

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）  
2025 年第 2 季度报告

2025 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：2025 年 7 月 21 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 2025 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 2025 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 | 51,016,473.99 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 | 50,316,869.70 份           | 699,604.29 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（2025 年 4 月 1 日 - 2025 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      | 163,401.29                            | 2,873.00                  |
| 2. 本期利润         | 881,581.74                            | 13,178.57                 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0179                                | 0.0195                    |
| 4. 期末基金资产净值     | 52,233,334.31                         | 729,755.80                |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.0381                                | 1.0431                    |

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 | 1.77%  | 0.34%     | 1.31%      | 0.29%         | 0.46%  | 0.05%  |
| 过去六个月 | 3.36%  | 0.28%     | 1.12%      | 0.27%         | 2.24%  | 0.01%  |
| 过去一年  | 6.35%  | 0.28%     | 6.89%      | 0.33%         | -0.54% | -0.05% |
| 自基金合同 | 3.81%  | 0.23%     | 5.95%      | 0.27%         | -2.14% | -0.04% |

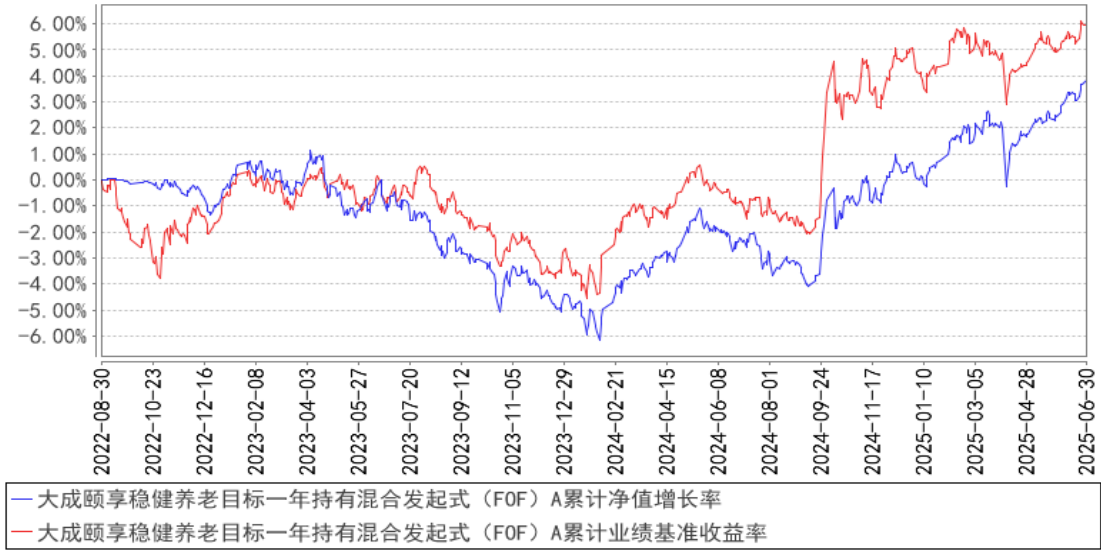
|       |  |  |  |  |  |  |
|-------|--|--|--|--|--|--|
| 生效起至今 |  |  |  |  |  |  |
|-------|--|--|--|--|--|--|

