

交银施罗德养老目标日期 2035 三年持有
期混合型基金中基金（FOF）
2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：交银施罗德基金管理有限公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 08 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 2023 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
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	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
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	50
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	50
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	50

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	50
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	51
7.12 本报告期投资基金情况	51
7.13 投资组合报告附注	错误!未定义书签。
§ 8 基金份额持有人信息	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
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	56
§ 9 开放式基金份额变动	56
§ 10 重大事件揭示	57
10.1 基金份额持有人大会决议	57
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	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	57
10.4 基金投资策略的改变	57
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	57
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	57
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	57
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况	58
10.9 其他重大事件	60
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	61
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	61
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	61
§ 12 备查文件目录	61
12.1 备查文件目录	61
12.2 存放地点	62
12.3 查阅方式	62

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	交银施罗德养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金（FOF）	
基金简称	交银养老 2035 三年	
基金主代码	008697	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 4 月 29 日	
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	461,116,119.50 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	交银养老 2035 三年 A	交银养老 2035 三年 Y
下属分级基金的交易代码	008697	017229
报告期末下属分级基金的份额总额	427,370,468.75 份	33,745,650.75 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为基金中基金，依照下滑曲线进行大类资产配置，力争实现养老资产的长期稳健增值，满足养老资金理财需求。
投资策略	本基金主要采用目标日期策略来进行投资品种的大类资产配置。随着所设定目标日期 2035 年的临近，逐步降低权益类资产的配置比例，增加非权益类资产的配置比例。从追求资本增值逐步转变为追求当期收益，通过全方位的定量和定性分析方法精选出优质基金组成投资组合，以期达到效用最大化，实现基金资产的长期增值。
业绩比较基准	$\text{沪深 300 指数收益率} \times X + \text{中债综合全价指数收益率} \times (1 - X)$ 其中 X 的取值如下表列示： 基金合同生效之日至 2020.12.31：53% 2021.1.1-2023.12.31：46% 2024.1.1-2026.12.31：39% 2027.1.1-2029.12.31：35% 2030.1.1-2032.12.31：32% 2033.1.1-2035.12.31：29%
风险收益特征	本基金为混合型基金中基金，由于本基金主要投资于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。本基金的预期风险与预期收益高于债券型基金、债券型基金中基金、货币市场基金和货币型基金中基金，低于股票型基金和股票型基金中基金。 本基金可投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

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		交银施罗德基金管理有限公司	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王晚婷	姜敏
	联系电话	(021) 61055050	4006800000
	电子邮箱	xxpl@jysld.com, disclosure@jysld.com	jiangmin@citicbank.com
客户服务电话		400-700-5000, 021-61055000	95558
传真		(021) 61055054	010-85230024
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区银城中路188号交通银行大楼二层(裙)	北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层
办公地址		上海市浦东新区世纪大道8号国金中心二期21-22楼	北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层
邮政编码		200120	100020
法定代表人		阮红	朱鹤新

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.fund001.com
基金中期报告备置地点	基金管理人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§ 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(2023年1月1日-2023年6月30日)	
	交银养老 2035 三年 A	交银养老 2035 三年 Y
本期已实现收益	-48,605,619.33	-2,107,918.37
本期利润	-8,211,849.80	-714,325.65
加权平均基金份额本期利润	-0.0119	-0.0261
本期加权平均净值利润率	-0.98%	-2.15%
本期基金份额净值增长率	-0.86%	-0.70%
3.1.2 期末数据	报告期末(2023年6月30日)	

和指标		
期末可供分配利润	76,680,238.74	6,102,676.33
期末可供分配基金份额利润	0.1794	0.1808
期末基金资产净值	511,479,385.60	40,469,999.81
期末基金份额净值	1.1968	1.1993
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	19.68%	-2.90%

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，计入费用后的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，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

交银养老 2035 三年 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	0.98%	0.54%	0.64%	0.40%	0.34%	0.14%
过去三个月	-1.79%	0.49%	-1.86%	0.38%	0.07%	0.11%
过去六个月	-0.86%	0.47%	0.41%	0.38%	-1.27%	0.09%
过去一年	-7.39%	0.51%	-5.90%	0.45%	-1.49%	0.06%
过去三年	13.08%	0.65%	0.85%	0.57%	12.23%	0.08%
自基金合同生效起至今	19.68%	0.64%	4.20%	0.56%	15.48%	0.08%

交银养老 2035 三年 Y

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.00%	0.54%	0.64%	0.40%	0.36%	0.14%

过去三个月	-1.71%	0.49%	-1.86%	0.38%	0.15%	0.11%
过去六个月	-0.70%	0.47%	0.41%	0.38%	-1.11%	0.09%
自基金合同生效起至今	-2.90%	0.45%	0.43%	0.39%	-3.33%	0.06%

注：1、本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数收益率×X+中债综合全价指数收益率×（1-X），每日进行再平衡过程。

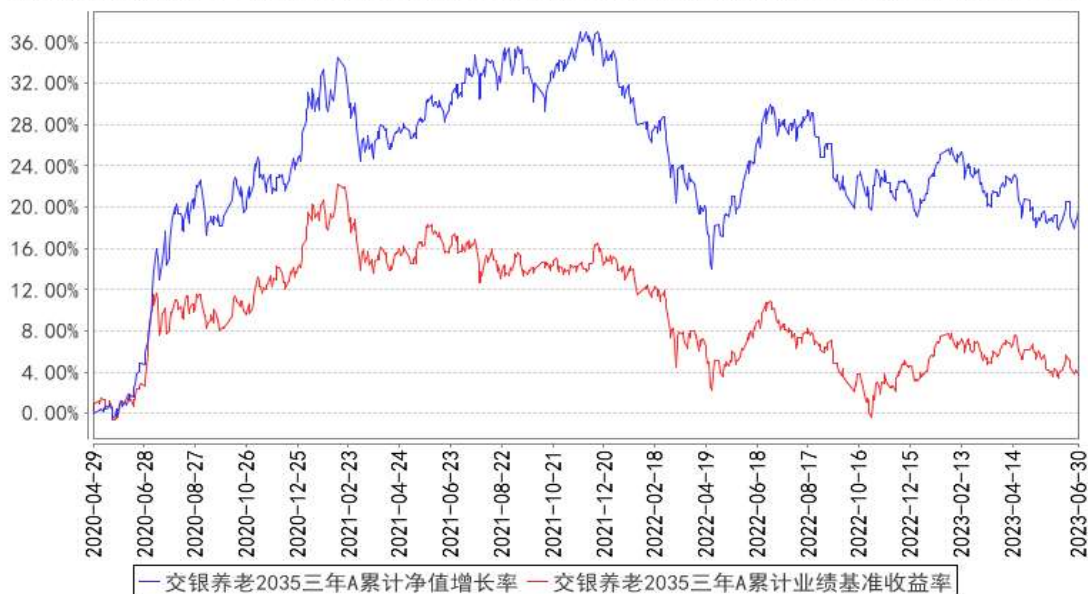
其中 X 的取值如下表列示：

年份	X 的取值
基金合同生效之日至 2020.12.31	53%
2021.1.1-2023.12.31	46%
2024.1.1-2026.12.31	39%
2027.1.1-2029.12.31	35%
2030.1.1-2032.12.31	32%
2033.1.1-2035.12.31	29%

