

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）
2023 年第 1 季度报告

2023 年 3 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：中国邮政储蓄银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 4 月 22 日

§ 1 重要提示

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

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 2023 年 4 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 3 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 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 |
| 报告期末基金份额总额 | 16,186,426.66 份 |
| 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段内保值增值的目的。 |
| 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。 |
| 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 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期 (2023 年 1 月 1 日-2023 年 3 月 31 日) |
|-----------------|--------------------------------------|
| 1. 本期已实现收益 | -42,966.12 |
| 2. 本期利润 | 291,269.13 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0181 |
| 4. 期末基金资产净值 | 14,414,870.59 |
| 5. 期末基金份额净值 | 0.8906 |

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。

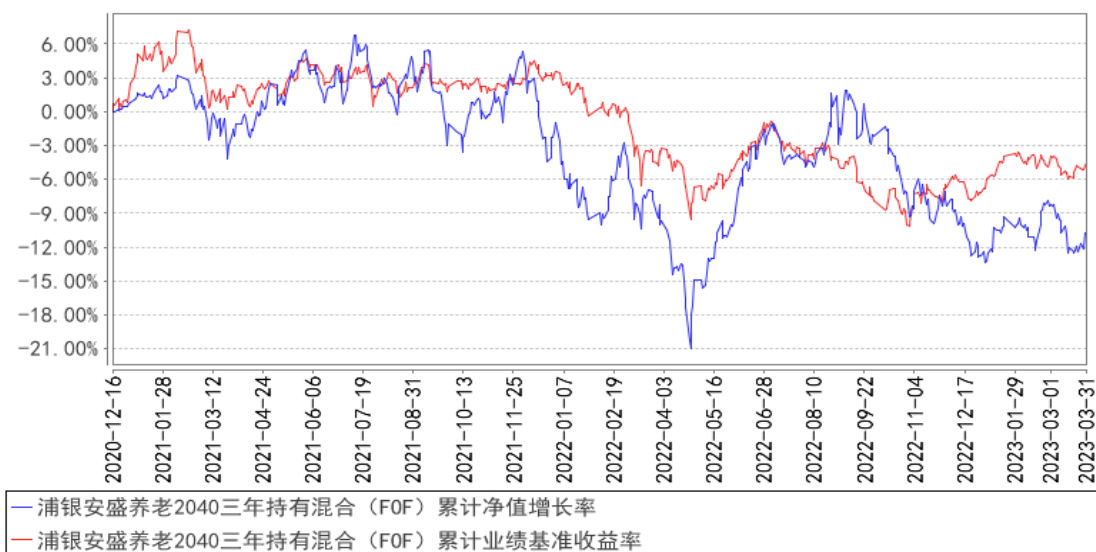
3.2 基金净值表现

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 | 净值增长率 ① | 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 |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|---------|-------|
| 过去三个月 | 2.09% | 0.76% | 2.81% | 0.38% | -0.72% | 0.38% |
| 过去六个月 | -8.97% | 0.82% | 3.59% | 0.49% | -12.56% | 0.33% |
| 过去一年 | -0.95% | 0.99% | -0.79% | 0.55% | -0.16% | 0.44% |
| 自基金合同 生效起至今 | -10.94% | 0.93% | -4.61% | 0.56% | -6.33% | 0.37% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



§ 4 管理人报告

4.1 基金经理 (或基金经理小组) 简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|----------------------|-------------|------|--------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 陈曙亮 | FOF 业务部部门总监兼本基金的基金经理 | 2021年5月27日 | - | 14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, 担任浦银安盛颐和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。2021年12月起, 担任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) 的基金经理。2022年1月起, 担任浦银安盛兴荣稳健一年持有期混合型基金中基金 (FOF) 的基金经理。2022年2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。2022年3月起, 担任浦银安盛稳健 |

| | | | | | |
|-----|----------|------------------|-----------------|------|--|
| | | | | | 回报 6 个月持有期债券型基金中基金（FOF）的基金经理。2022 年 7 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）的基金经理。 |
| 许文峰 | 本基金的基金经理 | 2021 年 10 月 18 日 | 2023 年 3 月 23 日 | 12 年 | 许文峰先生，中国科学院物理化学硕士。2010 年 7 月至 2020 年 6 月分别就职于东海证券、立溢股权投资中心、华泰资产管理有限公司、先融资产管理有限公司和永诚保险资产管理有限公司，均担任权益投资部投资经理之职。2020 年 6 月加盟浦银安盛基金管理有限公司，任权益专户部投资经理之职；2021 年 8 月起调岗至 FOF 业务部，现任 FOF 业务部 FOF 基金经理。2021 年 10 月至 2023 年 3 月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）及浦银安盛颐 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 12 月至 2023 年 3 月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。 |