大成颐享稳健养老目标一年持有混合发起式（FOF）Y

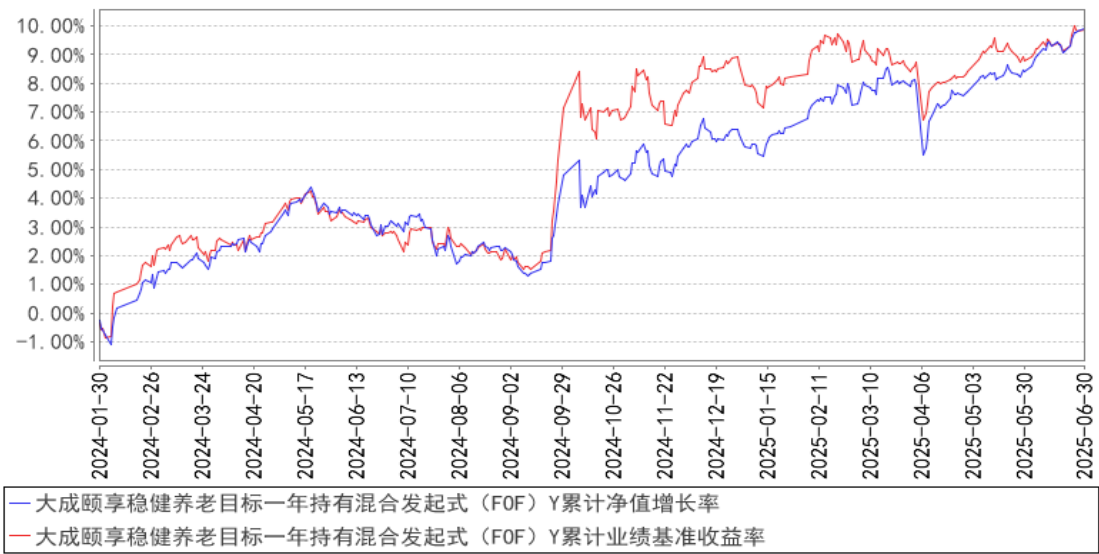
| 阶段         | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③    | ②－④    |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月      | 1.86%  | 0.34%     | 1.31%      | 0.29%         | 0.55%  | 0.05%  |
| 过去六个月      | 3.50%  | 0.28%     | 1.12%      | 0.27%         | 2.38%  | 0.01%  |
| 过去一年       | 6.67%  | 0.28%     | 6.89%      | 0.33%         | -0.22% | -0.05% |
| 自基金合同生效起至今 | 9.92%  | 0.26%     | 9.85%      | 0.30%         | 0.07%  | -0.04% |

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 | —    | 9 年    | 北京大学经济学硕士、香港大学金融学硕士。证券、保险资管从业年限 9 年。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。2025 年 6 月 24 日起担任大成睿浦智选三个月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遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》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

尽管受到美国关税政策影响，二季度国内宏观环境总体仍保持稳定。6 月份国内制造业 PMI、非制造业商务活动指数和综合 PMI 产出指数分别为 49.7%、50.5%和 50.7%，基本保持稳定，其中制造业 PMI 连续两个月回升。海外宏观环境不确定性在季初大幅提升，但随后回落。美国政府在 4 月初宣布加征“对等关税”，对市场造成冲击，但在之后美国宣布对超过 10%部分的对等关税在 90 天内暂停，并与主要贸易伙伴展开贸易谈判，中美之间也进行了谈判，取得一定成果。展望三季度，国内宏观环境预期继续保持稳定，海外方面仍存在一定不确定性，但随着贸易框架基本落地，美国政策重心转向国内，宏观风险有望进一步下降。

从大类资产表现来看，二季度权益市场波动较大，A 股、港股均先跌后涨，基本修复 4 月初的下跌，A 股呈现哑铃型的结构性行情，大盘价值和小盘成长表现亮眼。债市在季初关税摩擦的不确定性环境下大涨，随后保持震荡。海外资产方面，美股先跌后涨，年内实现正收益，美债收益率震荡，10 年美债收益率基本维持在 4.2%附近。黄金保持上涨，大宗商品则震荡分化，原油价格大幅波动，铜、铝等有色品种相对较强。

二季度本基金坚持大类资产配置策略，并在细分资产上寻找阿尔法，主要把握住权益、商品、债券等主要大类资产的上涨行情，净值实现增长。在投资策略上，我们进一步优化资产配置模型，在战术资产配置上完善量化模型+主观判断相结合的投资策略，并加强对中观行业的研究，完善 ETF 投资的卫星策略。接下来我们将继续深化对大类资产及细分资产的研究，寻找性价比较高的资产进行配置。

不同于一些工具性产品，公募 FOF 主要为个人投资者提供解决方案，满足个人投资者为教育、改善生活、养老等目的的理财需求，通过稳健的投资方式分享中国乃至全球主要资产的增值机会。FOF 首先是帮助投资者进行资产配置，其次帮助投资者在众多的基金产品中选取合适的品种。海外 FOF 在公募基金中占有比较明显的份额，而国内 FOF 在公募基金中占有的份额较低，其发展任重而道远。不过我们也欣慰地看到，今年以来公募 FOF 规模有所提升，FOF 作为大类资产配置的功能得到市场重视。我们希望通过不断努力，建立与投资者的信任关系，提升产品业绩表现，更好地服务投资者。

