

东方红养老目标日期 2045 五年持有期混合  
型发起式基金中基金（FOF）  
2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：上海东方证券资产管理有限公司

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 28 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。

本基金自 2023 年 11 月 3 日（含）起针对个人养老金投资基金业务单独增设 Y 类基金份额，原份额转为 A 类基金份额，供非个人养老金投资基金业务的投资者投资。Y 类基金份额于 2023 年 11 月 3 日开始办理申购业务并生效，本报告中本基金 Y 类份额的“基金合同生效日”特指 2023 年 11 月 3 日。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
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
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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内容的真实、准确和完整发表意见	15
<b>§ 6 半年度财务会计报告 (未经审计)</b>	<b>15</b>
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	19
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>42</b>
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	43
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	44

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	44
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	44
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	44
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	44
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	44
7.12	本报告期投资基金情况	44
7.13	投资组合报告附注	52
<b>§ 8</b>	<b>基金份额持有人信息</b>	<b>53</b>
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	53
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	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	53
8.4	发起式基金发起资金持有份额情况	54
<b>§ 9</b>	<b>开放式基金份额变动</b>	<b>54</b>
<b>§ 10</b>	<b>重大事件揭示</b>	<b>55</b>
10.1	基金份额持有人大会决议	55
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	55
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	55
10.4	基金投资策略的改变	55
10.5	本报告期持有的基金发生的重大影响事件	55
10.6	为基金进行审计的会计师事务所情况	55
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	55
10.8	基金租用证券公司交易单元的有关情况	55
10.9	其他重大事件	56
<b>§ 11</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息</b>	<b>57</b>
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	57
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	57
<b>§ 12</b>	<b>备查文件目录</b>	<b>57</b>
12.1	备查文件目录	57
12.2	存放地点	58
12.3	查阅方式	58

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	东方红养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)	
基金简称	东方红养老目标 2045 五年持有混合发起 (FOF)	
基金主代码	016242	
基金运作方式	<p>契约型开放式、发起式。</p> <p>2045 年 12 月 31 日 (含该日) 前, 本基金每份基金份额设置五年锁定持有期 (因红利再投资所得的份额与原份额适用相同的最短持有期限)。锁定持有期结束后即进入开放持有期, 自其开放持有期首日起才可以办理赎回及转换转出业务。2046 年 1 月 1 日 (含该日) 起, 本基金不再设置锁定持有期。转型前申购的本基金份额至转型日持有基金份额不足五年的, 在转型日之后 (含转型日) 可以提出赎回及转换转出申请, 不受五年持有期限限制。</p>	
基金合同生效日	2022 年 9 月 5 日	
基金管理人	上海东方证券资产管理有限公司	
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	76,663,619.41 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	东方红养老目标 2045 五年持有混合发起 (FOF) A	东方红养老目标 2045 五年持有混合发起 (FOF) Y
下属分级基金的交易代码	016242	019823
报告期末下属分级基金的份额总额	76,509,022.63 份	154,596.78 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金按照预先设定的下滑曲线进行长期资产配置, 在严格控制投资组合风险的前提下, 追求资产净值的长期稳健增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略: 本基金是养老目标日期基金。本基金在预先设定的下滑曲线范围内通过战略资产配置和战术资产配置确定各类资产的配置比例。</p> <p>2、基金投资策略: 本基金将根据基金产品特征, 综合定量和定性两</p>

	个维度优选拟投资基金标的。首先,对全市场基金进行筛选,构建基础基金池,再通过对基础基金池中基金管理人和基金经理的调研情况进一步筛选,构建精选基金池,最后结合市场情况和基金风格构建投资组合,努力获取基金经理优秀管理能力所产生的超额收益。除此以外,本基金还会综合运用股票投资策略,债券投资策略,可转换公司债券、可分离交易可转换债券和可交换债的投资策略,公开发行的证券公司短期公司债券投资策略,资产支持证券投资策略及债券回购杠杆策略等投资策略。
业绩比较基准	<p>沪深 300 指数收益率×X%+85%+恒生指数收益率(经汇率估值调整)×X%+15%+中国债券总指数收益率×(1-X%)</p> <p>X 取值范围如下:</p> <p>基金合同生效日-2025 年 12 月 31 日, X=80</p> <p>2026 年 1 月 1 日-2030 年 12 月 31 日, X=79</p> <p>2031 年 1 月 1 日-2035 年 12 月 31 日, X=75</p> <p>2036 年 1 月 1 日-2040 年 12 月 31 日, X=63</p> <p>2041 年 1 月 1 日-2045 年 12 月 31 日, X=36</p>
风险收益特征	<p>本基金属于采用目标日期策略的基金中基金,2045 年 12 月 31 日为本基金的目标日期。从基金合同生效日至目标日期止,本基金的预期风险与预期收益水平将随着时间逐渐接近目标日期而逐步降低。本基金是一只混合型发起式基金中基金,其预期风险与预期收益高于货币市场基金、货币型基金中基金、债券型基金及债券型基金中基金,低于股票型基金和股票型基金中基金。</p> <p>本基金除了投资 A 股外,还可根据法律法规规定投资香港联合交易所上市股票。除了需要承担与内地证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外,本基金还面临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。</p>

### 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	上海东方证券资产管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	周陶
	联系电话	021-53950806
	电子邮箱	service@dfham.com
客户服务电话	4009200808	95599
传真	021-63326381	010-68121816
注册地址	上海市黄浦区中山南路 109 号 7 层-11 层	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址	上海市黄浦区外马路 108 号供销大厦 7 层-11 层	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	200010	100031
法定代表人	杨斌	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	www.dfham.com

址	
基金中期报告备置地点	上海市黄浦区外马路 108 号供销大厦 7 层

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	上海东方证券资产管理有限公司	上海市黄浦区外马路 108 号供销大厦 7 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(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)	
	东方红养老目标 2045 五年持有混合发起 (FOF) A	东方红养老目标 2045 五年持有混合发起 (FOF) Y
本期已实现收益	-5,645,056.28	-2,785.81
本期利润	243,669.76	386.33
加权平均基金份额本期利润	0.0032	0.0043
本期加权平均净值利润率	0.37%	0.49%
本期基金份额净值增长率	0.35%	0.59%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	-10,632,976.71	-21,097.32
期末可供分配基金份额利润	-0.1390	-0.1365
期末基金资产净值	66,359,763.21	134,490.04
期末基金份额净值	0.8673	0.8699
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	-13.27%	-1.10%

注：1、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。

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，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

### 3.2 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

东方红养老目标 2045 五年持有混合发起 (FOF) 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	-1.90%	0.37%	-2.29%	0.37%	0.39%	0.00%
过去三个月	-0.23%	0.50%	-0.29%	0.59%	0.06%	-0.09%
过去六个月	0.35%	0.62%	1.78%	0.72%	-1.43%	-0.10%
过去一年	-8.19%	0.56%	-6.84%	0.70%	-1.35%	-0.14%
自基金合同生效起至今	-13.27%	0.59%	-9.21%	0.77%	-4.06%	-0.18%

