

交银施罗德安享稳健养老目标一年持有期
混合型基金中基金（FOF）
2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：交银施罗德基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 08 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
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
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	54
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	54
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	54

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	55
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
7.12 本报告期投资基金情况	55
7.13 投资组合报告附注	61
§ 8 基金份额持有人信息	65
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	65
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	66
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	66
§ 9 开放式基金份额变动	66
§ 10 重大事件揭示	67
10.1 基金份额持有人大会决议	67
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	67
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	67
10.4 基金投资策略的改变	67
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	67
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	67
10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	67
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况	68
10.9 其他重大事件	69
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	70
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	70
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	70
§ 12 备查文件目录	70
12.1 备查文件目录	70
12.2 存放地点	70
12.3 查阅方式	70

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	交银施罗德安享稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）	
基金简称	交银安享稳健养老一年	
基金主代码	006880	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 5 月 30 日	
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司	
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	4,379,101,544.29 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	交银安享稳健养老一年 A	交银安享稳健养老一年 Y
下属分级基金的交易代码	006880	017235
报告期末下属分级基金的份额总额	4,309,889,072.61 份	69,212,471.68 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金的基金份额，在控制风险并保持基金资产良好的流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值，满足养老资金理财需求。
投资策略	本基金主要采用目标风险策略来进行投资品种的大类资产配置。本基金根据特定的风险偏好设定权益类资产、非权益资产的基准配置比例，并采取有效措施控制基金组合风险。在基于目标风险策略应用过程中，本基金根据既定的风险预算对投资组合进行目标约束，并根据该风险预算目标来调整组合中各类资产的配置比例，将整个投资组合维持在相对稳定的市场风险暴露。基于本基金管理人绩效评估系统对备选基金的评估分析，在有效控制风险的前提下，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及投资业绩比较优势的基金确定本基金投资组合。本基金的绩效评估系统分析主要包括业绩指标分析、业绩归因分析以及基金管理人综合评估等。
业绩比较基准	80%×中债综合全价指数收益率+20%×沪深 300 指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金中基金，由于本基金主要投资于公开募集证券投资基金的基金份额，持有基金的预期风险和预期收益间接成为本基金的预期风险和预期收益。本基金的预期风险与预期收益高于债券型基金、债券型基金中基金、货币市场基金和货币型基金中基金，低于股票型基金和股票型基金中基金。

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	交银施罗德基金管理有限公司		中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王晚婷	任航
	联系电话	(021) 61055050	010-66060069
	电子邮箱	xxpl@jysld.com, disclosure@jysld.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话	400-700-5000, 021-61055000		95599
传真	(021) 61055054		010-68121816
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号交通银行大楼二层（裙）		北京市东城区建国门内大街69号
办公地址	上海市浦东新区世纪大道8号国金中心二期21-22楼		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	200120		100031
法定代表人	谢卫（代任）		谷澍

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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.fund001.com
基金中期报告备置地点	基金管理人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指标	报告期(2024年1月1日-2024年6月30日)	
	交银安享稳健养老一年A	交银安享稳健养老一年Y
本期已实现收益	-59,167,041.83	-628,762.26
本期利润	37,382,878.68	661,549.15
加权平均基金份额本期利润	0.0075	0.0094
本期加权平均净值利润率	0.65%	0.81%
本期基金份额净值增长率	0.69%	0.78%
3.1.2 期末数	报告期末(2024年6月30日)	

据和指标		
期末可供分配利润	436,814,286.50	7,264,846.07
期末可供分配基金份额利润	0.1014	0.1050
期末基金资产净值	5,020,596,861.09	80,911,531.85
期末基金份额净值	1.1649	1.1690
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	16.49%	-0.39%

注：1、上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，计入费用后的实际收益水平要低于所列数字；

2、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。

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

交银安享稳健养老一年 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.44%	0.17%	-0.15%	0.10%	-0.29%	0.07%
过去三个月	0.24%	0.20%	0.44%	0.14%	-0.20%	0.06%
过去六个月	0.69%	0.26%	2.19%	0.17%	-1.50%	0.09%
过去一年	-0.55%	0.22%	0.64%	0.17%	-1.19%	0.05%
过去三年	-0.07%	0.19%	-2.45%	0.21%	2.38%	-0.02%
自基金合同生效起至今	16.49%	0.19%	7.11%	0.22%	9.38%	-0.03%

交银安享稳健养老一年 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
过去一个月	-0.43%	0.17%	-0.15%	0.10%	-0.28%	0.07%

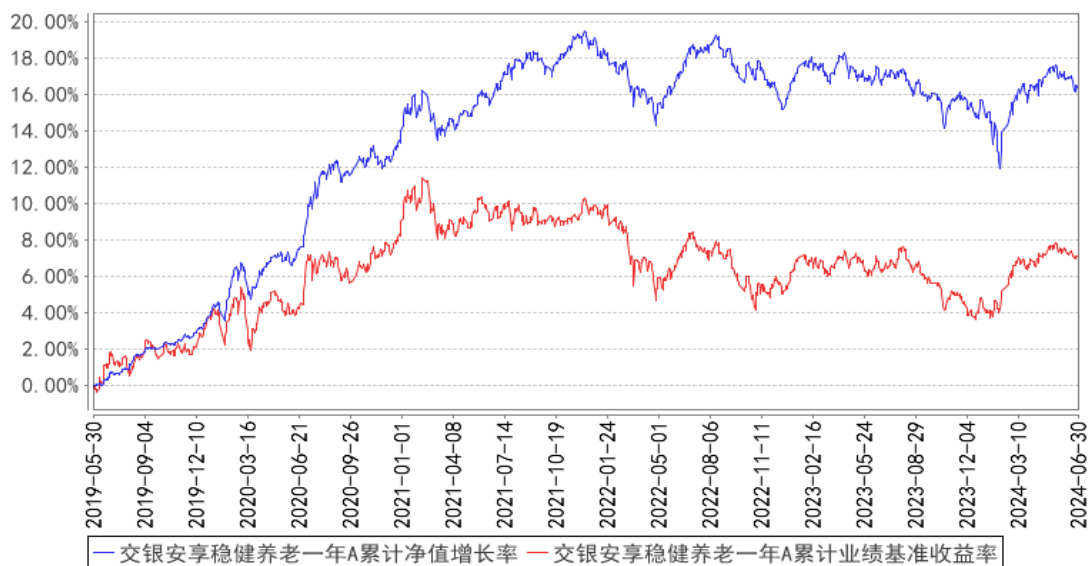
过去三个月	0.28%	0.20%	0.44%	0.14%	-0.16%	0.06%
过去六个月	0.78%	0.26%	2.19%	0.17%	-1.41%	0.09%
过去一年	-0.36%	0.22%	0.64%	0.17%	-1.00%	0.05%
自基金合同生效起至今	-0.39%	0.20%	1.46%	0.17%	-1.85%	0.03%

注：1、本基金的业绩比较基准为 80%×中债综合全价指数收益率+20%×沪深 300 指数收益率，每日进行再平衡过程。

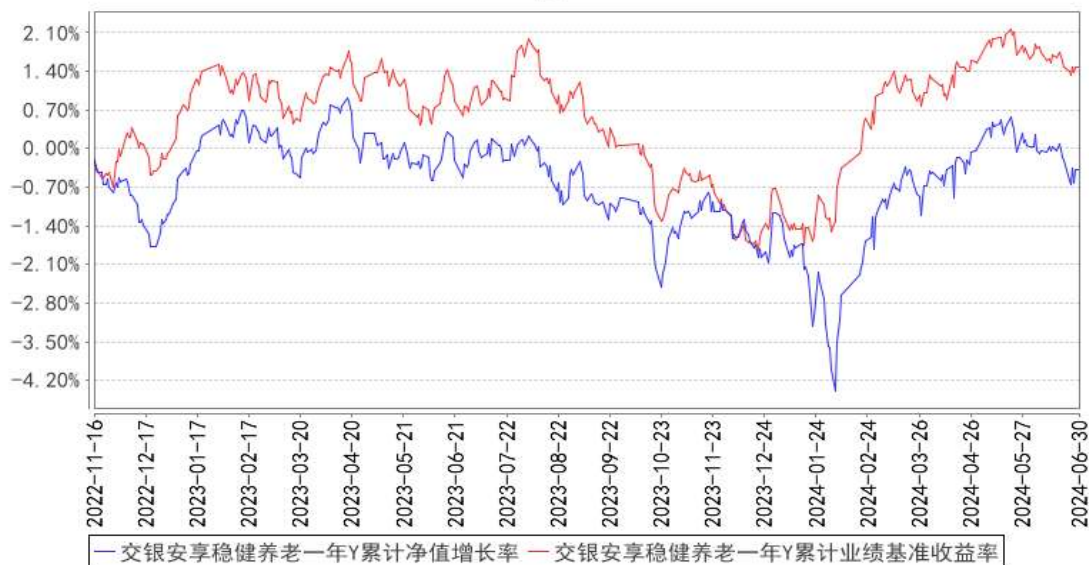
2、交银安享稳健养老一年 Y 上述“自基金合同生效起至今”实际为“自基金份额类别首次确认起至今”，下同。

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

交银安享稳健养老一年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



交银安享稳健养老一年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、本基金建仓期为自基金合同生效日起的 6 个月。截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

2、本基金自 2022 年 11 月 11 日增加 Y 类基金份额，自 2022 年 11 月 16 日起新增有效份额，并于 2022 年 11 月 28 日起面向公众发售。

§ 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

交银施罗德基金管理有限公司是经中国证监会证监基金字[2005]128 号文批准，由交通银行股份有限公司、施罗德投资管理有限公司、中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司共同发起设立。公司成立于 2005 年 8 月 4 日，注册地在中国上海，注册资本为 2 亿元人民币。其中，交通银行股份有限公司持有 65% 的股份，施罗德投资管理有限公司持有 30% 的股份，中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司持有 5% 的股份。公司并下设交银施罗德资产管理有限公司。

截至报告期末，公司管理了包括货币型、债券型、混合型和股票型在内的 130 只基金，其中股票型涵盖普通指数型、交易型开放式（ETF）、QDII 等不同类型基金。

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		
蔡铮	交银安享稳健养老	2021 年 4 月 30 日	-	15 年	蔡铮先生，中国国籍，复旦大学电子工程硕士。历任瑞士银行香港分行分析员。

