

浦银安盛颐璇平衡养老目标三年持有期混  
合型基金中基金（FOF）  
2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：浦银安盛基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2025 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 月 29 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 2025 年 1 月 1 日起至 2025 年 6 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                              | 6         |
| <b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>                | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现                              | 7         |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>9</b>  |
| 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              | 12        |
| 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                 | 15        |
| 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       | 15        |
| <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等内容真实、准确和完整发表意见       | 16        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>              | <b>16</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 16        |
| 6.2 利润表                                 | 17        |
| 6.3 净资产变动表                              | 18        |
| 6.4 报表附注                                | 20        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b>                       | <b>41</b> |
| 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                    | 42        |
| 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                     | 42        |
| 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      | 43        |

|                                             |           |
|---------------------------------------------|-----------|
| 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 ..... | 43        |
| 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 ..... | 43        |
| 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 本报告期投资基金情况 .....                       | 43        |
| 7.13 投资组合报告附注 .....                         | 46        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>                  | <b>47</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 47        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 47        |
| 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 .....      | 47        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>                  | <b>48</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>                    | <b>48</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 48        |
| 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 .....      | 48        |
| 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 .....                           | 50        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>            | <b>51</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 .....    | 51        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                   | 52        |
| <b>§ 12 备查文件目录 .....</b>                    | <b>52</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                           | 52        |
| 12.2 存放地点 .....                             | 52        |
| 12.3 查阅方式 .....                             | 52        |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

|                 |                                |                        |
|-----------------|--------------------------------|------------------------|
| 基金名称            | 浦银安盛颐璇平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF） |                        |
| 基金简称            | 浦银安盛颐璇平衡养老目标三年混合（FOF）          |                        |
| 基金主代码           | 017453                         |                        |
| 基金运作方式          | 契约型开放式                         |                        |
| 基金合同生效日         | 2023 年 7 月 31 日                |                        |
| 基金管理人           | 浦银安盛基金管理有限公司                   |                        |
| 基金托管人           | 交通银行股份有限公司                     |                        |
| 报告期末基金份额总额      | 248,481,451.94 份               |                        |
| 基金合同存续期         | 不定期                            |                        |
| 下属分级基金的基金简称     | 浦银安盛颐璇平衡养老目标三年混合（FOF）A         | 浦银安盛颐璇平衡养老目标三年混合（FOF）Y |
| 下属分级基金的交易代码     | 017453                         | 020275                 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 247,785,325.48 份               | 696,126.46 份           |

2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                                                                                                                                                       |
|--------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 本基金将运用主动资产配置和精选基金的投资方法进行投资，在通过 VaR 和风险预算模型控制整体波动率的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。                                                                                                                                                                |
| 投资策略   | 本基金结合大类资产配置和基金优选模型，灵活配置大类资产组建基金投资组合，从而实现基金资产在长时间内保值增值的目的。通过对全球、国内的宏观经济、金融市场的深入研究，形成对权益、固收等各大类资产的投资观点，进一步应用资产配置的量化模型（Black-Litterman 模型）确定其组合权重，实现基金资产在大类资产间的有效配置。同时，通过独创的量化基金优选模型来筛选基金，获取大类资产内部的 Alpha，最终实现基金资产在长时间内保值增值的目的。          |
| 业绩比较基准 | 中证债券型基金指数收益率×40%+中证股票型基金指数收益率×50%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×5%+银行活期存款利率（税后）×5%                                                                                                                                                                |
| 风险收益特征 | 本基金为基金中基金，由于本基金主要投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金的基金份额，持有基金的预期风险和预期收益间接成为本基金的预期风险和预期收益。本基金属于目标风险策略基金中风险收益特征相对平衡的基金，其预期收益和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、货币型基金中基金。<br>本基金可投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。 |

注：自 2025 年 2 月 26 日起，本基金业绩比较基准由原“中证债券型基金指数收益率×45%+中证  
第 5 页 共 52 页

股票型基金指数收益率×50%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×5%”变更为“中证债券型基金指数收益率×40%+中证股票型基金指数收益率×50%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×5%+银行活期存款利率（税后）×5%”。具体内容详见基金管理人于 2025 年 2 月 26 日发布的《浦银安盛基金管理有限公司关于旗下部分基金变更业绩比较基准并修改基金合同相应条款的公告》。

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          |      | 浦银安盛基金管理有限公司                                               | 交通银行股份有限公司              |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 薛香                                                         | 方圆                      |
|             | 联系电话 | 021-23212888                                               | 95559                   |
|             | 电子邮箱 | compliance@py-axa.com                                      | fangy_20@bankcomm.com   |
| 客户服务电话      |      | 021-33079999 或 400-8828-999                                | 95559                   |
| 传真          |      | 021-23212985                                               | 021-62701216            |
| 注册地址        |      | 中国（上海）自由贸易试验区滨江大道 5189 号地下 1 层、地上 1 层至地上 4 层、地上 6 层至地上 7 层 | 中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号 |
| 办公地址        |      | 上海市浦东新区滨江大道 5189 号 S2 座 1-7 层                              | 中国（上海）长宁区仙霞路 18 号       |
| 邮政编码        |      | 200127                                                     | 200336                  |
| 法定代表人       |      | 张健                                                         | 任德奇                     |

2.4 信息披露方式

|                     |                  |
|---------------------|------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 《证券时报》           |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.py-axa.com   |
| 基金中期报告备置地点          | 基金管理人、基金托管人的办公场所 |

2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称           | 办公地址                          |
|--------|--------------|-------------------------------|
| 注册登记机构 | 浦银安盛基金管理有限公司 | 上海市浦东新区滨江大道 5189 号 S2 座 1-7 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<br>和指标 | 报告期(2025 年 1 月 1 日-2025 年 6 月 30 日) |                             |
|-------------------|-------------------------------------|-----------------------------|
|                   | 浦银安盛颐璇平衡养老目标三年混合<br>(FOF) A         | 浦银安盛颐璇平衡养老目标三年混合<br>(FOF) Y |
| 本期已实现收益           | -1,820,677.59                       | -3,196.41                   |

|               |                       |            |
|---------------|-----------------------|------------|
| 本期利润          | 5,456,928.09          | 16,011.73  |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0220                | 0.0252     |
| 本期加权平均净值利润率   | 2.31%                 | 2.62%      |
| 本期基金份额净值增长率   | 2.32%                 | 2.56%      |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2025 年 6 月 30 日) |            |
| 期末可供分配利润      | -7,272,981.81         | -15,678.45 |
| 期末可供分配基金份额利润  | -0.0294               | -0.0225    |
| 期末基金资产净值      | 240,512,343.67        | 680,448.01 |
| 期末基金份额净值      | 0.9706                | 0.9775     |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2025 年 6 月 30 日) |            |
| 基金份额累计净值增长率   | -2.94%                | 3.74%      |

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额。

3、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

4、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。

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

浦银安盛颐璇平衡养老目标三年混合（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 |
|----|----------|-------------|------------|---------------|-----|-----|
|----|----------|-------------|------------|---------------|-----|-----|

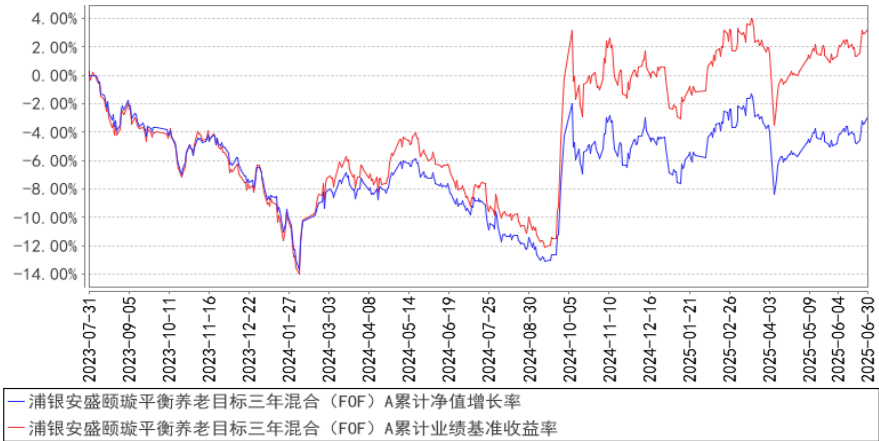
|                |        |       |        |       |        |        |
|----------------|--------|-------|--------|-------|--------|--------|
| 过去一个月          | 2.16%  | 0.38% | 2.14%  | 0.38% | 0.02%  | 0.00%  |
| 过去三个月          | 0.84%  | 0.70% | 1.59%  | 0.75% | -0.75% | -0.05% |
| 过去六个月          | 2.32%  | 0.63% | 3.54%  | 0.68% | -1.22% | -0.05% |
| 过去一年           | 6.78%  | 0.70% | 12.25% | 0.81% | -5.47% | -0.11% |
| 自基金合同生效起<br>至今 | -2.94% | 0.60% | 3.27%  | 0.70% | -6.21% | -0.10% |

