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定, 经国务院批准, 自2016年5月1日起, 在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点, 金融业纳入试点范围, 由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金(封闭式证券投资基金, 开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税; 国债、地方政府债利息收入免征增值税; 存款利息收入不征收增值税。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服

务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

### 3、个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴个人所得税。

基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
----	------------------------

活期存款	54,809,041.96
等于：本金	54,803,957.11
加：应计利息	5,084.85
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	54,809,041.96

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-	-
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	255,564,947.86	-	258,492,448.44	2,927,500.58
其他	-	-	-	-
合计	255,564,947.86	-	258,492,448.44	2,927,500.58

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

#### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

##### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

#### 6.4.7.5 债权投资

##### 6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

##### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

#### 6.4.7.6 其他债权投资

##### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

##### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

#### 6.4.7.7 其他权益工具投资

##### 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

## 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

## 6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应收利息	-
其他应收款	11,294.23
待摊费用	-
合计	11,294.23

## 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	175,866.04
其中：交易所市场	175,466.04
银行间市场	400.00
应付利息	-
预提费用	94,219.55
合计	270,085.59

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

大成养老 2040 三年持有混合（FOF）A

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	246,503,547.64	246,503,547.64
本期申购	231,149.56	231,149.56
本期赎回（以“-”号填列）	-98,359,071.53	-98,359,071.53
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	148,375,625.67	148,375,625.67

大成养老 2040 三年持有混合（FOF）C

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
----	----------------------------

	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	22,626,854.84	22,626,854.84
本期申购	48,419.99	48,419.99
本期赎回 (以“-”号填列)	-10,729,801.65	-10,729,801.65
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	11,945,473.18	11,945,473.18

注：1、申购含红利再投份额(如有)；

2、本基金设置投资者最短持有期限(即锁定期)为三年。对于每份基金份额，锁定期自基金合同生效日或基金份额申购申请确认日起，至基金合同生效日或基金份额申购申请确认日次三年的年度对日的前一日(不含对日)止的期间。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

无。

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

##### 大成养老 2040 三年持有混合 (FOF) A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	83,163,301.29	25,604,874.63	108,768,175.92
本期利润	-33,360,015.88	-17,542,962.68	-50,902,978.56
本期基金份额交易产生的变动数	-19,003,180.41	-3,783,802.13	-22,786,982.54
其中：基金申购款	53,648.99	3,765.76	57,414.75
基金赎回款	-19,056,829.40	-3,787,567.89	-22,844,397.29
本期已分配利润	-	-	-
本期末	30,800,105.00	4,278,109.82	35,078,214.82

##### 大成养老 2040 三年持有混合 (FOF) C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	7,304,964.95	2,353,295.62	9,658,260.57
本期利润	-3,112,697.18	-1,578,629.50	-4,691,326.68
本期基金份额交易产生的变动数	-1,899,322.37	-420,030.87	-2,319,353.24
其中：基金申购款	10,400.71	-390.85	10,009.86
基金赎回款	-1,909,723.08	-419,640.02	-2,329,363.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,292,945.40	354,635.25	2,647,580.65

## 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	72,780.29
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	9,594.25
其他	952.63
合计	83,327.17

## 6.4.7.14 股票投资收益

## 6.4.7.14.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	210,261,163.30
减：卖出股票成本总额	219,424,844.02
减：交易费用	626,334.90
买卖股票差价收入	-9,790,015.62

## 6.4.7.14.2 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

## 6.4.7.15 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	847,895,039.65
减：卖出/赎回基金成本总额	873,372,352.82
减：买卖基金差价收入应缴纳增值 税额	-
减：交易费用	704,177.90
基金投资收益	-26,181,491.07

## 6.4.7.16 债券投资收益

## 6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	321,386.78
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券 到期兑付）差价收入	-176,980.00

债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	144,406.78

#### 6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	61,312,000.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	60,085,780.00
减：应计利息总额	1,402,800.00
减：交易费用	400.00
买卖债券差价收入	-176,980.00

#### 6.4.7.17 资产支持证券投资收益

无。

#### 6.4.7.18 贵金属投资收益

无。

#### 6.4.7.19 衍生工具收益

##### 6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

##### 6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

#### 6.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	46,678.40
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	1,106,673.89
合计	1,153,352.29



