

信澳颐宁养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）

2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：信达澳亚基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：二〇二三年八月三十一日

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 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	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	13
5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	14
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.....	14
6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	18
7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况.....	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	41
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.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	42
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.....	42
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.....	42
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.....	42
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.....	43
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	43
7.12 本报告期投资本基金情况.....	43

7.13 投资组合报告附注	47
8 基金份额持有人信息	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48
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	48
9 开放式基金份额变动	49
10 重大事件揭示	49
10.1 基金份额持有人大会决议	49
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	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	49
10.4 基金投资策略的改变	49
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	49
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	49
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	49
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况	49
10.9 其他重大事件	55
11 影响投资者决策的其他重要信息	55
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	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	55
12 备查文件目录	56
12.1 备查文件目录	56
12.2 存放地点	56
12.3 查阅方式	56

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	信澳颐宁养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)
基金简称	信澳颐宁养老目标一年持有期混合(FOF)
基金主代码	017023
交易代码	017023
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2022年12月29日
基金管理人	信达澳亚基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	223,667,389.84份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金是基金中基金，通过大类资产配置，投资于多种具有不同风险收益特征的基金，寻求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金投资策略主要包括资产配置策略、基金优选策略、股票投资策略、存托凭证投资策略、港股通标的股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、可转换债券及可交换债券投资策略。
业绩比较基准	中证综合债券指数收益率*80%+中证800指数收益率*18%+中证港股通综合指数收益率*2%
风险收益特征	本基金为混合型基金中基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金、股票型基金中基金，高于债券型基金、债券型基金中基金、货币市场基金及货币型基金中基金。 本基金投资港股通标的股票的，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。

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		信达澳亚基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	黄晖	王小飞
	联系电话	0755-83172666	021-60637103
	电子邮箱	service@fscinda.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400-8888-118	021-60637228
传真		0755-83196151	021-60635778

注册地址	广东省深圳市南山区粤海街道海珠社区科苑南路2666号中国华润大厦L1001	北京市西城区金融大街25号
办公地址	广东省深圳市南山区粤海街道科苑南路2666号中国华润大厦10层	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码	518054	100033
法定代表人	朱永强	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.fscinda.com
基金中期报告备置地点	广东省深圳市南山区粤海街道科苑南路 2666 号中国华润大厦 10 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	信达澳亚基金管理有限公司	广东省深圳市南山区粤海街道科苑南路 2666 号中国华润大厦 10 层

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（2023年1月1日至2023年6月30日）
本期已实现收益	403,775.71
本期利润	1,516,066.88
加权平均基金份额本期利润	0.0068
本期加权平均净值利润率	0.67%
本期基金份额净值增长率	0.67%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)
期末可供分配利润	396,663.11
期末可供分配基金份额利润	0.0018
期末基金资产净值	225,176,508.45

期末基金份额净值	1.0067
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)
基金份额累计净值增长率	0.67%

注：1、上述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的认购、申购及赎回费等），计入费用后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、期末可供分配利润为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。

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

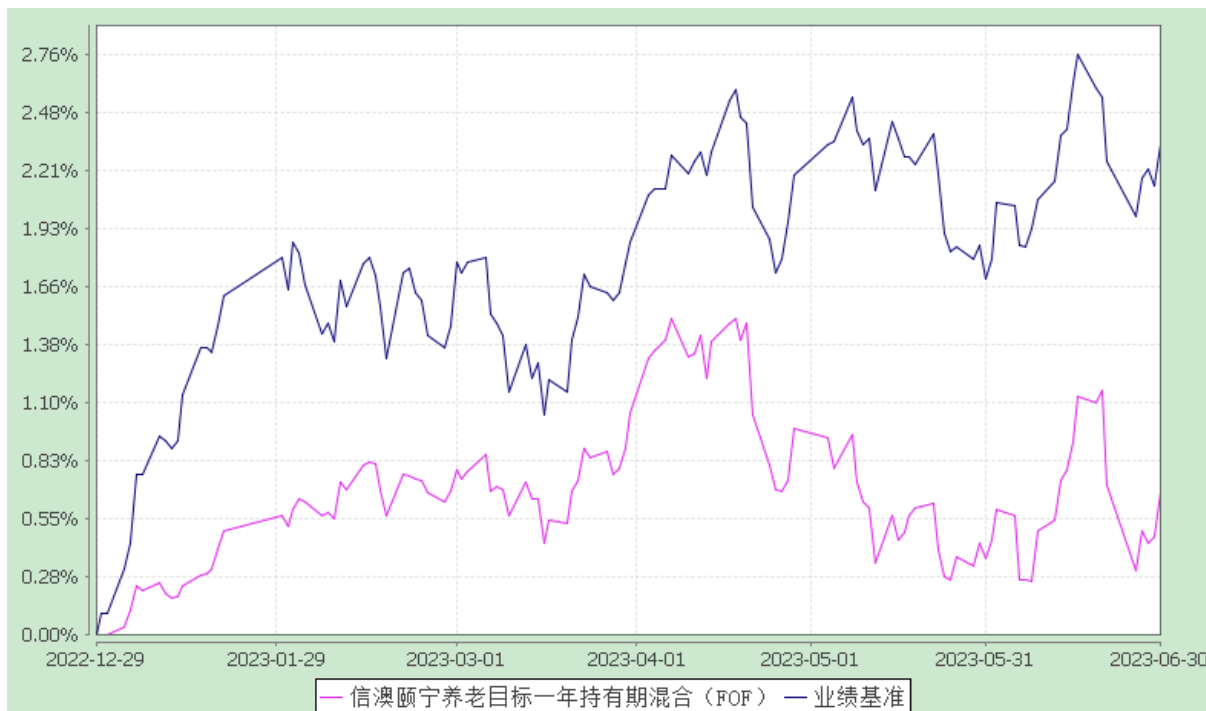
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.31%	0.20%	0.63%	0.16%	-0.32%	0.04%
过去三个月	-0.38%	0.17%	0.46%	0.16%	-0.84%	0.01%
过去六个月	0.67%	0.13%	2.23%	0.16%	-1.56%	-0.03%
自基金合同生效起至今	0.67%	0.13%	2.33%	0.16%	-1.66%	-0.03%

