

浦银安盛养老目标日期 2040 三年持有期  
混合型发起式基金中基金（FOF）  
2021 年中期报告

2021 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：中国邮政储蓄银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 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、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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 2021 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	5
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>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	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	11
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	12
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	12
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>13</b>
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
<b>§ 6 半年度财务会计报告 (未经审计)</b>	<b>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表	15
6.4 报表附注	16
<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	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	42
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.....	45
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.....	45
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.....	45
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	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.....	48
<b>§ 8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>48</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	49
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.....	49
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	49
<b>§ 9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>49</b>
<b>§ 10 重大事件揭示.....</b>	<b>50</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	50
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.....	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	50
10.4 基金投资策略的改变.....	50
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件.....	50
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	50
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.....	50
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	50
10.9 其他重大事件.....	51
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>52</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.....	52
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>53</b>
12.1 备查文件目录.....	53
12.2 存放地点.....	53
12.3 查阅方式.....	53

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	浦银安盛养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)
基金简称	浦银安盛养老 2040 三年持有混合 (FOF)
基金主代码	009626
前端交易代码	009626
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 12 月 16 日
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	15,273,272.20 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金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，随着所设定目标日期的临近，逐步降低权益类资产的配置比例，在合理控制风险并保持基金资产良好流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金根据浦银安盛养老目标日期基金下滑曲线模型进行动态大类资产配置，随着投资人生命周期的延续和目标日期的临近，权益类资产投资比例逐步下降，而非权益类资产投资比例逐步上升。同时，通过独创的量化基金优选模型来筛选基金，优先选择低波动率的标的基金，降低整体基金组合的波动率，并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 800 指数收益率×X+中债综合指数收益率×(1-X)。 其中，X 值如下：2019 年至 2020 年，X=50%；2021 年至 2022 年，X=49%；2023 年至 2024 年，X=48%；2025 年至 2026 年，X=45%；2027 年至 2028 年，X=41%；2029 年至 2030 年，X=37%；2031 年至 2032 年，X=32%；2033 年至 2034 年，X=27%；2035 年至 2036 年，X=22%；2037 年至 2038 年，X=17%；2039 年至 2040 年，X=15%。
风险收益特征	本基金是采用目标日期策略的混合型基金中基金，风险与收益水平会随着所设定目标日期的临近而逐步降低。本基金平均风险和预期收益水平低于股票型基金，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		浦银安盛基金管理有限公司	中国邮政储蓄银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	薛香	田东辉
	联系电话	021-23212888	010-68858113
	电子邮箱	compliance@py-axa.com	tiantonghui@psbc.com

客户服务电话	021-33079999 或 400-8828-999	95580
传真	021-23212985	010-68858120
注册地址	中国 (上海) 自由贸易试验区浦东大道 981 号 3 幢 316 室	北京市西城区金融大街 3 号
办公地址	上海市淮海中路 381 号中环广场 38 楼	北京市西城区金融大街 3 号 A 座
邮政编码	200020	100808
法定代表人	谢伟	张金良

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.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	上海市淮海中路 381 号 38 楼

## § 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 (2021 年 1 月 1 日-2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	366,581.37
本期利润	397,279.30
加权平均基金份额本期利润	0.0264
本期加权平均净值利润率	2.61%
本期基金份额净值增长率	2.60%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2021 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	401,278.90
期末可供分配基金份额利润	0.0263
期末基金资产净值	15,796,819.20
期末基金份额净值	1.0343
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2021 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	3.43%

