

平安养老目标日期 2035 三年持有期混合型
基金中基金（FOF）
2022 年第 1 季度报告

2022 年 3 月 31 日

基金管理人：平安基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 4 月 22 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 04 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 03 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 平安养老 2035 |
| 基金主代码 | 007238 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2019 年 6 月 19 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 680,346,356.56 份 |
| 投资目标 | 本基金在严格控制风险的前提下，通过基金资产配置和组合管理，在合理控制投资组合波动性的同时，力争实现与其承担的风险相对应的长期稳健回报，追求基金资产的长期稳健增值。在 2035 年 12 月 31 日以前，本基金侧重于资本增值，当期收益为辅；在 2035 年 12 月 31 日之后，本基金侧重于当期收益，资本增值为辅。 |
| 投资策略 | 本基金将采取主动的类别资产配置策略，注重风险与收益的平衡，即在股混类基金、债券类基金、货币市场基金和其他资产之间的配置比例；其次，本基金将精选具有较高投资价值的证券投资基金、股票和债券，力求实现基金资产的长期稳定增长。 |
| 业绩比较基准 | 中证平安 2035 退休宝指数收益率*95%+同期银行活期存款利率*5% |
| 风险收益特征 | 本基金是混合型基金中基金，是目标日期基金，风险与收益水平会随着投资者目标时间期限的接近而逐步降低。本基金的预期风险与收益在投资初始阶段属于较高水平；随着目标投资期限的逐步接近，本基金将逐步降低预期风险与收益水平，转变成为中等风险的证券投资基金；在临近目标期限和目标期限达到以后，本基金转 |

| | | |
|-----------------|---|------------------|
| | 变成为低风险的证券投资基金。本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。 | |
| 基金管理人 | 平安基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 招商银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 平安养老 2035A | 平安养老 2035C |
| 下属分级基金的交易代码 | 007238 | 007239 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 501,624,626.30 份 | 178,721,730.26 份 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2022 年 1 月 1 日-2022 年 3 月 31 日） | |
|-----------------|-------------------------------------|----------------|
| | 平安养老 2035A | 平安养老 2035C |
| 1. 本期已实现收益 | -15,295,938.70 | -5,557,862.56 |
| 2. 本期利润 | -75,855,706.15 | -26,845,034.00 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.1548 | -0.1547 |
| 4. 期末基金资产净值 | 713,975,036.79 | 252,620,347.98 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.4233 | 1.4135 |

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）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

平安养老 2035A

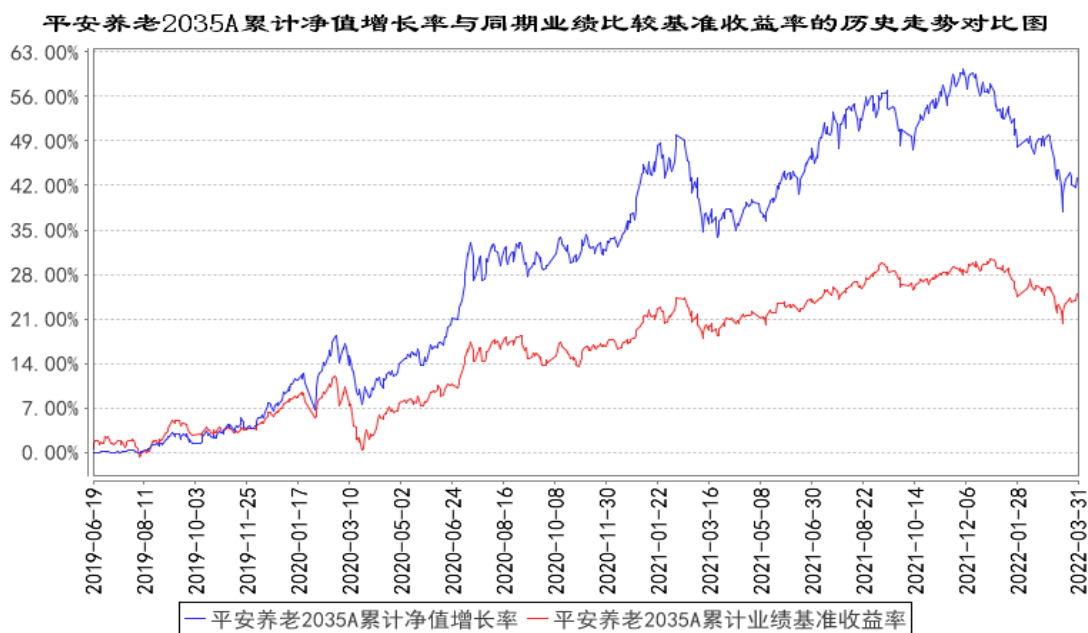
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|-------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | -9.89% | 0.89% | -4.48% | 0.56% | -5.41% | 0.33% |
| 过去六个月 | -5.59% | 0.80% | -1.54% | 0.46% | -4.05% | 0.34% |
| 过去一年 | 4.03% | 0.80% | 3.84% | 0.41% | 0.19% | 0.39% |
| 自基金合同 | 42.33% | 0.79% | 24.51% | 0.52% | 17.82% | 0.27% |