	一年、交银养老 2035 三年的基金经理，公司量化投资副总监兼多元资产管理副总监				<p>2009 年加入交银施罗德基金管理有限公司，历任投资研究部数量分析师、基金经理助理、量化投资部助理总经理、量化投资部副总经理。2012 年 12 月 27 日至 2015 年 6 月 30 日担任交银施罗德沪深 300 行业分层等权重指数证券投资基金基金经理，2015 年 4 月 22 日至 2017 年 3 月 24 日担任交银施罗德环球精选价值证券投资基金基金经理，2015 年 4 月 22 日至 2017 年 3 月 24 日担任交银施罗德全球自然资源证券投资基金基金经理，2015 年 8 月 13 日至 2016 年 7 月 18 日担任交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金基金经理。2018 年 5 月 18 日至 2020 年 7 月 17 日担任交银施罗德致远量化智投策略定期开放混合型证券投资基金的基金经理。2015 年 6 月 26 日至 2020 年 11 月 25 日担任交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金的基金经理。2015 年 3 月 26 日至 2020 年 11 月 29 日担任交银施罗德德国证新能源指数分级证券投资基金的基金经理。2012 年 12 月 27 日至 2021 年 4 月 29 日担任上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金、交银施罗德上证 180 公司治理交易型开放式证券投资基金联接基金、深证 300 价值交易型开放式指数证券投资基金、交银施罗德深证 300 价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2015 年 5 月 27 日至 2021 年 4 月 29 日担任交银施罗德中证海外中国互联网指数型证券投资基金 (LOF) 的基金的基金经理。2016 年 7 月 19 日至 2021 年 4 月 29 日担任交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2019 年 11 月 20 日至 2021 年 4 月 29 日担任交银施罗德创业板 50 指数型证券投资基金的基金经理。2020 年 11 月 30 日至 2021 年 4 月 29 日担任交银施罗德德国证新能源指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理。</p>
刘兵	交银招享一年混合、交银智选星光混合	2023 年 1 月 7 日	-	8 年	<p>刘兵先生，上海财经大学经济学博士。2016 年加入交银施罗德基金管理有限公司，历任量化投资部研究员、多元资产管理部研究员、投资经理。</p>

	（ FOF-LOF）、交银兴享一年持有期混合（FOF）、交银优享一年持有期混合（FOF）、交银慧选睿信一年持有期混合（FOF）基金中基金、交银安享稳健养老一年、交银养老 2035 三年、交银智选进取三个月持有期混合发起（FOF）、交银安悦平衡养老三年持有期混合发起（FOF）的基金经理以及基金投顾业务投资经理，公司多元资产管理助理总监				
--	---	--	--	--	--

注：1、本表所列基金经理（助理）任职日期和离职日期均以基金合同生效日或公司作出决定并公告(如适用)之日为准。

2、本表所列基金经理（助理）证券从业年限中的“证券从业”的含义遵从中国证券业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3、基金经理（或基金经理小组）期后变动（如有）敬请关注基金管理人发布的相关公告。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，基金整体运作符合有关法律法规和基金合同的规定，为基金持有人谋求最大利益。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本公司制定了严格的投资控制制度和公平交易监控制度来保证旗下基金运作的公平，旗下所管理的所有资产组合，包括证券投资基金和私募资产管理计划均严格遵循制度进行公平交易。

公司建立资源共享的投资研究信息平台，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。公司在交易执行环节实行集中交易制度，建立公平的交易分配制度。对于交易所公开竞价交易，遵循“价格优先、时间优先”的原则，全部通过交易系统进行比例分配；对于非集中竞价交易、以公司名义进行的场外交易，遵循公平交易分配原则对交易结果进行分配。

公司中央交易室和风险管理部进行日常投资交易行为监控，风险管理部负责对各账户公平交易进行事后分析，于每季度和每年度分别对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析，通过分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

报告期内本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内，本公司管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量没有超过该证券当日总成交量 5% 的情形，本基金与本公司管理的其他投资组合在不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）同向交易的交易价差未出现异常。

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

2024 年上半年，国内经济延续修复态势。一季度，GDP 同比增长好于市场预期，但二季度经济略有放缓，且结构性特征显著。其中工业生产维持较高增速，制造业投资呈现一定韧性，出口较为强劲，但地产整体偏弱，居民消费有待提振，通胀和金融数据亦处于低位，当前经济有效需

求仍需进一步提振。海外方面，美国经济动能边际走弱但韧性仍在，通胀延续下行但距离通胀目标仍有距离，美联储上半年维持基准利率不变，美债利率震荡上行，美元指数走强。权益市场方面，上半年权益市场走势一波三折，年初市场在流动性冲击下深度回调，春节前后伴随政策利好和投资者情绪改善，市场全面反弹，三月后市场反弹动能趋弱，叠加退市新规推出等影响，市场震荡下行，四月底受政治局会议、地产政策预期等因素催化，市场风险偏好上升，但五月下旬后伴随基本面数据走弱，市场再度承压。从风格上看，大盘价值和红利风格显著占优，小微盘股深度回调。从行业看，以银行、公用事业和煤炭等为代表的偏防御属性的行业涨幅居前，而传媒和计算机等 TMT 板块以及商贸零售和社会服务等消费行业均迎来大幅调整。债市方面，上半年基本面延续修复，信贷数据相对偏弱，叠加债市资产荒的背景，国债各期限收益率均有所下行，期限利差走扩。信用债方面，整体收益率有所下行，信用利差压缩至历史低位，其中较长久期和中低评级压缩更多，信用下沉趋势明显。

报告期内，本基金密切关注市场动态，通过对基本面、流动性状况、波动率以及股债配置性价比等关键指标的跟踪分析，灵活调整股债仓位和资产内部结构，以应对市场变化。固定收益资产方面，利率下行较多，债市整体偏强，我们维持较高仓位的中长期纯债基金的配置，这类债基整体久期适中、信用为主。同时，鉴于利率债收益率处于低位，我们会持续做好持仓债基的日常风险监控，通过每日净值监测识别异常波动，及时做好固定收益类资产的风险管理。权益资产方面，波动率持续低位震荡，成交活跃度下降，整体上降低医药及制造板块，风格上降低中小盘的暴露，加仓追求绝对收益思路管理的主动权益基金和红利价值类指数基金。作为一个力争实现稳健收益的固收+产品，在过往运作中，存在不少值得提升的地方，尤其是资产配置和权益资产配置上。今后会在这两方面持续改进：资产配置方面，尽可能实现多资产、多策略布局，发挥配置能力，改善投资组合的风险收益比，拓展有效前沿，降低波动风险；权益配置上，更加注重估值层面的因素，力争在市场低位时增加仓位，在实现一定收益后止盈，提升“+”的可能性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金（各类）份额净值及业绩表现请见“3.1 主要会计数据和财务指标”及“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”部分披露。

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 年下半年，当前国内经济仍在修复过程中，前期稳地产、稳消费、推动基建形成实物工作量等政策效果还需跟踪，三季度是重要观察窗口期。与此同时，关注政策定调、发力方向和落地效果对市场信心可能带来的提振作用。海外来看，市场对美联储下半年降息预期较为充分，但考虑到美国大选期间经济和政策走向的不确定性上升，或会对外围风险偏好带来阶段性扰动。

此外，地缘政治的不确定性以及贸易环境恶化等外部风险亦需持续关注。股市方面，短期来看，当前投资者对经济修复预期和政策预期整体偏谨慎，权益市场资金面亦有承压，市场趋势性行情仍待更多积极因素催化，但中长期看，当前权益资产估值较低，A 股配置价值逐步凸显，权益资产仍在布局可为区间。债市方面，考虑到当前利率仍在低位运行，债市波动率或有所上升，接下来需密切关注政策面、资金面以及基本面等债市定价因素的边际变化。未来的投资操作上，我们会继续严密跟踪市场走势和经济形势，做好组合的风险管理，力争给投资者带来更好的持有体验。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人制定了健全、有效的估值政策和程序，经公司管理层批准后实行，并成立了估值委员会，估值委员会成员由研究部、基金运营部、风险管理部等人员和固定收益人员及基金经理组成。

公司严格按照新会计准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定进行估值，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。估值委员会的研究部成员按投资品种的不同性质，研究并参考市场普遍认同的做法，建议合理的估值模型，进行测算和认证，认可后交各估值委员会成员从基金会计、风险、合规等方面审批，一致同意后，报公司投资总监、总经理审批。

估值委员会会定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及其适用性的情况后，及时召开临时会议进行研究，及时修订估值方法，以保证其持续适用。估值委员会成员均具备相应的专业资格及工作经验。基金经理作为估值委员会成员，对本基金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。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，截止报告期末未有与任何外部估值定价服务机构签约。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内无需预警说明。

§ 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——交银施罗德基金管理有限公司 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了

认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：交银施罗德安享稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	164,279,200.11	13,385,895.95
结算备付金		3,421,951.59	1,376,218.71
存出保证金		83,173.68	107,305.02
交易性金融资产	6.4.7.2	4,979,062,851.01	6,729,859,142.07
其中：股票投资		437,476,421.55	370,735,170.30
基金投资		4,415,654,512.02	5,964,118,125.31
债券投资		125,931,917.44	395,005,846.46
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	5,000,000.00	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-

资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		14,777,060.54	9,000,219.96
应收股利		-	-
应收申购款		150,098.42	784,624.40
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	330,635.03	515,139.60
资产总计		5,167,104,970.38	6,755,028,545.71
负债和净资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		954,063.74	-
应付赎回款		61,936,510.31	120,967,647.34
应付管理人报酬		929,180.48	1,248,893.13
应付托管费		688,973.84	878,180.02
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		482.53	1,155.03
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	1,087,366.54	274,116.65
负债合计		65,596,577.44	123,369,992.17
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	4,379,101,544.29	5,732,265,366.62
未分配利润	6.4.7.12	722,406,848.65	899,393,186.92
净资产合计		5,101,508,392.94	6,631,658,553.54
负债和净资产总计		5,167,104,970.38	6,755,028,545.71