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。

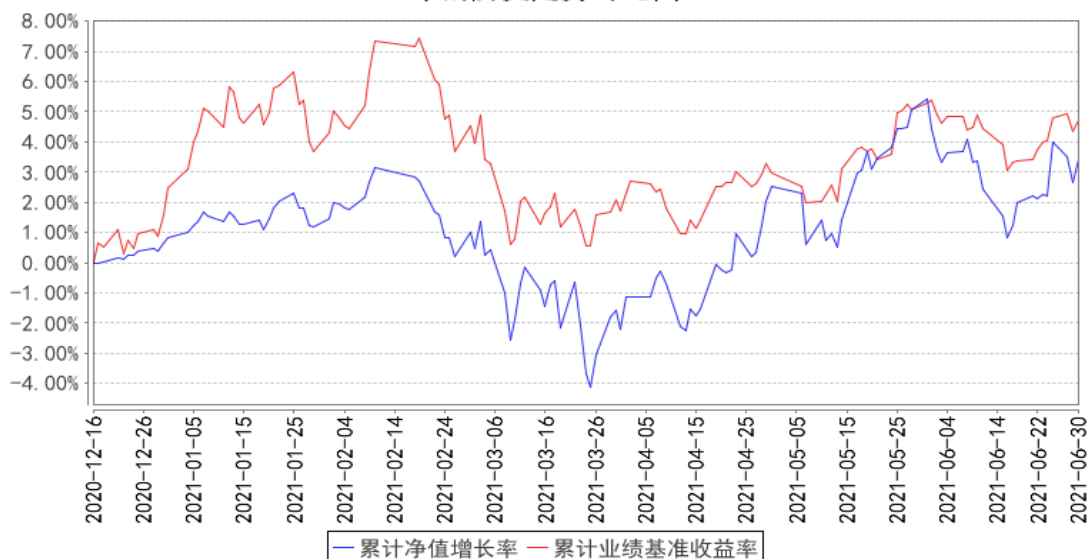
### 3.2 基金净值表现

#### 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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-1.89%	0.69%	-0.53%	0.38%	-1.36%	0.31%
过去三个月	5.79%	0.70%	2.97%	0.43%	2.82%	0.27%
过去六个月	2.60%	0.70%	2.18%	0.60%	0.42%	0.10%
自基金合同生效起至今	3.43%	0.67%	4.73%	0.59%	-1.30%	0.08%

#### 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

浦银安盛养老2040三年持有混合 (FOF) 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、本基金合同生效日为2020年12月16日，基金合同生效日至本报告期末，本基金运作时间未满1年。

2、根据基金合同规定：基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比

例符合基金合同的有关约定。本基金建仓期为 2020 年 12 月 16 日至 2021 年 6 月 15 日。建仓期结束时符合相关规定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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，注册资本为人民币 19.1 亿元，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 2021 年 6 月 30 日止，浦银安盛旗下共管理 74 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)、浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金、浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金、浦银安盛 6 个月定期开放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、浦银安盛幸福聚利定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛盛鑫定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛幸福聚益 18 个月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、浦银安盛安和回报定期开放混合型证券投资基金、浦银安盛中证锐联沪港深基本面 100 指数证券投资基金 (LOF)、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、浦银安盛安久回报定期开放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)、浦银安盛中证高股息精选交易型开放式指数证券投资基金、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、浦银安盛中证高股息精选交易型开放式指数证券投资基金联接基金、浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金、浦银安盛科技创新优选三年封闭运作灵活配置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、浦银安盛安远回报一年持有期混合型证券投资基金、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、浦银安盛盛毅一年定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金、浦银安盛科技创新一年定期开放混合型证券投资基金、浦银安盛养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、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。

公司信息技术系统由信息技术系统基础设施系统以及有关业务应用系统构成。信息技术系统基础设施系统包括机房工程系统、网络集成系统，这些系统在公司筹建之初由专业的系统集成公司负责建成，之后日常的维护管理由公司负责，但与第三方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。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。这些系统也主要是采购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。业务应用系统日常的维护管理由公司负责，但与系统提供商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。除上述情况外，我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		
陈曙亮	公司 FOF 业务部总监、本基金的基金经理	2021 年 5 月 27 日	-	13 年	陈曙亮先生，复旦大学硕士研究生。2008 年 6 月至 2019 年 6 月任职于富国基金管理有限公司，历任助理定量研究员、定量研究员、年金投资经理、基金经理、基金研究总监及多元资产投资部总经理。2019 年 6 月加盟浦银安盛基金管理有限公司，现任 FOF 业务部总监。2020 年 10 月起，担任浦银安盛颐 and 稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金 (FOF) 的基金经理。2021 年 5 月起，担任浦银安盛养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 的基金经理。2021 年 6 月起，担任浦银安盛嘉和稳健一年持有期混合型基金中基金 (FOF) 的基金经理。
王爽	本基金的基金经理	2020 年 12 月 16 日	-	13 年	王爽女士，华东政法大学经济学专业学士。2008 年至 2010 年在天相投资顾问有限公司从事证券分析工作。2010 年 9 月加盟浦银安盛基金管理有限公司后，担任研究部研究员之职。2013 年 2 月任权益投资部基金经理助理。2014 年 8 月调入专户管理部任专户投资经理。2018 年 9 月，经管理层批准，拟担任 FOF 养老基金经理之职。2019 年 11 月起担任浦银安盛颐 and 稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金经理。2020 年 12 月起担任养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 基金经理。

注：1、本基金基金经理的任职日期为公司决定的聘任日期。

2、证券从业年限的计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》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，本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，以及公司的规章制度，本着诚实守信、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。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。同时，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的投资指令的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；从事后监控角度上，一方面是定期对股票、债券交易情况进行分析，对不同时间窗口（同日，3日，5日和10日）发生的不同组合对同一投资标的的同向交易及反向交易进行价差分析，并进行统计显著性的检验，以确定交易价差对相关基金的业绩差异的贡献度；同时对旗下投资组合及其各投资类别的收益率差异的分析；另一方面是公司对于公平交易制度的遵守和相关业务流程的执行情况进行定期检查，并对发现的问题进行及时的报告。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。报告期内未发生旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量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

