

# 人保稳进配置三个月持有期混合型基金中基金(FOF)

## 2024 年中期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人:中国人保资产管理有限公司

基金托管人:中国银行股份有限公司

送出日期:2024 年 08 月 31 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年8月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2024年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	6
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	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
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	13
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	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
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	42
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	45
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	45
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	46
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	46
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	46
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	46
7.12 本报告期投资基金情况	46
7.13 投资组合报告附注	49
§8 基金份额持有人信息	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	50
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 .....	50
§9 开放式基金份额变动 .....	51
§10 重大事件揭示 .....	51
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	51
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 .....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	52
10.4 基金投资策略的改变 .....	52
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 .....	52
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	52
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 .....	52
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	52
10.9 其他重大事件 .....	54
§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....	56
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 .....	56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	56
§12 备查文件目录 .....	56
12.1 备查文件目录 .....	57
12.2 存放地点 .....	57
12.3 查阅方式 .....	57

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	人保稳进配置三个月持有期混合型基金中基金(FOF)
基金简称	人保稳进配置三个月持有 (FOF)
基金主代码	009383
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年09月17日
基金管理人	中国人保资产管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	54,032,676.58份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制投资风险的前提下，通过积极主动的投资管理，力争获取超越业绩比较基准的投资收益，为基金份额持有人创造持续稳定的投资回报。
投资策略	<p>在大类资产配置框架下，本基金将依据基金管理人构建的基金筛选体系进行基金的筛选，坚持从研究基金价值入手，结合定性分析与定量分析，甄选优质证券投资基金构建投资组合，以获得长期持续稳健的投资收益。</p> <p>本基金在严谨深入的研究分析基础上，综合考量宏观经济形势、市场资金面走向、信用债券的信用评级、协议存款交易对手的信用资质以及各类资产的收益率水平等，确定各类货币市场工具的配置比例并进行积极的流动性管理。</p> <p>本基金通过价值分析，采用自上而下确定投资策略，采取久期管理、类属配置和现金流管理策略等积极投资策略，发现、确认并利用细分市场失衡，实现组合增值。</p>
业绩比较基准	中债总财富指数收益率*80%+沪深300指数收益率*20%

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中基金，高于货币型基金中基金和债券型基金中基金；低于股票型基金和混合型基金，高于债券型基金和货币市场基金。
--------	---

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中国人保资产管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	郭乐琦	许俊
	联系电话	021-38572076	010-66596688
	电子邮箱	guolq@piccamc.com	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		400-820-7999	95566
传真		021-50765598	010-66594942
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道1198号20层、21层、22层、25层03、04单元	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道1198号20层、21层、22层、25层03、04单元、26层01、02、07、08单元	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码		100031	100818
法定代表人		黄本尧	葛海蛟

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	fund.piccamc.com
基金中期报告备置地点	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道1198号20层、21层、22层、25层03、04单元、26层01、02、07、08单元

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国人保资产管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道1198号20层、21层、22层、25层03、04单元、26层01、02、07、08单元

### §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01月01日-2024年06月30日)	
本期已实现收益	-265,350.78	
本期利润	496,155.42	
加权平均基金份额本期利润	0.0109	
本期加权平均净值利润率	1.14%	
本期基金份额净值增长率	1.29%	
3.1.2 期末数据和指标	报告期末	
	(2024年06月30日)	
	期末可供分配利润	-2,524,375.37
	期末可供分配基金份额利润	-0.0467
	期末基金资产净值	52,013,364.57
期末基金份额净值	0.9626	
3.1.3 累计期末指标	报告期末	
	(2024年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	-3.74%	

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、期末可供分配利润是指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、上述本基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，例如：基金的申购、赎回费等，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-0.30%	0.16%	0.08%	0.10%	-0.38%	0.06%
过去三个月	1.00%	0.20%	0.99%	0.14%	0.01%	0.06%
过去六个月	1.29%	0.30%	3.32%	0.17%	-2.03%	0.13%
过去一年	-1.12%	0.25%	2.76%	0.17%	-3.88%	0.08%
过去三年	-8.32%	0.39%	4.62%	0.21%	-12.94%	0.18%
自基金合同生效起至今	-3.74%	0.37%	10.47%	0.22%	-14.21%	0.15%

#### 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



注：1、本基金基金合同于2020年9月17日生效。根据基金合同规定，本基金建仓期为6个月，建仓期结束，本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。

2、本基金业绩比较基准为：中债总财富指数收益率×80%+沪深300指数收益率×20%。

## §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

中国人保资产管理有限公司（以下简称人保资产）成立于2003年7月16日，是经国务院同意、原保监会批准设立的境内第一家保险资产管理公司，由中国人民保险集团股份有限公司（股票代码：601319.SH，1339.HK）发起。目前管理资产1.7万亿元人民币，具备原银保监会核准的股票投资能力、无担保债券投资能力、股权投资能力、基础设施投资计划产品创新能力、不动产投资计划产品创新能力、衍生品运用能力和信托产品投资能力，具有国家外汇管理局批准的经营外汇业务资格，获选基本养老保险基金证券投资管理机构，获准发行投资理财产品和受托管理合格投资者资金，获批开展公募基金业务，是中国资本市场秉持价值投资理念、为客户创造绝对收益的重要机构投资者之一。

成立二十年来，人保资产以保险资金运用为主业，基于资产负债匹配管理理念，探索建立了从资产战略配置、资产战术配置、资产交易配置到集中交易和全流程风险管控的资产管理价值链，并着眼于构建能够获得持续稳定收益的资产组合，坚持以绝对收益为核心的收益缺口管理原则，为委托人贡献了长期稳定的投资收益。