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

信澳颐宁养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2022年12月29日至2023年6月30日）



注：1、本基金合同于 2022 年 12 月 29 日生效，自合同生效日起至披露时点未满一年。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起的 6 个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项资产配置比例将符合基金合同中的相关约定。

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

本基金管理人信达澳亚基金管理有限公司（原“信达澳银基金管理有限公司”，以下简称“公司”）成立于 2006 年 6 月 5 日，注册资本 1 亿元人民币，公司总部设在中国深圳，在北京和上海设有分公司，是由中国信达资产管理股份有限公司和澳大利亚联邦银行全资子公司设立的合资公司，是经中国证监会批准（批准文号：中国证监会证监基金字[2006]71 号文）设立的国内首家由国有资产管理公司控股的基金管理公司。2015 年 5 月 22 日，信达证券股份有限公司受让中国信达资产管理股份有限公司持有的股权，与 East Topco Limited 共同持有公司股份，持股比例分别为 54% 和 46%。2022 年 3 月 21 日，由于公司外方股东的实控人变更，以及公司国际化发展战略需要，公司正式更名为信达澳亚基金管理有限公司。

公司建立了健全的法人治理结构，根据《中华人民共和国公司法》的规定设立了股东会、董事

会和执行监事。董事会层面设立风险控制委员会和薪酬考核委员会两个专门委员会，并建立了独立董事制度。公司实行董事会领导下的总经理负责制,由总经理负责公司的日常运作,并由各委员会包括经营管理委员会、投资审议委员会、风险管理委员会、产品审议委员会、IT治理委员会、运营委员会、市场销售管理委员会、问责委员会等协助其议事决策。

公司建立了完善的组织架构，设立了权益投资总部、混合资产投资部、固收投资总部、智能量化与全球投资部、市场销售部、机构销售总部、银行机构总部、互联网金融部、战略客户部、市场支持部、投资管理部、产品创新部、运营管理总部、风险控制部、行政人事部、财务会计部、监察稽核部、董事会办公室等部门，各部门分工协作，职责明确。

截至 2023 年 6 月 30 日，公司共管理 54 只基金，包括信澳转型创新股票型证券投资基金、信澳新能源产业股票型证券投资基金、信澳先进智造股票型证券投资基金、信澳蓝筹精选股票型证券投资基金、信澳健康中国灵活配置混合型证券投资基金、信澳新目标灵活配置混合型证券投资基金、信澳新财富灵活配置混合型证券投资基金、信澳新起点定期开放灵活配置混合型证券投资基金、信澳核心科技混合型证券投资基金、信澳科技创新一年定期开放混合型证券投资基金、信澳研究优选混合型证券投资基金、信澳匠心臻选两年持有期混合型证券投资基金、信澳周期动力混合型证券投资基金、信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF)、信澳量化先锋混合型证券投资基金(LOF)、信澳领先增长混合型证券投资基金、信澳精华灵活配置混合型证券投资基金、信澳中小盘混合型证券投资基金、信澳红利回报混合型证券投资基金、信澳产业升级混合型证券投资基金、信澳消费优选混合型证券投资基金、信澳星奕混合型证券投资基金、信澳至诚精选混合型证券投资基金、信澳医药健康混合型证券投资基金、信澳新能源精选混合型证券投资基金、信澳领先智选混合型证券投资基金、信澳品质回报 6 个月持有期混合型证券投资基金、信澳成长精选混合型证券投资基金、信澳恒盛混合型证券投资基金、信澳价值精选混合型证券投资基金、信澳优势价值混合型证券投资基金、信澳景气优选混合型证券投资基金、信澳慧管家货币市场基金、信澳慧理财货币市场基金、信澳安益纯债债券型证券投资基金、信澳安盛纯债债券型证券投资基金、信澳鑫安债券型证券投资基金(LOF)、信澳信用债债券型证券投资基金、信澳鑫益债券型证券投资基金、信澳优享债券型证券投资基金、信澳产业优选一年持有期混合型证券投资基金、信澳远见价值混合型证券投资基金、信澳智选先锋一年持有期混合型证券投资基金、信澳业绩驱动混合型证券投资基金、信澳匠心严选一年持有期混合型证券投资基金、信澳鑫享债券型证券投资基金、信澳汇智优选一年持有期混合型证券投资基金、信澳汇享三个月定期开放债券型证券投资基金、信澳颐宁养老目标一年持有期混合型基金中基金、信澳聚优智选混合型证券投资基金、信澳优享生活混合型证券投资基金、信澳汇鑫两年封闭式债券型证券投资基金、信澳优势产业混合型证券投资基金、信澳博见成长一年定期开放混合型