本中期组合优选风险收益特征良好的基金构建多策略的底仓组合；在积累了部分安全垫之后，逐步提高权益部分的配置比例。

#### 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养老 2040 三年持有混合 (FOF) 基金份额净值为 1.0343 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.60%；同期业绩比较基准收益率为 2.18%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从宏观经济数据来看，经济仍然在持续恢复的路径上，市场对于经济复苏的节奏和强度依旧有很大的分歧。由于经济的恢复尤其是消费的恢复不是很理想，所以流动性预计会较长时间维持

持续宽松的局面。

#### 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。估值委员会成员由公司副总经理暨首席运营官、风险管理部负责人、指数与量化投资部负责人、研究部负责人、产品估值部和注册登记部负责人组成。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《基金合同》第十七部分第三条约定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。

本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。

基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

每一基金份额享有同等分配权。

本基金本报告期内未进行利润分配，符合相关法律法规的规定及基金合同的约定。

#### 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、本基金为发起式基金，基金持有人数符合法律法规及基金合同的要求。

2、本基金为发起式基金，基金资产净值符合法律法规及基金合同的要求。

## § 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，中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在浦银安盛养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（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。

本报告期内，本基金未进行利润分配。

### 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、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：浦银安盛养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	218,821.91	1,841,774.47
结算备付金		202,513.99	-
存出保证金		15,514.32	-
交易性金融资产	6.4.7.2	16,249,958.13	13,266,684.50
其中：股票投资		2,751,255.20	-
基金投资		12,649,220.43	13,266,684.50
债券投资		849,482.50	-

资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		295,195.97	-
应收利息	6.4.7.5	10,679.76	367.35
应收股利		-	-
应收申购款		2,032.56	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	847.82	625.31
资产总计		16,995,564.46	15,109,451.63
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年6月30日</b>	<b>上年度末 2020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		600,000.00	-
应付证券清算款		464,511.18	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		8,374.28	3,380.90
应付托管费		1,933.51	923.22
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	44,583.13	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	79,343.16	-
负债合计		1,198,745.26	4,304.12
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	15,273,272.20	14,983,618.13
未分配利润	6.4.7.10	523,547.00	121,529.38
所有者权益合计		15,796,819.20	15,105,147.51
负债和所有者权益总计		16,995,564.46	15,109,451.63

注： 报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0343 元，基金份额总额 15,273,272.20 份。

## 6.2 利润表

会计主体：浦银安盛养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、收入		660,217.65
1. 利息收入		14,397.22
其中：存款利息收入	6.4.7.11	4,036.86
债券利息收入		10,360.36
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		608,573.43
其中：股票投资收益	6.4.7.12	642,433.69
基金投资收益	6.4.7.13	-95,815.68
债券投资收益	6.4.7.14	-4,721.50
资产支持证券投资收益	6.4.7.14.5	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-
股利收益	6.4.7.17	66,676.92
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	30,697.93
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	6,549.07
减：二、费用		262,938.35
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	44,915.17
2. 托管费	6.4.10.2.2	11,334.47
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 交易费用	6.4.7.20	125,965.64
5. 利息支出		979.91
其中：卖出回购金融资产支出		979.91
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	6.4.7.21	79,743.16
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		397,279.30
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		397,279.30

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：浦银安盛养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	14,983,618.13	121,529.38	15,105,147.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	397,279.30	397,279.30
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	289,654.07	4,738.32	294,392.39
其中: 1. 基金申购款	289,654.07	4,738.32	294,392.39
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 (净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	15,273,272.20	523,547.00	15,796,819.20

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:

郁蓓华

郁蓓华

钱琨

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

浦银安盛养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (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 [2020] 512 号《关于准予浦银安盛养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (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《浦银安盛养老目标日期



2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式发起式基金，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

14,981,332.56 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(2020)第 1089 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《浦银安盛养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 基金合同》于 2020 年 12 月 16 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 14,983,618.13 份基金份额，其中认购资金利息折合 2,285.57 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，基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

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。

本基金为发起式基金，发起资金认购部分为 10,000,800.04 份基金份额，发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《浦银安盛养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 招募说明书》的有关规定，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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、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(含分离交易可转债)、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%，投资于股票(含存托凭证)、股票型基金、混合型基金和商品基金(含商品期货基金和黄金 ETF)等品种的比例合计原则上不超过 60%；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。本基金的业绩比较基准为： $\text{中证 800 指数收益率} \times X + \text{中债综合指数收益率} \times (1-X)$ ，其中自 2020 年 12 月 16 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日，X 值为 50%；2021 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日，X=49%；2023 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日，X=48%；2025 年 1 月 1 日至 2026 年 12 月 31 日，X=45%；2027 年 1 月 1 日至 2028 年 12 月 31 日，X=41%；2029 年 1 月 1 日至 2030 年 12 月 31 日，X=37%；2031 年 1 月 1 日至 2032 年 12 月 31 日，X=32%；2033 年 1 月 1 日