## 6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-19,121,592.18
股票投资	-51,905.43
债券投资	21,460.00
资产支持证券投资	-
基金投资	-19,091,146.75
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-19,121,592.18

## 6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
其他	57,222.91
合计	57,222.91

注：其他收入-其他为基金管理人运用基金中基金财产申购自身管理的基金的返还的销售服务费。

## 6.4.7.23 持有基金产生的费用

项目	本期费用 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	210,945.52
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	1,204,610.83
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	255,191.48

## 6.4.7.24 信用减值损失

无。

## 6.4.7.25 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	34,712.18
信息披露费	59,507.37

证券出借违约金	-
银行划款手续费	9,483.60
账户维护费	9,000.00
合计	112,703.15

#### 6.4.7.26 分部报告

无。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或者其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
大成基金管理有限公司（“大成基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人、基金销售机构
光大证券股份有限公司（“光大证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例(%)
光大证券	192,467,495.11	46.26	33,479,287.96	54.67

##### 6.4.10.1.2 债券交易

无。

## 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)
光大证券	70,000,000.00	100.00	830,000,000.00	100.00

## 6.4.10.1.4 基金交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	成交金额	占当期基金 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期基金 成交总额的比例 (%)
光大证券	848,523,327.35	88.60	150,764,170.50	98.01

## 6.4.10.1.5 权证交易

无。

## 6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
光大证券	175,922.49	46.25	84,790.16	48.32
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
光大证券	30,509.15	54.67	4,188.19	100.00

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

## 6.4.10.2 关联方报酬

## 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年6月	2021年1月1日至2021年

	月 30 日	6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,552,582.54	1,824,566.27
其中：支付销售机构的客户维护费	597,087.70	655,074.78

注：基金投资于本基金管理人所管理的公开募集证券投资基金的部分不收取管理费。基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.0% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.0\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值中扣除本基金持有的基金管理人自身管理的其他公开募集证券投资基金部分

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	227,679.27	240,468.01

注：本基金投资于本基金托管人所托管的公开募集证券投资基金的部分不收取托管费。基金托管费每日计提，按月支付。基金托管人的基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.15% 年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值中扣除本基金持有的基金托管人自身托管的其他公开募集证券投资基金部分

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成养老 2040 三年持有 混合（FOF）A	大成养老 2040 三年持有 混合（FOF）C	合计
大成基金	-	12,086.73	12,086.73
中国农业银行	-	9,003.18	9,003.18
合计	-	21,089.91	21,089.91
获得销售服务费的各关联方	上年度可比期间		

方名称	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成养老 2040 三年持有混合（FOF）A	大成养老 2040 三年持有混合（FOF）C	合计
大成基金	-	13,989.35	13,989.35
中国农业银行	-	9,659.46	9,659.46
合计	-	23,648.81	23,648.81

注：基金销售服务费每日计算，按月支付。

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费；C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.4% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.4\% / \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

大成养老 2040 三年持有混合（FOF）A

关联方名称	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日

	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例 (%)
光大证券	7,500,566.66	4.6800	7,500,566.66	2.7900

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30 日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	54,809,041.96	72,780.29	42,142,698.72	101,286.23

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，并按银行约定利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

报告期末，本基金持有基金管理人大成基金管理有限公司所管理的公开募集证券投资基金合计 35,608,474.73 元，占本基金资产净值的比例为 17.98%。

##### 6.4.10.8.2 当期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

项目	本期费用 2022年1月1日至2022年6 月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6 月30日
当期交易基金产生的申购费（元）	4,827.94	-
当期交易基金产生的赎回费（元）	253,417.50	-
当期持有基金产生的应支付销售 服务费（元）	210,945.52	57,222.89
当期持有基金产生的应支付管理 费（元）	1,204,610.83	150,553.13
当期持有基金产生的应支付托管 费（元）	255,191.48	27,185.29
当期交易基金产生的转换费（元）	410,978.38	-

