

大成养老目标日期 2040 三年持有期混合型  
基金中基金（FOF）  
2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 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：2024 年 3 月 29 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。本年度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 2024 年 03 月 28 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。

本报告财务资料已经审计。安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况</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	10
3.3 过去三年基金的利润分配情况	13
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>13</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	15
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	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	18
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	18
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	19
4.9 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	19
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>19</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	19
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	20
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	20
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>20</b>
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>22</b>
7.1 资产负债表	22
7.2 利润表	23
7.3 净资产变动表	24
7.4 报表附注	26
<b>§ 8 投资组合报告</b>	<b>55</b>
8.1 期末基金资产组合情况	55
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	55
8.3 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	56
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	56

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	56
8.6 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 .....	56
8.7 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 .....	56
8.8 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 .....	56
8.9 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 .....	56
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	56
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	57
8.12 本报告期投资基金情况 .....	57
8.13 投资组合报告附注 .....	64
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>64</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	64
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	65
9.3 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 .....	65
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 .....	66
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>66</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>66</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	66
11.2 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 .....	66
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	67
11.4 基金投资策略的改变 .....	67
11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 .....	67
11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	67
11.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	67
11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	67
11.9 其他重大事件 .....	70
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>74</b>
12.1 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 .....	74
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	74
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>74</b>
13.1 备查文件目录 .....	74
13.2 存放地点 .....	74
13.3 查阅方式 .....	75

## § 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	50,009,193.90 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	大成养老 2040 三年持有混 合（FOF）Y
下属分级基金的交 易代码	007297	007298	017282
报告期末下属分级 基金的份额总额	34,287,471.20 份	5,839,978.30 份	9,881,744.40 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： $X \times$ 沪深 300 指数收益率 + $(1-X) \times$ 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	任航
	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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.dcfund.com.cn
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
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、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2023 年			2022 年			2022 年 11 月 11 日(基 金合同 生效 日)-20 22 年 12 月 31 日	2021 年			
	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	大成养老 2040 三年持有混合 (FOF) Y	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	大成养老 2040 三年持有混合 (FOF) Y	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	大成养老 2040 三年持有混合 (FOF) Y	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

									年持有混合 (FOF) Y
本期已实现收益	-4,020,747.93	-569,906.59	-791,258.67	-39,617,625.98	-3,734,608.54	-15,667.39	33,490,652.47	2,902,307.96	-
本期利润	-2,567,729.30	-422,622.43	-765,602.08	-61,338,245.70	-5,664,673.56	-41,964.78	13,519,686.86	1,060,108.40	-
加权平均基金份额本期利润	-0.0466	-0.0653	-0.0869	-0.3621	-0.3627	-0.0227	0.0550	0.0473	-
本期加权平均净值利润	-4.13%	-5.93%	-7.80%	-29.36%	-29.77%	-2.00%	3.89%	3.37%	-

率									
本期基金份额净值增长率	-6.84%	-7.22%	-6.37%	-21.40%	-21.71%	-1.96%	3.97%	3.56%	-
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末			2022 年末			2021 年末		
期末可供分配利润	1,633,616.48	161,764.43	517,276.44	11,399,266.63	988,440.24	604,892.01	83,163,301.29	7,304,964.95	-
期末可供分配基金份额利润	0.0476	0.0277	0.0523	0.1328	0.1170	0.1309	0.3374	0.3228	-
期末基	36,182,307.78	6,052,609.14	10,463,831.65	97,245,387.11	9,437,274.65	5,226,481.86	355,271,723.56	32,285,115.41	-



金 资 产 净 值									
期 末 基 金 份 额 净 值	1.0553	1.0364	1.0589	1.1328	1.1170	1.1309	1.4412	1.4268	-
3. 1. 3 累 计 期 末 指 标	2023 年末			2022 年末			2021 年末		
基 金 份 额 累 计 净 值 增 长 率	5.53%	3.64%	-8.20%	13.28%	11.70%	-1.96%	44.12%	42.68%	-

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、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、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
过去三个月	-2.11%	0.44%	-3.14%	0.39%	1.03%	0.05%
过去六个月	-7.38%	0.43%	-4.64%	0.42%	-2.74%	0.01%
过去一年	-6.84%	0.43%	-3.88%	0.42%	-2.96%	0.01%
过去三年	-23.87%	0.67%	-13.10%	0.56%	-10.77%	0.11%
自基金合同生效起至今	5.53%	0.77%	5.68%	0.58%	-0.15%	0.19%

大成养老 2040 三年持有混合（FOF）C

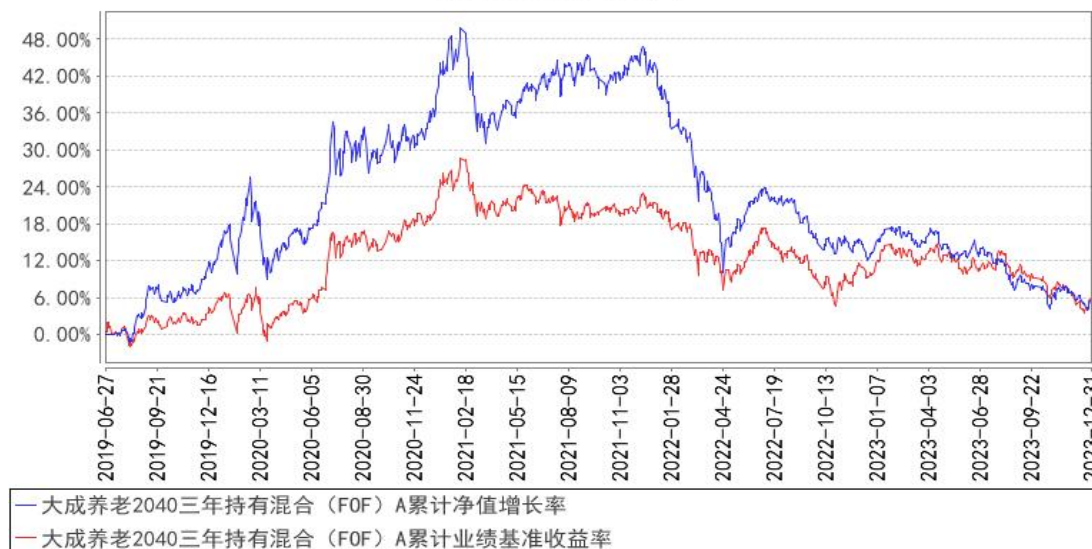
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-2.22%	0.44%	-3.14%	0.39%	0.92%	0.05%
过去六个月	-7.57%	0.43%	-4.64%	0.42%	-2.93%	0.01%
过去一年	-7.22%	0.43%	-3.88%	0.42%	-3.34%	0.01%
过去三年	-24.78%	0.67%	-13.10%	0.56%	-11.68%	0.11%
自基金合同生效起至今	3.64%	0.77%	5.68%	0.58%	-2.04%	0.19%

大成养老 2040 三年持有混合（FOF）Y

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
过去三个月	-2.00%	0.44%	-3.14%	0.39%	1.14%	0.05%
过去六个月	-7.15%	0.43%	-4.64%	0.42%	-2.51%	0.01%
过去一年	-6.37%	0.43%	-3.88%	0.42%	-2.49%	0.01%
自基金合同生效起至今	-8.20%	0.42%	-3.33%	0.43%	-4.87%	-0.01%

