

**上银稳健优选 12 个月持有期混合型发起式基金中基金  
(FOF)**

**2023 年中期报告**

2023 年 06 月 30 日

基金管理人:上银基金管理有限公司

基金托管人:交通银行股份有限公司

送出日期:2023 年 08 月 31 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年08月30日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2023年01月01日起至2023年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遵规守信情况的说明	12
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遵规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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的真实、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	17
6.3 净资产（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	21
§7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48
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	48
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	48
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	48
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	48
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.12 本报告期投资基金情况	48

---

7.13 投资组合报告附注 .....	52
§8 基金份额持有人信息 .....	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	54
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 .....	54
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	55
§9 开放式基金份额变动 .....	55
§10 重大事件揭示 .....	56
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	56
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 .....	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	56
10.4 基金投资策略的改变 .....	56
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 .....	56
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	56
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 .....	56
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	57
10.9 其他重大事件 .....	58
§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....	59
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 .....	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	59
§12 备查文件目录 .....	59
12.1 备查文件目录 .....	59
12.2 存放地点 .....	60
12.3 查阅方式 .....	60

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	上银稳健优选12个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)	
基金简称	上银稳健优选12个月持有混合发起式(FOF)	
基金主代码	013397	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022年03月03日	
基金管理人	上银基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	13,432,932.66份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	上银稳健优选12个月持有混合发起式(FOF)A	上银稳健优选12个月持有混合发起式(FOF)C
下属分级基金的交易代码	013397	013398
报告期末下属分级基金的份额总额	10,799,937.58份	2,632,995.08份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将通过大类资产配置,投资于不同资产类别中的优质基金,在有效控制组合风险并保持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	本基金的投资策略包括资产配置策略、基金投资选择策略、股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略等。
业绩比较基准	上证国债指数收益率*70%+沪深300指数收益率*30%
风险收益特征	本基金为混合型基金中基金,理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金、股票型基金中基金,高于债券型基金、债券型基金中基金、货币市场基金、货币型基金中基金。

## 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		上银基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责 人	姓名	王玲	陆志俊
	联系电话	021-60232799	95559
	电子邮箱	ling.wang@boscam.com.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		021-60231999	95559
传真		021-60232779	021-62701216
注册地址		上海市浦东新区秀浦路2388号3幢528室	中国(上海)自由贸易试验区 银城中路188号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道1528号陆家嘴基金大厦9层	中国(上海)长宁区仙霞路18号
邮政编码		200122	200336
法定代表人		武俊	任德奇

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.boscam.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	上银基金管理有限公司	上海市浦东新区世纪大道1528号陆家嘴基金大厦9层

## §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

		报告期 (2023年01月01日-2023年06月30日)	
3.1.1 期间数据和指标		上银稳健优选12个 月持有混合发起式 (FOF) A	上银稳健优选12个 月持有混合发起式 (FOF) C
本期已实现收益		-495,553.62	-167,307.29
本期利润		-122,303.72	-10,995.71
加权平均基金份额本期利润		-0.0113	-0.0027
本期加权平均净值利润率		-1.15%	-0.28%
本期基金份额净值增长率		-1.17%	-1.32%
3.1.2 期末数据和指标		报告期末 (2023年06月30日)	
期末可供分配利润		-563,679.12	-147,405.01
期末可供分配基金份额利润		-0.0522	-0.0560
期末基金资产净值		10,407,043.23	2,527,065.45
期末基金份额净值		0.9636	0.9598
3.1.3 累计期末指标		报告期末 (2023年06月30日)	
基金份额累计净值增长率		-3.64%	-4.02%

注：1、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。

2、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（为期末余额，不是当期发生数）。

3、上述基金业绩指标不包括基金份额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。

## 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

上银稳健优选12个月持有混合发起式 (FOF) A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标	业绩比较 基准收益	业绩比较 基准收益	①-③	②-④

		准差②	率③	率标准差 ④		
过去一个月	1.40%	0.32%	0.67%	0.25%	0.73%	0.07%
过去三个月	-2.46%	0.34%	-0.56%	0.24%	-1.90%	0.10%
过去六个月	-1.17%	0.32%	1.36%	0.25%	-2.53%	0.07%
过去一年	-5.33%	0.33%	-1.80%	0.29%	-3.53%	0.04%
自基金合同 生效起至今	-3.64%	0.31%	-1.33%	0.35%	-2.31%	-0.04%

## 上银稳健优选12个月持有混合发起式 (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
过去一个月	1.38%	0.32%	0.67%	0.25%	0.71%	0.07%
过去三个月	-2.53%	0.34%	-0.56%	0.24%	-1.97%	0.10%
过去六个月	-1.32%	0.32%	1.36%	0.25%	-2.68%	0.07%
过去一年	-5.62%	0.33%	-1.80%	0.29%	-3.82%	0.04%
自基金合同 生效起至今	-4.02%	0.31%	-1.33%	0.35%	-2.69%	-0.04%

注：本基金的业绩比较基准为上证国债指数收益率\*70%+沪深300指数收益率\*30%。

### 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

上银稳健优选12个月持有混合发起式(FOF)A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2022年03月03日-2023年06月30日)



上银稳健优选12个月持有混合发起式(FOF)C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2022年03月03日-2023年06月30日)



注：本基金合同生效日为2022年3月3日，自基金合同生效日起6个月内为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