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 4,379,101,544.29 份，其中交银安享稳健养老一年 A 基金份额总额 4,309,889,072.61 份，基金份额净值 1.1649 元；交银安享稳健养老一年 Y 基金份额总额 69,212,471.68 份，基金份额净值 1.1690 元。

6.2 利润表

会计主体：交银施罗德安享稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
----	-----	----	---------

		2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		48,878,892.59	163,064,421.21
1. 利息收入		184,196.71	611,600.87
其中：存款利息收入	6.4.7.13	119,447.46	486,393.97
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		64,749.25	125,206.90
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-51,633,950.18	-76,227,622.37
其中：股票投资收益	6.4.7.14	1,649,859.15	-8,850,748.85
基金投资收益	6.4.7.15	-105,683,451.57	-116,017,278.97
债券投资收益	6.4.7.16	1,506,373.45	6,091,979.75
资产支持证券投资	6.4.7.17	-	-
贵金属投资	6.4.7.18	-	-
收益			
衍生工具收益	6.4.7.19	-	-
股利收益	6.4.7.20	50,893,268.79	42,548,425.70
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	97,840,231.92	236,089,933.17
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.22	2,488,414.14	2,590,509.54
减：二、营业总支出		10,834,464.76	21,761,922.54
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	6,035,680.05	13,414,922.92
2. 托管费	6.4.10.2.2	4,553,717.65	8,184,821.76
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		106,496.53	6,019.42
其中：卖出回购金融资产支出		106,496.53	6,019.42
6. 信用减值损失	6.4.7.24	-	-
7. 税金及附加		529.45	575.71
8. 其他费用	6.4.7.25	138,041.08	155,582.73

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		38,044,427.83	141,302,498.67
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		38,044,427.83	141,302,498.67
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		38,044,427.83	141,302,498.67

6.3 净资产变动表

会计主体：交银施罗德安享稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	5,732,265,366.62	-	899,393,186.92	6,631,658,553.54
二、本期期初净资产	5,732,265,366.62	-	899,393,186.92	6,631,658,553.54
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	1,353,163,822.33	-	176,986,338.27	1,530,150,160.60
（一）、综合收益总额	-	-	38,044,427.83	38,044,427.83
（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）	1,353,163,822.33	-	215,030,766.10	1,568,194,588.43
其中：1. 基金申购款	20,915,414.85	-	3,455,920.36	24,371,335.21
2. 基金赎回款	1,374,079,237.18	-	218,486,686.46	1,592,565,923.64
（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	4,379,101,544.29	-	722,406,848.65	5,101,508,392.94
项目	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	10,747,715,143.64	-	1,706,161,081.49	12,453,876,225.13
二、本期期初净资产	10,747,715,143.64	-	1,706,161,081.49	12,453,876,225.13
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	- 3,035,976,809.18	-	- 385,150,898.39	- 3,421,127,707.57
(一)、综合收益总额	-	-	141,302,498.67	141,302,498.67
(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)	- 3,035,976,809.18	-	- 526,453,397.06	- 3,562,430,206.24
其中：1. 基金申购款	61,763,174.60	-	10,683,346.36	72,446,520.96
2. 基金赎回款	- 3,097,739,983.78	-	- 537,136,743.42	- 3,634,876,727.20
(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	7,711,738,334.46	-	1,321,010,183.10	9,032,748,517.56

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

谢卫

基金管理人负责人

印皓

主管会计工作负责人

单江

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

交银施罗德安享稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）（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[2018]2197号《关于准予交银施罗德安享稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）注册的批复》注册，由交银施罗德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《交银施罗德安享稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 2,041,455,334.24 元，业经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）普华永道中天验字（2019）第 0294 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《交银施罗德安享稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》于 2019 年 5 月 30 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,042,809,040.74 份基金份额，其中认购资金利息折合 1,353,706.50 份基金份额。本基金的基金管理人为交银施罗德基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德安享稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）增加 Y 类基金份额并修改基金合同和托管协议的公告》及更新的《交银施罗德安享稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》，自 2022 年 11 月 11 日起，本基金增加 Y 类基金份额。本基金的 Y 类基金份额为针对个人养老金投资基金业务设立的单独的基金份额类别，投资者仅能通过个人养老金资金账户购买 Y 类基金份额参与个人养老金投资基金业务。本基金 A 类基金份额和 Y 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 Y 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《交银施罗德安享稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，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 ETF 和 LOF、香港互认基金、不含 QDII）、国内依法发行上市的股票（含中小板、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（含国债、央行票据、金融债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、企业债券、公司债券、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换债券、次级债券、中期票

据、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(含协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证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。本基金的投资组合比例为:本基金投资于公开募集证券投资基金的基金份额的资产不低于本基金资产的 80%,其中投资于股票(含存托凭证)、股票型基金(包括股票指数基金)、混合型基金和商品基金(含商品期货基金和黄金 ETF)等品种的比例合计占基金资产的 0%-30%;本基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金投资于权益类资产(包括股票(含存托凭证)、股票型基金、混合型基金)的战略配置目标比例为 25%,投资比例为基金资产的 15%-30%。其中混合型基金需符合下列两个条件之一:1、基金合同中明确约定股票投资占基金资产的比例为 50%以上;2、最近 4 个季度披露的股票投资占基金资产的比例均在 50%以上的混合型基金。本基金的业绩比较基准为:80%x 中债综合全价指数收益率+20%x 沪深 300 指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人交银施罗德基金管理有限公司于 2024 年 8 月 30 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《交银施罗德安享稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2024 年上半年度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 2024 年 06 月 30 日的财务状况以及 2024 年上半年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《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》、财税[2015]101 号《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》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《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》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《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》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对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，股票的股息、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) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，

解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 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。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	164,279,200.11
等于：本金	164,258,497.86
加：应计利息	20,702.25
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	164,279,200.11

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	473,487,963.91	-	437,476,421.55	-36,011,542.36
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债 交易所	124,377,589.38	1,482,016.28	125,931,917.44	72,311.78

券	市场				
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	124,377,589.38	1,482,016.28	125,931,917.44	72,311.78
资产支持证券		-	-	-	-
基金		4,231,387,624.82	-	4,415,654,512.02	184,266,887.20
其他		-	-	-	-
合计		4,829,253,178.11	1,482,016.28	4,979,062,851.01	148,327,656.62

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	5,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	5,000,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应收利息	-
其他应收款	330,635.03
待摊费用	-
合计	330,635.03

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	983,412.64
其中：交易所市场	983,412.64
银行间市场	-
应付利息	-
预提审计费	39,781.56
预提信息披露费	59,672.34
预提账户维护费	4,500.00
合计	1,087,366.54

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

交银安享稳健养老一年 A

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
----	----------------------------

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,662,657,555.16	5,662,657,555.16
本期申购	13,627,801.74	13,627,801.74
本期赎回（以“-”号填列）	-1,366,396,284.29	-1,366,396,284.29
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	4,309,889,072.61	4,309,889,072.61

交银安享稳健养老一年 Y

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	69,607,811.46	69,607,811.46
本期申购	7,287,613.11	7,287,613.11
本期赎回（以“-”号填列）	-7,682,952.89	-7,682,952.89
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	69,212,471.68	69,212,471.68

注：1、如果本报告期间发生红利再投、转换入业务，则总申购份额中包含该业务；

2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

交银安享稳健养老一年 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	629,378,189.27	258,884,624.39	888,262,813.66
本期期初	629,378,189.27	258,884,624.39	888,262,813.66
本期利润	-59,167,041.83	96,549,920.51	37,382,878.68
本期基金份额交易产生的变动数	-133,396,860.94	-81,541,042.92	-214,937,903.86
其中：基金申购款	1,320,486.46	988,343.60	2,308,830.06
基金赎回款	-134,717,347.40	-82,529,386.52	-217,246,733.92
本期已分配利润	-	-	-
本期末	436,814,286.50	273,893,501.98	710,707,788.48

交银安享稳健养老一年 Y

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	7,915,498.72	3,214,874.54	11,130,373.26

本期期初	7,915,498.72	3,214,874.54	11,130,373.26
本期利润	-628,762.26	1,290,311.41	661,549.15
本期基金份额交易产生的变动数	-21,890.39	-70,971.85	-92,862.24
其中：基金申购款	760,150.25	386,940.05	1,147,090.30
基金赎回款	-782,040.64	-457,911.90	-1,239,952.54
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,264,846.07	4,434,214.10	11,699,060.17

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	105,190.28
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	13,749.97
其他	507.21
合计	119,447.46

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	1,649,859.15
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	1,649,859.15

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	647,036,751.59
减：卖出股票成本总额	643,971,202.12
减：交易费用	1,415,690.32
买卖股票差价收入	1,649,859.15

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	2,149,441,064.24
减：卖出/赎回基金成本总额	2,254,889,467.33
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	-
减：交易费用	235,048.48
基金投资收益	-105,683,451.57

6.4.7.16 债券投资收益**6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	2,999,366.64
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-1,492,993.19
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	1,506,373.45

6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	337,559,048.29
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	332,563,560.44
减：应计利息总额	6,486,483.91
减：交易费用	1,997.13
买卖债券差价收入	-1,492,993.19

6.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 资产支持证券投资收益

6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 贵金属投资收益

6.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.19 衍生工具收益

6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	6,212,551.27
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	44,680,717.52
合计	50,893,268.79

6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	97,840,231.92
股票投资	-9,200,722.54
债券投资	493,749.14
资产支持证券投资	-
基金投资	106,547,205.32
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	97,840,231.92

6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
销售服务费返还	2,488,414.14
合计	2,488,414.14

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2、本基金的赎回费收入包括转换费收入，其中转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的不低于赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.23 持有基金产生的费用

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	3,677,704.73
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	13,413,472.92
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	3,563,775.92

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。

6.4.7.24 信用减值损失

无。

6.4.7.25 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	39,781.56
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	29,587.18
债券账户费用	9,000.00
合计	138,041.08

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
交银施罗德基金管理有限公司（“交银施罗德基金公司”）	基金管理人、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
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金管理人的股东、基金销售机构
施罗德投资管理有限公司	基金管理人的股东
中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司	基金管理人的股东
交银施罗德资产管理有限公司	基金管理人的子公司
上海直源投资管理有限公司	受基金管理人控制的公司