二十年来，中国金融市场日趋成熟，财富管理行业日渐交融。人保资产科学筹划发展战略，积极把握第三方业务的发展机遇和另类资产的投资机会，在国内保险资产管理机构中较早开展了第三方保险机构的专户管理业务，并积极创新和开展股权投资、基础设施债权投资、资产管理产品等业务，积极开展公募基金业务，形成了专户管理、资产管理产品、债权投资计划、股权投资计划、不动产投资计划和外汇投资等业务多元化发展的格局，与国内各主要金融机构和大中型龙头企业建立了良好的合作关系。

自成立以来，人保资产始终坚持专业化发展、市场化经营、规范化运作，是第一家建立“委托-受托-托管”资金三方存管机制的保险资产管理机构，并探索建立了覆盖投资全流程的风险防控体系；二十年来，人保资产还培养了具备国际投资视野、历经市场多周期磨练的投研管理和业务执行团队，忠实履行了对各委托人的价值创造承诺。

人保资产于2017年1月11日获得中国证监会《关于核准中国人保资产管理有限公司公开募集证券投资基金管理业务资格的批复》（证监许可[2017]107号），于2017年3月29日获得中国证监会颁发的《经营证券期货业务许可证》。截至2024年6月30日，本公司旗下基金产品线逐渐丰富，涵盖了股票指数型、债券型、混合型、货币型产品，管理的基金产品分别为人保货币市场基金、人保双利优选混合型证券投资基金、人保研究精选混合型证券投资基金、人保转型新动力灵活配置混合型证券投资基金、人保鑫利回报债券型证券投资基金、人保鑫瑞中短债债券型证券投资基金、人保鑫裕增强债券型证券投资基金、人保中证500指数型证券投资基金、人保鑫盛纯债债券型证券投资基金、人保沪深300指数型证券投资基金、人保鑫泽纯债债券型证券投资基金、人保行业轮动混

合型证券投资基金、人保稳进配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）、人保福欣3个月定期开放债券型证券投资基金、人保利丰纯债债券型证券投资基金、人保安睿一年定期开放债券型发起式证券投资基金、人保安和一年定期开放债券型发起式证券投资基金、人保民富债券型证券投资基金、人保中债1-5年政策性金融债指数证券投资基金、人保民享利率债债券型证券投资基金、人保泰睿积极配置三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）等。

心有所向，路必不远。面向未来，人保资产将深刻理解和把握服务中国式现代化的“人保坐标”，深入贯彻落实人保集团卓越战略，踔厉奋发，奋力开创人保资产高质量发展的新局面，谱写新时代卓越保险资产管理公司的新篇章！

#### 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		
吴若宗	基金经理	2022-11-16	2024-07-17	10年	北京大学工程硕士。曾任鸣石投资管理有限公司量化分析师，长江证券资产管理有限公司研究员，淳厚基金管理有限公司研究员。2022年8月加入中国人保资产管理有限公司公募基金事业部，2022年11月16日至2024年7月17日任人保稳进配置三个月持有期混合型基金中基金(FOF)基金经理。2024年8月29日起任人保研究精选混合型证券投资基金基金经理。
叶忻	基金经理	2023-07-13	-	14.5年	北京大学硕士。曾任泰信基金产品经理，农银汇理基金产品经理、产品主管、基金经理。2022年12月加入人保

					资产公募基金事业部，自2023年7月13日起任人保稳进配置三个月持有期混合型基金中基金(FOF)基金经理，2024年4月26日起任人保泰睿积极配置三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为本基金合同生效日。

2、非首任基金经理，其“任职日期”为公告确定的聘任日期。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、基金合同和其他有关法律法规，本着诚实信用、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，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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

本基金管理人公平对待旗下所有公募基金投资组合，建立了公平交易制度和流程。报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，在研究分析、投资决策、交易执行等各个环节，公平对待旗下所有公募基金投资组合，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。

##### 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异常交易行为。

报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价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5%的情况。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024年上半年，宏观经济在波折中前行：多部门政策组合拳的出台，意味着房地产行业政策底已现，需求端能否改善成为未来一段时间经济和股市的关键；微盘股流动性危机和国九条政策可能从根本上改变了市场参与者的审美；外部地缘扰动增多，海外去

库进程暂缓，出海逻辑遭遇反复；AI浪潮进展迅猛，投资者在星辰大海中寻找脚踏实地的核心资产。

A股市场权重指数涨跌互现，在资产荒和保险会计准则的改变下，大盘、高股息、高质量资产延续强势表现，而小盘、成长表现较差。在基本面偏弱、景气持续性较差、增量资金有限的背景下，市场存量博弈特征较为明显，行业轮动速度较快，行业选择的难度较大。

报告期内，本基金实时动态评估股票类资产、债券类资产、现金类资产等大类资产的中长期性价比，在保证流动性充裕的前提下，优选基金为底仓，通过主动选股获得超额收益；在资产配置层面，在固定收益资产底仓的基础上，以周期资源和科技成长构建哑铃型权益资产。此外，根据景气度、估值情况和市场情绪，通过ETF阶段性参与行业/主题性投资机会。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末人保稳进配置三个月持有（FOF）基金份额净值为0.9626元，本报告期内，基金份额净值增长率为1.29%，同期业绩比较基准收益率为3.32%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2024年下半年，全球央行转向格局将更加清晰；外部地缘因素可能在未来一段时间持续影响宏观经济和微观主体；居民消费和购房意愿仍较低迷，或需较长时间才能扭转；市场对更为积极的财政政策抱有期望。在此背景下，我们将重点关注以下几个方向：供给格局清晰、全球定价的大宗品；兼顾景气度与安全性的资产；受益于AI科技浪潮和“新质生产力”等增量逻辑的资产。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格按照中国证监会相关规定和基金合同关于估值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。会计师事务所在管理人改变估值技术导致基金资产净值的变化在0.25%以上时对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。本基金管理人设立估值委员会，成员主要由公募基金事业部相关领导、投研、交易、合规风控及运营等部门人员组成，以上人员均具有专业胜任能力和相关工作经验。基金经理列席会议，但不参与具体决策。参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种、流通受限股票等的估值数据。

