

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)  
2024 年第 2 季度报告

2024 年 6 月 30 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：2024 年 7 月 18 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 2024 年 7 月 16 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 2024 年 4 月 1 日起至 6 月 30 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 | 283,091,094.83 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 | 247,472,326.93 份  | 35,618,767.90 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 (2024 年 4 月 1 日-2024 年 6 月 30 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      | -1,065,172.85                        | -112,676.86                    |
| 2. 本期利润         | 1,393,944.91                         | 219,624.14                     |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0056                               | 0.0063                         |
| 4. 期末基金资产净值     | 206,408,018.19                       | 29,957,058.68                  |
| 5. 期末基金份额净值     | 0.8341                               | 0.8410                         |

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 |
|----|--------|-----------|------------|--------------|-----|-----|
|    |        |           |            |              |     |     |

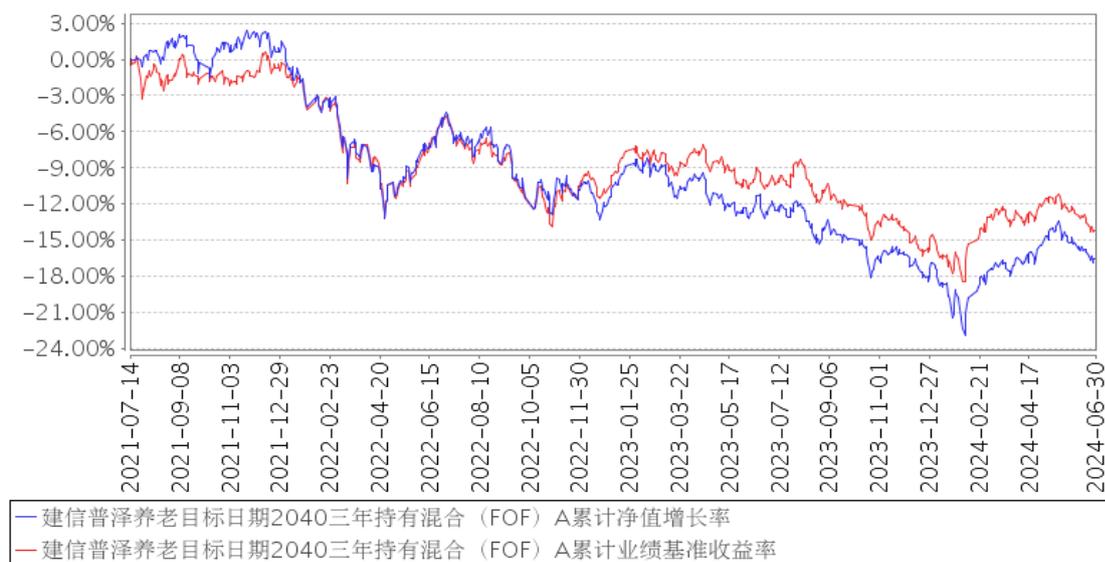
|                |         |       |         | ④     |        |       |
|----------------|---------|-------|---------|-------|--------|-------|
| 过去三个月          | 0.69%   | 0.44% | -1.08%  | 0.40% | 1.77%  | 0.04% |
| 过去六个月          | 0.37%   | 0.58% | 0.47%   | 0.51% | -0.10% | 0.07% |
| 过去一年           | -4.90%  | 0.51% | -4.39%  | 0.46% | -0.51% | 0.05% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | -16.59% | 0.54% | -14.21% | 0.52% | -2.38% | 0.02% |