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。

本报告期实际与基金发生关联交易的关联方及关联交易具体情况请见下述内容。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 基金交易

无。

6.4.10.1.5 权证交易

无。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	6,035,680.05	13,414,922.92
其中：应支付销售机构的客户维护费	3,151,729.94	6,844,237.00
应支付基金管理人的净管理费	2,883,950.11	6,570,685.92

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。支付基金管理人的管理人报酬按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的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。A类基金份额和Y类基金份额约定的年管理费率分别为0.6%和0.3%。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日A/Y类基金份额的基金资产净值扣除该类基金份额持有的基金管理人管理的其他基金部分后的余额×约定年费率/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	4,553,717.65	8,184,821.76

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。支付基金托管人的托管费按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的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。A类基金份额和Y类基金份额约定的年托管费率分别为0.2%和0.1%。其计算公式为：

日托管人报酬=前一日 A/Y 类基金份额的基金资产净值扣除该类基金份额持有的基金托管人托管的其他基金部分后的余额×约定年费率/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月 30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行_活期存款	164,279,200.11	105,190.28	113,351,389.74	463,964.46

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，存款利率参考银行同业利率及银行存款利率确定。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

于2024年06月30日，本基金持有基金管理人所管理的公开募集证券投资基金合计3,248,988,122.22元，占本基金资产净值的比例为63.69%。

6.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 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）	82,757.42	181,504.78
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	2,482,512.76	2,594,053.43
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	9,233,942.98	19,875,578.36
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	2,695,759.67	5,219,866.58
当期交易基金产生的交易费（元）	-	-
当期交易基金产生的转换费（元）	21,826.01	184,738.11

注：本基金申购、赎回本基金的基金管理人管理的其他基金（ETF 除外），应当通过基金管理人的直销渠道且不得收取申购费、赎回费（按规定应当收取并记入被投资基金其他收入部分的赎回费除外）、销售服务等销售费用。相关申购费、赎回费由基金管理人直接减免，故当期交易基金产生的申购费为零，当期交易基金产生的赎回费仅为按规定应当收取并记入被投资基金其他收入部分的赎回费。相关销售服务费已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，由基金管理人从被投资基金收取后向本基金返还，当期持有基金产生的应支付销售服务费为管理人当期应向本基金返还的销售服务费，相关披露金额根据本基金对被投资基金的实际持仓、被投资基金的基金合同约定的费率和方法估算。当期持有基金产生的应支付管理费、当期持有基金产生的应支付托管费已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，相关披露金额根据本基金对被投资基金的实际持仓、被投资基金的基金合同约定的费率和方法估算。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001359	平	2024	6 个月	限售	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	-

	安电 工	年 3 月 19 日	以上	股						
001379	腾达 科技	2024 年 1 月 11 日	6 个月 以上	限售 股	16.98	13.48	213	3,616.74	2,871.24	-
001387	雪祺 电气	2024 年 1 月 4 日	6 个月 以上	限售 股	15.38	15.25	133	2,045.54	2,028.25	-
001387	雪祺 电气	2024 年 6 月 3 日	1-6 个 月 (含)	限售 股送 股	-	15.25	40	-	610.00	-
001389	广合 科技	2024 年 3 月 26 日	6 个月 以上	限售 股	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-
301392	汇成 真空	2024 年 5 月 28 日	6 个月 以上	限售 股	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
301502	华阳 智能	2024 年 1 月 26 日	6 个月 以上	限售 股	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-
301536	星辰 科技	2024 年 3 月 20 日	6 个月 以上	限售 股	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-
301538	骏鼎 达	2024 年 3 月 13 日	6 个月 以上	限售 股	55.82	91.24	107	5,972.74	9,762.68	-
301538	骏鼎 达	2024 年 5 月 22 日	1-6 个 月 (含)	限售 股送 股	-	91.24	43	-	3,923.32	-
301539	宏鑫 科技	2024 年 4 月 3 日	6 个月 以上	限售 股	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-
301565	中	2024	6 个月	限售	11.88	18.98	711	8,446.68	13,494.78	-

	仑新材	年6月13日	以上	股							
301566	达利凯普	2023年12月22日	6个月以上	限售股	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-	
301580	爱迪特	2024年6月19日	6个月以上	限售股	44.95	65.93	202	9,079.90	13,317.86	-	
301587	中瑞股份	2024年3月27日	6个月以上	限售股	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-	
301588	美新科技	2024年3月6日	6个月以上	限售股	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-	
301589	诺瓦星云	2024年2月1日	6个月以上	限售股	126.89	188.01	691	87,680.99	129,914.91	-	
301589	诺瓦星云	2024年5月30日	1-6个月(含)	限售股送股	-	188.01	553	-	103,969.53	-	
301591	肯特股份	2024年2月20日	6个月以上	限售股	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-	
601033	永兴股份	2024年1月11日	6个月以上	限售股	16.20	15.96	1,258	20,379.60	20,077.68	-	
603082	北自科技	2024年1月23日	6个月以上	限售股	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-	
603285	键邦股份	2024年6月28日	6个月以上	限售股	18.65	18.65	129	2,405.85	2,405.85	-	
603285	键	2024	1个月	新股	18.65	18.65	1,158	21,596.70	21,596.70	-	

	邦股份	年6月28日	内(含)	未上市						
603312	西典新能	2024年1月4日	6个月以上	限售股	29.02	25.36	130	3,772.60	3,296.80	-
603325	博隆技术	2024年1月3日	6个月以上	限售股	72.46	68.06	66	4,782.36	4,491.96	-
603341	龙旗科技	2024年2月23日	6个月以上	限售股	26.00	37.49	298	7,748.00	11,172.02	-
603344	星德胜	2024年3月13日	6个月以上	限售股	19.18	22.66	182	3,490.76	4,124.12	-
603350	安乃达	2024年6月26日	1个月内(含)	新股未上市	20.56	20.56	945	19,429.20	19,429.20	-
603350	安乃达	2024年6月26日	6个月以上	限售股	20.56	20.56	106	2,179.36	2,179.36	-
603375	盛景微	2024年1月17日	6个月以上	限售股	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	-
603381	永臻股份	2024年6月19日	6个月以上	限售股	23.35	25.13	178	4,156.30	4,473.14	-
688691	灿芯股份	2024年4月2日	6个月以上	限售股	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-
688692	达梦数据	2024年6月4日	6个月以上	限售股	86.96	174.93	175	15,218.00	30,612.75	-
688695	中	2024	6个月	限售	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-

	创 股 份	年 3 月 6 日	以 上	股						
688709	成 都 华 微	2024 年 1 月 31 日	6 个 月 以 上	限 售 股	15.69	18.79	1,045	16,396.05	19,635.55	-

注：1、基金可作为特定投资者，参与上市公司非公开发行股份认购，交易所主板、创业板、科创板新股申购，通过大宗交易或其他符合法律法规的交易方式取得带限售期的股票等业务，并根据各项法律法规的要求进行锁定；

2、上表所披露的受限期指自该证券实际取得之日起至可流通日之间的受限期限。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金中基金，由于本基金主要投资于公开募集证券投资基金的基金份额，持有基金的预期风险和预期收益间接成为本基金的预期风险和预期收益。本基金的预期风险与预期收益高于债券型基金、债券型基金中基金、货币市场基金和货币型基金中基金，低于股票型基金和股票型基金中基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，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 ETF 和 LOF、香港互认基金、不含 QDII）、国内依法发行上市的股票（含中小板、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（含国债、央行票据、金融债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、企业债券、公司债券、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换债券、次级债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（含协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、权证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)。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制再限定的范围之内，本基金主要投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金的基金份额，在控制风险并保持基金资产良好的流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值，满足养老资金理财需求。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立合规审核及风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由风险管理部负责协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。风险管理部对公司总经理负责。督察长独立行使督察权利，直接对董事会负责，就内部控制制度和执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能，定期和不定期地向董事会报告公司内部控制执行情况。

本基金的基金管理人建立了以合规审核及风险管理委员会为核心的，由督察长、风险控制委员会、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

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。

6.4.13.2 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同责任，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，因而与该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，在场外申赎基金份额均通过该基金的基金管理人的直销柜台办理，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，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2024 年 6 月 30 日，本基金持有除国债、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 0.39%（2023 年 12 月 31 日：0.46%）。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指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在基金最短持有期限到期日起（含当日）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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。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。

于 2024 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

注：流动性受限资产、7 个工作日可变现资产的计算口径见《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》第四十条。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《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》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金持有单只基金的市值，不高于本基金资产净值的 20%，且不持有其他基金中基金。本基金的基金管理人管理的全部基金中基金（ETF 联接基金除外）持有单只基金不超过被投资基金净资产的 20%，被投资基金净资产规模以最近定期报告披露的规模为准。本基金投资于一家公司发行的证券（不含本基金所投资的基金份额）市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券（不含本基金所投资的基金份额）不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在基金销售机构申购、赎回，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。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投资的公允价值。在本基金开放日，本基金投资于流通受限基金不高于本基金资产净值的 10%；本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

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

而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指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。

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	164,279,200.11	-	-	-	164,279,200.11
结算备付金	3,421,951.59	-	-	-	3,421,951.59
存出保证金	83,173.68	-	-	-	83,173.68
交易性金融资产	106,252,795.92	18,832,383.88	846,737.64	4,853,130,933.57	4,979,062,851.01
买入返售金融资产	5,000,000.00	-	-	-	5,000,000.00
应收申购款	0.01	-	-	150,098.41	150,098.42
应收清算款	-	-	-	14,777,060.54	14,777,060.54
其他资产	-	-	-	330,635.03	330,635.03
资产总计	279,037,121.31	18,832,383.88	846,737.64	4,868,388,727.55	5,167,104,970.38
负债					
应付赎回款	-	-	-	61,936,510.31	61,936,510.31
应付管理人报酬	-	-	-	929,180.48	929,180.48
应付托管费	-	-	-	688,973.84	688,973.84
应付清算款	-	-	-	954,063.74	954,063.74
应交税费	-	-	-	482.53	482.53
其他负债	-	-	-	1,087,366.54	1,087,366.54
负债总计	-	-	-	65,596,577.44	65,596,577.44
利率敏感度缺口	279,037,121.31	18,832,383.88	846,737.64	4,802,792,150.11	5,101,508,392.94
上年度末 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	13,385,895.95	-	-	-	13,385,895.95
结算备付金	1,376,218.71	-	-	-	1,376,218.71
存出保证金	107,305.02	-	-	-	107,305.02

