

建信普泽养老目标日期 2040 三年持有期混  
合型发起式基金中基金 (FOF)  
2023 年第 1 季度报告

2023 年 3 月 31 日

基金管理人：建信基金管理有限责任公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 4 月 21 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 4 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

|            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
|------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 建信普泽养老目标日期 2040 三年持有混合 (FOF)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 基金主代码      | 012283                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 基金合同生效日    | 2021 年 7 月 14 日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| 报告期末基金份额总额 | 258,963,679.82 份                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
| 投资目标       | 本基金以多元资产配置为核心驱动力，通过优化配置各类资产实现投资组合的风险分散和长期稳健增长。同时本基金通过精选各类基金并构造分散的基金组合，力求实现投资组合的稳健超额收益和风险再分散。                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 投资策略       | 本基金属于养老目标日期基金，本基金资产根据建信基金目标日期型基金下滑曲线模型进行动态资产配置，随着投资人生命周期的延续和目标日期的临近，本基金将不断调整投资组合的资产配置比例，权益类资产（股票、股票型基金、混合型基金等）投资比例逐步下降，而非权益类资产比例逐步上升。<br>为进一步增强组合收益并控制最大回撤，本基金将利用各类量化指标或模型，分析股票、债券、商品等各类资产的短期趋势：对处于上升通道的强势资产，或短期趋势有大概率由弱转强的资产，将给予适当的超配；对处于下行通道的弱势资产，或短期趋势有大概率由强转弱的资产，将给予适当的低配。但总体而言，战术性组合调整不会改变产品本身的风险收益属性，其目标是进一步增强组合收益，并力争避免资产泡沫破裂对组合带来的风险。 |

|                 |                                                                             |                                |
|-----------------|-----------------------------------------------------------------------------|--------------------------------|
| 业绩比较基准          | X×中证 800 指数收益率+(1-X)×中债综合指数收益率，X 取值见招募说明书。编制日 X 的取值为 50%。                   |                                |
| 风险收益特征          | 本基金为混合型基金中基金，其预期收益及预期风险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、货币市场基金及货币型基金中基金。 |                                |
| 基金管理人           | 建信基金管理有限责任公司                                                                |                                |
| 基金托管人           | 兴业银行股份有限公司                                                                  |                                |
| 下属分级基金的基金简称     | 建信普泽养老目标日期 2040 三年持有混合 (FOF) A                                              | 建信普泽养老目标日期 2040 三年持有混合 (FOF) Y |
| 下属分级基金的交易代码     | 012283                                                                      | 017258                         |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 247, 126, 102. 06 份                                                         | 11, 837, 577. 76 份             |

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标          | 报告期 (2023 年 1 月 1 日-2023 年 3 月 31 日) |                                |
|-----------------|--------------------------------------|--------------------------------|
|                 | 建信普泽养老目标日期 2040 三年持有混合 (FOF) A       | 建信普泽养老目标日期 2040 三年持有混合 (FOF) Y |
| 1. 本期已实现收益      | -935, 229. 60                        | -23, 186. 86                   |
| 2. 本期利润         | 4, 617, 690. 53                      | 148, 031. 82                   |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0. 0187                              | 0. 0150                        |
| 4. 期末基金资产净值     | 221, 945, 674. 07                    | 10, 650, 417. 62               |
| 5. 期末基金份额净值     | 0. 8981                              | 0. 8997                        |

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、所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。

#### 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

建信普泽养老目标日期 2040 三年持有混合 (FOF) A

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差 | ①-③ | ②-④ |
|----|--------|-----------|------------|--------------|-----|-----|
|    |        |           |            |              |     |     |