### 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

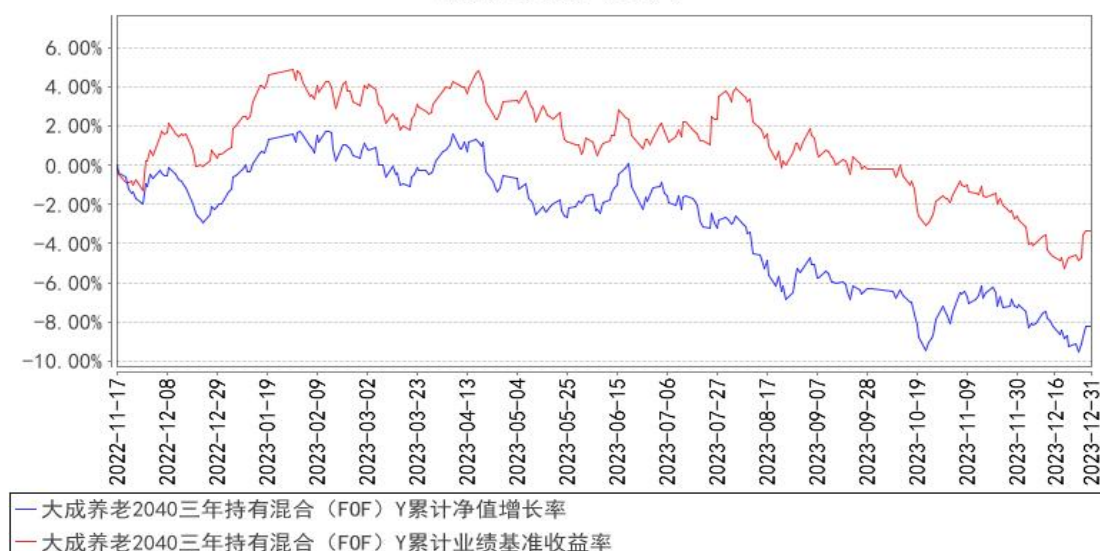
大成养老2040三年持有混合（FOF）A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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



大成养老2040三年持有混合（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

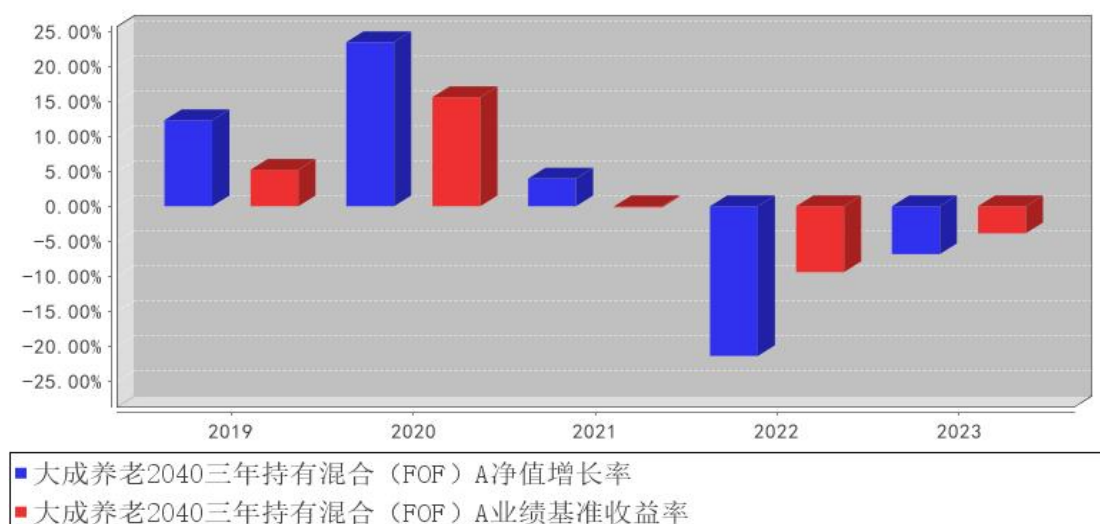


注：1、本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

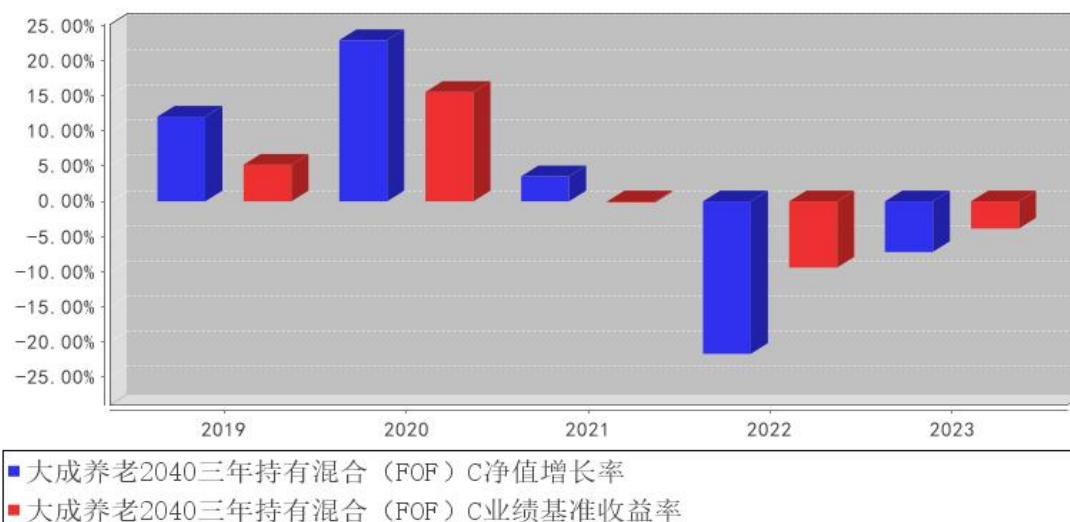
2、本基金自 2022 年 11 月 11 日起增设 Y 类基金份额类别，Y 类的净值增长率和业绩比较基准收益率自 2022 年 11 月 17 日有份额之日开始计算。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

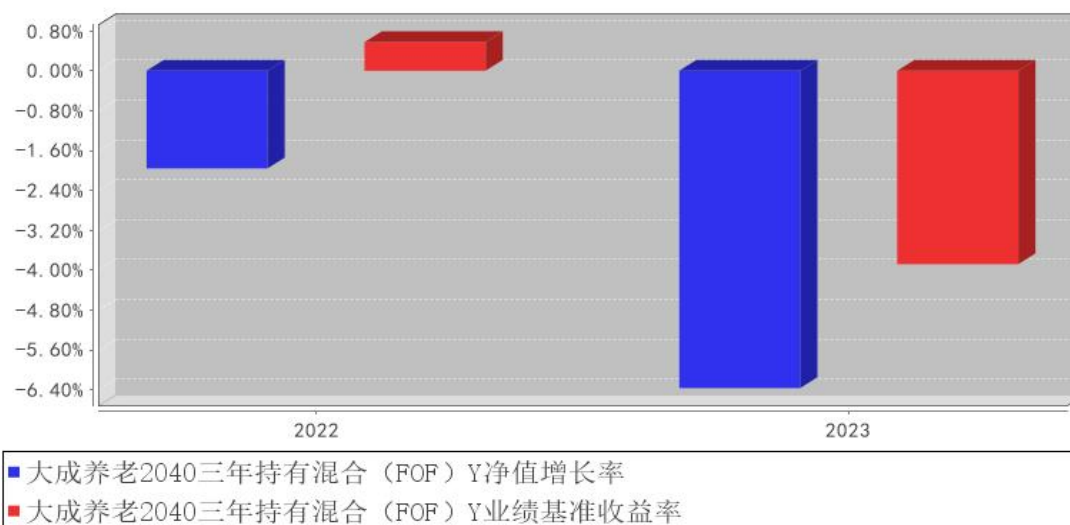
大成养老2040三年持有混合（FOF）A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



大成养老2040三年持有混合（FOF）C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



大成养老2040三年持有混合（FOF）Y基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

## § 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成立于1999年4月12日，注册资本人民币2亿元，是中国首批获准成立的“老十家”基金管理公司之一。公司总部位于深圳，同时设置了北方、华东和南方营销总