#### 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实施利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，因赎回等原因，本基金自2024年1月1日至2024年6月19日连续110个工作日净值低于5000万。本报告期内本基金未出现连续20个工作日基金持有人数不满二百人的情形。

### §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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在人保稳进配置三个月持有期混合型基金中基金(FOF)（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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应尽的义务。

#### 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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

### §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：人保稳进配置三个月持有期混合型基金中基金(FOF)

报告截止日：2024年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末	上年度末
----	-----	-----	------

		2024年06月30日	2023年12月31日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	290,778.18	375,143.55
结算备付金		126,174.47	88,090.70
存出保证金		9,057.89	11,961.28
交易性金融资产	6.4.7.2	48,655,561.69	42,290,673.55
其中：股票投资		3,286,576.00	3,364,821.00
基金投资		42,527,498.70	36,071,451.23
债券投资		2,841,486.99	2,854,401.32
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	2,800,000.00	-90.41
应收清算款		331,374.86	6,166,588.45
应收股利		8,880.00	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		52,221,827.09	48,932,367.12
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年06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		100,972.25	35,530.75
应付赎回款		-	4,228,650.00
应付管理人报酬		29,810.22	33,244.59

应付托管费		6,185.35	6,467.03
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		69.91	13.60
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	71,424.79	62,420.10
负债合计		208,462.52	4,366,326.07
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	54,032,676.58	46,895,358.83
未分配利润	6.4.7.8	-2,019,312.01	-2,329,317.78
净资产合计		52,013,364.57	44,566,041.05
负债和净资产总计		52,221,827.09	48,932,367.12

注：报告截止日2024年06月30日，人保稳进配置三个月持有(FOF)份额净值人民币0.9626元，基金份额总额54,032,676.58份。

## 6.2 利润表

会计主体：人保稳进配置三个月持有期混合型基金中基金(FOF)

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至202 3年06月30日
一、营业总收入		735,366.52	1,662,494.88
1.利息收入		13,182.24	9,175.38
其中：存款利息收入	6.4.7.9	2,373.25	4,853.89
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		10,808.99	4,321.49
其他利息收入		-	-

2.投资收益（损失以“-”填列）		-39,322.13	650,159.83
其中：股票投资收益	6.4.7.10	1,090.97	353,582.74
基金投资收益	6.4.7.11	-174,907.92	-68,098.46
债券投资收益	6.4.7.12	19,114.61	36,317.59
资产支持证券投资 收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	115,380.21	328,357.96
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	761,506.20	1,003,159.42
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	0.21	0.25
<b>减：二、营业总支出</b>		239,211.10	327,788.71
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	172,589.17	233,234.22
2.托管费	6.4.10.2.2	35,477.50	46,422.90
3.销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
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	6.4.7.20	-	-
7.税金及附加		263.17	2,268.41
8.其他费用	6.4.7.21	30,881.26	45,863.18
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		496,155.42	1,334,706.17
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		496,155.42	1,334,706.17
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		496,155.42	1,334,706.17

### 6.3 净资产变动表

会计主体：人保稳进配置三个月持有期混合型基金中基金(FOF)

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06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	46,895,358.83	-2,329,317.78	44,566,041.05
二、本期期初净资产	46,895,358.83	-2,329,317.78	44,566,041.05
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	7,137,317.75	310,005.77	7,447,323.52
（一）、综合收益总额	-	496,155.42	496,155.42
（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）	7,137,317.75	-186,149.65	6,951,168.10
其中：1.基金申购款	10,348,236.86	-348,737.32	9,999,499.54
2.基金赎回款	-3,210,919.11	162,587.67	-3,048,331.44
（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	54,032,676.58	-2,019,312.01	52,013,364.57
项目	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06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	65,051,490.52	-3,101,162.60	61,950,327.92
二、本期期初净资产	65,051,490.52	-3,101,162.60	61,950,327.92
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-7,280,738.99	1,572,326.26	-5,708,412.73
（一）、综合收益总额	-	1,334,706.17	1,334,706.17
（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）	-7,280,738.99	237,620.09	-7,043,118.90
其中：1.基金申购款	28,141.30	-644.84	27,496.46
2.基金赎回款	-7,308,880.29	238,264.93	-7,070,615.36
（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	57,770,751.53	-1,528,836.34	56,241,915.19

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：

黄明

贾鸣

沈静

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

人保稳进配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）（以下简称“本基金”）系由基金管理人中国人保资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《人保稳进配置三个月持有期混合型基金中基金（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[2020]281号文批准公开募集。本基金为契约型定期开放式基金，存续期限为不定期，首次设立募集基金份额为239,282,825.01份，经毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）验证，并出具了编号为毕马威华振验字第2000721号的验资报告。基金合同于2020年9月17日正式生效。本基金的管理人为中国人保资产管理有限公司，托管人为中国银行股份有限公司。

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本基金招募说明书的有关规定，本基金的投资范围包括经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金（不包括QDII基金和香港互认基金）、国内依法发行上市的股票（包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、次级债券）、资产支持证券、银行存款、货币市场工具（含同业存单）以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。基金的投资组合比例为：本基金80%以上的基金资产投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集基金份额，其中，股票、股票型基金与混合型基金占比合计不高于基金资产的30%；每个交易日日终，现金或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、存出保证金及应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中债总财富指数收益率\*80%+沪深300指数收益率\*20%。

### 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颁布的《企业会计准则》、应用指南、解释及其他相关规定，并参照中国证监会发布的《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>》以及中国证券投资基金业协会发布的《证券投资基金会计核算业务指引》等基金行业实务操作的有关规定编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金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6月30日的财务状况以及2024年1月1日至2024年6月30日的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

### 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[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]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。