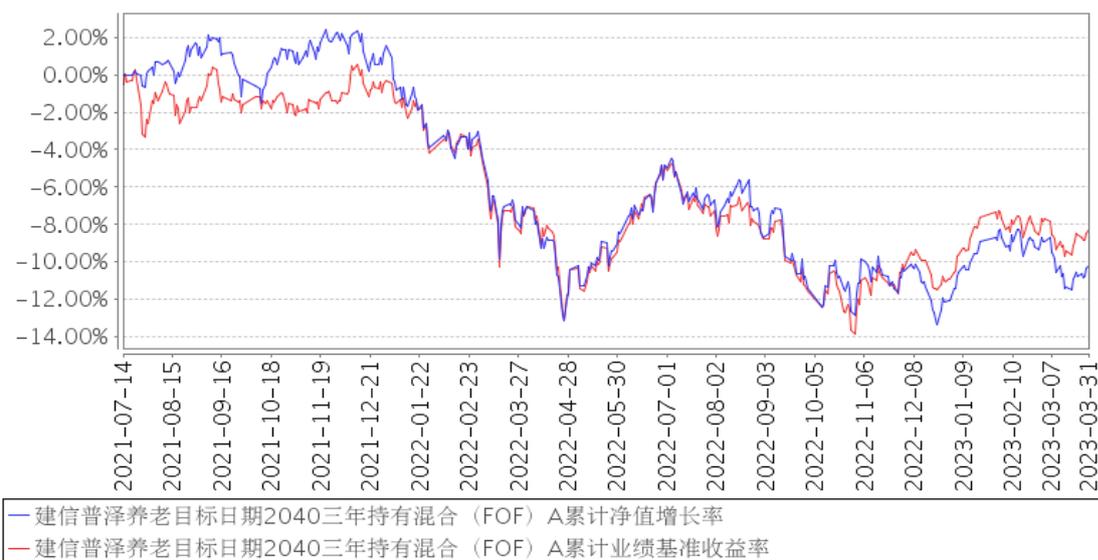
|            |         |       |        | ④     |        |       |
|------------|---------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 过去三个月      | 2.13%   | 0.43% | 2.92%  | 0.40% | -0.79% | 0.03% |
| 过去六个月      | 1.43%   | 0.52% | 3.72%  | 0.50% | -2.29% | 0.02% |
| 过去一年       | -2.92%  | 0.58% | -0.77% | 0.56% | -2.15% | 0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | -10.19% | 0.57% | -8.31% | 0.56% | -1.88% | 0.01% |

建信普泽养老目标日期 2040 三年持有混合 (FOF) Y

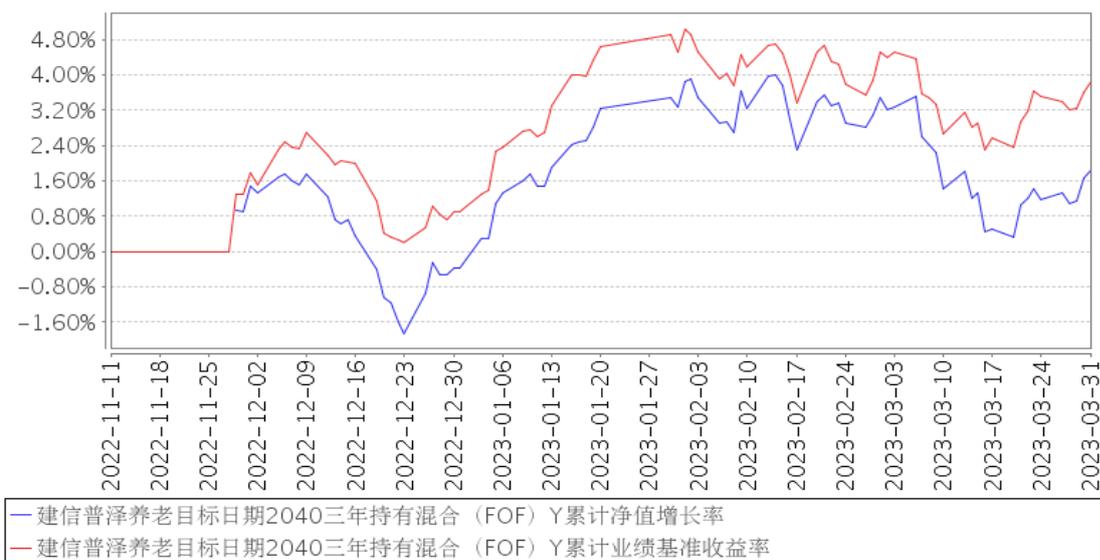
| 阶段         | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④   |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月      | 2.25%  | 0.43%     | 2.92%      | 0.40%         | -0.67% | 0.03% |
| 自基金合同生效起至今 | 1.86%  | 0.44%     | 3.84%      | 0.38%         | -1.98% | 0.06% |

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

建信普泽养老目标日期2040三年持有混合 (FOF) A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



建信普泽养老目标日期2040三年持有混合（FOF）Y累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本报告期，本基金投资组合比例符合基金合同要求。