证券投资基金。

报告期内，公司第六届董事会独立董事宋若冰先生以参加董事会会议、邮件、现场与管理层沟通、通讯表决董事会决议、审阅公司重要报告和提交工作报告等方式履行职责，报告期内累计履职时间达到法定要求；独立董事杨棉之先生以参加董事会会议、邮件、现场与管理层邮件沟通、通讯表决董事会决议、审阅公司重要报告和提交工作报告等方式履行职责，报告期内累计履职时间达到法定要求；独立董事屈文洲先生以参加董事会会议、通讯表决董事会决议和风险控制委员会决议、审阅公司重要报告和提交工作报告等方式履行职责，报告期内累计履职时间达到法定要求。

报告期内，公司及基金运作未发生重大利益冲突事件，独立董事在履职过程中未发现公司存在损害基金份额持有人利益的行为。

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		
王兰	本基金的基金经理	2022-12-29	-	13.5 年	中南大学工商管理专业硕士。2009 年 9 月至 2014 年 10 月，就职于金鹰基金基金管理有限公司，历任研究部固定收益分析师、债券交易员。2014 年 11 月加入信达澳亚基金管理有限公司，历任投资经理，现任信澳颐宁养老目标一年持有期混合型基金（FOF）基金经理（2022 年 12 月 29 日起至今）。

注：1、基金经理的任职日期、离任日期为根据公司决定确定的任职或离任日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会从业人员资格管理办法的相关规定等。

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《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益，没有发生损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人已经建立了投资决策及交易内控制度，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，维护投资者的利益。本基金管理人建立了严谨的公平交易机制，确保不同基金在买卖同一证券时，按照比例分配的原则在各基金间公平分配交易量。公司对报告期内公司所管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行了分析；利用数据统计和重点审查价差原因相结合的方法，对连续四个季度内、不同时间窗口（日内、3日内、5日内）公司管理的不同投资组合向交易价差进行了分析；对部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易进行了审核和监控，未发现公司所管理的投资组合存在违反公平交易原则的情形。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内，本公司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出现超过该证券当日成交量的 5% 的情况。投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易，未导致不公平交易和利益输送。

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

今年上半年 A 股市场的分化还是非常明显的，整个市场在经历 1 月的快速上涨后，2 月以来各大指数陆续开启回调，其中，万得全 A、沪深 300、创业板指在 2 月就开始调整了，上证综指于 5 月 9 初达到年内高点后开启回调。端午节期间海外地缘事件和美联储鹰派的表态都影响了市场的风险偏好，而国内方面，经济在一季度的恢复性增长后修复动能减弱，4 月底开始市场博弈政策的情绪较浓，AI 主题相关行业跌幅明显，周期板块、军工、新能源等前期跌幅较大的行业有一定的反弹。6 月更是进入了加速轮动的阶段。在经济复苏较弱的阶段，市场主要还是在主题交易和政策博弈之间轮换。

同时，中国经济不及预期而美国经济好于预期，带动本轮人民币贬值，而美联储放鹰和中国央行降息又进一步加大了人民币贬值压力。在汇率持续贬值且国内刺激政策低于预期的情况下，导致市场整体情绪偏悲观。但目前的汇率已经是近 10 年以来的极低水平，市场逐渐开始预期汇率企稳。后续汇率方面的负面影响将会逐渐降低。

6 月制造业 PMI 小幅回升 0.2% 至 49%，已经连续三个月位于荣枯线下方，但结束了自 2 月以来环比下降的态势，基本面恶化最快的时间已近尾声。6 月规模以上工业企业利润同比增长-8.4%，5 月为-12.4%。量升价跌，利润率有所回升。同时，近期会议在方向上出现了重大变化，除了定调超预期而外，对于房地产等问题及地方隐性债务风险的态度有明显的方向性变化，后续住建部也快速反应，表明要进一步落实好降低购买首套住房首付比例和贷款利率、改善性住房换购税费减免、个

人住房贷款“认房不用认贷”等政策措施，有效的提振了市场的风险偏好。

当前沪深 300、中证 500 的风险溢价率均在历史均值之上，尤其是沪深 300 在一倍标准差附近，具备较好的配置性价比。从国内市场来看，大家对于经济悲观的预期已经打得比较足了，所以应该说整个权益市场的下行风险已经比较可控，整体不具备一个加速下行的条件。而且我们可以预期后续伴随着政策的推动和经济的复苏会有一个比较好的表现。

结构上，后续的配置方向可能相较于前期哑铃型（AI+中特估）的策略来说要应该更均衡一点。AI 作为全年主线，近期调整较为明显，一些细分子版块又到了具备配置价值的位置。科技方面逐渐向半导体产业链倾斜，该板块处于周期见底位置叠加国产替代逻辑支撑，结合前期调整，也具备配置价值。新能源板块前期的持续调整主要源于市场对产能过剩的担忧以及筹码结构的问题，但大储、充电桩等基本面较强的细分板块当前性价比较高。同时，近期促进汽车消费的利好消息不断，也是未来政策可期待的一个方向，新能源汽车的需求或将持续回暖，新能车的电动智能化仍是长期趋势，增加了新能源车以及汽车零部件等方向上的配置。伴随着政策的博弈，将迎来包括顺周期板块的配置机会。同时，伴随着夏季高温用电旺季，火电及煤炭需求较好，相关行业 3 季度安全性较高。医药近期受反腐的影响，下跌明显，但估值、基本面等都处于底部，在短期利空消化之后将加大该板块的配置。组合相较于此前更加均衡。

