

# 浦银安盛稳健回报 6 个月持有期债券型基 金中基金（FOF） 2024 年年度报告

2024 年 12 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：兴业银行股份有限公司

送出日期：2025 年 3 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。本年度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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 3 月 28 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。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	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	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、基金净值表现及利润分配情况</b>	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
<b>§ 4 管理人报告</b>	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	18
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	19
4.9 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	19
<b>§ 5 托管人报告</b>	19
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	19
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	19
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	19
<b>§ 6 审计报告</b>	19
6.1 审计报告基本信息	19
6.2 审计报告的基本内容	19
<b>§ 7 年度财务报表</b>	21
7.1 资产负债表	21
7.2 利润表	23
7.3 净资产变动表	24
7.4 报表附注	25
<b>§ 8 投资组合报告</b>	55

8.1 期末基金资产组合情况 .....	55
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	55
8.3 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 .....	56
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	56
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	56
8.6 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 .....	57
8.7 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 .....	57
8.8 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 .....	57
8.9 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 .....	57
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	57
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	57
8.12 本报告期投资基金情况 .....	57
8.13 投资组合报告附注 .....	60
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>60</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	60
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	61
9.3 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 .....	61
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>61</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>62</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	62
11.2 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 .....	62
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	63
11.4 基金投资策略的改变 .....	63
11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 .....	63
11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	63
11.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	63
11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	64
11.9 其他重大事件 .....	65
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>66</b>
12.1 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 .....	66
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>67</b>
13.1 备查文件目录 .....	67
13.2 存放地点 .....	67
13.3 查阅方式 .....	67

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	浦银安盛稳健回报 6 个月持有期债券型基金中基金 (FOF)	
基金简称	浦银稳健回报 6 个月持有债券 (FOF)	
基金主代码	015155	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 3 月 23 日	
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	49,594,750.48 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	浦银稳健回报 6 个月持有债券 (FOF) A	浦银稳健回报 6 个月持有债券 (FOF) C
下属分级基金的交易代码	015155	015156
报告期末下属分级基金的份额总额	46,536,289.33 份	3,058,461.15 份

### 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，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	本基金结合大类资产配置和基金优选模型，形成稳健收益的基金投资组合，从而实现基金资产在长时间段内保值增值的目的。通过对全球、国内的宏观经济、物价走势、货币政策、财政政策、产业政策的深入研究，形成对股票、债券、商品、现金等各大类资产的投资观点，实现基金资产在大类资产间的有效配置。同时，通过自主开发的量化基金优选模型来筛选基金，优先选择风险调整后收益较高的基金组合，精选基金获取大类资产内部的 Alpha，最终实现基金资产在长时间段内保值增值的目的。
业绩比较基准	中债总财富 (1-3 年) 指数收益率 *90%+ 一年期定期存款利率 (税后) *10%
风险收益特征	本基金是债券型基金中基金，其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金、货币型基金中基金，低于混合型基金、混合型基金中基金、股票型基金和股票型基金中基金。

### 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	兴业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	薛香
	联系电话	021-23212888
	电子邮箱	compliance@py-axa.com
客户服务电话	021-33079999 或 400-8828-999	95561
传真	021-23212985	021-62159217

注册地址	中国（上海）自由贸易试验区滨江大道 5189 号地下 1 层、地上 1 层至地上 4 层、地上 6 层至地上 7 层	福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦
办公地址	上海市浦东新区滨江大道 5189 号 S2 座 1-7 层	上海市浦东新区银城路 167 号 4 楼
邮政编码	200127	200120
法定代表人	张健	吕家进

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.py-axa.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层
注册登记机构	浦银安盛基金管理有限公司	上海市浦东新区滨江大道 5189 号 S2 座 1-7 层

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2024 年		2023 年		2022 年 3 月 23 日(基金合同 生效日)-2022 年 12 月 31 日	
	浦银稳健回 报 6 个月持 有债券 (FOF) A	浦银稳健回 报 6 个月持 有债券 (FOF) C	浦银稳健回 报 6 个月持 有债券 (FOF) A	浦银稳健回 报 6 个月持 有债券 (FOF) C	浦银稳健回 报 6 个月持 有债券 (FOF) A	浦银稳健回 报 6 个月持 有债券 (FOF) C
本期已实现收 益	1,246,647.4 2	82,547.85	421,347.67	153,326.98	2,602,711.0 9	1,115,973.6 7
本期利润	1,940,887.6 3	170,582.78	982,786.01	291,806.14	1,043,077.4 8	1,555,049.8 7
加权平均基金 份额本期利润	0.0435	0.0398	0.0275	0.0241	0.0120	0.0183
本期	4.14%	3.82%	2.71%	2.38%	1.19%	1.81%

加权平均净值利润率						
本期基金份额净值增长率	4.22%	3.96%	2.55%	2.29%	0.69%	0.49%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
期末可供分配利润	3,545,784.22	209,824.74	1,390,273.78	191,144.07	399,045.07	77,648.92
期末可供分配基金份额利润	0.0762	0.0686	0.0326	0.0279	0.0069	0.0049
期末基金资产净值	50,082,073.55	3,268,285.89	44,001,986.06	7,032,321.54	57,981,831.91	15,965,380.24
期末基金份额净值	1.0762	1.0686	1.0326	1.0279	1.0069	1.0049
3.1.3 累计本期末指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
基金份额累计净值增长率	7.62%	6.86%	3.26%	2.79%	0.69%	0.49%

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

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

3、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

4、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

5、本基金《基金合同》2022 年 3 月 23 日生效，至报告期末，合同成立未满三年。

### 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

浦银稳健回报 6 个月持有债券 (FOF) A

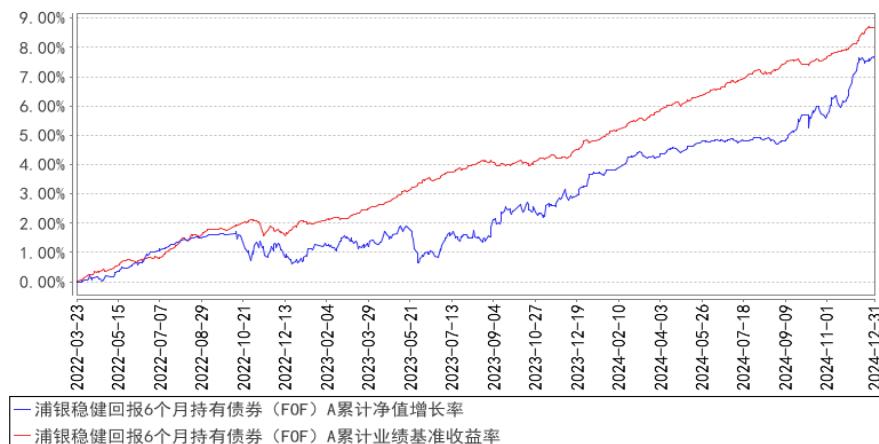
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.84%	0.11%	1.15%	0.03%	0.69%	0.08%
过去六个月	2.63%	0.09%	1.75%	0.03%	0.88%	0.06%
过去一年	4.22%	0.07%	3.67%	0.03%	0.55%	0.04%
自基金合同生效起至今	7.62%	0.08%	8.67%	0.03%	-1.05%	0.05%

浦银稳健回报 6 个月持有债券 (FOF) C

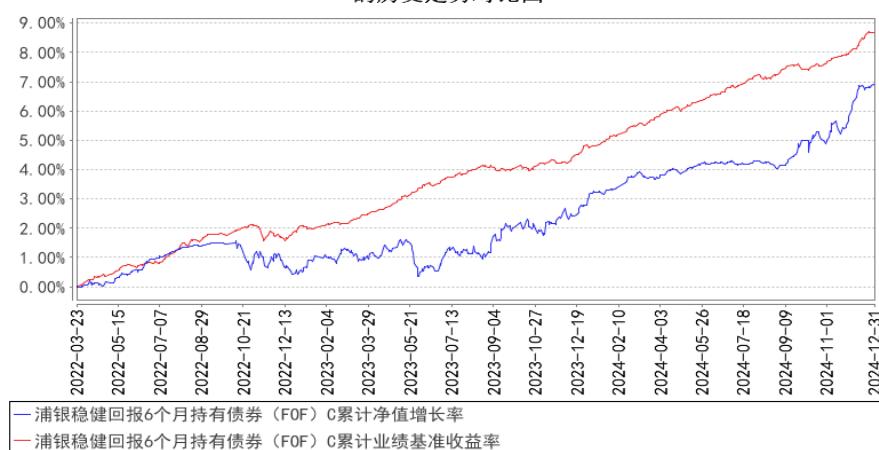
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.77%	0.11%	1.15%	0.03%	0.62%	0.08%
过去六个月	2.50%	0.09%	1.75%	0.03%	0.75%	0.06%
过去一年	3.96%	0.07%	3.67%	0.03%	0.29%	0.04%
自基金合同生效起至今	6.86%	0.08%	8.67%	0.03%	-1.81%	0.05%