上银基金管理有限公司经中国证券监督管理委员会批准，于2013年08月30日正式成立，股东为上海银行股份有限公司，注册资本为3亿元人民币，注册地上海。截至2023年06月30日，公司管理的基金共有51只，分别是：上银慧财宝货币市场基金、上银新兴价值成长混合型证券投资基金、上银慧添利债券型证券投资基金、上银慧盈利货币市场基金、上银鑫达灵活配置混合型证券投资基金、上银慧增利货币市场基金、上银聚增富定期开放债券型发起式证券投资基金、上银慧佳盈债券型证券投资基金、上银聚鸿益三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、上银慧祥利债券型证券投资基金、上银中债1-3年农发行债券指数证券投资基金、上银未来生活灵活配置混合型证券投资基金、上银政策性金融债债券型证券投资基金、上银鑫卓混合型证券投资基金、上银慧永利中短期债券型证券投资基金、上银慧丰利债券型证券投资基金、上银可转债精选债券型证券投资基金、上银中债1-3年国开行债券指数证券投资基金、上银聚永益一年定期开放债券型发起式证券投资基金、上银聚德益一年定期开放债券型发起式证券投资基金、上银中证500指数增强型证券投资基金、上银聚远盈42个月定期开放债券型证券投资基金、上银内需增长股票型证券投资基金、上银核心成长混合型证券投资基金、上银鑫恒混合型证券投资基金、上银聚远鑫87个月定期开放债券型证券投资基金、上银慧恒收益增强债券型证券投资基金、上银医疗健康混合型证券投资基金、上银慧兴盈债券型证券投资基金、上银丰益混合型证券投资基金、上银科技驱动双周定期可赎回混合型证券投资基金、上银慧嘉利债券型证券投资基金、上银鑫尚稳健回报6个月持有期混合型证券投资基金、上银慧鼎利债券型证券投资基金、上银中债5-10年国开行债券指数证券投资基金、上银恒泰稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、上银高质量优选9个月持有期混合型证券投资基金、上银慧尚6个月持有期混合型证券投资基金、上银价值增长3个月持有期混合型证券投资基金、上银稳健优选12个月持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、上银新能源产业精选混合型发起式证券投资基金、上银聚顺益一年定期开放债券型发起式证券投资基金、上银恒享平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、上银聚恒益一年定期开放债券型发起式证券投资基金、上银慧享利30天滚动持有中短债债券型发起式证券投资基金、上银慧信利三个月定期开放债券型证券投资基金、上银慧鑫利债券型证券投资基金、上银聚嘉益一年定期开放债券型发起式证券投资基金、上银中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金、上银聚合益一年定期开放债券型发起式证券投资基金以及上银恒睿养老目标日期2045三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)。

#### 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	说明

		任职日期	离任日期	业年限	
吴伟	资产配置部副总监、基金经理	2022-03-03	-	12.5年	博士研究生，曾任浙江大学博士后研究员，平安资产管理有限责任公司量化研究员，信泰人寿保险股份有限公司资产管理中心配置室负责人，中国太平洋人寿保险股份有限公司账户管理高级经理等职。2021年9月担任上银恒泰稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)基金经理，2022年3月担任上银稳健优选12个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)基金经理，2022年6月担任上银恒享平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)基金经理，2023年6月担任上银恒睿养老目标日期2045三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)基金经理。
王振雄	基金经理	2022-03-11	-	9.5年	博士研究生，曾任光大证券理财经理，中国太平洋人寿保险股份有限公司账户经理等职。2021年9月担任上银恒泰稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)基金经理，2022年3月担任上银

				稳健优选12个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)基金经理, 2022年6月担任上银恒享平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)基金经理, 2023年6月担任上银恒睿养老目标日期2045三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)基金经理。
--	--	--	--	--

注: 1、任职日期和离任日期一般情况下指公司作出决定之日; 若该基金经理自基金合同生效日起即任职, 则任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内, 本基金管理人严格遵循《中华人民共和国证券投资基金法》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、取信于社会的原则管理和运用基金资产, 为基金份额持有人谋求最大利益。报告期内, 基金投资管理符合有关法规和基金合同的约定, 无违法违规、未履行基金合同承诺或损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内, 本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》相关规定及公司内部的公平交易管理制度, 通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易的公平执行, 未发现不同投资组合之间存在非公平交易的情况。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内, 本基金管理人管理的所有投资组合不存在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%的情况, 且不存在其他可能导致非公平交易和利益输送的异常交易行为。

#### 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

在报告期内，本基金依据战术资产配置模型，总体维持权益类资产相对目标配置比例的一定超配水平。在基金优选策略方面，基本维持权益类资产在行业板块、估值、市值等多维度的相对平衡，并在市场结构化行情演绎时，通过相关主题ETF基金的量化配置策略进行调整。固收投资部分，受报告期内债券市场普遍上涨影响，本报告期内债券型基金势头良好。我们依然坚持以票息策略和波段交易策略为主的配置策略，适当加长了组合久期，并严格控制信用风险和流动性风险。组合构建方面，在满足基金相对均衡配置和行业风险控制要求的前提下，继续丰富完善组合策略，以更好适应市场不同风格。我们降低了主动管理基金策略的配置比例，提高了量化ETF策略、量化指数增强等策略的配置比例，并对整体组合持续进行迭代优化。总体上，本基金力争在资产配置和基金选取层面都获得积极管理创造的超额收益，力争能适应市场变化，以提升FOF组合的风险调整后收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末上银稳健优选12个月持有混合发起式(FOF)A基金份额净值为0.9636元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-1.17%，同期业绩比较基准收益率为1.36%；截至报告期末上银稳健优选12个月持有混合发起式(FOF)C基金份额净值为0.9598元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-1.32%，同期业绩比较基准收益率为1.36%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年以来宏观经济情况同比有所改善，市场也出现了经济复苏的预期，但边际上存在国内需求不足的问题，故A股市场整体宽幅震荡，同时出现了结构性行情，部分热点行业、板块涨幅较高。展望下半年，我们预期政府将加大宏观政策调控力度，经济复苏进程也将加快。当前A股证券市场整体估值仍处于历史上较低分位数，股债性价比较高。在市场流动性充裕，经济边际改善，估值较低的大背景下，我们认为下半年市场有望有一定表现。具体到行业上，下半年市场我们将关注两条主线，一是受益于扩大内需，消费复苏的食品饮料、家电家居、汽车、电子、酒店、旅游等消费板块，以及上游供给格局在变化的有色、煤炭等资源板块；二是符合构建现代化产业体系，满足高质量发展要求的数字经济与先进制造业，比如人工智能、精密机械、半导体、新能源等板块。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格按照本公司制订的《上银基金管理有限公司估值业务管理制度》、《上银基金管理有限公司基金估值委员会议事规则》以及相关法律法规的规定，有效地控制基金估值流程。公司估值委员会成员包括分管投资高管、督察长、分管运营高管、投资研究部门负责人、交易部负责人、监察稽核部负责人、风险管理部负责人、基金运营部负责人及相关专业代表等相关专业人士组成。估值委员会主要负责基