债券方面，今年以来债券市场经历了先上后下的过程，1-2 月处于经济数据的空窗期，市场对疫后经济复苏的预期较强，债市提前为经济复苏定价。进入 3 月，政府工作报告确定全年增长目标 5% 左右，再叠加 2 月通胀也不及预期，债市对经济的强复苏预期转为温和复苏预期。4 月以来部分中小银行下调存款利率，引发降息预期短暂升温叠加资金面转松，基金及理财交易热度较高，带动利率快速下行。6 月降息博弈结束，短期利率有所上升，但中长期看经济修复预期难以快速扭转，资金也难大幅收紧，市场流动性依然较为充裕。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.0067 元，份额累计净值为 1.0067 元，本报告期内，本基金份额净值增长率为 0.67%，同期业绩比较基准收益率为 2.23%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前利率处于历史及今年以来的低位，我们认为利率继续下行面临一定的不确定性，但经济偏弱，市场预期 3 季度仍有降准的可能，收益率大幅向上的风险也相对有限，市场可能还是维持震荡格局。因此未来一段时间市场可能还是处于一个上有顶下有底的震荡格局当中。所以在债券的持仓策略上，我们还是偏向短久期高评级的品种，同时也会在策略上去做一个分散。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

(1) 有关参与估值流程各方及人员（或小组）的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

本基金管理人设立了专项的估值小组，主要职责是决策制定估值政策和估值程序。小组成员具有估值核算、投资研究、风险管理等方面的专业经验。本小组设立基金估值小组负责人一名，由主管运营工作的公司领导担任；基金估值小组成员若干名，由权益投资总部、混合资产投资部、风险控制部、监察稽核部及基金运营部指定专人并经经营管理委员会审议通过后担任，其中基金运营部负责组织小组工作的开展。

(2) 基金经理参与或决定估值的程度

基金经理对基金的估值原则和估值程序可以提出建议，但不参与最终决策和日常估值工作。估值政策和程序、估值调整等与基金估值有关的业务，由基金估值小组采用集体决策方式决定。

(3) 参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方不存在任何重大利益冲突。

(4) 已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

本基金管理人未签订任何有关本基金估值业务的定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规和基金合同要求，本基金管理人可以根据基金实际运作情况进行利润分配。

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

无。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支、等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

本托管人复核审查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。

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：信澳颐宁养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）

报告截止日：2023年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,502,914.81	89,652,321.55
结算备付金		88,527.41	-
存出保证金		5,552.73	-
交易性金融资产	6.4.7.2	223,798,461.98	-
其中：股票投资		-	-
基金投资		211,260,866.14	-
债券投资		12,537,595.84	-
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	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-

资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
应收清算款		-	134,000,000.00
应收股利		0.08	-
应收申购款		2,396.05	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	12,678.24	-
资产总计		225,410,531.30	223,652,321.55
负债和净资产	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022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		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		121,978.02	8,578.29
应付托管费		30,221.97	2,450.94
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	81,822.86	-
负债合计		234,022.85	11,029.23
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	223,667,389.84	223,648,404.03
未分配利润	6.4.7.8	1,509,118.61	-7,111.71
净资产合计		225,176,508.45	223,641,292.32
负债和净资产总计		225,410,531.30	223,652,321.55

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，信澳颐宁养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）基金份额净值 1.0067 元，基金份额总额 223,667,389.84 份。

6.2 利润表

会计主体：信澳颐宁养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
----	-----	---------------------------------------

一、营业总收入		2,506,345.67
1.利息收入		8,562.71
其中：存款利息收入	6.4.7.9	7,838.04
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		724.67
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,372,813.55
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-
基金投资收益	6.4.7.11	226,053.34
债券投资收益	6.4.7.12	25,144.28
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.13	-
股利收益	6.4.7.14	1,121,615.93
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）	6.4.7.15	1,112,291.17
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	12,678.24
减：二、营业总支出		990,278.79
1. 管理人报酬		722,702.87
2. 托管费		181,579.29
3. 销售服务费		-
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-
7. 税金及附加		128.77
8. 其他费用	6.4.7.19	85,867.86
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,516,066.88
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,516,066.88
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		1,516,066.88

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：信澳颐宁养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）

本报告期：2023年1月1日至2023年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	223,648,404.03	-7,111.71	223,641,292.32
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	223,648,404.03	-7,111.71	223,641,292.32
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	18,985.81	1,516,230.32	1,535,216.13
（一）、综合收益总额	-	1,516,066.88	1,516,066.88
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	18,985.81	163.44	19,149.25
其中：1.基金申购款	18,985.81	163.44	19,149.25
2.基金赎回款	-	-	-
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	223,667,389.84	1,509,118.61	225,176,508.45

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：

朱永强

朱永强

刘玉兰

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

信澳颐宁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[2022]2303号《关于准予信澳颐宁养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)注册的批复》核准,由信达澳亚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《信澳颐宁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223,569,770.40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(2022)第1078号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《信澳颐宁养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)基金合同》于2022年12月29日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为223,648,404.03份,其中认购资金利息折合78,633.63份基金份额。本基金的基金管理人为信达澳亚基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司(“建设银行”)。