### 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

浦银稳健回报6个月持有债券 (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

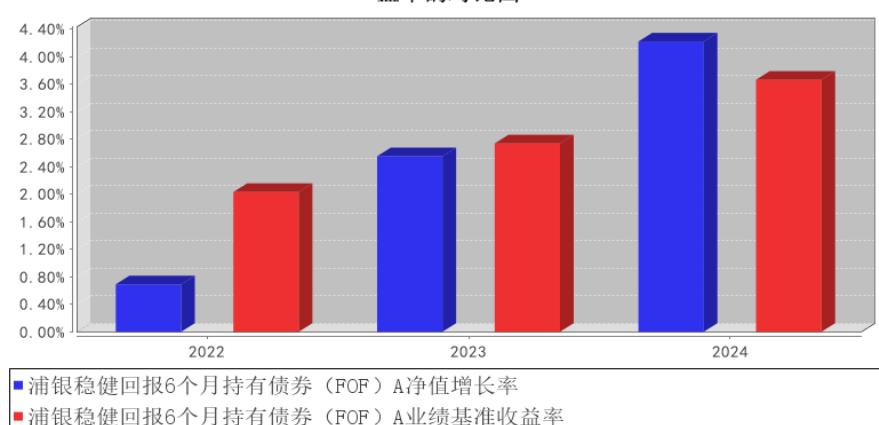


浦银稳健回报6个月持有债券 (FOF) C 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

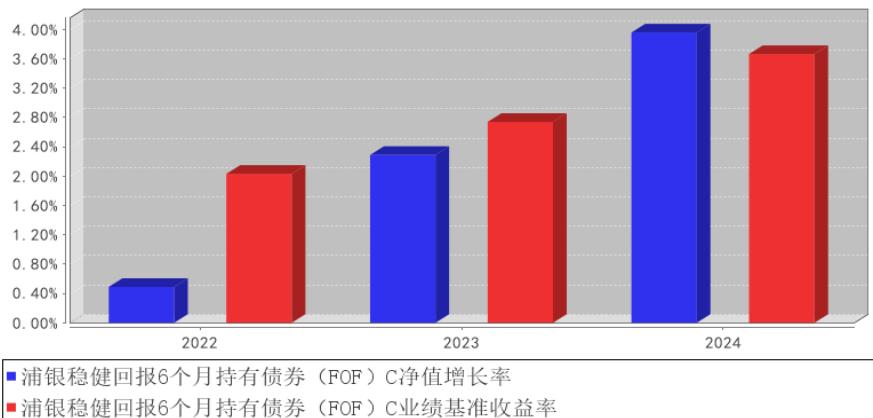


### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

浦银稳健回报6个月持有债券 (FOF) A 基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



浦银稳健回报6个月持有债券 (FOF) C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同于 2022 年 3 月 23 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金自成立以来未进行过利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2024 年 12 月 31 日止，浦银安盛旗下共管理 107 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 个月持有期债券型证券投资基金、浦银安盛消费升级灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛日日盈货币市场基金、浦银安盛新经济结构灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛盛世精选灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛增长动力灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛医疗健康灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛睿智精选灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛盛鑫定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛日日丰货币市场基金、浦银安盛盛泰纯债债券型证券投资基金。

基金、浦银安盛日日鑫货币市场基金、浦银安盛盛达纯债债券型证券投资基金、浦银安盛经济带崛起灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛盛跃纯债债券型证券投资基金、浦银安盛盛通定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛港股通量化优选灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛安恒回报定期开放混合型证券投资基金、浦银安盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛盛泽定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛中短债债券型证券投资基金、浦银安盛普益纯债债券型证券投资基金、浦银安盛盛融定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛普瑞纯债债券型证券投资基金、浦银安盛盛元定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛全球智能科技股票型证券投资基金 (QDII)、浦银安盛双债增强债券型证券投资基金、浦银安盛盛勤 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛环保新能源混合型证券投资基金、浦银安盛上海清算所高等级优选短期融资券指数证券投资基金、浦银安盛盛煊 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛普丰纯债债券型证券投资基金、浦银安盛盛诺 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛颐和稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金 (FOF)、浦银安盛先进制造混合型证券投资基金、浦银安盛盛智一年定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛盛晖一年定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛盛熙一年定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛 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混合型证券投资基金、浦银安盛创业板交易型开放式指数证券投资基金、浦银安盛普嘉 87 个月定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、浦银安盛价值精选混合型证券投资基金、浦银安盛普华 66 个月定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛普天纯债债券型证券投资基金、浦银安盛普庆纯债债券型证券投资基金、浦银安盛睿和优选 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF)、浦银安盛中债 3-5 年农发行债券指数证券投资基金、浦银安盛 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、浦银安盛稳健丰利债券型证券投资基金、浦银安盛 ESG 责任投资混合型证券投资基金、浦银安盛盛华一年定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛均衡优选 6 个月持有期混合型证券投资基金、浦银安盛季季鑫 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金、浦银安盛嘉和稳健一年持有期混合型基金中基金 (FOF)、浦银安盛中证 ESG 120 策略交易型开放式指数证券投资基金、浦银安盛安裕回报一年持有期混合型证券投资基金、浦银安盛中证智能电动汽车交易型开放式指数证券投资基金、浦银安盛双月鑫 60 天滚动持有短债债券型证券投资基金、浦银安盛中证证券公司 30 交易型开放式指数证券投资基金、浦银安盛中证沪港深游戏及文化传媒交易型开放式指数证券投资基金、浦银安盛 CFETS 0-5 年期央企债券指数发起式证券投资基金、浦银安盛颐享稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金 (FOF)、浦银安盛盛瑞纯债债券型证券投资基金、浦银安盛

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

公司信息技术系统由信息技术基础设施系统以及有关业务应用系统构成。当前，公司建设有上交所金桥托管机房和办公大楼自建机房，实现本地双活互备。同时，在合肥异地建设有灾备托管机房，实现异地备份，形成了两地三中心的架构布局。公司的机房建设、网络设备、服务器设备、监控设备等基础设施，由公司信息技术部主导并聘请专业的系统集成公司负责建成。公司业务应用系统主要包括开放式基金登记过户系统、直销系统、资金清算系统、投资交易系统、估值核算系统、网上交易系统、呼叫中心系统、外服系统、营销数据中心系统、XBRL 系统、反洗钱系统等。这些系统主要是采购行业内成熟、主流的专业系统提供商的产品建设而成，建成之后在业务运作过程中根据公司业务的需要进行了相关的系统功能升级，升级由系统提供商负责完成，升级后的系统也均是系统提供商对外提供的通用系统。公司的基础设施及业务应用系统，建成后均由公司信息技术部负责日常的运维、管理，同时与第三方专业服务公司签订有技术服务合同，由其提供定期的巡检及特殊情况下的技术支持运维服务。此外，公司自研开发团队建成了低代码的数字化运营平台，基于 CDH 底座的大数据开发平台，集 RPA、OCR、NLP、AI 等创新技术为一体的

