

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)
2022年第3季度报告

2022年9月30日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2022年10月26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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 10 月 25 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 2022 年 07 月 01 日起至 09 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 大成兴享平衡养老三年持有混合 (FOF) |
| 基金主代码 | 008753 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2020 年 6 月 17 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 50,003,260.22 份 |
| 投资目标 | 在控制风险的基础上，通过资产配置和基金优选，追求基金资产的长期稳健增值。 |
| 投资策略 | 本基金属于平衡型的养老目标风险基金，将根据基金合同约定的权益类、非权益类资产的目标配置比重进行资产配置。同时，基金经理将根据市场实际表现及预期判断，在基金合同约定的范围内对各大类资产配置比例进行动态调整。 |
| 业绩比较基准 | 中证全指指数收益率×45%+恒生指数收益率（使用估值汇率调整）×5%+中证全债指数收益率×50% |
| 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。 本基金还可投资港股通标的股票，还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 | 中国银行股份有限公司 |

§ 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（2022年7月1日-2022年9月30日） |
|-----------------|---------------------------|
| 1. 本期已实现收益 | -714,908.72 |
| 2. 本期利润 | -3,330,394.31 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0686 |
| 4. 期末基金资产净值 | 51,150,469.36 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.0229 |

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。

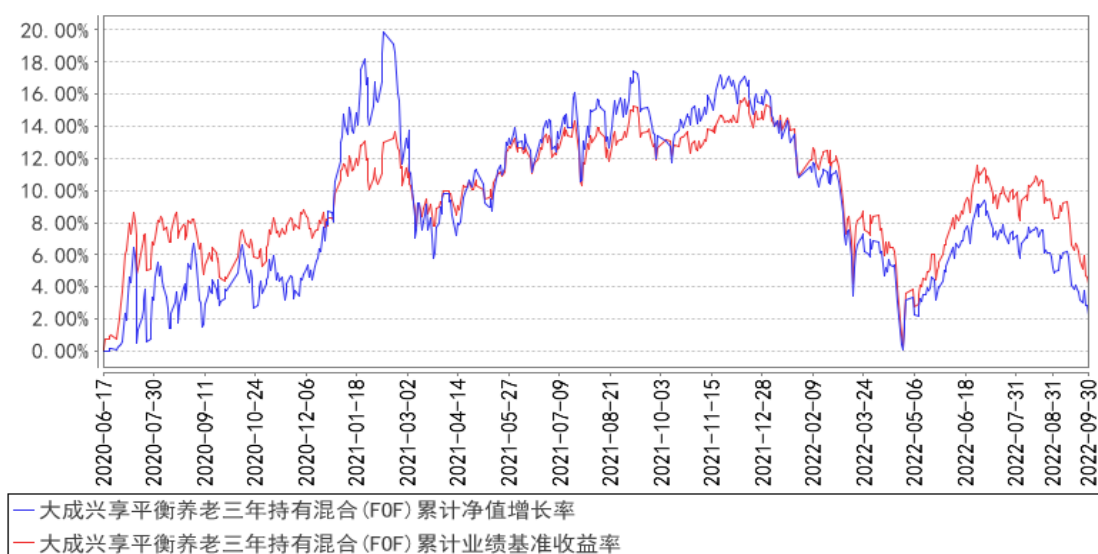
3.2 基金净值表现

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

| 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 | -6.28% | 0.43% | -6.26% | 0.49% | -0.02% | -0.06% |
| 过去六个月 | -3.84% | 0.56% | -3.55% | 0.64% | -0.29% | -0.08% |
| 过去一年 | -9.77% | 0.58% | -7.56% | 0.61% | -2.21% | -0.03% |
| 自基金合同 生效起至今 | 2.29% | 0.76% | 4.17% | 0.59% | -1.88% | 0.17% |

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

大成兴享平衡养老三年持有混合(FOF)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 | | |
| 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 |
| 尚琼 | 本基金基金经理 | 2020年6月17日 | 2022年8月3日 | 12年 | 北京大学经济学硕士。2010年7月至2011年5月任中银基金管理有限公司产品设计分析员。2011年5月加入大成基金管理有限公司，曾担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、大 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|
| | | | | | 类资产配置部基金经理。2019年6月27日至2022年8月3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。2020年6月17日至2022年8月3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。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，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不存在同日反向交易。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 1 笔同日反向交易，原因为合规比例调整。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 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度海外流动性持续收紧，全球风险资产承压，人民币兑美元汇率有所贬值，在能源危机的担忧下，A 股中煤炭和石油板块表现较好，而前期领涨的新能源和汽车板块则大幅调整。