浦银安盛颐璇平衡养老目标三年混合（FOF）Y

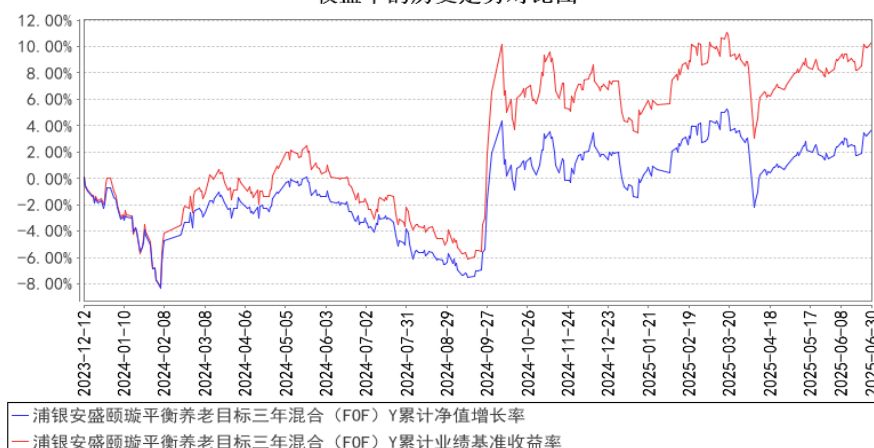
| 阶段             | 份额净值<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基准<br>收益率标准差<br>④ | ①－③    | ②－④    |
|----------------|--------------|---------------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去一个月          | 2.21%        | 0.38%               | 2.14%          | 0.38%                 | 0.07%  | 0.00%  |
| 过去三个月          | 0.97%        | 0.70%               | 1.59%          | 0.75%                 | -0.62% | -0.05% |
| 过去六个月          | 2.56%        | 0.63%               | 3.54%          | 0.68%                 | -0.98% | -0.05% |
| 过去一年           | 7.28%        | 0.70%               | 12.25%         | 0.81%                 | -4.97% | -0.11% |
| 自基金合同生效起<br>至今 | 3.74%        | 0.64%               | 10.29%         | 0.74%                 | -6.55% | -0.10% |

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

浦银安盛颐璇平衡养老目标三年混合（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



浦银安盛颐璇平衡养老目标三年混合（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



注：1、本基金于 2023 年 12 月 12 日增加 Y 类份额，详见本基金管理人于 2023 年 12 月 11 日发布的《关于浦银安盛颐璇平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）增加 Y 类基金份额并修改基金合同及托管协议相应条款的公告》。

2、自 2025 年 2 月 26 日起，本基金业绩比较基准由原“中证债券型基金指数收益率×45%+中证股票型基金指数收益率×50%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×5%”变更为“中证债券型基金指数收益率×40%+中证股票型基金指数收益率×50%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×5%+银行活期存款利率（税后）×5%”。具体内容详见基金管理人于 2025 年 2 月 26 日发布的《浦银安盛基金管理有限公司关于旗下部分基金变更业绩比较基准并修改基金合同相应条款的公告》。

## § 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

浦银安盛基金管理有限公司（以下简称“浦银安盛”）成立于 2007 年 8 月，股东为上海浦东发展银行股份有限公司、AXA Investment Managers S.A. 及上海国盛集团资产有限公司，公司总部设在上海，注册资本为 120,000 万元人民币，股东持股比例分别为 51%、39%和 10%。公司主要从事基金募集、基金销售、资产管理、境外证券投资管理和中国证监会许可的其他业务。

截至 2025 年 6 月 30 日止，浦银安盛旗下共管理 108 只基金，即浦银安盛价值成长混合型证券投资基金、浦银安盛优化收益债券型证券投资基金、浦银安盛精致生活灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛红利精选混合型证券投资基金、浦银安盛沪深 300 指数增强型证券投资基金、浦银安盛货币市场证券投资基金、浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金（LOF）、浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金、浦银安盛 6 个月持有期债券型证券投资基金、浦银安盛消费升级灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛日日盈货币市场基金、浦银安盛新经济结构灵活配置混

合型证券投资基金、浦银安盛盛世精选灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛增长动力灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛医疗健康灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛睿智精选灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛盛鑫定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛日日丰货币市场基金、浦银安盛盛泰纯债债券型证券投资基金、浦银安盛日日鑫货币市场基金、浦银安盛盛达纯债债券型证券投资基金、浦银安盛经济带崛起灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛盛跃纯债债券型证券投资基金、浦银安盛盛通定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛港股通量化优选灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛安恒回报定期开放混合型证券投资基金、浦银安盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛盛泽定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛中短债债券型证券投资基金、浦银安盛普益纯债债券型证券投资基金、浦银安盛盛融定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛普瑞纯债债券型证券投资基金、浦银安盛盛元定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛全球智能科技股票型证券投资基金（QDII）、浦银安盛双债增强债券型证券投资基金、浦银安盛盛勤 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛环保新能源混合型证券投资基金、浦银安盛上海清算所高等级优选短期融资券指数证券投资基金、浦银安盛盛煊 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛普丰纯债债券型证券投资基金、浦银安盛盛诺 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛颐和稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、浦银安盛先进制造混合型证券投资基金、浦银安盛盛智一年定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛盛晖一年定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛盛熙一年定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛科技创新优选混合型证券投资基金、浦银安盛创业板交易型开放式指数证券投资基金、浦银安盛普嘉 87 个月定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、浦银安盛价值精选混合型证券投资基金、浦银安盛普华 66 个月定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛普天纯债债券型证券投资基金、浦银安盛普庆纯债债券型证券投资基金、浦银安盛睿和优选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、浦银安盛中债 3-5 年农发行债券指数证券投资基金、浦银安盛科技创新一年持有期混合型证券投资基金（原浦银安盛科技创新一年定期开放混合型证券投资基金）、浦银安盛稳健丰利债券型证券投资基金、浦银安盛 ESG 责任投资混合型证券投资基金、浦银安盛盛华一年定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛均衡优选 6 个月持有期混合型证券投资基金、浦银安盛季季鑫 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金、浦银安盛嘉和稳健一年持有期混合型基金中基金（FOF）、浦银安盛中证 ESG 120 策略交易型开放式指数证券投资基金、浦银安盛安裕回报一年持有期混合型证券投资基金、浦银安盛中证智能电动汽车交易型开放式指数证券投资基金、浦银安盛双月鑫 60 天滚动持有短债债券型证券投资基金、浦银安盛中证证券公司 30 交易型开放

式指数证券投资基金、浦银安盛中证沪港深游戏及文化传媒交易型开放式指数证券投资基金、浦银安盛 CFETS 0-5 年期央企债券指数发起式证券投资基金、浦银安盛颐享稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、浦银安盛盛瑞纯债债券型证券投资基金、浦银安盛品质优选混合型证券投资基金、浦银安盛创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金、浦银安盛兴荣稳健一年持有期混合型基金中基金（FOF）、浦银安盛泰和配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、浦银安盛安弘回报一年持有期混合型证券投资基金、浦银安盛稳健回报 6 个月持有期债券型基金中基金（FOF）、浦银安盛普裕一年定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛兴耀优选一年持有期混合型证券投资基金、浦银安盛中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、浦银安盛稳鑫 120 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、浦银安盛盛嘉一年定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛普诚纯债债券型证券投资基金、浦银安盛中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、浦银安盛季季盈 90 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、浦银安盛普旭 3 个月定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛光耀优选混合型证券投资基金、浦银安盛中证证券公司 30 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、浦银安盛安荣回报一年持有期混合型证券投资基金、浦银安盛景气优选混合型证券投资基金、浦银安盛普兴 3 个月定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛颐璇平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、浦银安盛普恒利率债债券型证券投资基金、浦银安盛稳健富利 180 天持有期债券型证券投资基金、浦银安盛悦享 30 天持有期债券型证券投资基金、浦银安盛策略优选混合型证券投资基金、浦银安盛普安利率债债券型证券投资基金、浦银安盛养老目标日期 2050 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、浦银安盛高端装备混合型发起式证券投资基金、浦银安盛中证 A50 指数增强型证券投资基金、浦银安盛上证科创板 100 指数增强型证券投资基金、浦银安盛红利量化选股混合型证券投资基金、浦银安盛中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金、浦银安盛中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金、浦银安盛周期优选混合型发起式证券投资基金、浦银安盛普航 3 个月定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛上证科创板综合指数增强型证券投资基金。