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

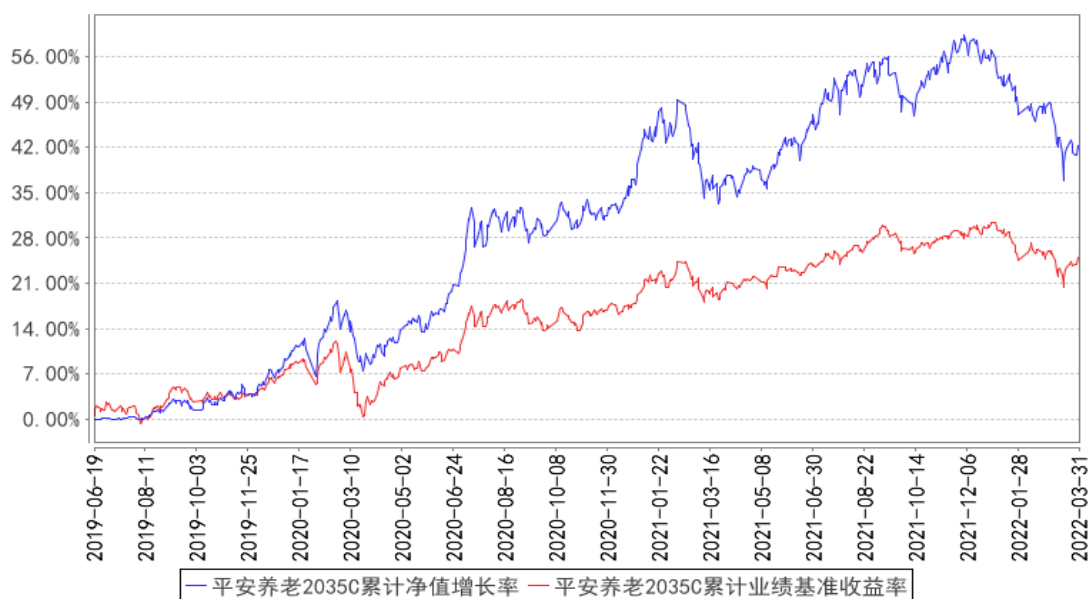
平安养老 2035C

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | -9.95% | 0.89% | -4.48% | 0.56% | -5.47% | 0.33% |
| 过去六个月 | -5.71% | 0.80% | -1.54% | 0.46% | -4.17% | 0.34% |
| 过去一年 | 3.77% | 0.80% | 3.84% | 0.41% | -0.07% | 0.39% |
| 自基金合同生效起至今 | 41.35% | 0.79% | 24.51% | 0.52% | 16.84% | 0.27% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



平安养老2035C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、本基金基金合同于 2019 年 06 月 19 日正式生效；

2、按照本基金的基金合同规定，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，截至报告期末本基金已完成建仓，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|--|-----------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 张文君 | 平安养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金经理 | 2019 年 6 月 19 日 | - | 14 年 | 张文君女士，厦门大学硕士。先后担任恒安标准人寿保险有限公司投资分析师、上海博鸿投资咨询合伙企业投研经理、上海苍石资产管理有限公司投资经理。2017 年 2 月加入平安基金管理有限公司，曾任 FOF 投资中心 FOF 研究员。现担任平安养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金 (FOF)、平安养老目标日期 2025 一年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、平安养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 基金经理。 |
| 高莺 | FOF 投资中心养老金投资团队投资执 | 2019 年 6 月 20 日 | - | 14 年 | 高莺女士，浙江大学硕士，美国爱荷华州立大学博士，曾先后担任联邦家庭贷款银行资本市场分析师、美国太平洋投资管理公司 (PIMCO) 养老金投资部投资研究岗。 |

