

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）
2022 年第 4 季度报告

2022 年 12 月 31 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

报告送出日期：2023 年 1 月 19 日

§ 1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 01 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 10 月 01 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	10,747,715,143.64 份
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	<p>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。</p> <p>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、业绩归因分析及基金管理人综合评估等。</p>
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。	
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	
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	10,721,921,554.00 份	25,793,589.64 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 10 月 1 日-2022 年 12 月 31 日）	报告期（2022 年 11 月 16 日-2022 年 12 月 31 日）
	交银安享稳健养老一年 A	交银安享稳健养老一年 Y
1. 本期已实现收益	32,401,062.36	57,442.94
2. 本期利润	-125,808,483.27	-35,954.59
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0105	-0.0037
4. 期末基金资产净值	12,423,968,636.23	29,907,588.90
5. 期末基金份额净值	1.1587	1.1595

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	净值增长率①	净值增长率	业绩比较基	业绩比较基	①—③	②—④
----	--------	-------	-------	-------	-----	-----

		标准差②	准收益率③	准收益率标准差④		
过去三个月	-0.95%	0.17%	-0.05%	0.25%	-0.90%	-0.08%
过去六个月	-2.27%	0.16%	-2.68%	0.21%	0.41%	-0.05%
过去一年	-2.74%	0.19%	-4.06%	0.26%	1.32%	-0.07%
过去三年	11.83%	0.19%	1.92%	0.25%	9.91%	-0.06%
自基金合同生效起至今	15.87%	0.18%	5.48%	0.24%	10.39%	-0.06%

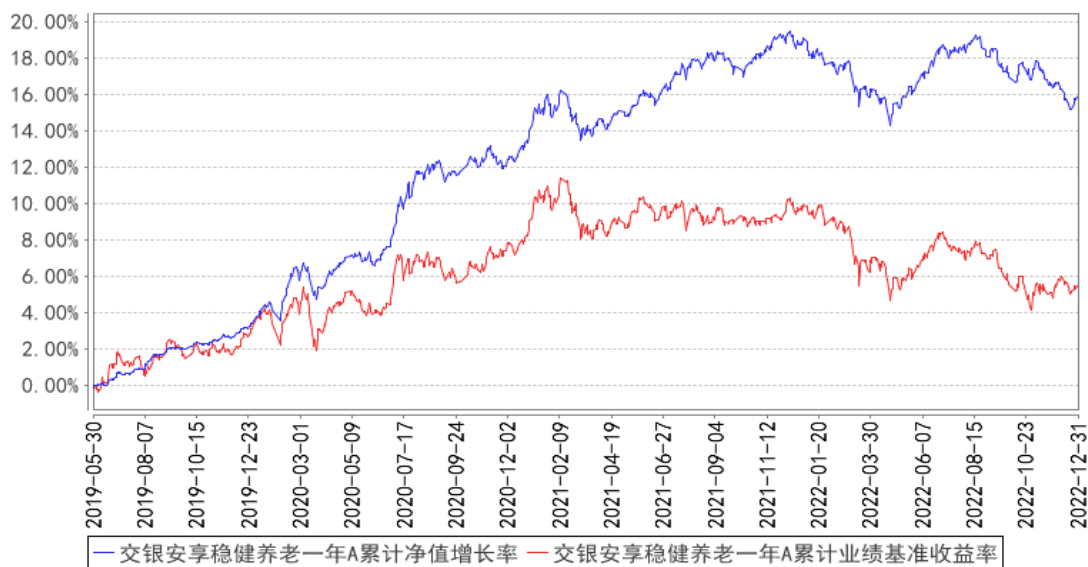
交银安享稳健养老一年 Y

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
自基金合同生效起至今	-1.20%	0.13%	-0.08%	0.17%	-1.12%	-0.04%