交易性金融资产	364,926,777.69	28,934,984.47	1,144,084.30	6,334,853,295.61	6,729,859,142.07
应收申购款	21,001.27	-	-	763,623.13	784,624.40
应收清算款	-	-	-	9,000,219.96	9,000,219.96
其他资产	-	-	-	515,139.60	515,139.60
资产总计	379,817,198.64	28,934,984.47	1,144,084.30	6,345,132,278.30	6,755,028,545.71
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	120,967,647.34	120,967,647.34
应付管理人报酬	-	-	-	1,248,893.13	1,248,893.13
应付托管费	-	-	-	878,180.02	878,180.02
应交税费	-	-	-	1,155.03	1,155.03
其他负债	-	-	-	274,116.65	274,116.65
负债总计	-	-	-	123,369,992.17	123,369,992.17
利率敏感度缺口	379,817,198.64	28,934,984.47	1,144,084.30	6,221,762,286.13	6,631,658,553.54

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2024 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 2.47% (2023 年 12 月 31 日：5.96%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2023 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险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。本基金主要投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金份额、证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的其他价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中：本基金投资于公开募

集证券投资基金的基金份额的资产不低于本基金资产的 80%，其中投资于股票（含存托凭证）、股票型基金（包括股票指数基金）、混合型基金和商品基金（含商品期货基金和黄金 ETF）等品种的比例合计占基金资产的 0%-30%。本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金投资于权益类资产（包括股票（含存托凭证）、股票型基金、混合型基金）的战略配置目标比例为 25%，投资比例为基金资产的 15%-30%。其中混合型基金需符合下列两个条件之一：1、基金合同中明确约定股票投资占基金资产的比例为 50%以上；2、最近 4 个季度披露的股票投资占基金资产的比例均在 50%以上的混合型基金。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	437,476,421.55	8.58	370,735,170.30	5.59
交易性金融资产—基金投资	4,415,654,512.02	86.56	5,964,118,125.31	89.93
交易性金融资产—债券投资	20,090,360.74	0.39	30,741,793.23	0.46
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	4,873,221,294.31	95.53	6,365,595,088.84	95.99

注：债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 6.4.1)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（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）

	1. 业绩比较基准上 涨 5%	261, 894, 958. 96	294, 295, 295. 18
	2. 业绩比较基准下 降 5%	-261, 894, 958. 96	-294, 295, 295. 18

6. 4. 14 公允价值

6. 4. 14. 1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6. 4. 14. 2 持续的以公允价值计量的金融工具

6. 4. 14. 2. 1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	4, 872, 585, 473. 17	6, 363, 719, 763. 73
第二层次	106, 007, 503. 63	365, 102, 866. 45
第三层次	469, 874. 21	1, 036, 511. 89
合计	4, 979, 062, 851. 01	6, 729, 859, 142. 07

6. 4. 14. 2. 2 公允价值所属层次间的重大变动

无。

6. 4. 14. 3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

6. 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、买入返售金融资产、应收款项、卖出回购金融资产款和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6. 4. 15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	437,476,421.55	8.47
	其中：股票	437,476,421.55	8.47
2	基金投资	4,415,654,512.02	85.46
3	固定收益投资	125,931,917.44	2.44
	其中：债券	125,931,917.44	2.44
	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	5,000,000.00	0.10
	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	167,701,151.70	3.25
8	其他各项资产	15,340,967.67	0.30
9	合计	5,167,104,970.38	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	43,072,492.00	0.84
C	制造业	320,781,457.81	6.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,336,682.00	0.22
E	建筑业	5,492,777.48	0.11
F	批发和零售业	10,268,063.84	0.20
G	交通运输、仓储和邮政业	3,504,819.00	0.07
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	23,417,506.62	0.46
J	金融业	4,425,315.00	0.09
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,305,689.12	0.06
M	科学研究和技术服务业	442,897.00	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	2,666,501.68	0.05

0	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	8,762,220.00	0.17
S	综合	-	-
	合计	437,476,421.55	8.58

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	603993	洛阳钼业	3,779,400	32,124,900.00	0.63
2	600660	福耀玻璃	349,700	16,750,630.00	0.33
3	600096	云天化	855,600	16,615,752.00	0.33
4	001309	德明利	179,150	15,478,560.00	0.30
5	300002	神州泰岳	1,795,200	14,577,024.00	0.29
6	002532	天山铝业	1,750,000	14,192,500.00	0.28
7	600066	宇通客车	544,200	14,040,360.00	0.28
8	601058	赛轮轮胎	956,950	13,397,300.00	0.26
9	300857	协创数据	217,500	12,397,500.00	0.24
10	600183	生益科技	584,700	12,313,782.00	0.24
11	002601	龙佰集团	577,800	10,729,746.00	0.21
12	002008	大族激光	462,300	9,615,840.00	0.19
13	603160	汇顶科技	134,762	9,264,887.50	0.18
14	300724	捷佳伟创	165,600	8,944,056.00	0.18
15	002128	电投能源	405,100	8,547,610.00	0.17
16	300251	光线传媒	925,200	7,780,932.00	0.15
17	603379	三美股份	172,000	6,732,080.00	0.13
18	300679	电连技术	163,000	6,557,490.00	0.13
19	001207	联科科技	404,900	5,879,148.00	0.12
20	600900	长江电力	200,000	5,784,000.00	0.11
21	002215	诺普信	766,500	5,710,425.00	0.11
22	300842	帝科股份	142,800	5,540,640.00	0.11
23	300783	三只松鼠	233,000	5,095,710.00	0.10
24	300428	立中集团	254,100	4,723,719.00	0.09
25	688766	普冉股份	41,300	4,013,121.00	0.08
26	300054	鼎龙股份	171,900	3,898,692.00	0.08
27	600315	上海家化	208,900	3,714,242.00	0.07
28	688253	英诺特	86,400	3,292,704.00	0.06
29	301567	贝隆精密	57,700	2,564,188.00	0.05

30	002380	科远智慧	137,600	2,518,080.00	0.05
31	600674	川投能源	130,000	2,437,500.00	0.05
32	003025	思进智能	188,200	2,316,742.00	0.05
33	301128	强瑞技术	56,600	2,252,680.00	0.04
34	688065	凯赛生物	48,500	2,201,415.00	0.04
35	301233	盛帮股份	57,000	2,167,140.00	0.04
36	300493	润欣科技	237,600	1,922,184.00	0.04
37	301280	珠城科技	48,300	1,874,040.00	0.04
38	002025	航天电器	39,200	1,818,096.00	0.04
39	605289	罗曼股份	71,300	1,811,020.00	0.04
40	300295	三六五网	200,400	1,799,592.00	0.04
41	300423	昇辉科技	309,100	1,718,596.00	0.03
42	601117	中国化学	206,700	1,703,208.00	0.03
43	002179	中航光电	44,100	1,678,005.00	0.03
44	002864	盘龙药业	64,100	1,658,908.00	0.03
45	600150	中国船舶	40,100	1,632,471.00	0.03
46	301161	唯万密封	105,100	1,632,203.00	0.03
47	002371	北方华创	5,100	1,631,439.00	0.03
48	301122	采纳股份	86,500	1,628,795.00	0.03
49	301045	天禄科技	84,300	1,606,758.00	0.03
50	002083	孚日股份	376,100	1,590,903.00	0.03
51	600697	欧亚集团	156,700	1,574,835.00	0.03
52	000768	中航西飞	65,000	1,561,950.00	0.03
53	300193	佳士科技	207,900	1,542,618.00	0.03
54	601669	中国电建	274,972	1,537,093.48	0.03
55	600011	华能国际	158,700	1,526,694.00	0.03
56	600372	中航机载	127,200	1,522,584.00	0.03
57	002142	宁波银行	69,000	1,522,140.00	0.03
58	600862	中航高科	79,800	1,498,644.00	0.03
59	600050	中国联通	317,600	1,492,720.00	0.03
60	688122	西部超导	38,600	1,479,152.00	0.03
61	688012	中微公司	10,100	1,426,726.00	0.03
62	300421	力星股份	155,520	1,426,118.40	0.03
63	603601	再升科技	515,000	1,421,400.00	0.03
64	600547	XD 山东黄	51,600	1,412,808.00	0.03
65	600482	中国动力	72,500	1,412,300.00	0.03
66	600085	同仁堂	36,800	1,406,128.00	0.03
67	300909	汇创达	62,000	1,385,080.00	0.03
68	002534	西子洁能	138,000	1,381,380.00	0.03
69	605128	上海沿浦	47,508	1,324,998.12	0.03
70	601688	华泰证券	105,100	1,302,189.00	0.03
71	688169	石头科技	3,300	1,295,580.00	0.03
72	600004	白云机场	136,600	1,294,968.00	0.03