部，在北京、上海等地开设有 5 家分公司。2009 年，公司在香港设立大成国际资产管理有限公司，大力拓展国际业务；2013 年，设立大成创新资本管理有限公司，开拓专户及专项管理业务。

公司业务资质齐全，全面覆盖公募基金、机构投资、海外投资、财富管理、养老金管理等业务，还受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金和基本养老保险基金。旗下大成国际资产管理公司具备 QFII、RQFII 等资格，是首批首家完成备案的能够提供港股通投资顾问服务的香港机构。

历经二十余年的磨砺和沉淀，大成基金形成了以长期投资能力为核心的竞争优势，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。公司目前已形成权益投资、固收投资、指数与期货投资、跨境投资、混合资产投资、大类资产配置六大投资团队，全面覆盖各类投资领域，综合实力不断提升，各项业务迅猛发展，管理资产种类位居同业前列。

#### 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		
吴翰	本基金基金经理， 大类资产配置部副 总监	2023 年 2 月 13 日	-	23 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 月加入大成基金管理有限公司，现任大类资产配置部副总监。2022 年 8 月 2 日起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 31 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。2023 年 2 月 13 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。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 日起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
鲁速	本基金基金经理	2021 年 8 月 3 日	2023 年 3 月 30 日	12 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，曾担任大类资产配置部基金经理。2021 年 8 月 3 日至 2023 年 3 月 30 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。2021 年 8 月 3 日至 2023 年 4 月 28 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。

#### 4.1.3 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。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

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 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定，公司制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》、《大成基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。公司旗下投资组合严格按照制度的规定，参与股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，内容包

括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等与投资活动相关的各个环节。研究部负责提供投资研究支持，投资部门负责投资决策，交易管理部负责实施交易并实时监控，监察稽核部负责事前监督、事中检查和事后稽核，风险管理部负责对交易情况进行合理性分析，通过多部门的协作互控，保证了公平交易的可操作、可稽核和可持续。

#### 4.3.2 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。

##### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

无。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价，未发生成交较少的单边交易量超过该股当日成交量 5% 的股票同日反向交易；主动投资组合间债券交易存在 1 笔同日反向交易，原因为流动性需要。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

回顾 2023 年，全球宏观经济与国际政治环境错综复杂，主要国家经济以及金融市场运行特征与年初投资者共识形成较大偏离。美国实施宽财政、紧货币的金融财政政策，叠加消费需求较强以及制造业回归等因素，美国经济显示异常韧性，通胀超预期上行。我国经济面临内外部多重挑战，经济转型之路需要扎实推进；权益市场受到欧美紧缩货币、外资流出以及人民币汇率大幅波动的扰动。尽管年初国内疫情防控转段后经济活动逐渐回归正常化，线下场景消费恢复较快，但是房地产和地方融资平台双重债务问题成为经济增长羁绊，收入预期弱化等因素使得整体消费尤其是占据核心位置的地产链相关消费恢复速度慢于预期，并传导至制造业中游环节，国内经济修复进程曲折。在此背景下，货币信用政策环境超预期友好，央行通过降准、降息等举措进行逆



周期调节，同时各级部门进行了一系列房企债务纾困以及地方债务化解工作，但是信用传导不畅，M1 增速等金融经济指标不及预期。同时，复杂的全球政治环境，对经济转型和市场风险偏好有一定影响。国内外综合因素作用下，国内债券市场收益率震荡下行，A 股市场整体上震荡走低，呈现存量资金博弈的结构分化行情。

组合管理方面，鉴于友好的货币信用政策环境以及权益风险溢价处于较高水平，本基金将权益类资产配置比例基本维持在基准水平，并根据较为曲折的经济消费复苏进程和 AI 技术突破，在上半年从原来均衡配置风格上逐渐向成长风格倾斜；之后随着经济指标不及预期以及较低的风险偏好，将权益组合调整为红利与成长的杠铃组合。同时，基于产业政策、行业竞争格局、估值水平 and 交易拥挤度变化，对行业配置进行了结构调整。然而，由于对宏观环境复杂性缺少前瞻性认识，权益部分回撤相对较大，影响了组合业绩表现。

#### 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 1.0553 元，本报告期基金份额净值增长率为-6.84%，同期业绩比较基准收益率为-3.88%；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 1.0364 元，本报告期基金份额净值增长率为-7.22%，同期业绩比较基准收益率为-3.88%；截至本报告期末大成养老 2040 三年持有混合（FOF）Y 的基金份额净值为 1.0589 元，本报告期基金份额净值增长率为-6.37%，同期业绩比较基准收益率为-3.88%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2024 年，随着经济增长放缓以及通胀回落，美国将进入降息周期。中美经济周期错位现象将有所缓和，从而增强我国货币财政与汇率政策的自主灵活性。基于各地房产限购政策松绑、房企融资多元化支持以及地方政府化债进程的深化，信用传导将逐渐顺畅，经济转型将逐渐见效，经济复苏更为稳健。

各级部门正在进一步强化资本市场支持举措，优化投融资功能，叠加股权风险溢价处于历史高位水平，A 股市场存在估值修复的机会。考虑到经济与消费修复有一定曲折性，产业周期所处位置不同，因此盈利修复方面仍可能是结构性机会。在组合管理方面，基金管理人将根据全球政治格局、国内外宏观经济环境以及产业周期的变化，顺应变化进行适应性配置，包括资产类别配置、风格配置与行业配置等方面。为充分发挥资产配置优化组合风险收益水平的作用，基金管理人将关注跨境资产和商品资产的配置机会，把握美国降息周期、AI 技术突破、全球资本再平衡以及全球供应链重塑引致的全球区域市场以及全球比较优势行业的投资机会。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，依据相关的法律法规、基金合同以及内部监察稽核制度，本基金管理人对本基金运作、内部管理、制度执行及遵规守法情况进行了监察稽核。内部监察稽核的重点是：国家法律法规及行业监管规则的执行情况；基金合同的遵守情况；内部规章制度的执行情况；资讯管制和保密工作落实情况；员工职业操守规范情况，目的是规范基金财产的运作，防范和控制投资风险，确保经营业务的稳健运行和受托资产的安全完整，维护本基金份额持有人的合法权益。

（一）根据最新的法律法规、规章、规范性文件，本基金管理人及时制定了相应的公司制度，并对现有制度进行不断修订和完善，确保本基金管理人内控制度的适时性、全面性和合法合规性。同时，为保障制度的适时性，避免部分内控制度、业务规则与业务发展不相适应，报告期内本基金管理人组织各部门对内部管理制度作了进一步梳理和完善。

（二）全面加强风险监控，不断提高基金业务风险管理水平。为督促各部门完善并落实各项内控措施，公司严格执行风险控制管理员制度，健全内控工作协调机制及监督机制，并进一步加强投资风险数量化评价能力及事前风险防范能力，有效防范相关业务风险。同时，公司严格执行投资报备制度，建立了基金从业人员证券投资管理监控信息系统，将投资报备工作纳入常态。

（三）日常监察和专项监察相结合，确保监察稽核的有效性和深入性。本年度，公司继续对本基金销售、宣传等方面的材料、协议及其他法律资料等进行了严格审查，对本基金各项投资比例、投资权限、基金交易、股票投资限制、股票库维护等方面进行实时监控，同时，还专门针对基金投资交易（包括公平交易、转债投资、投资权限、投资比例、流动性风险、基金重仓股等）、基金运营（基金头寸、基金结算、登记清算等）、网上交易、基金销售等进行专项监察。通过日常监察，保证了公司监察的全面性、实时性，通过专项监察，及时发现并纠正了业务中的潜在风险，加强了业务部门和人员的风险意识，从而较好地预防了风险的发生。