创新研发平台以及移动平台等业务支持应用平台，积极为业务赋能。除上述情况外，公司未委托服务机构代为办理重要的、特定的信息技术系统开发、维护事项。

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

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券从 业年限	说明
		任职日期	离任日期		
缪夏美	本基金的基金经理	2024 年 8 月 8 日	-	8 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 月至 2024 年 12 月，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。2023 年 7 月至 2024 年 8 月，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。2022 年 3 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。2024 年 2 月起，担任浦银安盛养老目标日期 2050 五年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 的基金经理。2024 年 8 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)、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)、浦银安盛稳健回报 6 个月持有期债券型基金中基金 (FOF) 的基金经理。
陈曙亮	FOF 业务部部门总监兼本基金的基金经理	2022 年 3 月 23 日	2024 年 8 月 8 日	16 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。2021 年 5 月至 2023 年 12 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) 的基金经理。2020 年 10 月至 2024 年 8 月，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 6 月至 2024 年 8 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。2021 年 12 月至 2024 年 8 月, 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 月至 2024 年 8 月, 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 月至 2024 年 8 月, 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 月至 2024 年 8 月, 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 月至 2024 年 8 月, 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 月至 2024 年 8 月, 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。2024 年 2 月至 2024 年 8 月, 担任浦银安盛招睿精选 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 的基金经理。
--	--	--	--	--

注: 1、首任基金经理及基金经理助理的“任职日期”为基金合同生效日, 非首任基金经理及基金经理助理的“任职日期”为根据公司决定确定的聘任日期, 基金经理及基金经理助理的“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《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内, 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 公平交易制度和控制方法

管理人制定了《浦银安盛基金管理有限公司公平交易管理规定》, 并进行了多次修订。现行公平交易管理规定分为总则、实现公平交易的具体措施、公平交易监控与实施效果评估、公平交易的报告和信息披露、隔离及保密、附则等六部分。公平交易管理规定从投资决策、研究支持、交

易实施、监控与评估、报告与披露等各个环节，预防和发现可能违反公平交易的异常情况，并予以及时纠正与改进。

管理人用于公平交易控制方法包括：

- 公司建立严格的投资组合投资信息的管理及保密制度，不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离；
- 相对所有组合建立并使用统一的、系统化的研究平台；
- 明确了投资决策委员会、投资总监、投资组合经理三级授权体系；
- 要求同一基金经理管理的多个组合下达投资指令应尽量“同时同价”；
- 严格控制不同投资组合之间的同日反向交易；
- 执行投资交易交易系统中的公平交易程序；
- 银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易的交易分配严格依照制度和程序规范进行，并对该分配过程进行监控；
- 定期对投资目标和投资策略类似的投资组合的业绩表现进行分析、归因和评估；
- 对不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内、10 日内）管理人管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析。分析如发现有涉嫌不公平的交易，投资组合经理及交易主管对该情况需提供详细的原因说明，并将检查结果向公司管理层和督察长汇报。同时改进公平交易管理方法及流程。
- 其他能够防范公平交易异常情况的有效方式。

#### 4.3.2 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。

#### 4.3.3 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中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

回顾 2024 年，国内经济基本面于二季度转弱，924 以来“稳增长”政策发力，带动经济动能回升；权益先弱后强，利率基本延续“债牛”行情。在美国经济基本面韧性持续和美国大选预期的反复博弈下，美股延续上涨行情，美债利率上半年呈“倒 U 型”走势，下半年震荡上行。

一季度，国内生产、出口及消费指标均有改善，呈现温和回升复苏的局面，A 股出现“开门红”行情。债市基本延续去年的 beta 行情，10Y、30Y 等主要券种利率持续下行。

二季度，经济增速有所回落，有效需求不足、社会预期较弱，增长环比回升动能仍待进一步夯实，A 股持续偏弱。国内债券方面，积极的“防风险”政策基调为信用利差压缩提供了良好条件，叠加广义基金规模扩容、配置需求上升，信用债“资产荒”行情演绎，贡献额外 alpha 行情。

三季度，A 股市场上，大小盘风格快速切换，TMT 和红利主题表现分化。924 会后，A 股市场大幅反弹，TMT 和前期跌幅较大的消费医药板块涨幅居前，红利板块表现较弱。国内利率整体呈现先下后上态势：七至八月中旬，降息降准预期下利率持续下行，信用利差压缩；八月中旬起，利率窄幅震荡；924 后，风险偏好抬升，利率快速上行，信用利差走阔。海外方面，美国经济基本面数据偏弱，临近大选时点政策不确定性增强，叠加市场对 AI 热潮持续性的担忧，多空双方博弈加剧，美股整体区间震荡。

四季度，“稳增长”政策推动的快速上涨行情于 10 月 8 日见顶回落，月中开启二轮上涨行情，小盘和创业板整体占优，TMT 领涨，触及前期高点后资金博弈加剧，11 月中下旬 A 股震荡回调，市场高低切环境下，前期涨幅较大的军工和家电有所回调；12 月，出于对外部环境的担忧，下半月 A 股整体回调，市场风格更偏向大盘。利率延续下行趋势，10 月利率窄幅震荡，11 月重回下行趋势，“双降”政策预期叠加年末配置压力的影响，利率快速下行，债市“抢跑”现象明显，信用利差加速压降。海外方面，10-11 月，临近大选，美股波动放大，“特朗普预期交易”下美债利率上行；美大选落地后，对于特朗普政策下强美元强美股的预期推动美股延续震荡上涨行情。

基金投资运作方面，本产品维持偏低权益仓位，仍以持有债券型基金为主，权益方面底仓维持红利资产和美股的配置，9 月下旬增配宽基指数，10 月初边际减仓。结构上大盘红利为主，辅

助配置黄金和海外权益资产。债券部分，组合于 10-11 月明显提升久期，久期策略较为积极，净值表现占优；12 月中下旬，考虑到短期收益率下行幅度较大，有内在调整需求，组合于边际降低久期。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末浦银稳健回报 6 个月持有债券 (FOF) A 的基金份额净值为 1.0762 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.22%，同期业绩比较基准收益率为 3.67%，截至本报告期末浦银稳健回报 6 个月持有债券(FOF)C 的基金份额净值为 1.0686 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.96%，同期业绩比较基准收益率为 3.67%。

#### 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 2025 年，宏观上关注特朗普关税政策，对全球资产的扰动；科技方面，关注 DeepSeek 带动的中国科技股的再估值和对 AI 产业的带动。美股科技股长牛逻辑或短期被打破，年内有调整风险。国内方面，美对华增加 10% 关税正式落地，短期 A 股大盘或呈震荡格局，DeepSeek 的冲击或加剧 TMT 细分赛道和产业链轮动，AI 变局或带来中国资产新的投资机会。债市方面，中长维度的“货币适度宽松”或持续推动利率下行，经济基本面和地产开工和销售数据仍对长期债牛形成支撑。组合将维持 A 股权益仓位，边际降低海外权益敞口，结构上增配国内人工智能相关行业，并通过适当参与信用债和利率波段进行增厚，后续观察“两会”具体产业支持政策出台与经济基本面的修复情况择机调整仓位和债券久期。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本基金管理人根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》等有关法规诚实守信、勤勉尽责，依法履行基金管理人职责，强化风险及合规管理，确保基金管理业务运作的安全、规范，保护基金份额持有人的合法权益。

2024 年以来，公司进一步强化合规风险底线意识，塑造良好的合规风控文化，打造“纵向到底，横向到边”的合规风控机制，促进公司持续、健康、平稳地高质量发展，充分保护投资者的利益，维护公司股东的合法权益，依照法律法规及监管部门的要求，结合公司实际业务开展情况，制定和修订了一系列内部规章制度，进一步完善了全面合规和风险管理机制。2024 年度，公司各项合规风控审计管理方面总体上得到了良好的控制，各项控制措施切实而有效，年内未发生重大违规及重大风险事件。

在公司董事会的指导、管理层的支持和各部门的密切配合下，公司紧密围绕经营目标和计划，结合公司的特点和现状，扎实推进开展各项合规风控审计工作。2024 年，合规风控审计工作内容涵盖了制度内控、法律合规、信息披露、反洗钱、风险监控、绩效评估、内部审计等工作。

法律合规方面，新规落实、法律事务、合规审核、合规培训、合规检查、信息披露、反洗钱、配合客户投诉处理等各项工作均有序开展，为公司各项业务开展提供有力的法律合规支持，为公司高质量发展打下了坚实基础。

风险管理方面，对投资合规风险、信用风险、流动性风险、市场风险、操作风险、信息科技风险、法律风险、合规风险、声誉风险、业务连续性风险、洗钱风险、集中度风险、廉洁从业风险和创新产品/业务风险等均建立了完善的二层风险监控机制，注重加强对基金经理的日常培训，提升前台人员风险意识，同时进一步开发智能风控系统及数字可视化驾驶舱，前置化加强风险预警能力，智能化分析各项风险并向投研人员提供线上支持，努力提升风险化解及处置能力。

