

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）
2023 年第 3 季度报告

2023 年 9 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：中国民生银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 10 月 25 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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 10 月 24 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 7 月 1 日起至 2023 年 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	浦银安盛颐享稳健养老一年混合（FOF）
基金主代码	012167
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 12 月 9 日
报告期末基金份额总额	963,522,085.27 份
投资目标	本基金将运用主动资产配置和精选基金的投资方法进行投资，在通过 VaR 和风险预算模型控制整体波动率的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金结合大类资产配置和基金优选模型，灵活配置大类资产组建基金投资组合，从而实现基金资产在长时间内保值增值的目的。通过对全球、国内的宏观经济、金融市场的深入研究，形成对权益、固收等各大类资产的投资观点，进一步应用资产配置的量化模型（Black-Litterman 模型）确定其组合权重，实现基金资产在大类资产间的有效配置。同时，通过独创的量化基金优选模型来筛选基金，获取大类资产内部的 Alpha，最终实现基金资产在长时间内保值增值的目的。
业绩比较基准	中证债券型基金指数收益率×80%+中证股票型基金指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为基金中基金，由于本基金主要投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金的基金份额，持有基金的预期风险和预期收益间接成为本基金的预期风险和预期收益。本基金以风险控制为产品主要导向，属于目标风险策略基金中风险收益特征相对稳健的

	基金。本基金长期平均风险和预期收益率低于股票型基金，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	中国民生银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	浦银安盛颐享稳健养老一年混合（FOF）A	浦银安盛颐享稳健养老一年混合（FOF）Y
下属分级基金的交易代码	012167	017321
报告期末下属分级基金的份额总额	960,811,898.39 份	2,710,186.88 份

§ 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 7 月 1 日-2023 年 9 月 30 日）	
	浦银安盛颐享稳健养老一年混合（FOF）A	浦银安盛颐享稳健养老一年混合（FOF）Y
1. 本期已实现收益	91,611.16	2,674.40
2. 本期利润	-28,797,809.27	-75,204.46
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0287	-0.0282
4. 期末基金资产净值	891,027,131.17	2,520,798.69
5. 期末基金份额净值	0.9274	0.9301

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

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

3、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

4、自 2022 年 11 月 17 日起，本基金增加 Y 类基金份额类别。

5、本基金增加 Y 类基金份额类别后，本基金分设 A 类和 Y 类两类基金份额，分别设置对应的基金代码并分别计算基金份额净值。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

浦银安盛颐享稳健养老一年混合（FOF）A

阶段	净值增长率①	净值增长率标准 偏差②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准 收益率标准差	①—③	②—④

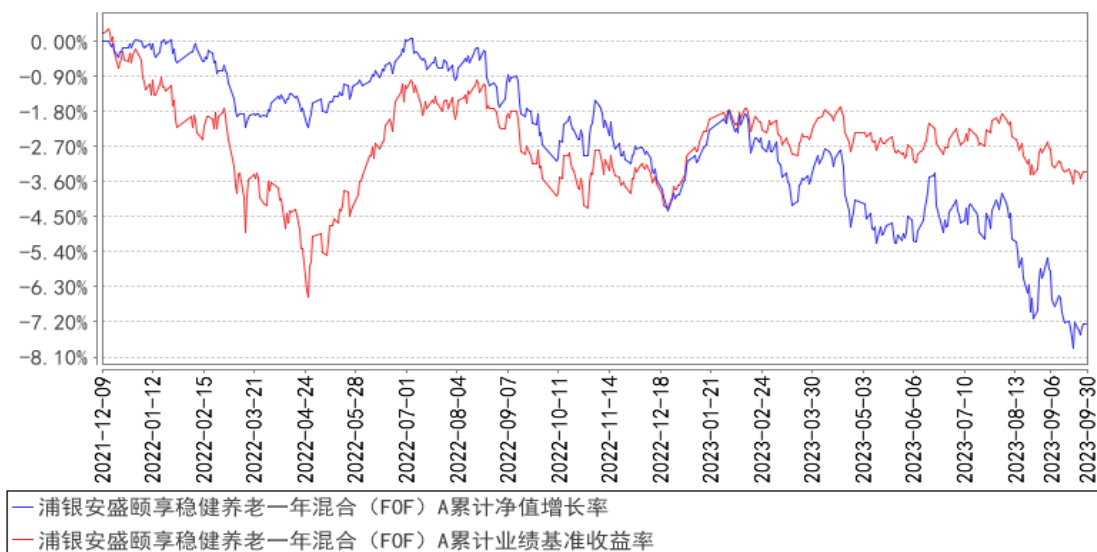
				④		
过去三个月	-3.01%	0.34%	-0.86%	0.18%	-2.15%	0.16%
过去六个月	-4.16%	0.32%	-1.22%	0.18%	-2.94%	0.14%
过去一年	-4.74%	0.28%	0.15%	0.20%	-4.89%	0.08%
自基金合同生效起至今	-7.26%	0.24%	-3.35%	0.25%	-3.91%	-0.01%