东方红养老目标 2045 五年持有混合发起 (FOF) 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	-1.87%	0.37%	-2.29%	0.37%	0.42%	0.00%
过去三个月	-0.11%	0.50%	-0.29%	0.59%	0.18%	-0.09%
过去六个月	0.59%	0.62%	1.78%	0.72%	-1.19%	-0.10%
自基金合同生效起至今	-1.10%	0.58%	-1.56%	0.69%	0.46%	-0.11%

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×X%×85%+恒生指数收益率（经汇率估值调整）×X%×15%+中国债券总指数收益率×（1-X%）

X 取值范围如下：

基金合同生效日-2025 年 12 月 31 日，X=80

2026 年 1 月 1 日-2030 年 12 月 31 日，X=79

2031 年 1 月 1 日-2035 年 12 月 31 日，X=75



2036 年 1 月 1 日-2040 年 12 月 31 日, X=63

2041 年 1 月 1 日-2045 年 12 月 31 日, X=36

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理, t 日收益率 (benchmarkt) 按下列公式计算:

$$\text{benchmarkt} = X\% \times 85\% \times [\text{t 日沪深 300 指数} / (\text{t-1 日沪深 300 指数}) - 1] + X\% \times 15\% \times [\text{t 日恒生指数} / (\text{t-1 日恒生指数}) - 1] \text{ (经汇率估值调整)} + (1 - X\%) \times [\text{t 日中国债券总指数} / (\text{t-1 日中国债券总指数}) - 1];$$

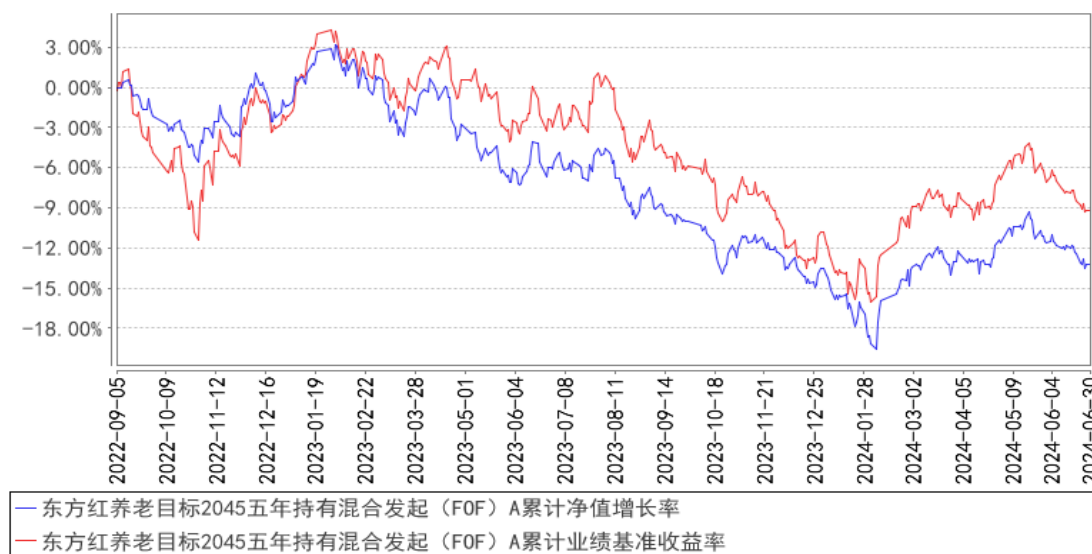
期间 T 日收益率 (benchmarkT) 按下列公式计算:

$$\text{benchmarkT} = [\prod (1 + \text{benchmarkt})] - 1$$
, 其中  $t=1, 2, 3, \dots, T$ , T 表示时间截至日;

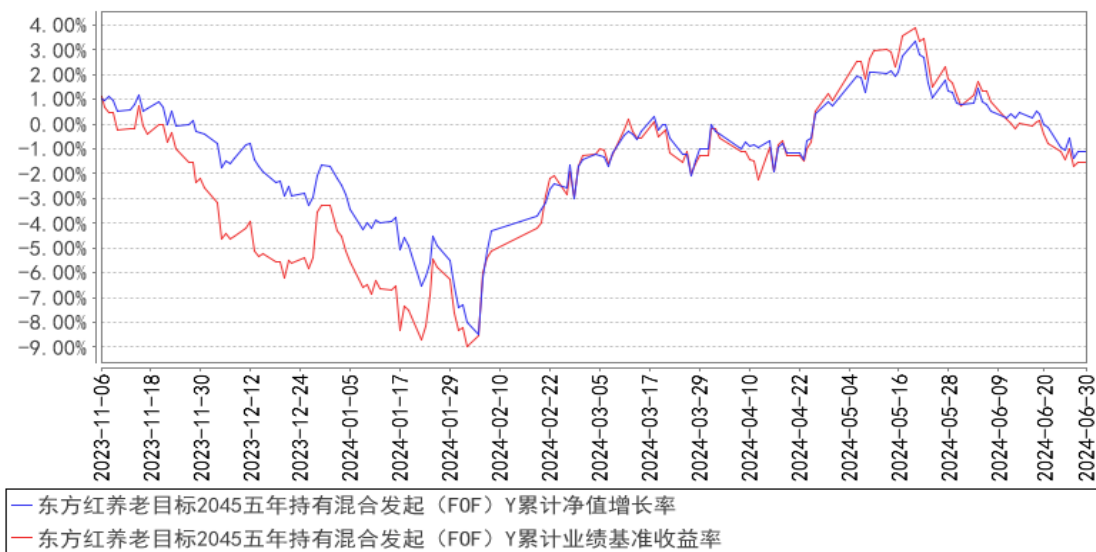
$\prod (1 + \text{benchmarkt})$  表示  $(1 + \text{benchmarkt})$  的数学连乘。

### 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

东方红养老目标2045五年持有混合发起 (FOF) 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



东方红养老目标2045五年持有混合发起 (FOF) 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



## § 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

本基金管理人上海东方证券资产管理有限公司成立于 2010 年 7 月 28 日，是国内首家获中国证监会批准设立的券商系资产管理公司。公司经中国证券监督管理委员会《关于核准东方证券股份有限公司设立证券资产管理子公司的批复》（证监许可[2010]518 号）批准，由东方证券股份有限公司出资 3 亿元在原东方证券资产管理业务总部的基础上成立。2013 年 8 月，公司成为首家获得“公开募集证券投资基金管理业务资格”的证券公司。公司主要业务为证券资产管理业务和公开募集证券投资基金业务。

截至 2024 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理东方红中证竞争力指数发起式证券投资基金、东方红新动力灵活配置混合型证券投资基金、东方红产业升级灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿元三年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红中国优势灵活配置混合型证券投资基金、东方红京东大数据灵活配置混合型证券投资基金、东方红优势精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿轩三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿满沪港深灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、东方红睿华沪港深灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、东方红睿玺三年持有期混合型证券投资基金、东方红睿泽三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红恒元五年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿逸定