#### 6.4.11 利润分配情况

无。

#### 6.4.12 期末(2022年6月30日)本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险,并设定适当的风险限额及内部控制流程,通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设,建立了以由高层监控(合规与风险管理委员会、公司投资风险控制委员会)、专业监控(监察稽核部、风险管理部)、部门互控、岗位自控构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规与风险管理委员会,对公司整体运营风险进行监督,监督风险控制措施的执行。在管理层层面设立投资风险控制委员会,通过定期会议讨论涉及投资风险的重大议题,形成正式决议提交投委会。在业务操作层面,监察稽核部履行合规控制职责,通过定期、不定期检查内控制度的执行情况、对重大风险点以专项稽核的方式确保公司内控制度、流程得到贯彻执行。风险管理部履行风险量化评估分析职责。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发,判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发,根据本基金的投资目标,结合基金资产所运用金融工

其特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指由于基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，债券发行人信用评级降低导致债券价格下降，或基金在交易过程中发生交收违约，而造成基金资产损失的可能性。

本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

##### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

##### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	20,142,000.00
合计	-	20,142,000.00

注：注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为债券期限在一年以上的政策性金融债。

3. 债券投资以净价列示。

##### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。



#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人于锁定期届满后赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及《养老目标证券投资基金指引（试行）》等有关法规的要求建立健全养老目标基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。本基金设置投资者最短持有期限（即锁定期）为三年，并自基金合同生效日满三年起对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非正常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。于本期末，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例未超过 15%。

本基金主要投资于公开募集的证券投资基金，除在附注“期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动

而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及买入返售金融资产等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	54,809,041.96	-	-	-	54,809,041.96
结算备付金	799,763.32	-	-	-	799,763.32
存出保证金	162,144.98	-	-	-	162,144.98
交易性金融资产	-	-	-	-258,492,448.44	258,492,448.44
应收股利	-	-	-	569.26	569.26
应收申购款	-	-	-	6,072.90	6,072.90
应收清算款	-	-	-	18,575,691.64	18,575,691.64
其他资产	-	-	-	11,294.23	11,294.23
资产总计	55,770,950.26	-	-	-277,086,076.47	332,857,026.73
负债					
应付赎回款	-	-	-	-134,262,633.57	134,262,633.57
应付管理人报酬	-	-	-	233,245.43	233,245.43
应付托管费	-	-	-	35,478.65	35,478.65
应付销售服务费	-	-	-	8,689.17	8,689.17
其他负债	-	-	-	270,085.59	270,085.59
负债总计	-	-	-	-134,810,132.41	134,810,132.41
利率敏感度缺口	55,770,950.26	-	-	-142,275,944.06	198,046,894.32
上年度末 2021年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	19,089,787.50	-	-	-	19,089,787.50
结算备付金	1,169,675.75	-	-	-	1,169,675.75
存出保证金	36,439.23	-	-	-	36,439.23
交易性金融资产	20,142,000.00	-	-	-346,897,277.90	367,039,277.90

买入返售金融资产	6,000,000.00	-	-	-	6,000,000.00
应收股利	-	-	-	7,533,925.00	7,533,925.00
应收申购款	137.89	-	-	2,645.25	2,783.14
其他资产	-	-	-	563,875.46	563,875.46
资产总计	46,438,040.37	-	-	-354,997,723.61	401,435,763.98
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	315,945.16	315,945.16
应付托管费	-	-	-	40,367.88	40,367.88
应付证券清算款	-	-	-	13,321,347.67	13,321,347.67
应付销售服务费	-	-	-	10,990.53	10,990.53
其他负债	-	-	-	190,273.77	190,273.77
负债总计	-	-	-	13,878,925.01	13,878,925.01
利率敏感度缺口	46,438,040.37	-	-	-341,118,798.60	387,556,838.97

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变。		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	利率上升 25 个基点	-	-17,111.26
	利率下降 25 个基点	-	17,140.39

注：于本期末，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有的金融工具均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于公开募集的证券投资基金，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券

价格实施监控。

本基金投资组合的资产配置范围为：本基金投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集的证券投资基金（含 QDII 基金、香港互认基金）的比例不低于基金资产的 80%；本基金投资于股票、股票型基金、混合型基金和商品基金（含商品期货基金和黄金 ETF）的比例合计不超过基金资产的 60%；本基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	-	-	13,670,091.36	3.53
交易性金融资产—基金投资	258,492,448.44	130.52	333,227,186.54	85.98
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	258,492,448.44	130.52	346,897,277.90	89.51