浦银安盛颐享稳健养老一年混合（FOF）Y

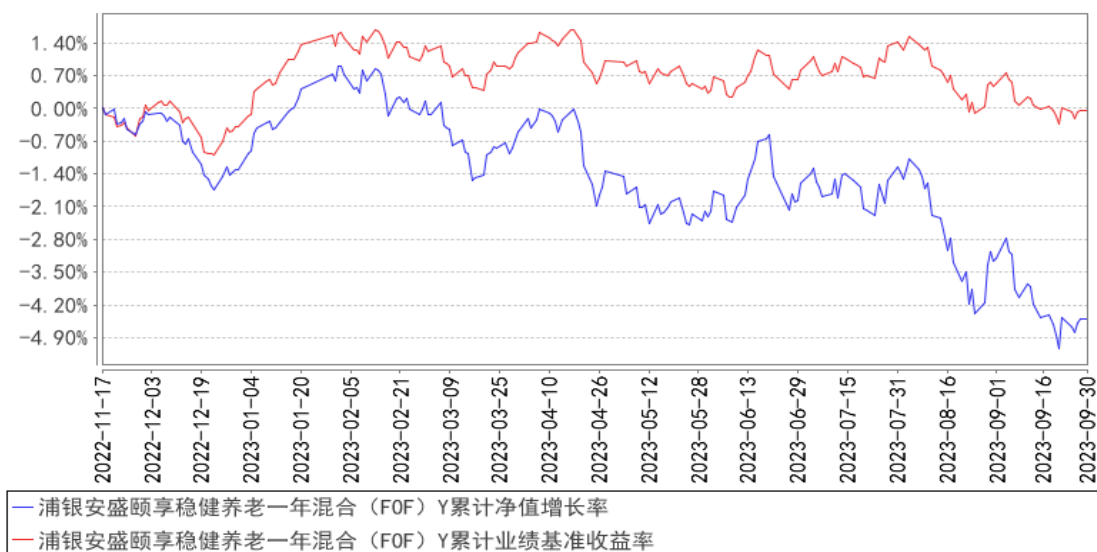
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-2.93%	0.33%	-0.86%	0.18%	-2.07%	0.15%
过去六个月	-4.00%	0.32%	-1.22%	0.18%	-2.78%	0.14%
自基金合同生效起至今	-4.50%	0.28%	-0.04%	0.17%	-4.46%	0.11%

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

浦银安盛颐享稳健养老一年混合（FOF）A 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



浦银安盛颐享稳健养老一年混合（FOF）Y 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金于 2022 年 11 月 17 日增加 Y 类份额，详见本基金管理人于 2022 年 11 月 17 日发布的《关于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）增加 Y 类基金份额并修改基金合同及托管协议相应条款的公告》。

§ 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 12 月 9 日	-	15 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。2023年7月起，担任浦银安盛颐璇平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）的基金经理。
缪夏美	本基金的基金经理	2022年3月15日	-	7年	缪夏美女士，复旦大学金融学硕士。2013年9月至2021年11月先后分别任职方正中期期货有限公司研究院宏观国债期货研究员、合众资产管理有限公司固定收益部投资经理、中信保诚基金固定收益部基金经理及平安养老保险责任有限公司固定收益投资部投资经理。2021年11月起加盟浦银安盛基金管理有限公司，现任FOF业务部FOF基金经理。2022年3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）及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。2023年7月起，担任浦银安盛颐璇平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）的基金经理。

