

泰康养老目标日期 2040 三年持有期混合型  
发起式基金中基金（FOF）  
2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：泰康基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 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。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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 月 28 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及其更新。

本报告财务资料已经审计。毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，基金管理人在本报告中对相关事项亦有详细说明，请投资者注意阅读。

本报告期为 2023 年 7 月 18 日起至 2023 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

|   |           |
|---|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b>                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§ 2 基金简介</b>                         | <b>5</b>  |
| 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                              | 7         |
| 2.5 其他相关资料                              | 7         |
| <b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>         | <b>8</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 8         |
| 3.2 基金净值表现                              | 8         |
| 3.3 其他指标                                | 10        |
| 3.4 过去三年基金的利润分配情况                       | 10        |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>11</b> |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 11        |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 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             | 13        |
| 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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况                 | 14        |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 15        |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 15        |
| 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       | 15        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>16</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 16        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 16        |
| 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见       | 16        |
| <b>§ 6 审计报告</b>                         | <b>17</b> |
| 6.1 审计报告基本信息                            | 17        |
| 6.2 审计报告的基本内容                           | 17        |
| <b>§ 7 年度财务报表</b>                       | <b>20</b> |
| 7.1 资产负债表                               | 20        |
| 7.2 利润表                                 | 21        |
| 7.3 净资产变动表                              | 22        |
| 7.4 报表附注                                | 23        |

|   |           |
|---|-----------|
| <b>§ 8 投资组合报告</b> .....                     | <b>52</b> |
| 8.1 期末基金资产组合情况 .....                        | 52        |
| 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....                  | 52        |
| 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 .....     | 52        |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....                   | 52        |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....                  | 53        |
| 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 .....    | 53        |
| 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 ..... | 53        |
| 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 ..... | 53        |
| 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 .....    | 53        |
| 8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....                   | 53        |
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 53        |
| 8.12 本报告期投资基金情况 .....                       | 53        |
| 8.13 投资组合报告附注 .....                         | 56        |
| <b>§ 9 基金份额持有人信息</b> .....                  | <b>58</b> |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 58        |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 58        |
| 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 .....      | 58        |
| 9.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....                   | 58        |
| <b>§ 10 开放式基金份额变动</b> .....                 | <b>59</b> |
| <b>§ 11 重大事件揭示</b> .....                    | <b>60</b> |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 60        |
| 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 .....      | 60        |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 60        |
| 11.4 基金投资策略的改变 .....                        | 60        |
| 11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 .....               | 60        |
| 11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 61        |
| 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 .....         | 61        |
| 11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 61        |
| 11.9 其他重大事件 .....                           | 62        |
| <b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....            | <b>65</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 .....    | 65        |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                   | 65        |
| <b>§ 13 备查文件目录</b> .....                    | <b>66</b> |
| 13.1 备查文件目录 .....                           | 66        |
| 13.2 存放地点 .....                             | 66        |
| 13.3 查阅方式 .....                             | 66        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                                     |
|------------|-------------------------------------|
| 基金名称       | 泰康养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF） |
| 基金简称       | 泰康养老目标日期 2040 三年持有混合发起（FOF）         |
| 基金主代码      | 017774                              |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                              |
| 基金合同生效日    | 2023 年 7 月 18 日                     |
| 基金管理人      | 泰康基金管理有限公司                          |
| 基金托管人      | 上海浦东发展银行股份有限公司                      |
| 报告期末基金份额总额 | 25,211,445.93 份                     |
| 基金合同存续期    | 不定期                                 |

### 2.2 基金产品说明

|      |  |
|------|--|
| 投资目标 | 本基金采用目标日期策略，依照下滑曲线进行大类资产配置，随着目标日期临近，逐渐降低权益资产的配置比例，在力争实现养老目标的前提下，追求养老资产的长期稳健增值。   |
| 投资策略 | <p>本基金属于养老目标日期基金。本基金的大类资产配置策略，随着投资人生命周期的延续和投资目标日期的临近，基金的投资风格相应的从“平衡”，转变为“稳健”，再转变为“保守”，权益类资产比例逐步下降，而非权益类资产比例逐步上升。本基金根据泰康目标日期型基金下滑曲线模型进行动态资产配置，下滑曲线模型运用随机动态规划技术，对跨生命周期的投资、消费进行了优化求解，并结合国内法规约束和投资工具范围作了本土化改进。随着本基金目标日期的临近，权益类资产投资比例逐渐下降。在下滑曲线模型的基础上，进行风险预算，控制基金相对回撤，精细挑选符合本基金投资目标的标的基金，构建投资组合。</p> <p>在基金实际管理过程中，本基金将结合基金管理人研发的投资决策体系，包括权益投资决策分析体系（MVPCT 系统）和固收投资决策分析体系（FIFAM 系统）两大系统，在控制风险的前提下，对各类资产的配置比例进行战术调整，力争通过基金管理人的主动配置把握各大类资产中长期趋势波动带来的 Beta 收益，获取更优异的风险调整回报。</p> <p>基金投资策略方面，本基金将结合各只基金的投资范围、投资比例、风险收益特征，将其归属为权益类和固收类，并且将每一类基金按照投资策略分为主动管理型基金和被动指数型基金。基金管理人将对全市场的主动型基金和被动型基金进行业绩分析、组合分析、费率比较、流动性比较等，权衡主动型基金和被动型基金的相对优势，在权益类和固收类的内部确定主动和被动的配置比例，并进行动态调整。力争通过投资优质的主动型基金、跟踪效率较高且流动性较好的被动型基金，获取超越业绩基准的 alpha 收益。</p> <p>股票投资策略方面，本基金在股票基本面研究的基础上，同时考虑投资者情绪、认知等决策因素的影响，将影响上市公司基本面和股价的增长类因素、估值类因素、盈利类因素、财务风险等因素</p> |

|        |   |
|--------|---|
|        | <p>进行综合分析，精选具有较高投资价值的上市公司，进行股票的选择与组合优化。</p> <p>债券投资策略方面，本基金基于流动性管理及策略性投资的需要，投资于债券资产。债券投资策略包括：久期管理策略；期限结构配置策略；骑乘策略；息差策略；信用策略；个券精选策略；证券公司短期公司债券投资策略；可转换债券投资策略等。</p> <p>资产支持证券投资策略方面，本基金基于策略性投资的需要，投资于资产支持证券。本基金将通过评估资产支持证券的信用风险、利率风险、流动性风险和提前偿付风险，精选那些经风险调整后收益率较高的品种进行投资。</p> <p>其他投资策略方面，如法律法规或监管机构以后允许基金中基金投资于其他衍生金融工具，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入本基金的投资范围。本基金对衍生金融工具的投资主要以对提高组合整体收益为主要目的。本基金将在有效风险管理的前提下，通过对标的品种的研究，谨慎投资。</p> |
| 业绩比较基准 | <p>(沪深 300 指数收益率*95%+恒生指数收益率*5%)*X+中债综合(全价)指数收益率*(1-X)</p> <p>在目标日期 2040 年 12 月 31 日(含当日)之前，X 取值范围如下：</p> <p>基金合同生效日至 2025 年 12 月 31 日：50%；2026 年 1 月 1 日至 2028 年 12 月 31 日：45%；2029 年 1 月 1 日至 2031 年 12 月 31 日：40%；2032 年 1 月 1 日至 2034 年 12 月 31 日：34%；2035 年 1 月 1 日至 2037 年 12 月 31 日：28%；2038 年 1 月 1 日至 2040 年 12 月 31 日：22%。</p>  |
| 风险收益特征 | <p>本基金属于混合型基金中基金(FOF)，本基金长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、股票型基金中基金(FOF)，高于债券型基金、债券型基金中基金(FOF)、货币市场基金和货币型基金中基金(FOF)。</p> <p>本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港证券市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、投资于香港证券市场的风险、以及通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险等特有风险。</p>   |

### 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          | 泰康基金管理有限公司                        | 上海浦东发展银行股份有限公司         |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名                                | 陈玮光                    |
|             | 联系电话                              | 010-89620366           |
|             | 电子邮箱                              | tkfchenwg06@tkfunds.cn |
| 客户服务电话      | 4001895522                        | 95528                  |
| 传真          | 010-89620100                      | 021-63602540           |
| 注册地址        | 北京市西城区复兴门内大街 156 号 3 层 1-10 内 302 | 上海市中山东一路 12 号          |
| 办公地址        | 北京市西城区武定侯街 2 号泰康                  | 上海市博成路 1388 号浦银中心 A    |

|       |            |        |
|-------|------------|--------|
|       | 国际大厦 3、5 层 | 栋      |
| 邮政编码  | 100033     | 200126 |
| 法定代表人 | 金志刚        | 张为忠    |