公司信息技术系统由信息技术基础设施系统以及有关业务应用系统构成。当前，公司建设有上交所金桥托管机房和办公大楼自建机房，实现本地双活互备。同时，在合肥异地建设有灾备托管机房，实现异地备份，形成了两地三中心的架构布局。公司的机房建设、网络设备、服务器设备、监控设备等基础设施，由公司信息技术部主导并聘请专业的系统集成公司负责建成。公司业务应用系统主要包括开放式基金登记过户系统、直销系统、资金清算系统、投资交易系统、估值核算系统、网上交易系统、呼叫中心系统、外服系统、营销数据中心系统、XBRL 系统、反洗钱系统等。这些系统主要是采购行业内成熟、主流的专业系统提供商的产品建设而成，建成之后在业

务运作过程中根据公司业务的需要进行了相关的系统功能升级，升级由系统提供商负责完成，升级后的系统也均是系统提供商对外提供的通用系统。公司的基础设施及业务应用系统，建成后均由公司信息技术部负责日常的运维、管理，同时与第三方专业服务公司签订有技术服务合同，由其提供定期的巡检及特殊情况下的技术支持运维服务。此外，公司自研开发团队建成了低代码的数字化运营平台，基于 CDH 底座的大数据开发平台，集 RPA、OCR、NLP、AI 等创新技术为一体的创新研发平台以及移动平台等业务支持应用平台，积极为业务赋能。除上述情况外，公司未委托服务机构代为办理重要的、特定的信息技术系统开发、维护事项。

另外，本公司可以根据自身发展战略的需要，委托资质良好的基金服务机构代为办理基金份额登记、估值核算等业务。

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 |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 李子宸 | 本基金的基金经理 | 2024 年 8 月 22 日 | -    | 9 年    | 李子宸先生，芝加哥大学金融数学专业硕士。2016 年 1 月至 2017 年 7 月在证通股份有限公司担任金融产品经理。2017 年 7 月加盟浦银安盛基金管理有限公司，在金融工程部担任助理金融分析师一职。2019 年 7 月起调至 FOF 业务部担任研究员之职，2021 年 7 月至 2023 年 8 月在权益投资部任投资经理之职，现在 FOF 业务部任基金经理之职。2024 年 8 月至 2024 年 11 月，担任浦银安盛招睿精选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）的基金经理。2023 年 8 月起担任浦银安盛泰和配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）的基金经理。2024 年 8 月起，担任浦银安盛睿和优选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、浦银安盛颐璇平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）的基金经理。 |

注：1、首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，非首任基金经理的“任职日期”为根据公司决定确定的聘任日期，基金经理的“离任日期”均为根据公司决定确定的解聘日期。

2、证券从业含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提

下，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内未有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

本基金管理人根据《公平交易管理规定》，建立并健全了有效的公平交易执行体系，保证公平对待旗下的每一个基金组合。

在具体执行中，在投资决策流程上，构建统一的研究平台，为所有投资组合公平的提供研究支持。在投资决策过程中，严格遵守公司的各项投资管理制度和投资授权制度，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作必须经过严格的审批程序。在交易执行环节上，详细规定了面对多个投资组合交易执行的流程和规定，以保证投资执行交易过程的公平性。公司严格控制主动投资组合的同日反向交易，非经特别控制流程审批同意，不得进行。从事后监控角度上，定期对组合间同一投资标的的临近交易日的同向交易和反向交易的合理性分析评估，以及不同时间窗口下（1 日、3 日、5 日、10 日）的季度公平性交易分析评估，对旗下投资组合及其各投资类别的收益率差异进行分析。公司定期对公平交易制度的遵守和相关业务流程的执行情况进行检查，季度公平交易分析报告按规定经基金经理或投资经理签字，并经督察长、总经理审阅签字后，归档保存。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，公平对待旗下各投资组合，未发现任何违反公平交易的行为。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在违反法律、法规、中国证监会和证券交易所颁布的相关规范性文件认定的异常交易行为。报告期内未发生本基金与旗下其他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超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

### 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

一季度 GDP 同比增速 5.4%，数据显示生产端持续恢复，多项高频工业指标已超越去年同期水平，PMI 重回景气区间。需求端呈现结构性分化，以汽车为代表的消费链明显回暖。权益市场方面，国内各指数震荡上行，其中港股资产大幅上涨领跑全球。国内政策托底态度明确叠加 AI 科技革命带动港股实现两轮估值重估。债券方面经历了一轮反转交易，修正了去年适度宽松后过高的降息预期。海外方面，美国基本面降温、科技优势收敛以及政策不确定性上升，导致美国股市震荡下跌。

二季度，国内经济延续了结构性修复的态势。从需求端来看，在以旧换新等政策支持下，消

费成为经济的压舱石，内需进一步稳固。从供给端来看，工业生产总体稳健，高技术制造业引领的产业升级趋势持续推进。在海外全球贸易摩擦持续、地缘冲突加剧的背景下，国内宏观政策持续显效、科技产业升级加速推进，二季度权益市场整体呈现出探底回升且结构分化的走势。4 月初至 5 月中旬，受美国对等关税影响 A 股市场下探回升，叠加财报季来临市场风险偏好有所回落，内需消费方向成为市场的交易主线。5 月中旬，中美双方就关税问题达成初步协议，市场对关税的担忧有所缓解，但中东地缘冲突加剧背景下市场波动加大，市场进入震荡整固期，行业轮动显著加速。整体权益市场呈现“V”型走势，行业轮动速度明显加快，金融和自主可控等方向逐渐受到关注。

本产品为平衡养老型产品，随着固定收益资产的静态收益逐步下降，产品在权益的暴露相对将有所提升。组合权益暴露维度上仍然以 A 股权益资产为主，运作期内仅小幅提高港股资产的配置，力争改善组合整体风险收益特征。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末浦银安盛颐璇平衡养老目标三年混合（FOF）A 的基金份额净值为 0.9706，本报告期基金份额净值增长率为 2.32%，同期业绩比较基准收益率为 3.54%；截至本报告期末浦银安盛颐璇平衡养老目标三年混合（FOF）Y 的基金份额净值为 0.9775，本报告期基金份额净值增长率为 2.56%，同期业绩比较基准收益率为 3.54%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我国经济、政策、资产基准情形应是：外需压力可能显著加大、内需延续偏弱。上半年 GDP 增速相对全年预期处于中偏高水平，下半年政策可能难以进行强刺激，可能更聚焦稳就业、保民生、稳消费、稳地产、稳市场等领域。对应到资产端，下半年 A 股、港股、利率债、人民币汇率、黄金，可能都会偏震荡，调整可能就是机会。下半年港股市场在增量资金足、行业结构优的环境下，有望再度走出结构性牛市。从资金角度看，港股市场相较于 A 股市场交易集中度高，更多的增量资金集中在头部的少数标的，资金的抱团行为更加坚实。权益策略和配置上，主要关注现金流改善、扩大内需、科技创新三条线索。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，设立了浦银安盛基金管理有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），制定了估值政策和估值程序。

根据投资品种条线的不同，估值委员会下设固定收益品种估值委员会和权益品种估值委员会。权益品种估值委员会由公司基金运营条线分管领导、权益投研条线分管领导、基金运营部主要负

责人、风险管理部负责人、所涉及投资品种的投资部门负责人（包括但不限于权益投资部、权益专户部、指数与量化投资部、FOF 业务部等）及一名基金会计业务骨干组成。固定收益品种估值委员会由公司基金运营条线分管领导、固定收益投研条线分管领导、基金运营部主要负责人、风险管理部负责人、所涉及投资品种的投资部门负责人（包括但不限于固定收益投资部、固定收益专户部等）及一名基金会计业务骨干组成。

估值委员会成员均具有 5 年以上专业工作经历，具备良好的专业经验、胜任能力和独立性。估值委员会的职责主要包括：保证基金估值的公平、合理；制订健全、有效的估值政策和程序；确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性；定期对估值政策和程序进行评价等。

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管银行有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金基金经理未参与或决定基金的估值。

本基金管理人与中央国债登记结算有限责任公司以及中债金融估值中心有限公司签订了《中债信息产品服务三方协议》。

本基金管理人与中证指数有限公司签订了《债券估值数据服务协议》。

#### 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，符合相关法律法规和基金合同的规定。

#### 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

- 1、本报告期内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的情形。
- 2、本报告期内未出现连续二十个工作日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

本报告期内，基金托管人在浦银安盛颐璇平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

#### 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

本报告期内，浦银安盛基金管理有限公司在浦银安盛颐璇平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）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、