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作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

7 月国内经济基本上仍维持偏弱格局（地产销售增速近 10 年新低，信贷投放持续偏弱等），但政策面出现了较前期更为积极的信号：第一，国常会提到的一揽子刺激政策（市场关心隐债化解法、促消费政策等）；第二、房地产方面根据各城市实际情况逐步放松，未来有望逐步实现“认房不认贷”，满足居民合理的刚性住房和改善住房需求；第三、推出了在大城市和特大城市进行城中村改造的重大项目；第四、7 月政治局会议通稿删除了“房住不炒”，进一步提振了市场信心；第五、政治局会议提到“活跃资本市场”字样，进一步提高了二级市场的信心；第六、从库存周期角度，市场普遍认为下半年将逐步进入被动去库阶段。在多重因素的影响下，大盘指数（以沪深 300 为代表）在经历了前期的震荡后，下旬开始开启了明显的反弹行情。

但是 7 月小盘股指数（特别是小盘成长）出现了不同程度的回调：一方面市场预期将有一定程度的政策刺激，基本上有利于价值风格的回归，交易盘根据市场预期进行了组合再配置操作；另一方面，成长风格在 5-6 月表现显著优于成长风格，短期有风格再均衡的需求。

7 月整体大盘好于小盘，价值好于成长，涨幅大小依次为上证 50、沪深 300、上证综指，分

别上涨 6.47%、4.48%、2.78%；其中科创 50 下跌 3.6%，中证 1000 下跌 1.31%。行业方面，地产链涨幅居前（房地产上涨 14.16%，建材上涨 10.16%，钢铁上涨 8.61%），非银在“活跃资本市场”的带动下，也贡献了较大涨幅（14.41%），此外顺周期代表品种食品饮料 7 月的表现也较好，上涨 9.24%。TMT 相关行业表现不佳，其中计算机下跌 4.21%，通信下跌 7.66%，传媒下跌 7.57%。

7 月债券市场整体高位震荡格局，虽然稳经济的政策预期提升，但年内无新增利率债供给，供给冲击风险解除，同时对于地产下行周期的判断和经济长期承压的判断并未改变，所以市场认为风险整体不大。从收益率曲线看，中长端利率债小幅上行 2BP 左右，信用债收益率仍以小幅下行为主。转债方面，7 月转债指数整体震荡为主，转债加权指数表现好于转债等权指数，主要源于加权指数中大金融占比较高，7 月大盘表现好于小盘。

8 月国内经济整体延续偏弱格局，宏观数据上并未出现大的变化，PMI 边际逐月回升，但社融数据低于预期，地产销售增速近十年低位。7 月政治局会议后市场对于政策推出给予一定的预期，市场反复博弈政策推出，但 8 月开始市场预期重新走弱，倾向认为短期推出大力度政策的概率较低，短期、中期、长期市场整体均持悲观态度。此外，8 月人民币汇率再次步入贬值通道，外资持续流出，北向累计卖出量较大，进一步加剧了市场的下探风险。节奏上，8 月初至下旬，权益指数以较为陡峭的斜率呈现单边下行，风险偏好持续降低，成交低迷。但 8 月下旬开始，推出多项政策活跃资本市场：降印花税、限制减持、暂缓 IPO、提高融资杠杆等；同时地产政策方面放松力度超出此前市场预期，四大一线城市同时放开“认房认贷”，情绪上给予市场较强支撑，普遍对于“金九银十”有较高期待。鉴于此，下旬权益指数出现了明显反弹，同时周期品反弹力度最大。结构上消费、周期、成长和大金融轮跌，全月看 7 月表现较好的顺周期品 8 月下跌幅度较大。此外，小盘股表现好于大盘股，尾盘股指数在所有指数中表现最优。指数层面，深成指跌 6.85%，沪深 300 跌 6.21%，中证 1000 跌 6.32%，科创 50 表现相对最优，跌 2.72%。行业方面全军覆没，顺周期方向跌幅最深，具体来看，采掘（0%）、传媒（-1.12%）、计算机（-3.72%）、军工（-3.9%）通信（-3.92%）等板块跌幅较小；建筑、商业、电气设备板块等跌幅较深。