（四）加强了对投资管理人员通讯工具在交易时间的集中管理，定期或不定期对投资管理人员的网络即时通讯记录、电话录音等进行抽查，有效的防范了各种形式的利益输送行为。

（五）以多种方式加强合规教育与培训，提高全公司的合规守法意识。及时向全公司传达与基金相关的法律法规，并要求公司各部门贯彻到日常工作中。公司监察稽核部通过解答各业务部门提出的法律问题，提供法律依据，对于较为重大疑难法律事项及时咨询公司外部律师或监管部门，避免了业务发展中的盲目性，及时防范风险，维护了基金份额持有人的利益。

#### 4.7 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。估值委员会由公司各投研部门、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八名投资组合经理。

各投研部门、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。

#### 4.8 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。

#### 4.9 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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 托管人对本年度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年度报告中的财务指标、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，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 6 审计报告

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	大成养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金（FOF）全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了大成养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金（FOF）（以下简称“大成养老 2040 三年持有混合（FOF）基金”）的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的大成养老 2040 三年持有混合（FOF）基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了大成养老 2040 三年持有混合（FOF）基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于大成养老 2040 三年持有混合（FOF）基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
其他信息	大成养老 2040 三年持有混合（FOF）基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不

	<p>涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时，管理层负责评估大成养老 2040 三年持有混合（FOF）基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。治理层负责监督大成养老 2040 三年持有混合（FOF）基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对大成养老 2040 三年持有混合（FOF）基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致大成养老 2040 三年持有混合（FOF）基金不能持续经营。（5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>

会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	昌华	林恩丽
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室	
审计报告日期	2024年3月28日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 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：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	4,891,138.61	9,943,161.33
结算备付金		82,476.61	176,920.35
存出保证金		9,041.27	35,520.36
交易性金融资产	7.4.7.2	46,687,778.24	100,248,418.42
其中：股票投资		-	1,727,000.00
基金投资		46,687,778.24	98,521,418.42
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		539,688.50	1,966,779.05
应收股利		6,280.95	697.96
应收申购款		1,663,141.94	669,170.67
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	2,618.59	664.58
资产总计		53,882,164.71	113,041,332.72
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2022 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		812,328.61	-
应付赎回款		151,689.25	823,723.23
应付管理人报酬		32,115.75	89,320.04
应付托管费		5,222.63	13,409.57
应付销售服务费		2,059.90	3,233.09
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	7.4.7.9	180,000.00	202,503.17
负债合计		1,183,416.14	1,132,189.10
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.10	50,009,193.90	98,916,544.74
未分配利润	7.4.7.12	2,689,554.67	12,992,598.88
净资产合计		52,698,748.57	111,909,143.62
负债和净资产总计		53,882,164.71	113,041,332.72

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额总额 50,009,193.90 份，其中，A 类基金份额净值 1.0553 元，基金份额 34,287,471.20 份；C 类基金份额净值 1.0364 元，基金份额 5,839,978.30 份；Y 类基金份额净值 1.0589 元，基金份额 9,881,744.40 份。

## 7.2 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		-2,770,437.82	-64,295,740.09
1. 利息收入		64,076.36	155,095.47
其中：存款利息收入	7.4.7.13	62,295.26	145,953.69
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,781.10	9,141.78
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-4,484,449.64	-40,838,674.96
其中：股票投资收益	7.4.7.14	273,750.74	-9,926,954.49
基金投资收益	7.4.7.15	-5,266,613.46	-32,466,893.68

债券投资收益	7.4.7.16	-	144,406.78
资产支持证券投资收益	7.4.7.17	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.18	-	-
衍生工具收益	7.4.7.19	-	-
股利收益	7.4.7.20	508,413.08	1,410,766.43
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.21	1,625,959.38	-23,676,982.13
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.22	23,976.08	64,821.53
<b>减：二、营业总支出</b>		985,515.99	2,749,143.95
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	666,917.01	2,147,546.40
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	102,346.96	312,903.37
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	28,657.77	77,330.79
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	7.4.7.24	-	-
7. 税金及附加		714.80	-
8. 其他费用	7.4.7.25	186,879.45	211,363.39
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-3,755,953.81	-67,044,884.04
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-3,755,953.81	-67,044,884.04
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-3,755,953.81	-67,044,884.04

### 7.3 净资产变动表

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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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	98,916,544.74	-	12,992,598.88	111,909,143.62



二、本期期初净资产	98,916,544.74	-	12,992,598.88	111,909,143.62
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-48,907,350.84	-	-10,303,044.21	-59,210,395.05
(一)、综合收益总额	-	-	-3,755,953.81	-3,755,953.81
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-48,907,350.84	-	-6,547,090.40	-55,454,441.24
其中：1. 基金申购款	11,076,722.58	-	1,062,722.62	12,139,445.20
2. 基金赎回款	-59,984,073.42	-	-7,609,813.02	-67,593,886.44
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	50,009,193.90	-	2,689,554.67	52,698,748.57
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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	269,130,402.48	-	118,426,436.49	387,556,838.97
二、本期期初净资产	269,130,402.48	-	118,426,436.49	387,556,838.97
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-170,213,857.74	-	-105,433,837.61	-275,647,695.35
(一)、综合收益总额	-	-	-67,044,884.04	-67,044,884.04
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-170,213,857.74	-	-38,388,953.57	-208,602,811.31
其中：1. 基金申购款	5,060,058.01	-	741,123.21	5,801,181.22
2. 基金赎回款	-175,273,915.7	-	-39,130,076.78	-214,403,992.53

回款	5			
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产	98,916,544.74	-	12,992,598.88	111,909,143.62

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>谭晓冈</u>	<u>范瑛</u>	<u>梁靖</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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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。

本财务报表已于 2024 年 3 月 28 日经本基金的基金管理人批准报出。

#### 7.4.2 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《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《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〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 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 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

### 7.4.4.3 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根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产。（2）金融负债分类 本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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。

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和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益。

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额。

对于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，所有公允价值变动计入当期损益。

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况。

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息。

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产。

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，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。

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。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。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

和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：（1）存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。（2）不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。（3）如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值。（4）如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法计算的利息扣除在适用情况下的相关税费后的净额确认利息收入，计入当期损益。处置时，其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。(2) 对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用直接计入投资收益。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为债权投资的，在持有期间将按票面或合同利率计算的利息收入扣除在适用情况下的相关税费后的净额计入投资收益，扣除该部分利息后的公允价值变动额计入公允价值变动损益；除上述之外的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债的公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失扣除在适用情况下预估的增值税费后的净额计入公允价值变动损益。处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益。(3) 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。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额的收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额默认的收益分配方式是现金分红。本基金 Y 类基金份额的收益分配方式是红利再投资；(2) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；(3) 本基金同一类别每一基金份额享有同等分配权；(4) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 分部报告

无。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据中基协发[2017]3 号《关于发布〈基金中基金估值业务指引（试行）〉的通知》之附件《基金中基金估值业务指引（试行）》，本基金按采用如下方法确定基金投资的公允价值：(a) 对于交易型开放式指数基金、境内上市定期开放式基金及封闭式基金，按所投资基金估值日的收盘价估值；(b) 对于境内上市开放式基金（LOF）及其他境内非货币市场基金，按所投资基金估值日

的份额净值估值；（c）对于境内上市交易型货币市场基金，如所投资基金披露份额净值，则按所投资基金估值日的份额净值估值；如所投资基金披露万份（百份）收益，则按所投资基金前一估值日后至估值日期间（含节假日）的万份（百份）收益计提估值日基金收益；（d）对于境内非上市货币市场基金按所投资基金前一估值日后至估值日期间（含节假日）的万份收益计提估值日基金收益。如遇所投资基金不公布基金份额净值、进行折算或拆分、估值日无交易等特殊情况，本基金根据以下原则进行估值：（a）以所投资基金的基金份额净值估值的，若所投资基金与基金中基金估值频率一致但未公布估值日基金份额净值，按其最近公布的基金份额净值为基础估值。（b）以所投资基金的收盘价估值的，若估值日无交易，且最近交易日后市场环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后市场环境发生了重大变化的，可使用最新的基金份额净值为基础或参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素调整最近交易市价，确定公允价值。（c）如果所投资基金前一估值日至估值日期间发生分红除权、折算或拆分，基金管理人应根据基金份额净值或收盘价、单位基金份额分红金额、折算拆分比例、持仓份额等因素合理确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 7.4.6 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。自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