基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，由浦银安盛基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关浦银安盛颐璇平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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：浦银安盛颐璇平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产      | 附注号     | 本期末<br>2025 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |
|----------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资 产：     |         |                        |                          |
| 货币资金     | 6.4.7.1 | 2,033,360.45           | 994,328.61               |
| 结算备付金    |         | 4,782,081.02           | 11,280,198.98            |
| 存出保证金    |         | -                      | -                        |
| 交易性金融资产  | 6.4.7.2 | 234,645,743.79         | 223,586,266.94           |
| 其中：股票投资  |         | -                      | -                        |
| 基金投资     |         | 221,944,399.69         | 211,171,443.27           |
| 债券投资     |         | 12,701,344.10          | 12,414,823.67            |
| 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     | 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    |         | -                      | -                        |
| 应收股利     |         | -                      | -                        |
| 应收申购款    |         | 8.91                   | 6,278.18                 |
| 递延所得税资产  |         | -                      | -                        |
| 其他资产     | 6.4.7.8 | -                      | -                        |
| 资产总计     |         | 241,461,194.17         | 235,867,072.71           |
| 负债和净资产   | 附注号     | 本期末                    | 上年度末                     |

|             |          | 2025 年 6 月 30 日 | 2024 年 12 月 31 日 |
|-------------|----------|-----------------|------------------|
| <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     |          | 155,328.70      | 159,680.53       |
| 应付托管费       |          | 28,771.23       | 29,493.75        |
| 应付销售服务费     |          | -               | -                |
| 应付投资顾问费     |          | -               | -                |
| 应交税费        |          | -               | 36,892.92        |
| 应付利润        |          | -               | -                |
| 递延所得税负债     |          | -               | -                |
| 其他负债        | 6.4.7.9  | 84,302.56       | 150,000.00       |
| 负债合计        |          | 268,402.49      | 376,067.20       |
| <b>净资产：</b> |          |                 |                  |
| 实收基金        | 6.4.7.10 | 248,481,451.94  | 248,243,422.06   |
| 其他综合收益      | 6.4.7.11 | -               | -                |
| 未分配利润       | 6.4.7.12 | -7,288,660.26   | -12,752,416.55   |
| 净资产合计       |          | 241,192,791.68  | 235,491,005.51   |
| 负债和净资产总计    |          | 241,461,194.17  | 235,867,072.71   |

注： 报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额总额 248,481,451.94 份，其中 A 类基金份额净值 0.9706 元，份额总额 247,785,325.48 份；Y 类基金份额净值 0.9775 元，份额总额 696,126.46 份。

6.2 利润表

会计主体：浦银安盛颐璇平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目            | 附注号      | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025<br>年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024<br>年 6 月 30 日 |
|----------------|----------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| <b>一、营业总收入</b> |          | 6,662,934.25                             | -5,353,075.96                                 |
| 1. 利息收入        |          | 34,773.83                                | 64,148.56                                     |
| 其中：存款利息收入      | 6.4.7.13 | 34,773.83                                | 60,973.79                                     |
| 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     |          | -                                        | 3,174.77                                      |

|                            |            |                     |                      |
|----------------------------|------------|---------------------|----------------------|
| 其他利息收入                     |            | -                   | -                    |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）          |            | -668,653.40         | -2,468,678.60        |
| 其中：股票投资收益                  | 6.4.7.14   | -                   | 223,920.74           |
| 基金投资收益                     | 6.4.7.15   | -995,580.42         | -2,932,773.07        |
| 债券投资收益                     | 6.4.7.16   | 56,574.18           | 69,993.71            |
| 资产支持证券投资<br>收益             | 6.4.7.17   | -                   | -                    |
| 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   | 270,352.84          | 170,180.02           |
| 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   | 7,296,813.82        | -2,949,049.69        |
| 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   | -                   | 503.77               |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |            | <b>1,189,994.43</b> | <b>1,158,876.22</b>  |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 932,985.44          | 902,885.14           |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 172,706.43          | 166,304.19           |
| 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<br>支出          |            | -                   | -                    |
| 6. 信用减值损失                  | 6.4.7.24   | -                   | -                    |
| 7. 税金及附加                   |            | -                   | 179.29               |
| 8. 其他费用                    | 6.4.7.25   | 84,302.56           | 89,507.60            |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | <b>5,472,939.82</b> | <b>-6,511,952.18</b> |
| 减：所得税费用                    |            | -                   | -                    |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | <b>5,472,939.82</b> | <b>-6,511,952.18</b> |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |            | <b>-</b>            | <b>-</b>             |
| <b>六、综合收益总额</b>            |            | <b>5,472,939.82</b> | <b>-6,511,952.18</b> |

6.3 净资产变动表

会计主体：浦银安盛颐璇平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

|    |    |
|----|----|
| 项目 | 本期 |
|----|----|

|                                          | 2025 年 1 月 1 日至 2025 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                                | 248,243,422.06                             | -12,752,416.55 | 235,491,005.51 |
| 二、本期期初净资产                                | 248,243,422.06                             | -12,752,416.55 | 235,491,005.51 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | 238,029.88                                 | 5,463,756.29   | 5,701,786.17   |
| （一）、综合收益总额                               | -                                          | 5,472,939.82   | 5,472,939.82   |
| （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）      | 238,029.88                                 | -9,183.53      | 228,846.35     |
| 其中：1. 基金申购款                              | 238,029.88                                 | -9,183.53      | 228,846.35     |
| 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                                | 248,481,451.94                             | -7,288,660.26  | 241,192,791.68 |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>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                                | 247,654,483.50                             | -16,015,292.75 | 231,639,190.75 |
| 二、本期期初净资产                                | 247,654,483.50                             | -16,015,292.75 | 231,639,190.75 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | 251,172.40                                 | -6,532,514.82  | -6,281,342.42  |
| （一）、综合收益总额                               | -                                          | -6,511,952.18  | -6,511,952.18  |
| （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）      | 251,172.40                                 | -20,562.64     | 230,609.76     |
| 其中：1. 基金申购款                              | 251,172.40                                 | -20,562.64     | 230,609.76     |

|                                          |                |                |                |
|------------------------------------------|----------------|----------------|----------------|
| 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                                | 247,905,655.90 | -22,547,807.57 | 225,357,848.33 |

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：

张弛

顾佳

孙赵辉

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

浦银安盛颐璇平衡养老目标三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]2662 号《关于准予浦银安盛颐璇平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）注册的批复》准予注册，由浦银安盛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《浦银安盛颐璇平衡养老目标三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基金，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 247,572,614.23 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（2023）第 0398 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《浦银安盛颐璇平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》于 2023 年 7 月 31 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 247,649,099.91 份基金份额，其中认购资金利息折合 76,485.68 份基金份额。本基金的基金管理人为浦银安盛基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据基金管理人浦银安盛基金管理有限公司 2023 年 12 月 11 日《关于浦银安盛颐璇平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）增加 Y 类基金份额并修改基金合同及托管协议相应条款的公告》的规定，经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案，自 2023 年 12 月 12 日起对本基金现有基金份额的基础上增设 Y 类基金份额，原基金份额额全部自动划归为 A 类基金份额，该类份额的申购赎回业务规则以及费率结构均保持不变。两类基金份额分别设置对应的基金代码并分别计算基金份额净值。Y 类基金份额的初始基金份额净值与当日 A 类基金份额的基金份额净值一

致。本基金每笔份额的最短持有期为 3 年，最短持有期内，投资者不能提出赎回申请，期满后（含到期日）投资者可提出赎回申请。认购份额的“3 年持有期限起始日”为基金合同生效日；申购份额的“3 年持有期限起始日”为申购申请确认日。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《浦银安盛颐璇平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金(FOF)招募说明书》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证券投资基金（包含 ETF、LOF、QDII 基金、商品基金和香港互认基金）的基金份额、国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券、可交换债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具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的相关规定）。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证券投资基金的基金份额的资产不低于基金资产的 80%；本基金所持有的现金或到期日在一年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、应收申购款等；投资于权益类资产的基准比例为基金资产的 55%，投资比例范围为基金资产的 45%-60%；投资于股票、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 60%；港股通标的股票投资占股票资产的比例为 0%-50%；本基金投资于商品基金占基金资产的比例不超过 10%。本基金的业绩比较基准为：中证债券型基金指数收益率×40%+中证股票型基金指数收益率×50%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×5%+银行活期存款利率（税后）×5%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《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“基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注所列示的中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注中所列示的中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金 2025 年 6 月 30 日的财

务状况、2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 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 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[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 [2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012] 85 号文《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 [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》、深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《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 [2008] 1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36 号文《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] 140 号文《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 号文《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》、财政部税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延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》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 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，以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。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。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。

(b) 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，暂不征收企业所得税。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(c) 对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）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。

(d) 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。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(e) 对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