金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允、合理，防止估值被歪曲进而对基金持有人产生不利影响。在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后或基金资产在采用新投资策略和新品种时，估值委员会应评价现有估值政策和程序的适用性，并在不适用的情况下，及时召开估值委员会修订相关估值方法，以确保其持续适用。涉及估值政策的变更均须经估值委员会决议批准后执行。

在每个估值日，本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金投资品种进行估值，确定证券投资基金的份额净值。基金管理人对基金资产进行估值后，将估值结果发送基金托管人。基金托管人则按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，复核无误后由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定予以对外公布。

上述参与估值流程人员均具有估值业务所需的专业胜任能力及相关工作经历。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

#### 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

本基金为发起式基金，截至本报告期末，基金合同生效不满三年，暂不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条第一款的规定。

### §5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，基金托管人在上银稳健优选12个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

#### 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

本报告期内，上银基金管理有限公司在上银稳健优选12个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)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、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内,上银基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关上银稳健优选12个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## §6 半年度财务会计报告(未经审计)

### 6.1 资产负债表

会计主体: 上银稳健优选12个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)

报告截止日: 2023年06月30日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
<b>资产:</b>			
银行存款	6.4.7.1	1,100,347.17	1,356,251.00
结算备付金		32,603.22	5,467.67
存出保证金		1,097.46	424.41
交易性金融资产	6.4.7.2	11,923,223.11	14,661,029.00
其中: 股票投资		764,558.00	-
基金投资		11,158,665.11	14,661,029.00
债券投资		-	-
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	-	-
债权投资		-	-
其中: 债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-

应收清算款		17,422.38	-
应收股利		0.22	0.44
应收申购款		20.00	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		13,074,713.56	16,023,172.52
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b> 2023年06月30日	<b>上年度末</b> 2022年12月31日
<b>负债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		59,386.30	-
应付赎回款		18,445.15	-
应付管理人报酬		8,541.36	10,823.54
应付托管费		1,969.92	2,431.71
应付销售服务费		647.02	1,342.12
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	51,615.13	145,000.00
负债合计		140,604.88	159,597.37
<b>净资产:</b>			
实收基金	6.4.7.7	13,432,932.66	16,283,471.14
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-498,823.98	-419,895.99
净资产合计		12,934,108.68	15,863,575.15
负债和净资产总计		13,074,713.56	16,023,172.52

注：报告截止日2023年06月30日，基金份额总额13,432,932.66份，其中上银稳健优选12个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)A类基金份额净值0.9636元，基金份额10,799,937.58份；上银稳健优选12个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)C类基金份额净值0.9598元，基金份额2,632,995.08份。

## 6.2 利润表

会计主体：上银稳健优选12个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年01月01日至 2023年06月30日	上年度可比期间 2022年03月03日(基金 合同生效日)至2022年 06月30日
<b>一、营业收入</b>		-11,398.25	399,382.91
1.利息收入		5,829.79	16,060.76
其中：存款利息收入	6.4.7.9	5,829.79	16,060.76
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-” 填列)		-546,789.52	81,589.04
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-81,849.44	-
基金投资收益	6.4.7.11	-507,867.14	-29,694.98
债券投资收益	6.4.7.12	-	-
资产支持证券投资 收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-

股利收益	6.4.7.16	42,927.06	111,284.02
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)	6.4.7.17	529,561.48	301,733.11
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.18	-	-
<b>减: 二、营业总支出</b>		121,901.18	114,452.31
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	57,961.57	42,212.59
2. 托管费	6.4.10.2.2	13,335.59	9,803.48
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	5,911.59	5,199.84
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		99.54	-
8. 其他费用	6.4.7.21	44,592.89	57,236.40
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		-133,299.43	284,930.60
<b>减: 所得税费用</b>		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		-133,299.43	284,930.60
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-133,299.43	284,930.60

### 6.3 净资产(基金净值)变动表

会计主体：上银稳健优选12个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	本期			
	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)	16,283,471.14	-	-419,895.99	15,863,575.15
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)	16,283,471.14	-	-419,895.99	15,863,575.15
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-2,850,538.48	-	-78,927.99	-2,929,466.47
(一)、综合收益总额	-	-	-133,299.43	-133,299.43
(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)	-2,850,538.48	-	54,371.44	-2,796,167.04
其中：1.基金申购款	52,436.81	-	-396.94	52,039.87
2.基金赎回款	-2,902,975.29	-	54,768.38	-2,848,206.91
(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)	13,432,932.66	-	-498,823.98	12,934,108.68
项目	上年度可比期间			
	2022年03月03日(基金合同生效日)至2022年06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)	-	-	-	-
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)	16,215,045.10	-	-	16,215,045.10
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	2,666.69	-	284,954.69	287,621.38
(一)、综合收益总额	-	-	284,930.60	284,930.60
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值	2,666.69	-	24.09	2,690.78

变动数(净值减少以“-”号填列)				
其中: 1.基金申购款	2,666.69	-	24.09	2,690.78
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)	16,217,711.79	-	284,954.69	16,502,666.48