建信普泽养老目标日期 2040 三年持有混合 (FOF) Y

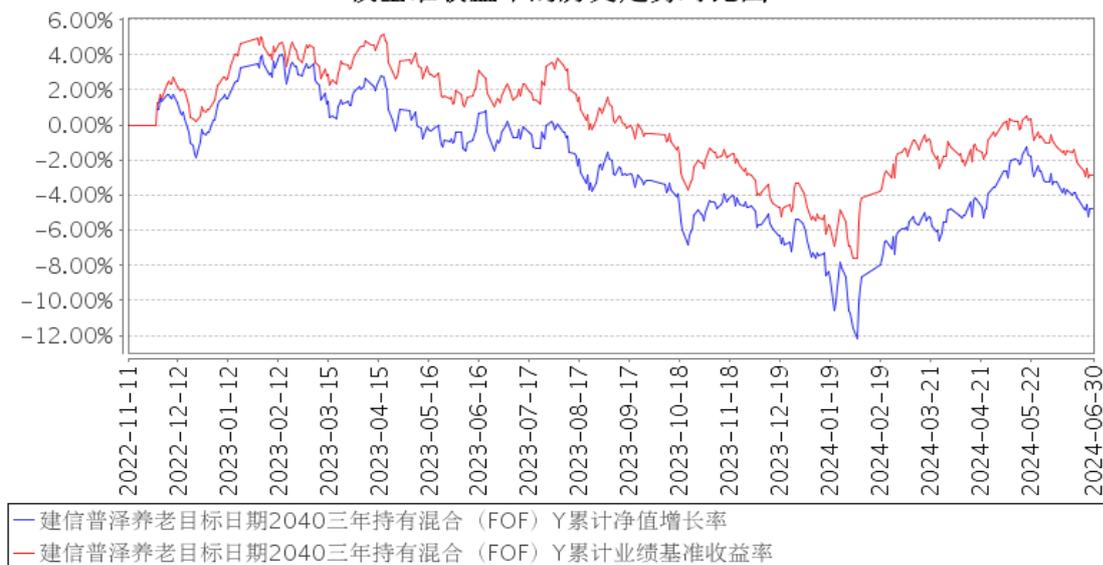
| 阶段             | 净值增长率① | 净值增长率标准<br>差② | 业绩比较基准<br>收益率③ | 业绩比较基准<br>收益率标准差<br>④ | ①-③    | ②-④   |
|----------------|--------|---------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月          | 0.82%  | 0.44%         | -1.08%         | 0.40%                 | 1.90%  | 0.04% |
| 过去六个月          | 0.63%  | 0.58%         | 0.47%          | 0.51%                 | 0.16%  | 0.07% |
| 过去一年           | -4.41% | 0.51%         | -4.39%         | 0.46%                 | -0.02% | 0.05% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | -4.79% | 0.48%         | -2.84%         | 0.44%                 | -1.95% | 0.04% |

### 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。 |

#### 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，本基金管理人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% 的情况有 1 次，原因是投资组合投资策略需要，未导致不公平交易和利益输送。

### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

权益市场方面，2024 年二季度，市场整体呈“倒 V 型”走势，各类指数自 5 月下旬开始出现了不同程度的调整。具体地，代表大盘蓝筹股的沪深 300 指数下跌了 2.14%，代表中盘股的中证 500 指数下跌了 6.5%，代表小盘股的中证 1000 指数下跌了 10%，但香港恒生指数得益于 AH 的估值修复，表现一枝独秀，上涨了 7.12%。4 月高股息大盘蓝筹股延续了一季度的强势，“新国九条”系列政策进一步助推大盘价值和红利股，叠加 5 月中旬四部委联合推出一揽子针对房地产行业的支持政策，沪深 300 和上证指数在市场情绪提振下创出上半年行情新高，地产板块也大幅上涨。但在 5 月下旬随着海外降息预期有所减弱、国内 PMI 数据不及预期、A 股资金面趋于平稳等背景下，行情重回震荡修整。行至 5 月末，受退市政策影响，绩差和涉嫌业绩作假的个股表现疲软，市场整体下跌。6 月小盘股仍然呈现高波动形态，红利股出现补跌迹象，以科创 50 为代表的成长风格受到事件催化的影响上半月表现强势。从整体权益市场的成交活跃度角度看，市场成交量持续萎缩，波动率处于历史较低水平。

债市方面，二季度以来，债券市场收益率短暂下行后快速反弹，随后再次转入震荡下行，强势行情延续至季末。尽管 4 月下旬受基本面支持、政策和供给放量等因素影响，收益率从低位快速反弹，但进入 5 月，在资金面整体偏宽松，基本面数据未明显转向背景下，债市在震荡中估值逐步修复，收益率呈现缓慢下行走势，其中中短端下行幅度更大，曲线陡峭化下移。6 月以来，债市继续走强，受 5 月的经济数据和地方政府债发行速度持续偏缓等因素影响，债市情绪维持偏多，收益进一步率缓慢下行。但在 6 月，转债市场出现了较为明显的波动，尤其是低价转债出现了较为明显的下跌，主要原因是市场对于低价转债的转股前景出现担忧，导致市场的阶段性承压。

回顾报告期内的运作，4 月份，权益资产大小盘风格分化显著，出于年度以大盘类风格占优的判断，在月度上旬调低了小盘类基金的权重，增加大盘平衡类基金以博弈经济基本面的改善。行至月度尾声，考虑到价值类风格演绎得已经较为极致，小幅增加科技成长类标的获取弹性，同时增加固收+基金仓位，以博弈市场上行机会。5 月份，观察到自春节以来的反弹已经超 3 个月，指数上方筹码较为密集，叠加成交逐渐清淡，市场波动率大幅下降，指数波动加大的概率显著增加，有必要进行阶段性规避，因此下旬边际下调了权益资产的仓位。而在结构上，以有色行业为代表的资源类标的前期涨幅较大，出现过热迹象，小幅减持相关标的。固定收益类资产方面，尽管 4、5 月份宏观环境没有明显变化，但债市利率中枢下行至历史较低位置，出于尾部风险防范考虑，债基配置上维持中短久期。6 月份，月初基于对于权益市场可能出现调整的判断，进一步减仓权益资产，增加了短久期债券基金的配置。在结构上仍然维持大盘价值风格类资产为底仓，同时辅以行业 ETF 轮动阶段性地参与了成长科技类题材的博弈。接近 6 月末，考虑到指数的调整已经持续一段时间，下探动能有所趋缓，小幅加仓宽基指数 ETF 以博弈市场的反弹。