期开放混合型发起式证券投资基金、东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金、东方红领先精选灵活配置混合型证券投资基金、东方红稳健精选混合型证券投资基金、东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红价值精选混合型证券投资基金、东方红战略精选沪港深混合型证券投资基金、东方红配置精选混合型证券投资基金、东方红核心优选一年定期开放混合型证券投资基金、东方红创新优选三年定期开放混合型证券投资基金、东方红目标优选三年定期开放混合型证券投资基金、东方红收益增强债券型证券投资基金、东方红汇利债券型证券投资基金、东方红汇阳债券型证券投资基金、东方红信用债债券型证券投资基金、东方红 6 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、东方红稳添利纯债债券型发起式证券投资基金、东方红益鑫纯债债券型证券投资基金、东方红启元三年持有期混合型证券投资基金、东方红聚利债券型证券投资基金、东方红品质优选两年定期开放混合型证券投资基金、东方红安鑫甄选一年持有期混合型证券投资基金、东方红鑫裕两年定期开放信用债债券型证券投资基金、东方红匠心甄选一年持有期混合型证券投资基金、东方红恒阳五年定期开放混合型证券投资基金、东方红均衡优选两年定期开放混合型证券投资基金、东方红启东三年持有期混合型证券投资基金、东方红颐和稳健养老目标两年持有期混合型基金中基金 (FOF)、东方红优质甄选一年持有期混合型证券投资基金、东方红颐和积极养老目标五年持有期混合型基金中基金 (FOF)、东方红益丰纯债债券型证券投资基金、东方红智远三年持有期混合型证券投资基金、东方红颐和平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金 (FOF)、东方红鑫泰 66 个月定期开放债券型证券投资基金、东方红明鉴优选两年定期开放混合型证券投资基金、东方红鼎元 3 个月定期开放混合型发起式证券投资基金、东方红鑫安 39 个月定期开放债券型证券投资基金、东方红招盈甄选一年持有期混合型证券投资基金、东方红启航三年持有期混合型证券投资基金、东方红多元策略混合型证券投资基金、东方红锦丰优选两年定期开放混合型证券投资基金、东方红远见价值混合型证券投资基金、东方红启瑞三年持有期混合型证券投资基金、东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基金中基金 (FOF)、东方红启阳三年持有期混合型证券投资基金、东方红创新趋势混合型证券投资基金、东方红启华三年持有期混合型证券投资基金、东方红启恒三年持有期混合型证券投资基金、东方红启盛三年持有期混合型证券投资基金、东方红启程三年持有期混合型证券投资基金、东方红新海混合型证券投资基金、东方红新源三年持有期混合型证券投资基金、东方红内需增长混合型证券投资基金、东方红安盈甄选一年持有期混合型证券投资基金、东方红锦和甄选 18 个月持有期混合型证券投资基金、东方红智华三年持有期混合型证券投资基金、东方红启兴三年持有期混合型证券投资基金、东方红智选三年持有期混合型证券投资基金、东方红睿和三年定期开放混合型证券投资基金、东方红中证东方红红利低波动指数证券投资基金、东方红锦弘甄选两年持有期混合型证券投资基金、

东方红 ESG 可持续投资混合型证券投资基金、东方红锦融甄选 18 个月持有期混合型证券投资基金、东方红医疗升级股票型发起式证券投资基金、东方红招瑞甄选 18 个月持有期混合型证券投资基金、东方红短债债券型证券投资基金、东方红货币市场基金、东方红民享甄选一年持有期混合型证券投资基金、东方红养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、东方红中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、东方红锦惠甄选 18 个月持有期混合型证券投资基金、东方红共赢甄选一年持有期混合型证券投资基金、东方红先进制造混合型证券投资基金、东方红颐安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金 (FOF)、东方红 30 天滚动持有纯债债券型证券投资基金、东方红欣和积极配置 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF)、东方红 6 个月持有期债券型证券投资基金、东方红中证东方红优势成长指数发起式证券投资基金、东方红远见领航混合型发起式证券投资基金、东方红 3 个月定期开放纯债债券型证券投资基金、东方红季鑫 90 天持有期纯债债券型证券投资基金、东方红 90 天持有期纯债债券型证券投资基金、东方红中债 0-3 年政策性金融债指数证券投资基金、东方红 60 天持有期纯债债券型证券投资基金、东方红慧鑫甄选 6 个月持有期混合型证券投资基金、东方红汇享债券型证券投资基金、东方红智享三年持有期混合型证券投资基金、东方红量化选股混合型发起式证券投资基金，共计 105 只公开募集证券投资基金。

#### 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		
陈文扬	上海东方证券资产管理有限公司基金经理	2022 年 9 月 5 日	-	14 年	上海东方证券资产管理有限公司基金经理，2020 年 06 月至今任 东方红颐和平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金经理、2020 年 06 月至今任东方红颐和积极养老目标五年持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金经理、2020 年 06 月至今任东方红颐和稳健养老目标两年持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金经理、2021 年 03 月至今任东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金经理、2022 年 09 月至今任东方红养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 基金经理、2023 年 05 月至今任东方红颐安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金经理。上海财经大学金融学硕士。曾任上海国利货币经纪有限公司利率衍生产品部经纪人，宁波银行股份有限公司金融市场部交易

					员，南京银行股份有限公司金融市场部高级投资经理，上海东方证券资产管理有限公司固定收益研究员、投资主办人。具备证券投资基金从业资格。
--	--	--	--	--	---

注：1、上述表格内基金首任基金经理“任职日期”指基金合同生效日，“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期；对此后非首任基金经理，基金经理的“任职日期”和“离任日期”均指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的涵义遵从行业协会的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：本基金基金经理本报告期末未兼任私募资产管理计划投资经理。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期，上海东方证券资产管理有限公司作为本基金管理人，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、基金合同以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为，本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

#### 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

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《上海东方证券资产管理有限公司公平交易制度》等规定。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 1 次，为指数投资组合因跟踪指数需要和其他组合发生的反向交易。

#### 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

本产品是面向客户养老资金储备需求所成立的基金中基金 (FOF)，当前以 80% 权益类资产和 20% 固收及其他类资产为中枢进行资产配置。

上半年市场波动比较大，有风险也有机会。产品努力进行回撤控制，但在反弹时对机会的捕

捉还要加强。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,本基金 A 类份额净值为 0.8673 元,份额累计净值为 0.8673 元;Y 类份额净值为 0.8699 元,份额累计净值为 0.8699 元。本报告期基金 A 类份额净值增长率为 0.35%,同期业绩比较基准收益率为 1.78%;Y 类份额净值增长率为 0.59%,同期业绩比较基准收益率为 1.78%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年在宏观经济上主要关注美国的货币政策和国内的内需恢复情况。

美国方面,市场对降息的预期高涨,在资产价格上出现了抢跑,会警惕市场预期在幅度上是否过度。

国内方面,近期政策加大了力度,关注了内需,展现出向好趋势。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算操作实务手册》以及中国证监会发布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定,对基金所持有的投资品种进行估值,本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。基金份额净值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。

本基金管理人对投资品种进行估值时原则上应保持估值程序和技术的一致性,对旗下管理的不同产品持有的具有相同特征的同一投资品种的估值调整原则、程序及技术应当一致(中国证监会规定的特殊品种除外)。为了保障基金能真实、准确地反映投资品种的公允价值,本基金管理人授权估值委员会负责建立健全估值决策体系,估值委员会成员的任命和调整由总经理办公会审议决定。运营部是估值委员会的日常办事机构。本基金管理人估值委员和估值人员均具有专业胜任能力和相关工作经验。