### 3.3 其他指标

无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名  | 职务                  | 任本基金的基金经理期限 |            | 证券从业年限 | 说明                                                                                                                                                                                            |
|-----|---------------------|-------------|------------|--------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |                     | 任职日期        | 离任日期       |        |                                                                                                                                                                                               |
| 孙悦萌 | 数量投资部总经理助理，本基金的基金经理 | 2023年3月29日  | -          | 11     | 孙悦萌女士，数量投资部总经理助理，博士。曾任美国银行梅林证券定量分析师、正信嘉华顾问管理公司高级咨询师。2014年8月加入建信基金，历任创新发展部初级研究员、资产配置及量化投资部研究员、投资经理、资深投资经理、总经理助理等职务。2023年3月29日起任建信福泽裕泰混合型基金中基金（FOF）、建信普泽养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）的基金经理。 |
| 梁珉  | 数量投资部副总经理，本基金的基金经理  | 2021年7月14日  | 2023年3月30日 | 17     | 梁珉先生，数量投资部副总经理，硕士。曾任鹏华基金管理有限公司金融工程部研究员。2007年7月加入我公司，历任创新发展部产品开发专员、产品开发主管、部门副总监、部门执行总监、量化衍生品条线执行总经理、资产配置及量化投                                                                                   |

|  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
|--|--|--|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  | <p>资部总经理等职务。2017 年 11 月 2 日至 2023 年 2 月 15 日任建信福泽安泰混合型基金中基金 (FOF) 的基金经理; 2019 年 1 月 31 日至 2023 年 3 月 30 日任建信优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; 2019 年 6 月 5 日至 2023 年 3 月 30 日任建信福泽裕泰混合型基金中基金 (FOF) 的基金经理; 2021 年 1 月 26 日至 2023 年 2 月 15 日起任建信智汇优选一年持有期混合型管理人中管理人 (MOM) 证券投资基金的基金经理; 2021 年 7 月 14 日至 2023 年 3 月 30 日任建信普泽养老目标 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 的基金经理; 2021 年 11 月 30 日至 2023 年 2 月 15 日任建信龙祥稳进 6 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 的基金经理; 2022 年 4 月 15 日至 2023 年 3 月 30 日任建信优享平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 的基金经理; 2022 年 5 月 31 日至 2023 年 3 月 30 日任建信普泽养老目标日期 2050 五年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 的基金经理; 2022 年 12 月 21 日至 2023 年 3 月 30 日任建信优享进取养老目标五年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 的基金经理。</p> |
|--|--|--|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

#### 4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内, 基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益, 严格遵守了《证券法》、《证券投资基金法》、其他有关法律法规的规定和《建信普泽养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 基金合同》的规定。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待投资人, 保护投资人利益, 避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行

为，公司根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》、《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部制度，制定和修订了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》、《公司防范内幕交易管理办法》、《利益冲突管理办法》等风险管控制度。公司使用的交易系统中设置了公平交易模块，一旦出现不同基金同时买卖同一证券时，系统自动切换至公平交易模块进行操作，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未出现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% 的情况。本报告期，未发现本基金存在异常交易行为。

### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2023 年一季度，A 股市场在年初快速拉升后转为震荡行情。1 月在基本面强复苏预期和外资大幅流入下，A 股市场迎来普涨行情；2 月强政策和强增长进入“盲人摸象”验证期，加上美联储加息预期升温压制市场风险偏好，A 股市场分歧加大，行业轮动速度明显加快；3 月因市场对经济预期逐步转弱，A 股市场震荡调整，但在弱基本面复苏+强数字经济政策预期下，以传媒、计算机、电子为代表的 TMT 板块上涨明显。回看一季度，上证指数上涨 5.94%，沪深 300 指数上涨 4.63%，中证 500 指数上涨 8.11%，结构上计算机、传媒、通信等行业涨幅居前。债券市场方面，理财赎回风波的影响在逐渐减弱，一季度利率经历了先上后下的过程，整体处于小幅波动状态。1 年国债利率的波动区间 2.07-2.33%，10 年国债的波动区间 2.81-2.93%。

2023 年二季度，预计 A 股市场温和向好。从基本面看，宏观经济仍在修复趋势中，二季度经济修复的斜率依旧是市场关注的重点，往后看我们仍需关注基本面数据的验证情况。从流动性看，国内货币环境预计仍将保持合理充裕，后续重点关注海外流动性拐点的出现，5 月美联储议息会议将是关键的时间节点，若确认最后一次加息/停止加息，资产交易逻辑或将转向衰退交易，在“中强美弱”进一步强化下利好人民币资产。风格上，预计均衡偏成长，部分价值板块有修复行情。一是若经济弱修复+强产业逻辑延续，AI+带动产业行情有望成为持续全年主线，但短期不排除在交易过热下流动性等其他外部事件冲击或导致阶段性回调。二是若二季度美联储加息拐点出现，美债利率或将趋势性下行，利好大盘成长标的；三是随着进入季报披露期，数据有望超预期的地产链和消费板块有较好投资机会。债券市场方面，全年来看预计货币政策以稳为主，基本面延续自然修复态势，我们对债市总体持中性偏谨慎观点。短期来看，政策方面近期重点关注 4 月