内部审计方面，以公司整体的战略目标为指导，努力构建与公司业务发展相适应的审计监督模式，建立健全各项审计工作规范、不断提升内部审计工作质量，不断强化审计监督职能，守牢公司风险第三道防线。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

本基金基金经理未参与或决定基金的估值。

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

本基金管理人与中证指数有限公司签订了《债券估值数据服务协议》。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配，符合相关法律法规和基金合同的规定。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

- 1、本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。
- 2、本基金自 2024 年 7 月 16 日至 2024 年 9 月 26 日存在连续二十个工作日基金资产净值低于五千万的情形。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，本托管人严格遵守《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，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

### § 6 审计报告

#### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第 2501648 号

#### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
--------	------

审计报告收件人	浦银安盛稳健回报 6 个月持有期债券型基金中基金(FOF)全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了后附的浦银安盛稳健回报 6 个月持有期债券型基金中基金(FOF) (以下简称“该基金”) 财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表、2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了该基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则(以下简称“审计准则”)的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于该基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	无
其他信息	<p>该基金管理人浦银安盛基金管理有限公司(以下简称“该基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金 2024 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>该基金管理人管理层负责按照企业会计准则及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，该基金管理人管理层负责评估该基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项 (如适用)，并运用持续经营假设，除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。</p> <p>该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则

	<p>执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价该基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对该基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对该基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致该基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与该基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	王国蓓 叶凯韵
会计师事务所的地址	北京市东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层
审计报告日期	2025 年 3 月 27 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：浦银安盛稳健回报 6 个月持有期债券型基金中基金 (FOF)

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			

货币资金	7.4.7.1	1,460,516.17	265,871.33
结算备付金		90,915.70	-
存出保证金		8,858.55	1,466.50
交易性金融资产	7.4.7.2	51,901,314.54	45,136,916.61
其中：股票投资		-	2,130,520.00
基金投资		49,069,925.15	40,367,113.54
债券投资		2,831,389.39	2,639,283.07
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		-	5,800,000.00
应收股利		-	14,895.00
应收申购款		31,009.71	237.16
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		53,492,614.67	51,219,386.60
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2023 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		7,030.88	60,909.73
应付管理人报酬		13,561.08	9,762.35
应付托管费		1,938.16	1,560.39
应付销售服务费		715.45	1,932.62
应付投资顾问费		-	-
应交税费		7,646.28	694.85
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	111,363.38	110,219.06
负债合计		142,255.23	185,079.00
<b>净资产：</b>			

实收基金	7.4.7.10	49,594,750.48	49,452,889.75
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	3,755,608.96	1,581,417.85
净资产合计		53,350,359.44	51,034,307.60
负债和净资产总计		53,492,614.67	51,219,386.60

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，浦银稳健回报 6 个月持有债券 (FOF) A 份额净值 1.0762 元，基金份额总额 46,536,289.33 份，浦银稳健回报 6 个月持有债券 (FOF) C 份额净值 1.0686 元，基金份额总额 3,058,461.15 份，总份额合计 49,594,750.48 份。

## 7.2 利润表

会计主体：浦银安盛稳健回报 6 个月持有期债券型基金中基金 (FOF)

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
<strong>一、营业总收入</strong>		2,453,734.66	1,589,530.62
1. 利息收入		6,184.48	8,937.98
其中：存款利息收入	7.4.7.13	6,184.48	4,131.57
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		-	4,806.41
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		1,665,275.04	880,675.14
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-587,207.25	-234,122.55
基金投资收益	7.4.7.15	1,725,728.97	472,821.76
债券投资收益	7.4.7.16	44,841.97	39,044.04
资产支持证券投资 收益	7.4.7.17	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.18	-	-
衍生工具收益	7.4.7.19	-	-
股利收益	7.4.7.20	481,911.35	602,931.89
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益(损失 以“-”号填列)	7.4.7.21	782,275.14	699,917.50
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	7.4.7.22	-	-

<b>减：二、营业总支出</b>		342,264.25	314,938.47
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	154,553.96	147,012.74
2. 托管费	7.4.10.2.2	24,727.25	23,153.00
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	11,255.57	30,837.58
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		1,689.29	933.54
其中：卖出回购金融资产支出		1,689.29	933.54
6. 信用减值损失	7.4.7.24	-	-
7. 税金及附加		2,429.72	295.11
8. 其他费用	7.4.7.25	147,608.46	112,706.50
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		2,111,470.41	1,274,592.15
<b>减：所得税费用</b>		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		2,111,470.41	1,274,592.15
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		2,111,470.41	1,274,592.15

### 7.3 净资产变动表

会计主体：浦银安盛稳健回报 6 个月持有期债券型基金中基金 (FOF)

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	49,452,889.75	1,581,417.85	51,034,307.60
二、本期期初净资产	49,452,889.75	1,581,417.85	51,034,307.60
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	141,860.73	2,174,191.11	2,316,051.84
(一)、综合收益总额	-	2,111,470.41	2,111,470.41
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	141,860.73	62,720.70	204,581.43
其中：1. 基金申购款	21,054,364.27	1,036,403.84	22,090,768.11
2. 基金赎回款	-20,912,503.54	-973,683.14	-21,886,186.68

(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动 (净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	49, 594, 750. 48	3, 755, 608. 96	53, 350, 359. 44
项目		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
		实收基金	未分配利润
一、上期期末净资产	73, 470, 518. 16	476, 693. 99	73, 947, 212. 15
二、本期期初净资产	73, 470, 518. 16	476, 693. 99	73, 947, 212. 15
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-24, 017, 628. 41	1, 104, 723. 86	-22, 912, 904. 55
(一)、综合收益总额	-	1, 274, 592. 15	1, 274, 592. 15
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	-24, 017, 628. 41	-169, 868. 29	-24, 187, 496. 70
其中: 1. 基金申购款	25, 836, 261. 63	640, 187. 23	26, 476, 448. 86
2. 基金赎回款	-49, 853, 890. 04	-810, 055. 52	-50, 663, 945. 56
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动 (净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	49, 452, 889. 75	1, 581, 417. 85	51, 034, 307. 60

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

张弛

顾佳

孙赵辉

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

浦银安盛稳健回报 6 个月持有期债券型基金中基金(FOF) (以下简称“本基金”) 经中国证券

监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2022]152号《关于准予浦银安盛稳健回报6个月持有期债券型基金中基金(FOF)注册的批复》准予注册,由浦银安盛基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《浦银安盛稳健回报6个月持有期债券型基金中基金(FOF)基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币216,322,555.41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(2022)第0229号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《浦银安盛稳健回报6个月持有期债券型基金中基金(FOF)基金合同》于2022年3月23日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为216,349,801.37份基金份额,其中认购资金利息折合27,245.96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,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《浦银安盛稳健回报6个月持有期债券型基金中基金(FOF)基金合同》和《浦银安盛稳健回报6个月持有期债券型基金中基金(FOF)招募说明书》的规定,本基金根据认购/申购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购基金份额时收取认购/申购费,但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额为A类基金份额;在投资者认购申购基金份额时不收取认购/申购费,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额为C类基金份额。本基金A类、C类两种收费模式并存,由于基金费用的不同,本基金A类基金份额和C类基金份额分别计算基金份额净值。

本基金对每笔有效认购或申购的份额设置6个月的最短持有期,最短持有期内,投资者不能提出赎回申请,期满后(含到期日)投资者可以申请赎回。认、申购份额的最短持有期的起始日分别为基金合同生效日、申购申请确认日的6个月对日,若6个月后无对日的,则该月最后一个工作日为到期日,若该对日为非工作日,则到期日顺延至下一工作日。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《浦银安盛稳健回报6个月持有期债券型基金中基金(FOF)招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金(包含ETF、LOF、QDII基金、商品基金、香港互认基金、“公开募集基础设施证券投资基金(以下简称“公募REITs”))的基金份额、国内依法发行上市的股票(包括主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券、可交换债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金的投资组合比例为:本基金投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金的基金份