至 2034 年 12 月 31 日, X=27%; 2035 年 1 月 1 日至 2036 年 12 月 31 日, X=22%; 2037 年 1 月 1 日至 2038 年 12 月 31 日, X=17%; 2039 年 1 月 1 日至 2040 年 12 月 31 日, X=15%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《浦银安盛养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日期间财务报表符合企业会计准则的要求, 真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为: 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外, 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项, 包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

## (2) 金融负债的分类

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

### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

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

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资 and 衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关

资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

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

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 6.4.4.7 实收基金

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

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

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

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流

通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”),按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

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

(4)对于基金投资,根据中基协发[2017]3号《关于发布〈基金中基金估值业务指引(试行)〉的通知》之附件《基金中基金估值业务指引(试行)》,采用如下方法估值:

(a)对于交易型开放式指数基金、境内上市定期开放式基金及封闭式基金,按所投资基金估值日的收盘价估值;

(b)对于境内上市开放式基金(LOF)及其他境内非货币市场基金,按所投资基金估值日的份额净值估值;

(c)对于境内上市交易型货币市场基金,如所投资基金披露份额净值,则按所投资基金估值日的份额净值估值;如所投资基金披露万份(百份)收益,则按所投资基金前一估值日后至估值日期间(含节假日)的万份(百份)收益计提估值日基金收益;

(d)对于境内非上市货币市场基金按所投资基金前一估值日后至估值日期间(含节假日)的万份收益计提估值日基金收益。

如遇所投资基金不公布基金份额净值、进行折算或拆分、估值日无交易等特殊情况,本基金根据以下原则进行估值:

(a)以所投资基金的基金份额净值估值的,若所投资基金与基金中基金估值频率一致但未公布估值日基金份额净值,按其最近公布的基金份额净值为基础估值;

(b)以所投资基金的收盘价估值的,若估值日无交易,且最近交易日后市场环境未发生重大变化,按最近交易日的收盘价估值;如最近交易日后市场环境发生了重大变化的,可使用最新的基金份额净值为基础或参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素调整最近交易市价,确定公允价值;

(c)如果所投资基金前一估值日至估值日期间发生分红除权、折算或拆分,基金管理人应根

据基金份额净值或收盘价、单位基金份额分红金额、折算拆分比例、持仓份额等因素合理确定公允价值。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)

的, 其股息红利所得全额计入应纳税所得额; 持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的, 暂减按 50%计入应纳税所得额; 持股期限超过 1 年的, 暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股, 解禁后取得的股息、红利收入, 按照上述规定计算纳税, 持股时间自解禁日起计算; 解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税, 买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位: 人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	218,821.91
定期存款	-
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	-
合计	218,821.91

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,703,558.98	2,751,255.20	47,696.22
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	849,739.30	849,482.50
	银行间市场	-	-
	合计	849,739.30	849,482.50
资产支持证券	-	-	-
基金	12,574,309.22	12,649,220.43	74,911.21
其他	-	-	-
合计	16,127,607.50	16,249,958.13	122,350.63

##### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注: 本基金在本报告期末未持有衍生金融资产/负债。



## 6.4.7.4 买入返售金融资产

## 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金在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：本基金在本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

## 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	6.15
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	81.99
应收债券利息	10,585.32
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	6.30
合计	10,679.76

## 6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
其他应收款	847.82
待摊费用	-
合计	847.82

## 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	44,583.13
银行间市场应付交易费用	-
合计	44,583.13

## 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2021 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	-
预提费用	79,343.16
合计	79,343.16

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	14,983,618.13	14,983,618.13
本期申购	289,654.07	289,654.07
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	15,273,272.20	15,273,272.20

#### 6.4.7.10 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	29,876.68	91,652.70	121,529.38
本期利润	366,581.37	30,697.93	397,279.30
本期基金份额交易产生的变动数	4,820.85	-82.53	4,738.32
其中：基金申购款	4,820.85	-82.53	4,738.32
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	401,278.90	122,268.10	523,547.00

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
	活期存款利息收入
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	484.21
其他	40.72
合计	4,036.86

## 6.4.7.12 股票投资收益

## 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	642,433.69
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	642,433.69

## 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	31,009,354.80
减：卖出股票成本总额	30,366,921.11
买卖股票差价收入	642,433.69

## 6.4.7.12.3 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。

## 6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	23,010,621.33
减：卖出/赎回基金成本总额	23,106,437.01
基金投资收益	-95,815.68

## 6.4.7.14 债券投资收益

## 6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-4,721.50
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	-4,721.50

#### 6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	779,680.69
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	754,500.00
减：应收利息总额	29,902.19
买卖债券差价收入	-4,721.50

