

新华养老稳建1号分期基础设施债权投资计划型养老金产品5期

企业年金养老金产品管理情况报告

(报告期间：2024年07月01日至09月30日)

一、产品基本情况

产品名称：新华养老稳建1号分期基础设施债权投资计划型养老金产品5期
产品代码：XHCg0105
产品起始投资日期：2022-08-01
投资管理人：新华养老保险股份有限公司
托管人：中国光大银行股份有限公司
注册登记人：新华养老保险股份有限公司

二、产品管理情况

(一) 履职情况

在报告期内，投资管理人严格遵守《企业年金基金管理办法》（人社部令11号）、《关于企业年金养老金产品有关问题的通知》（人社部发〔2013〕24号）及其他有关法律法规和管理合同的约定；履行了应尽义务情况，不存在违法违规、未履行管理合同承诺、未勤勉尽责地履行管理义务或损害受益人利益的行为。

(二) 重大事项说明

无。

三、产品投资情况

(一) 产品资产净值和收益情况

产品资产净值（元）	资产份额（份）	单位净值（元）	报告期	报告期	本年以来	产品成立
-----------	---------	---------	-----	-----	------	------

期初	期末	期初	期末	期初	期末	内投资 收益 (元)	内投资 收益率 (%)	投资收益 率(%)	以来累计 收益率 (%)
10,015,098.30	10,124,721.15	10,000,000.00	10,000,000.00	1.0015	1.0125	109,622.85	1.10	3.30	9.84

(二) 投资资产分布情况

资产/负债种类		市值/摊余成本(元)	占净资产比例(%)	
流动性 资产	银行活期存款	114,176.53	1.13	1.13
	--年期以内(含--年)中央银行票据	0.00	0.00	
	同业存单	0.00	0.00	
	--年期以内(含--年)国债	0.00	0.00	
	--年期以内(含--年)政策性、开发性银行 债券	0.00	0.00	
	--年期以内(含--年)定期存款/协议存款	0.00	0.00	
	买入返售金融资产	0.00	0.00	
	货币市场基金	0.00	0.00	
	清算备付金	0.00	0.00	
	应收证券清算款	0.00	0.00	
	其他	0.00	0.00	
固定收益 类资产	一年期以上银行存款	0.00	0.00	98.77
	一年期以上中央银行票据	0.00	0.00	
	一年期以上国债	0.00	0.00	
	一年期以上政策性、开发性银行债券	0.00	0.00	
	金融债	0.00	0.00	

	企业（公司）债	0.00	0.00	
	短期融资券	0.00	0.00	
	中期票据	0.00	0.00	
	可转换债	0.00	0.00	
	非公开定向债务融资工具	0.00	0.00	
	资产支持证券	0.00	0.00	
	其中：交易所资产支持证券	0.00	0.00	
	资产支持票据	0.00	0.00	
	债券基金	0.00	0.00	
	信托产品	0.00	0.00	
	债权投资计划	10,000,000.00	98.77	
	其他	0.00	0.00	
权益类资产	A股	0.00	0.00	0.00
	港股通标的股票	0.00	0.00	
	优先股	0.00	0.00	
	股票基金	0.00	0.00	
	混合基金	0.00	0.00	
	港股通基金	0.00	0.00	
	权证（非直接投资）	0.00	0.00	
	其他	0.00	0.00	
其他资产	期货保证金	0.00	0.00	0.13
	其他	13,581.86	0.13	
负债	债券正回购	0.00	0.00	-0.03
	其他	-3,037.24	-0.03	
合 计		10,124,721.15	100.00	

注：

1. 各级科目小项占净资产比例均按照各类小项的市值或摊余成本与资产净值相除计算得出。
2. 银行活期存款包括活期存款、七天通知存款、协定利率存款。

3. 一年期以内（含一年）定期存款、协议存款，中央银行票据指存期在一年以内。
4. 一年期以内（含一年）国债，一年期以内（含一年）政策性、开发性银行债券指剩余期限在一年以内。
5. 私募债并入企业（公司）债项下统计。
6. 可转换债包括可转换债、可交换债、分离交易可转债。
7. 股票基金、混合基金不包含名称中带有“港股”等类似字样的公开募集证券投资基金。
8. 港股通基金为名称中带有“港股”等类似字样的公开募集证券投资基金。
9. 股权类资产并入权益类资产“其他权益类资产”项下统计。
10. 其他资产是指没有归入上述各类投资资产的其他资产，包括应收利息、应收股利、交易保证金等。
11. 负债是指计划/组合运作及融资时所形成的负债，包括应付给他人的各项费用、应付资金利息等。
12. “合计”项中“市值/摊余成本”应等于“资产净值”，“占比”应为100%。