#### 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

报告期内,本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 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—上海东方证券资产管理有限公司 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，上海东方证券资产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，上海东方证券资产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，未发现有关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：东方红养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金 (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
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	3,798,009.41	675,812.09
结算备付金		140,711.88	380,968.21
存出保证金		21,371.94	24,010.19
交易性金融资产	6.4.7.2	62,629,360.65	56,938,961.37
其中：股票投资		-	-
基金投资		59,074,707.91	53,490,690.68
债券投资		3,554,652.74	3,448,270.69

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	-	-909.59
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		-	8,003,638.36
应收股利		-	-
应收申购款		4,607.42	5,040.71
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	465.57	342.39
资产总计		66,594,526.87	66,027,863.73
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年6月30日</b>	<b>上年度末 2023年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	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		43,095.18	44,166.43
应付托管费		7,452.40	7,357.39
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	6.4.7.9	49,726.04	100,000.00
负债合计		100,273.62	151,523.82
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	76,663,619.41	76,223,595.46
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-10,169,366.16	-10,347,255.55
净资产合计		66,494,253.25	65,876,339.91
负债和净资产总计		66,594,526.87	66,027,863.73

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 76,663,619.41 份，其中东方红养老目标 2045 五年持有混合发起 (FOF) A 基金份额总额 76,509,022.63 份，基金份额净值 0.8673 元；东方红



养老目标 2045 五年持有混合发起 (FOF) Y 基金份额总额 154,596.78 份, 基金份额净值 0.8699 元。

## 6.2 利润表

会计主体: 东方红养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金 (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 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
<b>一、营业总收入</b>		606,291.82	-2,778,934.04
1. 利息收入		29,627.53	21,721.91
其中: 存款利息收入	6.4.7.13	12,476.01	14,685.96
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		17,151.52	7,035.95
其他利息收入		-	-
2. 投资收益 (损失以“-”填列)		-5,316,352.00	-873,694.00
其中: 股票投资收益	6.4.7.14	-	-844,339.18
基金投资收益	6.4.7.15	-5,404,712.12	-155,395.61
债券投资收益	6.4.7.16	48,636.92	25,350.96
资产支持证券投资	6.4.7.17	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.18	-	-
衍生工具收益	6.4.7.19	-	-
股利收益	6.4.7.20	39,723.20	100,689.83
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	5,891,898.18	-1,926,961.95
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	1,118.11	-
<b>减: 二、营业总支出</b>		362,235.73	407,853.12
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	255,621.40	296,644.73
其中: 暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	44,001.62	47,859.58

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	6.4.7.24	-	-
7. 税金及附加		1,704.67	691.21
8. 其他费用	6.4.7.25	60,908.04	62,657.60
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		244,056.09	-3,186,787.16
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		244,056.09	-3,186,787.16
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		244,056.09	-3,186,787.16

### 6.3 净资产变动表

会计主体：东方红养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金 (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	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	76,223,595.46	-10,347,255.55	65,876,339.91
二、本期期初净资产	76,223,595.46	-10,347,255.55	65,876,339.91
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	440,023.95	177,889.39	617,913.34
(一)、综合收益总额	-	244,056.09	244,056.09
(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)	440,023.95	-66,166.70	373,857.25
其中：1. 基金申购款	440,023.95	-66,166.70	373,857.25
2. 基金赎回款	-	-	-
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变	-	-	-

动 (净资产减少以“-”号填列)			
四、本期期末净资产	76,663,619.41	-10,169,366.16	66,494,253.25
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	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	76,066,375.86	-1,028,614.98	75,037,760.88
二、本期期初净资产	76,066,375.86	-1,028,614.98	75,037,760.88
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	125,517.17	-3,184,432.51	-3,058,915.34
(一)、综合收益总额	-	-3,186,787.16	-3,186,787.16
(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)	125,517.17	2,354.65	127,871.82
其中: 1. 基金申购款	125,517.17	2,354.65	127,871.82
2. 基金赎回款	-	-	-
(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	76,191,893.03	-4,213,047.49	71,978,845.54

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:

张锋

汤琳

陈培

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

东方红养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) (以下简称“本基金”) 系由基金管理人上海东方证券资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《东方红养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 基金合同》(以下简称“基金合同”)

及其他有关法律法规的规定, 经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)以证监许可[2022]1268 号文批准公开募集。本基金为契约型开放式基金, 存续期限为不定期。本基金首次设立募集基金份额为 76,066,325.29 份, 经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证, 并出具了编号为德师报(验)字(22)第 00444 号验资报告。基金合同于 2022 年 9 月 5 日正式生效。根据基金管理人于 2023 年 11 月 1 日发布的《关于上海东方证券资产管理有限公司旗下部分养老目标基金新增 Y 类基金份额并修改基金合同和托管协议的公告》, 自 2023 年 11 月 3 日(含)起, 本基金增加 Y 类份额。本基金的基金管理人为上海东方证券资产管理有限公司, 基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金为发起式基金, 发起资金认购部分为 14,922,014.34 份基金份额, 发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

自基金合同生效日起至目标日期(即 2045 年 12 月 31 日, 含该日)的期间, 本基金每份基金份额设置五年锁定持有期(因红利再投资所得的份额与原份额适用相同的最短持有期限)。在目标日期次日(即 2046 年 1 月 1 日), 在不违反届时有效的法律法规或监管规定的情况下, 本基金将自动转型为“东方红颐享安泰混合型基金中基金(FOF)”, 届时本基金将转为每日开放申购/赎回的运作模式及变更基金名称, 无需召开基金份额持有人大会。基金份额持有人在转型前申购本基金, 至转型日持有基金份额不足五年的, 在转型日之后(含转型日)可以提出赎回及转换转出申请, 不受五年持有期限限制。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新公告的基金合同及《东方红养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)招募说明书》的有关规定, 自基金合同生效后起至目标日期(即 2045 年 12 月 31 日, 含该日)的期间:

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基金(含公募 Reits、QDII 基金、商品基金(含商品期货基金和黄金 ETF)和香港互认基金, 下同), 国内依法发行上市的股票及存托凭证(含创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票及存托凭证)、港股通标的股票、债券(包括国内依法发行的国家债券、地方政府债券、政府支持机构债券、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、公司债券(含公开发行的证券公司短期公司债券)、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可分离交易可转债、可交换债)、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、资产支持证券以及经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。

基金的投资组合比例为: 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比例

不低于基金资产的 80%，其中，投资于股票及存托凭证、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)等品种的比例合计原则上不超过基金资产的 80%。目标日期前，本基金根据下滑曲线的设定确定权益类资产和非权益类资产的配置比例。权益类资产包括股票及存托凭证、股票型基金、混合型基金。其中，计入上述权益类资产的混合型基金需符合下列两个条件之一：1)基金合同约定股票资产(含存托凭证)投资比例不低于基金资产 60%的混合型基金；2)根据基金披露的定期报告，最近四个季度股票资产(含存托凭证)占基金资产的比例均不低于 60%的混合型基金。本基金投资于港股通标的股票不超过股票资产的 50%。本基金保留的现金或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、存出保证金和应收申购款等。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率  $\times X\% \times 85\%$ +恒生指数收益率(经汇率估值调整)  $\times X\% \times 15\%$ +中国债券总指数收益率  $\times (1-X\%)$ 。X 取值范围为：基金合同生效日-2025 年 12 月 31 日：80；2026 年 1 月 1 日-2030 年 12 月 31 日：79；2031 年 1 月 1 日-2035 年 12 月 31 日：75；2036 年 1 月 1 日-2040 年 12 月 31 日：63；2041 年 1 月 1 日-2045 年 12 月 31 日：36。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)、中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

