

# 大成盛享一年持有期混合型证券投资基金 2025 年年度报告

2025 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：中国邮政储蓄银行股份有限公司

送出日期：2026 年 3 月 31 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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 3 月 30 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 2025 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	6
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>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	17
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	19
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	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>54</b>
8.1 期末基金资产组合情况	54
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 .....	57
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	59
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 .....	59
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 .....	59
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 .....	59
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 .....	59
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	59
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	60
8.12 投资组合报告附注 .....	60
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>61</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	61
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	61
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 .....	61
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 .....	61
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>61</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>62</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	62
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 .....	62
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	62
11.4 基金投资策略的改变 .....	62
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	63
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 .....	63
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	63
11.8 其他重大事件 .....	64
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>66</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 .....	66
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	66
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>66</b>
13.1 备查文件目录 .....	66
13.2 存放地点 .....	67
13.3 查阅方式 .....	67

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	大成盛享一年持有期混合型证券投资基金	
基金简称	大成盛享一年持有混合	
基金主代码	016547	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 2 月 24 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	
报告期末基金份 额总额	21,762,602.35 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	大成盛享一年持有混合 A	大成盛享一年持有混合 C
下属分级基金的交 易代码	016547	016548
报告期末下属分级 基金的份额总额	20,291,178.96 份	1,471,423.39 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和组合波动率的基础上,通过积极主动的投资管理,搭建长期稳定的配置中枢,坚持持仓的分散与组合内部风险的对冲,追求基金资产的长期稳健增值,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	<p>本基金的投资策略分为两方面:一方面体现在采取“自上而下”的方式对权益类、固定收益类等不同类别资产进行大类配置;另一方面体现在对单个投资品种“自下而上”的精选上。</p> <p>(一) 大类资产配置策略</p> <p>本基金通过对宏观经济环境、国家经济政策、股票市场风险、债券市场整体收益率曲线变化和资金供求关系等因素的分析,综合评价各类资产的市场趋势、预期风险收益水平和配置时机。</p> <p>(二) 债券投资策略</p> <p>本基金的债券投资采取稳健的投资管理方式,获得与风险相匹配的投资收益,以实现在一定程度上规避股票市场的系统性风险和保证基金资产的流动性。</p> <p>(三) 股票投资策略</p> <p>1、A 股投资策略 随着世界经济和中国经济的变革与发展,行业和公司所处的环境和竞争格局也发生着巨大而深刻的改变。国内经济结构转型、产业加速升级、信息化水平不断提升、企业效能增加、品牌逐步建立,传统产业和新兴产业共同为经济赋能,成为中国经济新的动力引擎,助力实现共同富裕的宏伟目标。</p> <p>2、港股投资策略</p> <p>(四) 可转换债券投资策略</p>

	(五) 可交换债券投资策略 (六) 股指期货投资策略 (七) 国债期货投资策略 (八) 存托凭证投资策略 (九) 基金投资策略 (十) 控制组合波动率策略
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*10%+中债综合全价（总值）指数收益率*80%+恒生指数收益率（使用估值汇率调整）*5%+金融机构人民币活期存款利率（税后）*5%
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金、但低于股票型基金。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。本基金若投资科创板股票，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括流动性风险、退市风险和投资集中风险等。

### 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	中国邮政储蓄银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	段皓静	张立学
	联系电话	0755-83183388	010-68858113
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	zhanglixue@psbcoa.com.cn
客户服务电话		4008885558	95580
传真		0755-83199588	010-86353609
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	北京市西城区金融大街3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	北京市西城区金融大街3号A座
邮政编码		518054	100808
法定代表人		吴庆斌	郑国雨

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
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	2025 年		2024 年		2023 年 2 月 24 日(基金合同生效日) - 2023 年 12 月 31 日	
	大成盛享一年持有混合 A	大成盛享一年持有混合 C	大成盛享一年持有混合 A	大成盛享一年持有混合 C	大成盛享一年持有混合 A	大成盛享一年持有混合 C
本期已实现收益	4,039,654.09	145,441.42	9,209,034.24	79,687.27	-913,994.52	-12,778.24
本期利润	3,634,412.08	148,221.89	10,422,138.22	83,746.41	-701,168.42	-11,374.01
加权平均基金份额本期利润	0.1253	0.1323	0.0851	0.0788	-0.0021	-0.0054
本期加权平均净值利润率	11.18%	11.72%	8.34%	7.73%	-0.21%	-0.55%
本期基金份额净值增长率	12.71%	12.24%	7.73%	7.30%	-0.21%	-0.55%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末		2024 年末		2023 年末	
期末可供分配利润	4,293,520.85	290,946.07	3,212,237.97	50,616.23	-914,561.27	-12,844.52
期末可供分配基金份额利润	0.2116	0.1977	0.0750	0.0671	-0.0027	-0.0061
期末基金资产净值	24,584,699.81	1,762,369.46	46,042,358.24	805,055.30	334,074,988.50	2,091,568.43
期末基金份额净值	1.2116	1.1977	1.0750	1.0671	0.9979	0.9945
3.1.3 累计期末指标	2025 年末		2024 年末		2023 年末	
基金份额累计净值增长率	21.16%	19.77%	7.50%	6.71%	-0.21%	-0.55%

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

大成盛享一年持有混合 A

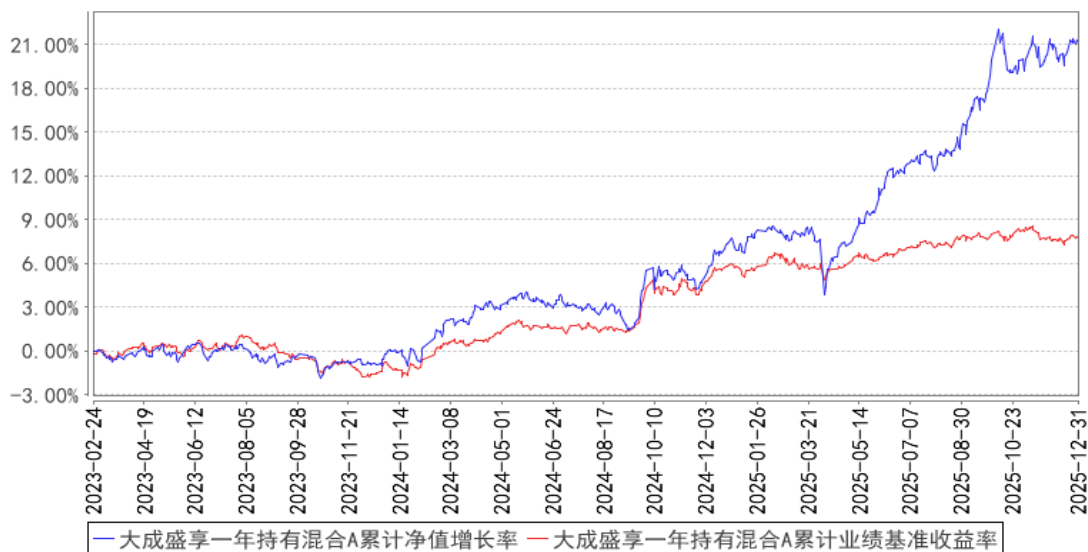
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.01%	0.47%	-0.23%	0.14%	1.24%	0.33%
过去六个月	8.00%	0.41%	0.81%	0.13%	7.19%	0.28%
过去一年	12.71%	0.41%	1.71%	0.15%	11.00%	0.26%
自基金合同生效起至今	21.16%	0.30%	7.74%	0.15%	13.42%	0.15%