额的资产不低于基金资产的 80%，其中投资于债券型证券投资基金的比例不低于本基金资产的 80%；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中债总财富（1-3 年指数收益率×90%+一年期定期存款利率（税后）×10%。

本财务报表由本基金的基金管理人浦银安盛基金管理有限公司于 2025 年 3 月 27 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况、2024 年度的经营成果和净资产变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

###### （1）金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资、资产支持证券投资和基金投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

#### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融负债和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。本基金持有的以摊余成本计量的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。

#### (3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

### 7.4.4.4 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在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，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，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，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。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资和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。

#### 7.4.4.6 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。

#### 7.4.4.7 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。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

#### 7.4.4.8 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净资产比例计算的金额。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净资产比例计算的金额。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)。

#### 7.4.4.9 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。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证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投资收益。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。

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扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息后的净额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扣除相关交易费用后的净额确认为投资收益，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。

#### 7.4.4.10 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。以摊余成本计量的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。

#### 7.4.4.11 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净资产转出。

#### 7.4.4.12 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。

#### 7.4.4.13 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(可转换债券和可交换债券除外)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》及中国基金业协会中基协字[2022]566 号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知之附件《关于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(可转换债券和可交换债券除外)，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。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内未发生会计政策变更。

### 7.4.5.2 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。

### 7.4.5.3 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。

## 7.4.6 税项

根据财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部 税务总局公告2024年第8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

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

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c) 对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

d) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	1,460,516.17	265,871.33
等于： 本金	1,460,324.85	265,663.50
加： 应计利息	191.32	207.83
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	1,460,516.17	265,871.33

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-	-
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	2,803,721.00	26,429.39	2,831,389.39
	银行间市场	-	-	-
	合计	2,803,721.00	26,429.39	2,831,389.39
资产支持证券	-	-	-	-
基金	48,709,528.92	-	49,069,925.15	360,396.23
其他	-	-	-	-
合计	51,513,249.92	26,429.39	51,901,314.54	361,635.23
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	2,703,395.82	-	2,130,520.00	-572,875.82
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	2,601,219.00	39,313.07	2,639,283.07
	银行间市场	-	-	-
	合计	2,601,219.00	39,313.07	2,639,283.07
资产支持证券	-	-	-	-
基金	40,213,628.63	-	40,367,113.54	153,484.91
其他	-	-	-	-
合计	45,518,243.45	39,313.07	45,136,916.61	-420,639.91

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有任何衍生金融资产/负债。

##### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有期货合约。

### 7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有黄金衍生品。

### 7.4.7.4 买入返售金融资产

#### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有任何买入返售金融资产。

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

本基金本报告期末及上年度末均未按预期信用损失一般模型计提减值准备。

### 7.4.7.5 债权投资

#### 7.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有债权投资。

#### 7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均未计提债权投资减值准备。

### 7.4.7.6 其他债权投资

#### 7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有其他债权投资。

#### 7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均未计提其他债权投资减值准备。

### 7.4.7.7 其他权益工具投资

#### 7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有其他权益工具投资。

#### 7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有其他权益工具投资。

### 7.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

### 7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 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	1,363.38	219.06
其中：交易所市场	1,363.38	219.06
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	110,000.00	110,000.00
合计	111,363.38	110,219.06

#### 7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

浦银稳健回报 6 个月持有债券 (FOF) A

项目	本期	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	账面金额
上年度末	42,611,712.28	42,611,712.28
本期申购	20,916,738.90	20,916,738.90
本期赎回 (以“-”号填列)	-16,992,161.85	-16,992,161.85
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	46,536,289.33	46,536,289.33

浦银稳健回报 6 个月持有债券 (FOF) C

项目	本期	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	账面金额
上年度末	6,841,177.47	6,841,177.47
本期申购	137,625.37	137,625.37
本期赎回 (以“-”号填列)	-3,920,341.69	-3,920,341.69
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	3,058,461.15	3,058,461.15

注：申购含红利再投资、转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无其他综合收益。

#### 7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

浦银稳健回报 6 个月持有债券 (FOF) A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,168,322.29	-778,048.51	1,390,273.78

本期期初	2,168,322.29	-778,048.51	1,390,273.78
本期利润	1,246,647.42	694,240.21	1,940,887.63
本期基金份额交易产生的变动数	274,734.52	-60,111.71	214,622.81
其中：基金申购款	1,178,779.20	-148,873.17	1,029,906.03
基金赎回款	-904,044.68	88,761.46	-815,283.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,689,704.23	-143,920.01	3,545,784.22

## 浦银稳健回报 6 个月持有债券 (FOF) C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	315,872.49	-124,728.42	191,144.07
本期期初	315,872.49	-124,728.42	191,144.07
本期利润	82,547.85	88,034.93	170,582.78
本期基金份额交易产生的变动数	-178,985.52	27,083.41	-151,902.11
其中：基金申购款	7,140.18	-642.37	6,497.81
基金赎回款	-186,125.70	27,725.78	-158,399.92
本期已分配利润	-	-	-
本期末	219,434.82	-9,610.08	209,824.74

## 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	5,622.68	3,705.11
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	522.39	305.06
其他	39.41	121.40
合计	6,184.48	4,131.57

## 7.4.7.14 股票投资收益

## 7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31 日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月 31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-587,207.25	-234,122.55
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	-587,207.25	-234,122.55

#### 7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
卖出股票成交总额	3,922,861.00	1,606,245.00
减：卖出股票成本总额	4,504,416.82	1,836,525.89
减：交易费用	5,651.43	3,841.66
买卖股票差价收入	-587,207.25	-234,122.55

#### 7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无股票投资收益-证券出借差价收入。

#### 7.4.7.15 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
卖出/赎回基金成交总额	113,591,501.36	47,231,669.52
减：卖出/赎回基金成本总额	111,830,740.33	46,755,851.78
减：买卖基金差价收入应缴 纳增值税额	20,247.66	2,459.19
减：交易费用	14,784.40	536.79
基金投资收益	1,725,728.97	472,821.76

#### 7.4.7.16 债券投资收益

##### 7.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
债券投资收益——利 息收入	51,293.97	62,864.04
债券投资收益——买 卖债券（债转股及债	-6,452.00	-23,820.00

券到期兑付) 差价收入		
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	44,841.97	39,044.04

#### 7.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位: 人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31 日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月 31日
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额	6,226,560.36	6,432,269.88
减: 卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	6,107,024.00	6,323,985.00
减: 应计利息总额	125,988.36	132,104.88
减: 交易费用	-	-
买卖债券差价收入	-6,452.00	-23,820.00

#### 7.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

注: 本基金本报告期内及上年度可比期间均无债券投资收益-赎回差价收入。

#### 7.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

注: 本基金本报告期内及上年度可比期间均无债券投资收益-申购差价收入。

### 7.4.7.17 资产支持证券投资收益

#### 7.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

注: 本基金在本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注: 本基金本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益-买卖资产支持证券差价收入。

#### 7.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注: 本基金本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益-赎回差价收入。

#### 7.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注: 本基金本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益-申购差价收入。

### 7.4.7.18 贵金属投资收益

#### 7.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益-买卖贵金属差价收入。

#### 7.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益-赎回差价收入。

#### 7.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益-申购差价收入。

### 7.4.7.19 衍生工具收益

#### 7.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

#### 7.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益-其他投资收益。

### 7.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	63,090.47	229,161.70
其中：证券出借权益补偿收入	—	—
基金投资产生的股利收益	418,820.88	373,770.19
合计	481,911.35	602,931.89

### 7.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	782,275.14	699,917.50
股票投资	572,875.82	103,194.89
债券投资	2,488.00	12,395.00
资产支持证券投资	—	—
基金投资	206,911.32	584,327.61
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	782, 275. 14	699, 917. 50

#### 7.4.7.22 其他收入

注: 本基金在本报告期内及上年度可比期间均无其他收入。

#### 7.4.7.23 持有基金产生的费用

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期持有基金产生的应支付销售服务费 (元)	1, 523. 66	2, 932. 81
当期持有基金产生的应支付管理费 (元)	143, 003. 24	118, 176. 88
当期持有基金产生的应支付托管费 (元)	43, 035. 90	33, 480. 84