#### 2.4 信息披露方式

|                     |                    |
|---------------------|--------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 证券时报               |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | www.tkfunds.com.cn |
| 基金年度报告备置地点          | 基金管理人办公地、基金托管人的住所  |

#### 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） | 中国北京东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层  |
| 注册登记机构 | 泰康基金管理有限公司          | 北京市西城区武定侯街 2 号泰康国际大厦 3、5 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 | 2023 年 7 月 18 日 (基金合同生效日) - 2023 年 12 月 31 日 |
|---------------|--|
| 本期已实现收益       | -526,031.79                                  |
| 本期利润          | -644,046.22                                  |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.0256                                      |
| 本期加权平均净值利润率   | -2.60%                                       |
| 本期基金份额净值增长率   | -2.56%                                       |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2023 年末                                      |
| 期末可供分配利润      | -644,809.15                                  |
| 期末可供分配基金份额利润  | -0.0256                                      |
| 期末基金资产净值      | 24,566,636.78                                |
| 期末基金份额净值      | 0.9744                                       |
| 3.1.3 累计期末指标  | 2023 年末                                      |
| 基金份额累计净值增长率   | -2.56%                                       |

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。

(3) 本基金所述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。

(4) 本基金合同生效日为 2023 年 7 月 18 日，截止报告期末本基金未满一年。

#### 3.2 基金净值表现

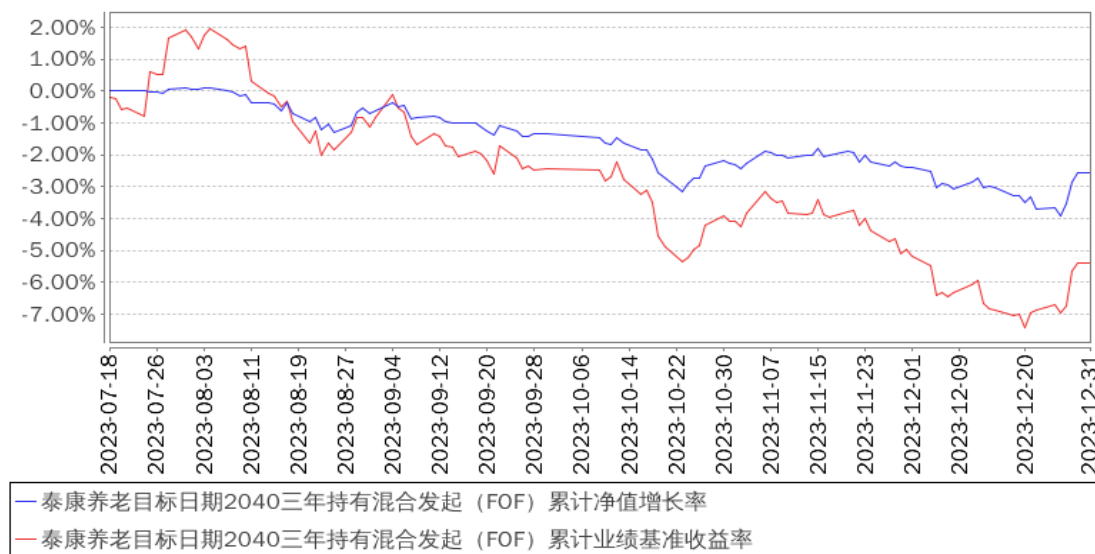
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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      | -1.23%   | 0.23%       | -3.04%     | 0.40%         | 1.81% | -0.17% |
| 自基金合同生效起至今 | -2.56%   | 0.20%       | -5.40%     | 0.43%         | 2.84% | -0.23% |



### 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

泰康养老目标日期2040三年持有混合发起 (FOF) 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

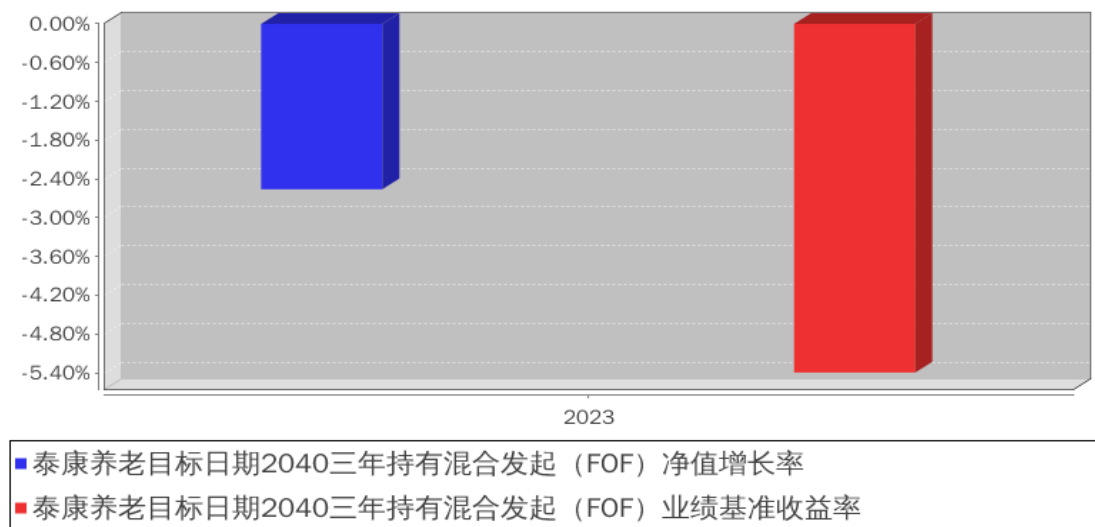


注：1、本基金基金合同于 2023 年 07 月 18 日生效, 截止报告期末本基金未满一年。

2、按照本基金的基金合同规定, 基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定, 截止报告期末本基金未过建仓期。

### 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

泰康养老目标日期2040三年持有混合发起 (FOF) 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：本基金成立于 2023 年 07 月 18 日, 2023 年度净值增长率的计算期间为 2023 年 07 月 18 日至 2023 年 12 月 31 日。

### 3.3 其他指标

无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

无。

## § 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

泰康基金管理有限公司（以下简称“泰康基金”）前身为泰康资产管理有限责任公司（以下简称“泰康资产”）公募事业部，2015年4月，泰康资产公募基金管理业务资格正式获得监管机构批准，成为首家获得该业务资格的保险资产管理公司。2021年9月1日，泰康资产获得证监会批准设立子公司泰康基金，2021年10月12日，泰康基金完成工商注册。2022年11月18日，泰康资产旗下公募基金产品的基金管理人变更为泰康基金。

泰康基金注册地为北京，注册资本为1.2亿元人民币。截至2023年12月31日，泰康基金共管理77只证券投资基金，已形成包括货币、债券、偏债混合、偏股混合、主动权益、沪港深系列、主动量化及被动指数、FOF基金等不同类型、不同风险收益特征的产品系列，并在养老目标基金、宽基及细分行业主题ETF、双碳、科技、大健康等方面均进行了战略布局，为广大投资者提供了丰富多元的投资选择。

#### 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 |        |   |
| 潘漪 | 本基金基金经理、FOF及多资产配置部负责人 | 2023年7月18日      | -    | 18年    | 潘漪于2018年3月加入泰康公募，现任泰康基金FOF及多资产配置部负责人、FOF基金经理。曾任瑞泰人寿保险有限公司投资部研究员、金元比联基金管理有限公司研究部研究员、泰康资产管理有限责任公司基金投资部研究员、阳光资产管理股份有限公司基金管理部高级投资经理等职务。2020年4月13日至今担任泰康睿福优选配置3个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金经理。2021年4月28日至今担任泰康福泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）基金经理。2021年6月29日至今担任泰康福泽积极养老目标五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金经理。2021年7月20日至今担任泰康福安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）基金经理。2023 |

|  |  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  |  | 年 7 月 18 日至今担任泰康养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 基金经理。 |
|--|--|--|--|--|--|