##### （2）增值税及附加

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以及金融同业往来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]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金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，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 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，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、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》的规定确定。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按 7%、3% 和 2% 的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

### （3）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，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、债券的差价收入，继续免征企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对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。

### （4）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等

收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	4,891,138.61	9,943,161.33
等于：本金	4,890,110.98	9,940,662.76
加：应计利息	1,027.63	2,498.57
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	4,891,138.61	9,943,161.33

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2023 年 12 月 31 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		46,689,708.23	-	46,687,778.24	-1,929.99
其他		-	-	-	-
合计		46,689,708.23	-	46,687,778.24	-1,929.99
项目		上年度末 2022 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,540,269.29	-	1,727,000.00	186,730.71
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		100,336,038.50	-	98,521,418.42	-1,814,620.08
其他		-	-	-	-
合计		101,876,307.79	-	100,248,418.42	-1,627,889.37

## 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

## 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

## 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

## 7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

## 7.4.7.4 买入返售金融资产

## 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

**7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

无。

**7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明**

无。

**7.4.7.5 债权投资****7.4.7.5.1 债权投资情况**

无。

**7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况**

无。

**7.4.7.6 其他债权投资****7.4.7.6.1 其他债权投资情况**

无。

**7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况**

无。

**7.4.7.7 其他权益工具投资****7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况**

无。

**7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况**

无。

**7.4.7.8 其他资产**

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应收利息	-	-
其他应收款	2,618.59	664.58
待摊费用	-	-
合计	2,618.59	664.58

**7.4.7.9 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 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	-	22,503.17
其中：交易所市场	-	22,503.17
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	180,000.00	180,000.00
合计	180,000.00	202,503.17

## 7.4.7.10 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	85,846,120.48	85,846,120.48
本期申购	5,767,764.99	5,767,764.99
本期赎回 (以“-”号填列)	-57,326,414.27	-57,326,414.27
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	34,287,471.20	34,287,471.20

## 大成养老 2040 三年持有混合 (FOF) C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	8,448,834.41	8,448,834.41
本期申购	48,803.04	48,803.04
本期赎回 (以“-”号填列)	-2,657,659.15	-2,657,659.15
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	5,839,978.30	5,839,978.30

## 大成养老 2040 三年持有混合 (FOF) Y

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	4,621,589.85	4,621,589.85
本期申购	5,260,154.55	5,260,154.55
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
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	9,881,744.40	9,881,744.40
-----	--------------	--------------

注：(1) 本基金申购含红利再投份额（如有）、转换入份额（如有）、级别调整入份额（如有）；赎回含转出份额（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

#### 7.4.7.11 其他综合收益

无。

#### 7.4.7.12 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
上年度末	11,854,418.53	-455,151.90	11,399,266.63
本期期初	11,854,418.53	-455,151.90	11,399,266.63
本期利润	-4,020,747.93	1,453,018.63	-2,567,729.30
本期基金份额交易产生的变动数	-6,200,054.12	-736,646.63	-6,936,700.75
其中：基金申购款	410,333.31	-94,979.16	315,354.15
基金赎回款	-6,610,387.43	-641,667.47	-7,252,054.90
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,633,616.48	261,220.10	1,894,836.58

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
上年度末	1,022,554.88	-34,114.64	988,440.24
本期期初	1,022,554.88	-34,114.64	988,440.24
本期利润	-569,906.59	147,284.16	-422,622.43
本期基金份额交易产生的变动数	-290,883.86	-62,303.11	-353,186.97
其中：基金申购款	4,149.87	421.28	4,571.15
基金赎回款	-295,033.73	-62,724.39	-357,758.12
本期已分配利润	-	-	-
本期末	161,764.43	50,866.41	212,630.84

大成养老 2040 三年持有混合 (FOF) Y

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	634,144.62	-29,252.61	604,892.01
本期期初	634,144.62	-29,252.61	604,892.01
本期利润	-791,258.67	25,656.59	-765,602.08
本期基金份额交易产生的变动数	674,390.49	68,406.83	742,797.32
其中：基金申购款	674,390.49	68,406.83	742,797.32
基金赎回款	-	-	-

本期已分配利润	-	-	-
本期末	517,276.44	64,810.81	582,087.25

#### 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
活期存款利息收入	60,913.88	132,476.34
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	1,107.56	11,750.15
其他	273.82	1,727.20
合计	62,295.26	145,953.69

#### 7.4.7.14 股票投资收益

##### 7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	273,750.74	-9,926,954.49
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	273,750.74	-9,926,954.49

##### 7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
卖出股票成交总额	2,251,647.00	221,652,613.43
减：卖出股票成本总额	1,972,960.29	230,917,416.25
减：交易费用	4,935.97	662,151.67
买卖股票差价收入	273,750.74	-9,926,954.49

## 7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

## 7.4.7.15 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
卖出/赎回基金成交总额	357,038,485.76	1,235,260,742.89
减：卖出/赎回基金成本总额	362,136,768.20	1,266,797,770.81
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	5,956.64	-
减：交易费用	162,374.38	929,865.76
基金投资收益	-5,266,613.46	-32,466,893.68

## 7.4.7.16 债券投资收益

## 7.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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

## 7.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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

#### 7.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

#### 7.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

#### 7.4.7.17 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

##### 7.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

##### 7.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

##### 7.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

#### 7.4.7.18 贵金属投资收益

##### 7.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

无。

##### 7.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

##### 7.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

##### 7.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

#### 7.4.7.19 衍生工具收益

##### 7.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

##### 7.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

## 7.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	-2,191.00	68,588.40
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	510,604.08	1,342,178.03
合计	508,413.08	1,410,766.43

## 7.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	1,625,959.38	-23,676,982.13
股票投资	-186,730.71	134,825.28
债券投资	-	21,460.00
资产支持证券投资	-	-
基金投资	1,812,690.09	-23,833,267.41
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	1,625,959.38	-23,676,982.13

## 7.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	-	-
销售服务费返还	23,976.08	64,821.53
合计	23,976.08	64,821.53

## 7.4.7.23 持有基金产生的费用

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期持有基金产生的应支付销售服	184,816.50	316,835.67

务费（元）		
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	643,816.06	1,711,433.07
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	114,720.18	348,452.71

注：上述费用为根据所投资基金的招募说明书列明的计算方法对销售服务费、管理费和托管费进行的估算；上述费用已在本基金所持有基金的净值中体现，不构成本基金的费用项目。

#### 7.4.7.24 信用减值损失

无。

#### 7.4.7.25 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	6,879.45	14,863.39
账户维护费	-	16,500.00
合计	186,879.45	211,363.39

#### 7.4.7.26 分部报告

无。

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

无。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 7.4.9 关联方关系

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
中泰信托有限责任公司	基金管理人的股东
光大证券股份有限公司（“光大证券”）	基金管理人的股东
中国银河投资管理有限公司	基金管理人的股东
大成国际资产管理有限公司（“大成国际”）	基金管理人的子公司

大成创新资本管理有限公司 (“大成创新资本”)	基金管理人的合营企业
-------------------------	------------

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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	1,852,612.00	69.02	202,662,356.14	46.01

###### 7.4.10.1.2 债券交易

无。

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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	1,200,000.00	100.00	70,000,000.00	100.00

###### 7.4.10.1.4 基金交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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	128,082,920.20	73.96	1,007,610,492.99	88.96