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。

#### 7.4.7.24 信用减值损失

注: 本基金在本报告期内及上年度可比期间均无信用减值损失。

#### 7.4.7.25 其他费用

单位: 人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	30, 000. 00	60, 000. 00
信息披露费	80, 000. 00	50, 000. 00
证券出借违约金	-	-
银行费用	2, 608. 46	2, 706. 50
持有人大会律师费	25, 000. 00	-
持有人大会公证费	10, 000. 00	-
合计	147, 608. 46	112, 706. 50

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日, 本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

#### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日, 本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
浦银安盛基金管理有限公司 (“浦银安盛”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
兴业银行股份有限公司 (“兴业银行”)	基金托管人、基金销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司 (“上海浦东发展银行”)	基金管理人的股东、基金销售机构
法国安盛投资管理有限公司	基金管理人的股东
上海国盛集团资产有限公司	基金管理人的股东
上海浦银安盛资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注: 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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

注: 本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过股票交易。

###### 7.4.10.1.2 债券交易

注: 本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过债券交易。

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

注: 本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过债券回购交易。

###### 7.4.10.1.4 基金交易

注: 本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过基金交易。

###### 7.4.10.1.5 权证交易

注: 本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过权证交易。

###### 7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

注: 本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有应支付关联方的佣金。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位: 人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	154,553.96	147,012.74

其中：应支付销售机构的客户维护费	27,142.62	36,409.45
应支付基金管理人的净管理费	127,411.34	110,603.29

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 0.30%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金管理人管理的其他基金部分后的余额×0.30%/当年天数。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	24,727.25	23,153.00

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。支付基金托管人兴业银行的托管费按前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金托管人托管的其他基金部分后的余额的 0.05%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金托管人托管的其他基金部分后的余额×0.05%/当年天数。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		合计
浦银稳健回报 6 个月持有债券 (FOF) A	12.60	12.60	12.60
浦银稳健回报 6 个月持有债券 (FOF) C	7,952.70	7,952.70	7,952.70
合计	7,965.30	7,965.30	7,965.30
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		合计
浦银稳健回报 6 个月持有债券 (FOF) A	12.60	12.60	12.60
浦银稳健回报 6 个月持有债券 (FOF) C	7,952.70	7,952.70	7,952.70
合计	7,965.30	7,965.30	7,965.30

上海浦东发展银行	-	0.48	0.48
兴业银行	-	23,061.29	23,061.29
合计	-	23,061.77	23,061.77

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给浦银安盛，再由浦银安盛计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}.$$

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.10.4 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

##### 7.4.10.4.1 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：本基金在本报告期内及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

##### 7.4.10.4.2 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：本基金在本报告期内及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 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	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
基金合同生效日（2022 年 3 月 23 日）持有的基金份额	浦银稳健回报 6 个月持有债券 (FOF) A 0.00	浦银稳健回报 6 个月持有债券 (FOF) C -
报告期初持有的基金份额	0.00	-
报告期内申购/买入总份额	3,781,750.63	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	0.00	-
报告期内持有的基金份额	3,781,750.63	-
报告期内持有的基金份额占基金总份额比例	8.13%	-

项目	上年度可比期间	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	浦银稳健回报 6 个月持有债券 (FOF) A	浦银稳健回报 6 个月持有债券 (FOF) C
基金合同生效日 (2022 年 3 月 23 日) 持有的基金份额	—	—
报告期初持有的基金份额	—	—
报告期内申购/买入总份额	—	—
报告期内因拆分变动份额	—	—
减: 报告期间赎回/卖出总份额	—	—
报告期末持有的基金份额	—	—
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	—	—

注: 1、截至本报告期末, 基金管理人持有本基金 3,781,750.63 份。

2、基金管理人投资本基金相关的费用按本基金法律文件约定收取。

#### 7.4.10.5.2 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

份额单位: 份

##### 浦银稳健回报 6 个月持有债券 (FOF) A

关联方名称	本期末		上年度末	
	2024 年 12 月 31 日	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)	2023 年 12 月 31 日	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)
上海浦银安盛资产管理有限公司	19,676,308.54	42.28	19,676,308.54	46.18

注: 1. 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浦银稳健回报 6 个月持有债券 (FOF) C;

2. 除基金管理人之外的其他关联方投资本基金费用按照本基金法律文件约定收取。

#### 7.4.10.6 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		上年度可比期间	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
兴业银行-活期	1,460,516.17	5,622.68	265,871.33	3,705.11

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.7 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及上年度可比期间均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.10.8.2 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

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均无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。

#### 7.4.11 利润分配情况

注：本基金在本报告期内未进行过利润分配。

#### 7.4.12 期末（2024 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：根据中国证监会相关规定，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。证券投资基金获配的科创板股票及创业板股票需要锁定的，锁定期根据相关法规及交易所相关规定执行。证券投资基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起在法规规定的限售期内不得转让。证券投资基金对上述非公开发行股票的减持还需根据交易所相关规定执行。此外，证券投资基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

于 2024 年 12 月 31 日，本基金未持有因认购新发或增发证券而受上述规定约束的流通受限证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：于 2024 年 12 月 31 日，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 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。

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于 2024 年 12 月 31 日，本基金未持有因债券正回购交易而作为抵押的交易所债券。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：于 2024 年 12 月 31 日，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

本基金是债券型基金中基金，其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金、货币型基金中基金，低于混合型基金、混合型基金中基金、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(包含 ETF, LOF, QDII 基金，商品基金，香港互认基金，公开募集基础设施证券投资基金(以下简称“公募 REITs”))的基金份额，国内依法发行上市的股票(包括主板，创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)，债券(包括国债，央行票据，金融债券，企业债券，公司债券，中期票据，短期融资券，超短期融资券，次级债券，政府支持机构债，政府支持债券，地方政府债，可转换债券，可交换债券等)，资产支持证券，债券回购，银行存款(包括协议存款，定期存款及其他银行存款)，同业存单，货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金的基金份额的资产不低于基金资产的 80%，其中投资于债券型证券投资基金的比例不低于本基金资产的 80%；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。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在科学的风险管理的前提下，实现基金财产的安全和增值。

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

董事会下属的合规及审计委员会，负责对公司整体风险管理及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。

#### 7.4.13.2 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兴业银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于 2024 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投资和资产支持证券投资(2023 年 12 月 31 日：同)。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合

理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2024 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.3.1 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不超过被投资基金净资产的 20%，被投资基金净资产规模以最近定期报告披露的规模为准。本基金投资于一家公司发行的证券(不含本基金所投资的基金份额)市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券(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，其余亦可在银行间同业市场交易，基金销售机构申购、赎回，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。在本基金开放日，本基金投资于流通受限基金不高于本基金资产净值的 10%；本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2024 年 12 月 31 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 2024

年 12 月 31 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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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、债券投资等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
货币资金	1,460,516.17	-	-	-	1,460,516.17
结算备付金	90,915.70	-	-	-	90,915.70
存出保证金	8,858.55	-	-	-	8,858.55
交易性金融资产	2,831,389.39	-	-	49,069,925.15	51,901,314.54
应收申购款	-	-	-	31,009.71	31,009.71
<b>资产总计</b>	<b>4,391,679.81</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>49,100,934.86</b>	<b>53,492,614.67</b>
<b>负债</b>					
应付赎回款	-	-	-	7,030.88	7,030.88

应付管理人报酬	-	-	-	13,561.08	13,561.08
应付托管费	-	-	-	1,938.16	1,938.16
应付销售服务费	-	-	-	715.45	715.45
应交税费	-	-	-	7,646.28	7,646.28
其他负债	-	-	-	111,363.38	111,363.38
负债总计	-	-	-	142,255.23	142,255.23
利率敏感度缺口	4,391,679.81	-	-	48,958,679.63	53,350,359.44
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	265,871.33	-	-	-	265,871.33
存出保证金	1,466.50	-	-	-	1,466.50
交易性金融资产	2,639,283.07	-	-	42,497,633.54	45,136,916.61
应收股利	-	-	-	14,895.00	14,895.00
应收申购款	-	-	-	237.16	237.16
应收清算款	-	-	-	5,800,000.00	5,800,000.00
资产总计	2,906,620.90	-	-	48,312,765.70	51,219,386.60
负债					
应付赎回款	-	-	-	60,909.73	60,909.73
应付管理人报酬	-	-	-	9,762.35	9,762.35
应付托管费	-	-	-	1,560.39	1,560.39
应付销售服务费	-	-	-	1,932.62	1,932.62
应交税费	-	-	-	694.85	694.85
其他负债	-	-	-	110,219.06	110,219.06
负债总计	-	-	-	185,079.00	185,079.00
利率敏感度缺口	2,906,620.90	-	-	48,127,686.70	51,034,307.60