政治局会议的政策定调，预计对债市形成冲击的风险有限；在弱复苏确认、政策刺激偏弱的背景下，近期部分高频数据出现走弱迹象，叠加资金面趋松，利率不排除短期小幅震荡向下。我们认为固收市场阶段性具备配置价值，但也要提防经济复苏持续性超预期带来的调整风险。

在 2023 年一季度，由于前期经济修复处于验证期、加上 2 月风格快速轮动，基金管理人对整体组合未有大幅调整，在增配港股、黄金等资产，用以增加组合配置分散度、提升组合的夏普率外，更多是自下而上对部分持仓基金的优化。未来对于权益型基金组合，管理人将根据研究结果优化组合结构，将组合风格调整为均衡略偏成长，在部分前期未有表现的行业，例如医药等行业适当加配，把握补涨机会。在债基组合中，当前的研究结果对债市观点仍然中性偏多，未来基金会密切跟踪宏观基本面高频数据变化，适度调节久期配置。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金 A 净值增长率 2.13%，波动率 0.43%，业绩比较基准收益率 2.92%，波动率 0.40%。本报告期本基金 Y 净值增长率 2.25%，波动率 0.43%，业绩比较基准收益率 2.92%，波动率 0.40%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

## § 5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额（元）          | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | -              | -            |
|    | 其中：股票             | -              | -            |
| 2  | 基金投资              | 211,658,687.71 | 90.89        |
| 3  | 固定收益投资            | 12,078,315.87  | 5.19         |
|    | 其中：债券             | 12,078,315.87  | 5.19         |
|    | 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      | 8,849,968.92   | 3.80         |
| 8  | 其他资产              | 289,623.07     | 0.12         |
| 9  | 合计                | 232,876,595.57 | 100.00       |

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

## 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

无。

## 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

## 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

## 5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

无。

## 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 4,961,209.73  | 2.13         |
| 2  | 央行票据      | -             | -            |
| 3  | 金融债券      | 7,117,106.14  | 3.06         |
|    | 其中：政策性金融债 | 7,117,106.14  | 3.06         |
| 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        | 12,078,315.87 | 5.19         |

## 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 数量（张）  | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|--------|--------------|--------------|
| 1  | 018008 | 国开 1802  | 69,000 | 7,117,106.14 | 3.06         |
| 2  | 019679 | 22 国债 14 | 49,000 | 4,961,209.73 | 2.13         |

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资  
明细

无。

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

无。

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

无。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

## 5.11 投资组合报告附注

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

本基金该报告期内投资前十名证券的发行主体未披露被监管部门立案调查和在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

### 5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|----|-------|
|----|----|-------|

|   |         |            |
|---|---------|------------|
| 1 | 存出保证金   | 3,398.10   |
| 2 | 应收证券清算款 | -          |
| 3 | 应收股利    | -          |
| 4 | 应收利息    | -          |
| 5 | 应收申购款   | 284,523.19 |
| 6 | 其他应收款   | 1,701.78   |
| 7 | 其他      | -          |
| 8 | 合计      | 289,623.07 |

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

#### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## §6 基金中基金

#### 6.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

| 序号 | 基金代码   | 基金名称             | 运作方式           | 持有份额 (份)     | 公允价值 (元)      | 占基金资产净值比例 (%) | 是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金 |
|----|--------|------------------|----------------|--------------|---------------|---------------|------------------------|
| 1  | 001667 | 南方转型增长灵活配置混合 A   | 契约型开放式         | 6,889,317.83 | 13,723,521.12 | 5.90          | 否                      |
| 2  | 161222 | 国投瑞银瑞利混合 (LOF) A | 上市契约型开放式 (LOF) | 4,737,699.51 | 11,484,183.61 | 4.94          | 否                      |
| 3  | 000612 | 华宝生态中国混合 A       | 契约型开放式         | 2,293,858.05 | 10,609,093.48 | 4.56          | 否                      |
| 4  | 110007 | 易方达稳健收益债券 A      | 契约型开放式         | 7,668,827.72 | 10,559,975.77 | 4.54          | 否                      |
| 5  | 530021 | 建信纯债债券 A         | 契约型开放式         | 6,792,555.36 | 10,533,894.85 | 4.53          | 是                      |
| 6  | 000931 | 国寿安保尊            | 契约型开放          | 8,442,015.01 | 9,945,537.88  | 4.28          | 否                      |