本基金对每份基金份额设置一年的最短持有期。对于每份基金份额,最短持有期起始日指基金合同生效日(对认购份额而言)或基金份额申购确认日(对申购份额而言)。在最短持有期到期日之前(不含当日),投资者不能提出赎回或转换转出申请;最短持有期到期日起(含当日)投资者可以申请赎回或转换转出。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《信澳颐宁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的证券投资基金(包括QDII基金、香港互认基金及其他经中国证监会依法核准或注册的基金)、国内依法发行上市的股票(包括创业板及其他经中国证监会核准上市的股票及存托凭证)、港股通标的股票、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债券、政府支持机构债、中期票据、可转换债券(含可分离交易可转债的纯债部分)、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、货币市场工具、同业存单、银行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的投资组合比例为:本基金投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金份额的资产不低于基金资产的80%;投资于股票(含存托凭证)、股票型基金、混合型基金和商品基金(含商品期货基金和黄金ETF)等品种的比例合计不超过30%;投资于港股通标的股票不超过股票资产的50%。本基金保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：中证综合债券指数收益率*80%+中证 800 指数收益率*18%+中证港股通综合指数收益率×2%。

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》、《信澳颐宁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。

6.4.3 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 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产(基金净值)变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。本财务报表的实际编制期间为 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日和 2022 年 12 月 29 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金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。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债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。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。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，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

(2) 该金融资产已转移，且本基金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；或者(3) 该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具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其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，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) 当金融工具不存在活跃市场，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。采用估值技术时，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，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。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。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征:(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利, 这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产; 这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位, 并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量;(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别, 即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具, 且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权;(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别), 所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征, 并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同); (4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外, 该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征;(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额, 应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具, 是指根据合同约定, 持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利, 或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时, 自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同:(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响); (2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具, 列报于净资产。

6.4.4.8 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(基金净值)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(基金净值)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认列, 并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，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由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

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。

6.4.4.11 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。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产(基金净值)转出。

6.4.4.12 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。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估

值结果确定公允价值。

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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会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[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]127号《财政部国家税务总局证监会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》、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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利, H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请,由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册, H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利,由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票,按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	1,502,914.81
等于: 本金	1,502,661.27
加: 应计利息	253.54
定期存款	-
等于: 本金	-
加: 应计利息	-
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	-
合计	1,502,914.81

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	-	-	-	-	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	12,402,304.00	114,035.84	12,537,595.84	21,256.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	12,402,304.00	114,035.84	12,537,595.84	21,256.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	210,169,830.97	-	211,260,866.14	1,091,035.17	
其他	-	-	-	-	
合计	222,572,134.97	114,035.84	223,798,461.98	1,112,291.17	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本期末无衍生金融资产/负债。

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

本基金本期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本期无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2023年6月30日
应收利息	-
其他应收款	12,678.24
待摊费用	-
合计	12,678.24

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023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	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	81,822.86
合计	81,822.86

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	223,648,404.03	223,648,404.03
本期申购	18,985.81	18,985.81
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	223,667,389.84	223,667,389.84

注：本期申购中包含转入份额及金额，本期赎回中包含转出份额及金额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-7,111.71	-	-7,111.71
本期利润	403,775.71	1,112,291.17	1,516,066.88
本期基金份额交易产生的变动数	-0.89	164.33	163.44
其中：基金申购款	-0.89	164.33	163.44
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	396,663.11	1,112,455.50	1,509,118.61

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	7,487.01
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	330.08
其他	20.95
合计	7,838.04

6.4.7.10 股票投资收益

本基金本期无股票投资收益。

6.4.7.11 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	69,501,672.04
减：卖出/赎回基金成本总额	69,253,637.62
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	1,073.08
减：交易费用	20,908.00
基金投资收益	226,053.34

6.4.7.12 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	25,144.28
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
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	25,144.28

6.4.7.13 衍生工具收益

本基金本期无衍生工具收益。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	-
其中：证券出借权益补偿收入	-

基金投资产生的股利收益	1,121,615.93
合计	1,121,615.93

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1.交易性金融资产	1,112,291.17
——股票投资	-
——债券投资	21,256.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	1,091,035.17
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	1,112,291.17

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	-
其他	12,678.24
合计	12,678.24

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% 归入基金资产即为基金赎回费收入。

2、本基金的转换费由赎回费和申购费补差两部分构成，其中不低于赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产即为基金转换费收入。

3、其他为销售费返还收入。

6.4.7.17 持有基金产生的费用

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	50,905.49
当期持有基金产生的应支付管理费	512,366.25

(元)	
当期持有基金产生的应支付托管费	133,026.67
(元)	

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本期无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	22,315.49
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行结算费用	4,045.00
合计	85,867.86

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

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告批准报出日，本基金无需要说明的资产负债表日后事项。

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
信达澳亚基金管理有限公司（“信达澳亚基金公司”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人
信达证券股份有限公司（“信达证券”）	基金管理人的控股股东、基金代销机构
East Topco Limited	基金管理人的股东
信达新兴财富（北京）资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司
中国信达资产管理股份有限公司	对公司法人股东直接持股 20% 以上的股东

注：1、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。

2、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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

本基金本期无关联方交易单元进行的交易。

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 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	722,702.87
其中：支付销售机构的客户维护费	221,986.88

注：支付基金管理人信达澳亚基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.70% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.70%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	181,579.29

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.20%/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

本基金本期无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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

本基金本期无与关联方进行转融通证券出借交易。

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

份额单位：份

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
报告期初持有的基金份额	30,001,700.00
报告期间申购/买入总份额	-
报告期间因拆分变动份额	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-
报告期末持有的基金份额	30,001,700.00
报告期末持有的基金份额占基	13.41%