注：证券从业的含义遵从行业协会的相关规定。表中的任职日期和离任日期均指公司相关公告中披露的日期。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守相关法律法规以及基金合同的约定，本基金运作整体合法合规，没有出现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

本基金管理人制定了公平交易制度和流程，并按照证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规的相关规定，从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面，确保不同投资组合在投资管理活动中得到公平对待，杜绝不同投资组合之间进行利益输送，保护投资者合法权益。

公司公平交易管理制度要求交易以及投资管理过程中各个相关环节符合公平交易的监管要求。投资组合能够公平地获得投资信息、投资建议，并在投资决策委员会的制度规范下独立决策，实施投资决策时享有公平的机会。所有组合投资决策与交易执行保持隔离，任何组合必须经过公司交易部集中交易。各组合享有平等的交易权利，共享交易资源，保证各投资组合获得公平的贸易机会。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人公平对待旗下管理的所有基金和组合，建立了公平交易制度和流程，并严格执行。报告期内，本基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。在投资管理活动中，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

本报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行了分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金管理人建立了异常交易的监控与报告制度，对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。报告期内，没有出现本基金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 5% 的情况。报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

## 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

回顾 2023 年的资本市场，整体而言是股熊债牛，偏股基金指数下跌 14.6%，债券基金指数上涨 2.97%，货币基金指数上涨 1.96%。

权益市场主要反映了投资者对经济复苏的预期的波动，在 22 年 11 月疫情管控放开时，对经济复苏的预期极高，之后的经济数据使得这一预期逐渐降温，大家开始对一些中周期的东西给予了更多关注，例如房地产下行周期尚未结束、产能周期尚未见底等。同时，美国的利率在高位维持的时间也比预期的要更长，这也对一些国际资金的流动产生了影响。

权益资产中占优的是小微盘风格和高股息风格，前者主要由量化资金主导，后者则是体现了比较极致的避险倾向。此外，23 年在产业领域的主要变化来自于 AI，但由于产业仍处于早期，使得资产价格的波动非常大。

偏股基金指数历史首次连续下跌 3 个自然年度，给基金投资者的体验非常差，投资者开始了小幅的赎回。

债市收益率整体呈现中枢下移的趋势，十年国债收益率从年初的高点 2.95 附近最低下行到 2.55 附近，收益率曲线平坦化，信用利差也大幅收窄。

回顾我们在 23 年的操作，对经济复苏预期有些过于乐观了，尤其是在库存周期见底后，但实际情况是需求较弱的情况下，库存周期见底后的弹性非常小。这给我们的教训是，在新的国际环境和新的国内政策框架下，过去的规律不一定适用，经济会有新的范式，投资模式同样需要更新迭代，需要降低收益率预期，重视对于安全性的把握。

泰康 2040 养老目标基金成立于熊市期间，我们在成立后的建仓期一直保持着较低的权益仓位，但在建仓期临近结束期间，为了符合合同的约定，即权益类资产不得低于 35%，我们已经将仓位提升到下限以上。目前整体组合仍然是较为防御的状态，即权益基金方面超配了红利类和价值类风格的品种，债券基金方面主要以久期策略和信用策略为主。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.9744 元，本报告期基金份额净值增长率为-2.56%；同期业绩比较基准增长率为-5.40%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023 年实现了低基数下的 5.2% 的经济增长，2024 年作为十四五的最后一年，经济增速的目标为 5%，要实现这一目标还是有不小的压力。最主要的压力来自于两大中周期向下的问题，一是房地产周期，二是产能周期，此外还面临国际政治环境的较大不确定性。

在压力之外，我们也看到了一些相比于 23 年有改善的方面。首先是投资者的预期，2023 年实际上经历了一个预期从高到低不断降低的过程，体现为指数的不断下行；但站在 24 年初，投资者的预期已经足够低，甚至于在估值中打入了大量的远期悲观假设，一旦政策或者数据有所好转，预期可能会得到修复。其次是我们相信政府对于经济和资本市场的重视程度在提升，房价、股价、就业等问题关系到国计民生，政府正在出台稳增长、保就业、发展资本市场的各项政策。

估值是衡量股市投资价值的最为客观的指标，近期的整体估值水平无论是 PB 还是 PE 都达到了历史的极端低位。估值低不是市场上涨的充分必要条件，因为短期是否会出现超跌这样的尾部风险是难以预测的，但是中期看这必然是一个有投资价值的位置，所以这必然不是一个离场的时刻，而是逐步进场的时机。

在这样的阶段，其实不同的投资目标决定了不同的投资策略。我们的投资目标是要兼顾绝对收益和相对收益，在控制回撤的基础上争取超额。这样的投资目标决定了我们在市场左侧的时候更适合以防守反击的策略去构建组合，我们需要防范一定的尾部风险，当然可能也会牺牲一定的弹性，这是由我们的长期策略定位决定的。

在防守的部分，我们会做仓位控制，并在组合中配置一部分的红利和低估风格的品种。在进攻的部分，我们会主要通过配置一些成长风格和 ETF 品种来实现。

在固定收益部分，我们判断今年的债市依然有不错的表现，同时可转债在股市的底部区域也具备较好的性价比，也是我们择机配置的方向。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

为防范和化解经营风险，确保基金投资的合法合规、切实维护基金份额持有人的最大利益，基金管理人主要采取了如下监察稽核措施：

本基金管理人根据《证券投资基金法》等相关法律、法规、规章和公司管理制度，定期与不定期地对基金的投资、交易、产品、市场销售、信息技术等方面进行事前、事中或事后的监督检查。

同时，公司在产品开发、销售募集、投资交易、运营管理等业务环节，进行事前合规性审核，以有效防范业务风险；公司通过投资交易系统控制和人工审核控制相结合的方式，对基金投资交易情况进行监督，以确保基金投资满足监管法规、基金合同和公司制度的规定；公司设立专人负责信息披露工作，信息披露做到真实、准确、完整、及时；公司监察稽核人员日常对基金运作及员工行为的合规性进行定期和不定期检查，发现问题及时督促有关部门整改，并定期向风险控制委员会报告。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值小组，并制定了相关制度及流程。估值小组设成员若干名，成员由各相关部门选派，包括运营管理部、风险控制部、各投资部门（包括固定收益投资部、权益投资部、量化投资部、FOF 及多资产配置部）、监察稽核部等。估值小组成员具有一定的工作经验及专业胜任能力。

本公司基金经理参与讨论估值原则及方法，但不参与最终估值决策。

本报告期内，本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

与估值相关的机构包括上海、深圳、北京证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算有限责任公司以及中国基金业协会等。

本基金所采用的估值流程及估值结果均已经过会计师事务所鉴证，并经托管人复核确认。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同的相关规定，结合本基金实际运作情况，本报告期 2023 年 7 月 18 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日本基金未进行利润分配。

#### 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

本基金为发起式基金且截至本报告期末，合同生效不满三年，不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条的披露规定。

## § 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，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对泰康养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）的托管过程中，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、托管协议的规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 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，本托管人依照《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、托管协议的规定，对泰康养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本报告期内，由泰康基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、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 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 2404708 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   | 泰康养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 全体基金份额持有人:   |
| 审计意见      | <p>我们审计了后附的泰康养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) (以下简称“该基金”) 财务报表, 包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表, 自 2023 年 7 月 18 日 (基金合同生效日) 至 2023 年 12 月 31 日止期间的利润表、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 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2023 年 7 月 18 日 (基金合同生效日) 至 2023 年 12 月 31 日止期间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。  |
| 其他事项      | 无。  |
| 其他信息      | <p>该基金管理人泰康基金管理有限公司 (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 2023 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。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</p>   |

|                        |   |
|------------------------|---|
|                        | <p>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>  |
| <p>管理层和治理层对财务报表的责任</p> | <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 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>   |
| <p>注册会计师对财务报表审计的责任</p> | <p>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  | 左艳霞                       | 贾君宇 |
| 会计师事务所的地址 | 中国北京东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层 |     |
| 审计报告日期    | 2024 年 03 月 27 日          |     |

## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：泰康养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产            | 附注号        | 本期末<br>2023 年 12 月 31 日         |
|---------------|------------|---------------------------------|
| <b>资产：</b>    |            |                                 |
| 货币资金          | 7.4.7.1    | 1,668,604.82                    |
| 结算备付金         |            | -                               |
| 存出保证金         |            | 3,274.76                        |
| 交易性金融资产       | 7.4.7.2    | 21,514,200.72                   |
| 其中：股票投资       |            | -                               |
| 基金投资          |            | 21,514,200.72                   |
| 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        | 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         |            | 1,427,706.87                    |
| 应收股利          |            | -                               |
| 应收申购款         |            | 39.60                           |
| 递延所得税资产       |            | -                               |
| 其他资产          | 7.4.7.8    | -                               |
| 资产总计          |            | 24,613,826.77                   |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>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       |          | -             |
| 应付管理人报酬     |          | 11,825.34     |
| 应付托管费       |          | 4,116.08      |
| 应付销售服务费     |          | -             |
| 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        | 7.4.7.9  | 31,248.57     |
| 负债合计        |          | 47,189.99     |
| <b>净资产：</b> |          |               |
| 实收基金        | 7.4.7.10 | 25,211,445.93 |
| 其他综合收益      | 7.4.7.11 | -             |
| 未分配利润       | 7.4.7.12 | -644,809.15   |
| 净资产合计       |          | 24,566,636.78 |
| 负债和净资产总计    |          | 24,613,826.77 |

注：本基金合同生效日为 2023 年 07 月 18 日，本报告期自基金合同生效日 2023 年 07 月 18 日起至 2023 年 12 月 31 日止。报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.9744 元，基金份额总额 25,211,445.93 份。

## 7.2 利润表

会计主体：泰康养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)

本报告期：2023 年 7 月 18 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                | 附注号      | 本期<br>2023 年 7 月 18 日（基金合同<br>生效日）至 2023 年 12 月 31<br>日 |
|-------------------|----------|---|
| <b>一、营业总收入</b>    |          | -524,863.18   |
| 1. 利息收入           |          | 8,625.97  |
| 其中：存款利息收入         | 7.4.7.13 | 8,625.97  |
| 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        |          | -   |
| 其他利息收入            |          | -   |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） |          | -415,474.72   |
| 其中：股票投资收益         | 7.4.7.14 | -   |
| 基金投资收益            | 7.4.7.15 | -479,976.38   |
| 债券投资收益            | 7.4.7.16 | -   |
| 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   | 64,501.66   |
| 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)     | 7.4.7.21   | -118,014.43 |
| 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>            |            | 119,183.04  |
| 1. 管理人报酬                    | 7.4.10.2.1 | 67,979.00   |
| 其中：暂估管理人报酬                  |            | -           |
| 2. 托管费                      | 7.4.10.2.2 | 22,516.01   |
| 3. 销售服务费                    | 7.4.10.2.3 | -           |
| 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                   | 7.4.7.24   | -           |
| 7. 税金及附加                    |            | 88.03       |
| 8. 其他费用                     | 7.4.7.25   | 28,600.00   |
| <b>三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)</b> |            | -644,046.22 |
| 减：所得税费用                     |            | -           |
| <b>四、净利润 (净亏损以“-”号填列)</b>   |            | -644,046.22 |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>        |            | -           |
| <b>六、综合收益总额</b>             |            | -644,046.22 |

注：本基金合同生效日为 2023 年 7 月 18 日，本期是指自基金合同生效日 2023 年 7 月 18 日至 2023 年 12 月 31 日止期间，无上年度可比期间数据。

### 7.3 净资产变动表

会计主体：泰康养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)

本报告期：2023 年 7 月 18 日 (基金合同生效日) 至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目        | 本期   |        |       |       |
|-----------|--|--------|-------|-------|
|           | 2023 年 7 月 18 日 (基金合同生效日) 至 2023 年 12 月 31 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 | -  | -      | -     | -     |
| 加：会计政策变更  | -  | -      | -     | -     |
| 前期差错更     | -  | -      | -     | -     |

|  |               |   |             |               |
|--|---------------|---|-------------|---------------|
| 正  |               |   |             |               |
| 其他                                       | -             | - | -           | -             |
| 二、本期期初净资产                                | 25,184,649.32 | - | -           | 25,184,649.32 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | 26,796.61     | - | -644,809.15 | -618,012.54   |
| (一)、综合收益总额                               | -             | - | -644,046.22 | -644,046.22   |
| (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)      | 26,796.61     | - | -762.93     | 26,033.68     |
| 其中：1. 基金申购款                              | 26,796.61     | - | -762.93     | 26,033.68     |
| 2. 基金赎回款                                 | -             | - | -           | -             |
| (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)、其他综合收益结转留存收益                         | -             | - | -           | -             |
| 四、本期期末净资产                                | 25,211,445.93 | - | -644,809.15 | 24,566,636.78 |

注：本基金合同生效日为 2023 年 7 月 18 日，本期是指自基金合同生效日 2023 年 7 月 18 日至 2023 年 12 月 31 日止期间，无上年度可比期间数据。

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：

金志刚

基金管理人负责人

金志刚

主管会计工作负责人

李俊佑

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

泰康养老目标日期 2040 三年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”）证监许可 [2022] 3184 号《关于准予泰康养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 注册的批复》核准，由泰康基金管理有限公司（以下简称“泰康基金”）依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰康养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的开放式基金，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 25,157,361.84 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 2300818 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泰康养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 基金合同》于 2023 年 7 月 18 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 25,184,649.32 份基金份额，其中认购资金利息折合 27,287.48 份基金份额。本基金的基金管理人为泰康基金，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“浦发银行”）。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰康养老目标日期 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份额（含 QDII 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”）、股票（包含创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国债、金融债券、地方政府债、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、企业债券、公司债券、证券公司短期公司债券、可转换公司债券（含可分离交易可转债的纯债部分）、可交换公司债券、公开发行的次级债等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、同业存单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。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。本基金的投资组合比例为：本基金投资于中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金（含 QDII 基金、香港互认基金、公募 REITs）的比例不低于基金资产的 80%；其中，投资于股票、股票型基金和混合型基金等品种的比例合计不超过基金资产的 60%，投资于 QDII 基金和香港互认基金的比例合计不超过基金资产的 20%，投资于货币市场基金的比例不超过基金资产的 15%，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%，现金或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：（沪深 300 指数收益率\*95%+恒生指数收益率\*5%）\*X+中债综合（全价）指数收益率\*（1-X）。

本财务报表由本基金的基金管理人泰康基金于 2024 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〉》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》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 12 月 31 日的财务状况、自 2023 年 7 月 18 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表是本基金的首份财务报表，实际编制期间为自 2023 年 7 月 18 日（基金合同生效日）至 2023 年 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，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (a) 金融资产的分类

本基金的金融工具包括股票投资、债券投资、基金投资等。

本基金通常根据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，在初始确认时将金融资产分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、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摊余成本计量的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- 该金融资产的合同条款规定，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。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金现无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。

管理金融资产的商业模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。商业模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的商业模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

#### (b) 金融负债的分类

本基金将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及以摊余成本计量的金融负债。

##### - 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

##### - 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

#### 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

##### (a) 金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

##### (b) 金融工具的后续计量

##### - 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失（包括利息和

股利收入) 计入当期损益, 除非该金融资产属于套期关系的一部分。

- 以摊余成本计量的金融资产

初始确认后, 对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失, 在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时, 计入当期损益。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后, 对于该类金融负债以公允价值进行后续计量, 除与套期会计有关外, 产生的利得或损失 (包括利息费用) 计入当期损益。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后, 对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时, 本基金终止确认该金融资产:

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止;
- 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;
- 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。

金融资产整体转移满足终止确认条件的, 本基金将下列两项金额的差额计入当期损益:

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值;
- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债 (或其一部分) 的现时义务已经解除的, 本基金终止确认该金融负债 (或该部分金融负债)。

(d) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础, 对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备:

- 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

预期信用损失, 是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失, 是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额, 即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时, 本基金需考虑的最长期限为面临信用风险的最长合同期限 (包括考

考虑续约选择权)。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来 12 个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后 12 个月内（若金融工具的预计存续期少于 12 个月，则为预计存续期）可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或
- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定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。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。

与上述金融工具相同，但具有不同特征的，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，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，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。采用估值技术确定公允价值时，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。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似金融工具的现行市价及重大变化等因素，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

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 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份额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。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