大成盛享一年持有混合 C

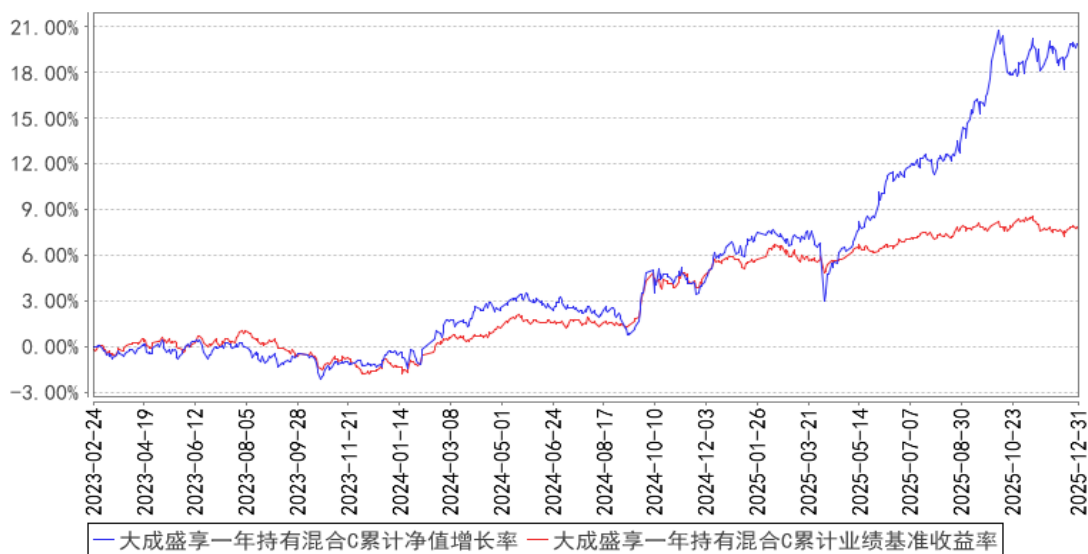
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.90%	0.47%	-0.23%	0.14%	1.13%	0.33%
过去六个月	7.78%	0.41%	0.81%	0.13%	6.97%	0.28%
过去一年	12.24%	0.41%	1.71%	0.15%	10.53%	0.26%
自基金合同生效起至今	19.77%	0.30%	7.74%	0.15%	12.03%	0.15%

### 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

大成盛享一年持有混合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



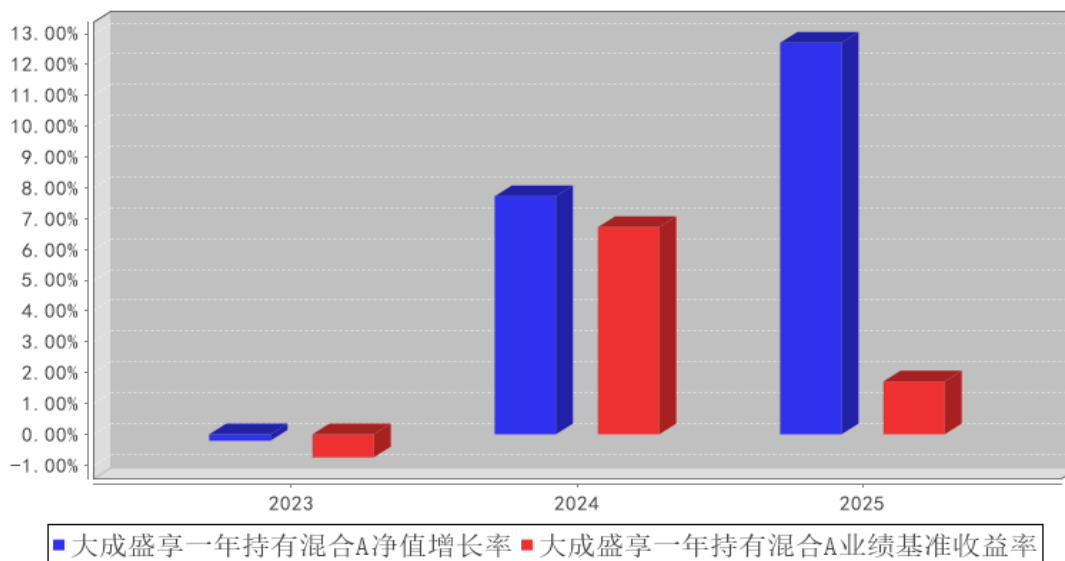
大成盛享一年持有混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



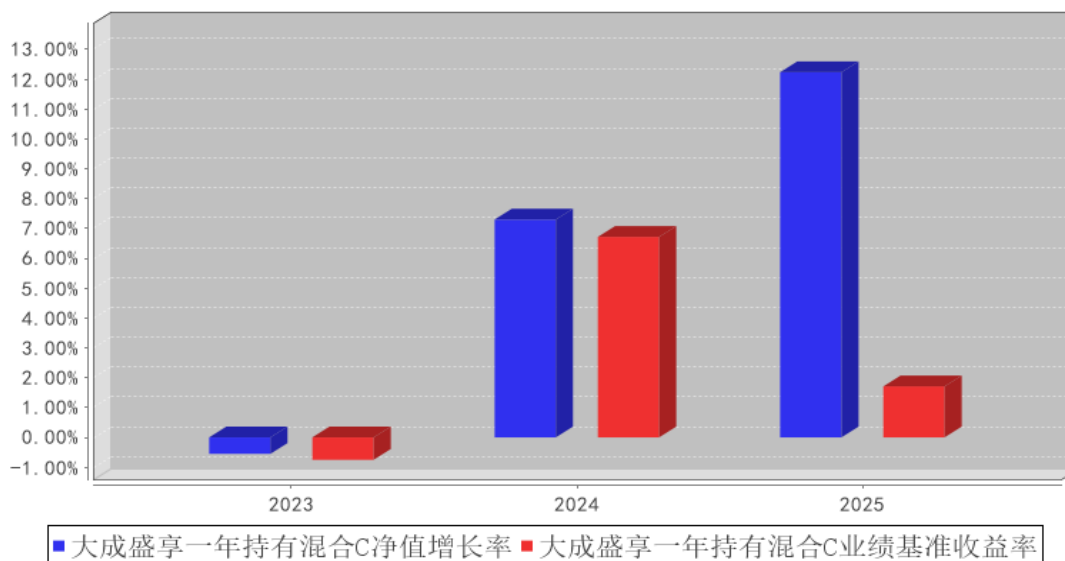
注：本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

### 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

大成盛享一年持有混合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



大成盛享一年持有混合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



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；2013 年，设立大成创新资本管理有限公司。

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		
张家旺	本基金基金经理	2025 年 3 月 10 日	-	9 年	南京大学工程硕士。2016 年 7 月加入大成基金管理有限公司，曾任大成创新成长混合型证券投资基金（LOF）、大成高新技术产业股票型证券投资基金、大成优势企业混合型证券投资基金、大成睿裕六个月持有期股票型证券投资基金、大成睿鑫股票型证券投资基金、大成国企改革灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理，现任股票投资部基金经理。2021 年 11 月 29 日至 2023 年 12 月 27 日任大成蓝筹稳健证券投资基金基金经理。2022 年 11 月 24 日起任大成正向回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2024 年 6 月 3 日起任大成安享得利六个月持有期混合型证券投资基金基金经理。2025 年 3 月 10 日起任大成盛享一年持有期混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国
郑煌斌	本基金基金经理助理	2023 年 12 月 19 日	2025 年 12 月 23 日	6 年	厦门大学经济学硕士。2019 年 6 月加入大成基金管理有限公司，曾担任交易管理部交易员、固定收益总部研究员、混合资产投资部基金经理助理，现任混合资产投资部基金经理。2025 年 12 月 24 日起任大成元享臻利债券型证券投资基金、大成丰享回报混合型证券投资基金基金经理。具有