###### 7.4.10.1.5 权证交易

无。

###### 7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31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	1,706.80	69.02	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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	185,314.83	46.00	9,392.34	41.74

注：(1)上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费和经手费后的净额列示。

(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。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 12月31日
	当期发生的基金应支付的管理费	666,917.01
其中：应支付销售机构的客户维护 费	220,021.62	778,028.91
应支付基金管理人的净管理费	446,895.39	1,369,517.49

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。其中A类和C类的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，Y类的基金管理费按前一日的基金资产净值的0.5%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times R / \text{当年天数}$$

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

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 12月31日
	当期发生的基金应支付的托管费	102,346.96

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。其中 A 类和 C 类的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，Y 类的基金托管人的基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.075% 年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times R / \text{当年天数}$$

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

#### 7.4.10.2.3 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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	大成养老 2040 三年持有混合 (FOF) Y	合计
中国农业银行	-	6,632.23	-	6,632.23
合计	-	6,632.23	-	6,632.23
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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	大成养老 2040 三年持有混合 (FOF) Y	合计
大成基金	-	12,086.73	-	12,086.73
中国农业银行	-	14,337.25	-	14,337.25
合计	-	26,423.98	-	26,423.98

注：基金销售服务费每日计算，按月支付。本基金 A 类和 Y 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：

$$H=E \times 0.40\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

## 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

## 7.4.10.4 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

## 7.4.10.4.1 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。

## 7.4.10.4.2 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。

## 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

## 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2023年1月1日至2023 年12月31日	本期 2023年1月1日至 2023年12月31日	本期 2023年1月1日至 2023年12月31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	大成养老 2040 三年持有 混合（FOF）Y
基金合同生效日 （2019年6月27 日）持有的基金份额	-	-	-
报告期初持有的基 金份额	0.00	-	-
报告期间申购/买入 总份额	3,980,205.18	-	-
报告期间因拆分变 动份额	-	-	-
减：报告期间赎回/ 卖出总份额	0.00	-	-
报告期末持有的基 金份额	3,980,205.18	-	-
报告期末持有的基 金份额 占基金总份额比例	7.96%	-	-
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至 2022年12月31日	上年度可比期间 2022年11月11日（基 金合同生效日）至 2022年12月31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	大成养老 2040 三年持有 混合（FOF）Y

基金合同生效日 (2019年6月27日)持有的基金份额	-	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-	-
减: 报告期间赎回/卖出总份额	-	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	-	-

注: 基金管理人大成基金投资本基金适用的交易费率与本基金法律文件规定一致。

#### 7.4.10.5.2 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

无。

#### 7.4.10.6 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 2023年1月1日至2023年12月 31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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	4,891,138.61	60,913.88	9,943,161.33	132,476.34

注: 本基金由基金托管人保管的银行存款, 按银行约定利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 7.4.10.8.1 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 9,246,216.71 元, 占本基金资产净值的比例为 17.55%。

##### 7.4.10.8.2 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	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月	2022年1月1日至2022年



	月 31 日	12 月 31 日
当期交易基金产生的申购费（元）	-	-
当期交易基金产生的赎回费（元）	4,184.49	3,036.92
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	23,975.64	64,821.52
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	89,054.22	183,350.55
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	15,771.01	35,254.34
当期交易基金产生的转换费（元）	5,152.44	3,554.54

#### 7.4.11 利润分配情况

无。

#### 7.4.12 期末（2023 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

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

无。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

##### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 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具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。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国农业银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级，通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

本期末，本基金无债券投资（上年度末：同）。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金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可随时要求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。

##### 7.4.13.3.1 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》等有关法规的要求建立健全开放式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。并于开放日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，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受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、债券投资等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

资产					
货币资金	4,891,138.61	-	-	-	4,891,138.61
结算备付金	82,476.61	-	-	-	82,476.61
存出保证金	9,041.27	-	-	-	9,041.27
交易性金融资产	-	-	-	46,687,778.24	46,687,778.24
应收股利	-	-	-	6,280.95	6,280.95
应收申购款	1,549,900.00	-	-	113,241.94	1,663,141.94
应收清算款	-	-	-	539,688.50	539,688.50
其他资产	-	-	-	2,618.59	2,618.59
资产总计	6,532,556.49	-	-	47,349,608.22	53,882,164.71
负债					
应付赎回款	-	-	-	151,689.25	151,689.25
应付管理人报酬	-	-	-	32,115.75	32,115.75
应付托管费	-	-	-	5,222.63	5,222.63
应付清算款	-	-	-	812,328.61	812,328.61
应付销售服务费	-	-	-	2,059.90	2,059.90
其他负债	-	-	-	180,000.00	180,000.00
负债总计	-	-	-	1,183,416.14	1,183,416.14
利率敏感度缺口	6,532,556.49	-	-	46,166,192.08	52,698,748.57
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	9,943,161.33	-	-	-	9,943,161.33
结算备付金	176,920.35	-	-	-	176,920.35
存出保证金	35,520.36	-	-	-	35,520.36
交易性金融资产	-	-	-	100,248,418.42	100,248,418.42
应收股利	-	-	-	697.96	697.96
应收申购款	500.00	-	-	668,670.67	669,170.67
应收清算款	-	-	-	1,966,779.05	1,966,779.05
其他资产	-	-	-	664.58	664.58
资产总计	10,156,102.04	-	-	102,885,230.68	113,041,332.72
负债					
应付赎回款	-	-	-	823,723.23	823,723.23
应付管理人报酬	-	-	-	89,320.04	89,320.04
应付托管费	-	-	-	13,409.57	13,409.57
应付销售服务费	-	-	-	3,233.09	3,233.09
其他负债	-	-	-	202,503.17	202,503.17
负债总计	-	-	-	1,132,189.10	1,132,189.10
利率敏感度缺口	10,156,102.04	-	-	101,753,041.58	111,909,143.62

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，本基金未持有交易性债券投资和交易性资产支持证券投资（上年度末：同），因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响（上年度末：同）。

#### 7.4.13.4.2 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。本基金持有的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 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。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日		上年度末 2022 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	-	-	1,727,000.00	1.54
交易性金融资产—基金投资	46,687,778.24	88.59	98,521,418.42	88.04
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	46,687,778.24	88.59	100,248,418.42	89.58

##### 7.4.13.4.3.2 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
----	----------------------

分析	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（2023 年 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	2,183,535.21	5,485,881.67
	业绩比较基准下降 5%	-2,183,535.21	-5,485,881.67

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 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。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	46,687,778.24	100,248,418.42
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	46,687,778.24	100,248,418.42

###### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

对于公开市场交易的证券，若出现重大事项、新发未上市等原因导致不存在活跃市场未经调整的报价，本基金不会于此期间将相关证券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。

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

无。

##### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

无。

#### 7.4.14.3 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。

#### 7.4.14.4 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。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	46,687,778.24	86.65
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	4,973,615.22	9.23
8	其他各项资产	2,220,771.25	4.12
9	合计	53,882,164.71	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

无。

#### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

**8.3 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。

**8.4 报告期内股票投资组合的重大变动****8.4.1 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	000858	五粮液	432,691.00	0.39

注：本期累计买入金额指买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

**8.4.2 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	600519	贵州茅台	1,852,612.00	1.66
2	000858	五粮液	399,035.00	0.36

注：本期累计卖出金额指卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

**8.4.3 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	432,691.00
卖出股票收入（成交）总额	2,251,647.00

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。

**8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合**

无。

**8.6 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。

**8.7 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。

**8.8 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。

**8.9 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。

**8.10 本基金投资股指期货的投资政策**

无。



## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

无。

### 8.11.2 本期国债期货投资评价

无。

## 8.12 本报告期投资基金情况

### 8.12.1 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。

### 8.12.2 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	006597	国泰利享中短债债券 A	契约型开放式	2,883,370.80	3,374,120.51	6.40	否
2	530028	建信短债债券 C	契约型开放式	2,983,222.13	3,308,095.02	6.28	否
3	015779	景顺长城价值边际灵活配置混合 C	契约型开放式	2,432,842.22	3,296,257.92	6.25	否
4	002872	华夏智胜价值成长股票 C	契约型开放式	1,676,072.67	2,495,169.38	4.73	否