（三）投资资产明细

1. 期货投资情况

1) 本期期末期货合约占用的保证金： 0.00元

2) 本期期末期货合约持仓和公允价值变动明细（公允价值为负时以负号填列）

期货 代码	名称	持仓量		合约价值	公允价值 变动
		买入	沽出		
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计					-

2. 股票、基金、债券投资（前十位）

类型名称	序号	名称	代码	数量	市值（元）	占该养老金产品净资产比例（%）
------	----	----	----	----	-------	-----------------

股票	-	-	-	-	-	-
----	---	---	---	---	---	---

基金	-	-	-	-	-	-
----	---	---	---	---	---	---

债券	-	-	-	-	-	-
----	---	---	---	---	---	---

3. 其他投资品种资产投资（前十位）

类型名称	序号	名称	发行方	期限	收益率（%）	投资金额（元）	占该养老金产品净资产比例（%）
信托产品	-	-	-	-	0	0	0

债权投资计划	1	大家-济南城建基础设施债权投资计划	大家资产管理有限公司	5年	4.44	100000000	98.77
债权投资计划	-	-	-	-	0	0	0

资产支持证券	1						
	...						
	10						

资产支持票据	1						
--------	---	--	--	--	--	--	--

	...						
	10						

(四) 报告期间产品收益分配情况 (如有)

序号	分红日期	收益分配金额(元)	备注
-	-	-	

注：货币型产品按自然月列示分红情况。

四、投资分析

新华养老稳健1号分期基础设施债权投资计划型养老金产品5期，总投资规模为0.1亿元，底层资产为“大家-济南城建基础设施债权投资计划”。截至2024年6月30日，投资项目运营情况正常，未发生涉及可能损害投资计划财产、委托人或受益人利益的情形。

五、其他需要说明的情况

(一) 份额持有人个数

份额持有人个数(个)	
期初	期末
4	4

六、声明

郑重承诺报告所提供的内容、数据、报表及附件真实、准确、完整。

2024年10月15日

填报说明:

1. 起始投资日期指首笔资金到达投资资产托管账户当日。
2. 本表中“三、产品投资情况”的内容需经托管人复核。
3. 三（一）产品资产净值和收益情况中，对于报告期间成立的新组合，期初是指产品起始投资运作时点的数据。
4. 成立以来累计投资收益率指自本投资管理人管理本产品开展投资以来的累计数据。
5. 报告期内投资收益=本期投资资产利息收入+投资处置收益+公允价值变动损益+其他收入-受托费-托管费-投资管理费-交易费用-利息支出-其他费用（包括审计费、清算费等）。

投资收益率采用单位净值计算方法：收益率 = 期末单位净值/期初单位净值-1。若计算期间存在分红情况，则收益率采用分段计算方式，即分红之前的单位净值增长率与分红之后的单位净值增长率连乘所得。即：本期单位基金净值增长率 = (本期第一次分红前单位净值 ÷ 期初单位净值) × (本期第二次分红前单位净值 ÷ 本期第一次分红后单位净值) × ... × (期末单位净值 ÷ 本期最后一次分红后单位净值) - 1

其中：

分红前单位净值按除息日前一交易日的单位净值计算

分红后单位净值 = 分红前单位净值 - 单位分红金额。

6. 货币型养老金产品在第三部分的产品资产净值和收益信息中单位净值指标因不适用，可不填列。货币型养老金产品投资收益率公式如下：

(1) 按日结转份额的本期（或累计）净值收益率 = $\left[\prod_{i=1}^n (1 + R_i / 10000) \right] - 1 \times 100\%$ ；
其中，R1为期初（或基金合同生效日）的每万份基金净收益，Ri为日每万份基金净收益，Rn为报告期末的每万份基金净收益。

(2) 按月结转份额的本期（或累计）净值收益率 = $\left[\prod_{m=1}^l (1 + R_m / 10000) \right] - 1 \times 100\%$ ；
其中，R1为报告期起始至首次转份额期间（或基金合同生效后首月）的每万份基金净收益，Rm为第m-1次转份额至第m次转份额期间的每万份基金净收益，Rl为报告期最后一次转份额至期末的每万份基金净收益。

其中，日每万份基金净收益 = 当日基金净收益 / 当日基金份额总额 × 10000。

7. 对于伞状结构产品，披露对应的子组合的收益率。
8. 其他投资品种资产投资表中的收益率是指养老金产品估值办法中分类处理的年化预期收益率或年化保证收益率等。
9. 份额持有人数据由注册登记公司（TA）提供并确认。