本基金三季度适度增加了价值板块的配置比例，当前从股债性价比来看，权益资产明显占优，随着国内经济数据持续回暖，A 股有望重新回到震荡上行的趋势。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0229 元；本报告期基金份额净值增长率为-6.28%，业绩比较基准收益率为-6.26%。

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 | 45,007,105.28 | 87.80 |
| 3 | 固定收益投资 | 2,042,115.62 | 3.98 |
| | 其中：债券 | 2,042,115.62 | 3.98 |
| | 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 | 2,721,034.31 | 5.31 |
| 8 | 其他资产 | 1,488,194.33 | 2.90 |
| 9 | 合计 | 51,258,449.54 | 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

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 | 2,042,115.62 | 3.99 |
| 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） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 2,042,115.62 | 3.99 |

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 | 019664 | 21 国债 16 | 20,000 | 2,042,115.62 | 3.99 |

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

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无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

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|----------|
| 1 | 存出保证金 | 2,021.73 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |

| | | |
|---|-------|--------------|
| 5 | 应收申购款 | 1,485,443.40 |
| 6 | 其他应收款 | 729.20 |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 1,488,194.33 |

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 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 | 501022 | 银华鑫盛灵活配置混合 (LOF) | 上市契约型开放式 (LOF) | 1,357,673.02 | 2,905,420.26 | 5.68 | 否 |
| 2 | 014499 | 南方转型增长灵活配置混合 C | 契约型开放式 | 1,486,464.75 | 2,791,580.80 | 5.46 | 否 |
| 3 | 100058 | 富国产业债债券 A | 契约型开放式 | 2,205,278.90 | 2,623,620.31 | 5.13 | 否 |
| 4 | 002637 | 广发集裕债券 C | 契约型开放式 | 2,053,205.39 | 2,554,187.51 | 4.99 | 否 |
| 5 | 006805 | 富国短债债券 C | 契约型开放式 | 1,822,293.23 | 2,023,109.94 | 3.96 | 否 |
| 6 | 006662 | 易方达安悦超短债债券 A | 契约型开放式 | 1,988,143.38 | 2,020,351.30 | 3.95 | 否 |
| 7 | 008106 | 博时富瑞纯债债券 C | 契约型开放式 | 1,816,231.25 | 1,926,113.24 | 3.77 | 否 |

| | | | | | | | |
|----|--------|-------------|--------|--------------|--------------|------|---|
| 8 | 110052 | 易方达安源中短债债券C | 契约型开放式 | 1,657,292.26 | 1,805,122.73 | 3.53 | 否 |
| 9 | 003280 | 鹏华丰恒债券 | 契约型开放式 | 1,617,278.40 | 1,792,914.83 | 3.51 | 否 |
| 10 | 002086 | 大成景安短融债券E | 契约型开放式 | 1,408,795.08 | 1,750,850.53 | 3.42 | 是 |

6.2 当期交易及持有基金产生的费用

| 项目 | 本期费用 2022年7月1日至2022年9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) | 2,098.31 | - |
| 当期交易基金产生的赎回费(元) | 7,912.22 | - |
| 当期持有基金产生的应支付销售服务费(元) | 20,145.00 | 2,170.44 |
| 当期持有基金产生的应支付管理费(元) | 110,420.40 | 8,249.37 |
| 当期持有基金产生的应支付托管费(元) | 19,948.16 | 1,698.11 |

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

| | |
|---------------------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 48,554,340.42 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 1,448,919.80 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | - |
| 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 | 50,003,260.22 |

§ 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

| | |
|------------------|---------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 10,000,000.00 |
| 报告期期间买入/申购总份额 | 7,329,118.56 |

| | |
|--------------------------|---------------|
| 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 | 17,329,118.56 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%) | 34.66 |

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 | 2022-07-01 | 7,329,118.56 | 8,000,000.00 | - |
| 合计 | | | 7,329,118.56 | 8,000,000.00 | |

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 | 17,329,118.56 | 34.66 | 17,329,118.56 | 34.66 | 3年 |
| 基金管理人高级管理人员 | 9,900.99 | 0.02 | - | - | - |
| 基金经理等人员 | 19.98 | 0.00 | - | - | - |
| 基金管理人股东 | - | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - | - |
| 合计 | 17,339,039.53 | 34.68 | 17,329,118.56 | 34.66 | 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 |

| | | | | | | |
|---|---|-------------------|---------------|--------------|----------------|-------|
| 机构 | 1 | 20220701-20220930 | 10,000,000.00 | 7,329,118.56 | -17,329,118.56 | 34.66 |
| 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）的文件；
- 2、《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）基金合同》；
- 3、《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）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

2022 年 10 月 26 日