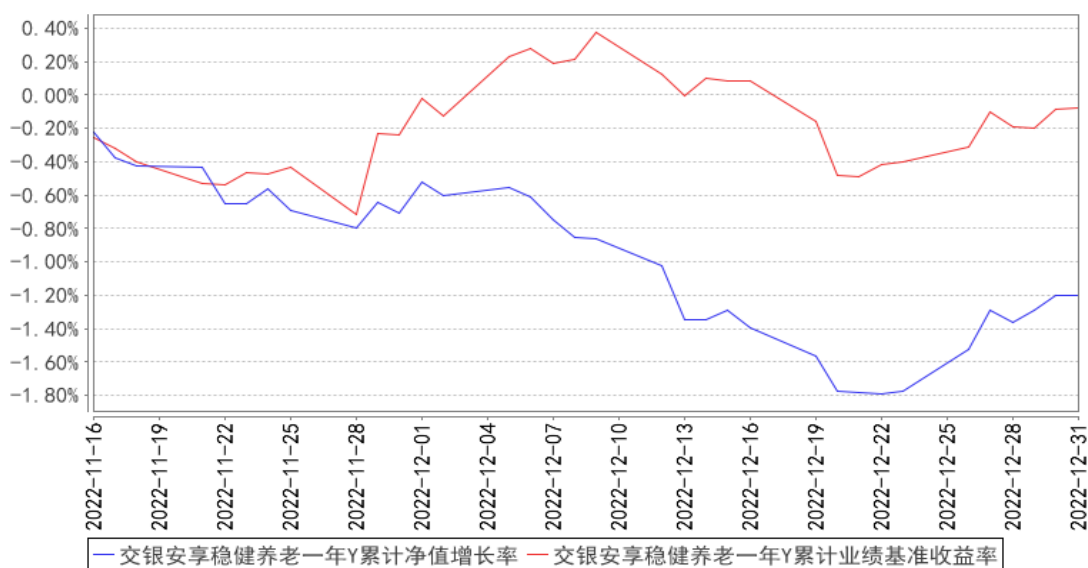
注：交银安享稳健养老一年 Y 上述“自基金合同生效起至今”实际为“自基金份额类别首次确认起至今”，下同。

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		
蔡铮	交银安享稳健养老一年、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	2021 年 4 月 30 日	-	13 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师。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

				<p>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 日担任交银施罗德国证新能源指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理。</p>
--	--	--	--	---

注：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 公平交易专项说明

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2022 年四季度，海内外宏观环境均出现一定变化。受到国庆节后多地疫情散发以及临近年底防疫政策逐步优化放松的影响，国内基本面的修复进程较为曲折，疫情对供需两端的扰动加剧，工业生产、消费以及房地产投资等多项指标走弱。海外方面，美国通胀粘性有所收敛，市场对于衰退的担忧开始浮现，但短期内美国劳动力市场仍然强劲。国内权益市场整体呈现震荡下行走势，在存量博弈情绪的影响之下，市场行业和风格的轮动速度加快，把握难度较大。十月，科创 50、中证 1000 等中小成长板块表现明显占优，而以消费龙头、上证 50 为代表的大盘价值和外资持仓占比更高的板块出现了大幅回调。十一月，市场出现了较为极致的反转行情，大盘价值风格相对占优，港股也出现了明显的反弹，而前期表现突出的小盘成长风格则有所休整。十二月初以来，主要市场指数再度出现回调，行情持续性较差，各个行业出现普跌，市场成交活跃度出现了明显下降。债市方面，本季度市场出现了较大波动，十月在资金面平稳、经济延续弱修复态势的背景下，国债收益率低位运行，信用利差不断收窄，然而十一月中旬后，随着资金利率逐步回归中枢，叠加疫情和地产政策的边际变化，多重利空因素之下，债市出现了比较剧烈的调整，十年期国债收益率逼近 3%，机构短期的赎回压力增加，流动性相对更弱的信用债面临着更大的

估值冲击。十二月初信用债市场再度受到一轮较为猛烈的赎回冲击，直到十二月中下旬才逐步企稳。

报告期内，权益市场在震荡中结构性行情加剧，债券市场大幅调整。本基金持续跟踪市场基本面、流动性、波动率以及股债配置性价比等指标的变化，灵活调整固定收益和权益资产配置情况。固定收益资产方面，我们保持谨慎态度，并于十一月中旬本轮债市回撤伊始，考虑到可能会发生机构集中赎回问题，组合逐步赎回部分阶段波动较大的纯债基金，以防范风险为主。权益资产方面，我们保持相对积极的态度，报告期内小幅提升组合的权益仓位且对持仓结构进行了优化，配置思路还是紧密跟踪市场主流配置方向，整体持仓更偏均衡风格且更贴近偏股基金。面对股债市场剧烈波动，我们仍是以防范风险为前提，及时总结每个阶段的操作，力争增强组合长期获取超额收益的能力。