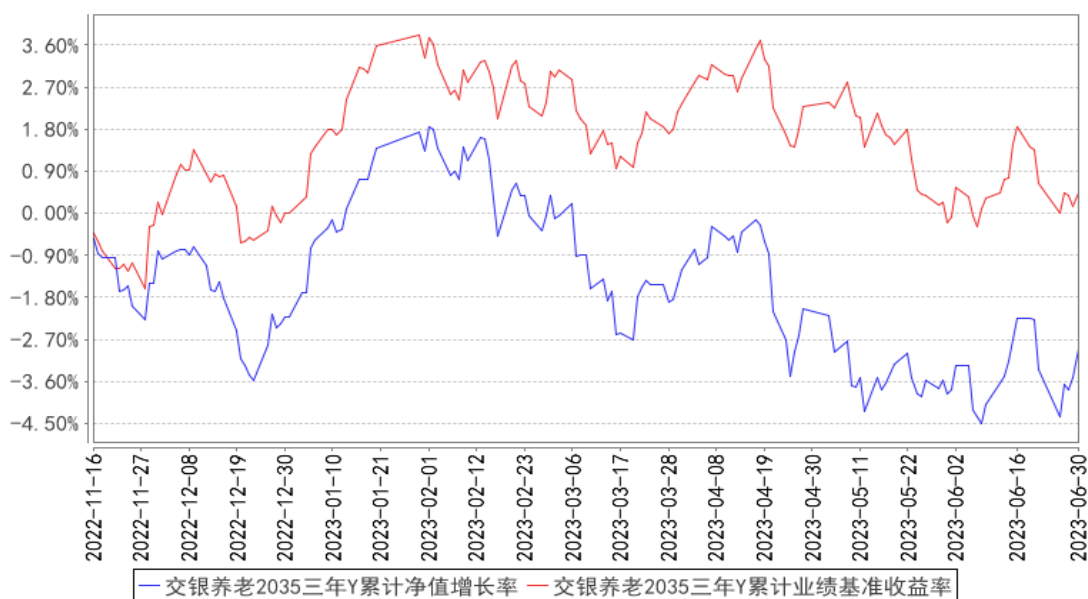
2、交银养老 2035 三年 Y 上述“自基金合同生效起至今”实际为“自基金份额类别首次确认起至今”，下同。

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

交银养老2035三年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



交银养老2035三年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、本基金建仓期为自基金合同生效日起的 6 个月。截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

2、本基金自 2022 年 11 月 11 日增加 Y 类基金份额，自 2022 年 11 月 16 日起新增有效份额，并于 2022 年 11 月 28 日起面向公众发售。

§ 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

交银施罗德基金管理有限公司是经中国证监会证监基金字[2005]128 号文批准，由交通银行股份有限公司、施罗德投资管理有限公司、中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司共同发起设立。公司成立于 2005 年 8 月 4 日，注册地在中国上海，注册资本为 2 亿元人民币。其中，交通银行股份有限公司持有 65% 的股份，施罗德投资管理有限公司持有 30% 的股份，中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司持有 5% 的股份。公司并下设交银施罗德资产管理（香港）有限公司和交银施罗德资产管理有限公司。

截至报告期末，公司管理了包括货币型、债券型、混合型和股票型在内的 122 只基金，其中股票型涵盖普通指数型、交易型开放式 (ETF)、QDII 等不同类型基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
蔡铮	交银安享	2021 年 4	-	14 年	蔡铮先生，中国国籍，复旦大学电子工程

	稳健养老一年、交银养老 2035 三年的基金经理，公司量化投资副总监兼多元资产管理副总监	月 30 日			<p>硕士。历任瑞士银行香港分行分析员。2009 年加入交银施罗德基金管理有限公司，历任投资研究部数量分析师、基金经理助理、量化投资部助理总经理、量化投资部副总经理。2012 年 12 月 27 日至 2015 年 6 月 30 日担任交银施罗德沪深 300 行业分层等权重指数证券投资基金基金经理，2015 年 4 月 22 日至 2017 年 3 月 24 日担任交银施罗德环球精选价值证券投资基金基金经理，2015 年 4 月 22 日至 2017 年 3 月 24 日担任交银施罗德全球自然资源证券投资基金基金经理，2015 年 8 月 13 日至 2016 年 7 月 18 日担任交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金基金经理。2018 年 5 月 18 日至 2020 年 7 月 17 日担任交银施罗德致远量化智投策略定期开放混合型证券投资基金的基金经理。2015 年 6 月 26 日至 2020 年 11 月 25 日担任交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金的基金经理。2015 年 3 月 26 日至 2020 年 11 月 29 日担任交银施罗德德国证新能源指数分级证券投资基金的基金经理。2012 年 12 月 27 日至 2021 年 4 月 29 日担任上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金、交银施罗德上证 180 公司治理交易型开放式证券投资基金联接基金、深证 300 价值交易型开放式指数证券投资基金、交银施罗德深证 300 价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2015 年 5 月 27 日至 2021 年 4 月 29 日担任交银施罗德中证海外中国互联网指数型证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2016 年 7 月 19 日至 2021 年 4 月 29 日担任交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2019 年 11 月 20 日至 2021 年 4 月 29 日担任交银施罗德创业板 50 指数型证券投资基金的基金经理。2020 年 11 月 30 日至 2021 年 4 月 29 日担任交银施罗德德国证新能源指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理。</p>
刘兵	交银招享一年混合、交银智选星光	2023 年 1 月 7 日	-	7 年	<p>刘兵先生，上海财经大学经济学博士。2016 年加入交银施罗德基金管理有限公司，历任量化投资部研究员、多元资产管理部研究员、投资经理。</p>

	一年封闭运作混合（FOF-LOF）、交银兴享一年持有期混合（FOF）、交银优享一年持有期混合（FOF）、交银慧选睿信一年持有期混合（FOF）基金中基金、交银安享稳健养老一年、交银养老 2035 三年的基金经理以及基金投资经理，公司多元资产管理助理总监				
--	---	--	--	--	--

注：1、本表所列基金经理（助理）任职日期和离职日期均以基金合同生效日或公司作出决定并公告（如适用）之日为准。

2、本表所列基金经理（助理）证券从业年限中的“证券从业”的含义遵从中国证券业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3、基金经理（或基金经理小组）期后变动（如有）敬请关注基金管理人发布的相关公告。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，基金整体运作符合有关法律法规和基金合同的规定，为基金持有人谋求最大利益。

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

本公司制定了严格的投资控制制度和公平交易监控制度来保证旗下基金运作的公平，旗下所管理的所有资产组合，包括证券投资基金和私募资产管理计划均严格遵循制度进行公平交易。

公司建立资源共享的投资研究信息平台，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。公司在交易执行环节实行集中交易制度，建立公平的交易分配制度。对于交易所公开竞价交易，遵循“价格优先、时间优先”的原则，全部通过交易系统进行比例分配；对于非集中竞价交易、以公司名义进行的场外交易，遵循公平交易分配原则对交易结果进行分配。

公司中央交易室和风险管理部进行日常投资交易行为监控，风险管理部负责对各账户公平交易进行事后分析，于每季度和每年度分别对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析，通过分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

报告期内本公司严格执行公平交易制度，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

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内，本公司管理的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没有超过该证券当日总成交量 5% 的情形，本基金与本公司管理的其他投资组合在不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）同向交易的交易价差未出现异常。

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

2023 年上半年，国内经济开启复苏进程。一季度，伴随经济社会生活逐步恢复常态运行，经济呈现出弱复苏态势；进入二季度后，经济内生修复动能力度边际趋缓，除出口外多数经济指标走弱，反映当前经济内生需求仍不足。海外方面，欧美通胀自高位持续回落，但通胀读数仍高于欧美央行政策预期，市场对美国经济衰退预期经历曲折反复。国内权益市场在经济复苏预期摇摆中于一月快速上行，随后持续震荡调整，整体上价值风格相对占优。从行业上看，TMT 板块涨幅领先，主要是人工智能领域主题催化，同时家电亦涨幅居前，得益于基本面改善及较好的估值性价比。此外，受“中特估”概念催化下，建筑、机械等亦有较好的涨幅；相对的，受内需消费不振、地产销售较弱、猪肉价格持续低迷等因素影响，消费、地产和农林牧渔等相关行业跌幅居前。债