| | | | | |
|--|---|--|--|--|
| | 行总经理，平安养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金经理 | | | 2019 年 1 月加入平安基金管理有限公司，现任 FOF 投资中心养老金投资团队投资执行总经理。同时担任平安养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金 (FOF)、平安养老目标日期 2025 一年持有期混合型基金中基金 (FOF)、平安养老目标日期 2045 五年持有期混合型基金中基金 (FOF)、平安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金 (FOF)、平安盈禧均衡配置 1 年持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金经理。 |
|--|---|--|--|--|

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确认的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确认的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：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

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和本基金基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。

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。

报告期内，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未超过该证券当日成交量的 5%。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

1、A 股市场：

2022 年开年以来，A 股市场整体波动较大，有些调整在预期中，有些事件也超出绝大部分投资者的判断。在年初以来，去年涨幅较显著，资金集中度高的成长赛道结构出现了显著回撤，这方面在预期中，组合在四季度也做了相应的风险防范调整；春节后俄乌事件的爆发以及随后的推演，是超出预期的，市场出现了无差别大幅回落，组合在此过程中顺势补跌，这方面向持有人表示歉意。三月疫情的变化也为今年的经济复苏增加了不确定性，市场的风险偏好持续走弱。

政府工作报告中，定调今年 GDP 增速在 5.5%左右，CPI 目标涨幅 3%左右，新增就业 1100 万人以上的整体目标。针对当前的局势，完成目标的困难也在加大。政策方面，相对较为宽松；人民银行一季度例会中提到延续去年四季度货币政策稳健基调，确保信贷总量合理稳定增长。对房地产的相关政策也做了适度调整，未来预计在利率方面也会有相对积极的应对。

经过一季度以来市场的调整，整体风险溢价到达较高的水平，风险也得到充分释放。一季度以来，表现较好的结构主要集中在估值较低的传统领域，一方面，由于前期这些板块资金集中度较低，风险较小；另一方面，部分板块例如上游资源品类在俄乌冲突中由于供给的大幅波动带来了价格较大幅度的上涨。回撤较大的板块主要集中在去年涨幅较大的成长类结构中，一方面由于估值较高，资金的密集度也同样增加了波动的幅度；另一方面在于对部分具有消费属性的成长品种，投资者担忧需求会出现回落。

站在当前的时点上，虽然近期的疫情为市场情绪蒙上阴影，但放眼长期，这些也都是事件性冲击。从长期投资的角度，我们需要观察事件性冲击后，哪些具有前瞻性的板块更加具有投资性价比。

2、债券市场：

债券：在经济逐步进入下行阶段，对债券市场带来支撑；政策向市场传达较为友好的导向。前期利率端的上行风险也有了一定程度的释放。

宏观方面，虽然宏观经济稳中回落，宏观对债市有所支撑。

信用方面，仍然以高等级信用为首选；久期方面，建议继续中性久期。

3、运作回顾及后续操作

权益方面，本基金以权益下滑线为主要参考；保持组合整体动态估值均衡。操作方面，去年四季度降低了高景气度赛道风格结构，增加了稳增长品种，今年一季度为组合的回撤控制带来了帮助；在三月初市场无差别下跌中，适度增加了上游基本面较好的相关标的，后续的反弹过程中也有较好的超额收益。当前组合仍维持较均衡的配置结构，在结构调整中，遵循估值、景气度性价比相结合的方法。

固收方面，仍以中性久期，中高等级债券型基金为主要配置方向。

后续投资操作中，由于一季度的调整，市场的整体风险充分释放；疫情虽然带来不确定性，但疫情总会恢复，投资需要保持一定前瞻性，今年 GDP 5.5%的增速目标以及就业率的要求，对接下来稳增长的诉求进一步加强，相关领域仍有一定配置价值；同时，一些逆境反转、长期品种的估值性价比也开始显现出来，整体组合结构上也会进一步均衡。