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:

尉迟平

陈士琛

刘漠

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

上银稳健优选12个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于准予上银稳健优选12个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)注册的批复》(证监许可[2021]1848号文)核准,由上银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《上银稳健优选12个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,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16,210,482.20元,业经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)毕马威华振验字第2200426号验资报告

予以验证。经向中国证监会备案,《上银稳健优选12个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)基金合同》于2022年3月3日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为16,215,045.10份基金份额,其中认购资金利息折合4,562.90份基金份额。本基金的基金管理人为上银基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

本基金对每份基金份额设置12个月的最短持有期。在每份基金份额的最短持有期到期日前(不含当日),基金份额持有人不能对该基金份额提出赎回或转换转出申请;每份基金份额的最短持有期到期日起(含当日),基金份额持有人可对该基金份额提出赎回申请。

本基金为发起式基金,发起资金认购部分为10,000,000.00份基金份额,发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于3年。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《上银稳健优选12个月持有期混合型发起式基金中基金(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,包括经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金(包括QDII基金和香港互认基金)、国内依法发行上市的股票(包括创业板以及其他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、地方政府债、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、可交换债券、中期票据、短期融资券等)、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)、同业存单以及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)。本基金投资经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金的比例不低于基金资产的80%,对权益类资产(包括股票、股票型基金和满足条件的混合型基金)的目标配置比例为基金资产的10%-50%。本基金持有的现金或者到期日在一年以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:上证国债指数收益率×70%+沪深300指数收益率×30%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《上银稳健优选12个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合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》及附注6.4.2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的要求，真实、完整地反映了本基金2023年6月30日的财务状况、2023年1月1日至2023年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

#### 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一致。

#### 6.4.5 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管理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06月30日
活期存款	1,100,347.17
等于： 本金	1,100,095.68
加： 应计利息	251.49
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	1,100,347.17

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2023年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	751,705.46	-	764,558.00	12,852.54
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	10,944,142.54	-	11,158,665.11	214,522.57
其他	-	-	-	-
合计	11,695,848.00	-	11,923,223.11	227,375.11

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

##### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

本基金本报告期内无按预期信用损失一般模型计提的减值准备。

#### 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末

	2023年06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	7,022.24
其中: 交易所市场	7,022.24
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用-审计费	24,795.19
预提费用-信息披露费	19,797.70
合计	51,615.13

#### 6.4.7.7 实收基金

##### 6.4.7.7.1 上银稳健优选12个月持有混合发起式(FOF) A

金额单位: 人民币元

项目 (上银稳健优选12个月持有混合发起式(FOF) A)	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	10,888,741.87	10,888,741.87
本期申购	23,887.56	23,887.56
本期赎回(以“-”号填列)	-112,691.85	-112,691.85
本期末	10,799,937.58	10,799,937.58

##### 6.4.7.7.2 上银稳健优选12个月持有混合发起式(FOF) C

金额单位: 人民币元

项目 (上银稳健优选12个月持有混合发起式(FOF) C)	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	5,394,729.27	5,394,729.27
本期申购	28,549.25	28,549.25
本期赎回(以“-”号填列)	-2,790,283.44	-2,790,283.44

本期末	2,632,995.08	2,632,995.08
-----	--------------	--------------

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.8 未分配利润

##### 6.4.7.8.1 上银稳健优选12个月持有混合发起式(FOF) A

单位：人民币元

项目 (上银稳健优选12个月 持有混合发起式(FO F) A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-69,848.06	-202,187.38	-272,035.44
本期利润	-495,553.62	373,249.90	-122,303.72
本期基金份额交易产 生的变动数	1,722.56	-277.75	1,444.81
其中：基金申购款	-227.87	144.93	-82.94
基金赎回款	1,950.43	-422.68	1,527.75
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-563,679.12	170,784.77	-392,894.35

##### 6.4.7.8.2 上银稳健优选12个月持有混合发起式(FOF) C

单位：人民币元

项目 (上银稳健优选12个月 持有混合发起式(FO F) C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-47,927.00	-99,933.55	-147,860.55
本期利润	-167,307.29	156,311.58	-10,995.71
本期基金份额交易产 生的变动数	67,829.28	-14,902.65	52,926.63
其中：基金申购款	-453.22	139.22	-314.00
基金赎回款	68,282.50	-15,041.87	53,240.63
本期已分配利润	-	-	-

本期末	-147,405.01	41,475.38	-105,929.63
-----	-------------	-----------	-------------

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
活期存款利息收入	5,763.26
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	61.90
其他	4.63
合计	5,829.79

注：其他为结算保证金利息收入。

#### 6.4.7.10 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01月01日至2023年06月30日
卖出股票成交总额	3,372,065.00
减：卖出股票成本总额	3,442,924.31
减：交易费用	10,990.13
买卖股票差价收入	-81,849.44

#### 6.4.7.11 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
卖出/赎回基金成交总额	20,566,246.80
减：卖出/赎回基金成本总额	21,029,968.34
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	995.39
减：交易费用	43,150.21
基金投资收益	-507,867.14

**6.4.7.12 债券投资收益**

本基金本报告期内无债券投资收益。

**6.4.7.13 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.14 贵金属投资收益**

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

**6.4.7.15 衍生工具收益**

本基金本报告期内无衍生工具收益。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
股票投资产生的股利收益	4,865.90
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	38,061.16
合计	42,927.06

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
1.交易性金融资产	529,561.48
——股票投资	12,852.54
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	516,708.94
——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	529,561.48

#### 6.4.7.18 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

#### 6.4.7.19 持有基金产生的费用

项目	本期费用 2023年01月01日至2023年06月30日
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	7.38
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	53,610.77
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	10,916.26