市方面，利率在年初小幅调整后震荡下行，体现了市场对于复苏预期重新定价的过程，同时信用修复行情延续，信用利差整体收窄。

报告期内，本基金持续跟踪市场基本面、流动性以及波动率等指标，灵活调整股债仓位和资产内部结构。今年以来权益市场轮动加快，经济恢复预期存在分歧，导致整体市场走势震荡，但考虑到市场波动率已持续下行至历史较低水平，且存量资金博弈下结构性机会仍存，因此我们继续保持相对较高的权益仓位，更加重视组合配置结构调整的节奏。我们的配置思路还是紧密跟踪市场主流配置方向，在不过度暴露行业和风格偏离风险的情况下，适当偏向景气趋势向好的板块。我们始终坚持顺势而为，力求把握确定性相对较高的投资机会，努力为组合创造超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金（各类）份额净值及业绩表现请见“3.1 主要会计数据和财务指标”及“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”部分披露。

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 2023 年下半年，经济基本面仍面临一定周期性压力，但伴随基数效应叠加稳增长政策效果逐步显现，国内经济或将企稳复苏，我们将关注总量及产业政策的推进。海外方面，美国经济仍有韧性，就业市场依然强劲，且通胀水平距离目标仍有较大距离，需跟踪美国经济数据和美联储加息动态。此外，海外金融风险暴露和地缘政治冲突演化等外围风险事件亦值得关注。股市方面，在政策和经济预期未出现进一步变化前，短期内权益市场走势仍有不确定性。但后续若伴随着国内经济温和复苏，A 股上市公司盈利修复延续，叠加投资者信心逐步回暖，股市微观流动性压力得到缓解。从中长期来看，A 股机会大于风险，其中政策支持对国内经济增长复苏的延续仍较为关键。债市方面，国内政策边际变化和经济修复节奏将成为影响债市的主要因素。在内生动能偏弱、政策温和发力、流动性保持平稳下，债市或呈现震荡的格局。未来的投资操作上，我们会继续严密跟踪市场走势和经济形势，做好组合的风险管理，力争给投资者带来更好的持有体验。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人制定了健全、有效的估值政策和程序，经公司管理层批准后实行，并成立了估值委员会，估值委员会成员由研究部、基金运营部、风险管理部等人员和固定收益人员及基金经理组成。

公司严格按照新会计准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定进行估值，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。估值委员会的研究部成员按投资品种的不同性质，研究并参考市场普遍认同的做法，建议合理的估值模型，进行测算和认证，认可后交各估值委员会成员从基金会计、风险、合规等方面审批，一致同意后，报公司投资总监、总经理审批。

估值委员会会定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及应用性的情况后，及时召开临时会议进行研究，及时修订估值方法，以保证其持续适用。估值委员会成员均具备相应的专业资格及工作经验。基金经理作为估值委员会成员，对本基金持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的职业敏感，向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论。本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突，截止报告期末未有与任何外部估值定价服务机构签约。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内无需预警说明。

§ 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

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对交银施罗德养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金（FOF）2023 年上半年的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，交银施罗德基金管理有限公司在交银施罗德养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金（FOF）的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，交银施罗德基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的 2023 年中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：交银施罗德养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金 (F0F)

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	8,776,752.98	25,869,683.37
结算备付金		1,654,583.51	-
存出保证金		83,628.40	3,654.12
交易性金融资产	6.4.7.2	553,876,261.22	931,862,618.57
其中：股票投资		45,894,804.13	74,403,577.31
基金投资		479,496,381.50	812,212,283.72
债券投资		28,485,075.59	45,246,757.54
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	1,999,581.37	-
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		627.95	-
应收股利		1,038.59	2,502.97
应收申购款		229,989.65	2,780,825.03
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	25,026.34	26,898.10
资产总计		566,647,490.01	960,546,182.16
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负债：			
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		13,949,640.77	-

应付管理人报酬		195,931.88	388,660.73
应付托管费		80,039.61	158,295.64
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,878.61	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	470,613.73	274,308.27
负债合计		14,698,104.60	821,264.64
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	461,116,119.50	794,998,543.14
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	90,833,265.91	164,726,374.38
净资产合计		551,949,385.41	959,724,917.52
负债和净资产总计		566,647,490.01	960,546,182.16

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 461,116,119.50 份，其中交银养老 2035 三年 A 基金份额总额 427,370,468.75 份，基金份额净值 1.1968 元；交银养老 2035 三年 Y 基金份额总额 33,745,650.75 份，基金份额净值 1.1993 元。

6.2 利润表

会计主体：交银施罗德养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金 (FOF)

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-5,996,212.20	-42,549,064.96
1. 利息收入		98,189.71	142,175.14
其中：存款利息收入	6.4.7.13	64,824.30	142,175.14
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		33,365.41	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-48,060,166.93	1,179,691.08
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-5,028,313.72	806,373.82
基金投资收益	6.4.7.15	-43,845,328.63	-12,420,621.27
债券投资收益	6.4.7.16	-117,882.71	418,074.27

资产支持证券投资收益	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	931,358.13	12,375,864.26
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	41,787,362.25	-43,927,960.07
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	178,402.77	57,028.89
减：二、营业总支出		2,929,963.25	3,844,035.64
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,038,486.00	2,782,792.58
2. 托管费	6.4.10.2.2	796,557.43	961,378.15
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		460.27	-
其中：卖出回购金融资产支出		460.27	-
6. 信用减值损失	6.4.7.24	-	-
7. 税金及附加		379.99	0.26
8. 其他费用	6.4.7.25	94,079.56	99,864.65
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-8,926,175.45	-46,393,100.60
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-8,926,175.45	-46,393,100.60
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-8,926,175.45	-46,393,100.60

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：交银施罗德养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金（FOF）

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产(基金净值)	794,998,543.14	-	164,726,374.38	959,724,917.52
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	794,998,543.14	-	164,726,374.38	959,724,917.52
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	- 333,882,423.64	-	-73,893,108.47	-407,775,532.11
(一)、综合收益总额	-	-	-8,926,175.45	-8,926,175.45
(二)、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)	- 333,882,423.64	-	-64,966,933.02	-398,849,356.66
其中：1. 基金申购款	23,166,566.58	-	5,273,817.92	28,440,384.50
2. 基金赎回款	- 357,048,990.22	-	-70,240,750.94	-427,289,741.16
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	461,116,119.50	-	90,833,265.91	551,949,385.41
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	776,645,577.66	-	273,498,699.36	1,050,144,277.02
加：会计政策变更	-	-	-	-

前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	776,645,577.66	-	273,498,699.36	1,050,144,277.02
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	3,142,311.26	-	-45,560,729.15	-42,418,417.89
(一)、综合收益总额	-	-	-46,393,100.60	-46,393,100.60
(二)、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)	3,142,311.26	-	832,371.45	3,974,682.71
其中：1. 基金申购款	3,142,311.26	-	832,371.45	3,974,682.71
2. 基金赎回款	-	-	-	-
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	779,787,888.92	-	227,937,970.21	1,007,725,859.13

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：

谢卫

基金管理人负责人

印皓

主管会计工作负责人

单江

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

交银施罗德养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金 (F0F) (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[2019]2546号《关于准予交银施罗德养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金(FOF)注册的批复》注册,由交银施罗德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《交银施罗德养老目标日期 2035 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,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 632,796,182.59 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 0217 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《交银施罗德养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金(FOF)基金合同》于 2020 年 4 月 29 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 633,153,686.13 份基金份额,其中认购资金利息折合 357,503.54 份基金份额。本基金的基金管理人为交银施罗德基金管理有限公司,基金托管人为中信银行股份有限公司。

根据《交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德养老目标日期 2035 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和托管协议的公告》,本基金自 2022 年 11 月 11 日起增加 Y 类份额,并对本基金的基金合同、托管协议作相应修改。非针对个人养老金投资基金业务设立的基金份额,称为 A 类基金份额;针对个人养老金投资基金业务设立的基金份额,称为 Y 类基金份额。