(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。

(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06月30日
活期存款	290,778.18
等于：本金	290,675.44
加：应计利息	102.74
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	290,778.18

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	3,242,478.67	-	3,286,576.00	44,097.33
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	37,326.99	2,841,486.99	2,570.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	37,326.99	2,841,486.99	2,570.00
资产支持证券	-	-	-	-
基金	42,080,598.16	-	42,527,498.70	446,900.54
其他	-	-	-	-
合计	48,124,666.83	37,326.99	48,655,561.69	493,567.87

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	2,800,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	2,800,000.00	-

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金本报告期末无因买断式逆回购交易而取得的债券。

**6.4.7.5 其他资产**

本基金本报告期末未持有其他资产。

**6.4.7.6 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06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	41,589.53
其中：交易所市场	41,589.53
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	29,835.26
合计	71,424.79

**6.4.7.7 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	46,895,358.83	46,895,358.83
本期申购	10,348,236.86	10,348,236.86
本期赎回（以“-”号填列）	-3,210,919.11	-3,210,919.11
本期末	54,032,676.58	54,032,676.58

注：本期申购含红利再投、转换入份(金)额，本期赎回含转换出份(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	-1,931,111.62	-398,206.16	-2,329,317.78
本期期初	-1,931,111.62	-398,206.16	-2,329,317.78
本期利润	-265,350.78	761,506.20	496,155.42
本期基金份额交易产生的变动数	-327,912.97	141,763.32	-186,149.65
其中：基金申购款	-488,437.48	139,700.16	-348,737.32
基金赎回款	160,524.51	2,063.16	162,587.67
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,524,375.37	505,063.36	-2,019,312.01

## 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
活期存款利息收入	912.14
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	1,365.21
其他	95.90
合计	2,373.25

## 6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
卖出股票成交总额	58,523,344.84
减：卖出股票成本总额	58,398,694.91
减：交易费用	123,558.96
买卖股票差价收入	1,090.97

**6.4.7.11 基金投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
卖出/赎回基金成交总额	8,341,464.39
减：卖出/赎回基金成本总额	8,509,156.41
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	1,868.77
减：交易费用	5,347.13
基金投资收益	-174,907.92

**6.4.7.12 债券投资收益****6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
债券投资收益——利息收入	23,860.61
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-4,746.00
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	19,114.61

**6.4.7.12.2 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01月01日至2024年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,854,776.36
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,804,564.00

减：应计利息总额	54,958.36
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-4,746.00

#### 6.4.7.13 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
股票投资产生的股利收益	27,980.68
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	87,399.53
合计	115,380.21

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
1.交易性金融资产	761,506.20
——股票投资	-30,190.97
——债券投资	6,854.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	784,843.17
——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	761,506.20

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
基金赎回费收入	0.21
合计	0.21

#### 6.4.7.19 持有基金产生的费用

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	17,118.21
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	82,206.55
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	21,359.32

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、管理费及托管费等进行的估算，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。

#### 6.4.7.20 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

#### 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2024年01月01日至2024年06月30日
审计费用	4,972.24
信息披露费	24,863.02
证券出借违约金	-
汇划手续费	1,046.00
合计	30,881.26

## 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，本基金没有需要在财务报表附注中说明的重大或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的重大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

本基金本报告期内不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。

### 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
中国人保资产管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
中国人民保险集团股份有限公司	基金管理人控股股东

注：下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立，与本基金管理人同受一方控制的关联方发生的交易已经根据实际发生情况于下文分别列示。

## 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

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

#### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

#### 6.4.10.1.5 基金交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的基金交易。

#### 6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

### 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01月01日至20 24年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至20 23年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	172,589.17	233,234.22
其中：应支付销售机构的客户维护费	41,119.93	62,542.04
应支付基金管理人的净管理费	131,469.24	170,692.18

注：支付基金管理人中国人保资产管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值扣除基金财产中本基金的基金管理人管理的其他基金份额所对应资产净值后剩余部分(若为负数，则取0)的0.80%年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值扣除基金财产中本基金的基金管理人管理的其他基金份额所对应资产净值后剩余部分(若为负数，则取0)×0.80%÷当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024	上年度可比期间 2023年01月01日至2023
----	------------------------	-----------------------------

	年06月30日	年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	35,477.50	46,422.90

注：支付基金托管人中国银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值扣除基金财产中本基金托管人托管的其他基金份额所对应资产净值后剩余部分(若为负数，则取0)的0.20%年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值扣除基金财产中本基金托管人托管的其他基金份额所对应资产净值后剩余部分(若为负数，则取0) $\times$ 0.20% $\div$ 当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

本基金不收取销售服务费。

#### 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

本基金本报告期内及上年度可比期间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

本基金本报告期内及上年度可比期间无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

本基金本报告期内及上年度可比期间无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01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至 2023年06月30日
报告期初持有的基金份额	13,499,000.00	19,999,000.00

报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	2,000,000.00
报告期末持有的基金份额	13,499,000.00	17,999,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	24.98%	31.16%

#### 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 2024年06月30日		上年度末 2023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
中国人民健康保险股份有限公司	9,999,000.00	18.51%	9,999,000.00	21.32%

#### 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01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	290,778.18	912.14	2,053,454.70	3,681.87

注：本基金由基金托管人中国银行股份有限公司保管的银行存款利息收入，按银行同业或协议利率计算。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### **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**

本基金本报告期及上年度可比期间无其他关联交易事项的说明。

##### **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**

本基金本报告期及上年度可比期间无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。

#### **6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金**

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### **6.4.12 期末（2024年06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**

本基金本报告期末无因认购新发/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**

本基金本报告期末无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**

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

###### **6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

##### **6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券**

本基金本报告期末无因参与转融通证券出借业务而出借的证券。

#### **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**

本基金在日常经营活动中面临的相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。与本基金相关的市场风险主要包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在力求基金资产安全性、较高流动性的基础上，追求超过业绩比较基准的稳定收益。