投资收益

股票投资收益、债券投资收益和基金投资收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

#### 公允价值变动收益

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、衍生工具、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。不包括本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资在持有期间按票面利率计算的利息。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管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。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产款在资金实际占用期间按实际利率法逐日确认利息支出。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资，投资者持有的基金份额（原份额）所获得的红利再投资基金份额的持有期按原份额的持有期计算；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；本基金的每份基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 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。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

对于证券交易所上市的股票，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《中国证券监督管理委员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。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，根据中基协发 [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》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

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）》，按如下方法估值：

(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；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；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；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。

(b) 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：

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；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；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。

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》（以下简称“估值处理标准”），在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

## 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

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

## 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 [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》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。

(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) 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费附加。



## 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<br>2023 年 12 月 31 日 |
|----------------|-------------------------|
| 活期存款           | 1,668,604.82            |
| 等于：本金          | 1,668,281.04            |
| 加：应计利息         | 323.78                  |
| 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             | 1,668,604.82            |

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目                | 本期末<br>2023 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<br>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                | 21,632,215.15           | -    | 21,514,200.72 | -118,014.43 |
| 其他                | -                       | -    | -             | -           |
| 合计                | 21,632,215.15           | -    | 21,514,200.72 | -118,014.43 |

## 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

无。

## 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

## 7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

## 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

无。

## 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

## 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

无。

## 7.4.7.5 债权投资

## 7.4.7.5.1 债权投资情况

无。

## 7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

## 7.4.7.6 其他债权投资

## 7.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

## 7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

## 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

无。

## 7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

## 7.4.7.8 其他资产

无。

## 7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 |
|----|-----|
|----|-----|

| 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           | 6,748.57  |
| 其中：交易所市场         | 6,748.57  |
| 银行间市场            | -         |
| 应付利息             | -         |
| 预提费用             | 24,500.00 |
| 合计               | 31,248.57 |

#### 7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2023 年 7 月 18 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日 |               |
|---------------|--|---------------|
|               | 基金份额（份）  | 账面金额          |
| 基金合同生效日       | 25,184,649.32                                    | 25,184,649.32 |
| 本期申购          | 26,796.61  | 26,796.61     |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -  | -             |
| 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           | 25,211,445.93                                    | 25,211,445.93 |

注：1. 申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

2. 本基金自 2023 年 6 月 5 日至 2023 年 7 月 14 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金 25,184,649.32 元。根据《泰康养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）招募说明书》和《泰康养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）份额发售公告》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入 27,287.48 元在本基金成立后，折算为 27,287.48 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

#### 7.4.7.11 其他综合收益

无。

#### 7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

| 项目       | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------|-------|-------|---------|
| 基金合同生效日  | -     | -     | -       |
| 加：会计政策变更 | -     | -     | -       |
| 前期差错更正   | -     | -     | -       |

|                |             |             |             |
|----------------|-------------|-------------|-------------|
| 其他             | -           | -           | -           |
| 本期期初           | -           | -           | -           |
| 本期利润           | -526,031.79 | -118,014.43 | -644,046.22 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -338.47     | -424.46     | -762.93     |
| 其中：基金申购款       | -338.47     | -424.46     | -762.93     |
| 基金赎回款          | -           | -           | -           |
| 本期已分配利润        | -           | -           | -           |
| 本期末            | -526,370.26 | -118,438.89 | -644,809.15 |

#### 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期   |  |
|-----------|--|--|
|           | 2023 年 7 月 18 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日 |  |
| 活期存款利息收入  | 8,505.12                                   |  |
| 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 | 102.93                                     |  |
| 其他        | 17.92                                      |  |
| 合计        | 8,625.97                                   |  |

#### 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

无。

##### 7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

无。

##### 7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

#### 7.4.7.15 基金投资收益

单位：人民币元

| 项目                | 本期   |  |
|-------------------|--|--|
|                   | 2023 年 7 月 18 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日 |  |
| 卖出/赎回基金成交总额       | 15,791,397.16                              |  |
| 减：卖出/赎回基金成本总额     | 16,216,340.69                              |  |
| 减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额 | 733.55                                     |  |
| 减：交易费用            | 54,299.30                                  |  |
| 基金投资收益            | -479,976.38                                |  |

#### 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

无。

##### 7.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

##### 7.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

##### 7.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

#### 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

无。

##### 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

无。

##### 7.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

##### 7.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

#### 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

无。

##### 7.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

##### 7.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

##### 7.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

#### 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

无。

**7.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益**

无。

**7.4.7.20 股利收益**

单位：人民币元

| 项目            | 本期                              |
|---------------|---------------------------------|
|               | 2023年7月18日（基金合同生效日）至2023年12月31日 |
| 股票投资产生的股利收益   | -                               |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | -                               |
| 基金投资产生的股利收益   | 64,501.66                       |
| 合计            | 64,501.66                       |

**7.4.7.21 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期                              |
|------------------------|---------------------------------|
|                        | 2023年7月18日（基金合同生效日）至2023年12月31日 |
| 1. 交易性金融资产             | -118,014.43                     |
| 股票投资                   | -                               |
| 债券投资                   | -                               |
| 资产支持证券投资               | -                               |
| 基金投资                   | -118,014.43                     |
| 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                     | -118,014.43                     |

**7.4.7.22 其他收入**

无。

**7.4.7.23 持有基金产生的费用**

| 项目                   | 本期                              |
|----------------------|---------------------------------|
|                      | 2023年7月18日（基金合同生效日）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） | 384.45                          |
| 当期持有基金产生的应支付管理费（元）   | 60,068.39                       |
| 当期持有基金产生的应支付托管费（元）   | 12,983.39                       |

注：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

无。

#### 7.4.7.25 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2023 年 7 月 18 日（基金合同生效日）至 2023 年<br>12 月 31 日 |
|---------|---|
| 审计费用    | 20,000.00   |
| 信息披露费   | -   |
| 证券出借违约金 | -   |
| 银行费用    | 700.00  |
| 债券帐户维护费 | 7,500.00  |
| 其他      | 400.00  |
| 合计      | 28,600.00   |

#### 7.4.7.26 分部报告

无。

#### 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             |
|------------------------|---------------------|
| 泰康基金管理有限公司             | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 上海浦东发展银行股份有限公司（“浦发银行”） | 基金托管人、基金销售机构        |
| 泰康保险集团股份有限公司           | 基金管理人的最终控股母公司       |
| 泰康资产管理有限责任公司           | 基金管理人控股股东           |
| 嘉兴昱泰资产管理合伙企业（有限合伙）     | 基金管理人的股东            |
| 嘉兴舜泰资产管理合伙企业（有限合伙）     | 基金管理人的股东            |
| 嘉兴祺泰资产管理合伙企业（有限合伙）     | 基金管理人的股东            |
| 嘉兴崇泰资产管理合伙企业（有限合伙）     | 基金管理人的股东            |
| 嘉兴宸泰资产管理合伙企业（有限合伙）     | 基金管理人的股东            |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 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

无。

###### 7.4.10.1.2 债券交易

无。

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

###### 7.4.10.1.4 基金交易

无。

###### 7.4.10.1.5 权证交易

无。

###### 7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

无。

##### 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                              |
|------------------|---------------------------------|
|                  | 2023年7月18日（基金合同生效日）至2023年12月31日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 67,979.00                       |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 18,601.08                       |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 49,377.92                       |

注：本基金对持有的基金管理人自身管理的基金部分不收取管理费。支付基金管理人泰康基金的基金管理费按前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金管理人自身管理的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。计算公式为：

$$\text{日基金管理费} = \text{前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金管理人自身管理的基金部分后的余额} \times 0.80\% / \text{当年天数}$$

本基金本期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为 22,222.44 元。

###### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元



| 项目             | 本期   |
|----------------|--|
|                | 2023 年 7 月 18 日 (基金合同生效日) 至 2023 年 12 月 31 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 22,516.01                                    |

注：本基金对持有的基金托管人自身托管的基金部份不收取托管费。

支付基金托管人浦发银行的基金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自身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。计算公式为：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金托管人自身托管的其他基金部分后的余额} \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

本基金本期因投资于基金托管人所托管的其他基金而已在托管费计算基数中扣除部分对应的托管费金额为 0.00 元。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