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。

#### 6.4.7.20 信用减值损失

本基金在本报告期内无信用减值损失。

#### 6.4.7.21 其他费用

单位: 人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	19,797.70
证券出借违约金	-

合计	44,592.89
----	-----------

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期内，与本基金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
上银基金管理有限公司（以下简称“上银基金”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金直销机构
交通银行股份有限公司（以下简称“交通银行”）	基金托管人、基金代销机构
上海银行股份有限公司（以下简称“上海银行”）	基金管理人的股东、基金代销机构

注：下述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日 至2023年06月30 日	上年度可比期间 2022年03月03日（基金合同 生效日）至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	57,961.57	42,212.59
其中：支付销售机构的客户维护费	8,789.72	7,390.59

注：1. 本基金投资于基金管理人所管理的其他基金部分不收取管理费。支付基金管理人上银基金的管理人报酬按前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金管理人管理的其他基金部分后的余额的0.80%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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  $\times$  0.80% / 当年天数。

2. 本基金本报告期无因投资于基金管理人所管理的其他基金而已在管理费计算基数中扣除部分对应的管理费金额。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日 至2023年06月30 日	上年度可比期间 2022年03月03日（基金合同生 效日）至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	13,335.59	9,803.48

注：1. 本基金投资于基金托管人所托管的其他基金部分不收取托管费。支付基金托管人交通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0.20%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  $\times$  0.20% / 当年天数。

##### 6.4.10.2.3 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		
	2023年01月01日至2023年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	上银稳健优选12个月持有混合发起式(FOF)A	上银稳健优选12个月持有混合发起式(FOF)C	合计
上海银行	0.00	28.72	28.72
交通银行	0.00	8.67	8.67
合计	0.00	37.39	37.39
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2022年03月03日(基金合同生效日)至2022年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	上银稳健优选12个月持有混合发起式(FOF)A	上银稳健优选12个月持有混合发起式(FOF)C	合计
交通银行	0.00	15.47	15.47
上银基金	0.00	0.00	0.00
上海银行	0.00	19.24	19.24
合计	0.00	34.71	34.71

注:支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值0.30%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给上银基金,再由上银基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为:

日销售服务费=前一日C类基金份额的基金资产净值 X 0.30%/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

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。

#### 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

本基金在本报告期内及上年度可比期间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。

#### 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

本基金在本报告期内及上年度可比期间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。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

上银稳健优选12个月持有混合发起式 (FOF) A

份额单位：份

项目	本期 2023年01月01 日至2023年06 月30日	上年度可比期间 2022年03月03日 (基 金合同生效日)至2022年0 6月30日
基金合同生效日 (2022年03月03日) 持有的基金份额	0.00	10,000,000.00
报告期初持有的基金份额	10,000,000.00	0.00
报告期内申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期内因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期内赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	74.44%	61.66%

上银稳健优选12个月持有混合发起式 (FOF) C

份额单位：份

项目	本期 2023年01月01 日至2023年06 月30日	上年度可比期间 2022年03月03日 (基 金合同生效日)至2022年0 6月30日
基金合同生效日 (2022年03月03日) 持有的基金份额	0.00	0.00

报告期初持有的基金份额	0.00	0.00
报告期内申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期内因拆分变动份额	0.00	0.00
减: 报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%

注: 1. 固有资金投资持有本基金A类基金份额10,000,000.00份; 报告期末持有的基金份额占比为占基金总份额的比例的74.44%。

2. 本基金管理人运用固有资金投资本基金所采用的费率适用招募说明书规定的费率结构。

#### 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

于本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位: 人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2023年01月01日至2023年06月30日	期末余额	2022年03月03日(基金合同生效日)至2022年06月30日	当期利息收入
交通银行	1,100,347.17	5,763.26	1,622,609.97	16,054.72

注: 本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管, 按银行同业利率或约定利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

##### 6.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

本基金本报告期及上年度可比期间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。

#### **6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金**

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### **6.4.12 期末（2023年06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**

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### **6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### **6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

###### **6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

本基金本报告期内无从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

###### **6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

本基金本报告期内无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### **6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券**

本基金本报告期内无参与转融通证券出借业务的证券。

#### **6.4.13 金融工具风险及管理**

##### **6.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：信用风险、流动性风险和市场风险。

本基金在下文主要论述上述风险敞口及其形成原因；风险管理目标、政策和过程以及计量风险的方法等。

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是使本基金在风险和收益之间取得适当的平衡，以实现"风险和收益相匹配"的风险收益目标。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人已制定了政策和程序来辨别和分析这些风险，设定适当的风险限额并设计相应的内部控制程序，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人奉行全面风险管理体系建设，在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，设定最高风险承受度以及审议批准防范风险和内部控制的政策等；在业务操作层面风险管理职责主要由风险管理部和其下属风险管理人负责，

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。风险管理部向督察长负责。

本基金管理人建立了以风险管理委员会为核心的，由督察长、风险管理部、相关职能部门和业务部门构成的风险管理架构体系。

#### **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交通银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，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以及具有证券投资基金管理业务资格的销售机构办理，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。

##### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的债券投资。

##### **6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

##### **6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

##### **6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的债券投资。

##### **6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

##### **6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

### 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依据基金合同约定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。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短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。

本基金投资于一家公司发行的证券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，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。

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、结算备付金和存出保证金等。

###### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年0 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	1,100,347.17	-	-	-	1,100,347.17
结算备付金	32,603.22	-	-	-	32,603.22
存出保证金	1,097.46	-	-	-	1,097.46
交易性金融资产	-	-	-	11,923,223.11	11,923,223.11
应收清	-	-	-	17,422.38	17,422.38