基金份额持有人持有的每份基金份额最短持有期限为三年,在最短持有期限内该份基金份额不可赎回,自最短持有期限的下一工作日起(含该日)可赎回。对于每笔认购的基金份额而言,最短持有期限自基金合同生效之日起(含该日)至三年后的年度对日的前一日;对于每笔申购的基金份额而言,最短持有期限自该笔申购份额确认日(含该日,通常 T 日提交的有效申购申请于 T+3 日确认)至三年后的年度对日的前一日。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《交银施罗德养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金(FOF)基金合同》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(含 ETF 和 LOF、香港互认基金、QDII)、国内依法发行上市的股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证)、港股通标的股票、债券(含国债、央行票据、金融债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、企业债券、公司债券、可转换债券(含可分离交易可转换债券)、可交换债券、次级债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(含协议存款、定期存款及其他银行存款)、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。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。本基金的投资组合比例为:本基金投资于公开募集证券投资基

金的基金份额的资产不低于本基金资产的 80%，其中投资于股票(含存托凭证)、股票型基金(包括股票指数基金)、混合型基金和商品基金(含商品期货基金和黄金 ETF)等品种的比例合计占基金资产的 0%-60%；投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%；本基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×X+中债综合全价指数收益率×(1-X)。

其中 X 的取值如下表列示：

年份 X 的取值

基金合同生效之日至 2020. 12. 31 53%

2021. 1. 1-2023. 12. 31 46%

2024. 1. 1-2026. 12. 31 39%

2027. 1. 1-2029. 12. 31 35%

2030. 1. 1-2032. 12. 31 32%

2033. 1. 1-2035. 12. 31 29%

本财务报表由本基金的基金管理人交银施罗德基金管理有限公司于 2023 年 8 月 30 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)以及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年上半年度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 2023 年 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年上半年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	8,776,752.98
等于：本金	8,775,537.00
加：应计利息	1,215.98
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	8,776,752.98

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	45,130,439.17	-	45,894,804.13	764,364.96	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	28,026,200.00	422,675.59	28,485,075.59	36,200.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	28,026,200.00	422,675.59	28,485,075.59	36,200.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	491,755,263.02	-	479,496,381.50	12,258,881.52	
其他	-	-	-	-	
合计	564,911,902.19	422,675.59	553,876,261.22	11,458,316.56	

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

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	1,999,581.37	-
银行间市场	-	-
合计	1,999,581.37	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

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

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

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

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应收利息	-
其他应收款	25,026.34
待摊费用	-
合计	25,026.34

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023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	381,811.17
其中：交易所市场	381,811.17
银行间市场	-
应付利息	-
预提审计费	24,795.19
预提信息披露费	59,507.37
预提账户维护费	4,500.00
合计	470,613.73

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

交银养老 2035 三年 A

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	782,378,515.21	782,378,515.21
本期申购	2,040,943.76	2,040,943.76
本期赎回(以“-”号填列)	-357,048,990.22	-357,048,990.22
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	427,370,468.75	427,370,468.75

交银养老 2035 三年 Y

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	12,620,027.93	12,620,027.93
本期申购	21,125,622.82	21,125,622.82
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	33,745,650.75	33,745,650.75

注：1、如果本报告期间发生红利再投、转换入业务，则总申购份额中包含该业务；

2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

交银养老 2035 三年 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	200,869,841.44	-38,764,431.60	162,105,409.84
本期利润	-48,605,619.33	40,393,769.53	-8,211,849.80
本期基金份额交易产生的变动数	-75,583,983.37	5,799,340.18	-69,784,643.19
其中：基金申购款	464,730.07	-8,622.32	456,107.75
基金赎回款	-76,048,713.44	5,807,962.50	-70,240,750.94
本期已分配利润	-	-	-
本期末	76,680,238.74	7,428,678.11	84,108,916.85

交银养老 2035 三年 Y

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,233,948.12	-612,983.58	2,620,964.54
本期利润	-2,107,918.37	1,393,592.72	-714,325.65
本期基金份额交易产生的变动数	4,976,646.58	-158,936.41	4,817,710.17
其中：基金申购款	4,976,646.58	-158,936.41	4,817,710.17
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,102,676.33	621,672.73	6,724,349.06

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	57,317.30
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	7,085.52
其他	421.48
合计	64,824.30

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

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-5,028,313.72
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	-5,028,313.72

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	415,868,350.75
减：卖出股票成本总额	419,672,162.23
减：交易费用	1,224,502.24
买卖股票差价收入	-5,028,313.72

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	792,707,831.45
减：卖出/赎回基金成本总额	836,102,739.11
减：买卖基金差价收入应缴纳增	1,574.90

值税额	
减：交易费用	448,846.07
基金投资收益	-43,845,328.63

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 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	461,018.34
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付)差价收入	-578,901.05
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	-117,882.71

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 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额	42,843,146.26
减：卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	43,107,945.80
减：应计利息总额	312,046.53
减：交易费用	2,054.98
买卖债券差价收入	-578,901.05

6.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

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

无。

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

无。

6.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

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

无。

6.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

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

无。

6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	591,507.27
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	339,850.86
合计	931,358.13

6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	41,787,362.25
股票投资	2,675,293.02
债券投资	33,200.00
资产支持证券投资	-
基金投资	39,078,869.23
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	41,787,362.25

6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	-
销售服务费返还	178,402.77
合计	178,402.77

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的不低于赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.23 持有基金产生的费用

项目	本期费用 2023年1月1日至2023年6月30日
当期持有基金产生的应支付销售服务费(元)	745,652.65
当期持有基金产生的应支付管理费(元)	3,481,952.63
当期持有基金产生的应支付托管费(元)	708,185.53

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

无。

6.4.7.25 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023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	-
银行费用	777.00
债券账户费用	9,000.00
合计	94,079.56

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

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期内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
交银施罗德基金管理有限公司（“交银施罗德基金公司”）	基金管理人、基金销售机构
中信银行股份有限公司（“中信银行”）	基金托管人、基金销售机构
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金管理人的股东、基金销售机构
施罗德投资管理有限公司	基金管理人的股东
中国国际海运集装箱(集团)股份有限公司	基金管理人的股东
交银施罗德资产管理有限公司	基金管理人的子公司

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。

本报告期实际与基金发生关联交易的关联方及关联交易具体情况请见下述内容。

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

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 基金交易

无。

6.4.10.1.5 权证交易

无。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

无。

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,038,486.00	2,782,792.58
其中：支付销售机构的客户维护 费	779,701.99	1,052,309.55

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。支付基金管理人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约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。A 类基金份额和 Y 类基金份额约定的年管理费率分别为 0.8% 和 0.4%。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日 A/Y 类基金份额的基金资产净值扣除该类基金份额持有的基金管理人管理的其他基金部分后的余额 × 约定年费率 / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	796,557.43	961,378.15

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。支付基金托管人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约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。A 类基金份额和 Y 类基金份额约定的年托管费率分别为 0.2% 和 0.1%。其计算公式为：

日托管人报酬 = 前一日 A/Y 类基金份额的基金资产净值扣除该类基金份额持有的基金托管人托管的其他基金部分后的余额 × 约定年费率 / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

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**

无。

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

无。

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自有资金投资本基金的情况

无。

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

无。

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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信银行_活期存款	8,776,752.98	57,317.30	52,489,543.82	141,989.43

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，存款利率参考银行同业利率及银行存款利率确定。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

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 2023 年 06 月 30 日，本基金持有基金管理人所管理的公开募集证券投资基金合计 247,002,259.37 元，占本基金资产净值的比例为 44.75%。

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 2023年1月1日至2023年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022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）	45,786.01	-
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	178,266.46	58,224.94
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	1,662,137.15	1,379,581.48
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	339,534.48	280,189.60
当期交易基金产生的交易费（元）	-	-

当期交易基金产生的转换费 (元)	25,687.66	27,671.80
---------------------	-----------	-----------

注：本基金申购、赎回本基金的基金管理人管理的其他基金(ETF 除外)，应当通过基金管理人的直销渠道且不得收取申购费、赎回费(按规定应当收取并记入被投资基金其他收入部分的赎回费除外)、销售服务费等销售费用。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为零，当期交易基金产生的赎回费仅为按规定应当收取并记入被投资基金其他收入部分的赎回费。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