展望 2023 年一季度，A 股当前进入了观望窗口期，前期演绎的“强预期，弱现实”逻辑已经开始转变，目前全国疫情正处于快速流行期，之后还将面对春运的考验，短期内疫情的扰动难免会带来市场对于经济增速预期的下修，加之市场整体上仍处于存量环境当中，市场风险偏好或将受到一定压制。不过当前权益资产估值仍处于性价比较高的位置，下行空间较为有限，后续随着市场对主要城市疫情达峰的预期升温，市场可能会迎来修复行情，陆续发布的年报预告或将给市场主线提供一些线索。债市方面，核心矛盾依旧是宏观经济的复苏进程以及货币环境的边际变化，从中央经济会议等高层表态来看，货币政策仍将维持相对宽松态势，利率一段时间内可能还会维持低位运行。本轮理财的赎回压力基本释放完毕，但年初时段仍应继续保持密切关注。城投债信用下沉仍需保持慎重，地产债信用风险有待释放。我们将持续关注海内外风险、市场流动性和政策走向，做好大类资产配置，在严控风险的基础上把握确定性相对较高的机会。

4.5 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 主要财务指标”及“3.2.1 本报告期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。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内无需预警说明。

§ 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	146,820,159.83	1.15
	其中：股票	146,820,159.83	1.15
2	基金投资	11,542,237,296.76	90.68
3	固定收益投资	505,441,209.94	3.97
	其中：债券	505,441,209.94	3.97
	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	149,956,283.29	1.18
	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	377,136,590.35	2.96
8	其他资产	7,066,261.22	0.06
9	合计	12,728,657,801.39	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	2,429,700.00	0.02
B	采矿业	11,958,781.00	0.10
C	制造业	64,861,993.48	0.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	30,751,624.48	0.25
E	建筑业	3,782,925.00	0.03
F	批发和零售业	4,721,215.10	0.04
G	交通运输、仓储和邮政业	4,705,081.00	0.04
H	住宿和餐饮业	439,314.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	624,115.69	0.01
J	金融业	15,885,036.38	0.13
K	房地产业	712,153.00	0.01
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,308,066.35	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	125,337.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,509,212.85	0.04
R	文化、体育和娱乐业	5,604.50	0.00
S	综合	-	-
	合计	146,820,159.83	1.18

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

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	600900	长江电力	1,295,000	27,195,000.00	0.22
2	300750	宁德时代	33,260	13,085,149.20	0.11
3	002594	比亚迪	23,700	6,090,189.00	0.05
4	300124	汇川技术	76,300	5,302,850.00	0.04
5	000858	五粮液	26,300	4,752,147.00	0.04
6	000568	泸州老窖	20,600	4,620,168.00	0.04
7	300274	阳光电源	36,500	4,080,700.00	0.03
8	300015	爱尔眼科	111,495	3,464,149.65	0.03
9	601838	成都银行	203,600	3,115,080.00	0.03
10	600919	江苏银行	364,100	2,654,289.00	0.02

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	505,388,328.78	4.06
	其中：政策性金融债	505,388,328.78	4.06
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）	52,881.16	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	505,441,209.94	4.06

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	200207	20 国开 07	1,000,000	101,728,219.18	0.82
2	220304	22 进出 04	1,000,000	101,288,630.14	0.81
3	220408	22 农发 08	1,000,000	100,183,424.66	0.80
4	200313	20 进出 13	500,000	50,939,465.75	0.41
5	220206	22 国开 06	500,000	50,524,027.40	0.41

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

无。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

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

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体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、处罚的情形披露如下：