					基金从业资格。国籍：中国
徐雄晖	本基金基金经理	2023年2月24日	2025年4月14日	17年	北京大学经济学硕士。2008年7月至2015年5月先后担任大成基金管理有限公司研究部行业研究主管、基金经理助理、股票投资部基金经理。2015年11月至2017年10月任红土创新基金管理有限公司股票投资部基金经理。2018年6月至2021年4月任生命保险资产管理有限公司权益投资部投资经理。2021年4月加入大成基金管理有限公司，曾担任股票投资部基金经理，现任混合资产投资部基金经理。2021年6月16日起任大成汇享一年持有期混合型证券投资基金基金经理。2021年7月14日至2025年12月9日任大成尊享18个月持有期混合型发起式证券投资基金（原大成尊享18个月定期开放混合型证券投资基金转型）基金经理。2021年9月17日起任大成民稳增长混合型证券投资基金基金经理。2022年12月4日起任大成景润灵活配置混合型证券投资基金、大成趋势回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2023年2月24日至2025年4月14日任大成盛享一年持有期混合型证券投资基金基金经理。2024年3月20日起任大成元吉增利债券型证券投资基金基金经理。2025年3月28日起任大成元鸿锦利债券型证券投资基金基金经理。2025年12月16日起任大成荣享混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国
孙丹	本基金基金经理，混合资产投资部总监	2023年2月24日	2025年4月14日	17年	美国德克萨斯 A&M 大学经济学硕士。2008年至2012年任景顺长城产品开发部产品经理。2012年至2014年任华夏基金机构债券投资部研究员。2014年5月加入大成基金管理有限公司，曾担任固定收益总部信用策略及宏观利率研究员、基金经理助理、固定收益总部总监助理、固定收益总部副总监、混合资产投资部副总监，现任混合资产投资部总监。2017年5月8日起任大成景尚灵活配置混合型证券投资基金、大成景兴信用债债券型证券投资基金基金经理。2017年5月8日至2019年10月31日任大成景荣债券型证券投资基金（原大成景荣保本混合型证券投资基金转型）基金经理。2017年5月31日至2020

				<p>年 10 月 20 日任大成惠裕定期开放纯债债券型证券投资基金基金经理。2017 年 6 月 2 日至 2018 年 11 月 19 日任大成景禄灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 6 月 2 日至 2018 年 12 月 8 日任大成景源灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 6 月 2 日至 2019 年 6 月 15 日任大成景秀灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 6 月 6 日至 2019 年 9 月 29 日任大成惠明定期开放纯债债券型证券投资基金基金经理。2018 年 3 月 14 日至 2018 年 11 月 30 日任大成景辉灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2018 年 3 月 14 日至 2018 年 11 月 30 日任大成景沛灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2018 年 3 月 14 日至 2018 年 7 月 20 日任大成景裕灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2018 年 3 月 14 日起任大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金基金经理。2019 年 7 月 31 日至 2020 年 5 月 23 日任大成景丰债券型证券投资基金 (LOF) 基金经理。2020 年 2 月 27 日至 2021 年 4 月 13 日任大成景泰纯债债券型证券投资基金基金经理。2020 年 3 月 5 日至 2021 年 4 月 14 日任大成恒享混合型证券投资基金基金经理。2020 年 3 月 31 日至 2021 年 4 月 14 日任大成民稳增长混合型证券投资基金基金经理。2020 年 4 月 26 日至 2023 年 8 月 31 日任大成景瑞稳健配置混合型证券投资基金基金经理。2020 年 8 月 21 日至 2021 年 5 月 18 日任大成景和债券型证券投资基金基金经理。2020 年 9 月 3 日至 2021 年 11 月 26 日任大成汇享一年持有期混合型证券投资基金基金经理。2020 年 9 月 23 日至 2023 年 3 月 24 日任大成尊享 18 个月持有期混合型发起式证券投资基金 (原大成尊享 18 个月定期开放混合型证券投资基金转型) 基金经理。2020 年 11 月 16 日至 2024 年 12 月 9 日任大成卓享一年持有期混合型证券投资基金基金经理。2020 年 11 月 18 日至 2024 年 8 月 14 日任大成丰享回报混合型证券投资基金基金经理。2021 年 4 月 22 日至 2024 年 6 月 6 日任大成安享得利六个月持有期混合型证券投资基金基金经理。2022 年 3 月 11 日起</p>
--	--	--	--	---

					任大成民享安盈一年持有期混合型证券投资基金基金经理。2023年2月24日至2025年4月14日任大成盛享一年持有期混合型证券投资基金基金经理。2023年11月2日起任大成元丰多利债券型证券投资基金基金经理。2024年4月2日起任大成元辰招利债券型证券投资基金基金经理。2025年3月10日起任大成安享得利六个月持有期混合型证券投资基金基金经理。2025年11月4日起任大成元享臻利债券型证券投资基金基金经理。2025年12月18日起任大成优享6个月持有期混合型证券投资基金基金经理。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》、《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间连续 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。

#### 4.3.2.1 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交易中，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的 5% 的交易共 1 次，为完全按照指数的构成比例进行投资的组合和其他组合发生的反向交易。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

2025 年债券市场整体偏弱，短端利率冲高回落，长端利率回升至高位，全年收益率区间上移但仍处在低位。24 年四季度债券市场明显“抢跑”，进入 25 年后 10Y 国债利率缓慢上行，在 4 月关税冲突爆发后因避险需求再次出现下行，随后呈现震荡上行的状态，反映出经济基本面出现企稳的态势且整体通缩压力未再加剧。管理本基金一年以来，债券部分保持久期中等偏低，管理人认为可转债的机会不足，权益部分基本以股票为主。在股票层面，以资源品为主，特别是在年初比较好的位置做了以港股资源品为主的配置。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成盛享一年持有混合 A 的基金份额净值为 1.2116 元，本报告期基金份额净值增长率为 12.71%，同期业绩比较基准收益率为 1.71%；截至本报告期末大成盛享一年持有混合 C 的基金份额净值为 1.1977 元，本报告期基金份额净值增长率为 12.24%，同期业绩比较基准收益率为 1.71%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

站在当前往后看，管理人认为 2026 年在 PPI 回升的趋势中，债市机会不足，将更多在权益上提升组合的收益，为此我重点阐述对权益市场及相关投资机会的展望，以及我在权益投资中的一些思考：

第一，起点，基于认知还是基于信息的投资

“懂很多道理，却过不好这一生”，这是一个被反复提起，却很少被认真解释的问题。原因并不复杂：很多“道理”，只是被理解为信息，而不是被转化为认知。作为公募的平台拥有大量的信息和资源优势，但在 AI 大模型提升，量化能力加强的背景下，这种优势在被逐步的蚕食，基于信息的认知显得尤为重要，无论这种认知是在宏观行业还是个股层面。

第二，过程，过去三年在资源品的研究和投资中，一些认知的积累，我所认为的资源品投资三要素：

##### 1、宏观基础（金融属性）

自上而下在市场上一直被认为不是一个价值投资的经典范式（企业价值是未来可持续现金流的折现，实际上现金流离不开经营环境，折现率离不开流动性和利率，有机会我们下次报告再讨论），但在资源品投资中，无论是否承认都离不开对宏观的判断，这决定着商品的金融属性，如果说三年前我们拿出铜的供需平衡表只看商品属性，还能对铜的价格走势心里有个谱，但到今年底的价格水平上一定包含着大量的金融属性预期，这不仅是商品本身而是大部分资产的共性。从这个角度看，金融属性的趋势如何看，我认为债务扩张是逻辑的起点，这一轮起始于 2020 年，全球财政和货币扩张，之前全球是通缩状态之后是通胀状态，一直延续至今，到 25 年初这一扩张进入加速状态，美国一年内的债务上限上调了十万亿（大于 2020 年的七万亿），往前看量的变化远比是否降息还是加息更为重要，只要债务螺旋无法打破（某种程度上战争也是债务的一部分，美元的衰落是一个结果），短期不降息意味未来会降得更多。因此最具备金融属性的黄金就有了延续趋势的基础，当然央行购金等行为也会继续加强逻辑。以黄金为锚，我们再去具体分析各个细分品种的供需平衡表：