本基金的基金管理人建立了由董事会负最终责任、管理层直接领导、内部控制职能部门统筹协调、内部控制评价部门监察监督、业务职能部门负首要责任的分工明确、路线清晰、相互协作、有效执行的内部控制组织体系。公募基金事业部部务会为公募基金业务日常运行管理的议事机构，负责事业部经营管理重要事项的研究与决定，以及拟提交公司审批事项的审核。

为加强公募基金管理的内部控制，防范和化解经营风险，提高经营管理效益，保障基金持有人利益，基金管理人遵照中国法律和公司章程的规定履行职责，建立健全公司授权标准和程序，确保授权制度的贯彻执行；公募基金事业部及各职能部门根据既定的业务规范、制度执行具体业务；董事会下设风险管理与消费者权益保护委员会、监事会、总裁室下设风险合规委员会、风险管理部、法律合规部为公司不同层面的监督机构，构成公司相对独立的监督系统。

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**

信用风险是指基金所投资证券的发行人出现违约或拒绝支付到期利息、本金，或基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任等，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在证券交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小。本基金在进行银行间同业市场债券交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

本基金报告期末债券投资按短期信用评级及长期信用评级列示的情况如下，其中不包括本基金所持有的国债、央行票据、政策性金融债。

##### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

##### **6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

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**

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**

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**

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**

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**

#### **6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析**

流动性风险指因市场交易相对不活跃导致基金投资资产无法以适当价格及时变现，进而无法应对债务到期偿付或投资者赎回款按时支付的风险。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本报告期内，基金管理人坚持组合管理、分散投资的基本原则，严格按照法律法规的有关规定和基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理，本基金所持大部分证券在证券交易所上市或银行间同业市场交易，不存在具有重大流动性风险的投资品种。

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，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。

截至本报告期末及上年度末，本基金无重大流动性风险。

### **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，主要包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和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日常通过对持仓品种组合的久期分析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0 6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	290,778.18	-	-	-	290,778.18
结算备付金	126,174.47	-	-	-	126,174.47
存出保证金	9,057.89	-	-	-	9,057.89
交易性金融资产	2,841,486.99	-	-	45,814,074.70	48,655,561.69
买入返售金融资产	2,800,000.00	-	-	-	2,800,000.00
应收清算款	-	-	-	331,374.86	331,374.86
应收股利	-	-	-	8,880.00	8,880.00
资产总计	6,067,497.53	-	-	46,154,329.56	52,221,827.09
负债					

应付清算款	-	-	-	100,972.25	100,972.25
应付管理人报酬	-	-	-	29,810.22	29,810.22
应付托管费	-	-	-	6,185.35	6,185.35
应交税费	-	-	-	69.91	69.91
其他负债	-	-	-	71,424.79	71,424.79
负债总计	-	-	-	208,462.52	208,462.52
利率敏感度缺口	6,067,497.53	-	-	45,945,867.04	52,013,364.57
上年度末 2023年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	375,143.55	-	-	-	375,143.55
结算备付金	88,090.70	-	-	-	88,090.70
存出保证金	11,961.28	-	-	-	11,961.28
交易性金融资产	2,854,401.32	-	-	39,436,272.23	42,290,673.55
买入返售金融资产	-90.41	-	-	-	-90.41
应收清算款	-	-	-	6,166,588.45	6,166,588.45
资产总	3,329,506.44	-	-	45,602,860.68	48,932,367.12

计					
负债					
应付清算款	-	-	-	35,530.75	35,530.75
应付赎回款	-	-	-	4,228,650.00	4,228,650.00
应付管理人报酬	-	-	-	33,244.59	33,244.59
应付托管费	-	-	-	6,467.03	6,467.03
应交税费	-	-	-	13.60	13.60
其他负债	-	-	-	62,420.10	62,420.10
负债总计	-	-	-	4,366,326.07	4,366,326.07
利率敏感度缺口	3,329,506.44	-	-	41,236,534.61	44,566,041.05

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，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		
假设	假设所有期限的利率保持同方向同幅度的变化(即平移收益率曲线)		
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06月30日	上年度末 2023年12月31日
	1.市场利率上升25个基点	-2,390.51	-328.54
	2.市场利率下降25个基点	2,399.50	329.40

#### 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均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险，该风险可能与特定投资品种相关，也有可能与整体投资品种相关。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的债券和股票，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金在构建资产配置和基金资产投资组合的基础上，通过建立事前和事后跟踪误差的方式，对基金资产的市场价格风险进行管理。

于6月30日，本基金面临的其他市场价格风险列示如下：

##### 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06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	3,286,576.00	6.32	3,364,821.00	7.55
交易性金融资产—基金投资	42,527,498.70	81.76	36,071,451.23	80.94
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	45,814,074.70	88.08	39,436,272.23	88.49

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化5%，其他变量不变		
	用期末时点比较基准浮动5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险		
	Beta系数是根据组合的净值数据和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性		
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06月30日	上年度末 2023年12月31日
	1.业绩比较基准增加5%	591,809.35	456,489.39
	2.业绩比较基准减少5%	-591,809.35	-456,489.39

#### 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公开报价。

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06月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	45,814,074.70	39,436,272.23
第二层次	2,841,486.99	2,854,401.32
第三层次	-	-
合计	48,655,561.69	42,290,673.55

###### 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；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，确定相关股票和债券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6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。

#### 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银行存款、结算备付金和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	3,286,576.00	6.29
	其中：股票	3,286,576.00	6.29
2	基金投资	42,527,498.70	81.44
3	固定收益投资	2,841,486.99	5.44
	其中：债券	2,841,486.99	5.44
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	2,800,000.00	5.36
	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	416,952.65	0.80
8	其他各项资产	349,312.75	0.67
9	合计	52,221,827.09	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