展望后市，宏观方面，当前经济内生动能和微观主体活力延续弱势，尽管近期一线城市二手房市场成交有所企稳，但持续性有待观察；后续需要观察价格预期企稳、收入预期改善等积极指标释放，判断居民融资需求的拐点是否出现。

股市方面，整体来看市场仍处于修复期，股票市场流动性温和修复。6 月北向资金转为净流出，叠加融资资金的普遍回落，在市场震荡调整背景下，不排除资金再度入场的可能。从市场情绪角度看，成交和波动水平均处于较低水平，根据经验，上述状态往往以指数向某一个方向大幅突破的形式终结。因此在组合层面应做好波动率放大的准备，做好仓位的应对。风格层面，从资本市场负债端观察，市场仍未出现明显的增量资金，价值风格有望维持。从政策的角度看，“新

国九条”加强企业上市的监管、收紧退市指标、“削减壳资源价值”等政策也将引导大盘价值、红利行情贯穿全年。5月22日以来中证红利指数阶段性回调使其股息率水平已经重回具备比价优势的水平。行业层面，经过过去几年的强劲表现，资源股已经证明了较高的盈利潜力，但其中的节奏会根据市场的供需情况有所起伏，6月以有色为代表的资源类标的出现调整也与此有关，但在全球合作模式重构的背景下，我们仍然看好资源类标的的机会。此外，引领新质生产力发展的科技制造板块随着“科创板八条”、“创投17条”等政策支撑，也有望进一步受益，但考虑到目前仍未看到市场有持续的增量资金，上述机会的持续性存疑，目前仍然以主题投资的思路进行参与。债市方面，债券负债端规模的持续攀升与资产端供给之间或存在错配，使得配置力量支撑债市，叠加基本面弱复苏+资产荒背景下，利率中枢下行行情或将延续。但当前债券较低的收益率绝对位置、长债受监管制约做多行情，后续利率波动性或将加大，对于长债的资产形成扰动。

操作上，权益资产方面，计划继续维持大盘价值为底仓、阶段参与主题投资的配置思路。在相关标的的回调后，红利板块吸引力有所提升，适合逢低布局。以有色为代表的资源类标的会以更为积极的交易思维参与，力求降低其高波动对于组合的影响。此外适时捕捉前期超跌反弹机会和积极参与科技的博弈机会，精选优质成长类基金持有。固收资产方面，考虑到债市短期或有承压，超长端波动较大，整体上将以短久期策略为主。

本产品定位于养老场景下的财富管理，从长期的角度看，权益资产仍然是应对通胀的最优选择，管理人也在持续的优化投资方法论以提升持有体验、应对市场的变化。自2023年以来，产品的策略也在基金优选的基础上拓展到中观风格、行业和固定收益资产久期择时等维度上，以适应近期市场指数强、个基分化的特点。从未来运作的角度上，产品管理人将更加关注市场风格的变化，辅以战术资产配置调整的策略，力求为投资者实现长期财富管理的目标。

#### 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 0.69%，波动率 0.44%，业绩比较基准收益率-1.08%，波动率 0.40%。本报告期本基金 Y 净值增长率 0.82%，波动率 0.44%，业绩比较基准收益率-1.08%，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              | 222,036,551.84 | 93.26         |
| 3  | 固定收益投资            | 11,940,681.70  | 5.02          |
|    | 其中：债券             | 11,940,681.70  | 5.02          |
|    | 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      | 3,400,345.04   | 1.43          |
| 8  | 其他资产              | 704,234.90     | 0.30          |
| 9  | 合计                | 238,081,813.48 | 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       | 11,940,681.70 | 5.05          |
| 2  | 央行票据       | -             | -             |
| 3  | 金融债券       | -             | -             |
|    | 其中：政策性金融债  | -             | -             |
| 4  | 企业债券       | -             | -             |
| 5  | 企业短期融资券    | -             | -             |
| 6  | 中期票据       | -             | -             |
| 7  | 可转债 (可交换债) | -             | -             |
| 8  | 同业存单       | -             | -             |
| 9  | 其他         | -             | -             |

|    |    |               |      |
|----|----|---------------|------|
| 10 | 合计 | 11,940,681.70 | 5.05 |
|----|----|---------------|------|