73	688533	上声电子	48,800	1,262,456.00	0.02
74	603165	荣晟环保	118,200	1,255,284.00	0.02
75	301063	海锅股份	87,500	1,254,750.00	0.02
76	600009	上海机场	38,900	1,254,525.00	0.02
77	002049	紫光国微	23,300	1,225,580.00	0.02
78	603558	健盛集团	122,500	1,218,875.00	0.02
79	603173	福斯达	54,100	1,174,511.00	0.02
80	300801	泰和科技	77,800	1,170,890.00	0.02
81	002860	星帅尔	139,300	1,140,867.00	0.02
82	300831	派瑞股份	100,000	1,131,000.00	0.02
83	000661	长春高新	12,200	1,119,594.00	0.02
84	000905	厦门港务	195,600	1,105,140.00	0.02
85	688087	XD 英科再	42,700	1,105,076.00	0.02
86	601888	中国中免	17,500	1,093,575.00	0.02
87	603338	浙江鼎力	17,600	1,063,392.00	0.02
88	002129	TCL 中环	122,600	1,060,490.00	0.02
89	002752	昇兴股份	209,200	1,058,552.00	0.02
90	301129	瑞纳智能	41,800	1,055,032.00	0.02
91	605166	聚合顺	99,400	1,042,706.00	0.02
92	300543	朗科智能	123,900	991,200.00	0.02
93	300651	金陵体育	81,600	988,992.00	0.02
94	000975	银泰黄金	60,600	987,174.00	0.02
95	603216	梦天家居	107,000	982,260.00	0.02
96	601801	皖新传媒	141,600	981,288.00	0.02
97	300662	科锐国际	60,800	980,704.00	0.02
98	301102	兆讯传媒	82,900	977,391.00	0.02
99	301033	迈普医学	24,900	973,839.00	0.02
100	002152	广电运通	91,400	956,044.00	0.02
101	601966	玲珑轮胎	52,000	955,240.00	0.02
102	002918	蒙娜丽莎	104,800	949,488.00	0.02
103	300652	雷迪克	47,400	939,942.00	0.02
104	300986	志特新材	138,300	936,291.00	0.02
105	300817	双飞集团	88,000	934,560.00	0.02
106	001222	源飞宠物	75,300	922,425.00	0.02
107	688213	思特威	18,900	916,650.00	0.02
108	002637	赞宇科技	105,000	888,300.00	0.02
109	300631	久吾高科	45,900	878,985.00	0.02
110	605155	西大门	95,340	872,361.00	0.02
111	603380	易德龙	43,100	865,448.00	0.02
112	300915	海融科技	32,800	857,392.00	0.02
113	600535	天士力	67,900	854,182.00	0.02
114	002558	巨人网络	90,400	853,376.00	0.02
115	000598	兴蓉环境	110,200	828,704.00	0.02

116	605388	均瑶健康	150,780	826,274.40	0.02
117	300948	冠中生态	91,500	809,775.00	0.02
118	301181	标榜股份	34,900	791,532.00	0.02
119	603676	卫信康	97,300	779,373.00	0.02
120	603755	日辰股份	33,500	774,855.00	0.02
121	301011	华立科技	50,200	773,582.00	0.02
122	002034	旺能环境	58,400	759,784.00	0.01
123	688093	世华科技	41,300	750,421.00	0.01
124	688181	八亿时空	39,600	750,420.00	0.01
125	688080	映翰通	24,300	737,019.00	0.01
126	603535	嘉诚国际	44,900	724,686.00	0.01
127	688219	会通股份	92,500	718,725.00	0.01
128	603201	常润股份	29,660	717,772.00	0.01
129	002998	优彩资源	125,300	710,451.00	0.01
130	300021	大禹节水	214,400	707,520.00	0.01
131	301296	新巨丰	94,100	678,461.00	0.01
132	301272	英华特	17,500	675,150.00	0.01
133	301003	江苏博云	30,800	662,508.00	0.01
134	688468	科美诊断	104,400	660,852.00	0.01
135	688361	中科飞测	13,900	657,470.00	0.01
136	603059	倍加洁	33,300	657,342.00	0.01
137	300632	光莆股份	65,300	649,735.00	0.01
138	688798	艾为电子	11,100	628,482.00	0.01
139	688517	金冠电气	44,900	627,702.00	0.01
140	603150	万朗磁塑	24,500	613,480.00	0.01
141	301276	嘉曼服饰	28,864	604,989.44	0.01
142	603385	惠达卫浴	109,300	600,057.00	0.01
143	300829	金丹科技	41,300	598,024.00	0.01
144	003033	征和工业	25,800	597,786.00	0.01
145	301196	唯科科技	19,700	581,741.00	0.01
146	600628	新世界	105,202	570,194.84	0.01
147	688630	芯碁微装	9,000	563,130.00	0.01
148	688132	邦彦技术	32,300	560,405.00	0.01
149	603856	东宏股份	54,200	551,756.00	0.01
150	301153	中科江南	19,260	544,287.60	0.01
151	002674	兴业科技	52,500	536,550.00	0.01
152	603180	金牌家居	27,200	519,792.00	0.01
153	603808	歌力思	81,000	512,730.00	0.01
154	688239	航宇科技	14,600	508,080.00	0.01
155	301287	康力源	18,600	495,690.00	0.01
156	688480	赛恩斯	17,400	484,764.00	0.01
157	688330	宏力达	23,700	483,243.00	0.01
158	000055	方大集团	135,150	473,025.00	0.01

159	688231	隆达股份	33,000	470,580.00	0.01
160	688156	路德环境	35,100	464,373.00	0.01
161	688398	赛特新材	26,100	458,838.00	0.01
162	300102	乾照光电	69,300	444,906.00	0.01
163	605189	富春染织	41,600	443,456.00	0.01
164	301365	矩阵股份	40,300	442,897.00	0.01
165	688237	超卓航科	21,700	435,085.00	0.01
166	688267	中触媒	21,900	434,934.00	0.01
167	603181	皇马科技	48,300	434,217.00	0.01
168	300371	汇中股份	51,600	431,892.00	0.01
169	300130	新国都	25,800	429,312.00	0.01
170	300955	嘉亨家化	33,400	423,178.00	0.01
171	605339	南侨食品	28,700	408,114.00	0.01
172	605033	美邦股份	31,700	393,714.00	0.01
173	688589	力合微	15,600	393,276.00	0.01
174	301193	家联科技	22,920	365,803.20	0.01
175	688393	安必平	23,800	364,854.00	0.01
176	688273	麦澜德	17,400	344,520.00	0.01
177	300272	开能健康	69,700	341,530.00	0.01
178	688338	赛科希德	15,600	337,740.00	0.01
179	688332	中科蓝讯	5,700	336,243.00	0.01
180	688021	奥福环保	35,000	322,000.00	0.01
181	688153	唯捷创芯	8,500	314,500.00	0.01
182	601601	中国太保	10,700	298,102.00	0.01
183	688633	星球石墨	14,980	280,875.00	0.01
184	601838	成都银行	18,300	277,977.00	0.01
185	688291	金橙子	16,000	275,520.00	0.01
186	603408	建霖家居	20,800	274,352.00	0.01
187	601998	中信银行	40,200	269,340.00	0.01
188	002966	苏州银行	34,900	261,750.00	0.01
189	600901	江苏金租	51,440	259,772.00	0.01
190	600057	厦门象屿	37,000	251,600.00	0.00
191	688656	浩欧博	10,500	240,765.00	0.00
192	600919	江苏银行	31,500	234,045.00	0.00
193	301589	诺瓦星云	1,244	233,884.44	0.00
194	002930	宏川智慧	18,600	230,640.00	0.00
195	688618	三旺通信	9,176	229,675.28	0.00
196	600502	安徽建工	51,900	223,170.00	0.00
197	000090	天健集团	54,300	218,286.00	0.00
198	301108	洁雅股份	8,600	209,066.00	0.00
199	688466	金科环境	15,100	179,992.00	0.00
200	301097	天益医疗	4,200	158,088.00	0.00
201	688692	达梦数据	175	30,612.75	0.00

202	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.00
203	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.00
204	601033	永兴股份	1,258	20,077.68	0.00
205	688709	成都华微	1,045	19,635.55	0.00
206	301536	星辰科技	481	15,521.87	0.00
207	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
208	301565	中仑新材	711	13,494.78	0.00
209	301580	爱迪特	202	13,317.86	0.00
210	603341	龙旗科技	298	11,172.02	0.00
211	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
212	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
213	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
214	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
215	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
216	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
217	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
218	301578	辰奕智能	153	6,054.21	0.00
219	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
220	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
221	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
222	603325	博隆技术	66	4,491.96	0.00
223	603381	永臻股份	178	4,473.14	0.00
224	603344	星德胜	182	4,124.12	0.00
225	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
226	001326	联域股份	99	3,550.14	0.00
227	603004	鼎龙科技	195	3,305.25	0.00
228	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
229	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
230	001379	腾达科技	213	2,871.24	0.00
231	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00
232	603231	索宝蛋白	161	2,743.44	0.00
233	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00
234	001358	兴欣新材	122	2,503.44	0.00
235	603373	安邦护卫	88	2,419.12	0.00
236	688006	杭可科技	117	2,041.65	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	603993	洛阳钼业	32,194,287.00	0.49
2	601058	赛轮轮胎	18,863,311.00	0.28
3	600096	云天化	18,396,472.00	0.28

4	001309	德明利	17,875,292.00	0.27
5	600660	福耀玻璃	17,727,782.00	0.27
6	002171	楚江新材	17,614,797.00	0.27
7	300002	神州泰岳	16,844,832.00	0.25
8	600737	中粮糖业	16,066,739.00	0.24
9	300857	协创数据	13,590,193.00	0.20
10	002532	天山铝业	13,542,562.00	0.20
11	002601	龙佰集团	12,620,405.50	0.19
12	601137	博威合金	11,646,266.00	0.18
13	300724	捷佳伟创	11,522,584.00	0.17
14	600183	生益科技	11,477,507.65	0.17
15	603383	顶点软件	11,414,910.00	0.17
16	603338	浙江鼎力	10,839,680.45	0.16
17	600066	宇通客车	10,737,824.00	0.16
18	600642	申能股份	10,055,610.00	0.15
19	002008	大族激光	9,889,198.00	0.15
20	600157	永泰能源	9,405,031.00	0.14

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

7.4.2 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	600900	长江电力	19,434,012.00	0.29
2	000786	北新建材	18,520,952.92	0.28
3	601137	博威合金	16,489,023.72	0.25
4	002171	楚江新材	16,475,947.00	0.25
5	600737	中粮糖业	16,350,609.50	0.25
6	601058	赛轮轮胎	14,788,649.00	0.22
7	300740	水羊股份	13,632,476.57	0.21
8	000426	兴业银锡	13,314,392.00	0.20
9	601966	玲珑轮胎	11,372,502.00	0.17
10	603383	顶点软件	11,356,493.00	0.17
11	688036	传音控股	11,264,442.71	0.17
12	603338	浙江鼎力	11,013,138.73	0.17
13	600642	申能股份	10,728,986.00	0.16
14	301004	嘉益股份	9,591,031.75	0.14
15	603298	杭叉集团	9,514,260.00	0.14
16	002558	巨人网络	9,467,841.54	0.14
17	600157	永泰能源	9,417,192.00	0.14
18	300856	科思股份	9,407,563.50	0.14
19	601163	三角轮胎	8,765,493.00	0.13