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

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，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 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

#### 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

本基金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

本基金本报告期末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

根据财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年9月18日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、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》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、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]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》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税;2018年1月1日起,公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务,以基金管理人为增值税纳税人,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。

(2) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不计缴企业所得税。

(3) 对基金取得的股票股息、红利收入,由上市公司代扣代缴个人所得税;从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。对基金通过港股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。基金通过港股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) 对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10% 的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳印花税；自 2023 年 8 月 28 日起，出让方减按 0.05% 的税率缴纳证券(股票)交易印花税。对于基金通过港股通买卖、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 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	3,798,009.41	
等于：本金	3,797,326.01	
加：应计利息	683.40	
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	3,798,009.41	

##### 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	-	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券   交易所市场	3,500,191.00	53,952.74	3,554,652.74	509.00

	银行间市场	-	-	-	-
	合计	3,500,191.00	53,952.74	3,554,652.74	509.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		58,564,958.53	-	59,074,707.91	509,749.38
其他		-	-	-	-
合计		62,065,149.53	53,952.74	62,629,360.65	510,258.38

### 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

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/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

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 债权投资

#### 6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

### 6.4.7.6 其他债权投资

#### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权投资。

### 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

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

### 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	-
待摊费用	-
应收销售服务费返还	465.57
合计	465.57

### 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	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	49,726.04
合计	49,726.04

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

东方红养老目标 2045 五年持有混合发起 (FOF) 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	76,198,385.78	76,198,385.78
本期申购	310,636.85	310,636.85
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
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	76,509,022.63	76,509,022.63

东方红养老目标 2045 五年持有混合发起 (FOF) 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	25,209.68	25,209.68
本期申购	129,387.10	129,387.10
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
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	154,596.78	154,596.78

注：申购含红利再投、转换入份（金）额，赎回含转换出份（金）额。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期无其他综合收益。

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

东方红养老目标 2045 五年持有混合发起 (FOF) A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-4,966,044.64	-5,377,803.80	-10,343,848.44
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-4,966,044.64	-5,377,803.80	-10,343,848.44
本期利润	-5,645,056.28	5,888,726.04	243,669.76
本期基金份额交易产生的变动数	-21,875.79	-27,204.95	-49,080.74
其中：基金申购款	-21,875.79	-27,204.95	-49,080.74
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-10,632,976.71	483,717.29	-10,149,259.42

东方红养老目标 2045 五年持有混合发起 (FOF) Y

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,627.87	-1,779.24	-3,407.11
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-1,627.87	-1,779.24	-3,407.11
本期利润	-2,785.81	3,172.14	386.33
本期基金份额交易产生的变动数	-16,683.64	-402.32	-17,085.96
其中：基金申购款	-16,683.64	-402.32	-17,085.96
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-21,097.32	990.58	-20,106.74

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	9,676.46
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	2,645.17
其他	154.38
合计	12,476.01

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

注：本基金本报告期内无股票投资收益。

#### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益-买卖股票差价收入。

#### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益-证券出借差价收入。

#### 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	63,796,313.58
减：卖出/赎回基金成本总额	69,104,739.10
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	14,205.49
减：交易费用	82,081.11
基金投资收益	-5,404,712.12

#### 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	42,242.27
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	6,394.65
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	48,636.92

##### 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	5,433,443.41
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	5,336,284.83
减：应计利息总额	90,607.91
减：交易费用	156.02
买卖债券差价收入	6,394.65

**6.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期内无债券投资收益-赎回差价收入。

**6.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期内无债券投资收益-申购差价收入。

**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**

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

**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**

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益-买卖资产支持证券差价收入。

**6.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益-赎回差价收入。

**6.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益-申购差价收入。

**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**

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

**6.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益-买卖贵金属差价收入。

**6.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益-赎回差价收入。

**6.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益-申购差价收入。

**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**

注：本基金本报告期内无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

**6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：本基金本报告期内无衍生工具收益-其他投资收益。

**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	-
其中: 证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	39,723.20
合计	39,723.20

#### 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	5,891,898.18
股票投资	-
债券投资	10,263.51
资产支持证券投资	-
基金投资	5,881,634.67
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	5,891,898.18

#### 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	1,118.11
合计	1,118.11

#### 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)	26,678.17
当期持有基金产生的应支付管理费(元)	285,831.69
当期持有基金产生的应支付托管费(元)	46,145.59

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

注: 本基金本报告期内无信用减值损失。

#### 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	9,944.48
信息披露费	39,781.56
证券出借违约金	-
银行费用	2,182.00
账户维护费	9,000.00
合计	60,908.04

#### 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，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露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
上海东方证券资产管理有限公司（“东证资管”）	基金管理人、注册登记机构、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
东方证券股份有限公司（“东方证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

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。

#### 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

金额单位：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	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
东方证券	-	-	10,655,156.02	97.39

### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：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	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)
东方证券	7,400,202.01	100.00	15,306,416.00	100.00

### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：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	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)
东方证券	164,757,000.00	100.00	74,600,000.00	94.91

### 6.4.10.1.4 基金交易

金额单位：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	
	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
东方证券	91,372,762.78	100.00	89,858,565.81	96.18

### 6.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

### 6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
-	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
东方证券	7,825.05	97.35	1,614.51	91.92

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果等。

#### 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	255,621.40	296,644.73
其中：应支付销售机构的客户维护费	116,611.18	131,475.90
应支付基金管理人的净管理费	139,010.22	165,168.83

注：(1) 本基金投资于本基金管理人所管理的公开募集证券投资基金的部分不收取管理费。东方红养老目标 2045 五年持有混合 A 的年管理费率为 0.80%；东方红养老目标 2045 五年持有混合 Y 的年管理费率为 0.40%；基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：东方红养老目标 2045 五年持有混合 A 的每日应计提的基金管理费=(前一日基金资产净值中扣除所持有本基金管理人管理的其他公开募集证券投资基金部分)×(前一日该类基金份额的基金资产净值/前一日基金资产净值)(若为负数，则取 0)×0.80%÷当年天数；东方红养老目标 2045 五年持有混合 Y 的每日应计提的基金管理费=(前一日基金资产净值中扣除所持有本基金管理人管理的其他公开募集证券投资基金部分)×(前一日该类基金份额的基金资产净值/前一日基金资产净值)(若为负数，则取 0)×0.40%÷当年天数。