无。

6.4.12 期末(2023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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001282	三联锻造	2023年5月15日	6个月以上	限售股	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-
001286	陕西能源	2023年3月31日	6个月以上	限售股	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
001287	中电港	2023年3月30日	6个月以上	限售股	11.88	21.02	1,173	13,935.24	24,656.46	-
001328	登康口腔	2023年3月29日	6个月以上	限售股	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-
001360	南矿集团	2023年3月31日	6个月以上	限售股	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-

001367	海森药业	2023年3月30日	6个月以上	限售股	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
301157	华塑科技	2023年3月1日	6个月以上	限售股	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
301203	国泰环保	2023年3月28日	6个月以上	限售股	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	-
301281	科源制药	2023年3月28日	6个月以上	限售股	44.18	25.10	241	10,647.38	6,049.10	-
301281	科源制药	2023年5月26日	1-6个月(含)	限售股送股	-	25.10	96	-	2,409.60	-
301293	三博脑科	2023年4月25日	6个月以上	限售股	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-
301305	朗坤环境	2023年5月15日	6个月以上	限售股	25.25	19.69	753	19,013.25	14,826.57	-
301307	美利信	2023年4月14日	6个月以上	限售股	32.34	31.86	687	22,217.58	21,887.82	-
301310	鑫宏业	2023年5月26日	6个月以上	限售股	67.28	65.43	409	27,517.52	26,760.87	-
301322	绿通科技	2023年2月27日	6个月以上	限售股	131.11	53.24	261	34,219.71	13,895.64	-
301322	绿通科技	2023年5月25日	1-6个月(含)	限售股送股	-	53.24	130	-	6,921.20	-
301325	曼恩斯特	2023年5月4日	6个月以上	限售股	76.80	107.95	364	27,955.20	39,293.80	-
301332	德尔玛	2023年5月9日	6个月以上	限售股	14.81	13.73	1,122	16,616.82	15,405.06	-
301337	亚华电子	2023年5月16日	6个月以上	限售股	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-
301345	C 涛涛	2023年3月10日	6个月以上	限售股	73.45	46.64	266	19,537.70	12,406.24	-
301360	荣旗科技	2023年4月17日	6个月以上	限售股	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	-

		日								
301382	蜂助手	2023 年 5 月 9 日	6 个月 以上	限售股	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72	-
301387	光大同 创	2023 年 4 月 10 日	6 个月 以上	限售股	58.32	45.36	307	17,904.24	13,925.52	-
301399	英特科 技	2023 年 5 月 16 日	6 个月 以上	限售股	43.99	51.57	293	12,889.07	15,110.01	-
301429	森泰股 份	2023 年 4 月 10 日	6 个月 以上	限售股	28.75	21.02	499	14,346.25	10,488.98	-
301439	泓淋电 力	2023 年 3 月 10 日	6 个月 以上	限售股	19.99	16.90	949	18,970.51	16,038.10	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券 代码	证券 名称	成功 认购日	受限期	流通受 限类型	认购 价格	期末估 值单价	数量 (单 位： 张)	期末 成本总额	期末估值 总额	备注
127087	星帅转 2	2023 年 6 月 14 日	1-6 个 月 (含)	老股东 配债	100.00	100.01	513	51,300.00	51,305.73	-

注：1、基金可作为特定投资者，参与上市公司非公开发行股份认购，交易所主板、创业板、科创板新股申购，通过大宗交易或其他符合法律法规的交易方式取得带限售期的股票等业务，并根据各项法律法规的要求进行锁定

2、上表所披露的受限期指自该证券实际取得之日起至可流通日之间的受限期限。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金中基金，由于本基金主要投资于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。本基金的预期风险与预期收益高于债券型基金、债券型基金中基金、货币市场基金和货币型基金中基金，低于股票型基金和股票型基金中基金。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（含 ETF 和 LOF、香港互认基金、QDII）、国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票、债券（含国债、央行票据、金融债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、企业债券、公司债券、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换债券、次级债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（含协议存款、定期存款及其他银行存款）、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。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。本基金可投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。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，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，在控制风险并保持基金资产良好的流动性的前提下，依照下滑曲线进行大类资产配置，力争实现养老资产的长期稳健增值，满足养老资金理财需求。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立合规审核及风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由风险管理部负责协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。风险管理部对公司总经理负责。督察长独立行使督察权利，直接对董事会负责，就内部控制制度和执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能，定期和不定期地向董事会报告公司内部控制执行情况。

本基金的基金管理人建立了以合规审核及风险管理委员会为核心的，由督察长、风险控制委员会、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

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产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工

具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中信银行股份有限公司，因而与该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，在场外申赎基金份额均通过该基金的基金管理人的直销柜台办理，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 2023 年 6 月 30 日，本基金持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.0093%（2022 年 12 月 31 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）。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

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）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 2023 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)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。

注：流动性受限资产、7 个工作日可变现资产的计算口径见《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》第四十条。

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》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）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时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金持有单只基金的市值，不高于本基金资产净值的 20%，且不持有其他基金中基金。本基金的基金管理人管理的全部基金中基金持有单只基金 (ETF 联接基金除外) 不超过被投资基金净资产的 20%，被投资基金净资产规模以最近定期报告披露的规模为准。本基金投资于一家公司发行的证券 (不含本基金所投资的基金份额) 市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券 (不含本基金所投资的基金份额) 不得超过该证券的 10%。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该比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在基金销售机构申购、赎回，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产

方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。在本基金开放日，本基金投资于流通受限基金不高于本基金资产净值的 10%；本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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。

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、买入返售金融资产及应收申购款等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	8,776,752.98	-	-	-	8,776,752.98
结算备付金	1,654,583.51	-	-	-	1,654,583.51
存出保证金	83,628.40	-	-	-	83,628.40

交易性金融资产	28,433,769.86	-	51,305.73	525,391,185.63	553,876,261.22
买入返售金融资产	1,999,581.37	-	-	-	1,999,581.37
应收股利	-	-	-	1,038.59	1,038.59
应收申购款	250.04	-	-	229,739.61	229,989.65
应收清算款	-	-	-	627.95	627.95
其他资产	-	-	-	25,026.34	25,026.34
资产总计	40,948,566.16	-	51,305.73	525,647,618.12	566,647,490.01
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	13,949,640.77	13,949,640.77
应付管理人报酬	-	-	-	195,931.88	195,931.88
应付托管费	-	-	-	80,039.61	80,039.61
应交税费	-	-	-	1,878.61	1,878.61
其他负债	-	-	-	470,613.73	470,613.73
负债总计	-	-	-	14,698,104.60	14,698,104.60
利率敏感度缺口	40,948,566.16	-	51,305.73	510,949,513.52	551,949,385.41
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	25,869,683.37	-	-	-	25,869,683.37
存出保证金	3,654.12	-	-	-	3,654.12
交易性金融资产	45,246,757.54	-	-	886,615,861.03	931,862,618.57
应收股利	-	-	-	2,502.97	2,502.97
应收申购款	250.14	-	-	2,780,574.89	2,780,825.03
其他资产	-	-	-	26,898.10	26,898.10
资产总计	71,120,345.17	-	-	889,425,836.99	960,546,182.16
负债	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	388,660.73	388,660.73
应付托管费	-	-	-	158,295.64	158,295.64
其他负债	-	-	-	274,308.27	274,308.27
负债总计	-	-	-	821,264.64	821,264.64
利率敏感度缺口	71,120,345.17	-	-	888,604,572.35	959,724,917.52

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2023 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 5.16%(2022 年 12 月 31 日：4.69%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2022 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。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。

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，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的其他价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中：本基金投资于公开募集证券投资基金的基金份额的资产不低于本基金资产的 80%，其中投资于股票（含存托凭证）、股票型基金（包括股票指数基金）、混合型基金和商品基金（含商品期货基金和黄金 ETF）等品种的比例合计占基金资产的 0%-60%；投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%。本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。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 2023年6月30日		上年度末 2022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	45,894,804.13	8.32	74,403,577.31	7.75
交易性金融资产—基金投资	479,496,381.50	86.87	812,212,283.72	84.63
交易性金融资产—债券投资	51,305.73	0.01	—	—
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	525,442,491.36	95.20	886,615,861.03	92.38