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合规守信情况的说明

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 公平交易专项说明

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

一季度国内外宏观经济改善，A 股整体延续去年 11-12 月份的震荡向上行情。国内来看，随着国内疫情防控政策放开且并未出现疫情变异毒株对市场的快速冲击，叠加一二月份的“春节行情”，生产生活逐渐恢复，经济基本面持续改善；从海外市场上看，俄乌关系有所缓和，另外由于美国通胀持续超预期下行，以及美国硅谷银行和瑞士信贷风险的先后出现，对美联储的加息预判有所放缓，不排除 5 月份停止加息的可能，利好制造业等出口占据较大市场的行业，逐步进入后疫情时代，市场流动性和外汇压力得到缓解。一月份北向资金大幅净流入 1412.9 亿元，导致 A 股全面走强；二三月份北向资金流入放缓后市场陷入放量滞涨行情，各板块分化，呈现板块轮动行情。分板块来看，以茅台为代表的大消费板块和大盘蓝筹股、半导体和光伏产业链等复苏赛道股、以及信创和能源板块先后出现行情，穿插 ChatGPT 概念带来的个股放量上涨。债券市场方面，经济仍然面临客观压力，经济修复的斜率可能放缓，但低基数效应下同比大概率冲高。虽然两会上未见强刺激和高目标，导致市场对 2023 年经济增长高度一路下修，甚至出现“能否达到 5%”的担忧。资金面是影响机构行为和市场预期的关键，债市重点在于 4 月和二季度信贷是否多增，以及是否引致资金面再度紧平衡。

策略上我们参照下滑曲线模型进行资产配置，权益持仓上重点投资了对能源转型过程中起支撑作用的传统能源以及部分稳增长相关板块。同时，我们也密切跟踪计算机、传媒等科技板块的

演化情况，观察市场的主线投资机会。展望后市，我们认为中国国内经济将延续复苏，随着国民对经济预期信心的恢复，房地产行业将逐步改善，稳定中国经济基本盘，消费和成长性板块的复苏将进一步刺激国内需求，信创和半导体板块的迅速扩张赋予产业新的增长动能。拉长时间维度，中国经济将完成 V 型反转，盈利改善带来的产业高景气将带来良好的投资机会。

4.5 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 0.8906 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.09%；同期业绩比较基准收益率为 2.81%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

- 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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额 (元) | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|---------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | 2,203,056.00 | 15.11 |
| | 其中：股票 | 2,203,056.00 | 15.11 |
| 2 | 基金投资 | 11,424,162.99 | 78.35 |
| 3 | 固定收益投资 | 813,971.64 | 5.58 |
| | 其中：债券 | 813,971.64 | 5.58 |
| | 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 | 136,275.43 | 0.93 |
| 8 | 其他资产 | 2,851.90 | 0.02 |
| 9 | 合计 | 14,580,317.96 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值 (元) | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|----------|--------------|---------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | 2,203,056.00 | 15.28 |
| 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 | | - |
| 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 | 2,203,056.00 | 15.28 |

5.2.2 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。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 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 | 600256 | 广汇能源 | 98,100 | 907,425.00 | 6.30 |
| 2 | 600188 | 兖矿能源 | 20,500 | 729,185.00 | 5.06 |
| 3 | 000983 | 山西焦煤 | 30,500 | 335,195.00 | 2.33 |
| 4 | 601666 | 平煤股份 | 22,300 | 231,251.00 | 1.60 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 (元) | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------|------------|---------------|
| 1 | 国家债券 | 609,421.94 | 4.23 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 204,549.70 | 1.42 |
| | 其中：政策性金融债 | 204,549.70 | 1.42 |
| 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 | 813,971.64 | 5.65 |
|----|----|------------|------|