(2) 实际支付销售机构的客户维护费以本基金管理人和各销售机构对账确认的金额为准。

##### 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	44,001.62	47,859.58

注：本基金投资于本基金托管人所托管的公开募集证券投资基金的部分不收取托管费。东方红养老目标 2045 五年持有混合 A 的年托管费率为 0.15%；东方红养老目标 2045 五年持有混合 Y 的年托管费率为 0.075%；逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：东方红养老目标 2045 五年持有混合 A 每日应计提的基金托管费=(前一日基金资产净值中扣除所持有本基金托管人托管的其他公开募集证券投资基金部分)×(前一日该类基金份额的基金资产净值/前一日基金资产净



值) (若为负数, 则取 0)  $\times 0.15\% \div$  当年天数; 东方红养老目标 2045 五年持有混合 Y 每日应计提的基金托管费=(前一日基金资产净值中扣除所持有本基金托管人托管的其他公开募集证券投资基金部分)  $\times$  (前一日该类基金份额的基金资产净值/前一日基金资产净值) (若为负数, 则取 0)  $\times 0.075\% \div$  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

注: 本基金本报告期内及上年度可比期间未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

注: 本基金本报告期内及上年度可比期间未有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。

#### 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

注: 本基金本报告期内及上年度可比期间未有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。

### 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 2024年1月1日至2024年6月30日	
	东方红养老目标 2045 五年持有混合发起 (FOF) A	东方红养老目标 2045 五年持有混合发起 (FOF) Y
基金合同生效日 (2022 年 9 月 5 日) 持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	14,922,014.34	-
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	14,922,014.34	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	19.5036%	-
项目	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	上年度可比期间 -

	东方红养老目标 2045 五年持有混合发起 (FOF) A	东方红养老目标 2045 五年持有混合发起 (FOF) Y
基金合同生效日 ( 2022 年 9 月 5 日 ) 持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	14,922,014.34	-
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减: 报告期内赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	14,922,014.34	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	19.5848%	-

注: 1、基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

2、分类基金持有的基金份额占基金总份额比例的计算中,对下属分类基金,比例的分母采用各自类别的份额。

#### 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

注: 本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 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	3,798,009.41	9,676.46	3,055,271.89	13,684.80

注: 本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管,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

注: 本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 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东证资管所管理的公开募集证券投资基金合计 1,560,026.20 元 (2023 年 12 月 31 日: 810,463.93 元),占本基金资产净值的比例为 2.35% (2023 年 12 月 31 日: 1.23%)。

##### 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6

	月 30 日	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)	474.24	-
当期持有基金产生的应支付销售服务费 (元)	1,118.11	-
当期持有基金产生的应支付管理费 (元)	8,102.94	-
当期持有基金产生的应支付托管费 (元)	1,608.38	-

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）、销售服务费等销售费用。交易本基金管理人管理的基金产生的申购费、赎回费由基金管理人直接减免，故当期交易基金产生的该类申购费为零，当期交易基金产生的该类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。交易本基金管理人管理的基金产生的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管理费、应支付托管费、应支付销售服务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

注：1、本基金本报告期内未进行利润分配。

2、本基金于资产负债表日之后、中期报告批准报出日之前批准、公告或实施的利润分配情况请参见资产负债表日后事项。

#### 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

注：本基金无因认购新发/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

注：本基金本报告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

注：本基金本报告期末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。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 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

本基金金融工具的风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险。本基金管理人制定了相应政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金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与风险管理委员会，负责对合规管理和风险管理的总体目标、基本政策进行审议并提出意见；对合规管理和风险管理的机构设置及其职责进行审议并提出意见；对需董事会审议的重大决策的风险和重大风险的解决方案进行评估并提出意见；对需董事会审议的合规报告和风险评估报告进行审议并提出意见等。在经营层层面设立风险控制委员会，负责指导、协调和监督各职能部门和各业务单元开展风险管理工作；根据董事会制定的风险管理原则制订相关风险控制政策，使公司整体业务发展战略与风险承受能力保持相当；督促各职能部门在日常工作中识别各项业务所涉及各类重大风险，组织对重大事件、重大决策和重要业务流程的风险进行评估，就相关解决方案进行评审；督促各职能部门识别和评估新产品、新业务的风险，就相关控制措施进行评审；督促各职能部门重点关注内控机制薄弱环节和可能给公司带来重大损失的事件，审议并决定相应的控制措施和解决方案；根据公司风险管理总体策略和各职能部门与业务单元职责分工，指导实施风险应对方案；审议公司投资授权有关的风险控制方案等。

##### 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农业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	3,554,652.74	3,448,270.69
合计	3,554,652.74	3,448,270.69

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的债券投资。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

#### 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于开放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于开放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 06 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(净资产)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。

### 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》且于基金开放日内按照《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》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持有单只基金 (ETF 联接基金除外) 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%。于开放日内，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上述比例限制)。

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%。于 2024 年 06 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例未超过 15%。

于开放日内，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。于 2024 年 06 月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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。

##### 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个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>							
货币资金	3,798,009.41	-	-	-	-	-	3,798,009.41
结算备付金	140,711.88	-	-	-	-	-	140,711.88
存出保证金	21,371.94	-	-	-	-	-	21,371.94
交易性金融资产	3,554,652.74	-	-	-	-	59,074,707.91	62,629,360.65
应收申购款	497.42	-	-	-	-	4,110.00	4,607.42
其他资产	-	-	-	-	-	465.57	465.57
<b>资产总计</b>	<b>7,515,243.39</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>59,079,283.48</b>	<b>66,594,526.87</b>
<b>负债</b>							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	43,095.18	43,095.18
应付托管费	-	-	-	-	-	7,452.40	7,452.40
其他负债	-	-	-	-	-	49,726.04	49,726.04
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>100,273.62</b>	<b>100,273.62</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>7,515,243.39</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>58,979,009.86</b>	<b>66,494,253.25</b>
上年度末 2023年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>							
货币资金	675,812.09	-	-	-	-	-	675,812.09
结算备付金	380,968.21	-	-	-	-	-	380,968.21
存出保证金	24,010.19	-	-	-	-	-	24,010.19
交易性金融资产	-	-	3,448,270.69	-	-	53,490,690.68	56,938,961.37
买入返售金融资	-909.59	-	-	-	-	-	-909.59

产							
应收申购款	100.00	-	-	-	-	4,940.71	5,040.71
应收清算款	-	-	-	-	-	8,003,638.36	8,003,638.36
其他资产	-	-	-	-	-	342.39	342.39
资产总计	1,079,980.90	-3,448,270.69	-	-	-	61,499,612.14	66,027,863.73
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	44,166.43	44,166.43
应付托管费	-	-	-	-	-	7,357.39	7,357.39
其他负债	-	-	-	-	-	100,000.00	100,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	151,523.82	151,523.82
利率敏感度缺口	1,079,980.90	-3,448,270.69	-	-	-	61,348,088.32	65,876,339.91

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者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	606.59	2,717.84
2. 市场利率上升 25 个基点	-606.38	-2,713.56	

#### 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。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金承受的其他价格风险，主要是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。本基金的其他价格风险，主要受到证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行其他价格风险管理。



### 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	-	-	-	-
交易性金融资产—基金投资	59,074,707.91	88.84	53,490,690.68	81.20
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	59,074,707.91	88.84	53,490,690.68	81.20

### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数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. 沪深 300 指数上升 5%	2,135,214.18	2,115,310.16
	2. 沪深 300 指数下降 5%	-2,135,214.18	-2,115,310.16

注：本基金管理人运用资产-资本定价模型 (CAPM) 对本基金的其他价格风险进行分析。上表为其其他价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，股票市场指数 (沪深 300) 价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

## 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	59,074,707.91	53,490,690.68
第二层次	3,554,652.74	3,448,270.69
第三层次	-	-
合计	62,629,360.65	56,938,961.37

##### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 年 06 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2023 年 12 月 31 日：同)。

##### 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应收款项和其他金融负债，其公允价值和账面价值相若。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 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	59,074,707.91	88.71
3	固定收益投资	3,554,652.74	5.34
	其中：债券	3,554,652.74	5.34
	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	3,938,721.29	5.91
8	其他各项资产	26,444.93	0.04
9	合计	66,594,526.87	100.00

注：1、本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

2、本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

## 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

注：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

注：本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

## 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

注：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

注：本基金本报告期内未进行股票投资。

### 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

注：本基金本报告期内未进行股票投资。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：本基金本报告期末未进行股票投资。

## 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	3,554,652.74	5.35
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	3,554,652.74	5.35

### 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	35,000	3,554,652.74	5.35

### 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

注：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

注：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

注：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

根据本基金合同，本基金不参与股指期货投资。

### 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

根据本基金合同，本基金不参与国债期货投资。

#### 7.11.2 本期国债期货投资评价

根据本基金合同，本基金不参与国债期货投资。

### 7.12 本报告期投资基金情况

#### 7.12.1 投资政策及风险说明

本基金将根据基金产品特征，综合定量和定性两个维度优选拟投资基金标的。首先，对全市场基金进行筛选，构建基础基金池，再通过对基础基金池中基金管理人和基金经理的调研情况进一步筛选，构建精选基金池，最后结合市场情况和基金风格构建投资组合，努力获取基金经理优秀管理能力所产生的超额收益。

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	968052	摩根国际债券人民币累计	契约型开放式	696,056.70	7,600,939.16	11.43	否
2	511880	银华日利	契约型开放式	53,900.00	5,440,504.30	8.18	否
3	006624	中泰玉衡价值优选混合 A	契约型开放式	1,692,732.35	3,742,800.50	5.63	否
4	008271	大成优势企业混合 A	契约型开放式	1,807,092.56	3,576,778.30	5.38	否
5	013531	浙商聚潮产业成长混合 C	契约型开放式	2,457,671.17	3,352,263.48	5.04	否
6	000754	华宝量化对冲混合 C	契约型开放式	2,373,532.79	2,705,115.32	4.07	否
7	513500	博时标普 500ETF	交易型开放式 (ETF)	1,157,400.00	2,281,235.40	3.43	否
8	510300	华泰柏瑞沪深 300ETF	交易型开放式 (ETF)	620,800.00	2,164,729.60	3.26	否
9	159792	富国中证港股	交易型开	3,305,200.00	1,883,964.00	2.83	否

		通互联网 ETF	开放式 (ETF)				
10	005233	广发睿毅领先混合 A	契约型开放式	750,530.55	1,635,556.17	2.46	否
11	008099	广发价值领先混合 A	契约型开放式	1,242,731.54	1,580,257.43	2.38	否
12	007262	东方红聚利债券 A	契约型开放式	927,086.79	1,187,041.93	1.79	是
13	013859	宝盈品质甄选混合 A	契约型开放式	536,782.85	654,177.26	0.98	否
14	004814	中欧红利优享灵活配置混合 A	契约型开放式	366,304.10	563,705.38	0.85	否
15	006281	万家人工智能混合 A	契约型开放式	212,804.16	447,846.35	0.67	否
16	002258	大成国企改革灵活配置混合 A	契约型开放式	130,164.52	428,631.76	0.64	否
17	008638	广发科技创新混合 A	契约型开放式	303,942.75	420,231.25	0.63	否
18	005094	万家臻选混合	契约型开放式	172,086.85	417,138.52	0.63	否
19	519756	交银国企改革灵活配	契约型开放式	272,003.05	403,489.32	0.61	否

		置混合 A					
20	040025	华安科技动力混合 A	契约 型开 放式	88,779.02	398,529.02	0.60	否
21	001072	华安智能装备主题股票 A	契约 型开 放式	207,527.91	393,680.45	0.59	否
22	519183	万家双引擎灵活配置混合 A	契约 型开 放式	174,987.24	390,921.49	0.59	否
23	016313	富国研究精选灵活配置混合 C	契约 型开 放式	153,802.54	383,429.73	0.58	否
24	001287	安信优势增长混合 A	契约 型开 放式	172,302.85	382,960.31	0.58	否
25	000979	景顺长城沪港深精选股票	契约 型开 放式	167,845.28	377,651.88	0.57	否
26	002980	华夏创新前沿股票	契约 型开 放式	187,982.69	376,153.36	0.57	否
27	398021	中海能源策略混合	契约 型开 放式	568,311.81	374,858.47	0.56	否
28	017773	大成消费主题混合 C	契约 型开 放式	216,698.79	373,458.69	0.56	否
29	005765	中欧明睿新常	契约 型开	199,657.63	373,259.94	0.56	否

		态混合 C	放式				
30	017535	东方红京东大数据混合 C	契约型开放式	153,113.41	372,984.27	0.56	是
31	700003	平安策略先锋混合	契约型开放式	89,034.50	370,739.66	0.56	否
32	014849	建信健康民生混合 C	契约型开放式	81,193.25	367,480.65	0.55	否
33	003886	汇安丰利混合 A	契约型开放式	268,064.28	366,631.52	0.55	否
34	005851	财通新视野混合 A	契约型开放式	208,411.62	365,158.00	0.55	否
35	519995	长信金利趋势混合 A	契约型开放式	954,128.72	362,282.67	0.54	否
36	010003	景顺长城电子信息产业股票 A 类	契约型开放式	383,746.19	361,412.16	0.54	否
37	671030	西部利得事件驱动股票	契约型开放式	216,077.00	360,373.22	0.54	否
38	320005	诺安价值增长混合	契约型开放式	210,935.55	360,172.45	0.54	否
39	210002	金鹰红利价值混合 A	契约型开放式	217,087.01	360,169.06	0.54	否



40	161611	融通内 需驱动 混合 A/B	契约 型开 放式	127,748.53	358,845.62	0.54	否
41	013485	尚正竞 争优势 混合发 起 A	契约 型开 放式	308,401.51	358,670.96	0.54	否
42	007460	华安成 长创新 混合 A	契约 型开 放式	215,449.45	356,633.47	0.54	否
43	012079	信澳新 能源精 选混合 A	契约 型开 放式	371,293.08	355,253.22	0.53	否
44	000308	建信创 新中国 混合	契约 型开 放式	81,548.52	354,572.96	0.53	否
45	673060	西部利 得景瑞 混合 A	契约 型开 放式	178,767.11	353,780.11	0.53	否
46	000689	前海开 源新经 济混合 A	契约 型开 放式	188,643.59	352,423.95	0.53	否
47	007146	鹏华研 究智选 混合	契约 型开 放式	216,788.05	351,933.72	0.53	否
48	008328	诺安新 兴产业 混合	契约 型开 放式	243,280.78	351,054.17	0.53	否
49	164205	天弘文 化新兴 产业股 票 A	契约 型开 放式	180,646.30	350,977.70	0.53	否
50	010090	中信建	契约	533,603.40	349,456.87	0.53	否