金总份额比例	
--------	--

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
信达证券股份有限公司	7,899,355.50	3.53%	7,899,355.50	3.53%

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	
	2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
建设银行	1,502,914.81	7,487.01

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期无在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 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	本期费用	
	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）		1,000.00
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）		12,711.39
当期持有基金产生的应支付管理费（元）		42,807.38
当期持有基金产生的应支付托管费（元）		12,984.61

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配情况。。

6.4.12 期末（2023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

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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

截至本报告期末 2023 年 06 月 30 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额，无作为质押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 06 月 30 日止，本基金无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，无抵押债券。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，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。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2023 年 06 月 30 日，本基金未持有从事转融通证券出借业务交易的证券。

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（FOF），理论上预期风险与预期收益水平低于股票型基金、股票型基金中基金（FOF），高于债券型基金、债券型基金中基金（FOF）、货币市场基金和货币型基金中基金（FOF）。日常经营活动中本基金面临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在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人秉承全面风险管理的理念，将风险管理融入业务中，建立了由董事会风险控制委员会、经营层风险管理委员会、督察长、风险控制部、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。在董事会下设立风险控制委员会，负责审定重大风险管理战略、风险政策和风险控制制度；在经营层面设立风险管理委员会，对公司风险管理和控制政策、程序的制定、风险限额的设定等提出意见和建议，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

面的风险控制主要由风险控制部、监察稽核部负责督促与协调，各业务部门负责人为其所在部门的风险管理第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控和及时报告的义务，员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。

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行中国建设银行及其他股份制银行，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，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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	12,537,595.84	-
合计	12,537,595.84	-

注：1、未评级债券为国债。

2、短期债券为债券发行日至到期日的期间在1年以内（含1年）的债券。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。

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。

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。

本基金除在本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中列示的部分基金资产流通暂时受限制外，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。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。

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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,502,914.81	-	-	-	1,502,914.81
结算备付金	88,527.41	-	-	-	88,527.41
存出保证金	5,552.73	-	-	-	5,552.73
交易性金融资产	12,537,595.84	-	-	211,260,866.14	223,798,461.98
应收股利	-	-	-	0.08	0.08
应收申购款	-	-	-	2,396.05	2,396.05
其他资产	-	-	-	12,678.24	12,678.24
资产总计	14,134,590.79	-	-	211,275,940.51	225,410,531.30
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	121,978.02	121,978.02
应付托管费	-	-	-	30,221.97	30,221.97
其他负债	-	-	-	81,822.86	81,822.86
负债总计	-	-	-	234,022.85	234,022.85
利率敏感度缺口	14,134,590.79	-	-	211,041,917.66	225,176,508.45
上年度末 2022年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	89,652,321.55	-	-	-	89,652,321.55
应收清算款	-	-	-	134,000,000.00	134,000,000.00
资产总计	89,652,321.55	-	-	134,000,000.00	223,652,321.55
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	8,578.29	8,578.29
应付托管费	-	-	-	2,450.94	2,450.94
负债总计	-	-	-	11,029.23	11,029.23
利率敏感度缺口	89,652,321.55	-	-	133,988,970.77	223,641,292.32

注：上表按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者对金融资产和金融负债的期限予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本报告期末，本基金未持有交易性债券资产，因此市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本报告期内，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。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，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，包括 VaR(Value at Risk)指标等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 2023年6月30日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	-	-	-	-
交易性金融资产—基金投资	211,260,866.14	93.82	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
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	211,260,866.14	93.82	-	-

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 2023年6月30日
第一层次	211,260,866.14
第二层次	12,537,595.84
第三层次	-
合计	223,798,461.98

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有的重要意义的输入所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

6.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于2023年08月30日经本基金的基金管理人批准。

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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	211,260,866.14	93.72
3	固定收益投资	12,537,595.84	5.56
	其中：债券	12,537,595.84	5.56
	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	1,591,442.22	0.71
8	其他各项资产	20,627.10	0.01
9	合计	225,410,531.30	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

本基金本报告期末未持有境内股票。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末未持有港股通股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金报告期末未参与股票投资。

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

本基金报告期末未参与股票投资。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金报告期末未参与股票投资。

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	12,537,595.84	5.57
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	12,537,595.84	5.57

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	019694	23 国债 01	124,000	12,537,595.84	5.57

注：本基金本报告期末仅持有上述债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未参与投资股指期货。

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

本基金未参与投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金未参与投资国债期货。

7.12 本报告期投资基金情况

7.12.1 投资政策及风险说明

本基金为混合型基金中基金，以风险为核心进行分散化资产配置，在此基础上精选基金品种，控制本基金的波动性，从而实现本基金的风险设定目标，力争实现基金资产的长期稳健增值。

本基金主要投资于公开募集证券投资基金的基金份额，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，并面临因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、由于基金投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险、基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险、信用风险，以及基于标的基金特殊性带来的特定风险等。

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	217022	招商产业 债券 A	契约型开 放式	8,997,600. 47	15,439,88 2.41	6.86	否
2	000191	富国信用 债债券 A/B	契约型开 放式	12,487,71 9.59	15,431,07 5.10	6.85	否
3	003280	鹏华丰恒 债券	契约型开 放式	11,172,95 9.85	12,333,83 0.38	5.48	否
4	004614	鹏扬利泽 债券 A	契约型开 放式	11,115,62 9.54	11,704,75 7.91	5.20	否
5	003265	招商招坤	契约型开	8,078,694.	10,301,95	4.58	否