固收方面，总体上仍维持当前中性久期、中高等级债券型基金的配置策略。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末平安养老 2035A 的基金份额净值 1.4233 元，本报告期基金份额净值增长率为 -9.89%，同期业绩比较基准收益率为 -4.48%；截至本报告期末平安养老 2035C 的基金份额净值 1.4135 元，本报告期基金份额净值增长率为 -9.95%，同期业绩比较基准收益率为 -4.48%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数低于 200 人、基金资产净值低于 5,000 万元的情形。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 79,495,951.60 | 8.22 |
| | 其中：股票 | 79,495,951.60 | 8.22 |
| 2 | 基金投资 | 808,985,631.29 | 83.62 |
| 3 | 固定收益投资 | 61,534,926.03 | 6.36 |
| | 其中：债券 | 61,534,926.03 | 6.36 |
| | 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 | 16,492,644.07 | 1.70 |
| 8 | 其他资产 | 973,766.59 | 0.10 |
| 9 | 合计 | 967,482,919.58 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 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 | 3,979,062.80 | 0.41 |
| B | 采矿业 | 13,336,500.00 | 1.38 |
| C | 制造业 | 57,201,388.80 | 5.92 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 4,979,000.00 | 0.52 |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - |
| J | 金融业 | - | - |
| 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 | 79,495,951.60 | 8.22 |

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 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 | 601717 | 郑煤机 | 700,000 | 9,618,000.00 | 1.00 |
| 2 | 002353 | 杰瑞股份 | 190,000 | 8,008,500.00 | 0.83 |
| 3 | 600426 | 华鲁恒升 | 200,000 | 6,514,000.00 | 0.67 |
| 4 | 601808 | 中海油服 | 450,000 | 6,138,000.00 | 0.64 |
| 5 | 600547 | 山东黄金 | 250,000 | 5,375,000.00 | 0.56 |
| 6 | 601677 | 明泰铝业 | 130,000 | 5,369,000.00 | 0.56 |
| 7 | 601186 | 中国铁建 | 650,000 | 4,979,000.00 | 0.52 |
| 8 | 600516 | 方大炭素 | 500,000 | 4,225,000.00 | 0.44 |
| 9 | 002714 | 牧原股份 | 69,980 | 3,979,062.80 | 0.41 |
| 10 | 603986 | 兆易创新 | 27,000 | 3,807,810.00 | 0.39 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 61,534,926.03 | 6.37 |
| | 其中：政策性金融债 | 61,534,926.03 | 6.37 |
| 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 | 61,534,926.03 | 6.37 |

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 210206 | 21 国开 06 | 400,000 | 40,951,079.45 | 4.24 |
| 2 | 190207 | 19 国开 07 | 200,000 | 20,583,846.58 | 2.13 |

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金报告期末未持有贵金属投资。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证投资。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期无股指期货投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期无股指期货投资。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期无国债期货投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期无国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期无国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

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

中国银行保险监督管理委员会于 2022-03-21 作出银保监罚决字（2022）8 号处罚决定，由于国家开发银行监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在以下违法违规行为：一、未报送逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据；二、漏报贸易融资业务 EAST 数据；三、漏报贷款核销业务 EAST 数据；四、信贷资产转让业务 EAST 数据存在偏差；五、未报送债券投资业务 EAST 数据；六、漏报权益类投资业务 EAST 数据；七、漏报跟单信用证业务 EAST 数据；八、漏报保函业务 EAST 数据；九、EAST 系统理财产品底层持仓余额数据存在偏差；十、EAST 系统理财产品非标投向行业余额数据存在偏差；十一、漏报分户账 EAST 数据；十二、漏报授信信息 EAST 数据；十三、EAST 系统《表外授信业务》表错报；十四、EAST 系统《对公信贷业务借据》表错报；十五、EAST 系统《关联关系》表漏报；十六、EAST 系统《对公信贷分户账》表漏报；十七、理财产品登记不规范，根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，对国家开发银行罚款 440 万元。

本基金管理人对上述公司进行了深入的了解和分析，认为该事项有利于公司规范开展业务，对公司的偿债能力暂不会造成重大不利影响。我们对上述证券的投资严格执行内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

报告期内，本基金投资的前十名证券的其余证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选库以外的股票。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|-----------|
| 1 | 存出保证金 | 85,661.18 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |

| | | |
|---|-------|------------|
| 3 | 应收股利 | 346.27 |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 878,594.45 |
| 6 | 其他应收款 | 9,164.69 |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 973,766.59 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中无流通受限的股票。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§6 基金中基金