注：债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

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影响金额(单位:人民币元)	
		本期末(2023年6月30日)	上年度末(2022年12月31日)
	1. 业绩比较基准上涨 5%	26,715,013.02	47,604,252.05
	2. 业绩比较基准下降 5%	-26,715,013.02	-47,604,252.05

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。”常见的各层次金融工具举例如下，第一层次：如以活跃市场报价估值的股票投资、股指期货投资、国债期货投资、每日开放申赎/买卖的基金投资等；第二层次：如因新发/增发尚未上市交易而按发行价格/增发价格估值的不限售的股票投资、债券投资等，使用第三方基准服务机构提供的报价估值的在交易所市场或银行间同业市场交易的债券投资、资产支持证券投资等；第三层次：如使用亚式期权模型计算流动性折扣进行估值的尚处于限售期的股票投资，以及违约债、非指数收益法估值的长期停牌的股票等估值模型中使用不可观察输入值的投资等。

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 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日

第一层次	525,031,380.28	885,816,486.52
第二层次	28,485,075.59	45,246,757.54
第三层次	359,805.35	799,374.51
合计	553,876,261.22	931,862,618.57

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

无。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 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	45,894,804.13	8.10
	其中：股票	45,894,804.13	8.10
2	基金投资	479,496,381.50	84.62
3	固定收益投资	28,485,075.59	5.03
	其中：债券	28,485,075.59	5.03
	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	1,999,581.37	0.35
	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	10,431,336.49	1.84
8	其他各项资产	340,310.93	0.06
9	合计	566,647,490.01	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	2,096,016.00	0.38
B	采矿业	955,044.00	0.17
C	制造业	33,959,064.21	6.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,080,390.47	0.20
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,534,529.46	0.28
G	交通运输、仓储和邮政业	3,449,890.00	0.63
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	20,444.56	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,424,593.00	0.26
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	753,596.00	0.14
N	水利、环境和公共设施管理业	597,453.57	0.11
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	23,782.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	45,894,804.13	8.32

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

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	300680	隆盛科技	48,600	1,208,682.00	0.22
2	002478	常宝股份	161,900	1,206,155.00	0.22
3	603518	锦泓集团	105,200	1,194,020.00	0.22
4	600748	上实发展	291,500	1,151,425.00	0.21
5	300511	雪榕生物	151,000	1,147,600.00	0.21
6	600717	天津港	248,900	1,102,627.00	0.20
7	600125	铁龙物流	181,700	1,097,468.00	0.20

8	002997	瑞鹄模具	36,400	1,082,172.00	0.20
9	688517	金冠电气	48,500	1,065,060.00	0.19
10	600461	洪城环境	127,900	1,044,943.00	0.19
11	000589	贵州轮胎	183,900	1,029,840.00	0.19
12	000552	靖远煤电	286,800	955,044.00	0.17
13	300970	华绿生物	40,600	948,416.00	0.17
14	002582	好想你	117,900	920,799.00	0.17
15	003011	海象新材	27,200	877,200.00	0.16
16	603507	振江股份	20,600	746,956.00	0.14
17	002641	公元股份	131,400	741,096.00	0.13
18	600858	银座股份	122,100	737,484.00	0.13
19	601188	龙江交通	204,700	687,792.00	0.12
20	603109	神驰机电	36,400	649,740.00	0.12
21	300092	科新机电	39,100	641,240.00	0.12
22	002283	天润工业	98,700	633,654.00	0.11
23	301006	迈拓股份	24,000	627,600.00	0.11
24	002483	润邦股份	99,500	577,100.00	0.10
25	301011	华立科技	24,510	574,269.30	0.10
26	002108	沧州明珠	122,300	554,019.00	0.10
27	002284	亚太股份	59,800	536,406.00	0.10
28	002327	富安娜	63,700	536,354.00	0.10
29	605128	上海沿浦	12,900	522,579.00	0.09
30	603324	盛剑环境	13,400	505,180.00	0.09
31	000417	合肥百货	103,400	483,912.00	0.09
32	002860	星帅尔	34,000	458,320.00	0.08
33	301181	标榜股份	15,160	456,164.40	0.08
34	688156	路德环境	14,900	427,183.00	0.08
35	300838	浙江力诺	23,100	422,037.00	0.08
36	300796	贝斯美	33,860	407,335.80	0.07
37	300839	博汇股份	30,460	404,813.40	0.07
38	301063	海锅股份	14,500	403,970.00	0.07
39	600794	保税科技	114,400	402,688.00	0.07
40	002952	亚世光电	22,500	398,925.00	0.07
41	605167	利柏特	41,200	398,816.00	0.07
42	603112	华翔股份	33,900	398,664.00	0.07
43	603856	东宏股份	28,800	379,872.00	0.07
44	300881	盛德鑫泰	11,220	369,699.00	0.07
45	300690	双一科技	23,100	368,907.00	0.07
46	002674	兴业科技	29,700	366,795.00	0.07
47	300019	硅宝科技	21,500	366,575.00	0.07
48	000055	方大集团	73,900	365,805.00	0.07
49	002160	常铝股份	90,400	365,216.00	0.07
50	300547	川环科技	21,800	363,406.00	0.07

51	300938	信测标准	8,100	354,780.00	0.06
52	605218	伟时电子	22,600	350,300.00	0.06
53	605088	冠盛股份	20,300	348,145.00	0.06
54	300791	仙乐健康	11,600	336,864.00	0.06
55	688558	国盛智科	9,400	336,144.00	0.06
56	300893	松原股份	13,000	334,490.00	0.06
57	688338	赛科希德	5,800	321,610.00	0.06
58	603111	康尼机电	64,100	319,859.00	0.06
59	605388	均瑶健康	24,800	315,208.00	0.06
60	603180	金牌厨柜	9,400	315,088.00	0.06
61	605060	联德股份	11,300	310,298.00	0.06
62	300652	雷迪克	13,500	307,395.00	0.06
63	002724	海洋王	34,200	296,856.00	0.05
64	600628	新世界	39,900	288,477.00	0.05
65	300632	光莆股份	22,100	282,438.00	0.05
66	301310	鑫宏业	4,089	280,239.27	0.05
67	300871	回盛生物	16,800	276,864.00	0.05
68	003033	征和工业	7,800	273,780.00	0.05
69	000541	佛山照明	47,900	273,509.00	0.05
70	000608	阳光股份	100,800	273,168.00	0.05
71	002398	垒知集团	47,500	270,750.00	0.05
72	300371	汇中股份	20,400	267,240.00	0.05
73	605068	明新旭腾	10,500	256,830.00	0.05
74	605166	聚合顺	27,200	253,504.00	0.05
75	688021	奥福环保	9,300	241,056.00	0.04
76	603657	春光科技	13,300	233,415.00	0.04
77	300305	裕兴股份	21,500	232,200.00	0.04
78	603303	得邦照明	16,200	223,722.00	0.04
79	300817	双飞股份	14,880	222,456.00	0.04
80	301189	奥尼电子	7,000	214,130.00	0.04
81	688093	世华科技	10,600	212,636.00	0.04
82	688155	先惠技术	3,900	211,614.00	0.04
83	300837	浙矿股份	5,500	211,200.00	0.04
84	301092	争光股份	7,900	206,822.00	0.04
85	605189	富春染织	12,360	202,827.60	0.04
86	688312	燕麦科技	10,300	199,923.00	0.04
87	688015	交控科技	11,200	195,664.00	0.04
88	300927	江天化学	11,900	194,803.00	0.04
89	300107	建新股份	39,200	191,688.00	0.03
90	301108	洁雅股份	5,100	184,620.00	0.03
91	301100	风光股份	8,900	183,874.00	0.03
92	605099	共创草坪	8,100	180,873.00	0.03
93	301000	肇民科技	9,540	174,963.60	0.03