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<br>2025 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 2,033,360.45           |
| 等于：本金          | 2,033,163.91           |
| 加：应计利息         | 196.54                 |
| 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             | 2,033,360.45           |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            |       | 本期末<br>2025 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 | 12,603,481.00          | 106,984.10 | 12,701,344.10  | -9,121.00   |
|               | 银行间市场 | -                      | -          | -              | -           |
|               | 合计    | 12,603,481.00          | 106,984.10 | 12,701,344.10  | -9,121.00   |
| 资产支持证券        |       | -                      | -          | -              | -           |
| 基金            |       | 222,323,697.91         | -          | 221,944,399.69 | -379,298.22 |
| 其他            |       | -                      | -          | -              | -           |
| 合计            |       | 234,927,178.91         | 106,984.10 | 234,645,743.79 | -388,419.22 |

#### 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。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

#### 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。

##### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

本基金本报告期末未按预期信用损失一般模型计提减值准备。

#### 6.4.7.5 债权投资

##### 6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期期末未持有债权投资。

##### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期内未计提债权投资减值准备。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期期末未持有其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期内未计提其他债权投资减值准备。

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。

6.4.7.7.2 报告期末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

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2025 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        | 84,302.56              |
| 合计          | 84,302.56              |

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

浦银安盛颐璇平衡养老目标三年混合（FOF）A

| 项目            | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |                |
|---------------|---------------------------------------|----------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额           |
| 上年度末          | 247,708,010.33                        | 247,708,010.33 |
| 本期申购          | 77,315.15                             | 77,315.15      |
| 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 | 247,785,325.48 | 247,785,325.48 |
|-----|----------------|----------------|

## 浦银安盛颐璇平衡养老目标三年混合（FOF）Y

| 项目            | 本期                              |            |
|---------------|---------------------------------|------------|
|               | 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |            |
|               | 基金份额（份）                         | 账面金额       |
| 上年度末          | 535,411.73                      | 535,411.73 |
| 本期申购          | 160,714.73                      | 160,714.73 |
| 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           | 696,126.46                      | 696,126.46 |

注：申购含红利再投资、转换入份额；赎回含转换出份额。

## 6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期内无其他综合收益。

## 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

## 浦银安盛颐璇平衡养老目标三年混合（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           | -5,027,956.02 | -7,699,329.23 | -12,727,285.25 |
| 本期期初           | -5,027,956.02 | -7,699,329.23 | -12,727,285.25 |
| 本期利润           | -1,820,677.59 | 7,277,605.68  | 5,456,928.09   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -1,839.04     | -785.61       | -2,624.65      |
| 其中：基金申购款       | -1,839.04     | -785.61       | -2,624.65      |
| 基金赎回款          | -             | -             | -              |
| 本期已分配利润        | -             | -             | -              |
| 本期末            | -6,850,472.65 | -422,509.16   | -7,272,981.81  |

## 浦银安盛颐璇平衡养老目标三年混合（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           | -7,911.41  | -17,219.89 | -25,131.30 |
| 本期期初           | -7,911.41  | -17,219.89 | -25,131.30 |
| 本期利润           | -3,196.41  | 19,208.14  | 16,011.73  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -2,758.50  | -3,800.38  | -6,558.88  |
| 其中：基金申购款       | -2,758.50  | -3,800.38  | -6,558.88  |
| 基金赎回款          | -          | -          | -          |
| 本期已分配利润        | -          | -          | -          |
| 本期末            | -13,866.32 | -1,812.13  | -15,678.45 |

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 1,575.36                              |
| 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 | 33,198.47                             |
| 其他        | -                                     |
| 合计        | 34,773.83                             |

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<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|-------------------|---------------------------------------|
| 卖出/赎回基金成交总额       | 15,162,711.27                         |
| 减：卖出/赎回基金成本总额     | 16,128,360.00                         |
| 减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额 | -                                     |
| 减：交易费用            | 29,931.69                             |
| 基金投资收益            | -995,580.42                           |

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<br>2025年1月1日至2025年6月30日 |
|------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 90,610.07                  |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | -34,035.89                 |
| 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                           | 56,574.18                  |

**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<br>2025年1月1日至2025年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 11,021,440.00              |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 10,833,586.00              |
| 减：应计利息总额               | 221,440.00                 |
| 减：交易费用                 | 449.89                     |
| 买卖债券差价收入               | -34,035.89                 |

**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<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 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   | 270,352.84                            |
| 合计            | 270,352.84                            |

**6.4.7.21 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|------------------------|---------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产             | 7,296,813.82                          |
| 股票投资                   | -                                     |
| 债券投资                   | 3,634.00                              |
| 资产支持证券投资               | -                                     |
| 基金投资                   | 7,293,179.82                          |
| 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                     | 7,296,813.82                          |

**6.4.7.22 其他收入**

注：本基金本报告期内无其他收入。

**6.4.7.23 持有基金产生的费用**

| 项目                   | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|----------------------|---------------------------------------|
| 当期持有基金产生的应支付销售服务费（元） | 23,084.35                             |
| 当期持有基金产生的应支付管理费（元）   | 819,528.37                            |
| 当期持有基金产生的应支付托管费（元）   | 154,351.09                            |

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<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 审计费用    | 24,795.19                             |
| 信息披露费   | 59,507.37                             |
| 证券出借违约金 | —                                     |
| 合计      | 84,302.56                             |

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或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中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             |
|----------------------------|---------------------|
| 浦银安盛基金管理有限公司（“浦银安盛”）       | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 交通银行股份有限公司（“交通银行”）         | 基金托管人、基金销售机构        |
| 上海浦东发展银行股份有限公司（“上海浦东发展银行”） | 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，并以一般交易价格为定价基础。

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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均未有通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 基金交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均未有通过关联方交易单元进行的基金交易。

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均未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均未有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<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
|------------------|---------------------------------------|--------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 932,985.44                            | 902,885.14                                 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 267,276.60                            | 252,756.25                                 |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 665,708.84                            | 650,128.89                                 |

注：本基金投资于基金管理人所管理的其他基金部分不收取管理费。本基金 A 类份额支付基金管理人浦银安盛的管理人报酬按前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金管理人管理的其他基金部分后的余额的 0.90%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扣除本基金持有的基金管理人管理的其他基金部分后的余额 × 0.90% / 当年天数。

本基金 Y 类份额支付基金管理人浦银安盛的管理人报酬按前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金管理人管理的其他基金部分后的余额的 0.45%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扣除本基金持有的基金管理人管理的其他基金部分后的余额 × 0.45% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
|----------------|---------------------------------------|--------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 172,706.43                            | 166,304.19                                 |

注：本基金投资于基金托管人所托管的其他基金部分不收取托管费。本基金 A 类份额支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金托管人托管的其他基金部分后的余额的 0.15% 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扣除本基金持有的基金托管人托管的其他基金部分后的余额  $\times$  0.15% / 当年天数。

本基金 Y 类份额支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金托管人托管的其他基金部分后的余额的 0.075% 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扣除本基金持有的基金托管人托管的其他基金部分后的余额  $\times$  0.075% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

注：本基金无销售服务费。

#### 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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均未发生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均未发生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均未发生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

注：基金管理人本报告期内与上年度可比期间均未持有本基金。

##### 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：除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末及上年度末均未持有本基金。

#### 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<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |          | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 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    |
| 交通银行-活期 | 2,033,360.45                          | 1,575.36 | 1,719,512.38                               | 17,525.90 |

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，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均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 2025 年 06 月 30 日，本基金持有基金管理人浦银安盛所管理的公开募集证券投资基金合计 27,883,732.41 元，占本基金净资产的比例为 11.56%。（于 2024 年 06 月 30 日，本基金持有基金管理人浦银安盛所管理的公开募集证券投资基金合计 39,372,287.85 元，占本基金净资产的比例为 17.47%）。

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<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 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）      | -                                     | -                                          |
| 当期持有基金产生的应支付销售服务费（元） | -                                     | 503.80                                     |
| 当期持有基金产生的应支付管理费（元）   | 41,320.06                             | 36,620.24                                  |
| 当期持有基金产生的应支付托管费（元）   | 6,886.76                              | 6,355.32                                   |

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）、销售服务等销售费用。相关申购费、赎回费由基金管理人直接减免，故当期交易基金产生的申购费和当期交易基金产生的赎回费为零。相关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销售服务费为管理人当期应向本基金返还的销售服务费，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。当期持有基金产生的应支付管理费、当期持有基金产生的应支付托管费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：本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2025 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

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

本基金为基金中基金，由于本基金主要投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金的基金份额，持有基金的预期风险和预期收益间接成为本基金的预期风险和预期收益。本基金属于目标风险策略基金中风险收益特征相对平衡的基金，其预期收益和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、货币型基金中基金。本基金可投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

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证券投资基金(包含 ETF, LOF, QDII 基金，商品基金和香港互认基金)的基金份额，国内依法发行上市的股票(包括主板，创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)，港股通标的股票，债券(包括国债，央行票据，金融债券，企业债券，公司债券，中期票据，短期融资券，超短期融资券，次级债券，政府支持机构债，政府支持债券，地方政府债，可转换债券，可交换债券等)，资产支持证券，债券回购，银行存款(包括协议存款，定期存款及其他银行存款)，同业存单，货币市场工具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)。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：本基金投资于经中国证监会依法核准或注册的公