|    |        |                |            |              |              |      |   |
|----|--------|----------------|------------|--------------|--------------|------|---|
|    |        | 益信用纯债<br>债券    | 式          |              |              |      |   |
| 7  | 206018 | 鹏华产业债<br>债券    | 契约型开放<br>式 | 8,911,764.71 | 9,811,852.95 | 4.22 | 否 |
| 8  | 100018 | 富国天利增<br>长债券 A | 契约型开放<br>式 | 7,270,600.42 | 9,630,637.32 | 4.14 | 否 |
| 9  | 000893 | 工银创新动<br>力股票   | 契约型开放<br>式 | 8,872,557.72 | 9,200,842.36 | 3.96 | 否 |
| 10 | 001070 | 建信信息产<br>业股票 A | 契约型开放<br>式 | 3,223,440.66 | 9,022,410.41 | 3.88 | 是 |

## 6.2 当期交易及持有基金产生的费用

| 项目                       | 本期费用 2023 年 1 月 1 日至 2023<br>年 3 月 31 日 | 其中：交易及持有基金管理人<br>以及管理人关联方所管理基<br>金产生的费用 |
|--------------------------|-----------------------------------------|-----------------------------------------|
| 当期交易基金产生的申购费(元)          | 9,440.30                                | -                                       |
| 当期交易基金产生的赎回费(元)          | 33,684.24                               | -                                       |
| 当期持有基金产生的应支付销售<br>服务费(元) | 18,011.69                               | 4,936.47                                |
| 当期持有基金产生的应支付管理<br>费(元)   | 568,058.86                              | 82,906.64                               |
| 当期持有基金产生的应支付托管<br>费(元)   | 107,907.05                              | -                                       |
| 当期交易基金产生的转换费(元)          | 84,403.52                               | -                                       |
| 当期交易基金产生的交易费(元)          | 99.86                                   | -                                       |

注：持有基金产生的费用是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、托管费进行的估算，上述费用已在基金中基金所持有基金的净值中体现，不构成基金中基金的费用。其中，销售服务费由基金管理人从被投资基金收取后向本基金返还，当期持有基金产生的应支付销售服务费为管理人当期应向本基金返还的销售服务费。

## 6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本报告期内本基金参与了所持有的建信纯债债券型证券投资基金份额持有人大会，对审议事项“关于建信纯债债券型证券投资基金修改收益分配条款及赎回费的议案”投同意票。

## § 7 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目           | 建信普泽养老目标日期<br>2040 三年持有混合 (FOF)<br>A | 建信普泽养老目标日期<br>2040 三年持有混合 (FOF)<br>Y |
|--------------|--------------------------------------|--------------------------------------|
| 报告期期初基金份额总额  | 246,922,116.31                       | 7,388,560.03                         |
| 报告期期间基金总申购份额 | 203,985.75                           | 4,449,017.73                         |

|                            |                |               |
|----------------------------|----------------|---------------|
| 减: 报告期期间基金总赎回份额            | -              | -             |
| 报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列) | -              | -             |
| 报告期期末基金份额总额                | 247,126,102.06 | 11,837,577.76 |

注: 如有相应情况, 申购含红利再投、转换入份额及金额, 赎回含转换出份额及金额。

## § 8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位: 份

|                           |               |
|---------------------------|---------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额          | 10,007,100.00 |
| 报告期期间买入/申购总份额             | -             |
| 报告期期间卖出/赎回总份额             | -             |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额          | 10,007,100.00 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%) | 3.86          |

### 8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

## § 9 报告期末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   | 10,007,100.00 | 3.86             | 10,007,100.00 | 3.86             | 3 年        |
| 基金管理人高级管理人员 | -             | -                | -             | -                | -          |
| 基金经理等人员     | 11.12         | 0.00             | -             | -                | 3 年        |
| 基金管理人股东     | -             | -                | -             | -                | -          |
| 其他          | -             | -                | -             | -                | -          |
| 合计          | 10,007,111.12 | 3.86             | 10,007,100.00 | 3.86             | 3 年        |

## § 10 影响投资者决策的其他重要信息

### 10.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

### 10.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

1、中国证监会批准建信普泽养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 设立的文件；

- 2、《建信普泽养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 基金合同》；
- 3、《建信普泽养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 招募说明书》；
- 4、《建信普泽养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 托管协议》；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

### 11.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

### 11.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。也可在支付工本费后，在合理时间内取得上述文件的复印件。

建信基金管理有限责任公司

2023 年 4 月 21 日