		纯债债券 A	放式	35	1.04		
6	007529	嘉实汇鑫 中短债债 券 A	契约型开 放式	9,677,703. 84	10,280,62 4.79	4.57	否
7	675100	西部利得 得尊纯债 债券 A	契约型开 放式	9,918,286. 93	10,243,60 6.74	4.55	否
8	006865	泰康安惠 纯债债券 C	契约型开 放式	8,952,551. 48	10,193,37 5.12	4.53	否
9	003949	兴全稳泰 债券 A	契约型开 放式	8,219,193. 74	9,306,593. 07	4.13	否
10	002361	富兰克林 国海恒瑞 债券 A	契约型开 放式	5,645,024. 70	8,140,125. 62	3.61	否
11	007014	嘉合磐泰 短债债券 A	契约型开 放式	7,495,314. 84	8,121,173. 63	3.61	否
12	003030	安信新目 标灵活配 置混合 A	契约型开 放式	5,812,804. 30	8,099,561. 51	3.60	否
13	003327	万家鑫璟 纯债债券 A	契约型开 放式	6,065,133. 62	7,378,841. 56	3.28	否
14	161019	富国天锋	契约型	5,740,120. 56	6,164,315. 47	2.74	否
15	610008	信澳信用 债债券 A	契约型开 放式	4,273,504. 27	5,098,290. 59	2.26	是
16	013168	东方红稳 添利纯债 债券 C	契约型开 放式	4,658,362. 59	5,086,931. 95	2.26	否
17	166105	信达澳银 鑫安债券 (LOF)	契约型开 放式	5,019,076. 31	5,074,286. 15	2.25	是
18	485111	工银瑞信 双利债券 A	契约型开 放式	2,833,900. 23	5,018,837. 31	2.23	否
19	110017	易方达增 强回报债 券 A	契约型开 放式	3,047,464. 78	4,095,792. 66	1.82	否
20	512760	国泰 CES 半导体芯 片行业	交易型开 放式	3,663,100. 00	3,714,383. 40	1.65	否

		ETF					
21	515790	华泰柏瑞 中证光伏 产业 ETF	交易型开 放式	2,215,900. 00	2,754,363. 70	1.22	否
22	512660	国泰中证 军工 ETF	交易型开 放式	2,203,100. 00	2,476,284. 40	1.10	否
23	016600	万家品质 生活灵活 配置混合 C	契约型开 放式	750,103.1 4	2,126,767. 43	0.94	否
24	000584	新华鑫益 灵活配置 混合 C	契约型开 放式	416,051.2 6	2,082,586. 19	0.92	否
25	015208	信澳健康 中国灵活 配置混合 C	契约型开 放式	793,965.8 6	2,020,643. 11	0.90	是
26	000390	华商优势 行业灵活 配置混合	契约型开 放式	1,585,344. 02	1,740,707. 73	0.77	否
27	159928	汇添富中 证主要消 费 ETF	交易型开 放式	1,855,000. 00	1,717,730. 00	0.76	否
28	014106	融通成长 30 灵活配 置混合 C	契约型开 放式	642,549.1 0	1,623,079. 03	0.72	否
29	017167	景顺长城 策略精选 灵活配置 混合 C	契约型开 放式	514,176.7 6	1,513,736. 38	0.67	否
30	515700	平安中证 新能源汽车 产业 ETF	交易型开 放式	744,300.0 0	1,501,253. 10	0.67	否
31	512720	国泰中证 计算机主 题 ETF	交易型开 放式	1,117,100. 00	1,465,635. 20	0.65	否
32	015779	景顺长城 价值边际 灵活配置 混合 C	契约型开 放式	1,094,246. 28	1,465,524. 04	0.65	否
33	516970	广发中证 建设工程 ETF	交易型开 放式	1,193,200. 00	1,447,351. 60	0.64	否

34	016090	中泰玉衡 价值优选 灵活配置 混合 C	契约型开 放式	621,990.7 8	1,317,998. 46	0.59	否
35	512010	易方达沪 深 300 医 药卫生 ETF	交易型开 放式	3,035,500. 00	1,290,087. 50	0.57	否
36	159865	国泰中证 畜牧养殖 ETF	交易型开 放式	1,766,600. 00	1,218,954. 00	0.54	否
37	512800	华宝中证 银行 ETF	交易型开 放式	1,114,200. 00	1,196,650. 80	0.53	否
38	010055	万家健康 产业混合 C	契约型开 放式	1,115,747. 41	1,159,484. 71	0.51	否
39	008270	大成睿享 混合 C	契约型开 放式	728,312.1 9	1,030,634. 58	0.46	否
40	005496	创金合信 科技成长 主题股票 C	契约型开 放式	511,556.8 2	1,010,427. 03	0.45	否
41	015773	招商移动 互联网产 业股票 C	契约型开 放式	674,048.8 2	992,941.3 2	0.44	否
42	005763	中欧电子 信息产业 沪港深股 票 C	契约型开 放式	346,878.5 7	966,993.3 9	0.43	否
43	000893	工银瑞信 创新动力 股票	契约型开 放式	884,938.3 0	945,999.0 4	0.42	否
44	516010	国泰中证 动漫游戏 ETF	交易型开 放式	643,900.0 0	938,162.3 0	0.42	否
45	015608	信澳转型 创新股票 C	契约型开 放式	1,009,081. 74	929,364.2 8	0.41	是
46	014833	汇添富盈 鑫灵活配 置混合 C	契约型开 放式	473,484.8 5	910,037.8 8	0.40	否
47	007790	南方梦元 短债债券 A	契约型开 放式	703,780.8 9	775,566.5 4	0.34	否