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收益目标，发挥资产配置的优势，以更宽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，争取为投资人获取收益。

#### 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 1.0381 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.77%，同期业绩比较基准收益率为 1.31%；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 1.0431 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.86%，同期业绩比较基准收益率为 1.31%。

#### 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              | 43,592,044.29 | 82.09        |
| 3  | 固定收益投资            | 6,705,733.15  | 12.63        |
|    | 其中：债券             | 6,705,733.15  | 12.63        |
|    | 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      | 2,787,875.30  | 5.25         |
| 8  | 其他资产              | 14,794.48     | 0.03         |
| 9  | 合计                | 53,100,447.22 | 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      | 2,623,330.19 | 4.95         |
| 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） | 4,082,402.96 | 7.71         |
| 8  | 同业存单      | —            | —            |
| 9  | 其他        | —            | —            |
| 10 | 合计        | 6,705,733.15 | 12.66        |

### 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  | 019758 | 24 国债 21 | 26,000 | 2,623,330.19 | 4.95         |
| 2  | 111010 | 立昂转债     | 2,500  | 288,729.79   | 0.55         |
| 3  | 123216 | 科顺转债     | 2,500  | 280,606.85   | 0.53         |
| 4  | 127085 | 韵达转债     | 2,500  | 274,491.30   | 0.52         |
| 5  | 113644 | 艾迪转债     | 2,000  | 237,106.30   | 0.45         |

### 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   | 12,032.05 |
| 2  | 应收证券清算款 | —         |
| 3  | 应收股利    | 0.02      |
| 4  | 应收利息    | —         |
| 5  | 应收申购款   | —         |
| 6  | 其他应收款   | 2,762.41  |
| 7  | 其他      | —         |
| 8  | 合计      | 14,794.48 |

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  | 111010 | 立昂转债 | 288,729.79 | 0.55         |
| 2  | 123216 | 科顺转债 | 280,606.85 | 0.53         |