94	300915	海融科技	4,300	159,659.00	0.03
95	605050	福然德	12,900	159,315.00	0.03
96	300955	嘉亨家化	7,300	155,490.00	0.03
97	301196	唯科科技	4,400	149,380.00	0.03
98	688466	金科环境	7,400	147,704.00	0.03
99	300920	润阳科技	8,100	139,401.00	0.03
100	301003	江苏博云	6,000	138,660.00	0.03
101	301325	曼恩斯特	364	39,293.80	0.01
102	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.01
103	001287	中电港	1,173	24,656.46	0.00
104	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
105	301307	美利信	687	21,887.82	0.00
106	301322	绿通科技	391	20,816.84	0.00
107	301377	鼎泰高科	770	17,710.00	0.00
108	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
109	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
110	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
111	301305	朗坤环境	753	14,826.57	0.00
112	301387	光大同创	307	13,925.52	0.00
113	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
114	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
115	301345	C 涛涛	266	12,406.24	0.00
116	301290	东星医疗	330	10,576.50	0.00
117	301429	森泰股份	499	10,488.98	0.00
118	301265	华新环保	819	9,516.78	0.00
119	301281	科源制药	337	8,458.70	0.00
120	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
121	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
122	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
123	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
124	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
125	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
126	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00

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	002466	天齐锂业	5,363,536.00	0.56
2	603259	药明康德	5,340,705.00	0.56
3	601668	中国建筑	4,469,585.00	0.47
4	000001	平安银行	4,376,448.00	0.46
5	002352	顺丰控股	4,171,868.00	0.43

6	002179	中航光电	4,022,715.00	0.42
7	000878	云南铜业	3,899,243.00	0.41
8	600583	海油工程	3,699,617.00	0.39
9	000568	泸州老窖	3,383,828.55	0.35
10	600919	江苏银行	3,286,614.00	0.34
11	002714	牧原股份	3,262,859.00	0.34
12	300748	金力永磁	3,176,478.00	0.33
13	600519	贵州茅台	3,144,600.00	0.33
14	601012	隆基绿能	3,096,713.00	0.32
15	600438	通威股份	3,081,159.00	0.32
16	601069	西部黄金	2,998,326.00	0.31
17	300750	宁德时代	2,993,654.60	0.31
18	002459	晶澳科技	2,967,375.00	0.31
19	002049	紫光国微	2,962,883.80	0.31
20	601166	兴业银行	2,925,279.00	0.30

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 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	11,800,170.51	1.23
2	000568	泸州老窖	6,392,392.63	0.67
3	002714	牧原股份	6,187,236.00	0.64
4	601668	中国建筑	6,041,390.00	0.63
5	603259	药明康德	5,537,492.00	0.58
6	002466	天齐锂业	5,127,678.00	0.53
7	600919	江苏银行	4,893,402.00	0.51
8	000001	平安银行	4,828,302.00	0.50
9	002352	顺丰控股	4,685,934.00	0.49
10	002594	比亚迪	4,281,530.00	0.45
11	601166	兴业银行	4,103,497.19	0.43
12	002179	中航光电	4,036,076.10	0.42
13	601012	隆基绿能	4,007,149.00	0.42
14	000878	云南铜业	3,758,139.00	0.39
15	600583	海油工程	3,275,553.00	0.34
16	300124	汇川技术	3,274,343.00	0.34
17	601857	中国石油	3,266,685.00	0.34
18	002920	德赛西威	3,221,775.00	0.34
19	600256	广汇能源	3,184,283.00	0.33
20	000858	五粮液	3,172,933.00	0.33

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。

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	388,488,096.03
卖出股票收入（成交）总额	415,868,350.75

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”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	11,221,591.23	2.03
2	央行票据	-	-
3	金融债券	17,212,178.63	3.12
	其中：政策性金融债	17,212,178.63	3.12
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）	51,305.73	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	28,485,075.59	5.16

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	018065	进出 2201	170,000	17,212,178.63	3.12
2	019663	21 国债 15	110,000	11,221,591.23	2.03
3	127087	星帅转 2	513	51,305.73	0.01

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

无。

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

无。

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

无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

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

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 本报告期投资基金情况

7.12.1 投资政策及风险说明

基于本基金管理人绩效评估系统对备选基金的评估分析，在有效控制风险的前提下，通过定量和定性相结合的方法，精选具有不同风险收益特征及投资业绩比较优势的基金确定本基金配置组合。本基金的绩效评估系统分析主要包括业绩指标分析、业绩归因分析以及基金管理人综合评估等。

运用量化方法分析所有适选基金在不同市场下的历史业绩表现，包括收益指标、风险指标和风险调整后收益指标等，具体如下：收益指标：包括绝对收益、相对收益等指标；风险指标：包括波动率、最大回撤等指标；风险调整后收益指标：包括夏普比率、信息比率等指标。

深入分析基金的业绩表现，再次精选基金确定备选基金，包括对基金的择时能力、资产配置能力、个股选择能力等进行归因分析，解释基金收益来源，评估未来收益的持续性与稳定性。基于市场环境、政策变动、风险事件等多重因素对基金配置组合进行持续跟踪，动态调整基金投资组合及配置比例。

结合对基金管理人的定性评估，包括基金管理人基本情况、投研团队实力以及投研团队稳定性、基金经理投资优势及业绩稳定性方面，被投资基金运作合规，风格清晰，中长期收益良好，业绩波动性较低，根据定性评估分析结果，最终确定本基金的投资组合及配置比例。

本基金通过定量和定性相结合的方法，长期持续跟踪本基金的组合业绩，并定期对基金组合进行维护，力争实现基金资产的长期稳健增值。

报告期内，本基金主要投资于开放式基金，符合基金合同约定的投资政策、投资限制等要求

7.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	519680	交银增	契约	55,000,000.00	56,248,500.00	10.19	是

		利债券 A/B	型开 放式				
2	519732	交银定 期支付 双息平 衡混合	契约 型开 放式	5,898,014.89	29,442,890.33	5.33	是
3	005578	交银丰 晟收益 债券 C	契约 型开 放式	25,515,121.76	29,194,402.32	5.29	是
4	531017	建信双 息红利 债券 C	契约 型开 放式	25,000,000.00	26,925,000.00	4.88	否
5	008204	交银稳 利中短 债债券 A	契约 型开 放式	24,000,000.00	26,731,200.00	4.84	是
6	519773	交银数 据产业 灵活配 置混合	契约 型开 放式	11,217,662.85	23,448,280.66	4.25	是
7	011321	国泰大 健康股 票 C	契约 型开 放式	7,500,000.00	21,457,500.00	3.89	否
8	001752	华商信 用增强 债券 C	契约 型开 放式	15,000,000.00	20,895,000.00	3.79	否
9	519772	交银新 生活力 灵活配 置混合	契约 型开 放式	8,508,951.26	18,923,907.60	3.43	是
10	015779	景顺长 城价值 边际灵 活配置 混合 C	契约 型开 放式	13,094,776.34	17,537,833.95	3.18	否
11	519704	交银先	契约	4,000,000.00	16,762,400.00	3.04	是

		进制造混合	型开放式				
12	360014	光大保德信信用添益债券 C	契约型开放式	15,000,000.00	15,780,000.00	2.86	否
13	009274	融通健康产业灵活配置混合 C	契约型开放式	5,252,610.05	15,778,840.59	2.86	否
14	005577	交银丰晟收益债券 A	契约型开放式	13,341,634.79	15,595,036.91	2.83	是
15	008647	天弘增利短债债券 C	契约型开放式	13,744,235.24	15,012,828.15	2.72	否
16	003823	中信建投轮换混合 C	契约型开放式	6,000,000.00	14,769,000.00	2.68	否
17	007464	交银创业板 50 指数 A	契约型开放式	10,000,000.00	14,630,000.00	2.65	是
18	009300	西部利得中证 500 指数增强 (LOF) C	契约型开放式 (LOF)	9,000,000.00	14,282,100.00	2.59	否
19	017772	大成景阳领先混合 C	契约型开放式	18,280,550.50	13,637,290.67	2.47	否
20	008187	淳厚信睿混合 C	契约型开放式	5,886,372.23	11,209,418.64	2.03	否
21	013882	交银品质	契约	5,940,560.37	10,829,641.55	1.96	是