开募集证券投资基金的基金份额的资产不低于基金资产的 80%，本基金所持有现金或到期日在一年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，应收申购款等。本基金为平衡型目标风险策略基金，投资于权益类资产的基准比例为基金资产的 55%，投资比例范围为基金资产的 45%-60%；本基金投资于股票，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基金资产的 60%；港股通标的股票投资占股票资产的比例为 0%-50%；本基金投资于商品基金占基金资产的比例不超过 10%。其中，上述权益类资产为股票，股票型基金以及符合以下两种情况之一的混合型基金：一是基金合同约定股票资产投资比例不低于基金资产的 60%，二是最近 4 个季度末，每季度定期报告披露的股票资产占基金资产的比例不低于 60%。如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。

本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关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，使本基金在科学的风险管理的前提下，实现基金财产的安全和增值。

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人奉行全面风险管理，设立了三层次的风险控制体系：第一层次为各业务部门对各自部门潜在风险的自我管理和检查；第二层次为公司总经理领导的管理层、风险管理委员会、风险管理部和法律合规部的风险管理；第三层次为董事会层面对公司的风险管理，包括董事会、合规及审计委员会、督察长和内部审计。

本基金管理人下设的各业务部门是公司第一线风险控制的实施者，均备有符合法律法规、公司政策的业务流程，其中包含与其业务相关的风险控制措施、风险管理计划、工作流程和管理责任。这些流程均得到公司管理层的批准。

本基金管理人设立的风险管理委员会是公司经营层面负责风险管理的最高权利机构，主要负责制定公司的风险管理政策，并监督实施，确保公司整体风险暴露得到有效的识别、评估、监控和控制。公司设立风险管理部与法律合规部监控公司面临的各类风险。风险管理部建立了定性和数量化分析模型进行基金投资风险和绩效评估，法律合规部根据基金相关法律法规、公司基本制度及业务流程，对信息披露、法律文件等进行事中审核，并对基金管理人经营活动及各职能部门履职情况的合法合规性进行监督和检查。

董事会下属的合规及审计委员会，负责对公司整体风险管理和内部控制的有效性进行审议和评估。同时，督察长及合规及审计委员会负责检查、评价公司风险控制的充分性和有效性，并向董事会报告。

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可能产生的损失。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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人交通银行股份有限公司，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。

于 2025 年 6 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券投资和资产支持证券投资(2024 年 12 月 31 日：同)。

#### 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。

于 2025 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约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》及《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，通过独立的风险管理部门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公司的证券（不含本基金所投资的基金份额）不得超过该证券的 10%。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，其余亦可在银行间同业市场交易，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 2025 年 6 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符合法律法规的相关要求。

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 2025 年 6 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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2025 年 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                     | 2,033,360.45  | -     | -     | -               | 2,033,360.45   |
| 结算备付金                    | 4,782,081.02  | -     | -     | -               | 4,782,081.02   |
| 交易性金融资产                  | 12,701,344.10 | -     | -     | -221,944,399.69 | 234,645,743.79 |
| 应收申购款                    | -             | -     | -     | 8.91            | 8.91           |
| 资产总计                     | 19,516,785.57 | -     | -     | -221,944,408.60 | 241,461,194.17 |
| 负债                       |               |       |       |                 |                |
| 应付管理人报酬                  | -             | -     | -     | 155,328.70      | 155,328.70     |
| 应付托管费                    | -             | -     | -     | 28,771.23       | 28,771.23      |
| 其他负债                     | -             | -     | -     | 84,302.56       | 84,302.56      |
| 负债总计                     | -             | -     | -     | 268,402.49      | 268,402.49     |
| 利率敏感度缺口                  | 19,516,785.57 | -     | -     | -221,676,006.11 | 241,192,791.68 |
| 上年度末<br>2024 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                     | 994,328.61    | -     | -     | -               | 994,328.61     |
| 结算备付金                    | 11,280,198.98 | -     | -     | -               | 11,280,198.98  |
| 交易性金融资产                  | 12,414,823.67 | -     | -     | -211,171,443.27 | 223,586,266.94 |
| 应收申购款                    | -             | -     | -     | 6,278.18        | 6,278.18       |
| 资产总计                     | 24,689,351.26 | -     | -     | -211,177,721.45 | 235,867,072.71 |
| 负债                       |               |       |       |                 |                |
| 应付管理人报酬                  | -             | -     | -     | 159,680.53      | 159,680.53     |

|         |               |   |   |                 |                |
|---------|---------------|---|---|-----------------|----------------|
| 应付托管费   | -             | - | - | 29,493.75       | 29,493.75      |
| 应交税费    | -             | - | - | 36,892.92       | 36,892.92      |
| 其他负债    | -             | - | - | 150,000.00      | 150,000.00     |
| 负债总计    | -             | - | - | 376,067.20      | 376,067.20     |
| 利率敏感度缺口 | 24,689,351.26 | - | - | -210,801,654.25 | 235,491,005.51 |

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

注：于 2025 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 5.27%（2024 年 12 月 31 日：5.27%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2024 年 12 月 31 日：同）。

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。

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。本基金主要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、证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，结合大类资产配置和基金优选模型，形成稳健收益的基金投资组合，从而实现基金资产在长时间段内保值增值的目的。通过对全球、国内的宏观经济、金融市场的深入研究，形成对股票、债券等各大类资产的投资观点，进一步应用资产配置的量化模型（Black-Litterman 模型，其中股票暴露限定在 0-30%）确定其组合权重，实现基金资产在大类资产间的有效配置。同时，通过自主开发的量化基金优选模型来筛选基金，优先选择风险调整后收益较高的基金组合，精选基金获取大类资产内部的 Alpha，最终实现基金资产在长时间段内保值增值的目的。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金的基金份额的资产不低于基金资产的 80%，本基金所持有现金或到期日在一年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、应收申购款等。本基金为平衡型目标风险策略基金，投资于权益类资产的基准比例为基金资产的 55%，投资比例范围为基金资产的 45%-60%；本基金投资于股票、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基金资产的 60%；港股通标的股票投资占股票资产的比例为 0%-50%；本基金投资于商品基金占基金资产的比例不超过 10%。其中，上述权益类资产为股票、股票型基金以及符合以下两种情况之一的混合型基金：一是基金合同约定股票资产投资比例不低于基金资产的 60%，二是最近 4 个季度末，每季度定期报告披露的股票资产占基金资产的比例不低于 60%。

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，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<br>2025 年 6 月 30 日 |                  | 上年度末<br>2024年12月31日 |                  |
|---------------|------------------------|------------------|---------------------|------------------|
|               | 公允价值                   | 占基金资产净值<br>比例（%） | 公允价值                | 占基金资产净值<br>比例（%） |
| 交易性金融资产—股票投资  | -                      | -                | -                   | -                |
| 交易性金融资产—基金投资  | 221,944,399.69         | 92.02            | 211,171,443.27      | 89.67            |
| 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            | 221,944,399.69         | 92.02            | 211,171,443.27      | 89.67            |

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

|    |                                |                                 |                        |
|----|--------------------------------|---------------------------------|------------------------|
| 假设 | 除业绩比较基准（附注 6.4.1）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<br>影响金额（单位：人民币元） |                        |
|    |                                | 本期末（2025 年 6 月 30 日）            | 上年度末（2024 年 12 月 31 日） |
|    | 业绩比较基准上升 500 基点                | 11,326,590.64                   | 8,790,374.65           |
|    | 业绩比较基准下降 500 基点                | -11,326,590.64                  | -8,790,374.65          |

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<br>2025 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次          | 221,944,399.69         | 211,171,443.27           |
| 第二层次          | 12,701,344.10          | 12,414,823.67            |
| 第三层次          | -                      | -                        |
| 合计            | 234,645,743.79         | 223,586,266.94           |

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。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2025 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(2024 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工具主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

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  | 221,944,399.69 | 91.92        |

|   |                   |                |        |
|---|-------------------|----------------|--------|
| 3 | 固定收益投资            | 12,701,344.10  | 5.26   |
|   | 其中：债券             | 12,701,344.10  | 5.26   |
|   | 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      | 6,815,441.47   | 2.82   |
| 8 | 其他各项资产            | 8.91           | 0.00   |
| 9 | 合计                | 241,461,194.17 | 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

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

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买入股票。

### 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卖出股票。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：本基金本报告期内未买入/卖出股票。

## 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      | 12,701,344.10 | 5.27         |
| 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   | 12,701,344.10 | 5.27 |