|    |        |         |            |      |
|----|--------|---------|------------|------|
| 3  | 127085 | 韵达转债    | 274,491.30 | 0.52 |
| 4  | 113644 | 艾迪转债    | 237,106.30 | 0.45 |
| 5  | 113660 | 寿 22 转债 | 230,190.68 | 0.43 |
| 6  | 118024 | 冠宇转债    | 229,595.89 | 0.43 |
| 7  | 113691 | 和邦转债    | 216,503.51 | 0.41 |
| 8  | 123122 | 富瀚转债    | 175,457.47 | 0.33 |
| 9  | 113679 | 芯能转债    | 169,967.67 | 0.32 |
| 10 | 110086 | 精工转债    | 166,140.21 | 0.31 |
| 11 | 110095 | 双良转债    | 157,227.53 | 0.30 |
| 12 | 123194 | 百洋转债    | 120,020.96 | 0.23 |
| 13 | 113636 | 甬金转债    | 118,247.53 | 0.22 |
| 14 | 118033 | 华特转债    | 117,403.56 | 0.22 |
| 15 | 113655 | 欧 22 转债 | 116,373.29 | 0.22 |
| 16 | 123117 | 健帆转债    | 114,221.56 | 0.22 |
| 17 | 123151 | 康医转债    | 113,010.00 | 0.21 |
| 18 | 113627 | 太平转债    | 112,693.97 | 0.21 |
| 19 | 110081 | 闻泰转债    | 111,661.23 | 0.21 |
| 20 | 127030 | 盛虹转债    | 109,178.47 | 0.21 |
| 21 | 118034 | 晶能转债    | 103,674.68 | 0.20 |
| 22 | 123192 | 科思转债    | 60,751.58  | 0.11 |
| 23 | 123168 | 惠云转债    | 59,851.10  | 0.11 |
| 24 | 127090 | 兴瑞转债    | 59,074.92  | 0.11 |
| 25 | 113638 | 台 21 转债 | 58,312.47  | 0.11 |
| 26 | 128135 | 洽洽转债    | 58,136.04  | 0.11 |
| 27 | 113647 | 禾丰转债    | 57,430.07  | 0.11 |
| 28 | 123154 | 火星转债    | 57,056.64  | 0.11 |
| 29 | 113633 | 科沃转债    | 56,745.14  | 0.11 |
| 30 | 127089 | 晶澳转债    | 52,542.55  | 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<br>基金 |
|----|--------|-------------------------------------------|-----------------------|--------------|--------------|------|------------|
| 1  | 002086 | 大成景安短<br>融债券 E                            | 契约型开放<br>式            | 2,802,172.80 | 3,747,065.47 | 7.07 | 是          |
| 2  | 007361 | 易方达中短<br>期美元债债<br>券<br>(QDII)C(人<br>民币份额) | 契约型开放<br>式            | 2,631,374.35 | 3,103,969.18 | 5.86 | 否          |
| 3  | 008846 | 大成民稳增长混合 A                                | 契约型开放<br>式            | 1,817,014.47 | 2,326,141.92 | 4.39 | 是          |
| 4  | 100058 | 富国产业债<br>债券 A/B                           | 契约型开放<br>式            | 1,843,000.11 | 2,240,166.63 | 4.23 | 否          |
| 5  | 010928 | 大成元吉增<br>利债券 C                            | 契约型开放<br>式            | 2,102,835.89 | 2,227,113.49 | 4.21 | 是          |
| 6  | 008383 | 招商安心收<br>益债券 A                            | 契约型开放<br>式            | 1,079,123.58 | 2,094,363.04 | 3.95 | 否          |
| 7  | 007360 | 易方达中短<br>期美元债债<br>券<br>(QDII)A(人<br>民币份额) | 契约型开放<br>式            | 1,636,042.78 | 1,964,396.57 | 3.71 | 否          |
| 8  | 161119 | 易方达中债<br>新综指<br>(LOF)A                    | 上市契约型<br>开放式<br>(LOF) | 1,000,000.00 | 1,763,300.00 | 3.33 | 否          |
| 9  | 518880 | 华安黄金易<br>(ETF)                            | 交易型开放<br>式(ETF)       | 240,000.00   | 1,755,360.00 | 3.31 | 否          |
| 10 | 161120 | 易方达中债<br>新综指<br>(LOF)C                    | 上市契约型<br>开放式<br>(LOF) | 830,186.76   | 1,409,657.12 | 2.66 | 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 2025 年 4 月 1 日至 2025 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)      | 699.71    | —         |
| 当期交易基金产生的赎回费(元)      | —         | —         |
| 当期持有基金产生的应支付销售服务费(元) | 15,108.16 | 8,185.37  |
| 当期持有基金产生的应支付管理费(元)   | 59,237.27 | 22,501.08 |
| 当期持有基金产生的应支付托管费(元)   | 13,373.54 | 4,440.99  |
| 当期交易基金产生的交易费(元)      | 741.26    | 51.98     |
| 当期交易基金产生的转换费(元)      | 2,062.80  | —         |

### 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               | 50,223,763.17             | 655,828.77                |
| 报告期期间基金总申购份额              | 1,923,442.66              | 66,780.62                 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额            | 1,830,336.13              | 23,005.10                 |
| 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               | 50,316,869.70             | 699,604.29                |

## §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         | 42,793,141.80             | —                         |
| 报告期期间买入/申购总份额            | 1,919,230.16              | —                         |
| 报告期期间卖出/赎回总份额            | 0.00                      | —                         |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额         | 44,712,371.96             | —                         |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 87.64                     | —                         |

### 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   | 2025-06-30 | 1,919,230.16 | 2,000,000.00 | -       |
| 合计 |      |            | 1,919,230.16 | 2,000,000.00 |         |

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<br>份额比例(%) | 发起份额总数        | 发起份额占基金总<br>份额比例(%) | 发起份额承<br>诺持有期限 |
|-------------|---------------|---------------------|---------------|---------------------|----------------|
| 基金管理人固有资金   | 44,712,371.96 | 87.64               | 10,000,138.90 | 19.60               | 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     | 341,588.72    | 0.67                | -             | -                   | -              |
| 基金管理人股东     | -             | -                   | -             | -                   | -              |
| 其他          | -             | -                   | -             | -                   | -              |
| 合计          | 45,063,960.81 | 88.33               | 10,000,138.90 | 19.60               | 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<br>份额占比(%)        |
| 机构                                                                                                                          | 1              | 20250401-20250630       | 42,793,141.80 | 1,919,230.16 | -          | 44,712,371.96<br>87.64 |
| 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

2025 年 7 月 21 日