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2024 年 12 月 31 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 5.31%（2023 年 12 月 31 日：5.17%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2023 年 12 月 31 日：同）。

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于经中国证监会依法核准或注册的公

开募集的基金份额、证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金的基金份额的资产不低于基金资产的 80%，其中投资于债券型证券投资基金的比例不低于本基金资产的 80%；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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023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	-	-	2,130,520.00	4.17
交易性金融资产—基金投资	49,069,925.15	91.98	40,367,113.54	79.10
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	49,069,925.15	91.98	42,497,633.54	83.27

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准（附注 7.4.1）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 (2024 年 12 月 31 日)	上年度末 (2023 年 12 月 31 日)
分析	业绩比较基准上升 500 基点	1,999,916.42	232,674.54
	业绩比较基准下降 500 基点	-1,999,916.42	-232,674.54

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 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。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	49,069,925.15	42,497,633.54
第二层次	2,831,389.39	2,639,283.07
第三层次	-	-
合计	51,901,314.54	45,136,916.61

###### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

###### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

###### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

注: 于 2024 年 12 月 31 日, 本基金未持有第三层次以公允价值计量的金融工具 (2023 年 12 月 31 日: 同)。

#### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

注：于 2024 年 12 月 31 日，本基金无使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况（2023 年 12 月 31 日：同）。

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 年 12 月 31 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具（2023 年 12 月 31 日：无）。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2024 年 12 月 31 日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

### § 8 投资组合报告

#### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	—	—
	其中：股票	—	—
2	基金投资	49,069,925.15	91.73
3	固定收益投资	2,831,389.39	5.29
	其中：债券	2,831,389.39	5.29
	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	1,551,431.87	2.90
8	其他各项资产	39,868.26	0.07
9	合计	53,492,614.67	100.00

#### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有境内股票。

##### 8.2.2 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。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有股票。

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 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	601988	中国银行	542,100.00	1.06
2	600938	中国海油	374,159.00	0.73
3	300750	宁德时代	281,975.00	0.55
4	601398	工商银行	247,600.00	0.49
5	601088	中国神华	198,420.00	0.39
6	600519	贵州茅台	156,767.00	0.31

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

#### 8.4.2 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	600188	兖矿能源	566,361.00	1.11
2	601988	中国银行	563,800.00	1.10
3	600256	广汇能源	527,545.00	1.03
4	601088	中国神华	453,924.00	0.89
5	601898	中煤能源	418,936.00	0.82
6	600938	中国海油	326,532.00	0.64
7	601225	陕西煤业	286,819.00	0.56
8	300750	宁德时代	262,950.00	0.52
9	601398	工商银行	253,400.00	0.50
10	600519	贵州茅台	162,200.00	0.32
11	002176	江特电机	60,990.00	0.12
12	002192	融捷股份	39,404.00	0.08

注：“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 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	1,801,021.00
卖出股票收入（成交）总额	3,922,861.00

注：“买入股票的成本”和“卖出股票的收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交量）填列，不考虑相关交易费用。

### 8.5 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	2,831,389.39	5.31
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	2,831,389.39	5.31

## 8.6 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	019740	24 国债 09	17,000	1,721,477.75	3.23
2	019749	24 国债 15	10,000	1,007,761.64	1.89
3	102233	国债 2305	1,000	102,150.00	0.19

## 8.7 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。

## 8.8 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。

## 8.9 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。

## 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 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。

### 8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 8.12 本报告期投资基金情况

### 8.12.1 投资政策及风险说明

本基金为债券型基金中基金，主要投资于具有稳定票息收益的债券型基金，符合基金合同约定的投资政策、投资限制等要求。

本基金为债券型基金中基金，其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金、货币型基金中基金，低于混合型基金、混合型基金中基金、股票型基金和股票型基金中基金。

### 8.12.2 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	511360	海富通中证短融 ETF	交易型开放式(ETF)	90,000.00	10,002,330.00	18.75	否
2	006663	易方达安悦超短债券 C	契约型开放式	7,002,201.19	7,117,737.51	13.34	否
3	004388	鹏华丰享债券	契约型开放式	3,967,706.67	5,014,784.46	9.40	否
4	007295	天弘安益债券 A	契约型开放式	3,595,019.75	3,889,451.87	7.29	否
5	005159	华泰保兴尊合债券 A	契约型开放式	2,679,630.27	3,300,768.57	6.19	否
6	006475	国泰嘉睿纯债债券 A	契约型开放式	3,011,180.21	3,191,248.79	5.98	否
7	000147	易方达高等级信用债债券 A	契约型开放式	2,253,134.35	2,730,798.83	5.12	否
8	003223	广发景丰纯债 A	契约型开放式	2,321,054.82	2,706,814.13	5.07	否
9	100066	富国纯债债券发起式 A/B	契约型开放式	2,389,880.06	2,702,476.37	5.07	否
10	004089	汇添富鑫瑞债券 A	契约型开放式	1,647,713.65	1,901,791.09	3.56	否
11	004463	鹏华丰玉债券 A	契约型开放式	1,590,546.83	1,709,201.62	3.20	否
12	019539	鹏华丰玉债券 C	契约型开放式	962,927.30	1,018,391.91	1.91	否

13	510880	华泰柏瑞上证红利 ETF	交易型开放式(ETF)	200,000.00	670,200.00	1.26	否
14	515120	广发创新药 ETF	交易型开放式(ETF)	600,000.00	312,000.00	0.58	否
15	510330	华夏沪深300ETF	交易型开放式(ETF)	70,000.00	288,050.00	0.54	否
16	510050	华夏上证50ETF	交易型开放式(ETF)	100,000.00	273,800.00	0.51	否
17	159996	国泰中证全指家用电器 ETF	交易型开放式(ETF)	200,000.00	266,400.00	0.50	否
18	512690	酒 ETF	交易型开放式(ETF)	400,000.00	246,400.00	0.46	否
19	159949	华安创业板50ETF	交易型开放式(ETF)	250,000.00	240,250.00	0.45	否
20	510500	南方中证500ETF	交易型开放式(ETF)	40,000.00	232,440.00	0.44	否
21	512000	华宝中证全指证券公司 ETF	交易型开放式(ETF)	200,000.00	224,000.00	0.42	否
22	159736	天弘中证食品饮料 ETF	交易型开放式(ETF)	300,000.00	218,400.00	0.41	否
23	513180	华夏恒生科技 ETF(QDII)	交易型开放式(ETF)	350,000.00	213,850.00	0.40	否
24	159766	富国中证旅游主题 ETF	交易型开放式(ETF)	300,000.00	211,500.00	0.40	否

25	588000	华夏上证科创板 50 成份 ETF	交易型开放式 (ETF)	200,000.00	209,000.00	0.39	否
26	518880	华安黄金易 (ETF)	交易型开放式 (ETF)	30,000.00	177,840.00	0.33	否

### 8.12.3 报告期末基金持有的全部公开募集基础设施证券投资基金情况

注：本基金本报告期末未持有公开募集基础设施证券投资基金。

### 8.13 投资组合报告附注

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

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

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

报告期内，本基金投资的前十名股票不存在超出基金合同规定的备选股票库的情况。

#### 8.13.3 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	8,858.55
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	31,009.71
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	39,868.26

#### 8.13.4 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。

#### 8.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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(%)
浦银稳健回报 6 个月持有债券 (FOF) A	229	203,215.24	42,149,814.09	90.57	4,386,475.24	9.43
浦银稳健回报 6 个月持有债券 (FOF) C	269	11,369.74	-	-	3,058,461.15	100.00
合计	498	99,587.85	42,149,814.09	84.99	7,444,936.39	15.01

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例(%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	浦银稳健回报 6 个月持有债券 (FOF) A	38,244.01	0.08
	浦银稳健回报 6 个月持有债券 (FOF) C	-	-
	合计	38,244.01	0.08