2022年3月25日，中国银行保险监督管理委员会公示银保监罚决字（2022）8号行政处罚决定书，给予国家开发银行罚款440万元。

2022年3月25日，中国银保监会公示银保监罚决字（2022）9号行政处罚决定书，给予中国进出口银行420万元人民币罚款的行政处罚。

2022年3月25日，中国银行保险监督管理委员会公示银保监罚决字（2022）10号行政处罚决定书，给予中国农业发展银行480万元人民币罚款的行政处罚。

本基金管理人对证券投资决策程序的说明如下：本基金管理人对证券投资特别是重仓证券的投资有严格的投资决策流程控制，对上述主体发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述主体外，本基金投资的前十名证券的其他发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	10,806.78
2	应收证券清算款	87,433.41
3	应收股利	152,050.57
4	应收利息	-
5	应收申购款	6,440,317.06
6	其他应收款	375,653.40
7	其他	-
8	合计	7,066,261.22

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§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	519718	交银纯债债券发起 A/B	契约型开放式	1,579,447,894.80	1,680,374,615.28	13.49	是
2	519723	交银双轮动债券 A	契约型开放式	928,666,263.80	980,207,241.44	7.87	是
3	519783	交银裕隆纯债债券 C	契约型开放式	777,368,459.58	968,523,363.79	7.78	是
4	164902	交银信用添利债券 (LOF)	契约型开放式 (LOF)	560,677,675.83	697,314,825.43	5.60	是
5	007823	天弘弘择短债 A	契约型开放式	450,917,244.51	500,743,600.03	4.02	否
6	008204	交银稳利中短债债券 A	契约型开放式	378,701,139.64	409,489,542.29	3.29	是
7	000402	工银纯债债券 A	契约型开放式	347,198,081.90	403,374,731.55	3.24	否
8	000914	中加纯债债券	契约型开放式	294,131,226.14	317,632,311.11	2.55	否
9	519782	交银裕隆纯债债券 A	契约型开放式	239,836,198.69	304,232,218.04	2.44	是
10	003480	财通资管鑫管家货币 B	契约型开放式	255,551,428.20	255,551,428.20	2.05	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 10 月 1 日至 2022 年 12 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）	9,000.00	-
当期交易基金产生的赎回费（元）	1,033,764.78	11,027.09
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	1,657,222.39	1,119,576.88
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	19,775,018.09	11,732,757.12
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	5,165,762.58	3,242,852.53
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）	278,298.82	31,253.34

注：上述当期持有基金产生的应支付销售服务费、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，是根据被投资基金的实际持仓情况和被投资基金的基金合同约定费率估算得出。该三项费用根据被投资基金的基金合同约定已经作为费用计入被投资基金的基金份额净值，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。

根据相关法律法规及本基金合同的约定，基金管理人不得对基金中基金财产中持有的自身管理的基金部分收取基金中基金的管理费，基金托管人不得对基金中基金财产中持有的自身托管的基金部分收取基金中基金的托管费。基金管理人运用本基金财产申购自身管理的其他基金的（ETF 除外），应当通过直销渠道申购且不收取申购费、赎回费（按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并计入基金资产的赎回费用除外）、销售服务等销售费用，其中申购费、赎回费在实际申购、赎回时按上述规定执行，销售服务费由本基金管理人从被投资基金收取后返还至本基金基金资产。

6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

报告期内，交银施罗德持续成长主题混合型证券投资基金发布了《交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德持续成长主题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》。除上述基金外，本基金持有的其他基金未发生重大影响事件。

§ 7 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
报告期期初基金份额总额	13,214,863,202.29	-

报告期期间基金总申购份额	11,459,890.43	25,793,589.64
减:报告期期间基金总赎回份额	2,504,401,538.72	-
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	10,721,921,554.00	25,793,589.64

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。

§ 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

无。

8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

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

无。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金基金合同的有关规定，经与基金托管人协商一致，本基金管理人于 2022 年 11 月 11 日起对本基金增加 Y 类基金份额，并对本基金的基金合同、托管协议作相应修改，欲知详情请查阅本基金管理人发布的最新法律文件。

§ 10 备查文件目录

10.1 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。

10.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

10.3 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。