20	300729	乐歌股份	8,565,872.60	0.13
----	--------	------	--------------	------

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	719,913,175.91
卖出股票收入（成交）总额	647,036,751.59

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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	105,841,556.70	2.07
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	20,090,360.74	0.39
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	125,931,917.44	2.47

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	019709	23 国债 16	700,000	71,093,054.80	1.39
2	019740	24 国债 09	130,000	13,044,442.19	0.26
3	019685	22 国债 20	124,000	12,609,019.84	0.25
4	019631	20 国债 05	65,000	6,549,563.84	0.13
5	019727	23 国债 24	25,000	2,545,476.03	0.05

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 本报告期投资基金情况

7.12.1 投资政策及风险说明

基于本基金管理人绩效评估系统对备选基金的评估分析，在有效控制风险的前提下，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及投资业绩比较优势的基金确定本基金配置组合。本基金的绩效评估系统分析主要包括业绩指标分析、业绩归因分析以及基金管理人综合评估等。

运用量化方法分析所有适选基金在不同市场下的历史业绩表现，包括收益指标、风险指标和风险调整后收益指标等，具体如下：收益指标：包括绝对收益、相对收益等指标；风险指标：包括波动率、最大回撤等指标；风险调整后收益指标：包括夏普比率、信息比率等指标。

深入分析基金的业绩表现，再次精选基金确定备选基金，包括对基金的择时能力、资产配置能力、个股选择能力等进行归因分析，解释基金收益来源，评估未来收益的持续性与稳定性。基于市场环境、政策变动、风险事件等多重因素对基金配置组合进行持续跟踪，动态调整基金投资组合及配置比例。

结合对基金管理人的定性评估，包括基金管理人基本情况、投研团队实力以及投研团队稳定性、基金经理投资优势及业绩稳定性方面，被投资基金运作合规，风格清晰，中长期收益良好，业绩波动性较低，根据定性评估分析结果，最终确定本基金的投资组合及配置比例。

本基金通过定量和定性相结合的方法，长期持续跟踪本基金的组合业绩，并定期对基金组合进行维护，力争实现基金资产的长期稳健增值。

报告期内，本基金主要投资于开放式基金，符合基金合同约定的投资政策、投资限制等要求

7.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额（份）	公允价值（元）	占基金资产	是否属于基金管理
----	------	------	------	---------	---------	-------	----------

						产净值比例 (%)	人及管理人关联方所管理的基金
1	519783	交银裕隆纯债债券 C	契约型开放式	510,000,000.00	683,247,000.00	13.39	是
2	519723	交银双轮动债券 A/B	契约型开放式	600,000,000.00	655,380,000.00	12.85	是
3	519718	交银纯债债券发起 A/B	契约型开放式	550,000,000.00	607,750,000.00	11.91	是
4	000914	中加纯债债券	契约型开放式	318,751,954.65	345,048,990.91	6.76	否
5	519782	交银裕隆纯债债券 A	契约型开放式	239,836,198.69	329,127,215.46	6.45	是
6	008204	交银稳利中短债债券 A	契约型开放式	175,000,000.00	201,337,500.00	3.95	是
7	005578	交银丰晟收益债券 C	契约型开放式	131,618,447.29	157,112,940.53	3.08	是

8	164902	交银信用添利债券 (LOF)	契约型开放式 (LOF)	126,561,310.61	153,215,122.62	3.00	是
9	005577	交银丰晟收益债券 A	契约型开放式	125,885,035.27	152,874,786.83	3.00	是
10	519772	交银新生活力灵活配置混合	契约型开放式	65,000,000.00	129,740,000.00	2.54	是
11	161716	招商双债增强债券 C	契约型开放式 (LOF)	70,000,000.00	109,116,000.00	2.14	否
12	015736	长盛盛裕纯债 D	契约型开放式	82,354,465.61	85,821,588.61	1.68	否
13	007574	宝盈新价值混合 C	契约型开放式	23,790,283.40	68,563,596.76	1.34	否
14	519702	交银趋势混合 A	契约型开放式	15,000,000.00	62,445,000.00	1.22	是
15	013486	尚正竞争优势混合	契约型开放式	54,013,511.19	61,823,864.91	1.21	否

		发起 C					
16	012709	东方 红中 证东 方红 红利 低波 动指 数 C	契 约 型 开 放 式	52,517,736.71	61,240,932.78	1.20	否
17	260112	景顺 长城 能源 基建 混合 A	契 约 型 开 放 式	25,000,000.00	60,875,000.00	1.19	否
18	013860	宝盈 品质 甄选 混合 C	契 约 型 开 放 式	47,867,193.68	57,196,509.73	1.12	否
19	011476	工银 新蓝 筹股 票 C	契 约 型 开 放 式	18,656,829.96	46,865,956.86	0.92	否
20	003401	工银 可转 债债 券	契 约 型 开 放 式	28,698,978.12	45,157,842.07	0.89	否
21	002165	汇添 富达 欣混 合 C	契 约 型 开 放 式	23,786,219.77	38,557,462.25	0.76	否
22	013449	广发 景宁 纯债 C	契 约 型 开 放 式	28,347,639.03	32,509,072.44	0.64	否

23	010094	交银 产业 机遇 混合	契约 型开 放式	37,780,316.79	28,456,134.61	0.56	是
24	004388	鹏华 丰享 债券	契约 型开 放式	21,754,664.88	26,830,028.20	0.53	否
25	015394	交银 科技 创新 灵活 配置 混合 C	契约 型开 放式	12,645,846.76	25,050,157.85	0.49	是
26	003864	招商 招祥 纯债 C	契约 型开 放式	20,800,000.00	23,687,040.00	0.46	否
27	519746	交银 丰享 收益 债券 A	契约 型开 放式	10,180,995.48	23,167,873.31	0.45	是
28	519773	交银 数据 产业 灵活 配置 混合 A	契约 型开 放式	13,190,532.99	21,135,191.01	0.41	是
29	008340	华富 安徽 省信 用债 指数 A	契约 型开 放式	20,000,000.00	21,042,000.00	0.41	否

30	014549	交银数据产业灵活配置混合C	契约型开放式	12,000,000.00	18,949,200.00	0.37	是
31	217022	招商产业债券A	契约型开放式	10,000,000.00	17,918,000.00	0.35	否
32	016049	华商甄选回报混合C	契约型开放式	13,491,687.86	17,783,393.77	0.35	否
33	005562	创金合信中证红利低波动指数C	契约型开放式	8,339,655.76	16,004,633.37	0.31	否
34	518880	华安黄金易(ETF)	交易型开放式(ETF)	1,820,000.00	9,640,540.00	0.19	否
35	019894	天弘通利混合C	契约型开放式	4,111,388.12	8,091,211.82	0.16	否
36	008929	宏利消费红利指数C	契约型开放式	5,261,877.09	7,207,719.24	0.14	否

37	001966	圆信永丰兴源C	契约型开放式	2,932,112.26	4,003,506.08	0.08	否
38	206018	鹏华产业债债券A	契约型开放式	1,500,000.00	1,681,500.00	0.03	否

7.12.3 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。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

7.13.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	83,173.68
2	应收清算款	14,777,060.54
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	150,098.42
6	其他应收款	330,635.03
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,340,967.67

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113052	兴业转债	2,282,310.69	0.04
2	110059	浦发转债	2,226,459.72	0.04
3	110068	龙净转债	1,237,656.01	0.02
4	113044	大秦转债	926,041.24	0.02
5	113056	重银转债	719,084.35	0.01

6	110081	闻泰转债	436,049.88	0.01
7	127049	希望转 2	430,570.71	0.01
8	118031	天 23 转债	420,616.08	0.01
9	113641	华友转债	383,545.31	0.01
10	113065	齐鲁转债	383,031.99	0.01
11	127083	山路转债	262,720.11	0.01
12	113037	紫银转债	252,547.37	0.00
13	127040	国泰转债	225,869.20	0.00
14	113059	福莱转债	216,828.47	0.00
15	113049	长汽转债	199,016.14	0.00
16	127073	天赐转债	190,651.51	0.00
17	118024	冠宇转债	169,963.66	0.00
18	110093	神马转债	164,650.67	0.00
19	118022	锂科转债	163,693.56	0.00
20	127067	恒逸转 2	161,501.98	0.00
21	110089	兴发转债	158,454.45	0.00
22	113623	凤 21 转债	157,284.63	0.00
23	110087	天业转债	152,782.59	0.00
24	128081	海亮转债	146,482.88	0.00
25	128048	张行转债	140,176.13	0.00
26	113054	绿动转债	127,819.20	0.00
27	127027	能化转债	127,222.32	0.00
28	113602	景 20 转债	124,301.22	0.00
29	113632	鹤 21 转债	122,725.56	0.00
30	123119	康泰转 2	117,819.50	0.00
31	113666	爱玛转债	114,130.27	0.00
32	110082	宏发转债	113,953.56	0.00
33	123158	宙邦转债	113,714.66	0.00
34	113058	友发转债	111,113.97	0.00
35	132020	19 蓝星 EB	110,561.10	0.00
36	113069	博 23 转债	109,729.26	0.00
37	113655	欧 22 转债	109,091.76	0.00
38	123216	科顺转债	107,765.44	0.00
39	110095	双良转债	107,149.25	0.00
40	127022	恒逸转债	104,252.75	0.00
41	128109	楚江转债	103,068.66	0.00
42	110076	华海转债	102,086.19	0.00
43	127070	大中转债	97,855.75	0.00
44	113033	利群转债	94,542.88	0.00
45	127025	冀东转债	94,172.24	0.00
46	123108	乐普转 2	88,608.96	0.00
47	113652	伟 22 转债	85,964.81	0.00
48	128134	鸿路转债	85,672.99	0.00