8 月债券市场单边走牛，一方面市场较为悲观，风险偏好继续回落；另一方面，LPR 降幅不及预期，市场认为对地产的支持不足，将引起长期需求收缩。但 8 月下旬活跃资本市场和放松地产政策推出后，债券出现明显回调，收益率开始掉头向上。转债方面，8 月跟随权益市场下跌出现了一定幅度的下行。

9 月国内经济底部震荡，从宏观数据层面看边际略有回暖，PMI 延续回升势头，金融数据显著超市场预期。政策支持上，9 月明显较前期更为积极，一线城市地产“认房不认贷”政策放开后，成交量明显回暖；城中村改造政策稳步推进；地方化债有序推进，逐步化解了地方政府债务压力；

市场信心偏弱情况下，央行再次降准提振信心。此外，中美关系较前期边际改善。总之，尽管当前私人部门信心仍略显不足，但高频数据显示经济确实在逐步小幅改善。

9 月从大类资产看，股债汇整体均偏弱，商品表现较好。股票经历 8 月大跌后，9 月指数层面底部震荡为主，虽然宏观、中观数据略有改善，政策也更为积极，但短期市场仍信心偏弱，此外外资流出，成为做空 A 股的主要力量，负贡献较多。9 月债券市场在持续收益率下行后开启弱调整，尽管 9 月央行降准，但市场收益率仍上行为主，投资者倾向认为经济将逐步复苏，当前处于周期底部偏右侧位置。

9 月美国经济韧性较强，服务业延续强势，制造业回升向上，市场倾向认为美国经济软着陆概率较高，全球需求回暖。随着原油价格在 9 月大幅回升，再通胀压力上行，美债收益率在 9 月回升幅度较大，叠加美国国债的发行量的上升，10 年美债目前上行至 4.8 附近。美元指数表现较为强劲，在此背景下，人民币汇率 9 月持续承压。

国内权益市场 9 月呈普跌格局，但从宽基指数看，大盘表现好于小盘，价值表现整体好于成长。上证 50 微跌 0.13%，上证综指微跌 0.30%，创业板指和科创 50 表现较弱。行业上，9 月上游表现好于中下游，周期和金融表现好于成长和消费。具体看，煤炭上涨 9.61%，医药上涨 4.3%，石油石化上涨 3.49%；跌幅较大分别为传媒（-7.63%）、美容美护（-6.56%）、电力设备（-5.71%）、房地产（-5.49%）。

9 月债券整体弱势调整，交易经济边际复苏为主。短端调整幅度大于长端，收益率曲线平坦化。转债方面，在股债均偏弱格局下表现不佳。

展望未来，从大类资产角度看，权益资产表现大概率将较前期更为积极：第一、指数处于较低位置，万得全 A 接近于去年 10 月的低点位置，继续向下的空间有限，赔率较高；第二、从库存周期角度看，工业企业利润大概率已见底开始回升，进入被动去库存阶段；第三、从政策角度看，降印花税政策的推出，一定程度上可确认“政策底”已出现，若后期市场仍继续出现下行风险，还将推出新的政策稳定市场预期，进一步确认了下行空间较小；第四、地产政策放松力度和节奏超市场预期，有利于提振信心；第五、中美关系阶段性缓和；第五、市场信心逐步修复；第六、美债突破去年高点，收益率进一步大幅上行的概率较低。

基于以上几点，未来大概率市场有一波全面反弹的机会，结构上偏成长弹性较大行业将有明显相对收益。所以仓位上保持相对较高的敞口暴露，结构上仍是顺周期和科技同时暴露，当顺周期上行时适度边际减仓获利了结，同时小幅提升科技仓位的暴露。