6.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

| 序号 | 基金代码 | 基金名称 | 运作方式 | 持有份额（份） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） | 是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金 |
|----|--------|--------------|--------|---------------|---------------|--------------|------------------------|
| 1 | 000385 | 景顺长城景颐双利债券 A | 契约型开放式 | 47,237,099.29 | 73,548,163.59 | 7.61 | 否 |
| 2 | 001182 | 易方达安心回馈混合 | 契约型开放式 | 30,194,205.75 | 72,949,201.09 | 7.55 | 否 |
| 3 | 519133 | 海富通改革驱动混合 | 契约型开放式 | 23,567,476.09 | 61,558,247.55 | 6.37 | 否 |
| 4 | 519002 | 华安安信消费混合 A | 契约型开放式 | 12,861,463.26 | 58,532,519.30 | 6.06 | 否 |
| 5 | 519704 | 交银先进制造混合 | 契约型开放式 | 9,430,861.24 | 41,227,009.91 | 4.27 | 否 |
| 6 | 519702 | 交银趋势混合 A | 契约型开放式 | 9,727,912.35 | 40,193,788.25 | 4.16 | 否 |
| 7 | 000121 | 华夏永福混合 A | 契约型开放式 | 16,610,624.33 | 39,250,905.29 | 4.06 | 否 |
| 8 | 001410 | 信达澳银 | 契约型开放 | 7,479,847.24 | 31,991,306.65 | 3.31 | 否 |

| | | | | | | | |
|----|--------|------------|--------------|---------------|---------------|------|---|
| | | 新能源产业股票 | 式 | | | | |
| 9 | 006314 | 中融策略优选混合 A | 契约型开放式 | 12,442,149.16 | 31,076,755.96 | 3.22 | 否 |
| 10 | 515220 | 国泰中证煤炭 ETF | 交易型开放式 (ETF) | 12,000,000.00 | 27,792,000.00 | 2.88 | 否 |

6.2 当期交易及持有基金产生的费用

| 项目 | 本期费用 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 3 月 31 日 | 其中：交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用 |
|----------------------|--------------------------------------|---------------------------------|
| 当期交易基金产生的申购费(元) | - | - |
| 当期交易基金产生的赎回费(元) | - | - |
| 当期持有基金产生的应支付销售服务费(元) | 65,027.76 | 28,173.43 |
| 当期持有基金产生的应支付管理费(元) | 1,842,336.90 | 107,192.26 |
| 当期持有基金产生的应支付托管费(元) | 368,552.72 | 24,403.62 |

6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

平安养老 2035 所投资的交银施罗德先进制造混合型证券投资基金于 2021 年 12 月 21 日起至 2022 年 1 月 20 日，以通讯方式重新召开基金份额持有人大会审议基金调整投资范围及修改基金合同等相关事宜。就持有人大会审议事项平安养老 2035 投同意票。

根据表决结果，参加本次基金份额持有人大会的基金份额占权益登记日基金总份额的三分之一以上（含三分之一），同意本次会议议案的基金份额占参加本次基金份额持有人大会的基金份额持有人基金份额总数的三分之二以上（含三分之二），符合法律法规及《交银施罗德先进制造混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本次会议议案获得通过。修订后的《交银施罗德先进制造混合型证券投资基金基金合同》、《交银施罗德先进制造混合型证券投资基金托管协议》自本次基金份额持有人大会决议公告之日，即 2022 年 1 月 24 日起生效。

§ 7 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 平安养老 2035A | 平安养老 2035C |
|-------------------|----------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 467,791,893.43 | 164,121,444.50 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 33,832,732.87 | 14,600,285.76 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | - | - |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减 | - | - |

| | | |
|-------------|----------------|----------------|
| 少以“-”填列) | | |
| 报告期期末基金份额总额 | 501,624,626.30 | 178,721,730.26 |

§ 8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：无

8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：无

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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

注：无。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

(1) 中国证监会准予平安养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金 (FOF) 募集注册的文件

(2) 平安养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金合同

(3) 平安养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金 (FOF) 托管协议

(4) 法律意见书

(5) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

10.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所

10.3 查阅方式

(1) 投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件

(2) 投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人平安基金管理有限公司，客户服务电话：4008004800（免长途话费）

平安基金管理有限公司

2022 年 4 月 22 日