## 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  | 019766 | 25 国债 01 | 60,000 | 6,026,444.38 | 2.50         |
| 2  | 019749 | 24 国债 15 | 42,000 | 4,253,364.16 | 1.76         |
| 3  | 019758 | 24 国债 21 | 24,000 | 2,421,535.56 | 1.00         |

## 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

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 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

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 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，定位为平衡型的目标风险策略基金，均衡配置于权益类和固定收益类资产，主要投资于公开募集证券投资基金，符合基金合同约定的投资政策、投资限制等要求。

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。

### 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 | 是否属于基金管理人及管理 |
|----|------|------|------|---------|---------|---------|--------------|
|----|------|------|------|---------|---------|---------|--------------|

|    |        |                  |                     |               |               | 值比例（%） | 人关联方所管理的基金 |
|----|--------|------------------|---------------------|---------------|---------------|--------|------------|
| 1  | 006436 | 浦银中短债 A          | 契约型<br>开放式          | 25,238,715.07 | 27,883,732.41 | 11.56  | 是          |
| 2  | 004388 | 鹏华丰享债券           | 契约型<br>开放式          | 12,728,147.49 | 16,328,940.41 | 6.77   | 否          |
| 3  | 005159 | 华泰保兴尊合债券 A       | 契约型<br>开放式          | 12,467,051.02 | 15,714,717.81 | 6.52   | 否          |
| 4  | 675111 | 西部利得汇享债券 A       | 契约型<br>开放式          | 11,605,841.79 | 15,510,046.97 | 6.43   | 否          |
| 5  | 007126 | 博道远航混合 A         | 契约型<br>开放式          | 6,711,999.39  | 9,825,024.71  | 4.07   | 否          |
| 6  | 006624 | 中泰玉衡价值优选混合 A     | 契约型<br>开放式          | 2,701,765.45  | 6,575,556.75  | 2.73   | 否          |
| 7  | 005794 | 银华心怡灵活配置混合 A     | 契约型<br>开放式          | 2,260,106.24  | 6,294,169.87  | 2.61   | 否          |
| 8  | 006179 | 富国品质生活混合 A       | 契约型<br>开放式          | 3,388,499.77  | 5,737,068.96  | 2.38   | 否          |
| 9  | 001564 | 东方红京东大数据混合 A     | 契约型<br>开放式          | 1,863,127.22  | 5,604,286.68  | 2.32   | 否          |
| 10 | 004814 | 中欧红利优享灵活配置混合 A   | 契约型<br>开放式          | 3,009,270.41  | 5,535,552.92  | 2.30   | 否          |
| 11 | 006132 | 万家智造优势混合 A       | 契约型<br>开放式          | 2,139,672.58  | 5,502,809.94  | 2.28   | 否          |
| 12 | 000457 | 摩根核心成长股票 A       | 契约型<br>开放式          | 2,181,540.48  | 5,257,730.71  | 2.18   | 否          |
| 13 | 159740 | 大成恒生科技 ETF(QDII) | 交易型<br>开放式<br>(ETF) | 7,268,000.00  | 5,160,280.00  | 2.14   | 否          |
| 14 | 002361 | 国富恒瑞债券 A         | 契约型<br>开放式          | 3,795,747.91  | 5,112,872.43  | 2.12   | 否          |

|    |        |                |                     |              |              |      |   |
|----|--------|----------------|---------------------|--------------|--------------|------|---|
| 15 | 008791 | 招商安华债券 A       | 契约型<br>开放式          | 4,134,822.16 | 5,079,215.54 | 2.11 | 否 |
| 16 | 007075 | 富国产业债券 C       | 契约型<br>开放式          | 4,127,115.15 | 4,927,362.78 | 2.04 | 否 |
| 17 | 005630 | 华安研究精选混合 A     | 契约型<br>开放式          | 2,762,224.88 | 4,918,970.07 | 2.04 | 否 |
| 18 | 011300 | 易方达智造优势混合 A    | 契约型<br>开放式          | 5,341,953.41 | 4,915,665.53 | 2.04 | 否 |
| 19 | 000880 | 富国研究精选灵活配置混合 A | 契约型<br>开放式          | 1,905,106.71 | 4,892,314.03 | 2.03 | 否 |
| 20 | 510330 | 华夏沪深300ETF     | 交易型<br>开放式<br>(ETF) | 1,152,500.00 | 4,724,097.50 | 1.96 | 否 |
| 21 | 510300 | 华泰柏瑞沪深300ETF   | 交易型<br>开放式<br>(ETF) | 1,183,500.00 | 4,712,697.00 | 1.95 | 否 |
| 22 | 540003 | 汇丰晋信动态策略混合 A   | 契约型<br>开放式          | 1,451,979.86 | 4,710,367.86 | 1.95 | 否 |
| 23 | 002910 | 易方达供给改革混合      | 契约型<br>开放式          | 1,745,095.30 | 4,480,881.20 | 1.86 | 否 |
| 24 | 005004 | 交银品质升级混合 A     | 契约型<br>开放式          | 3,051,839.04 | 4,474,606.40 | 1.86 | 否 |
| 25 | 004390 | 平安转型创新混合 A     | 契约型<br>开放式          | 1,748,268.87 | 4,450,393.24 | 1.85 | 否 |
| 26 | 012778 | 中欧养老混合 C       | 契约型<br>开放式          | 1,593,118.30 | 4,395,891.33 | 1.82 | 否 |
| 27 | 007549 | 中泰开阳价值优选混合 A   | 契约型<br>开放式          | 2,419,768.62 | 4,056,742.09 | 1.68 | 否 |
| 28 | 006377 | 广发趋势动力混合 A     | 契约型<br>开放式          | 2,890,096.55 | 3,962,033.36 | 1.64 | 否 |
| 29 | 010385 | 华安汇嘉精选混合 A     | 契约型<br>开放式          | 3,636,961.71 | 3,800,261.29 | 1.58 | 否 |
| 30 | 513330 | 华夏恒生互          | 交易型                 | 7,568,800.00 | 3,738,987.20 | 1.55 | 否 |

|    |        |                           |                     |              |              |      |   |
|----|--------|---------------------------|---------------------|--------------|--------------|------|---|
|    |        | 联网科技业<br>ETF (QDII)       | 开放式<br>(ETF)        |              |              |      |   |
| 31 | 513920 | 华安恒生港<br>股通中国央<br>企红利 ETF | 交易型<br>开放式<br>(ETF) | 2,395,000.00 | 3,556,575.00 | 1.47 | 否 |
| 32 | 159949 | 华安创业板<br>50ETF            | 交易型<br>开放式<br>(ETF) | 3,676,000.00 | 3,547,340.00 | 1.47 | 否 |
| 33 | 512690 | 酒 ETF                     | 交易型<br>开放式<br>(ETF) | 5,943,500.00 | 3,298,642.50 | 1.37 | 否 |
| 34 | 159967 | 华夏创成长<br>ETF              | 交易型<br>开放式<br>(ETF) | 7,225,200.00 | 3,258,565.20 | 1.35 | 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没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

#### 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

报告期内，本基金投资的前十名股票不存在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 | -    |
| 2  | 应收清算款 | -    |
| 3  | 应收股利  | -    |
| 4  | 应收利息  | -    |
| 5  | 应收申购款 | 8.91 |
| 6  | 其他应收款 | -    |
| 7  | 待摊费用  | -    |
| 8  | 其他    | -    |
| 9  | 合计    | 8.91 |

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。

§ 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<br>户数<br>（户） | 户均持有的<br>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<br>额比例<br>（%） | 持有份额           | 占总份<br>额比例<br>（%） |
| 浦银安盛颐璇平衡养老目标三年混合（FOF）A | 2,751            | 90,071.00     | 126,188,346.42 | 50.93             | 121,596,979.06 | 49.07             |
| 浦银安盛颐璇平衡养老目标三年混合（FOF）Y | 87               | 8,001.45      | 0.00           | 0.00              | 696,126.46     | 100.00            |
| 合计                     | 2,838            | 87,555.13     | 126,188,346.42 | 50.78             | 122,293,105.52 | 49.22             |

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 | 浦银安盛颐璇平衡养老目标三年混合（FOF）A | 111,233.96 | 0.04        |
|                  | 浦银安盛颐璇平衡养老目标三年混合（FOF）Y | 67,627.73  | 9.71        |
|                  | 合计                     | 178,861.69 | 0.07        |