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变。		
相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）		
	本期末（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）	
分析	业绩比较基准上升 5%	11,727,719.65	22,757,615.69
	业绩比较基准下降 5%	-11,727,719.65	-22,757,615.69

## 6.4.14 公允价值

### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

#### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	258,492,448.44	346,897,277.90
第二层次	-	20,142,000.00
第三层次	-	-
合计	258,492,448.44	367,039,277.90

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	258,492,448.44	77.66
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	55,608,805.28	16.71
8	其他各项资产	18,755,773.01	5.63
9	合计	332,857,026.73	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

无。

#### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

无。

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002791	坚朗五金	23,796,483.00	6.14
2	601888	中国中免	12,347,121.00	3.19
3	601995	中金公司	12,324,241.38	3.18
4	600801	华新水泥	12,234,814.00	3.16
5	002714	牧原股份	10,831,159.00	2.79

6	300373	扬杰科技	9,811,839.00	2.53
7	603596	伯特利	9,802,872.00	2.53
8	002241	歌尔股份	8,912,241.00	2.30
9	603259	药明康德	8,149,853.00	2.10
10	600031	三一重工	8,073,565.00	2.08
11	002460	赣锋锂业	7,931,276.00	2.05
12	001979	招商蛇口	6,091,736.00	1.57
13	000333	美的集团	5,306,117.00	1.37
14	000001	平安银行	5,137,929.00	1.33
15	002371	北方华创	4,920,000.00	1.27
16	002271	东方雨虹	4,705,839.00	1.21
17	601877	正泰电器	4,526,987.00	1.17
18	002475	立讯精密	3,906,100.00	1.01
19	600011	华能国际	3,647,716.00	0.94
20	600612	老凤祥	3,452,000.00	0.89

注：本项中“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002791	坚朗五金	22,378,126.00	5.77
2	601888	中国中免	16,302,361.00	4.21
3	600801	华新水泥	12,170,410.22	3.14
4	601995	中金公司	11,369,848.00	2.93
5	002714	牧原股份	10,923,848.00	2.82
6	300373	扬杰科技	10,070,825.00	2.60
7	603596	伯特利	9,881,918.00	2.55
8	002460	赣锋锂业	8,340,488.00	2.15
9	002241	歌尔股份	8,215,067.00	2.12
10	603259	药明康德	8,163,608.48	2.11
11	600031	三一重工	7,117,405.00	1.84
12	001979	招商蛇口	5,963,822.00	1.54
13	002371	北方华创	5,580,000.00	1.44
14	000333	美的集团	5,269,827.00	1.36
15	000001	平安银行	5,075,859.00	1.31
16	002271	东方雨虹	4,939,280.00	1.27
17	601877	正泰电器	3,883,302.00	1.00
18	002475	立讯精密	3,488,517.00	0.90
19	600011	华能国际	3,389,876.00	0.87
20	000498	山东路桥	3,273,977.00	0.84

注：本项中“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	205,806,658.09
卖出股票收入（成交）总额	210,261,163.30

注：本项中“买入股票的成本(成交)总额”及“卖出股票的收入(成交)总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

#### 7.6 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。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

#### 7.8 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贵金属投资明细

无。

#### 7.9 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。

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

##### 7.11.2 本期国债期货投资评价

无。



## 7.12 本报告期投资基金情况

### 7.12.1 投资政策及风险说明

本基金是采用目标日期策略的基金中基金，目标日期为 2040 年 12 月 31 日。本基金在严格控制风险的前提下，通过科学的大类资产配置，投资于多种具有不同风险收益特征的基金等金融工具，并随着目标日期的临近逐步降低本基金整体的风险收益水平，以寻求基金资产的长期稳健增值。目标日期到期后，本基金将在严格控制风险的前提下，力争获得长期稳定的投资收益。

报告期内，本基金主要投资于开放式基金，所投资的子基金整体运作情况良好。本基金的投资符合基金合同约定的投资政策、投资限制等要求。

### 7.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

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	009532	广发景明中短债 E	契约型开放式	27,020,147.42	27,860,474.00	14.07	否
2	002086	大成景安短融债券 E	契约型开放式	21,944,886.66	27,156,797.24	13.71	是
3	006662	易方达安悦超短债债券 A	契约型开放式	24,568,143.39	24,983,345.01	12.61	否
4	511360	海富通中证短融 ETF	交易型开放式 (ETF)	187,000.00	19,691,287.00	9.94	否
5	001645	国泰大健康股票 A	契约型开放式	5,390,729.34	17,077,830.55	8.62	否
6	012940	中泰星元灵活配置混合 C	契约型开放式	5,569,479.98	13,797,272.75	6.97	否