算款					
应收股利	-	-	-	0.22	0.22
应收申购款	-	-	-	20.00	20.00
资产总计	1,134,047.85	-	-	11,940,665.71	13,074,713.56
负债					
应付清算款	-	-	-	59,386.30	59,386.30
应付赎回款	-	-	-	18,445.15	18,445.15
应付管理人报酬	-	-	-	8,541.36	8,541.36
应付托管费	-	-	-	1,969.92	1,969.92
应付销售服务费	-	-	-	647.02	647.02
其他负债	-	-	-	51,615.13	51,615.13
负债总计	-	-	-	140,604.88	140,604.88
利率敏感度缺口	1,134,047.85	-	-	11,800,060.83	12,934,108.68
上年度末 2022年1 2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	1,356,251.00	-	-	-	1,356,251.00
结算备付金	5,467.67	-	-	-	5,467.67
存出保证金	424.41	-	-	-	424.41
交易性金融资产	-	-	-	14,661,029.00	14,661,029.00
应收股利	-	-	-	0.44	0.44
资产总	1,362,143.08	-	-	14,661,029.44	16,023,172.52

计					
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	10,823.54	10,823.54
应付托管费	-	-	-	2,431.71	2,431.71
应付销售服务费	-	-	-	1,342.12	1,342.12
其他负债	-	-	-	145,000.00	145,000.00
负债总计	-	-	-	159,597.37	159,597.37
利率敏感度缺口	1,362,143.08	-	-	14,501,432.07	15,863,575.15

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。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2023年6月30日，本基金未持有交易性债券投资(2022年12月31日：同)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金份额、证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金的比例为不低于基金净资产的80%。

此外，本基金的基金管理人定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，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06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	764,558.00	5.91	-	-
交易性金融资产—基金投资	11,158,665.11	86.27	14,661,029.00	92.42
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
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	11,923,223.11	92.18	14,661,029.00	92.42

#### 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06月30日	上年度末 2022年12月31日
	1.业绩比较基准上升5%	382,497.70	368,798.37
	2.业绩比较基准下降5%	-382,497.70	-368,798.37

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

以公允价值计量的资产和负债：公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 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

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	11,923,223.11	14,661,029.00
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	11,923,223.11	14,661,029.00

##### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

于本报告期间，本基金无公允价值所属层次间的重大变动。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2023年6月30日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 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工具主要包括应收款项、买入返售金融资产、卖出回购金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于2023年6月30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。

### §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	764,558.00	5.85
	其中：股票	764,558.00	5.85
2	基金投资	11,158,665.11	85.35
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	1,132,950.39	8.67
8	其他各项资产	18,540.06	0.14
9	合计	13,074,713.56	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

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	61,500.00	0.48
C	制造业	632,668.00	4.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	70,390.00	0.54
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	764,558.00	5.91

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

### 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	601088	中国神华	2,000	61,500.00	0.48
2	688223	晶科能源	3,400	47,804.00	0.37
3	000333	美的集团	800	47,136.00	0.36
4	002865	钧达股份	300	45,759.00	0.35
5	601390	中国中铁	5,500	41,690.00	0.32
6	600933	爱柯迪	1,700	39,593.00	0.31
7	603179	新泉股份	800	35,112.00	0.27
8	601865	福莱特	900	34,659.00	0.27
9	688598	金博股份	200	34,300.00	0.27
10	000858	五粮液	200	32,714.00	0.25
11	603816	顾家家居	800	30,520.00	0.24
12	002032	苏泊尔	600	30,000.00	0.23
13	002271	东方雨虹	1,100	29,986.00	0.23

14	603833	欧派家居	300	28,740.00	0.22
15	601668	中国建筑	5,000	28,700.00	0.22
16	603308	应流股份	1,300	23,790.00	0.18
17	002129	TCL中环	700	23,240.00	0.18
18	300724	捷佳伟创	200	22,470.00	0.17
19	002648	卫星化学	1,500	22,440.00	0.17
20	603338	浙江鼎力	400	22,404.00	0.17
21	603806	福斯特	600	22,314.00	0.17
22	002466	天齐锂业	300	20,973.00	0.16
23	002372	伟星新材	1,000	20,540.00	0.16
24	600481	双良节能	1,300	18,174.00	0.14

## 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	601398	工商银行	227,150.00	1.43
2	601088	中国神华	226,769.00	1.43
3	601668	中国建筑	194,110.00	1.22
4	600938	中国海油	147,826.00	0.93
5	601318	中国平安	145,607.00	0.92
6	601857	中国石油	144,721.00	0.91
7	002372	伟星新材	127,379.00	0.80
8	000333	美的集团	126,658.00	0.80
9	603179	新泉股份	119,307.00	0.75
10	001979	招商蛇口	117,394.77	0.74
11	002271	东方雨虹	110,427.00	0.70
12	000858	五 粮 液	104,116.00	0.66
13	601390	中国中铁	92,695.00	0.58
14	002032	苏 泊 尔	92,086.00	0.58

15	603816	顾家家居	81,671.00	0.51
16	603833	欧派家居	78,292.00	0.49
17	600011	华能国际	77,616.00	0.49
18	600027	华电国际	77,480.00	0.49
19	601928	凤凰传媒	76,350.00	0.48
20	002648	卫星化学	74,105.00	0.47

注：本项及下项7.4.2, 7.4.3 的"买入金额"（或"买入股票成本"）、"卖出金额"（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。

#### 7.4.2 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	601398	工商银行	214,120.00	1.35
2	601668	中国建筑	166,375.00	1.05
3	601088	中国神华	165,223.00	1.04
4	601857	中国石油	142,751.00	0.90
5	600938	中国海油	137,437.00	0.87
6	601318	中国平安	131,202.00	0.83
7	001979	招商蛇口	119,353.00	0.75
8	002372	伟星新材	108,446.00	0.68
9	603179	新泉股份	85,064.00	0.54
10	002271	东方雨虹	80,093.00	0.50
11	000333	美的集团	79,225.00	0.50
12	600027	华电国际	78,312.00	0.49
13	600011	华能国际	77,144.00	0.49
14	000858	五粮液	72,410.00	0.46
15	601928	凤凰传媒	72,080.00	0.45
16	000933	神火股份	63,435.00	0.40
17	002032	苏泊尔	59,852.00	0.38
18	601601	中国太保	56,972.00	0.36