2、行业供需（商品属性），资源的各个细分品种，从大金属到小金属，到油气，再到农业等，我们习惯于先去看它的供给，过去三年，供给的约束体现为各个因素的叠加。比如铜长期资本开支的不足，品味的长期下降，电解铝产能天花板的严控，稀土的产能整合，镍的配额管理，油气因航道的控制导致的价格中枢上升（即使考虑冲突结束），橡胶的供给约束，VLCC 船的供给约束，甚至铝土矿这种严重过剩的品种也做供给控制，这里面有各国资源意识的觉醒，也有考虑备战等进行的超额库存，几乎每个品种都在进行供给端的重构，这个趋势在今年将会继续演绎；与此同

时，需求端也在重构，三年前电解铝还在担心房地产拖累需求崩塌，但新能源等制造业托起了新的需求，类似的 AI 算力对铜锡的需求，机器人军工对稀土的需求也在对各个品种的需求端进行了重构；

3、公司资源禀赋：禀赋好且又快又好的实现产能的释放这是评价一家资源品公司的标准，能够做到这样的资源品公司其实不多，这也导致在这一轮价格上行中很多公司还没有充分享受到利润的释放，很多还在修复资产负债表的过程中，资源禀赋优秀的公司还有可挖掘的机会，在具体的个股投资上，我习惯于选择偏左侧的公司，价格要求假设不高，明显的量的增长，估值中等偏低，经营节奏好，筹码干净的公司。

第三，扩散的投资机会，除了资源品本身，沿着 PPI 回升的受益链条继续寻找，从 PB-ROE 角度去看化工，建材，通用机械、餐饮、食品饮料、地产等。

节奏上不同阶段不同细分品种机会不同，本基金会做主动调整，努力做到主动挖掘机会，基于以上本基金在四季度持仓，以黄金为基础保持稳定，适度增加了一些供需结构更好的小金属以及油气的标的。

#### 第四，风险考量和交易纪律

我在前面提到目前大部分资产中都有流动性的溢价在里面，未来风险的核心还是债务螺旋的打破，有人为的打破，比如人为的缩表，也比如恶性通胀导致的被动缩表，那将不仅仅是资源品的风险，那将是大部分资产的系统性风险。

还有一种是自然的打破，依靠 AI 应用的成功提升全要素生产率，经济增长动能的系统性提升，那将是一个更好的结果。

风险时刻存在，认知是一方面，也可能会随时犯错，交易纪律上的坚持是一种弥补，大家都知道三思而后行，但实际上这还有其他的含义，《论语·公冶长》记载季文子三思而后行，孔子闻之说“再，斯可矣”（想两次就够了），投资中要杜绝犹豫不决。

第五，总结来说，基于商品属性的供需结构重构和金融属性的债务扩张，继续看好资源品及相应的扩散的投资机会，挖掘细分品种，在研究投资中处理好信息，认知和交易纪律的关系。

## 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、制度执行及遵纪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。估值委员会由公司分管领导、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验。

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，并负责与托管人沟通估值调整事项；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，并与托管人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人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

本基金在本报告期内，曾出现了连续 60 个工作日资产净值低于五千万元的情形。我公司已根据法律法规及基金合同要求拟定相关应对方案上报中国证券监督管理委员会。自 2025 年 2 月 25 日起，由本基金管理人承担本基金的固定费用。

## § 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

本报告期内，中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在大成盛享一年持有期混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

### 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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购

赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内，本基金未进行利润分配。

### 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、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	大成盛享一年持有期混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了大成盛享一年持有期混合型证券投资基金的财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的大成盛享一年持有期混合型证券投资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，公允反映了大成盛享一年持有期混合型证券投资基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>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《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》和中国注册会计师职业道德守则，我们独立于大成盛享一年持有期混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们在审计中遵循了对公众利益实体审计的独立性要求。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。</p>
其他信息	<p>大成盛享一年持有期混合型证券投资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。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>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。</p> <p>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</p>

	需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	<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。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估大成盛享一年持有期混合型证券投资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。</p> <p>治理层负责监督大成盛享一年持有期混合型证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<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。</p> <p>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：</p> <p>（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。</p> <p>（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。</p> <p>（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。</p> <p>（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，就可能导致对大成盛享一年持有期混合型证券投资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盛享一年持有期混合型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>（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。</p> <p>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	高鹤   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	2026年3月30日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：大成盛享一年持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	120,824.40	1,719,011.66
结算备付金		2,811.80	1,562,917.70
存出保证金		5,522.53	11,317.02
交易性金融资产	7.4.7.2	27,656,726.22	33,650,974.18
其中：股票投资		7,899,430.99	9,495,647.31
基金投资		-	-
债券投资		19,757,295.23	24,155,326.87
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	-	9,800,827.66
应收清算款		146,897.99	375,155.50
应收股利		-	-
应收申购款		12,169.44	38,050.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	22,216.85	-
资产总计		27,967,169.23	47,158,253.72
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2025 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2024 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		1,499,627.46	-
应付清算款		1.61	0.68
应付赎回款		85,567.26	142,797.20
应付管理人报酬		18,437.02	32,652.75
应付托管费		4,609.26	8,163.20
应付销售服务费		585.66	255.44
应付投资顾问费		-	-

应交税费		-	48.90
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	11,271.69	126,922.01
负债合计		1,620,099.96	310,840.18
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.10	21,762,602.35	43,584,559.34
未分配利润	7.4.7.12	4,584,466.92	3,262,854.20
净资产合计		26,347,069.27	46,847,413.54
负债和净资产总计		27,967,169.23	47,158,253.72

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额总额 21,762,602.35 份。其中大成盛享一年持有混合 A 类基金份额总额为 20,291,178.96 份，基金份额净值 1.2116 元；大成盛享一年持有混合 C 类基金份额总额为 1,471,423.39 份，基金份额净值 1.1977 元。

## 7.2 利润表

会计主体：大成盛享一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		4,163,710.85	12,505,242.63
1. 利息收入		12,822.63	202,083.11
其中：存款利息收入	7.4.7.13	8,844.03	61,652.16
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		3,978.60	140,430.95
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		4,553,349.76	11,085,996.40
其中：股票投资收益	7.4.7.14	2,887,618.64	4,931,909.69
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	1,418,369.59	5,604,278.42
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	247,361.53	549,808.29
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的		-	-

收益			
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.20	-402,461.54	1,217,163.12
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		381,076.88	1,999,358.00
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	271,866.79	1,034,363.88
2. 托管费	7.4.10.2.2	67,966.70	258,590.99
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	5,011.99	4,393.56
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		29,498.09	551,737.36
其中：卖出回购金融资产支出		29,498.09	551,737.36
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		14.08	5,050.37
8. 其他费用	7.4.7.23	6,719.23	145,221.84
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		3,782,633.97	10,505,884.63
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		3,782,633.97	10,505,884.63
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		3,782,633.97	10,505,884.63

### 7.3 净资产变动表

会计主体：大成盛享一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	43,584,559.34	-	3,262,854.20	46,847,413.54
二、本期期初净资产	43,584,559.34	-	3,262,854.20	46,847,413.54
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-21,821,956.99	-	1,321,612.72	-20,500,344.27

(一)、综合收益总额	-	-	3,782,633.97	3,782,633.97
(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)	-21,821,956.99	-	-2,461,021.25	-24,282,978.24
其中: 1. 基金申购款	3,777,160.64	-	552,571.01	4,329,731.65
2. 基金赎回款	-25,599,117.63	-	-3,013,592.26	-28,612,709.89
(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	21,762,602.35	-	4,584,466.92	26,347,069.27
项目	上年度可比期间 2024年1月1日至2024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	336,879,972.13	-	-713,415.20	336,166,556.93
二、本期期初净资产	336,879,972.13	-	-713,415.20	336,166,556.93
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-293,295,412.79	-	3,976,269.40	-289,319,143.39
(一)、综合收益总额	-	-	10,505,884.63	10,505,884.63
(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)	-293,295,412.79	-	-6,529,615.23	-299,825,028.02
其中: 1. 基金申购款	648,244.54	-	31,464.38	679,708.92
2. 基金赎回款	-293,943,657.33	-	-6,561,079.61	-300,504,736.94
(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	43,584,559.34	-	3,262,854.20	46,847,413.54