无。

#### 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

无。

#### 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

无。

##### 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

无。

#### 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

本报告期 2023 年 7 月 18 日 (基金合同生效日) 至 2023 年 12 月 31 日，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 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

| 关联方名称 | 本期末              |                      |
|-------|------------------|----------------------|
|       | 2023 年 12 月 31 日 |                      |
|       | 持有的基金份额          | 持有的基金份额占基金总份额的比例 (%) |

|              |               |         |
|--------------|---------------|---------|
| 泰康资产管理有限责任公司 | 10,015,112.62 | 39.7245 |
|--------------|---------------|---------|

#### 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<br>2023年7月18日(基金合同生效日)至2023年12月31日 |          |
|-------|---------------------------------------|----------|
|       | 期末余额                                  | 当期利息收入   |
| 浦发银行  | 1,668,604.82                          | 8,505.12 |

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行约定利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 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

本报告期末，本基金持有基金管理人所管理的公开募集证券投资基金合计 6,734,219.59 元，占本基金资产净值的比例为 27.41%。

##### 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

| 项目                   | 本期费用<br>2023年7月18日(基金合同生效日)至2023年12月31日 |   |
|----------------------|---|---|
|                      | 当期交易基金产生的申购费(元)                         | - |
| 当期交易基金产生的赎回费(元)      | -                                       |   |
| 当期持有基金产生的应支付销售服务费(元) | -                                       |   |
| 当期持有基金产生的应支付管理费(元)   | 20,089.45                               |   |
| 当期持有基金产生的应支付托管费(元)   | 4,152.58                                |   |

注：当期持有基金产生的应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金的基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率和计算方法计算得出。

根据相关法律法规及本基金合同的约定，基金管理人不得对基金中基金财产中持有的自身管理的基金部分收取基金中基金的管理费，基金托管人不得对基金中基金财产中持有的自身托管的基金部分收取基金中基金的托管费。基金管理人运用本基金财产申购自身管理的其他基金的（ETF 除外），应当通过直销渠道申购且不收取申购费、赎回费（按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并计入基金资产的赎回费用除外）、销售服务费等销售费用，其中申购费、赎回费

在实际申购、赎回时按上述规定执行，销售服务费由本基金管理人从被投资基金收取后返还至本基金基金资产。

#### 7.4.11 利润分配情况

无。

#### 7.4.12 期末（2023 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

无。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 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

无。

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

##### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金中基金，其长期平均风险和预期收益高于货币市场基金、货币型基金中基金、债券型基金和债券型基金中基金，低于股票型基金和股票型基金中基金。本基金投资的金融工具主要包括经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金份额、股票、债券和货币市场工具等。本基金在日常经营活动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、市场风险等。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是精选优质投资标的，在有效控制风险前提下保持一定流动性，力求超越业绩比较基准的投资回报，实现基金资产的长期稳健增值。

本基金的基金管理人董事会重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系，公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任。

为加强公募基金管理的内部控制，促进诚信、合法、有效经营的内部控制环境，保障基金持有人利益，基金管理人遵照国家有关法律法规，遵循合法合规性原则、全面性原则、审慎性原则和适时性原则，制定了系统完善的内部控制制度。内部控制的主要内容包括投资管理业务控制、

市场营销与过户登记业务控制、信息披露控制、监察稽核控制等。

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产生的可能损失。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上海浦东发展银行股份有限公司,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办理,违约可能性很小;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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位:人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2023年12月31日 |
|--------|--------------------|
| A-1    | 0.00               |
| A-1 以下 | 0.00               |
| 未评级    | 0.00               |
| 合计     | 0.00               |

注:短期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级,并由发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。以上按短期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

##### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位:人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2023年12月31日 |
|--------|--------------------|
|--------|--------------------|

|        |      |
|--------|------|
| A-1    | 0.00 |
| A-1 以下 | 0.00 |
| 未评级    | 0.00 |
| 合计     | 0.00 |

注：短期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|
| A-1    | 0.00                    |
| A-1 以下 | 0.00                    |
| 未评级    | 0.00                    |
| 合计     | 0.00                    |

注：短期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|
| AAA    | 0.00                    |
| AAA 以下 | 0.00                    |
| 未评级    | 0.00                    |
| 合计     | 0.00                    |

注：长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|
| AAA    | 0.00                    |
| AAA 以下 | 0.00                    |
| 未评级    | 0.00                    |
| 合计     | 0.00                    |

注：长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|
| AAA    | 0.00                    |
| AAA 以下 | 0.00                    |
| 未评级    | 0.00                    |
| 合计     | 0.00                    |

注：长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。

#### 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持有时间满三年后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 2023 年 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合同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，因此账面余额约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期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(ETF 联接基金除外)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该比例限制)。

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 2023 年 12 月 31 日，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未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。于 2023 年 12 月 31 日，本基金确认的净赎回申请未超过 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。

#### 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货币资金、结算备付金、债券投资、资产支持证券投资及买入返售金融资产等。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2023 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                    | 1,668,604.82 | -     | -     | -             | 1,668,604.82  |
| 存出保证金                   | 3,274.76     | -     | -     | -             | 3,274.76      |
| 交易性金融资产                 | -            | -     | -     | 21,514,200.72 | 21,514,200.72 |
| 应收申购款                   | -            | -     | -     | 39.60         | 39.60         |
| 应收清算款                   | -            | -     | -     | 1,427,706.87  | 1,427,706.87  |
| 资产总计                    | 1,671,879.58 | -     | -     | 22,941,947.19 | 24,613,826.77 |
| <b>负债</b>               |              |       |       |               |               |
| 应付管理人报酬                 | -            | -     | -     | 11,825.34     | 11,825.34     |
| 应付托管费                   | -            | -     | -     | 4,116.08      | 4,116.08      |
| 其他负债                    | -            | -     | -     | 31,248.57     | 31,248.57     |
| 负债总计                    | -            | -     | -     | 47,189.99     | 47,189.99     |
| 利率敏感度缺口                 | 1,671,879.58 | -     | -     | 22,894,757.20 | 24,566,636.78 |

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

| 假设 | 假设其他变量不变，仅利率发生合理、可能的变动，考察为交易而持有的债券公允价值的变动对基金利润总额和净值产生的影响 |                             |
|----|--|-----------------------------|
|    | 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 12 月 31 日）       |
| 分析 | 市场利率上调<br>0.25%  | 0.00                        |
|    | 市场利率下调<br>0.25%  | 0.00                        |

#### 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。

本基金采用定性分析与定量分析相结合的分析框架，自上而下灵活配置大类资产，自下而上精选投资标的，在控制风险的前提下集中资金进行优质证券的投资管理，同时进行高效的流动性管理，力争利用主动组合管理获得超过业绩比较基准的收益。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金的投资组合比例为：本基金投资于中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金（含 QDII 基金和香港互认基金）的比例不低于基金资产的 80%；其中，投资于股票、股票型基金和混合型基金等品种的比例合计不超过基金资产的 60%，投资于 QDII 基金和香港互认基金的比例合计不超过基金资产的 20%，投资于货币市场基金的比例不超过基金资产的 15%，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%，现金或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。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，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来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。

#### 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<br>2023 年 12 月 31 日 |               |
|---------------|-------------------------|---------------|
|               | 公允价值                    | 占基金资产净值比例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | -                       | -             |
| 交易性金融资产—基金投资  | 21,514,200.72           | 87.57         |
| 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            | 21,514,200.72           | 87.57         |

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2023 年 12 月 31 日，本基金成立未满一年，尚无足够经验数据。

## 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。

### 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<br>2023年12月31日 |
|---------------|--------------------|
| 第一层次          | 21,514,200.72      |
| 第二层次          | -                  |
| 第三层次          | -                  |
| 合计            | 21,514,200.72      |

#### 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。

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值的层次。

#### 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

无。

##### 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

无。

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 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

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 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              | 21,514,200.72 | 87.41         |
| 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      | 1,668,604.82  | 6.78          |
| 8  | 其他各项资产            | 1,431,021.23  | 5.81          |
| 9  | 合计                | 24,613,826.77 | 100.00        |

注：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。

### 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

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

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。

### 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

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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未买入股票。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未卖出股票。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未买入及卖出股票。