5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量 (张) | 公允价值 (元) | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|----------|--------|------------|---------------|
| 1 | 010303 | 03 国债(3) | 3,000 | 304,848.90 | 2.11 |
| 2 | 018008 | 国开 1802 | 1,000 | 103,146.47 | 0.72 |
| 3 | 019656 | 21 国债 08 | 1,000 | 102,284.99 | 0.71 |
| 4 | 019638 | 20 国债 09 | 1,000 | 101,815.15 | 0.71 |
| 5 | 108615 | 国开 2105 | 1,000 | 101,403.23 | 0.70 |

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额 (元) |
|----|---------|----------|
| 1 | 存出保证金 | 2,226.31 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 486.09 |
| 6 | 其他应收款 | 139.50 |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 2,851.90 |

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告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。

§6 基金中基金

6.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

| 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 | 159930 | 能源 ETF | 交易型开放式 (ETF) | 1,569,000.00 | 1,807,488.00 | 12.54 | 否 |
| 2 | 515220 | 国泰中证煤炭 ETF | 交易型开放式 (ETF) | 783,100.00 | 1,730,651.00 | 12.01 | 否 |
| 3 | 161032 | 煤炭 | 契约型开放式 | 933,200.00 | 1,721,754.00 | 11.94 | 否 |
| 4 | 511360 | 海富通中 | 交易型开放 | 13,400.00 | 1,431,120.00 | 9.93 | 否 |

| | | | | | | | |
|----|--------|----------------------|------------------|--------------|--------------|------|---|
| | | 证短融 ETF | 式 (ETF) | | | | |
| 5 | 006437 | 浦银中短 债债券 C | 契约型开放 式 | 1,223,248.62 | 1,257,377.26 | 8.72 | 是 |
| 6 | 003474 | 南方天天 利货币 B | 契约型开放 式 | 1,179,006.07 | 1,179,006.07 | 8.18 | 否 |
| 7 | 006662 | 易方达安 悦超短债 债券 A | 契约型开放 式 | 933,390.14 | 949,257.77 | 6.59 | 否 |
| 8 | 000836 | 国投瑞银 钱多宝货 币 A | 契约型开放 式 | 741,924.75 | 741,924.75 | 5.15 | 否 |
| 9 | 515210 | 国泰中证 钢铁 ETF | 交易型开放 式 (ETF) | 257,500.00 | 340,930.00 | 2.37 | 否 |
| 10 | 511990 | 华宝添益 货币 A | 交易型开放 式 (ETF) | 1,708.00 | 170,748.76 | 1.18 | 否 |

6.2 当期交易及持有基金产生的费用

| 项目 | 本期费用 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 3 月 31 日 | 其中：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 |
|----------------------|--------------------------------------|---------------------------------|
| 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) | 696.54 | 549.53 |
| 当期持有基金产生的应支付管理费(元) | 12,071.47 | 1,648.45 |
| 当期持有基金产生的应支付托管费(元) | 2,191.09 | 274.78 |
| 当期交易基金产生的交易费(元) | 34.40 | - |

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。

6.3 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未发生重大影响事件。

§ 7 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---------------------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 16,102,825.43 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 83,601.23 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | - |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 16,186,426.66 |

§ 8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

| | |
|---------------------------|---------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 10,000,800.04 |
| 报告期期间买入/申购总份额 | - |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | - |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 10,000,800.04 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%) | 61.79 |

8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：1、本报告期内，基金管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。截至本报告期末，本基金管理人持有浦银养老 2040 三年持有混合 (FOF) 10,000,800.04 份。

2、基金管理人固有资金投资本基金费用按照本基金法律文件约定收取。

§ 9 报告期末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 | 61.79 | 10,000,800.04 | 61.79 | 自合同生效之日起不少于 3 年 |
| 基金管理人高级管理人员 | - | - | - | - | - |

| | | | | | |
|-------------|---------------|-------|---------------|-------|---------------------|
| 员 | | | | | |
| 基金经理等 人员 | | | | | |
| 基金管理人 股东 | | | | | |
| 其他 | | | | | |
| 合计 | 10,000,800.04 | 61.79 | 10,000,800.04 | 61.79 | 自合同生效之 日起不少于 3 年 |

§ 10 影响投资者决策的其他重要信息

10.1 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 | 20230101-20230331 | 10,000,800.04 | - | - | 10,000,800.04 | 61.79 |
| 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 备查文件目录

11.1 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

11.2 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。

11.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站（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

2023 年 4 月 22 日