#### 6.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金在本报告期内无债券投资收益——赎回差价收入。

#### 6.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金在本报告期内无债券投资收益——申购差价收入。

#### 6.4.7.14.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.15 贵金属投资收益

##### 6.4.7.15.1 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。

##### 6.4.7.15.2 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。

##### 6.4.7.15.3 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。

**6.4.7.15.4 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。

**6.4.7.16 衍生工具收益****6.4.7.16.1 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。

**6.4.7.16.2 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。

**6.4.7.17 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	32,848.64
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	33,828.28
合计	66,676.92

**6.4.7.18 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	30,697.93
股票投资	47,696.22
债券投资	-256.80
资产支持证券投资	-
基金投资	-16,741.49
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	30,697.93

**6.4.7.19 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日

基金赎回费收入	-
销售服务费	6,549.07
合计	6,549.07

#### 6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	92,546.72
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	33,418.92
其中：申购费	7,239.36
赎回费	25,189.67
交易费	989.89
合计	125,965.64

#### 6.4.7.20.1 持有基金产生的费用

项目	本期费用 2021年1月1日至2021年6月30日
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	3,678.08
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	38,463.73
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	7,770.61

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率计算得出。

#### 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
开户费	400.00
合计	79,743.16

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本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	基金管理人、基金销售机构
中国邮政储蓄银行股份有限公司	基金托管人、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：本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的基金投资。

#### 6.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期内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
----	----

	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	44,915.17
其中：支付销售机构的客户维护费	8,095.87

注：1. 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。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 0.80% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.00\% / \text{当年天数}。$$

2. 本基金本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日因投资于基金管理人所管理的其他基金而已在管理费计算基数中扣除部分对应的管理费金额为 11,702.35 元。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	11,334.47

注：1. 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。支付基金托管人中国邮政储蓄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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}。$$

2. 本基金本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日因投资于基金托管人所托管的其他基金而已在托管费计算基数中扣除部分对应的托管费金额为 2,676.45 元。

#### 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：本基金在本报告期末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：本基金本报告期内转融通证券出借业务未发生重大关联交易事项。



#### 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：本基金本报告期内转融通证券出借业务未发生重大关联交易事项。

#### 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 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金合同生效日（2020年12月16日）持有的基金份额	10,000,800.04
报告期初持有的基金份额	10,000,800.04	
报告期间申购/买入总份额	-	
报告期间因拆分变动份额	-	
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	
报告期末持有的基金份额	10,000,800.04	
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	65.48%	

##### 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 2021年1月1日至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国邮储银行	218,821.91	3,511.93

注：本基金的银行存款由基金托管人中国邮储银行保管，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：本基金在本报告期内未有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

本基金本报告期内无须作说明的其他关联交易事项。

**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	本期费用
	2021 年 1 月 1 日至 2021 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)	2,565.80
当期持有基金产生的应支付管理费 (元)	11,702.35
当期持有基金产生的应支付托管费 (元)	2,676.45
-	-

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率计算得出。根据相关法律法规及本基金合同的约定，基金管理人不得对基金中基金财产中持有的自身管理的基金部分收取基金中基金的管理费，基金托管人不得对基金中基金财产中持有的自身托管的基金部分收取基金中基金的托管费。基金管理人运用本基金财产申购自身管理的其他基金的（ETF 除外），应当通过直销渠道申购且不收取申购费、赎回费（按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并计入基金资产的赎回费用除外）、销售服务等销售费用，其中申购费、赎回费在实际申购、赎回时按上述规定执行，销售服务费由本基金管理人从被投资基金收取后返还至本基金基金资产。

**6.4.11 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(2021 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：本基金在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

截至本报告期末 2021 年 06 月 30 日止, 本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 600,000.00 元, 截至 2021 年 07 月 01 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券, 按证券交易所规定的比例折算为标准券后, 不低于债券回购交易的余额。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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

本基金是采用目标日期策略的混合型基金中基金, 风险与收益水平会随着所设定目标日期的临近而逐步降低。本基金平均风险和预期收益水平低于股票型基金, 高于债券型基金和货币市场基金。

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 (包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、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 (含分离交易可转债)、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%, 投资于股票 (含存托凭证, 下同)、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 60%; 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。

根据浦银安盛养老目标日期基金下滑曲线模型, 随着目标日期的临近, 权益类资产投资比例逐渐下降, 非权益类资产投资比例逐步上升。此处权益类资产包含股票、股票型基金、商品基金 (含商品期货基金和黄金 ETF) 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 50%, 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 50%。

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。

#### 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、风险控制委员会、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。

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控制委员会是公司经营层面负责风险管理的最高权力机构，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中国邮政储蓄银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，

违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2021 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和资产支持证券。