## 8.5 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。

## 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

本基金本报告期末未持有债券。

## 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

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

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

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

本基金本报告期内未投资股指期货。

## 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

本基金本报告期内未投资国债期货。

### 8.11.2 本期国债期货投资评价

无。

## 8.12 本报告期投资基金情况

### 8.12.1 投资政策及风险说明

本基金采用目标日期策略，依照下滑曲线进行大类资产配置，随着目标日期临近，逐渐降低权益资产的配置比例，在力争实现养老目标的前提下，追求养老资产的长期稳健增值。本基金随着投资人生命周期的延续和投资目标日期的临近，基金的投资风格相应的从“平衡”，转变为“稳健”，再转变为“保守”，权益类资产比例逐步下降，而非权益类资产比例逐步上升。本基金根据泰康目标日期型基金下滑曲线模型进行动态资产配置，下滑曲线模型运用随机动态规划技术，对跨生命周期的投资、消费进行了优化求解，并结合国内法规约束和投资工具范围作了本土化改进。随着本基金目标日期的临近，权益类资产投资比例逐渐下降。在下滑曲线模型的基础上，进行风险预算，控制基金相对回撤，精细挑选符合本基金投资目标的标的基金，构建投资组合。基金管理人将对全市场的主动型基金和被动型基金进行业绩分析、组合分析、费率比较、流动性比较等，权衡主动型基金和被动型基金的相对优势，在权益类、固收类和商品类的内部确定主动和被动的配置比例，并进行动态调整。对于主动管理型基金，基金管理人创立了“以基金经理为核心”的

研究体系，覆盖全市场各种风格的基金经理和基金产品，基金将结合对市场风格、结构轮动的判断，选取部分投资风格适合当前市场、评价打分较高的基金经理所管理的基金进行组合投资；在被动指数型基金的筛选上，本基金将首先结合基金管理人对市场结构走势的判断，将适合当前市场的、已开发成基金的指数产品筛选出来，通过综合比较来选择优质的指数基金进行投资。

股票投资上，本 FOF 在股票基本面研究的基础上，同时考虑投资者情绪、认知等决策因素的影响，将影响上市公司基本面和股价的增长类因素、估值类因素、盈利类因素、财务风险等因素进行综合分析，精选具有较高投资价值的上市公司，进行股票的选择与组合优化。同时，本基金基于流动性管理及策略性投资的需要，投资于债券资产。债券投资策略包括：久期管理策略；期限结构配置策略；骑乘策略；息差策略；信用策略；个券精选策略；证券公司短期公司债券投资策略；可转换债券投资策略等。

本基金为混合型基金中基金，其预期风险与预期收益高于货币市场基金、货币型基金中基金、债券型基金和债券型基金中基金，低于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  | 007417 | 泰康信用精选债券 A      | 契约型开放式       | 2,309,256.75 | 2,530,945.40 | 10.30         | 是                      |
| 2  | 002245 | 泰康稳健增利债券 A      | 契约型开放式       | 1,841,417.88 | 2,517,954.81 | 10.25         | 是                      |
| 3  | 100018 | 富国天利增长债券        | 契约型开放式       | 1,854,330.76 | 2,515,770.54 | 10.24         | 否                      |
| 4  | 513980 | 景顺长城中证港股通科技 ETF | 交易型开放式 (ETF) | 3,400,000.00 | 1,536,800.00 | 6.26          | 否                      |
| 5  | 007888 | 农银金盈债券          | 契约型开         | 1,381,324.43 | 1,445,832.28 | 5.89          | 否                      |

|    |        |                  |                |              |              |      |   |
|----|--------|------------------|----------------|--------------|--------------|------|---|
|    |        |                  | 放式             |              |              |      |   |
| 6  | 006985 | 兴全恒裕债券 A         | 契约型开放式         | 1,136,942.86 | 1,268,146.07 | 5.16 | 否 |
| 7  | 005014 | 泰康景泰回报混合 A       | 契约型开放式         | 770,321.07   | 1,236,519.38 | 5.03 | 是 |
| 8  | 006195 | 国金量化多因子股票        | 契约型开放式         | 589,617.66   | 1,235,425.88 | 5.03 | 否 |
| 9  | 161834 | 银华鑫锐灵活配置混合 (LOF) | 上市契约型开放式 (LOF) | 786,911.50   | 1,183,514.90 | 4.82 | 否 |
| 10 | 011371 | 华商远见价值混合 A       | 契约型开放式         | 2,102,739.87 | 1,006,161.03 | 4.10 | 否 |
| 11 | 159915 | 创业板 ETF          | 交易型开放式 (ETF)   | 400,000.00   | 736,800.00   | 3.00 | 否 |
| 12 | 217021 | 招商优势企业混合         | 契约型开放式         | 207,136.53   | 726,427.81   | 2.96 | 否 |
| 13 | 000006 | 西部利得量化成长混合 A     | 契约型开放式         | 287,325.00   | 593,498.52   | 2.42 | 否 |
| 14 | 010761 | 华商甄选回报混合         | 契约型开放式         | 460,887.36   | 581,040.69   | 2.37 | 否 |
| 15 | 002252 | 融通成长 30 灵活配置混合   | 契约型开放式         | 201,717.62   | 498,242.52   | 2.03 | 否 |

|    |        |                                       |                         |              |            |      |   |
|----|--------|---------------------------------------|-------------------------|--------------|------------|------|---|
| 16 | 516510 | 易方达<br>中证云<br>计算与<br>大数据<br>主题<br>ETF | 交易<br>型开<br>放式<br>(ETF) | 530,000.00   | 484,950.00 | 1.97 | 否 |
| 17 | 513700 | 鹏华中<br>证港股<br>通医药<br>卫生综<br>合 ETF     | 交易<br>型开<br>放式<br>(ETF) | 1,000,000.00 | 481,000.00 | 1.96 | 否 |
| 18 | 515380 | 泰康沪<br>深<br>300ETF                    | 交易<br>型开<br>放式<br>(ETF) | 120,000.00   | 448,800.00 | 1.83 | 是 |
| 19 | 159997 | 电子<br>ETF                             | 交易<br>型开<br>放式<br>(ETF) | 400,000.00   | 362,400.00 | 1.48 | 否 |
| 20 | 008060 | 景顺长<br>城价值<br>边际灵<br>活配置<br>混合        | 契约<br>型开<br>放式          | 90,907.74    | 123,970.89 | 0.50 | 否 |

### 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

本报告期内本基金投资的前十名证券发行主体未出现被监管部门立案调查的情况，在报告编制前一年内未受到公开谴责、处罚。

#### 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

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

#### 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 | 3,274.76     |
| 2  | 应收清算款 | 1,427,706.87 |



|   |       |              |
|---|-------|--------------|
| 3 | 应收股利  | -            |
| 4 | 应收利息  | -            |
| 5 | 应收申购款 | 39.60        |
| 6 | 其他应收款 | -            |
| 7 | 待摊费用  | -            |
| 8 | 其他    | -            |
| 9 | 合计    | 1,431,021.23 |

#### 8.13.4 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。

#### 8.13.5 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未存在流通受限情况。

#### 8.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

- 1、由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。
- 2、报告期内没有需说明的证券投资决策程序。

## § 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

| 持有人户数<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>(%) | 持有份额          | 占总份额比例<br>(%) |
| 356          | 70,818.67     | 10,015,116.70 | 39.72         | 15,196,329.23 | 60.28         |

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 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 | 1,544,104.91 | 6.1246       |

### 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                                 | 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<br>究部门负责人持有本开放式基金 | >100               |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                    | 10~50              |

### 9.4 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<br>额<br>占基<br>金<br>总<br>份<br>额<br>比<br>例<br>(%) | 发起份<br>额<br>总<br>数 | 发起份<br>额<br>占<br>基<br>金<br>总<br>份<br>额<br>比<br>例<br>(%) | 发起份<br>额<br>承<br>诺<br>持<br>有<br>期<br>限 |
|-----------------|---------------|---|--------------------|---|--|
| 基金管理人固有资<br>金   | -             | -   | -                  | -   | -                                      |
| 基金管理人高级管<br>理人员 | -             | -   | -                  | -   | -                                      |
| 基金经理等人员         | -             | -   | -                  | -   | -                                      |
| 基金管理人股东         | 10,015,112.62 | 39.72   | 10,015,112.62      | 39.72   | 3年                                     |
| 其他              | -             | -   | -                  | -   | -                                      |
| 合计              | 10,015,112.62 | 39.72   | 10,015,112.62      | 39.72   | -                                      |

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

|                                    |               |
|------------------------------------|---------------|
| 基金合同生效日（2023 年 7 月 18 日）<br>基金份额总额 | 25,184,649.32 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金<br>总申购份额          | 26,796.61     |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基<br>金总赎回份额        | -             |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金<br>拆分变动份额         | -             |
| 本报告期期末基金份额总额                       | 25,211,445.93 |