7	110053	易方达安源中短债债券 A	契约型开放式	10,622,603.09	11,734,789.63	5.93	否
8	512800	华宝中证银行 ETF	交易型开放式 (ETF)	10,000,000.00	11,410,000.00	5.76	否
9	100018	富国天利增长债券	契约型开放式	7,415,131.62	10,083,095.98	5.09	否
10	510300	华泰柏瑞沪深 300ETF	交易型开放式 (ETF)	2,200,000.00	9,917,600.00	5.01	否
11	004813	中欧先进制造股票 C	契约型开放式	2,688,360.81	9,345,011.01	4.72	否
12	511990	华宝添益货币 A	交易型开放式 (ETF)	80,666.00	8,066,519.33	4.07	否
13	006804	富国短债债券 A	契约型开放式	7,162,699.62	8,002,884.29	4.04	否
14	000725	大成添利宝货币 B	契约型开放式	5,672,047.22	5,672,047.22	2.86	是
15	011309	富国消费主题混合 C	契约型开放式	1,932,740.63	5,651,333.60	2.85	否
16	008795	海富通阿尔法对冲混合 C	契约型开放式	4,812,810.56	5,543,876.48	2.80	否
17	001445	华安国	契约	1,350,464.40	5,280,315.80	2.67	否

		企改革主题灵活配置混合	型开放式				
18	002340	富国价值优势混合	契约型开放式	1,314,941.67	5,124,853.66	2.59	否
19	006664	易方达安悦超短债债券 F	契约型开放式	4,921,259.84	5,004,429.13	2.53	否
20	512690	鹏华中证酒 ETF	交易型开放式 (ETF)	5,000,000.00	4,665,000.00	2.36	否
21	008204	交银稳利中短债债券 A	契约型开放式	3,646,022.96	4,000,416.39	2.02	否
22	003280	鹏华丰恒债券	契约型开放式	3,612,244.62	4,000,199.69	2.02	否
23	000128	大成景安短融债券 A	契约型开放式	2,272,610.80	2,779,630.27	1.40	是
24	720001	财通价值动量混合	契约型开放式	564,232.69	2,757,969.39	1.39	否
25	011323	国泰智能汽车股票 C	契约型开放式	523,044.44	1,483,877.08	0.75	否
26	011322	国泰智能装备股票 C	契约型开放式	483,481.43	1,481,870.58	0.75	否
27	012631	中银优选混合	契约型开	1,137,776.67	1,444,407.48	0.73	否

		C	放式				
28	014043	银华心怡灵活配置混合 C	契约型开放式	442,370.91	1,434,697.34	0.72	否
29	588000	华夏上证科创板 50 成份 ETF	交易型开放式 (ETF)	1,000,000.00	1,155,000.00	0.58	否
30	012181	中银智能制造股票 C	契约型开放式	488,281.25	1,050,781.25	0.53	否
31	013619	华安动态灵活配置混合 C	契约型开放式	167,201.34	834,836.29	0.42	否

### 7.13 投资组合报告附注

#### 7.13.1 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

基金投资的前十名证券的发行主体本期未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。

#### 7.13.2 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。

#### 7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	162,144.98
2	应收清算款	18,575,691.64
3	应收股利	569.26
4	应收利息	-
5	应收申购款	6,072.90
6	其他应收款	11,294.23
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,755,773.01

## 7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

## 7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

## 7.13.6 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。

## § 8 基金份额持有人信息

## 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金 份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总份 额比例 (%)
大成养老 2040 三年 持有混合 (FOF) A	3,489	42,526.69	49,620,330.19	33.44	98,755,295.48	66.56
大成养老 2040 三年 持有混合 (FOF) C	572	20,883.69	-	-	11,945,473.18	100.00
合计	4,061	39,478.23	49,620,330.19	30.95	110,700,768.66	69.05

注：1、上述机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对分级份额，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

2、持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	大成养老 2040 三年持有混合（FOF）A	250,796.69	0.1690
	大成养老 2040 三年持有混合（FOF）C	2.00	0.0000