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：

谭晓冈

范瑛

梁靖

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

大成盛享一年持有期混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）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【2022】1759 号文《关于准予大成盛享一年持有期混合型证券投资基金注册的批复》注册，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《大成盛享一年持有期混合型证券投资基金基金合同》作为发起人于 2023 年 2 月 8 日至 2023 年 2 月 21 日向社会公开募集，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（2023）验字第 60469430\_H02 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 2023 年 2 月 24 日生效，基金合同生效日的基金份额总额为 336,644,879.93 份基金份额，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，基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板、科创板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、存托凭证、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许投资的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（简称“港股通标的股票”）、经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金（不包含 QDII 基金、香港互认基金、基金中基金、其他投资范围包含基金的基金、本基金基金经理管理的其他基金、货币市场基金、非本基金管理人管理的基金）、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、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可交换债券、可转换债券及其他中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款等）、货币市场工具、股指期货、国债期货，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的相关规定。本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定参与融资业务，但不参与融资买入股票业务。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。本基金的投资组合比例为：本基金投资于权益类资产的比例为基金资产的 10%-30%（其中投资于港股通标的股票占本基金股票资产的比例为 0%-50%），本基金投资的权益类资产包括股票、存托凭证、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、股票型基金以及至少满足以下一条标准的计入权益资产的混合型基金：（1）基金合同约定的股票资产占基金资产的比例不低于 60%；（2）基金最近 4 期季度报告中披露的股票资产占基金资产的比例均不低于 60%。本基金对经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金投资比例不超过基金资产净值的 10%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货、国债期货的投资比例遵循国家相关法律法规。本基金投资于同业存单的比例合计不超过基金资产的 20%。如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数收益率\*10%+中债综合全价（总值）指数收益率\*80%+恒生指数收益率（使用估值汇率调整）\*5%+金融机构人民币活期存款利率（税后）\*5%。

#### 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、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 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 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的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金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平准金和未实现平准金。已实现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损益占净资产比例计算的金额。未实现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损益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，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务工具投资的，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。

本基金在同时符合下列条件时确认股利收入并计入当期损益：1) 本基金收取股利的权利已经确立；2) 与股利相关的经济利益很可能流入本基金；3) 股利的金额能够可靠计量。

(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

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。基金收益分配后任一类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的任一类基金份额净值减去该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用。
- (2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩。
- (3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

无。

#### 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) 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征增值税试点的通知》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。

根据财政部、国家税务总局公告2025年第4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》，自2025年8月8日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在2025年8月8日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

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附加。

## （2）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[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。

## （3）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，（如有）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，（如有）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。

## （4）印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3% 调整为 1%，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

## （5）境外投资

本基金运作过程中如有涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税

[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

#### 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 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
活期存款	120,824.40	1,719,011.66
等于：本金	120,793.46	1,718,762.31
加：应计利息	30.94	249.35
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	120,824.40	1,719,011.66

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	6,744,754.08	-	7,899,430.99	1,154,676.91	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	1,599,136.00	17,848.11	1,617,848.11	864.00
	银行间市场	17,904,609.00	361,447.12	18,139,447.12	-126,609.00
	合计	19,503,745.00	379,295.23	19,757,295.23	-125,745.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	26,248,499.08	379,295.23	27,656,726.22	1,028,931.91	
项目	上年度末 2024 年 12 月 31 日				

	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	8,870,032.46	-	9,495,647.31	625,614.85
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	30,215.31	7,089,798.10	261,424.60
	银行间市场	16,170,846.00	17,065,528.77	544,354.00
	合计	22,969,004.19	24,155,326.87	805,778.60
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	31,839,036.65	380,544.08	33,650,974.18	1,431,393.45

#### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-
项目	上年度末 2024年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	9,800,827.66	-
合计	9,800,827.66	-

##### 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 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
应收利息	-	-
其他应收款	22,216.85	-
待摊费用	-	-
合计	22,216.85	-

## 7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024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	10,518.19	9,622.01
其中：交易所市场	3,969.84	5,453.36
银行间市场	6,548.35	4,168.65
应付利息	-	-
预提费用	753.50	117,300.00
合计	11,271.69	126,922.01

## 7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

## 大成盛享一年持有混合 A

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	42,830,120.27	42,830,120.27
本期申购	2,721,593.06	2,721,593.06
本期赎回（以“-”号填列）	-25,260,534.37	-25,260,534.37
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	20,291,178.96	20,291,178.96

## 大成盛享一年持有混合 C

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	754,439.07	754,439.07
本期申购	1,055,567.58	1,055,567.58
本期赎回（以“-”号填列）	-338,583.26	-338,583.26
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	1,471,423.39	1,471,423.39

注：申购含红利再投份额(如有)、转换入份额(如有)；赎回含转换出份额(如有)。

## 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

## 大成盛享一年持有混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,432,581.12	-220,343.15	3,212,237.97
本期期初	3,432,581.12	-220,343.15	3,212,237.97
本期利润	4,039,654.09	-405,242.01	3,634,412.08
本期基金份额交易产生的变动数	-3,090,134.96	537,005.76	-2,553,129.20
其中：基金申购款	454,937.30	-41,639.51	413,297.79
基金赎回款	-3,545,072.26	578,645.27	-2,966,426.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,382,100.25	-88,579.40	4,293,520.85

## 大成盛享一年持有混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	54,490.71	-3,874.48	50,616.23
本期期初	54,490.71	-3,874.48	50,616.23
本期利润	145,441.42	2,780.47	148,221.89
本期基金份额交易产生的变动数	97,702.98	-5,595.03	92,107.95
其中：基金申购款	151,702.38	-12,429.16	139,273.22
基金赎回款	-53,999.40	6,834.13	-47,165.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	297,635.11	-6,689.04	290,946.07

## 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
活期存款利息收入	6,771.18	11,841.14
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	2,044.87	49,418.33
其他	27.98	392.69
合计	8,844.03	61,652.16

## 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 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	2,887,618.64	4,931,909.69
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	2,887,618.64	4,931,909.69

## 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 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
----	-----------------------------	----------------------------------

卖出股票成交总额	35,645,958.01	83,004,944.34
减：卖出股票成本总额	32,684,174.06	77,932,300.19
减：交易费用	74,165.31	140,734.46
买卖股票差价收入	2,887,618.64	4,931,909.69

#### 7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

#### 7.4.7.15 债券投资收益

##### 7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
债券投资收益——利息收入	684,461.72	3,545,045.87
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	733,907.87	2,059,232.55
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	1,418,369.59	5,604,278.42

##### 7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	35,057,451.19	475,647,509.05
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	33,863,559.29	466,467,106.35
减：应计利息总额	458,772.54	7,114,650.74
减：交易费用	1,211.49	6,519.41
买卖债券差价收入	733,907.87	2,059,232.55

##### 7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

## 7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

## 7.4.7.16 资产支持证券投资收益

## 7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

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

无。

## 7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

## 7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

## 7.4.7.17 贵金属投资收益

## 7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

## 7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

## 7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

## 7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

## 7.4.7.18 衍生工具收益

## 7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

## 7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
股票投资产生的股利收益	247,361.53	549,808.29

其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	247,361.53	549,808.29

#### 7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年1月1日至2025年 12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024 年12月31日
1. 交易性金融资产	-402,461.54	1,217,163.12
股票投资	529,062.06	1,212,749.61
债券投资	-931,523.60	4,413.51
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
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	-402,461.54	1,217,163.12