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,974,461.00	5.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	312,115.00	0.60
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,286,576.00	6.32

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300476	胜宏科技	4,000	129,040.00	0.25
2	002371	北方华创	400	127,956.00	0.25
3	002444	巨星科技	5,000	123,500.00	0.24
4	002938	鹏鼎控股	3,000	119,280.00	0.23
5	002475	立讯精密	3,000	117,930.00	0.23
6	603556	海兴电力	2,500	117,075.00	0.23
7	002138	顺络电子	4,200	115,332.00	0.22
8	688120	华海清科	600	113,748.00	0.22
9	688012	中微公司	800	113,008.00	0.22
10	002384	东山精密	5,400	111,780.00	0.21
11	688018	乐鑫科技	1,000	98,680.00	0.19
12	688300	联瑞新材	2,000	96,200.00	0.18
13	688072	拓荆科技	800	96,088.00	0.18
14	688378	奥来德	4,000	93,840.00	0.18
15	300408	三环集团	3,100	90,489.00	0.17
16	000528	柳工	8,000	89,520.00	0.17
17	688630	芯碁微装	1,300	81,341.00	0.16
18	688252	天德钰	5,500	79,915.00	0.15
19	688183	生益电子	4,000	77,520.00	0.15
20	688772	珠海冠宇	5,000	74,500.00	0.14
21	000680	山推股份	8,000	74,160.00	0.14
22	300502	新易盛	700	73,885.00	0.14
23	688093	世华科技	4,000	72,680.00	0.14
24	300750	宁德时代	400	72,012.00	0.14
25	603160	汇顶科技	1,000	68,750.00	0.13
26	002273	水晶光电	4,000	67,920.00	0.13

27	002270	华明装备	3,000	66,720.00	0.13
28	600031	三一重工	4,000	66,000.00	0.13
29	000400	许继电气	1,900	65,379.00	0.13
30	603228	景旺电子	2,000	63,600.00	0.12
31	002993	奥海科技	1,700	63,240.00	0.12
32	688352	颀中科技	5,000	57,050.00	0.11
33	300308	中际旭创	400	55,152.00	0.11
34	688019	安集科技	420	52,836.00	0.10
35	688052	纳芯微	500	51,390.00	0.10
36	688484	南芯科技	1,300	48,230.00	0.09
37	300661	圣邦股份	500	41,390.00	0.08
38	300459	汤姆猫	10,000	33,900.00	0.07
39	688518	联赢激光	2,000	33,400.00	0.06
40	000921	海信家电	1,000	32,240.00	0.06
41	688009	中国通号	5,000	30,000.00	0.06
42	002292	奥飞娱乐	5,000	29,900.00	0.06

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	688300	联瑞新材	1,123,881.49	2.52
2	300308	中际旭创	1,071,169.00	2.40
3	688378	奥来德	969,707.83	2.18
4	002463	沪电股份	809,852.00	1.82
5	300502	新易盛	806,517.00	1.81
6	688072	拓荆科技	794,781.44	1.78
7	688484	南芯科技	786,641.28	1.77
8	300563	神宇股份	743,441.00	1.67

9	301012	扬电科技	732,287.80	1.64
10	601138	工业富联	711,645.00	1.60
11	001283	豪鹏科技	699,718.00	1.57
12	688200	华峰测控	695,024.99	1.56
13	603283	赛腾股份	662,474.00	1.49
14	002130	沃尔核材	626,974.00	1.41
15	603508	思维列控	566,721.00	1.27
16	688012	中微公司	553,253.70	1.24
17	300418	昆仑万维	548,777.00	1.23
18	688676	金盘科技	548,436.46	1.23
19	300666	江丰电子	548,426.11	1.23
20	688535	华海诚科	530,865.42	1.19

注：本项"买入金额"按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	688300	联瑞新材	1,257,404.19	2.82
2	300308	中际旭创	1,087,044.91	2.44
3	688378	奥来德	955,493.40	2.14
4	688484	南芯科技	834,858.00	1.87
5	002463	沪电股份	823,146.00	1.85
6	300502	新易盛	797,075.00	1.79
7	001283	豪鹏科技	765,253.00	1.72
8	301012	扬电科技	751,345.00	1.69
9	300563	神宇股份	748,110.00	1.68
10	688072	拓荆科技	729,782.05	1.64
11	601138	工业富联	711,873.00	1.60
12	603283	赛腾股份	711,627.00	1.60

13	688200	华峰测控	684,168.66	1.54
14	002130	沃尔核材	641,493.00	1.44
15	300418	昆仑万维	614,368.00	1.38
16	300666	江丰电子	555,683.00	1.25
17	603508	思维列控	545,883.00	1.22
18	688676	金盘科技	545,183.76	1.22
19	300394	天孚通信	540,380.00	1.21
20	300624	万兴科技	535,797.02	1.20

注：本项"卖出金额"按卖出成交金额填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	58,350,640.88
卖出股票收入（成交）总额	58,523,344.84

注：本项"买入股票成本"、"卖出股票收入"按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	2,841,486.99	5.46
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	2,841,486.99	5.46

### 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	019727	23国债24	15,000	1,527,285.62	2.94
2	019709	23国债16	8,000	812,492.05	1.56
3	019740	24国债09	5,000	501,709.32	0.96

**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**

本基金本报告期末无股指期货投资。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

本基金本报告期末无国债期货投资。

**7.12 本报告期投资基金情况****7.12.1 投资政策及风险说明**

报告期内，所投资的子基金均运作情况较好，未发生基金转换运作方式的情况。运作期内，投资过程符合基金合同约定的投资政策、投资限制等要求。

本基金为基金中基金，通过定量和定性相结合的方法筛选出各类资产类别中优秀的基金经理和基金品种进行投资，力求基金资产的长期稳健增值。本基金80%以上的基金资产投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集基金份额，其中股票、股票型基金与混合型基金占比合计不高于基金资产的30%。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，本基金整体风险符合基金合同约定的投资政策、投资限制等要求。