### 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  | 019740 | 24 国债 09 | 119,000 | 11,940,681.70 | 5.05          |

### 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   | 15,649.23  |
| 2  | 应收证券清算款 | 644,245.39 |
| 3  | 应收股利    | 849.95     |
| 4  | 应收利息    | -          |
| 5  | 应收申购款   | 43,358.88  |
| 6  | 其他应收款   | 131.45     |
| 7  | 其他      | -          |
| 8  | 合计      | 704,234.90 |

### 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  | 531028 | 建信短债债券 A   | 契约型开放式 | 10,614,082.30 | 11,986,483.14 | 5.07          | 是                      |
| 2  | 001316 | 安信稳健增值混合 A | 契约型开放式 | 4,544,770.47  | 7,526,139.90  | 3.18          | 否                      |
| 3  | 100018 | 富国天利增长债券 A | 契约型开放式 | 5,100,600.42  | 6,844,495.70  | 2.90          | 否                      |
| 4  | 011066 | 大成高新技术产业   | 契约型开放式 | 1,400,623.26  | 5,676,445.95  | 2.40          | 否                      |

|    |        | 股票 C           |        |              |              |      |   |
|----|--------|----------------|--------|--------------|--------------|------|---|
| 5  | 000931 | 国寿安保尊益信用纯债债券   | 契约型开放式 | 4,102,015.01 | 5,209,148.86 | 2.20 | 否 |
| 6  | 110007 | 易方达稳健收益债券 A    | 契约型开放式 | 3,858,253.92 | 5,163,887.05 | 2.18 | 否 |
| 7  | 008269 | 大成睿享混合 A       | 契约型开放式 | 3,736,822.76 | 5,005,474.09 | 2.12 | 否 |
| 8  | 213917 | 宝盈增强收益债券 C     | 契约型开放式 | 3,871,963.22 | 4,946,820.21 | 2.09 | 否 |
| 9  | 016090 | 中泰玉衡价值优选混合 C   | 契约型开放式 | 2,229,620.52 | 4,892,233.34 | 2.07 | 否 |
| 10 | 000880 | 富国研究精选灵活配置混合 A | 契约型开放式 | 1,776,650.82 | 4,475,383.42 | 1.89 | 否 |

#### 6.1.1 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公开募集基础设施证券投资基金投资明细

无。

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

无。

#### 6.2 当期交易及持有基金产生的费用

| 项目                   | 本期费用 2024 年 4 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | 其中：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 |
|----------------------|--------------------------------------|---------------------------------|
| 当期交易基金产生的申购费(元)      | 2,097.67                             | -                               |
| 当期交易基金产生的赎回费(元)      | 1,156.51                             | -                               |
| 当期持有基金产生的应支付销售服务费(元) | 85,977.71                            | 677.59                          |
| 当期持有基金产生的应支付管理费(元)   | 485,131.91                           | 14,204.36                       |
| 当期持有基金产生的应支付托管费(元)   | 94,583.09                            | 4,128.26                        |
| 当期交易基金产生的转换费(元)      | 21,922.19                            | 7,722.62                        |
| 当期交易基金产生的交易费(元)      | 2,911.61                             | -                               |

注：上述当期持有基金产生的应支付销售服务费、当期持有基金产生的应支付管理费、当期持有基金产生的应支付托管费，是根据被投资基金的实际持仓情况和被投资基金的基金合同约定费率估算得出。该三项费用根据被投资基金的基金合同约定已经作为费用计入被投资基金的基金份额

净值，已在本基金持有基金的净值中体现，不构成本基金的费用。

根据相关法律法规及本基金合同的约定，本基金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管理费，本基金的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（ETF 除外）的，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、基金招募说明书规定应当收取并计入基金资产的赎回费用除外）、销售服务等销售费用。相关申购费、赎回费由基金管理人直接减免，相关销售服务费由基金管理人从被投资基金收取后返还至本基金基金资产。

### 6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

## § 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               | 247,426,706.53                       | 34,287,570.46                        |
| 报告期期间基金总申购份额              | 45,620.40                            | 1,331,197.44                         |
| 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               | 247,472,326.93                       | 35,618,767.90                        |

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     | 3.53          |

|               |  |
|---------------|--|
| 额占基金总份额比例 (%) |  |
|---------------|--|

## 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 | 3.53            | 10,007,100.00 | 3.53            | 3 年        |
| 基金管理人高级管理人员 | -             | -               | -             | -               | -          |
| 基金经理等人员     | 9,597.93      | -               | -             | -               | 3 年        |
| 基金管理人股东     | -             | -               | -             | -               | -          |
| 其他          | -             | -               | -             | -               | -          |
| 合计          | 10,016,697.93 | 3.53            | 10,007,100.00 | 3.53            | 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

2024 年 7 月 18 日