#### 7.4.7.21 其他收入

无。

#### 7.4.7.22 信用减值损失

无。

#### 7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12 月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31 日
审计费用	753.50	28,000.00
信息披露费	-	80,000.00
证券出借违约金	-	-
深港通证券组合费	282.58	21.84
账户维护费	5,683.15	37,200.00
合计	6,719.23	145,221.84

#### 7.4.7.24 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
中国邮政储蓄银行股份有限公司(“邮政储蓄银行”)	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、基金销售机构
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：下述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

无。

###### 7.4.10.1.2 债券交易

无。

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

###### 7.4.10.1.4 权证交易

无。

###### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

##### 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	上年度可比期间
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

	月 31 日	12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	271,866.79	1,034,363.88
其中：应支付销售机构的客户维护费	134,399.19	514,276.11
应支付基金管理人的净管理费	137,467.60	520,087.77

注：本基金投资于基金管理人所管理的其他基金部分不收取管理费。本基金管理费年费率为 0.80%，每日计提，按月支付。其计算公式为：

日管理费 = 前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金管理人管理的其他基金部分后的余额 × 管理费年费率 / 当年天数。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	67,966.70	258,590.99

注：本基金投资于基金托管人所托管的其他基金部分不收取托管费。本基金托管费年费率为 0.20%，每日计提，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金托管人托管的其他基金部分后的余额 × 托管费年费率 / 当年天数。

#### 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		
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成盛享一年持有混合 A	大成盛享一年持有混合 C	合计
邮政储蓄银行	-	3,255.45	3,255.45
合计	-	3,255.45	3,255.45
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成盛享一年持有混合 A	大成盛享一年持有混合 C	合计
邮政储蓄银行	-	3,807.70	3,807.70

合计	-	3,807.70	3,807.70
----	---	----------	----------

注：C类基金份额的销售服务费年费率为0.40%。

销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times \text{该类基金份额销售服务费年费率} \div \text{当年天数}$$

H为该类基金份额每日应计提的销售服务费

E为该类基金份额前一日基金资产净值

#### 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

单位：人民币元

本期 2025年1月1日至2025年12月31日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
邮政储蓄银行	-	-	-	-	4,100,00 0.00	534.93
上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
邮政储蓄银行	-	-	-	-	50,100,0 00.00	3,233.77

#### 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固有资金投资本基金的情况

无。

##### 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 2025年1月1日至2025年12月 31日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024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
邮政储蓄银行	120,824.40	6,771.18	1,719,011.66	11,841.14

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

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

无。

#### 7.4.12 期末（2025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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值 单价	复 牌 日期	复牌 开盘 单价	数量 (股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
02362	金川国际	2025年3月28日	重大事项停牌	0.58	-	-	582,000	401,447.69	336,431.39	-

##### 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

截至本报告期末 2025 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 1,499,627.46 元，截至 2026 年 01 月 05 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

##### 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邮政储蓄银行股份有限公司，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，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券(上年度末：本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 9.11%)。

#### 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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场内交易的证券，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。

本基金持有交易所及银行间同业市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。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 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
货币资金	120,824.40	-	-	-	120,824.40
结算备付金	2,811.80	-	-	-	2,811.80
存出保证金	5,522.53	-	-	-	5,522.53
交易性金融资产	1,617,848.11	10,301,660.27	7,837,786.85	7,899,430.99	27,656,726.22
应收申购款	-	-	-	12,169.44	12,169.44
应收清算款	-	-	-	146,897.99	146,897.99
其他资产	-	-	-	22,216.85	22,216.85
<b>资产总计</b>	<b>1,747,006.84</b>	<b>10,301,660.27</b>	<b>7,837,786.85</b>	<b>8,080,715.27</b>	<b>27,967,169.23</b>
<b>负债</b>					
应付赎回款	-	-	-	85,567.26	85,567.26
应付管理人报酬	-	-	-	18,437.02	18,437.02
应付托管费	-	-	-	4,609.26	4,609.26
应付清算款	-	-	-	1.61	1.61
卖出回购金融资产款	1,499,627.46	-	-	-	1,499,627.46
应付销售服务费	-	-	-	585.66	585.66
其他负债	-	-	-	11,271.69	11,271.69
<b>负债总计</b>	<b>1,499,627.46</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>120,472.50</b>	<b>1,620,099.96</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>247,379.38</b>	<b>10,301,660.27</b>	<b>7,837,786.85</b>	<b>7,960,242.77</b>	<b>26,347,069.27</b>
上年度末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
货币资金	1,719,011.66	-	-	-	1,719,011.66
结算备付金	1,562,917.70	-	-	-	1,562,917.70
存出保证金	11,317.02	-	-	-	11,317.02
交易性金融资产	2,821,732.60	10,569,175.09	10,764,419.18	9,495,647.31	33,650,974.18
买入返售金融资产	9,800,827.66	-	-	-	9,800,827.66
应收申购款	-	-	-	38,050.00	38,050.00
应收清算款	-	-	-	375,155.50	375,155.50
<b>资产总计</b>	<b>15,915,806.64</b>	<b>10,569,175.09</b>	<b>10,764,419.18</b>	<b>9,908,852.81</b>	<b>47,158,253.72</b>
<b>负债</b>					
应付赎回款	-	-	-	142,797.20	142,797.20

应付管理人报酬	-	-	-	32,652.75	32,652.75
应付托管费	-	-	-	8,163.20	8,163.20
应付清算款	-	-	-	0.68	0.68
应付销售服务费	-	-	-	255.44	255.44
应交税费	-	-	-	48.90	48.90
其他负债	-	-	-	126,922.01	126,922.01
负债总计	-	-	-	310,840.18	310,840.18
利率敏感度缺口	15,915,806.64	10,569,175.09	10,764,419.18	9,598,012.63	46,847,413.54

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
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（2025年12月31日）	上年度末（2024年12月31日）
	市场利率上升25个基点	-122,894.69	-233,404.46
市场利率下降25个基点	124,405.42	238,741.49	

#### 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。本基金持有不以记账本位币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日			合计
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	4,027,721.73	-	4,027,721.73
资产合计	-	4,027,721.73	-	4,027,721.73

以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	4,027,721.73	-	4,027,721.73
项目	上年度末 2024年12月31日			
	美元折合人民币元	港币折合人民币元	其他币种折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	759,538.01	-	759,538.01
资产合计	-	759,538.01	-	759,538.01
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	759,538.01	-	759,538.01

#### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率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（2025年12月31日）	上年度末（2024年12月31日）
	所有外币相对人民币升值5%	201,386.08	37,976.90
	所有外币相对人民币贬值5%	-201,386.08	-37,976.90

#### 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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的债券，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。

本基金的投资组合比例为：本基金投资于权益类资产的比例为基金资产的 10%-30%（其中投资于港股通标的股票占本基金股票资产的比例为 0%-50%），本基金投资的权益类资产包括股票、存托凭证、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、股票型基金以及至少满足以下一条标准的计入权益资产的混合型基金：（1）基金合同约定的股票资产占基金资产的比例不低于 60%；（2）基金最近 4 期季度报告中披露的股票资产占基金资产的比例均不低于 60%。本基金对经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金投资比例不超过基金资产净值的 10%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货、国债期货的投资比例遵循国家相关法律法规。本基金投资于同业存单的比例合计不超过基金资产的 20%。如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

#### 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 2025 年 12 月 31 日		上年度末 2024 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	7,899,430.99	29.98	9,495,647.31	20.27
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	7,899,430.99	29.98	9,495,647.31	20.27

#### 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（2025 年 12 月 31 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）

	业绩比较基准上升 5%	2,469,944.98	2,533,394.18
	业绩比较基准下降 5%	-2,469,944.98	-2,533,394.18

#### 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 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
第一层次	7,562,999.60	13,763,712.81
第二层次	20,093,726.62	19,887,261.37
第三层次	-	-
合计	27,656,726.22	33,650,974.18

###### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次；对于定期开放的基金投资，本基金不会于封闭期将相关基金列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关投资的公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### 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

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具(上年度末：同)。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括货币资金、应收款项和其他金融负债等，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)于本期末，本基金出现连续 60 个工作日资产净值低于五千万元的情形。本基金的管理人已根据法律法规及基金合同要求拟定相关应对方案上报中国证券监督管理委员会。

(2)除上述事项外，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	7,899,430.99	28.25
	其中：股票	7,899,430.99	28.25
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	19,757,295.23	70.64
	其中：债券	19,757,295.23	70.64
	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	123,636.20	0.44
8	其他各项资产	186,806.81	0.67
9	合计	27,967,169.23	100.00

注：1、本基金通过深港通交易机制投资的港股公允价值为 4,027,721.73 元，占期末基金资产净值的比例为 15.29%。

2、截至报告期末，本基金因市值波动导致投资于港股通标的股票投资比例被动超过本基金股

票资产的 50%。

## 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

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	26,910.00	0.10
B	采矿业	1,154,074.00	4.38
C	制造业	1,617,163.26	6.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	320,586.00	1.22
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	22,178.00	0.08
J	金融业	730,798.00	2.77
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,871,709.26	14.70

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
通讯	261,247.35	0.99
非必需消费品	97,522.47	0.37
必需消费品	21,514.70	0.08
能源	726,008.23	2.76
金融	233,301.73	0.89
房地产	-	-
医疗保健	-	-
工业	260,127.36	0.99
材料	2,427,999.89	9.22
科技	-	-
公用事业	-	-

政府	-	-
合计	4,027,721.73	15.29

注：以上分类采用彭博行业分类标准。

### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600547	山东黄金	5,300	205,163.00	0.78
1	01787	山东黄金	9,750	304,701.27	1.16
2	00883	中国海洋石油	22,000	423,248.89	1.61
3	601665	齐鲁银行	71,800	412,132.00	1.56
4	000426	兴业银锡	11,400	405,840.00	1.54
5	600352	浙江龙盛	37,100	395,486.00	1.50
6	02099	中国黄金国际	2,600	368,459.57	1.40
7	03993	洛阳钼业	21,000	364,937.01	1.39
8	603619	中曼石油	15,300	352,665.00	1.34
9	00358	江西铜业股份	9,000	348,570.66	1.32
10	02362	金川国际	582,000	336,431.39	1.28
11	600690	海尔智家	12,300	320,907.00	1.22
12	601872	招商轮船	35,700	320,586.00	1.22
13	00857	中国石油股份	40,000	302,759.34	1.15
14	01258	中国有色矿业	21,000	279,772.40	1.06
15	03690	美团-W	2,800	261,247.35	0.99
16	01138	中远海能	30,000	260,127.36	0.99
17	03618	重庆农村商业银行	42,000	233,301.73	0.89
18	03939	万国黄金集团	28,000	192,963.92	0.73
19	601187	厦门银行	24,300	178,362.00	0.68
20	002497	雅化集团	6,900	170,775.00	0.65
21	000688	国城矿业	5,100	141,780.00	0.54
22	02259	紫金黄金国际	900	118,683.11	0.45
23	600426	华鲁恒升	3,300	103,719.00	0.39
24	601166	兴业银行	4,000	84,240.00	0.32
25	688303	大全能源	2,823	75,712.86	0.29
26	00325	布鲁可	1,200	72,564.69	0.28
27	002532	天山铝业	4,400	71,192.00	0.27
28	002539	云图控股	5,900	69,738.00	0.26
29	01171	兖矿能源	8,000	69,511.81	0.26
30	000933	神火股份	2,500	68,675.00	0.26
31	601288	农业银行	7,300	56,064.00	0.21
32	002262	恩华药业	2,300	55,499.00	0.21
33	603092	德力佳	800	49,992.00	0.19
34	600309	万华化学	600	46,008.00	0.17

35	02600	中国铝业	4,000	43,968.75	0.17
36	002379	宏桥控股	1,700	40,664.00	0.15
37	603260	合盛硅业	700	36,890.00	0.14
38	603087	甘李药业	400	27,228.00	0.10
39	601118	海南橡胶	4,600	26,910.00	0.10
40	03931	中创新航	1,100	24,957.78	0.09
41	001203	大中矿业	800	24,520.00	0.09
42	300483	首华燃气	1,700	24,106.00	0.09
43	002602	世纪华通	1,300	22,178.00	0.08
44	06969	思摩尔国际	2,000	21,514.70	0.08
45	300394	天孚通信	100	20,303.00	0.08
46	688472	阿特斯	1,339	19,964.49	0.08
47	600765	中航重机	900	17,244.00	0.07
48	002028	思源电气	100	15,459.00	0.06
49	688239	航宇科技	173	11,706.91	0.04

注：对于同时在 A+H 股上市的股票（如有），合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

## 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	06969	思摩尔国际	1,433,939.24	3.06
2	601665	齐鲁银行	1,328,529.00	2.84
3	01138	中远海能	1,112,498.24	2.37
4	00883	中国海洋石油	1,108,927.89	2.37
5	601187	厦门银行	1,103,010.00	2.35
6	01208	五矿资源	901,726.41	1.92
7	000426	兴业银锡	864,946.00	1.85
8	601077	渝农商行	312,156.00	0.67
8	03618	重庆农村商业银行	461,710.62	0.99
9	000333	美的集团	287,619.00	0.61
9	00300	美的集团	383,016.11	0.82
10	02600	中国铝业	663,384.71	1.42
11	03993	洛阳钼业	601,382.59	1.28
12	600690	海尔智家	559,151.00	1.19
13	02888	渣打集团	555,262.54	1.19
14	600547	山东黄金	263,846.00	0.56
14	01787	山东黄金	280,705.36	0.60
15	601872	招商轮船	542,552.00	1.16
16	01258	中国有色矿业	531,247.70	1.13

17	603619	中曼石油	513,640.00	1.10
18	00358	江西铜业股份	471,050.99	1.01
19	301078	孩子王	464,066.00	0.99
20	600760	中航沈飞	460,930.00	0.98

注：1. 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。

2. 对于同时在 A+H 股上市的股票（如有），合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

#### 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	601665	齐鲁银行	1,978,561.00	4.22
2	601077	渝农商行	1,391,240.00	2.97
2	03618	重庆农村商业银行	217,715.83	0.46
3	06969	思摩尔国际	1,502,611.99	3.21
4	01138	中远海能	1,237,694.50	2.64
5	000426	兴业银锡	1,125,396.00	2.40
6	01208	五矿资源	1,098,473.29	2.34
7	601187	厦门银行	1,096,880.00	2.34
8	00883	中国海洋石油	1,027,598.81	2.19
9	601872	招商轮船	895,674.00	1.91
10	600036	招商银行	876,573.00	1.87
11	601600	中国铝业	245,532.00	0.52
11	02600	中国铝业	575,202.30	1.23
12	002948	青岛银行	747,562.00	1.60
13	601088	中国神华	399,021.00	0.85
13	01088	中国神华	335,303.92	0.72
14	01258	中国有色矿业	689,603.88	1.47
15	000725	京东方 A	654,372.00	1.40
16	000333	美的集团	277,362.00	0.59
16	00300	美的集团	368,781.95	0.79
17	301078	孩子王	582,341.00	1.24
18	02888	渣打集团	580,880.12	1.24
19	03993	洛阳钼业	556,587.86	1.19
20	00358	江西铜业股份	497,192.97	1.06

注：1. 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。

2. 对于同时在 A+H 股上市的股票（如有），合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

## 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	30,558,895.68
卖出股票收入（成交）总额	35,645,958.01

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	1,617,848.11	6.14
2	央行票据	-	-
3	金融债券	18,139,447.12	68.85
	其中：政策性金融债	18,139,447.12	68.85
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	19,757,295.23	74.99