	合计	250,798.69	0.1564
--	----	------------	--------

注：上述占基金总份额比例的计算中，对分级份额，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	大成养老 2040 三年持有混合（FOF）A	10~50
	大成养老 2040 三年持有混合（FOF）C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	大成养老 2040 三年持有混合（FOF）A	0~10
	大成养老 2040 三年持有混合（FOF）C	0
	合计	0~10

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	大成养老 2040 三年持有混合（FOF）A	大成养老 2040 三年持有混合（FOF）C
基金合同生效日（2019 年 6 月 27 日）基金份额总额	202,703,278.96	19,789,361.80
本报告期期初基金份额总额	246,503,547.64	22,626,854.84
本报告期基金总申购份额	231,149.56	48,419.99
减：本报告期基金总赎回份额	98,359,071.53	10,729,801.65
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	148,375,625.67	11,945,473.18

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

无。

## 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

### 一、基金管理人的重大人事变动

1. 根据我司发布的《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经大成基金管理有限公司第七届董事会第十四次会议审议通过并履行必要程序，自 2022 年 4 月 15 日起，周立新先生因工作安排离任公司副总经理。具体事宜详见公司公告。

2. 根据我司发布的《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经大成基金管理有限公司第七届董事会第十五次会议审议通过并履行必要程序，自 2022 年 6 月 1 日起，赵冰女士担任公司副总经理，段皓静女士担任公司督察长。自同日起赵冰女士离任公司督察长。具体事宜详见公司公告。

### 二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

2022 年 3 月，中国农业银行总行决定王霄勇任托管业务部总裁。

2022 年 3 月，中国农业银行总行决定王洪滨任托管业务部高级专家。

## 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

无。

## 10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

## 10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

## 10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)。该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

## 10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.8.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	

国泰君安	3	223,600,326.28	53.74	204,421.29	53.75	-
光大证券	2	192,467,495.11	46.26	175,922.49	46.25	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东财证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
申万宏源西部	1	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
万和证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中国银河	4	-	-	-	-	-



证券							
中金公司	3	-	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-	-
中信建投 证券	2	-	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-	-
中银国际 证券	1	-	-	-	-	-	-
中原证券	1	-	-	-	-	-	-
-	1	-	-	-	-	-	-

注：1. 租用券商专用交易单元的选择标准和程序：

根据中国证监会颁布的《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，本公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序。

租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：

- (1) 财务状况良好，最近一年无重大违规行为；
- (2) 经营行为规范，内控制度健全，能满足各投资组合运作的保密性要求；
- (3) 研究实力较强，能提供包括研究报告、路演服务、协助进行上市公司调研等研究服务；
- (4) 具备各投资组合运作所需的高效、安全的通讯条件，有足够的交易和清算能力，满足各投资组合证券交易需要；
- (5) 能提供投资组合运作、管理所需的其他券商服务；
- (6) 相关基金合同、资产管理合同以及法律法规规定的其他条件。

租用证券公司交易单元的程序：首先根据租用证券公司交易单元的选择标准形成《券商服务评价表》，然后根据评分高低进行选择基金交易单元。

2. 本基金本报告期内新增交易单元：中信证券、东亚前海，退租交易单元：无。

### 10.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
国泰君安	-	-	-	-	-	-	109,158,822.74	11.40
光大证券	-	-	70,000,000.00	100.00	-	-	848,523,327.35	88.60

## 10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于再次提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022 年 06 月 30 日
2	大成养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金（FOF）2022 年第 1 季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022 年 04 月 22 日
3	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加和讯信息科技有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022 年 04 月 19 日
4	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加宁波银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022 年 03 月 29 日
5	大成养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金（FOF）2021 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022 年 03 月 29 日
6	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加诺亚正行基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022 年 03 月 11 日
7	大成基金管理有限公司关于公司固有资金拟申购旗下偏股型公募基金的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022 年 01 月 27 日
8	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中信百信银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022 年 01 月 25 日
9	大成养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金（FOF）2021 年第 4 季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022 年 01 月 21 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立大成养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金（FOF）的文件；

- 2、《大成养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》；
- 3、《大成养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金（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。

## 12.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

## 12.3 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

2022 年 8 月 30 日