#### 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在基金最短持有期限到期日起（含当日）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 2021 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 600,000.00 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约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（ETF 联接基金除外）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。本基金投资于封闭运作基金、定期开放基金等流通受限基金资产合计不得超过基金资产净值的 10%。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发行的证券(不含本基金所投资的基金份额)不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在，基金销售机构申购、赎回，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。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 2021 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 2021 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、存出保证金、债券投资和卖出回购金融资产等。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	218,821.91	-	-	-	218,821.91
结算备付金	202,513.99	-	-	-	202,513.99
存出保证金	15,514.32	-	-	-	15,514.32
交易性金融资产	849,482.50	-	-	15,400,475.63	16,249,958.13
应收利息	-	-	-	10,679.76	10,679.76
应收申购款	-	-	-	2,032.56	2,032.56
应收证券清算款	-	-	-	295,195.97	295,195.97
其他资产	-	-	-	847.82	847.82
资产总计	1,286,332.72	-	-	15,709,231.74	16,995,564.46
<b>负债</b>					
应付管理人报酬	-	-	-	8,374.28	8,374.28
应付托管费	-	-	-	1,933.51	1,933.51
应付证券清算款	-	-	-	464,511.18	464,511.18
卖出回购金融资产款	600,000.00	-	-	-	600,000.00
应付交易费用	-	-	-	44,583.13	44,583.13
其他负债	-	-	-	79,343.16	79,343.16
负债总计	600,000.00	-	-	598,745.26	1,198,745.26
利率敏感度缺口	686,332.72	-	-	15,110,486.48	15,796,819.20
<b>上年度末 2020 年 12 月 31 日</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
<b>资产</b>					
银行存款	1,841,774.47	-	-	-	1,841,774.47
交易性金融资产	-	-	-	13,266,684.50	13,266,684.50
应收利息	-	-	-	367.35	367.35
其他资产	-	-	-	625.31	625.31
资产总计	1,841,774.47	-	-	13,267,677.16	15,109,451.63
<b>负债</b>					
应付管理人报酬	-	-	-	3,380.90	3,380.90
应付托管费	-	-	-	923.22	923.22
负债总计	-	-	-	4,304.12	4,304.12
利率敏感度缺口	1,841,774.47	-	-	13,263,373.04	15,105,147.51

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

注：于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券投资公允价值占基金资产净值的比例为 5.38%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 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，本基金结合大类资产配置和基金优选模型，精选风险收益比较好的基金构建基金投资组合，从而实现基金资产长期增值的目的。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，通过自主开发的量化基金优选模型来筛选基金，获取资产轮动的 Beta 收益以及资产内部的 Alpha 收益，最终实现基金资产长期增值的目的。

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%，其中投资于股票、股票型基金和混合型基金资产占基金资产的比例为 60%-95%；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。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，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 2021年6月30日		上年度末 2020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	2,751,255.20	17.42	-	-
交易性金融资产—基金投资	12,649,220.43	80.07	13,266,684.50	87.83
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	15,400,475.63	97.49	13,266,684.50	87.83

#### 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		
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 (2021年6月30日)	上年度末 (2020年12月31日)	
业绩比较基准上升 500 基点	730,377.03	114,426.55	
业绩比较基准下降 500 基点	-730,377.03	-114,426.55	

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

## § 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	2,751,255.20	16.19
	其中:股票	2,751,255.20	16.19
2	基金投资	12,649,220.43	74.43
3	固定收益投资	849,482.50	5.00
	其中:债券	849,482.50	5.00

	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	421,335.90	2.48
8	其他各项资产	324,270.43	1.91
9	合计	16,995,564.46	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

金额单位：人民币元

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	-	-
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	-	-
J	金融业	2,751,255.20	17.42
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	2,751,255.20	17.42

### 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

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	300059	东方财富	24,780	812,536.20	5.14
2	600030	中信证券	24,700	616,018.00	3.90
3	601995	中金公司	7,900	485,850.00	3.08
4	002797	第一创业	65,000	464,100.00	2.94
5	601788	光大证券	13,700	245,093.00	1.55
6	601696	中银证券	6,200	127,658.00	0.81

## 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	000725	京东方 A	1,518,293.00	10.05
2	002466	天齐锂业	1,435,952.20	9.51
3	300059	东方财富	1,415,111.89	9.37
4	000100	TCL 科技	1,245,954.00	8.25
5	002460	赣锋锂业	1,217,725.00	8.06
6	600519	贵州茅台	1,194,981.00	7.91
7	601318	中国平安	1,094,667.00	7.25
8	603799	华友钴业	1,053,424.00	6.97
9	000799	酒鬼酒	839,420.00	5.56
10	600030	中信证券	832,829.00	5.51
11	300750	宁德时代	824,308.00	5.46
12	601628	中国人寿	786,687.00	5.21
13	601601	中国太保	776,868.00	5.14
14	600499	科达制造	776,048.00	5.14
15	300015	爱尔眼科	752,185.00	4.98
16	002304	洋河股份	739,980.00	4.90
17	000858	五粮液	736,643.00	4.88
18	000568	泸州老窖	736,320.00	4.87
19	002192	融捷股份	730,867.00	4.84
20	600019	宝钢股份	715,957.00	4.74
21	601088	中国神华	714,492.00	4.73
22	601398	工商银行	629,547.00	4.17
23	601377	兴业证券	629,256.00	4.17
24	601988	中国银行	629,256.00	4.17
25	601288	农业银行	629,148.00	4.17
26	601939	建设银行	629,043.00	4.16
27	600809	山西汾酒	628,807.00	4.16
28	300760	迈瑞医疗	579,841.00	3.84
29	601878	浙商证券	472,736.00	3.13