**7.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细**

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额 (份)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例(%)	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	162715	广发聚源LOF	契约型 开放式	2,870,627. 35	3,306,962. 71	6.36	否
2	000385	景顺长城景颐 双利债券A	契约型 开放式	1,936,800. 53	3,195,720. 87	6.14	否
3	007888	农银汇理金盈 债券	契约型 开放式	2,861,840. 02	3,031,833. 32	5.83	否
4	006338	华安安浦债券C	契约型 开放式	3,070,833. 36	3,024,463. 78	5.81	否
5	007542	永赢开泰中高 等级中短债债 券A	契约型 开放式	2,251,418. 05	2,535,547. 01	4.87	否
6	110007	易方达稳健收 益债券A	契约型 开放式	1,757,772. 56	2,352,602. 79	4.52	否
7	511010	国债ETF	契约型 开放式	17,100.00	2,340,972. 90	4.50	否
8	002882	中加丰润纯债 债券C	契约型 开放式	1,863,345. 49	2,069,804. 17	3.98	否
9	005159	华泰保兴尊合 债券A	契约型 开放式	1,747,266. 51	2,066,841. 55	3.97	否
10	008865	鑫元中短债债 券C	契约型 开放式	1,797,833. 70	2,053,126. 09	3.95	否
11	004322	创金合信尊隆 纯债债券A	契约型 开放式	1,914,388. 14	2,052,224. 09	3.95	否
12	008207	国泰合融纯债 债券A	契约型 开放式	1,833,038. 32	2,026,057. 26	3.90	否

13	000171	易方达裕丰回报债券A	契约型 开放式	1,136,144.14	1,972,346.23	3.79	否
14	008791	招商安华债券A	契约型 开放式	1,433,442.34	1,646,451.87	3.17	否
15	003638	安信永鑫增强债券C	契约型 开放式	1,558,073.65	1,637,067.98	3.15	否
16	511060	5年地债	契约型 开放式	14,800.00	1,552,120.40	2.98	否
17	511520	政金债	契约型 开放式	8,000.00	875,224.00	1.68	否
18	015779	景顺长城价值边际灵活配置混合C	契约型 开放式	378,816.58	608,303.66	1.17	否
19	000893	工银瑞信创新动力股票	契约型 开放式	501,256.14	527,321.46	1.01	否
20	001044	嘉实新消费股票	契约型 开放式	218,299.57	520,862.77	1.00	否
21	511990	华宝添益	契约型 开放式	5,087.00	508,745.78	0.98	否
22	017535	东方红京东大数据灵活配置混合C	契约型 开放式	203,500.20	495,726.49	0.95	否
23	002165	汇添富达欣灵活配置混合C	契约型 开放式	288,850.38	468,226.47	0.90	否
24	015450	华泰柏瑞多策略灵活配置混合C	契约型 开放式	151,478.43	272,494.55	0.52	否
25	002872	华夏智胜价值成长股票C	契约型 开放式	189,813.35	255,355.90	0.49	否
26	014339	长江智能制造混合A	契约型 开放式	251,994.31	235,438.28	0.45	否
27	004674	富国新机遇灵活配置混合A	契约型 开放式	155,133.65	227,363.88	0.44	否

28	260117	景顺长城支柱产业混合A	契约型 开放式	114,950.54	202,198.00	0.39	否
29	512200	地产ETF	契约型 开放式	300,000.00	126,600.00	0.24	否
30	512660	军工ETF	契约型 开放式	110,000.00	96,690.00	0.19	否
31	512880	证券ETF	契约型 开放式	120,000.00	93,960.00	0.18	否
32	008187	淳厚信睿核心精选混合C	契约型 开放式	51,435.04	92,984.27	0.18	否
33	588200	科创芯片	契约型 开放式	60,000.00	55,860.00	0.11	否
34	003625	创金合信资源主题精选股票C	契约型 开放式	0.07	0.17	0.00	否

### 7.13 投资组合报告附注

#### 7.13.1

胜宏科技（代码：300476.SZ）为本基金前十大持仓证券。2023年7月28日，据深圳证券交易所发布的自律监管及纪律处分信息显示，胜宏科技（惠州）股份有限公司因《关于收购 Pole Star Limited 100%股权的公告》信息披露问题，深圳证券交易所决定对公司采取出具关注函的监督管理措施。

本基金投资上述证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述证券外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期未被监管部门立案调查，且在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

#### 7.13.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

#### 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	9,057.89
2	应收清算款	331,374.86

3	应收股利	8,880.00
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	349,312.75

#### 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中不存在流通受限的股票。

#### 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，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

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
229	235,950.55	33,845,718.10	62.64%	20,186,958.48	37.36%

#### 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	138,759.20	0.26%

#### 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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2020年09月17日)基金份额总额	239,282,825.01
本报告期期初基金份额总额	46,895,358.83
本报告期基金总申购份额	10,348,236.86
减：本报告期基金总赎回份额	3,210,919.11
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	54,032,676.58

注：1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；  
2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金管理人以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，审议《关于持续运作人保稳进配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）的议案》，具体可参见基金管理人于2024年6月7日发布的《关于以通讯方式召开人保稳进配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金份额持有人大会的公告》及相关提示性公告。

### 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

2024年1月24日，本基金管理人发布了《中国人保资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告》，2024年1月5日新任公司公募基金事业部总经理贾鸣，原公司公募基金事业部总经理蔡红标因工作安排转任公司风险管理部总经理。

2024年4月13日，本基金管理人发布了《中国人保资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告》，2024年4月8日新任公司总裁黄本尧。