		质升级混合 C	型开放式				
22	007950	招商量化精选股票 C	契约型开放式	4,431,274.37	10,124,575.68	1.83	否
23	270014	广发货币 B	契约型开放式	10,013,072.58	10,013,072.58	1.81	否
24	015850	农银行业轮动混合 C	契约型开放式	817,773.38	6,281,562.66	1.14	否
25	007509	华商润丰混合 C	契约型开放式	2,817,321.22	6,014,980.80	1.09	否
26	014046	交银医药创新股票 C	契约型开放式	2,000,000.00	5,196,000.00	0.94	是
27	006234	万家汽车新趋势混合 C	契约型开放式	1,500,000.00	4,532,850.00	0.82	否
28	008348	中信建投甄选混合 C	契约型开放式	2,120,894.57	4,232,669.29	0.77	否
29	005151	红土创新优渥货币 B	契约型开放式	4,009,599.12	4,009,599.12	0.73	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、处罚的情形披露如下：

2023 年 1 月 17 日，中国证监会公示证监立案字 0032023002 号行政处罚决定书，给予上海实业发展股份有限公司立案告知书。

本基金管理人对证券投资决策程序的说明如下：本基金管理人对证券投资特别是重仓证券的

投资有严格的投资决策流程控制,对上述主体发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述主体外,本基金投资的前十名证券的其他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

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之外的股票。

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	83,628.40
2	应收清算款	627.95
3	应收股利	1,038.59
4	应收利息	-
5	应收申购款	229,989.65
6	其他应收款	25,026.34
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	340,310.93

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
交银养老2035三年A	7,469	57,219.24	86,318,577.80	20.20	341,051,890.95	79.80
交银养老	6,709	5,029.91	-	-	33,745,650.75	100.00

2035 三年 Y						
合计	14,178	32,523.35	86,318,577.80	18.72	374,797,541.70	81.28

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	交银养老 2035 三年 A	1,456,831.50	0.34
	交银养老 2035 三年 Y	491,289.21	1.46
	合计	1,948,120.71	0.42

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	交银养老 2035 三年 A	-
	交银养老 2035 三年 Y	0~10
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	交银养老 2035 三年 A	-
	交银养老 2035 三年 Y	0~10
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	交银养老 2035 三年 A	交银养老 2035 三年 Y
基金合同生效日 (2020 年 4 月 29 日) 基金份额总额	633,153,686.13	-
本报告期期初基金份额总额	782,378,515.21	12,620,027.93
本报告期基金总申购份额	2,040,943.76	21,125,622.82
减：本报告期基金总赎回份额	357,048,990.22	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	427,370,468.75	33,745,650.75

注：1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；

2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人的重大人事变动：本报告期内，本基金的基金管理人未发生重大人事变动。

2、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动：本报告期内，基金托管人中信银行股份有限公司董事会于 2023 年 4 月 17 日收到董事长、非执行董事朱鹤新先生的辞呈。董事会选举本行党委书记、副董事长、董事方合英先生为本行董事长，将自中国银行业监管机构核准其董事长任职资格之日起正式就任。

基金托管人中信银行股份有限公司董事会于 2023 年 4 月 17 日收到本行行长方合英先生的辞呈。董事会聘任本行党委副书记、董事、常务副行长刘成先生为本行行长，将自中国银行业监管机构核准其行长任职资格之日起正式就任。

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本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

无。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

报告期内，本基金持有的交银施罗德持续成长主题混合型证券投资基金召开基金份额持有人大会审议调整投资范围及修改基金合同有关事项的议案。本基金管理人代表本基金出席上述持有人大会，表决意见为同意。

除上述基金外，本基金持有的其他基金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

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务。

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

基金管理人及其高级管理人员本报告期内未受监管部门稽查或处罚。

10.7.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金托管人及其高级管理人员本报告期内未受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 (%)	
国金证券	3	590,620,461.21	73.79	589,724.33	73.97	-
东吴证券	1	209,793,922.39	26.21	207,553.80	26.03	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	3	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

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 (%)
国金证券	50,924,727.78	74.03	286,000,000.00	77.76	-	-	50,808,838.54	80.68

东吴证券	17,577,849.75	25.55	81,800,000.00	22.24	-	-	12,169,260.00	19.32
安信证券	283,900.00	0.41	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

注：1、报告期内，本基金新增交易单元为长江证券、兴业证券和中金公司，其他交易单元未发生变化；

2、租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：券商基本面评价（财务状况、经营状况）、券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）、券商每日信息评价（及时性和有效性）和券商协作表现评价等四个方面；

3、租用证券公司交易单元的程序：首先根据租用证券公司交易单元的选择标准进行综合评价，然后根据评价选择基金交易单元。研究部提交方案，并上报公司批准。

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	交银施罗德基金管理有限公司关于增加招商证券股份有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2023 年 1 月 6 日
2	交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金（FOF）基金经理变更的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2023 年 1 月 7 日
3	交银施罗德养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金（FOF）（更新）招募说明书（2023 年第 1 号）	中国证监会规定媒体及公司网站	2023 年 1 月 11 日
4	交银施罗德养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金（FOF）（Y 类份额）基金产品资料概要更新（2023 年第 1 号）	中国证监会规定媒体及公司网站	2023 年 1 月 11 日
5	交银施罗德养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金（FOF）（A 类份额）基金产品资料概要更新（2023 年第 1 号）	中国证监会规定媒体及公司网站	2023 年 1 月 11 日
6	交银施罗德养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金（FOF）2022 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒体及公司网站	2023 年 1 月 19 日
7	交银施罗德基金管理有限公司关于增加济安财富（北京）基金销售有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2023 年 2 月 10 日
8	交银施罗德基金管理有限公司关于增加上海浦东发展银行股份有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2023 年 2 月 20 日
9	交银施罗德基金管理有限公司关于增加申万宏源证券有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2023 年 2 月 27 日
10	交银施罗德养老目标日期 2035 三年	中国证监会规定媒体及	2023 年 3 月 30 日

	持有期混合型基金中基金（FOF） 2022 年年度报告	公司网站	
11	交银施罗德养老目标日期 2035 三年 持有期混合型基金中基金（FOF） 2023 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒体及 公司网站	2023 年 4 月 21 日
12	交银施罗德基金管理有限公司关于 交银施罗德养老目标日期 2035 三年 持有期混合型基金中基金（FOF）A 类基金份额开放日常赎回业务的公 告	中国证监会规定媒体及 公司网站	2023 年 4 月 26 日
13	交银施罗德基金管理有限公司关于 增加华西证券股份有限公司为旗下 基金的销售机构的公告	中国证监会规定媒体及 公司网站	2023 年 6 月 7 日
14	交银施罗德基金管理有限公司关于 增加中信证券（山东）有限责任公 司为旗下基金的销售机构的公告	中国证监会规定媒体及 公司网站	2023 年 6 月 15 日
15	交银施罗德基金管理有限公司关于 增加中信证券华南股份有限公司为 旗下基金的销售机构的公告	中国证监会规定媒体及 公司网站	2023 年 6 月 15 日
16	交银施罗德基金管理有限公司关于 旗下部分基金参与招商银行股份有 限公司费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒体及 公司网站	2023 年 6 月 19 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

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、中国证监会准予交银施罗德养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金（FOF）募集注册的文件；

2、《交银施罗德养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》；

3、《交银施罗德养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金（FOF）招募说明书》；

4、《交银施罗德养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金（FOF）托管协议》；

5、关于申请募集注册交银施罗德养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金（FOF）的法律意见书；

- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、报告期内交银施罗德养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金（FOF）在指定报刊上各项公告的原稿。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可在办公时间内至基金管理人的办公场所免费查阅备查文件，或者登录基金管理人的网站(www.fund001.com)查阅。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人交银施罗德基金管理有限公司。本公司客户服务中心电话：400-700-5000（免长途话费），021-61055000，电子邮件：services@jysld.com。