48	516110	国泰中证800汽车与零部件ETF	交易型开放式	481,200.00	503,335.20	0.22	否
49	517090	国泰富时中国国企开放共赢ETF	交易型开放式	375,000.00	478,875.00	0.21	否
50	512200	南方中证全指房地产ETF	交易型开放式	701,500.00	430,019.50	0.19	否
51	000681	信澳慧管家货币A	契约型开放式	1,436.29	1,436.29	0.00	是

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内没有被监管部门立案调查，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.13.2 本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股票库的情形。

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	5,552.73
2	应收清算款	-
3	应收股利	0.08
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,396.05
6	其他应收款	12,678.24
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,627.10

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票未存在流通受限情况。

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

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
1,253	178,505.50	112,678,999.38	50.38%	110,988,390.46	49.62%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	1,182,459.22	0.53%

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	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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2022年12月29日）基金份额总额	223,648,404.03
本报告期期初基金份额总额	223,648,404.03
本报告期基金总申购份额	18,985.81
减：本报告期基金总赎回份额	-
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	223,667,389.84

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，未召开基金份额持有人大会，未有相关决议。

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

本报告期内，本基金管理人经第六届董事会第六次会议决定，自2023年1月起黄晖女士担任公司督察长兼董事会秘书，徐伟文先生担任公司首席信息官，公司总经理朱永强先生不再兼任首席信息官。第六届董事会第十次会议决定，自2023年3月起，王咏辉先生离任公司副总经理。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门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

报告期内，未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内，未发生基金投资策略的改变。

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

本报告期内，本基金未改聘会计师事务所。

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

本报告期内，未发生管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	----	------	-----------	----

	单元 数量	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	
安信证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	4	-	-	-	-	新增 2 个
财信证券	2	-	-	-	-	新增 1 个
川财证券	1	-	-	-	-	-
东方财富	2	-	-	-	-	-
东方证券	3	-	-	-	-	-
东海证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	3	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	4	-	-	-	-	新增 2 个
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	新增 1 个
红塔证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	3	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	3	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
汇丰前海	1	-	-	-	-	-
江海证券	2	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	-
申港证券	3	-	-	-	-	新增 2 个
申万宏源	2	-	-	-	-	-
世纪证券	2	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-

太平洋证券	4	-	-	-	-	-
天风证券	3	-	-	-	-	-
五矿证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	5	-	-	-	-	-
兴业证券	3	-	-	-	-	-
野村东方	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	3	-	-	-	-	新增 1 个
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
中信证券（华南）	0	-	-	-	-	-
中信证券（山东）	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-

注：根据《交易单元及佣金管理办法》、《投资审议委员会议事规则》的规定，交易单元开设、增设或退租由研究咨询部提议，经公司投资审议委员会审议。在分配交易量方面，公司制订合理的评分体系，相关投资研究人员于每个季度最后20个工作日对提供研究报告的证券公司的研究水平、服务质量等综合情况通过投研管理系统进行评比打分。交易管理部根据上季度研究服务评分结果安排研究机构交易佣金分配，每季度佣金分配量应与上季度研究服务评分排名基本匹配，并确保券商研究机构年度佣金分配量与全年合计研究服务评分排名基本匹配。

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
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

渤海 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
财通 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
财信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
川财 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东方 财富	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东方 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东海 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
方正 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
光大 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
广发 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国都 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国海 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国金 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国联 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰 君安	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
海通 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
红塔 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-

华安 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华创 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华金 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华西 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
汇丰 前海	-	-	-	-	-	-	-	-	-
江海 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
金元 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
开源 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
民生 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
平安 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
山西 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
申港 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
申万 宏源	-	-	-	-	-	-	-	-	-
世纪 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
首创 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
太平 洋证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
天风 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
五矿 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
西部 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
西南	-	-	-	-	-	-	-	-	-

证券									
新时代证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
野村东方	-	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	12,402,304.00	100.00%	1,000,000.00	100.00%	-	-	25,886,596.01	86.37%	
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	4,084,974.40	13.63%	
中信证券（华南）	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券（山东）	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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	信达澳亚基金管理有限公司关于提醒投资者谨防虚假客服电话诈骗的提示性公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2023-01-10
2	信达澳亚基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2023-01-14
3	信澳颐宁养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）开放申购及定期定额投资业务的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2023-02-03
4	信达澳亚基金管理有限公司关于对个人投资者通过超级现金宝交易实施费率优惠的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2023-02-15
5	信达澳亚基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2023-03-25
6	信达澳亚基金管理有限公司关于对个人投资者通过直销网上交易汇款交易业务实施费率优惠的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2023-04-18
7	信澳颐宁养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）2023年第一季度报告	证监会信息披露网站、公司网站	2023-04-20
8	信达澳亚基金管理有限公司关于提醒客户及时更新身份证件及非自然人客户及时登记受益所有人信息的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2023-06-21

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

报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

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、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《信澳颐宁养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》；
- 3、《信澳颐宁养老目标一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；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、本报告期内公开披露的基金资产净值、基金份额净值及其他临时公告；
- 8、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公场所、营业场所及网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查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。

客户服务中心电话：400-8888-118

网址：www.fscinda.com

信达澳亚基金管理有限公司

二〇二三年八月三十一日