30	600760	中航沈飞	470,392.00	3.11
31	600893	航发动力	470,381.00	3.11
32	601336	新华保险	469,273.00	3.11
33	002240	盛新锂能	465,444.00	3.08
34	002797	第一创业	464,470.00	3.07
35	601995	中金公司	464,255.00	3.07
36	601788	光大证券	463,409.00	3.07
37	600109	国金证券	462,425.00	3.06
38	601225	陕西煤业	448,346.00	2.97
39	000932	华菱钢铁	448,120.00	2.97
40	600188	兖州煤业	445,210.00	2.95
41	600884	杉杉股份	444,417.00	2.94
42	000933	神火股份	443,666.00	2.94
43	601888	中国中免	442,832.00	2.93
44	600707	彩虹股份	442,200.00	2.93
45	000807	云铝股份	441,970.00	2.93

注：“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	002466	天齐锂业	1,634,403.00	10.82
2	000725	京东方 A	1,533,013.00	10.15
3	002460	赣锋锂业	1,288,103.00	8.53
4	000100	TCL 科技	1,261,538.00	8.35
5	600519	贵州茅台	1,211,805.00	8.02
6	603799	华友钴业	1,113,935.00	7.37
7	601318	中国平安	1,075,981.00	7.12
8	300750	宁德时代	937,103.00	6.20
9	000799	酒鬼酒	888,959.00	5.89
10	000858	五粮液	842,247.00	5.58
11	000568	泸州老窖	791,520.00	5.24
12	601088	中国神华	787,774.00	5.22
13	300015	爱尔眼科	782,834.00	5.18
14	600019	宝钢股份	769,908.00	5.10
15	601628	中国人寿	750,136.00	4.97
16	600499	科达制造	748,347.00	4.95
17	601601	中国太保	736,968.00	4.88
18	002304	洋河股份	731,679.00	4.84
19	002192	融捷股份	712,593.00	4.72

20	600809	山西汾酒	669,841.00	4.43
21	601288	农业银行	638,628.00	4.23
22	300059	东方财富	631,597.80	4.18
23	601398	工商银行	628,334.00	4.16
24	601939	建设银行	625,359.00	4.14
25	601377	兴业证券	611,044.00	4.05
26	300760	迈瑞医疗	609,121.00	4.03
27	600893	航发动力	585,155.00	3.87
28	601988	中国银行	582,156.00	3.85
29	600760	中航沈飞	495,467.00	3.28
30	002240	盛新锂能	494,361.00	3.27
31	601888	中国中免	466,598.00	3.09
32	601878	浙商证券	454,494.00	3.01
33	601336	新华保险	454,090.00	3.01
34	600188	兖州煤业	449,697.00	2.98
35	600109	国金证券	442,554.00	2.93
36	000932	华菱钢铁	435,906.00	2.89
37	601225	陕西煤业	429,146.00	2.84
38	600707	彩虹股份	427,728.00	2.83
39	000933	神火股份	414,697.00	2.75
40	600884	杉杉股份	390,780.00	2.59
41	000807	云铝股份	382,619.00	2.53

注：“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）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	33,070,480.09
卖出股票收入（成交）总额	31,009,354.80

注：“买入股票的成本”和“卖出股票的收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）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	556,060.50	3.52
2	央行票据	-	-
3	金融债券	293,422.00	1.86
	其中：政策性金融债	293,422.00	1.86
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	849,482.50	5.38

## 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	018006	国开 1702	2,900	293,422.00	1.86
2	019645	20 国债 15	2,800	280,868.00	1.78
3	019649	21 国债 01	2,750	275,192.50	1.74

## 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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

### 7.10.2 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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.3 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，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	006465	浦银安盛普益纯债债券 C	契约型开放式	2,899,102.63	2,952,446.12	18.69	是
2	512880	国泰中证全指证券公司 ETF	交易型开放式 (ETF)	1,712,100.00	1,898,718.90	12.02	否
3	512000	华宝中证全指证券公司 ETF	交易型开放式 (ETF)	1,780,700.00	1,891,103.40	11.97	否
4	510230	金融 ETF	交易型开放式 (ETF)	819,400.00	921,825.00	5.84	否
5	512660	国泰中证军工 ETF	交易型开放式 (ETF)	764,100.00	880,243.20	5.57	否
6	000191	富国信用债债券 A	契约型开放式	673,436.81	772,903.43	4.89	否
7	100058	富国产业债债券 A	契约型开放式	671,205.09	770,610.56	4.88	否
8	000305	中银中高等级债券 A	契约型开放式	719,155.18	762,304.49	4.83	否