49	127066	科利转债	84,001.09	0.00
50	127038	国微转债	83,857.67	0.00
51	113047	旗滨转债	83,335.46	0.00
52	127016	鲁泰转债	81,545.37	0.00
53	113068	金铜转债	80,802.36	0.00
54	127024	盈峰转债	79,999.32	0.00
55	113046	金田转债	79,140.36	0.00
56	113064	东材转债	78,714.14	0.00
57	128131	崇达转 2	78,686.77	0.00
58	113669	景 23 转债	78,072.60	0.00
59	113605	大参转债	77,298.12	0.00
60	113647	禾丰转债	77,140.13	0.00
61	110063	鹰 19 转债	77,070.38	0.00
62	123169	正海转债	75,672.01	0.00
63	128141	旺能转债	74,440.85	0.00
64	118013	道通转债	74,231.51	0.00
65	123228	震裕转债	72,882.81	0.00
66	113659	莱克转债	69,542.26	0.00
67	127082	亚科转债	68,964.86	0.00
68	123115	捷捷转债	67,548.73	0.00
69	123145	药石转债	66,786.71	0.00
70	123213	天源转债	63,598.15	0.00
71	127052	西子转债	63,287.98	0.00
72	123184	天阳转债	62,298.84	0.00
73	127046	百润转债	61,675.56	0.00
74	123161	强联转债	59,992.41	0.00
75	113631	皖天转债	59,496.85	0.00
76	127044	蒙娜转债	58,865.51	0.00
77	123113	仙乐转债	58,300.00	0.00
78	123117	健帆转债	57,857.61	0.00
79	123208	孩王转债	57,401.58	0.00
80	123104	卫宁转债	57,390.89	0.00
81	128130	景兴转债	54,998.12	0.00
82	110084	贵燃转债	54,674.01	0.00
83	113545	金能转债	53,987.88	0.00
84	127015	希望转债	52,017.29	0.00
85	128083	新北转债	50,576.84	0.00
86	128132	交建转债	50,069.26	0.00
87	128144	利民转债	49,178.70	0.00
88	113549	白电转债	49,035.80	0.00
89	118028	会通转债	48,416.28	0.00
90	123076	强力转债	48,090.43	0.00
91	113637	华翔转债	48,088.34	0.00

92	113679	芯能转债	47,800.38	0.00
93	123121	帝尔转债	47,671.38	0.00
94	123035	利德转债	47,151.42	0.00
95	123120	隆华转债	45,643.84	0.00
96	128119	龙大转债	45,491.87	0.00
97	113640	苏利转债	45,269.09	0.00
98	113627	太平转债	44,283.82	0.00
99	123191	智尚转债	43,701.08	0.00
100	128105	长集转债	42,110.06	0.00
101	128128	齐翔转 2	41,906.91	0.00
102	123133	佩蒂转债	41,809.49	0.00
103	113670	金 23 转债	41,793.25	0.00
104	123225	翔丰转债	41,365.29	0.00
105	127042	嘉美转债	41,189.66	0.00
106	123146	中环转 2	41,114.81	0.00
107	123204	金丹转债	40,776.66	0.00
108	113651	松霖转债	40,553.95	0.00
109	123071	天能转债	40,031.00	0.00
110	113609	永安转债	39,938.00	0.00
111	127035	濮耐转债	39,813.35	0.00
112	111002	特纸转债	39,180.67	0.00
113	127068	顺博转债	39,015.80	0.00
114	127019	国城转债	38,826.41	0.00
115	128142	新乳转债	38,808.39	0.00
116	128074	游族转债	38,678.01	0.00
117	110060	天路转债	37,763.95	0.00
118	111004	明新转债	37,192.34	0.00
119	128063	未来转债	37,126.49	0.00
120	123063	大禹转债	37,000.75	0.00
121	128121	宏川转债	36,664.72	0.00
122	127034	绿茵转债	36,113.42	0.00
123	113530	大丰转债	35,318.79	0.00
124	113584	家悦转债	35,046.85	0.00
125	123132	回盛转债	34,845.86	0.00
126	128116	瑞达转债	34,784.75	0.00
127	111009	盛泰转债	34,365.11	0.00
128	113542	好客转债	33,674.59	0.00
129	113638	台 21 转债	33,627.99	0.00
130	123147	中辰转债	33,467.26	0.00
131	127088	赫达转债	33,371.74	0.00
132	123193	海能转债	32,694.64	0.00
133	123091	长海转债	32,507.45	0.00
134	127055	精装转债	32,397.82	0.00

135	113629	泉峰转债	31,009.80	0.00
136	113639	华正转债	31,003.26	0.00
137	111005	富春转债	30,997.38	0.00
138	127051	博杰转债	30,577.50	0.00
139	123090	三诺转债	30,373.52	0.00
140	123144	裕兴转债	28,646.34	0.00
141	118008	海优转债	28,564.91	0.00
142	123085	万顺转 2	28,189.19	0.00
143	123109	昌红转债	26,848.60	0.00
144	113532	海环转债	26,732.28	0.00
145	123168	惠云转债	26,469.83	0.00
146	128066	亚泰转债	26,259.16	0.00
147	113657	再 22 转债	26,010.76	0.00
148	128097	奥佳转债	25,513.70	0.00
149	123157	科蓝转债	25,292.12	0.00
150	128138	侨银转债	25,126.35	0.00
151	123050	聚飞转债	25,097.48	0.00
152	128125	华阳转债	25,029.67	0.00
153	123048	应急转债	24,118.70	0.00
154	123059	银信转债	23,628.79	0.00
155	113649	丰山转债	22,576.52	0.00
156	127059	永东转 2	20,218.68	0.00
157	113030	东风转债	17,555.35	0.00
158	128071	合兴转债	17,321.36	0.00
159	128101	联创转债	17,281.94	0.00
160	123159	崧盛转债	16,275.53	0.00
161	113519	长久转债	13,770.54	0.00
162	113565	宏辉转债	12,520.19	0.00
163	128049	华源转债	11,147.03	0.00
164	113526	联泰转债	10,147.70	0.00

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人 户数	户均持有的基 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 (%)
交银安享 稳健养老 一年 A	351,260	12,269.80	1,874,801.75	0.04	4,308,014,270.86	99.96
交银安享 稳健养老 一年 Y	11,345	6,100.70	0.00	0.00	69,212,471.68	100.00
合计	362,605	12,076.78	1,874,801.75	0.04	4,377,226,742.54	99.96

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例 (%)
基金管 理人所有从业 人员持有本基 金	交银安享稳健养老一年 A	9,399,039.50	0.22
	交银安享稳健养老一年 Y	296,563.97	0.43
	合计	9,695,603.47	0.22

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人 员、基金投资和研 究部门负责人持有本开 放式基金	交银安享稳健养老一年 A	>100
	交银安享稳健养老一年 Y	0~10
	合计	>100
本基金基金经理持有 本开放式基金	交银安享稳健养老一年 A	-
	交银安享稳健养老一年 Y	-
	合计	-

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	交银安享稳健养老一年 A	交银安享稳健养老一年 Y
基金合同生效日 (2019年5月30 日) 基金份额总额	2,042,809,040.74	-
本报告期期初基金 份额总额	5,662,657,555.16	69,607,811.46

本报告期基金总申购份额	13,627,801.74	7,287,613.11
减：本报告期基金总赎回份额	1,366,396,284.29	7,682,952.89
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	4,309,889,072.61	69,212,471.68

注：1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；

2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人的重大人事变动：本报告期内，本基金的基金管理人未发生重大人事变动。

2、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动：本基金托管人的专门基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

无。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务。

10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.7.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金管理人及其高级管理人员本报告期内未受监管部门稽查或处罚。

10.7.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金托管人及其高级管理人员本报告期内未受监管部门稽查或处罚。

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.8.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
国盛证券	1	694,041,005.99	50.84	510,747.15	50.84	-
招商证券	1	671,099,838.56	49.16	493,853.05	49.16	-

10.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
国盛证券	18,196,993.59	5.02	-	-	-	-	-	-
招商证券	344,169,416.61	94.98	1,036,778,000.00	100.00	-	-	20,379,460.10	100.00

注：1、报告期内，本基金交易单元未发生变化；

2、租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：券商基本面评价（财务状况、经营状况）、券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）、券商每日信息评价（及时性和有效性）和券商协作表现评价等四个方面；

3、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进行综合评价，然后根据评价选择基金交易单元。研究部提交方案，并上报公司批准。

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	交银施罗德基金管理有限公司关于增加上海好买基金销售有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2024 年 1 月 16 日
2	交银施罗德安享稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）2023 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒体及公司网站	2024 年 1 月 20 日
3	交银施罗德基金管理有限公司关于增加深圳前海微众银行股份有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2024 年 2 月 8 日
4	交银施罗德安享稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）2023 年年度报告	中国证监会规定媒体及公司网站	2024 年 3 月 29 日
5	交银施罗德基金管理有限公司高级管理人员任职公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2024 年 3 月 30 日
6	交银施罗德安享稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）2024 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒体及公司网站	2024 年 4 月 20 日
7	交银施罗德安享稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）（更新）招募说明书（2024 年第 1 号）	中国证监会规定媒体及公司网站	2024 年 5 月 10 日
8	交银施罗德安享稳健养老目标一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（2024 年第 1 号）	中国证监会规定媒体及公司网站	2024 年 5 月 10 日
9	交银施罗德安享稳健养老目标一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（2024 年第 1 号）	中国证监会规定媒体及公司网站	2024 年 5 月 10 日
10	交银施罗德基金管理有限公司关于终止上海钜派钰茂基金销售有限公司办理相关销售业务的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2024 年 5 月 23 日
11	交银施罗德安享稳健养老目标一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	中国证监会规定媒体及公司网站	2024 年 6 月 27 日
12	交银施罗德安享稳健养老目标一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	中国证监会规定媒体及公司网站	2024 年 6 月 27 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、中国证监会准予交银施罗德安享稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）募集注册的文件；

2、《交银施罗德安享稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》；

3、《交银施罗德安享稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）招募说明书》；

4、《交银施罗德安享稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）托管协议》；

5、关于申请募集注册交银施罗德安享稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）的法律意见书；

6、基金管理人业务资格批件、营业执照；

7、基金托管人业务资格批件、营业执照；

8、报告期内交银施罗德安享稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）在规定报刊上各项公告的原稿。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可在办公时间内至基金管理人的办公场所免费查阅备查文件，或者登录基金管理人的网站(www.fund001.com)查阅。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人交银施罗德基金管理有限公司。本公司客户服务中心电话：400-700-5000（免长途话费），021-61055000，电子邮件：services@jysld.com。