债券方面，边际小幅降低久期，预防地产短期成交放量带来的利率风险。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末浦银安盛颐享稳健养老一年混合（FOF）A 的基金份额净值为 0.9274 元，本报告期基金份额净值增长率为-3.01%，同期业绩比较基准收益率为-0.86%，截至本报告期末浦银安盛颐享稳健养老一年混合（FOF）Y 的基金份额净值为 0.9301 元，本报告期基金份额净值增长率为-2.93%，同期业绩比较基准收益率为-0.86%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

- 1、本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。
- 2、本报告期内未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万的情形。

§ 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	6,847,594.00	0.76
	其中：股票	6,847,594.00	0.76
2	基金投资	841,512,110.79	93.37
3	固定收益投资	51,130,755.21	5.67
	其中：债券	51,130,755.21	5.67
	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	1,267,200.92	0.14
8	其他资产	531,034.97	0.06
9	合计	901,288,695.89	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	-	-
C	制造业	6,847,594.00	0.77
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	6,847,594.00	0.77

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	603225	新凤鸣	254,100	3,341,415.00	0.37
2	600882	妙可蓝多	82,000	1,427,620.00	0.16
3	600989	宝丰能源	95,300	1,362,790.00	0.15
4	002242	九阳股份	50,300	715,769.00	0.08

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	51,130,755.21	5.72
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	51,130,755.21	5.72

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	019688	22 国债 23	185,000	18,784,935.48	2.10

2	019703	23 国债 10	165,000	16,632,497.26	1.86
3	019694	23 国债 01	155,000	15,713,322.47	1.76

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。

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	29,426.93
2	应收证券清算款	500,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,608.04
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	531,034.97

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：本基金本报告期末不存在前十名股票中流通受限情况。

§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	360013	光大保德信信用添益债券 A	契约型开放式	60,243,741.70	60,544,960.41	6.78	否
2	006102	浙商丰利增强债券	契约型开放式	31,428,774.53	55,148,070.67	6.17	否
3	006663	易方达安悦超短债债券 C	契约型开放式	53,588,417.69	54,451,191.21	6.09	否
4	004127	鹏华丰康债券	契约型开放式	43,976,210.21	48,646,483.73	5.44	否
5	006436	浦银中短债债券 A	契约型开放式	42,025,743.60	44,185,866.82	4.94	是
6	002636	广发集裕债券 A	契约型开放式	35,897,129.54	43,973,983.69	4.92	否
7	004388	鹏华丰享债券	契约型开放式	34,596,487.30	40,810,016.42	4.57	否

			式				
8	007129	天弘增强回报债券 C	契约型开放式	30,778,979.49	40,486,669.62	4.53	否
9	002657	招商安裕灵活配置混合 A	契约型开放式	23,850,149.25	40,175,576.41	4.50	否
10	002969	易方达丰和债券	契约型开放式	27,860,759.49	36,901,575.94	4.13	否

6.1.1 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公开募集基础设施证券投资基金投资明细

注：本基金本报告期末未持有公开募集基础设施证券投资基金。

6.1.2 报告期末基金持有的全部公开募集基础设施证券投资基金情况

注：本基金本报告期期末未持有全部公开募集基础设施证券投资基金。

6.2 当期交易及持有基金产生的费用

项目	本期费用 2023 年 7 月 1 日至 2023 年 9 月 30 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）	25,624.70	-
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	238,886.79	-
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	1,435,345.29	42,197.66
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	326,853.85	7,032.98
当期交易基金产生的交易费（元）	1,405.69	-
当期交易基金产生的转换费（元）	150,941.25	-

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

项目	浦银安盛颐享稳健养老一年混合（FOF）A	浦银安盛颐享稳健养老一年混合（FOF）Y
报告期期初基金份额总额	1,047,244,873.40	2,615,326.13
报告期期间基金总申购份额	110,504.59	94,860.75
减：报告期期间基金总赎回份额	86,543,479.60	-
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	960,811,898.39	2,710,186.88

§ 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

注：本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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

注：本基金报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准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）募集的文件
- 2、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）基金合同
- 3、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）招募说明书
- 4、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）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

10.2 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。

10.3 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 10 月 25 日