9	512710	富国中证军工龙头 ETF	交易型开放式 (ETF)	784,300.00	657,243.40	4.16	否
10	511880	银华交易型货币 A	交易型开放式 (ETF)	6,000.00	607,152.00	3.84	否
11	510300	华泰柏瑞沪深 300ETF	交易型开放式 (ETF)	59,700.00	313,783.20	1.99	否
12	511990	华宝添益货币 A	交易型开放式 (ETF)	2,209.00	220,884.54	1.40	否
13	070009	嘉实超短债债券 C	契约型开放式	2.08	2.19	0.00	否

### 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

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体除第一创业以外没有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、处罚的情况。

第一创业持股 5%以上股东华熙昕宇投资有限公司截至 2020 年 7 月 8 日，累计减持超出承诺可减持数量。深圳证券交易所对华熙昕宇投资有限公司给予通报批评的处分。

本基金管理人的研究部门对第一创业保持了及时的研究跟踪，投资决策符合本基金管理人的投资流程。

#### 7.13.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库的范围。

#### 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	15,514.32
2	应收证券清算款	295,195.97



3	应收股利	-
4	应收利息	10,679.76
5	应收申购款	2,032.56
6	其他应收款	847.82
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	324,270.43

#### 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：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的股票。

## § 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

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 (%)
759	20,122.89	10,000,800.04	65.48	5,272,472.16	34.52

### 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	0.00	0.00

### 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

### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额 占基金总 份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占 基金总份额 比例(%)	发起份额承 诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,800.04	65.48	10,000,800.04	65.48	自合同生效之日起不少于3年

基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,800.04	65.48	10,000,800.04	65.48	自合同生效之日起不少于3年

注：上述份额总数均包含利息结转份额。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020年12月16日） 基金份额总额	14,983,618.13
本报告期期初基金份额总额	14,983,618.13
本报告期基金总申购份额	289,654.07
减：本报告期基金总赎回份额	-
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	15,273,272.20

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

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

报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内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普华永道中天会计师事务所(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

本报告期内, 管理人、托管人及其高级管理人员未受到有权机关调查、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。

### 10.8 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	
海通证券	2	44,942,935.10	70.14%	41,855.43	74.94%	-
国盛证券	1	19,136,899.79	29.86%	13,995.12	25.06%	-

注: 1、证券经营机构交易单元选择的标准和程序:

#### (1) 选择证券经营机构交易单元的标准

财务状况良好、经营管理规范、内部管理制度健全、风险管理严格;  
具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件, 交易设施满足基金进行证券交易的需要;  
具备较强的综合研究能力, 能及时、全面地为基金提供研究服务支持;  
佣金费率合理;  
本基金管理人要求的其他条件。

#### (2) 选择证券经营机构交易单元的程序

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;  
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。

2、报告期内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国盛证券交易单元。

### 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
海通证券	2,354,017.80	100.00%	10,200,000.00	100.00%	-	-	27,761,797.61	100.00%
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-

### 10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	浦银安盛养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 开放日常申购、赎回业务的公告	报刊及规定网站	2021 年 03 月 30 日
2	浦银安盛养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 2021 年第 1 季度报告	规定网站	2021 年 04 月 22 日
3	浦银安盛养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 招募说明书 (更新) 2021 年第 1 号	规定网站	2021 年 05 月 28 日
4	浦银安盛养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 基金经理变更公告	报刊及规定网站	2021 年 05 月 28 日
5	浦银安盛养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 基金产品资料概要更新	规定网站	2021 年 05 月 28 日
6	浦银安盛基金管理有限公司关于旗下部分基金调整基金投资范围及 (或) 引入侧袋机制并相应修改法律文件的公告	报刊及规定网站	2021 年 06 月 24 日
7	浦银安盛养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 基金产品资料概要更新	规定网站	2021 年 06 月 24 日
8	浦银安盛养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 招募说明书 (更新) 2021 年第 2 号	规定网站	2021 年 06 月 24 日
9	浦银安盛养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 托管协议	规定网站	2021 年 06 月 24 日
10	浦银安盛养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 基金合同	规定网站	2021 年 06 月 24 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	2021 年 01 月 01 日-2021 年 06 月 30 日	10,000,800.04	0.00	0.00	10,000,800.04	65.48
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

无。

## § 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养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 募集的文件
- 2、 浦银安盛养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 基金合同
- 3、 浦银安盛养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 招募说明书
- 4、 浦银安盛养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (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

上海市淮海中路 381 号中环广场 38 楼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

2021 年 8 月 31 日