## 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	220208	22 国开 08	100,000	10,301,660.27	39.10
2	210205	21 国开 05	70,000	7,837,786.85	29.75
3	019766	25 国债 01	16,000	1,617,848.11	6.14

## 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 投资组合报告附注

### 8.12.1 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 21 国开 05、22 国开 08 的发行主体国家开发银行于 2025 年 9 月 22 日因违反金融统计相关规定等受到中国人民银行处罚（银罚决字（2025）66 号）。本基金认为，对国家开发银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

### 8.12.2 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。

### 8.12.3 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	5,522.53
2	应收清算款	146,897.99
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	12,169.44
6	其他应收款	22,216.85
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	186,806.81

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	02362	金川国际	336,431.39	1.28	重大事项停牌

### 8.12.6 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)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总份 额比例 (%)
大成盛享 一年持有 混合 A	1,316	15,418.83	0.00	0.00	20,291,178.96	100.00
大成盛享 一年持有 混合 C	162	9,082.86	0.00	0.00	1,471,423.39	100.00
合计	1,478	14,724.36	0.00	0.00	21,762,602.35	100.00

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

无。

### 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、 基金投资和研部门 负责人持有本开放式 基金	大成盛享一年持有混合 A	0
	大成盛享一年持有混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有 本开放式基金	大成盛享一年持有混合 A	0
	大成盛享一年持有混合 C	0
	合计	0

### 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	大成盛享一年持有混合 A	大成盛享一年持有混合 C
基金合同生效日 (2023 年 2 月 24 日)		
基金份额总额	334,559,134.49	2,085,745.44
本报告期期初基金份 额总额	42,830,120.27	754,439.07
本报告期基金总申购 份额	2,721,593.06	1,055,567.58
减:本报告期基金总 赎回份额	25,260,534.37	338,583.26
本报告期基金拆分变 动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	20,291,178.96	1,471,423.39

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

大成盛享一年持有期混合型证券投资基金基金份额持有人大会以通讯方式自 2025 年 8 月 12 日起至 2025 年 9 月 4 日召开, 审议《关于大成盛享一年持有期混合型证券投资基金持续运作有关事项的议案》, 根据计票结果, 未达到以通讯方式召开基金份额持有人大会的有效开会条件。具体详见 2025 年 9 月 6 日公告。

### 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

2025 年 9 月 26 日, 公司召开大成基金管理有限公司 2025 年第一次临时股东会, 审议通过《关于公司董事会换届的议案》, 选举吴庆斌先生、杨红女士、林昌先生、宋立志先生担任公司第九届董事会董事; 选举杨飞先生、王亚坤先生、谢丹夏先生、江涛女士担任公司第九届董事会独立董事, 杨晓帆、胡维翊不再担任公司独立董事; 推举谭晓冈先生担任公司第九届董事会专职董事。第九届董事会董事任期为三年, 自本次股东会决议生效之日起计算。

#### 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 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务至今，本年度应支付的审计费用为 5,000.00 元。

### 11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人无受调查或处罚等情况。

#### 11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

#### 11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，托管人未因托管业务受调查或处罚。

#### 11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，托管人相关从业人员未受调查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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 (%)	
广发证券	2	43,499,671.78	65.70	19,835.84	65.70	-
申万宏源	1	22,705,181.91	34.30	10,353.55	34.30	-
长江证券	3	-	-	-	-	新增3个

注：本基金采用托管人结算模式，本基金管理人负责选择证券经纪商，租用其交易单元作为本基金的交易单元。证券经纪商的选择标准和流程如下：

#### （一）筛选标准

大成基金管理有限公司（以下简称“公司”）严格按照《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》要求制定了证券公司筛选标准，建立了证券公司尽职调查、证券公司负面筛查、备选池筛选机制，选择财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强的证券公司参与证券交易。

#### （二）筛选流程

1、经公司尽调符合条件的证券公司进入备选池，由股票投委会以公平、公正、公开为原则，结合定性及定量办法科学评估证券公司研究服务能力，形成证券公司白名单，并定期及不定期进行动态调整。

2、公司按照白名单与证券公司进行协议签署。

### 11.7.2 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	
	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(%)
广发证券	7,157,722.68	100.00	50,698,000.00	100.00	-	-

### 11.8 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	大成基金管理有限公司关于提请投资者持续完善身份信息公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025年12月31日
2	大成基金管理有限公司旗下200只公募基金2025年第3季度报告提示性公告	规定报刊	2025年10月28日
3	大成盛享一年持有期混合型证券投资基金2025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	2025年10月28日
4	大成基金管理有限公司关于大成盛享一年持有期混合型证券投资基金基金份额持有人大会会议情况的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025年9月6日
5	大成基金管理有限公司旗下193只公募基金2025年中期报告提示性公告	规定报刊	2025年8月29日
6	大成盛享一年持有期混合型证券投资基金2025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	2025年8月29日
7	大成基金管理有限公司关于以通讯方式召开大成盛享一年持有期混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025年8月6日
8	大成基金管理有限公司关于以通讯方式召开大成盛享一年持有期混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025年8月5日
9	大成基金管理有限公司关于以通讯方	中国证监会基金电子披	2025年8月4日

	式召开大成盛享一年持有期混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告	露网站、规定报刊及本公司网站	
10	大成基金管理有限公司旗下 194 只公募基金 2025 年第 2 季度报告提示性公告	规定报刊	2025 年 7 月 22 日
11	大成盛享一年持有期混合型证券投资基金 2025 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	2025 年 7 月 21 日
12	大成盛享一年持有期混合型证券投资基金(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	2025 年 6 月 30 日
13	大成基金管理有限公司关于再次提请投资者及时更新已过期身份证件及其他身份基本信息的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 6 月 30 日
14	大成盛享一年持有期混合型证券投资基金(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	2025 年 6 月 30 日
15	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	2025 年 6 月 6 日
16	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	2025 年 4 月 26 日
17	大成基金管理有限公司旗下 188 只公募基金 2025 年第 1 季度报告提示性公告	规定报刊	2025 年 4 月 22 日
18	大成盛享一年持有期混合型证券投资基金 2025 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	2025 年 4 月 22 日
19	大成盛享一年持有期混合型证券投资基金更新招募说明书	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 4 月 17 日
20	大成盛享一年持有期混合型证券投资基金(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	2025 年 4 月 17 日
21	大成盛享一年持有期混合型证券投资基金(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	2025 年 4 月 17 日
22	大成盛享一年持有期混合型证券投资基金变更基金经理公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 4 月 15 日
23	大成盛享一年持有期混合型证券投资基金 2024 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本	2025 年 3 月 31 日

		公司网站	
24	大成基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 3 月 31 日
25	大成基金管理有限公司旗下 184 只公募基金 2024 年年度报告提示性公告	规定报刊	2025 年 3 月 31 日
26	大成盛享一年持有期混合型证券投资基金更新招募说明书	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 3 月 24 日
27	大成盛享一年持有期混合型证券投资基金(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	2025 年 3 月 13 日
28	大成盛享一年持有期混合型证券投资基金(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	2025 年 3 月 13 日
29	大成盛享一年持有期混合型证券投资基金更新招募说明书	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 3 月 13 日
30	大成盛享一年持有期混合型证券投资基金增聘基金经理公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 3 月 12 日
31	大成基金管理有限公司旗下 184 只公募基金 2024 年 4 季度报告提示性公告	规定报刊	2025 年 1 月 22 日
32	大成盛享一年持有期混合型证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 1 月 22 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

无。

### 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盛享一年持有期混合型证券投资基金的文件；
- 2、《大成盛享一年持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成盛享一年持有期混合型证券投资基金托管协议》；
- 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

2026 年 3 月 31 日