5	016563	金鹰红利价值混合 C	契约型开放式	1,358,818.55	2,469,652.71	4.69	否
6	002086	大成景安短融债券 E	契约型开放式	1,847,563.82	2,369,870.11	4.50	是
7	513300	华夏纳斯达克 100ETF(QDII)	交易型开放式 (ETF)	1,420,000.00	2,139,940.00	4.06	否
8	007361	易方达中短期美元债债券 (QDII)C	契约型开放式	1,930,734.74	2,107,396.97	4.00	否
9	092002	大成债券 C	契约型开放式	1,678,589.12	1,773,261.55	3.36	是
10	008817	华宝可转债 C	契约型开放式	1,040,354.36	1,542,845.52	2.93	否
11	090007	大成策略回报混合	契约型开放式	1,277,464.26	1,430,759.97	2.71	是
12	010384	宝盈基础产业混合 C	契约型开放式	1,382,490.89	1,298,020.70	2.46	否
13	110052	易方达安源中短债债券 C	契约型开放式	1,231,558.91	1,258,776.36	2.39	否
14	007950	招商量化精选股票 C	契约型开放式	435,651.10	931,073.53	1.77	否
15	017900	鹏华医药科技股票 C	契约型开放式	921,184.59	915,657.48	1.74	否
16	159997	电子 ETF	交易型开	1,000,000.00	906,000.00	1.72	否

			放式 (ETF)				
17	018457	大成价值增长混合 C	契约型开放式	966,433.17	800,496.59	1.52	是
18	017773	大成消费主题混合 C	契约型开放式	422,715.94	788,365.23	1.50	是
19	008647	天弘增利短债债券 C	契约型开放式	547,311.55	604,998.19	1.15	否
20	000141	富国国有企业债债券 C	契约型开放式	558,789.72	562,645.37	1.07	否
21	014243	富国新材料新能源混合 C	契约型开放式	403,553.48	549,760.91	1.04	否
22	162102	金鹰中小盘精选混合	上市契约型开放式 (LOF)	582,328.52	545,991.22	1.04	否
23	003359	大成中证 360 互联网+大数据 100 指数 C	契约型开放式	251,341.79	530,079.84	1.01	是
24	010710	安信医药健康股票 C	契约型开放式	427,117.25	512,284.43	0.97	否
25	006038	大成景恒混合 C	契约型开放式	200,061.93	477,747.89	0.91	是
26	011475	工银消费服务混合 C	契约型开放式	182,646.57	444,744.40	0.84	否
27	159901	深 100ETF	交易型开	180,000.00	439,740.00	0.83	否

			放式 (ETF)				
28	512810	华宝中证军工 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	400,000.00	438,400.00	0.83	否
29	011066	大成高新技术 产业股票 C	契约 型开 放式	121,715.98	421,259.01	0.80	是
30	012094	鹏华创新升级 混合 C	契约 型开 放式	456,344.63	414,589.10	0.79	否
31	019094	金鹰中小盘精 选混合 C	契约 型开 放式	427,570.51	400,377.03	0.76	否
32	588400	嘉实中证科创 创业 50ETF	交易 型开 放式 (ETF)	700,000.00	351,400.00	0.67	否
33	159732	消费电子	交易 型开 放式 (ETF)	500,000.00	346,500.00	0.66	否
34	007491	南方信息创新 混合 C	契约 型开 放式	221,340.99	336,394.04	0.64	否
35	513310	华泰柏瑞中韩 芯片 ETF(QDII)	交易 型开 放式 (ETF)	270,000.00	333,180.00	0.63	否
36	159949	创业板 50	交易 型开 放式 (ETF)	400,000.00	314,800.00	0.60	否
37	515170	华夏中证细分 食品饮料产业	交易 型开	500,000.00	308,500.00	0.59	否

		主题 ETF	放式 (ETF)				
38	510310	易方达沪深 300 发起式 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	180,000.00	301,140.00	0.57	否
39	512660	国泰中证军工 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	300,000.00	288,000.00	0.55	否
40	562000	华宝中证 100ETF	交易 型开 放式 (ETF)	350,000.00	284,900.00	0.54	否
41	002183	广发天天红货 币 B	契约 型开 放式	280,074.27	280,074.27	0.53	否
42	518880	华安黄金易 (ETF)	交易 型开 放式 (ETF)	60,000.00	278,880.00	0.53	否
43	010236	广发电子信息 传媒股票 C	契约 型开 放式	127,031.76	264,073.62	0.50	否
44	002910	易方达供给改 革混合	契约 型开 放式	92,242.70	237,921.60	0.45	否
45	513290	汇添富纳斯达 克生物科技 ETF(QDII)	交易 型开 放式 (ETF)	200,000.00	228,200.00	0.43	否
46	010004	景顺长城电子 信息产业股票 C	契约 型开 放式	198,350.10	219,910.76	0.42	否
47	016060	大成健康产业 混合 C	契约 型开	165,995.61	218,782.21	0.42	是

			放式				
48	510050	华夏上证 50ETF	交易 型开 放式 (ETF)	90,000.00	211,950.00	0.40	否
49	014198	华夏智胜先锋 股票 (LOF) C	上市 契约 型开 放式 (LOF)	180,531.45	201,617.52	0.38	否
50	159628	国证 2000	交易 型开 放式 (ETF)	200,000.00	193,200.00	0.37	否
51	005756	平安短债债券 E	契约 型开 放式	158,302.68	185,736.53	0.35	否
52	018225	大成策略回报 混合 C	契约 型开 放式	165,451.23	184,478.12	0.35	是
53	008205	交银稳利中短 债债券 C	契约 型开 放式	150,413.11	168,131.77	0.32	否
54	000726	大成添利宝货 币 E	契约 型开 放式	154,879.47	154,879.47	0.29	是
55	015566	万家精选混合 C	契约 型开 放式	90,960.78	153,932.93	0.29	否
56	010388	易方达医药生 物股票 C	契约 型开 放式	212,292.68	138,032.70	0.26	否
57	512100	南方中证 1000ETF	交易 型开 放式 (ETF)	50,000.00	118,700.00	0.23	否

58	510500	南方中证500ETF	交易型开放式(ETF)	20,000.00	110,380.00	0.21	否
59	019449	摩根日本精选股票(QDII)C	上市契约型开放式(LOF)	65,011.05	100,604.60	0.19	否
60	015346	上投摩根健康品质生活混合C	契约型开放式	26,206.73	97,669.86	0.19	否
61	011926	大成消费精选股票C	契约型开放式	143,636.89	96,236.72	0.18	是
62	512400	南方中证申万有色金属ETF	交易型开放式(ETF)	100,000.00	94,500.00	0.18	否
63	019093	金鹰科技创新股票C	契约型开放式	68,034.36	86,730.20	0.16	否
64	017290	中欧科创主题混合(LOF)C	上市契约型开放式(LOF)	52,831.82	81,656.86	0.15	否
65	159930	能源ETF	交易型开放式(ETF)	50,000.00	62,600.00	0.12	否
66	510100	易方达上证50ETF	交易型开放式(ETF)	50,000.00	57,350.00	0.11	否
67	000905	鹏华安盈宝货币	契约型开	48,357.52	48,357.52	0.09	否

			放式				
--	--	--	----	--	--	--	--

### 8.12.3 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。

### 8.13 投资组合报告附注

#### 8.13.1 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

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。

#### 8.13.2 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。

#### 8.13.3 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	9,041.27
2	应收清算款	539,688.50
3	应收股利	6,280.95
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,663,141.94
6	其他应收款	2,618.59
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,220,771.25