注：（1）报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额；基金总赎回份额含转换出份额。

（2）本基金合同生效日为 2023 年 7 月 18 日，截止报告期末本基金未满一年。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期本基金未召开基金份额持有人大会。

### 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

2023 年 3 月 15 日, 泰康基金管理有限公司成立上海分公司, 金志刚担任上海分公司负责人。2023 年 4 月 19 日, 泰康基金管理有限公司成立深圳分公司, 金志刚担任深圳分公司负责人。2023 年 12 月 3 日, 金志刚不再担任上海分公司负责人及深圳分公司负责人, 并聘任吴辉担任上海分公司负责人, 代胜伟担任深圳分公司负责人。

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。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金无投资策略的变化。

### 11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本报告期内, 华商远见价值混合型证券投资基金自 2023 年 9 月 2 日起至 2023 年 9 月 25 日止以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会, 审议变更基金投资范围有关事项, 基金份额持有人大会决议已于 2023 年 9 月 26 日生效, 该基金修订基金合同和托管协议等法律文件, 将投资范围增加港股通标的股票, 删除中小板, 修改后基金的投资组合比例为股票 (包含创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准或注册上市的股票) 投资比例为基金资产的 60%-95%, 港股通标的股票投资比例不得超过股票资产的 50%; 招商优势企业灵活配置混合型证券投资基金自 2023 年 12 月 18 日起至 2024 年 1 月 30 日止以通讯方式召开基金份额持有人大会, 审议变更注册有关事项的议案, 基金份额持有人大会决议已于 2024 年 1 月 31 日生效, 该基金修订基金合同和托管协议等法律文件, 对基金名称进行变更, 并调整基金投资目标、投资范围、投资策略、投资限制、业绩比较基准、风险收益特征、基金收益分配原则、基金估值精度、C 类基金份额的销售服务费、C 类基金份额的销售服务费。

除上述基金外, 本基金所投资的其他子基金未发生包括转换运作方式、与其他基金合并、终止基金合同、召开基金份额持有人大会表决意见等重大影响事件。

## 11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘任毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，本年度应支付给毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）报酬为 20,000.00 元；截至 2023 年 12 月 31 日，该审计机构向本基金提供审计服务不满 1 年。

## 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

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

### 11.7.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

## 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 (%) |    |
| 方正证券 | 2      | -    | -                | -         | -              | -  |
| 广发证券 | 2      | -    | -                | 19,558.40 | 100.00         | -  |

注：1、此处的佣金指本基金通过券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

#### 2、交易单元的选择标准和程序

交易单元租用券商选择的首要标准为符合监管机构相关规定，包括但不限于满足以下条件：

- (1) 经营行为规范，近一年内无重大违规行为，未受监管机构重大处罚；
- (2) 财务状况和经营状况良好；
- (3) 内部管理规范，具备健全的内控制度，在业内有良好的声誉；
- (4) 有较强的研究能力，能提供质量较高的市场研究报告，并能根据基金投资需求提供专门的研究报告；
- (5) 能及时提供准确的信息资讯服务；
- (6) 满足基金运作的保密要求；
- (7) 符合中国证监会规定的其他条件。

本基金管理人依据以上标准，定期或者不定期对候选券商研究实力和服务质量进行评估，确定租用交易单元的券商，基金管理人与被选择的券商签订相关协议并通知托管行。

3、本报告期内本基金新增租用 4 个交易单元，为方正证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，广发证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个。

### 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 (%) |
| 方正证券 | -    | -                | -      | -                  | -    | -                | -             | -                |
| 广发证券 | -    | -                | -      | -                  | -    | -                | 22,946,511.20 | 100.00           |

### 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  | 泰康养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 招募说明书       | 《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2023 年 05 月 30 日 |
| 2  | 泰康养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 基金产品资料概要    | 《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2023 年 05 月 30 日 |
| 3  | 泰康养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 基金合同        | 《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2023 年 05 月 30 日 |
| 4  | 泰康养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 托管协议        | 《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2023 年 05 月 30 日 |
| 5  | 泰康养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 基金份额发售公告    | 《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2023 年 05 月 30 日 |
| 6  | 关于泰康养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 延长募集时间的公告 | 《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2023 年 06 月 16 日 |
| 7  | 泰康养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 可投资科创板股票的公告 | 《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2023 年 07 月 19 日 |
| 8  | 泰康养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 基金合同生效公告    | 《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2023 年 07 月 19 日 |

|    |  |                              |                  |
|----|--|------------------------------|------------------|
| 9  | 泰康养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 基金产品资料概要更新                                    | 《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2023 年 07 月 20 日 |
| 10 | 泰康基金管理有限公司关于泰康养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 可投资于公开募集基础设施证券投资基金并修订基金合同、托管协议的公告 | 《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2023 年 08 月 21 日 |
| 11 | 泰康养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 基金产品资料概要更新                                    | 《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2023 年 08 月 21 日 |
| 12 | 泰康养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 招募说明书 (2023 年第 1 次更新)                         | 《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2023 年 08 月 21 日 |
| 13 | 泰康养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 基金合同更新  | 《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2023 年 08 月 21 日 |
| 14 | 泰康养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 托管协议更新  | 《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2023 年 08 月 21 日 |
| 15 | 泰康基金管理有限公司关于终止凤凰金信 (海口) 基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告                                    | 《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2023 年 09 月 08 日 |
| 16 | 关于泰康养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 参加部分销售机构费率优惠活动的公告                           | 《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2023 年 10 月 13 日 |
| 17 | 泰康养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 开放日常申购、赎回及定期定额投资业务公告                          | 《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2023 年 10 月 13 日 |
| 18 | 泰康养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 2023 年第三季度报告                                  | 《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2023 年 10 月 24 日 |
| 19 | 关于泰康基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加上海万得基金销售有限公司转换费率优惠活动的公告                                     | 《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2023 年 11 月 08 日 |
| 20 | 关于泰康基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加平安银行股份有限公司转换费率优惠活动的公告                                       | 《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2023 年 11 月 27 日 |
| 21 | 关于泰康基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加嘉实财富管理有限公司转换费率优惠活动的公告                                       | 《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2023 年 11 月 29 日 |
| 22 | 泰康养老目标日期 2040 三年持有期  | 《证券时报》;中国证监会                 | 2023 年 12 月 08 日 |

|    |   |                              |                  |
|----|---|------------------------------|------------------|
|    | 混合型发起式基金中基金 (FOF) 更新招募说明书 (2023 年第 2 次更新)       | 会基金电子披露网站及基金管理人网站            |                  |
| 23 | 泰康养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 基金产品资料概要更新 | 《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2023 年 12 月 08 日 |
| 24 | 泰康基金管理有限公司关于深圳分公司负责人变更的公告                       | 《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2023 年 12 月 15 日 |
| 25 | 泰康基金管理有限公司关于上海分公司负责人及注册地址变更的公告                  | 《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2023 年 12 月 16 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              | 20230718-20231231       | 10,015,112.62 | 0.00 | 0.00 | 10,015,112.62 | 39.72    |
| 个人   | -              | -                       | -             | -    | -    | -             | -        |
| 产品特有风险   |                |                         |               |      |      |               |          |
| <p>当本基金出现单一持有者持有基金份额比例达到或者超过 20%时，基金管理人将审慎确认大额申购与大额赎回，投资者将面对管理人拒绝或暂停申购的风险、暂停赎回或延缓支付赎回款项的风险、巨额赎回的风险，以及当管理人确认大额申购与大额赎回时，可能会对基金份额净值造成一定影响等特有风险。</p> |                |                         |               |      |      |               |          |

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

(一) 中国证监会准予泰康养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 注册的文件;

(二) 《泰康养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 基金合同》;

(三) 《泰康养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 招募说明书》;

(四) 《泰康养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 托管协议》;

(五) 《泰康养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 产品资料概要》。

### 13.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

### 13.3 查阅方式

投资者可通过指定信息披露报纸 (《证券时报》) 或登录基金管理人网站 ( <http://www.tkfunds.com.cn> ) 和中国证监会基金电子披露网站 ( <http://eid.csrc.gov.cn/fund> ) 查阅。

泰康基金管理有限公司

2024 年 3 月 29 日