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 | 浦银安盛颐璇平衡养老目标三年混合（FOF）A | 0                 |
|                                | 浦银安盛颐璇平衡养老目标三年混合（FOF）Y | 0                 |
|                                | 合计                     | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 浦银安盛颐璇平衡养老目标三年混合（FOF）A | 0                 |
|                                | 浦银安盛颐璇平衡养老目标           | 0~10              |

|  |            |      |
|--|------------|------|
|  | 三年混合（FOF）Y |      |
|  | 合计         | 0~10 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                                     | 浦银安盛颐璇平衡养老目标三年混合（FOF）A | 浦银安盛颐璇平衡养老目标三年混合（FOF）Y |
|----------------------------------------|------------------------|------------------------|
| 基金合同生效日<br>（2023 年 7 月 31 日）<br>基金份额总额 | 247,649,099.91         | —                      |
| 本报告期期初基金份额总额                           | 247,708,010.33         | 535,411.73             |
| 本报告期基金总申购份额                            | 77,315.15              | 160,714.73             |
| 减：本报告期基金总赎回份额                          | —                      | —                      |
| 本报告期基金拆分变动份额                           | —                      | —                      |
| 本报告期期末基金份额总额                           | 247,785,325.48         | 696,126.46             |

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

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，基金管理人重大人事变动如下：

浦银安盛基金管理有限公司 2025 年第一次股东会会议审议通过，选举张健先生、Pierre-Axel Margulies 先生、杨志敏先生、侯林先生、林忠汉先生、袁涛先生、张弛先生、韩启蒙先生（独立董事）、赵晓菊女士（独立董事）、寇宗来先生（独立董事）和王少飞先生（独立董事）担任公司第六届董事会董事。其中，寇宗来先生、王少飞先生为新任公司独立董事。原第五届董事会成员董叶顺先生、霍佳震先生不再担任公司独立董事。具体信息请参见基金管理人于 2025 年 3 月 5 日在规定媒介披露的《浦银安盛基金管理有限公司关于董事会成员换届变更的公告》。

2025 年 3 月 6 日，赵婷女士新任公司副总经理。具体信息请参见基金管理人于 2025 年 3 月 8 日在规定媒介披露的《浦银安盛基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更公告》。

2025 年 3 月 18 日，浦银安盛基金管理有限公司 2025 年第二次股东会会议审议通过，批准屠旋旋先生接替袁涛先生续任公司第六届董事会董事。

2025 年 6 月 26 日，浦银安盛基金管理有限公司 2025 年第三次股东会会议审议通过，免去林忠汉先生公司第六届董事会董事职务。

本报告期内，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

本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

本报告期内基金投资策略未发生改变。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本报告期持有的基金在持有期内未发生重大影响事件。

10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金审计的会计师事务所为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙），未有改聘情况发生。

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：本报告期内，管理人及其高级管理人员无受到有权机关调查、司法纪检部门采取强制措施、被移送司法机关或追究刑事责任、中国证监会稽查、中国证监会行政处罚、证券市场禁入、认定为不适当人选、被其他行政管理部门处罚及证券交易所公开谴责的情形。

10.7.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中未受到相关监管部门稽查或处罚。

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 (%) |    |
| 兴业证券 | 2      | -    | -                | 2,570.99  | 100.00         | -  |

注：1. 根据《关于新设公募基金管理人证券交易模式转换有关事项的通知》（证监办发 [2019]14

号)的有关规定,基金产品管理人可选择一家或多家证券公司开展证券交易,并可免于执行《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》第二条“一家基金管理公司通过一家证券公司的交易席位买卖证券的年交易佣金,不得超过其当年所基金买卖证券交易佣金的 30%”的分仓规定。

2. 本基金管理人选择财务状况良好、经营行为规范、研究实力较强、能满足公募基金采用券商交易模式进行证券交易和结算需要的证券公司作为本基金的证券经纪商。

3. 本基金管理人与选择的证券经纪商、本基金的托管人签订证券经纪服务协议,对账户管理、资金存管、交易执行、交易管理、佣金收取、清算交收、违约责任等作出约定。

4. 本基金选择的证券经纪商兴业证券与本公司不存在关联关系。

5. 按照本基金与兴业证券签订的经纪服务协议及补充协议,本基金自 2024 年 6 月 30 日起,股票佣金费率由 0.07854%变更为 0.05%,实际支付的佣金已扣除由经纪服务商承担的费用,在进行交易结算时逐笔直接扣除。

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 (%) |
| 兴业证券 | 11,202,992.00 | 100.00           | -      | -                  | -    | -                | 4,611,136.60 | 100.00           |

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  | 浦银安盛颐璇平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）2024 年第 4 季度报告                      | 规定网站    | 2025 年 1 月 22 日 |
| 2  | 浦银安盛基金管理有限公司关于提请投资者及时更新已过期身份证件及其他身份基本信息的公告                        | 报刊及规定网站 | 2025 年 1 月 25 日 |
| 3  | 关于浦银安盛颐璇平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）Y 类新增海通证券为代销机构并开通基金定投业务、参加其费率优惠活动 | 报刊及规定网站 | 2025 年 2 月 14 日 |
| 4  | 浦银安盛颐璇平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）基金产品资料概要更新                          | 规定网站    | 2025 年 2 月 26 日 |
| 5  | 浦银安盛颐璇平衡养老目标三年持有期混合型                                              | 规定网站    | 2025 年 2 月 26 日 |

|    |                                                             |         |                 |
|----|-------------------------------------------------------------|---------|-----------------|
|    | 基金中基金（FOF）基金合同                                              |         |                 |
| 6  | 浦银安盛颐璇平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）招募说明书（更新）2025 年第 1 号          | 规定网站    | 2025 年 2 月 26 日 |
| 7  | 浦银安盛颐璇平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）托管协议                          | 规定网站    | 2025 年 2 月 26 日 |
| 8  | 浦银安盛基金管理有限公司关于旗下部分基金变更业绩比较基准并修改基金合同相应条款的公告                  | 报刊及规定网站 | 2025 年 2 月 26 日 |
| 9  | 浦银安盛基金管理有限公司关于董事会成员换届变更的公告                                  | 报刊及规定网站 | 2025 年 3 月 5 日  |
| 10 | 浦银安盛基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更公告                                | 报刊及规定网站 | 2025 年 3 月 8 日  |
| 11 | 浦银安盛基金管理有限公司关于旗下部分基金新增国泰君安证券为代销机构并开通基金定投业务、参加其费率优惠活动的公告     | 报刊及规定网站 | 2025 年 3 月 14 日 |
| 12 | 浦银安盛基金管理有限公司关于旗下部分基金新增国金证券为代销机构并开通基金定投业务、参加其费率优惠活动的公告       | 报刊及规定网站 | 2025 年 3 月 26 日 |
| 13 | 浦银安盛颐璇平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）2024 年年度报告                    | 规定网站    | 2025 年 3 月 31 日 |
| 14 | 浦银安盛基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年下半年度）             | 报刊及规定网站 | 2025 年 3 月 31 日 |
| 15 | 浦银安盛基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海联泰基金销售有限公司为代销机构并开通定投业务、参加其费率优惠活动的公告 | 报刊及规定网站 | 2025 年 4 月 11 日 |
| 16 | 浦银安盛颐璇平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）2025 年第 1 季度报告                | 规定网站    | 2025 年 4 月 22 日 |
| 17 | 浦银安盛基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华宝证券为代销机构并开通基金定投业务、参加其费率优惠活动的公告       | 报刊及规定网站 | 2025 年 6 月 25 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

| 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              | 20250101-20250630       | 50,006,000.00 | 0.00 | 0.00 | 50,006,000.00 | 20.12   |
| 产品特有风险 |                |                         |               |      |      |               |         |

基金管理人提示投资者注意：当特定的机构投资者进行大额赎回操作时，基金管理人需通过对基金持有证券的快速变现以支付赎回款，该等操作可能会产生基金仓位调整的困难，产生冲击成本的风险，并造成基金净值的波动；同时，该等大额赎回将可能产生（1）单位净值尾差风险；（2）基金净值大幅波动的风险；（3）因引发基金本身的巨额赎回而导致中小投资者无法及时赎回的风险；以及（4）因基金资产净值低于 5000 万元从而影响投资目标实现或造成基金终止等风险。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于 2025 年 2 月 26 日发布《浦银安盛基金管理有限公司关于旗下部分基金变更业绩比较基准并修改基金合同相应条款的公告》，决定自 2025 年 2 月 26 日起对本基金的业绩比较基准进行变更，并修改本基金基金合同的相应条款。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准浦银安盛颐璇平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）募集的文件
- 2、浦银安盛颐璇平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同
- 3、浦银安盛颐璇平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）招募说明书
- 4、浦银安盛颐璇平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）托管协议
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照、公司章程
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 7、本报告期内在中国证监会规定媒介上披露的各项公告
- 8、中国证监会要求的其他文件

### 12.2 存放地点

上海市浦东新区滨江大道 5189 号 S2 座 1-7 层 基金管理人办公场所。

### 12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站（[www.py-axa.com](http://www.py-axa.com)）查阅，或在营业时间内至基金管理人办公场所免费查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人。

客户服务中心电话：400-8828-999 或 021-33079999。

浦银安盛基金管理有限公司

2025 年 8 月 30 日