19	600048	保利发展	56,732.00	0.36
20	002050	三花智控	56,420.00	0.36

#### 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	4,194,629.77
卖出股票收入（成交）总额	3,372,065.00

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资范围未包括股指期货，无相关投资政策。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

#### 7.12 本报告期投资基金情况

##### 7.12.1 投资政策及风险说明

本基金属于混合型基金中基金 (FOF)，主要投资于股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币市场基金等基金产品。本基金将通过大类资产配置，投资于不同资产类别中的优质基金，在有效控制组合风险并保持良好流动性的前提下，力争实现基金资产

的长期稳定增值。本基金长期预期风险和预期收益水平低于股票型基金、股票型基金中基金，高于债券型基金、债券型基金中基金、货币市场基金、货币型基金中基金。

### 7.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	217022	招商产业债券A	契约型开放式	799,090.75	1,371,239.73	10.60	否
2	003949	兴全稳泰债券A	契约型开放式	684,713.67	775,301.29	5.99	否
3	007901	汇添富中短债A	契约型开放式	683,773.06	725,278.08	5.61	否
4	100058	富国产业债债券A/B	契约型开放式	495,317.84	590,270.27	4.56	否
5	511270	10年地债	交易型开放式	5,400.00	589,388.40	4.56	否
6	519782	交银裕隆纯债债券A	契约型开放式	414,124.79	542,834.77	4.20	否
7	008269	大成睿享混合A	契约型开放式	325,419.00	466,878.64	3.61	否
8	513300	纳斯达克	交易型开放式	317,000.00	435,241.00	3.37	否
9	000979	景顺长城沪港深精选股票	契约型开放式	203,314.37	384,670.79	2.97	否
10	004200	博时富瑞纯债债券A	契约型开放式	351,282.07	369,618.99	2.86	否
11	002670	万家沪深300指	契约型	265,763.61	350,276.44	2.71	否

		数增强A	开放式				
12	007143	国投瑞银沪深300指数量化增强A	契约型开放式	279,785.70	348,109.37	2.69	否
13	511360	短融ETF	交易型开放式	2,700.00	290,241.90	2.24	否
14	006551	中庚价值领航混合	契约型开放式	116,591.17	261,747.18	2.02	否
15	513500	标普500	交易型开放式	166,000.00	249,498.00	1.93	否
16	004672	华夏短债债券A	契约型开放式	192,323.99	202,497.93	1.57	否
17	161222	国投瑞银瑞利混合 (LOF) A	契约型开放式	83,859.11	195,140.15	1.51	否
18	001645	国泰大健康股票A	契约型开放式	65,812.98	190,133.70	1.47	否
19	001955	中欧养老混合A	契约型开放式	56,699.76	183,406.71	1.42	否
20	510300	300ETF	交易型开放式	43,000.00	166,926.00	1.29	否
21	004614	鹏扬利泽债券A	契约型开放式	153,607.40	161,748.59	1.25	否
22	007584	丰鑫债券	契约型开放式	144,299.87	150,879.94	1.17	否
23	519019	大成景阳领先混合A	契约型开放式	200,733.99	149,948.29	1.16	否
24	006624	中泰玉衡价值优选混合A	契约型开放式	64,166.66	136,476.07	1.06	否
25	270025	广发行业领先混合A	契约型开放式	72,801.97	135,630.07	1.05	否
26	510900	H股ETF	交易型开放式	167,300.00	134,174.60	1.04	否
27	515790	光伏ETF	交易型	86,000.00	106,898.00	0.83	否

			开放式				
28	512660	军工ETF	交易型 开放式	95,000.00	106,780.00	0.83	否
29	515880	通信ETF	交易型 开放式	75,500.00	98,905.00	0.76	否
30	561120	家电ETF	交易型 开放式	88,500.00	89,916.00	0.70	否
31	516010	游戏ETF	交易型 开放式	60,500.00	88,148.50	0.68	否
32	166301	华商新趋势优选 混合	契约型 开放式	8,817.02	85,013.71	0.66	否
33	516110	汽车ETF	交易型 开放式	81,000.00	84,726.00	0.66	否
34	562500	机器人	交易型 开放式	96,500.00	84,148.00	0.65	否
35	515250	智能汽车	交易型 开放式	90,500.00	81,631.00	0.63	否
36	516780	稀土ETF	交易型 开放式	72,000.00	76,176.00	0.59	否
37	515030	新汽车	交易型 开放式	41,000.00	63,099.00	0.49	否
38	515220	煤炭ETF	交易型 开放式	30,000.00	61,920.00	0.48	否
39	002910	易方达供给改革 混合	契约型 开放式	22,484.67	61,542.79	0.48	否
40	005233	广发睿毅领先混 合A	契约型 开放式	20,293.29	52,876.20	0.41	否
41	512200	地产ETF	交易型 开放式	85,000.00	52,105.00	0.40	否
42	110025	易方达资源行业 混合	契约型 开放式	44,745.33	51,054.42	0.39	否
43	519915	富国消费主题混 合A	契约型 开放式	19,693.81	50,219.22	0.39	否