#### 8.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

#### 8.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

#### 8.13.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者



	(户)		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	1,677	20,445.72	3,980,205.18	11.61	30,307,266.02	88.39
大成养老 2040 三年 持有混合 (FOF) C	430	13,581.34	0.00	0.00	5,839,978.30	100.00
大成养老 2040 三年 持有混合 (FOF) Y	2,205	4,481.52	0.00	0.00	9,881,744.40	100.00
合计	4,312	11,597.68	3,980,205.18	7.96	46,028,988.72	92.04

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。

## 9.2 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	288,397.05	0.8411
	大成养老 2040 三年持有混合 (FOF) C	2.00	0.0000
	大成养老 2040 三年持有混合 (FOF) Y	46,414.91	0.4697
	合计	334,813.96	0.6695

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）。

## 9.3 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、 基金投资和研发部门 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
	大成养老 2040 三年持有混 合 (FOF) Y	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
	大成养老 2040 三年持有混 合 (FOF) Y	0
	合计	0~10

#### 9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

无。

## § 10 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	大成养老 2040 三年持有 混合 (FOF) Y
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	85,846,120.48	8,448,834.41	4,621,589.85
本报告期基金 总申购份额	5,767,764.99	48,803.04	5,260,154.55
减：本报告期 基金总赎回份 额	57,326,414.27	2,657,659.15	-
本报告期基金 拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末 基金份额总额	34,287,471.20	5,839,978.30	9,881,744.40

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

无。

### 11.2 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

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八届董事会第二次会议审议通过并履行必要程序，自 2023 年 3 月 25 日起，温智敏先

生因个人原因辞去公司副总经理职务。聘请石国武先生担任公司副总经理，任期自公司八届二次董事会决议作出之日起，至本届董事会任期届满之日止。

## 二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

无。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 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。

### 11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

### 11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本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），本年度应支付的审计费用为 60,000.00 元整。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。

### 11.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.7.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 11.7.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

无。

### 11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.8.1 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 (%)	
光大证券	2	1,852,612.00	69.02	1,706.80	69.02	-
国泰君安	3	831,726.00	30.98	766.25	30.98	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	本期报告新增

						1 个
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	-	-	-	-	-
东亚前海	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
高盛中国 证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国投证券	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	0	-	-	-	-	本期 报告 退租 1 个
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	2	-	-	-	-	本期报告 退租 1 个
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投 证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	4	-	-	-	-	-
中银国际 证券	1	-	-	-	-	-
中原证券	1	-	-	-	-	-

注：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：

- （一）财务状况良好，最近一年无重大违规行为；
- （二）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；
- （三）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；
- （四）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；
- （五）能提供投资组合运作、管理所需的其他券商服务；
- （六）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。

### 11.8.2 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 (%)
光大证券	-	-	1,200,000.00	100.00	-	-	128,082,920.20	73.96
国泰君安	-	-	-	-	-	-	45,087,334.57	26.04

## 11.9 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	2023 年 12 月 29 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）Y 类份额增加东方财富证券股份有限公司为代销机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 12 月 18 日
3	大成养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金（FOF）（Y 类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 12 月 11 日
4	大成养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金（FOF）（A 类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 12 月 11 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）（C 类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 12 月 11 日
6	大成养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金（FOF）更新招募说明书	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 12 月 11 日
7	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	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 12 月 11 日
8	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金中基金可投资于公开募集基础设施证券投资基金并修订基金合同、托管协议的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 12 月 11 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）托管协议	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 12 月 11 日
10	大成基金管理有限公司关于终止和谐保险销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 11 月 29 日
11	大成养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金（FOF）A、C 类份额增加东方证券股份有限公司为代销机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 11 月 15 日
12	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海华夏财富投资管理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	2023 年 10 月 26 日
13	大成养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金（FOF）2023 年第 3 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	2023 年 10 月 25 日

14	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东方财富证券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	2023 年 9 月 21 日
15	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中信建投证券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	2023 年 9 月 19 日
16	大成养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金（FOF）Y 类份额增加东方证券股份有限公司为代销机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 9 月 19 日
17	大成基金管理有限公司关于终止凤凰金信（海口）基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 9 月 6 日
18	大成养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金（FOF）2023 年中期报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 8 月 30 日
19	大成养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金（FOF）（A 类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 8 月 26 日
20	大成养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金（FOF）（Y 类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 8 月 26 日
21	大成养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金（FOF）（C 类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 8 月 26 日
22	大成养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金（FOF）更新招募说明书	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 7 月 27 日
23	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海好买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	2023 年 7 月 24 日
24	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加嘉实财富管理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	2023 年 7 月 21 日
25	大成养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金（FOF）2023 年第 2 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	2023 年 7 月 20 日
26	大成基金管理有限公司提醒投资者谨防金融诈骗的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 7 月 13 日
27	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	2023 年 6 月 30 日
28	大成养老目标日期 2040 三年持有期	中国证监会基金电子披	2023 年 6 月 14 日

	混合型基金中基金 (FOF) Y 类份额增加部分代销机构的公告	露网站、规定报刊及本公司网站	
29	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海中欧财富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	2023 年 5 月 16 日
30	大成基金管理有限公司提醒投资者谨防金融诈骗的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 4 月 27 日
31	大成养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金 (FOF) Y 类份额增加安信证券股份有限公司为代销机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 4 月 26 日
32	大成养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金 (FOF) 2023 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	2023 年 4 月 21 日
33	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加浙江同花顺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	2023 年 4 月 19 日
34	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加浙江同花顺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	2023 年 4 月 13 日
35	大成养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金 (FOF) 更新招募说明书	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 4 月 3 日
36	大成养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金 (FOF) (A 类份额) 基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 4 月 3 日
37	大成养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金 (FOF) (C 类份额) 基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 4 月 3 日
38	大成养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金 (FOF) (Y 类份额) 基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 4 月 3 日
39	大成养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金 (FOF) 变更基金经理公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 3 月 31 日
40	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	2023 年 3 月 30 日
41	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 3 月 27 日
42	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本	2023 年 3 月 27 日



		公司网站	
43	大成基金管理有限公司关于养老金客户通过直销柜台申购旗下基金费率优惠的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 3 月 24 日
44	大成养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金 (FOF) A、C 类份额增加上海银行股份有限公司为代销机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 3 月 24 日
45	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加北京汇成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	2023 年 3 月 20 日
46	大成养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金 (FOF) Y 类份额增加上海银行股份有限公司为代销机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 2 月 23 日
47	大成养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金 (FOF) Y 类份额增加上海浦东发展银行股份有限公司为代销机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 2 月 20 日
48	大成养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金 (FOF) 更新招募说明书	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 2 月 15 日
49	大成养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金 (FOF) (A 类份额) 基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 2 月 15 日
50	大成养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金 (FOF) (C 类份额) 基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 2 月 15 日
51	大成养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金 (FOF) (Y 类份额) 基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 2 月 15 日
52	大成养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金 (FOF) 增聘基金经理公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 2 月 14 日
53	大成养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金 (FOF) Y 类份额增加国信证券股份有限公司为代销机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 2 月 1 日
54	大成养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金 (FOF) Y 类份额增加江苏银行股份有限公司为代销机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 1 月 18 日
55	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 4	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本	2023 年 1 月 18 日

	季度报告	公司网站	
56	大成养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金（FOF）Y 类份额增加招商证券股份有限公司为代销机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 1 月 9 日
57	大成养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金（FOF）Y 类份额增加中国银行股份有限公司为代销机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 1 月 3 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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	20230101-20230606	21,407,689.67	0.00	21,407,689.67	0.00	0.00
	2	20230605-20230814	15,710,840.53	0.00	15,710,840.53	0.00	0.00
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。							

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 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。

### 13.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

### 13.3 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 3 月 29 日