		投医药健康 A	型开放式				
51	005505	前海开源中药股票 A	契约型开放式	154,743.77	348,359.18	0.52	否
52	000126	招商安润灵活配置混合 A	契约型开放式	180,189.25	346,143.55	0.52	否
53	000893	工银创新动力股票	契约型开放式	327,587.04	344,621.57	0.52	否
54	519185	万家精选 A	契约型开放式	186,826.98	343,948.47	0.52	否
55	005821	万家新机遇龙头企业混合 A	契约型开放式	189,586.27	343,625.11	0.52	否
56	003434	博时鑫泽混合 A	契约型开放式	185,663.89	342,178.55	0.51	否
57	003145	国联竞争优势	契约型开放式	228,076.02	340,814.00	0.51	否
58	010452	广发瑞福精选混合 A	契约型开放式	503,359.24	340,472.19	0.51	否
59	002910	易方达供给改革混合	契约型开放式	151,040.32	338,874.06	0.51	否
60	487021	工银优质精选混合 A	契约型开放式	132,800.36	331,868.10	0.50	否
61	159980	大成有色金属	交易型开	189,700.00	330,078.00	0.50	否

		期货 ETF	放式 (ETF)				
62	290006	泰信蓝 筹精选 混合	契约 型开 放式	265,917.34	329,285.44	0.50	否
63	019607	诺安先 进制造 股票 C	契约 型开 放式	124,203.26	329,014.44	0.49	否
64	163822	中银主 题策略 混合 A	契约 型开 放式	106,211.54	328,087.45	0.49	否
65	003053	嘉实文 体娱乐 股票 A	契约 型开 放式	232,515.01	325,986.04	0.49	否
66	519915	富国消 费主题 混合 A	契约 型开 放式	146,128.83	324,990.52	0.49	否
67	002663	前海开 源沪港 深大消 费主题 混合 C	契约 型开 放式	185,742.02	320,590.73	0.48	否
68	008763	天弘越 南市场 股票 (QDII)A	契约 型开 放式	223,978.85	313,167.23	0.47	否
69	006002	工银医 药健康 股票 A	契约 型开 放式	205,644.41	308,055.33	0.46	否
70	001704	国投瑞 银进宝 混合	契约 型开 放式	171,280.72	304,382.97	0.46	否
71	002708	大摩健 康产业 混合 A	契约 型开 放式	184,257.14	299,602.11	0.45	否
72	013882	交银品	契约	218,691.32	288,147.68	0.43	否

		质升级 混合 C	型开 放式				
73	511990	华宝添 益	交易 型开 放式 (ETF)	1.00	100.01	0.00	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

注：本基金本报告期末未持有公开募集基础设施证券投资基金。

### 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

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未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。

#### 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

本基金不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情况。

#### 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	21,371.94
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	4,607.42
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	应收销售服务费返还	465.57
9	其他	-
10	合计	26,444.93

#### 7.13.4 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。

#### 7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票。

#### 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，投资组合报告中市值占净值比例的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)	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 (%)
东方红养老目标 2045 五年持有混合发起 (FOF) A	1,988	38,485.42	15,120,196.14	19.76	61,388,826.49	80.24
东方红养老目标 2045 五年持有混合发起 (FOF) Y	48	3,220.77	0.00	0.00	154,596.78	100.00
合计	2,036	37,654.04	15,120,196.14	19.72	61,543,423.27	80.28

注：分类基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分类基金，比例的分母采用各自类别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分类基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 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	东方红养老目标 2045 五年持有混合发起 (FOF) A	913,676.75	1.19
	东方红养老目标 2045 五年持有混合发起 (FOF) Y	69,416.39	44.90
	合计	983,093.14	1.28

注：分类基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分类基金，比例的分母采用各自类别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分类基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 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	东方红养老目标 2045 五年持有混合发起 (FOF) A	10~50
	东方红养老目标 2045 五年持有混合发起 (FOF) Y	0~10
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	东方红养老目标 2045 五年持有混合发起 (FOF) A	10~50
	东方红养老目标 2045 五年持有混合发起 (FOF) Y	0
	合计	10~50

#### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	14,922,014.34	19.46	14,922,014.34	19.46	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	14,922,014.34	19.46	14,922,014.34	19.46	3 年

### § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	东方红养老目标 2045 五年持有混合发起 (FOF) A	东方红养老目标 2045 五年持有混合发起 (FOF) Y
基金合同生效日 (2022 年 9 月 5 日) 基金份额总额	76,066,325.29	-
本报告期期初基金份额总额	76,198,385.78	25,209.68
本报告期基金总申购份额	310,636.85	129,387.10
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	76,509,022.63	154,596.78

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内没有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

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 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，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略无改变。

### 10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本基金本报告期不涉及持有的基金发生重大影响事件的情形。

### 10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金进行审计的会计师事务所是德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）。报告期内本基金未发生改聘会计师事务所的情形。

### 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

注：报告期内基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 10.7.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内基金托管人及其高级管理人员无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 (%)	

东方证券	3	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-

注：1、交易单元的选择标准和程序

(1) 选择标准

券商财务状况良好、经营行为规范，最近一年无重大违规行为；具有较强的合规风控能力、交易能力和研究服务能力；交易佣金收费合理。

(2) 选择程序

基金管理人根据以上标准对不同券商进行综合评价，然后根据评价选择券商，与其签订协议租用交易单元。

2、本基金本报告期租用券商交易单元无变更。

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 (%)
东方证券	7,400,202.01	100.00	164,757,000.00	100.00	-	-	91,372,762.78	100.00
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金 2024 年非港股通交易日暂停申购、赎回等业务的公告	中国证监会规定媒介	2024 年 1 月 5 日



2	东方红养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 2023 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2024 年 1 月 22 日
3	东方红养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 2023 年年度报告	中国证监会规定媒介	2024 年 3 月 29 日
4	东方红养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 2024 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2024 年 4 月 22 日
5	东方红养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) (A 类份额) 基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2024 年 6 月 14 日
6	东方红养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) (Y 类份额) 基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2024 年 6 月 14 日
7	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金 2024 年非港股通交易日申购、赎回等业务安排的公告	中国证监会规定媒介	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

注：本基金本报告期内未发生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、中国证监会准予注册东方红养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 的文件；

2、《东方红养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 基金合同》；

3、《东方红养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 托管协议》；

4、东方红养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 财务报表及报表附注；

5、报告期内在规定媒介上披露的各项公告；

6、基金管理人业务资格批件、营业执照；

7、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的办公场所：上海市黄浦区外马路 108 号 7 层。

## 12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公场所免费查阅备查文件，亦可通过公司网站查阅，公司网址为：  
[www.dfham.com](http://www.dfham.com)。

上海东方证券资产管理有限公司

2024 年 8 月 30 日