44	000727	融通健康产业灵活配置混合A/B	契约型开放式	16,444.33	50,171.65	0.39	否
45	001719	工银国家战略股票	契约型开放式	21,887.93	48,547.43	0.38	否
46	001975	景顺长城环保优势股票	契约型开放式	11,781.63	36,911.85	0.29	否
47	000628	大成高新技术产业股票A	契约型开放式	8,469.74	32,159.60	0.25	否
48	161729	招商瑞利灵活配置混合(LOF)A	契约型开放式	12,830.58	31,543.98	0.24	否
49	001410	信澳新能源产业股票	契约型开放式	8,434.33	31,468.49	0.24	否
50	516970	基建50	交易型开放式	20,000.00	24,260.00	0.19	否
51	512070	证券保险	交易型开放式	30,000.00	18,630.00	0.14	否
52	512100	1000ETF	交易型开放式	6,000.00	15,954.00	0.12	否
53	519702	交银趋势混合A	契约型开放式	3,000.56	13,162.56	0.10	否
54	001820	兴全天添益货币A	契约型开放式	1,793.71	1,793.71	0.01	否
55	002937	华夏沃利货币B	契约型开放式	1,346.09	1,346.09	0.01	否
56	005078	富国宝利增强债券	契约型开放式	0.01	0.01	0.00	否

### 7.13 投资组合报告附注

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

7.13.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 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	1,097.46
2	应收清算款	17,422.38
3	应收股利	0.22
4	应收利息	-
5	应收申购款	20.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,540.06

### 7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

### 7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中分项之和与合计可能存在尾差。

## §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
上银	89	121,347.61	10,000,000.00	92.5	799,937.58	7.41%

稳健 优选1 2个月 持有 混合 发起 式(FOF)A				9%		
上银 稳健 优选1 2个月 持有 混合 发起 式(FOF)C	929	2,834.23	0.00	0.00%	2,632,995.08	100.00%
合计	1,0 18	13,195.42	10,000,000.00	74.4 4%	3,432,932.66	25.56%

## 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	上银稳健优选12个月持有混 合发起式(FOF)A	-	-
	上银稳健优选12个月持有混 合发起式(FOF)C	2,153.98	0.08%
	合计	2,153.98	0.02%

## 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	上银稳健优选12个 月持有混合发起式	0

基金	(FOF) A	
	上银稳健优选12个月持有混合发起式(FOF) C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	上银稳健优选12个月持有混合发起式(FOF) A	0
	上银稳健优选12个月持有混合发起式(FOF) C	0
	合计	0

#### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	74.44%	10,000,000.00	74.44%	不少于3年
基金管理人高级管理人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金经理等人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金管理人股东	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
其他	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
合计	10,000,000.00	74.44%	10,000,000.00	74.44%	不少于3年

#### §9 开放式基金份额变动

单位：份

	上银稳健优选12个月持	上银稳健优选12个月持
--	-------------	-------------

	有混合发起式 (FOF) A	有混合发起式 (FOF) C
基金合同生效日(2022年03月03日)基金份额总额	10,886,975.07	5,328,070.03
本报告期期初基金份额总额	10,888,741.87	5,394,729.27
本报告期基金总申购份额	23,887.56	28,549.25
减: 本报告期基金总赎回份额	112,691.85	2,790,283.44
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	10,799,937.58	2,632,995.08

注: 总申购份额含红利再投资及转换入份额; 总赎回份额含转换出份额。

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、报告期内基金管理人的重大人事变动:

报告期内基金管理人无重大人事变动。

2、报告期内基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动:

报告期内, 基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、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

报告期内本基金投资策略未改变。

### 10.5 本报告期持有的基金发生重大影响事件

无。

### 10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自2022年12月5日起, 聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) 提供审计服务。报告期内本基金未改聘会计师事务所。

### 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

报告期内本基金管理人及其高级管理人员未受到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

报告期内本基金托管人及其高级管理人员未受到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	
长江证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
东方财富	2	7,566,694.77	100.00%	7,022.24	100.00%	-

注：1、根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力的基础上，选择基金交易单元，并由公司管理层批准。

2、本报告期内，本基金无新增或减少交易单元。

### 10.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-

海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-	17,268,165.70	100.00%

## 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	上银基金管理有限公司关于更新旗下公募基金风险等级的公告	中国证监会规定网站	2023-01-06
2	上银基金管理有限公司旗下基金2022年第4季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊和规定网站	2023-01-20
3	上银稳健优选12个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)2022年第4季度报告	中国证监会规定网站	2023-01-20
4	上银基金管理有限公司关于终止与民商基金销售(上海)有限公司代销合作的公告	中国证监会规定报刊和规定网站	2023-02-04
5	上银基金管理有限公司关于业务系统维护的公告	中国证监会规定网站	2023-02-10
6	上银基金管理有限公司关于业务系统维护的公告	中国证监会规定网站	2023-03-30
7	上银基金管理有限公司旗下基金2022年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊和规定网站	2023-03-31
8	上银稳健优选12个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)2022年年度报告	中国证监会规定网站	2023-03-31
9	上银基金管理有限公司旗下基金2023年第1季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊和规定网站	2023-04-22
10	上银稳健优选12个月持有期	中国证监会规定网站	2023-04-22

	混合型发起式基金中基金(FOF)2023年第1季度报告		
11	上银基金管理有限公司关于业务系统维护的公告	中国证监会规定网站	2023-06-02
12	上银基金管理有限公司关于业务系统维护的公告	中国证监会规定网站	2023-06-16
13	上银基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	中国证监会规定报刊和规定网站	2023-06-28

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额
机构	1	20230101-20230630	10,000,000.00	-	-	10,000,000.00
产品特有风险						
本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况，可能会出现集中赎回或巨额赎回从而引发基金净值剧烈波动或份额净值尾差风险，甚至引发基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。						

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立上银稳健优选12个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)的文件
- 2、《上银稳健优选12个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)基金合同》
- 3、《上银稳健优选12个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)托管协议》
- 4、《上银稳健优选12个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)招募说明书》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、报告期内在中国证监会规定报刊上公开披露的各项公告

## 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所

## 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间内至基金管理人、基金托管人办公场所免费查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人，客服电话：021-60231999，公司网址：[www.boscam.com.cn](http://www.boscam.com.cn)。

上银基金管理有限公司  
二〇二三年八月三十一日