2024年6月20日，本基金管理人发布了《中国人保资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告》，2024年6月14日公司总裁黄本尧因工作调整离任。

本报告期内，经中国银行股份有限公司研究决定，郭德秋先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 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、基金托管人基金托管业务的重大诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期无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

本基金本报告期内未改聘为其审计的会计师事务所。

### 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

#### 10.7.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本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

本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	
东北证券	1	-	-	-	-	-
东兴	1	-	-	-	-	-

证券						
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	34,725,133.25	29.71%	25,661.88	29.56%	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	80,351,989.56	68.75%	59,800.93	68.89%	-
银河证券	2	1,796,862.91	1.54%	1,340.28	1.54%	-

注：本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。

1、基金交易单元的选择标准如下：

(1)基本情况：包括但不限于资本充足，财务状况及最近三年盈利情况良好；主要股东实力强大；具备投资组合运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合进行证券交易的需要，并能为投资组合提供全面的信息服务；

(2)公司治理：公司治理完善，股东会、董事会、监事会及管理层权责明确，内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足投资组合运作高度保密的要求；

(3)研究实力：有固定的研究机构和数量足够的专职研究人员以及研究水平处于行业领先水平的研究员；研究覆盖面广，能涵盖宏观经济、行业、个股、债券、策略等各项领域，并能在符合相关法规及执业规范的前提下，根据公司的特定要求，提供专题研究报告；研究报告应分析严谨，观点独立、客观，并具备较强风险意识和风险测算能力；

2、基金交易单元的选择程序如下：

(1)本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。

(2)基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

3、报告期内基金租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内新增交易单元有：东北证券上交所交易单元1个，无退租交易单元。

### 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	成交金额	占当期债	成交金额	占当期权	成交金额	占当期基

		券成交总 额的比例		券回购成 交总额的 比例		证成交总 额的比例		金成交总 额的比例
东北证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证 券	500,375.00	10.42%	72,000,000. 00	58.70%	-	-	3,511,053.8 0	39.30%
华创证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	4,301,033.0 0	89.58%	50,666,000. 00	41.30%	-	-	5,422,326.9 0	60.70%
银河证 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	关于旗下基金2023年4季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-01-19
2	人保稳进配置三个月持有期混合型基金中基金(FOF)2023年第4季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2024-01-19
3	中国人保资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-01-24
4	关于旗下基金在部分销售机构暂停办理相关销售业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-02-01
5	关于旗下部分基金招募说明书及基金产品资料概要更新的提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-03-15
6	人保稳进配置三个月持有期	中国证监会规定报刊及网站	2024-03-15

	混合型基金中基金(FOF)招募说明书更新(2024年第1号)		
7	人保稳进配置三个月持有期混合型基金中基金(FOF)基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2024-03-15
8	公司旗下部分基金2023年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-03-30
9	人保稳进配置三个月持有期混合型基金中基金(FOF)2023年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2024-03-30
10	中国人保资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-04-13
11	公司旗下基金2024年1季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-04-19
12	人保稳进配置三个月持有期混合型基金中基金(FOF)2024年第1季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2024-04-19
13	关于以通讯方式召开人保稳进配置三个月持有期混合型基金中基金(FOF)基金份额持有人大会的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-06-07
14	关于以通讯方式召开人保稳进配置三个月持有期混合型基金中基金(FOF)基金份额持有人大会的第一次提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-06-08
15	关于以通讯方式召开人保稳进配置三个月持有期混合型基金中基金(FOF)基金份额持有人大会的第二次提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-06-11
16	中国人保资产管理有限公司	中国证监会规定报刊及网站	2024-06-20

	基金行业高级管理人员变更公告		
17	关于旗下部分基金基金产品资料概要更新的提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-06-21
18	人保稳进配置三个月持有期混合型基金中基金(FOF)基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2024-06-21

## §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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20240101 - 20240620	9,999,000.00	-	-	9,999,000.00	18.51%
	2	20240101 - 20240630	13,499,000.00	-	-	13,499,000.00	24.98%

#### 产品特有风险

本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况，该类投资者大额赎回所持有的基金份额时，将可能产生流动性风险，即基金资产不能迅速变现，或者未能以合理的价格变现基金资产以支付投资者赎回款，对资产净值产生不利影响。

当开放式基金发生巨额赎回，基金管理人认为基金组合资产变现能力有限或认为因应对赎回导致的资产变现对基金单位份额净值产生较大的波动时，为了切实保护存量基金份额持有人的合法权益，可能出现延期支付赎回款等情形。同时为了公平对待所有投资者合法权益不受损害，管理人有权根据基金合同和招募说明书的约定，暂停或者拒绝申购、暂停赎回，基金份额持有人存在可能无法及时赎回持有的全部基金份额的风险。

在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模连续六十个工作日低于5000万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。此外，当单一基金份额持有人所持有的基金份额已经达到或超过本基金规模的50%或者接受某笔或者某些申购或转换转入申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%时，本基金管理人可拒绝该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，本基金自2024年6月28日起下调股票交易佣金费率。

## §12 备查文件目录

## 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予人保稳进配置三个月持有期混合型基金中基金(FOF)募集注册的文件；
- 2、《人保稳进配置三个月持有期混合型基金中基金(FOF)基金合同》；
- 3、《人保稳进配置三个月持有期混合型基金中基金(FOF)托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 5、报告期内人保稳进配置三个月持有期混合型基金中基金(FOF)在规定报刊上披露的各项公告的原稿。

## 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

## 12.3 查阅方式

基金管理人办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道1198号20层、21层、22层、25层03、04单元、26层01、02、07、08单元

基金托管人地址：北京市西城区复兴门内大街1号

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人中国人保资产管理有限公司。

客户服务中心电话：400-820-7999

基金管理人网址：[fund.piccamc.com](http://fund.piccamc.com)

中国人保资产管理有限公司  
二〇二四年八月三十一日