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	浦银稳健回报 6 个月持有债券 (FOF) A	0
	浦银稳健回报 6 个月持有债券 (FOF) C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	浦银稳健回报 6 个月持有债券 (FOF) A	0~10
	浦银稳健回报 6 个月持有债券 (FOF) C	0
	合计	0~10

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	浦银稳健回报 6 个月持有债券(FOF)	浦银稳健回报 6 个月持有债券(FOF)
----	----------------------	----------------------

	A	C
基金合同生效日 (2022 年 3 月 23 日)	98,724,509.73	117,625,291.64
基金份额总额		
本报告期期初基金份额总额	42,611,712.28	6,841,177.47
本报告期基金总申购份额	20,916,738.90	137,625.37
减: 本报告期基金总赎回份额	16,992,161.85	3,920,341.69
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	46,536,289.33	3,058,461.15

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

2024 年 1 月 30 日至 2024 年 2 月 28 日, 基金管理人以通讯方式召开了基金份额持有人大会, 并审议通过了《关于持续运作浦银安盛稳健回报 6 个月持有期债券型基金中基金 (FOF) 的议案》, 详见本基金管理人于 2024 年 1 月 25 日发布的《关于浦银安盛稳健回报 6 个月持有期债券型基金中基金 (FOF) 以通讯方式召开基金份额持有人大会的公告》及其后续公告。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内, 基金管理人重大人事变动如下:

2024 年 7 月 1 日, 张弛先生新任公司总经理, 郁蓓华女士离任公司总经理。具体信息请参见基金管理人于 2024 年 7 月 2 日在规定媒介披露的《浦银安盛基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告》。

2024 年 12 月 13 日, 张健先生新任公司董事长, 谢伟先生离任公司董事长。具体信息请参见基金管理人于 2024 年 12 月 14 日在规定媒介披露的《浦银安盛基金管理有限公司关于董事长变更的公告》。

2024 年 12 月 16 日, 李宏宇先生离任公司副总经理兼首席市场营销官。具体信息请参见基金管理人于 2024 年 12 月 18 日在规定媒介披露的《浦银安盛基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更公告》。

报告截至日至报告批准送出日之间, 本基金管理人重大人事变动如下:

浦银安盛基金管理有限公司 2025 年第一次股东会会议审议通过, 选举张健先生、

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

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

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

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 11.3 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。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

### 11.5 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。

### 11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）改为聘请毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，本报告期应支付给毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 30,000.00 元人民币。目前该会计师事务所已为本基金提供 1 年审计服务。

### 11.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.7.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，管理人及其高级管理人员未有受到有权机关调查、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。

#### 11.7.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内，本基金托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中无受稽查或处罚等情况。

## 11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.8.1 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 (%)	
天风证券	1	5,078,563.00	88.73	3,005.10	90.43	-
国盛证券	1	645,319.00	11.27	317.88	9.57	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安 证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-

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

①基本情况：包括但不限于资本充足、近三年财务状况良好；主要股东经营稳健；具备高效、安全的通讯条件，能够提供有效交易执行服务。

②公司治理：公司治理完善，经营行为规范，具备健全的内控制度，合规管理体系，风险管理稳健。

③研究实力：有固定的研究机构和数量足够的专职研究团队；研究覆盖面广，能涵盖宏观经济、行业、公司等各项领域；研究报告分析严谨，观点独立、客观，并有完善的研究报告质量和合规保障机制。

#### (2) 选择证券经营机构交易单元的程序

对于符合选择证券公司参与证券交易标准的证券公司，经公司研究部评估，并递交公司券商佣金考核委员会审议批准后，可纳入公司备选池。在备选池中的证券公司方可参加券商考核，并被选择参与证券交易。公司会与被选中的证券公司签订协议，督察长及法律合规部在上述过程中履行合规审查职责。

2、本部分的数据统计时间区间与本报告的报告期一致。本公司网站披露的《浦银安盛基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年下半年度）》的报告期为 2024 年 7 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日。敬请投资者关注上述报告统计时间区间的口径差异。

#### 3、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长江证券、国泰君安证券交易单元。

### 11.8.2 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 (%)
天风证券	7,009,448.00	98.58	7,322,000.00	100.00	-	-	97,621,995.23	98.12
国盛证券	100,650.00	1.42	-	-	-	-	1,866,576.10	1.88
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-

### 11.9 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	浦银安盛稳健回报 6 个月持有期债券型基金中基金 (FOF) 2023 年第 4 季度报告	规定网站	2024 年 1 月 22 日
2	关于浦银安盛稳健回报 6 个月持有期债券型基金中基金 (FOF) 以通讯方式召开基金份额持有人大会的公告	报刊及规定网站	2024 年 1 月 25 日
3	关于浦银安盛稳健回报 6 个月持有期债券型基金中基金 (FOF) 以通讯方式召开基金份额持有人大会的第一次提示性公告	报刊及规定网站	2024 年 1 月 26 日
4	关于浦银安盛稳健回报 6 个月持有期债券型基	报刊及规定网站	2024 年 1 月 27 日

	金中基金 (FOF) 以通讯方式召开基金份额持有人大会的第二次提示性公告		
5	关于浦银安盛稳健回报 6 个月持有期债券型基金中基金 (FOF) 基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告	报刊及规定网站	2024 年 3 月 1 日
6	浦银安盛稳健回报 6 个月持有期债券型基金中基金 (FOF) 基金产品资料概要更新	规定网站	2024 年 3 月 22 日
7	浦银安盛稳健回报 6 个月持有期债券型基金中基金 (FOF) 招募说明书 (更新) 2024 年第 1 号	规定网站	2024 年 3 月 22 日
8	浦银安盛稳健回报 6 个月持有期债券型基金中基金 (FOF) 2023 年年度报告	规定网站	2024 年 3 月 30 日
9	浦银安盛稳健回报 6 个月持有期债券型基金中基金 (FOF) 2024 年第 1 季度报告	规定网站	2024 年 4 月 22 日
10	浦银安盛稳健回报 6 个月持有期债券型基金中基金 (FOF) 基金产品资料概要更新	规定网站	2024 年 6 月 26 日
11	浦银安盛稳健回报 6 个月持有期债券型基金中基金 (FOF) 2024 年第 2 季度报告	规定网站	2024 年 7 月 19 日
12	浦银安盛稳健回报 6 个月持有期债券型基金中基金 (FOF) 基金经理变更公告	报刊及规定网站	2024 年 8 月 10 日
13	浦银安盛稳健回报 6 个月持有期债券型基金中基金 (FOF) 基金产品资料概要更新	规定网站	2024 年 8 月 13 日
14	浦银安盛稳健回报 6 个月持有期债券型基金中基金 (FOF) 招募说明书 (更新) 2024 年第 2 号	规定网站	2024 年 8 月 13 日
15	浦银安盛稳健回报 6 个月持有期债券型基金中基金 (FOF) 2024 年中期报告	规定网站	2024 年 8 月 31 日
16	浦银安盛稳健回报 6 个月持有期债券型基金中基金 (FOF) 2024 年第 3 季度报告	规定网站	2024 年 10 月 25 日
17	浦银安盛基金管理有限公司关于旗下基金改聘会计师事务所公告	规定网站	2024 年 12 月 21 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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	20240101-20241231	19,676,308.54	3,781,750.63	0.00	23,458,059.17	47.30
	2	20240109-20240716	7,754,716.60	6,750,286.60	14,505,003.20	0.00	0.00
	3	20240926	4,845,522.07	4,267,339.97	0.00	9,112,862.04	18.37

**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。

**§ 13 备查文件目录****13.1 备查文件目录**

- 1、 中国证监会批准浦银安盛稳健回报 6 个月持有期债券型基金中基金 (FOF) 募集的文件
- 2、 浦银安盛稳健回报 6 个月持有期债券型基金中基金 (FOF) 基金合同
- 3、 浦银安盛稳健回报 6 个月持有期债券型基金中基金 (FOF) 招募说明书
- 4、 浦银安盛稳健回报 6 个月持有期债券型基金中基金 (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

**13.2 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。

**13.3 查阅方式**

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人。

客户服务中心电话：400-8828-999 或 021-33079999。

**浦银安盛基金管理有限公司**

2025 年 3 月 31 日