

景顺长城颐心养老目标日期 2040 三年持有
期混合型发起式基金中基金（FOF）
2023 年第 4 季度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 1 月 22 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 1 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 10 月 01 日起至 2023 年 12 月 31 日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 景顺长城颐心养老目标日期 2040 三年持有期混合 FOF |
| 基金主代码 | 012518 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2021 年 6 月 28 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 112,745,347.86 份 |
| 投资目标 | 本基金的目标日期为 2040 年 12 月 31 日，本基金采用成熟的资产配置策略，随着目标日期的接近，逐步降低投资组合的风险，进而调整基金资产投资于多种具有不同风险收益特征的基金和其他资产的比例，从而追求基金资产的长期稳健增值。 |
| 投资策略 | <p>1、大类资产配置策略</p> <p>本基金的大类资产配置采用战略资产配置和战术资产配置相结合的方式。以 2040 年作为目标日期，随着投资者生命周期的延续和目标日期期限的临近，本基金的风险逐步下降。本基金根据投资者的风险厌恶的变化及资本市场成熟度的演化构建了风险下滑曲线。</p> <p>2、基金投资策略</p> <p>基金管理人依托专业的研究能力，综合采用定量分析及定性研究相结合的方法，首先初步筛选满足养老目标基金的子基金；再根据七大指标对子基金进行定量及定性的分析，从而综合评价及打分并纳入基金库；最后精选出各类别基金中适合做各类资产配置标的的基金。</p> <p>3、子基金投资组合风险控制策略</p> <p>基金管理人每日跟踪子基金投资组合，每月对子基金投资组合表现进行回顾分析，并定期对子基金投资组合中单只子基金根据公开披露的信息进行持仓分析，并估算子基金投资组合中整体的个股和行业持仓情况。</p> |

| | |
|--------|--|
| | <p>4、债券投资策略</p> <p>出于对流动性、跟踪误差、有效利用基金资产的考量，本基金适时对债券进行投资。通过研究国内外宏观经济、货币和财政政策、市场结构变化、资金流动情况，采取自上而下的策略判断未来利率变化和收益率曲线变动的趋势及幅度，确定组合久期。进而根据各类资产的预期收益率，确定债券资产配置。</p> <p>5、股票及港股通标的股票投资策略</p> <p>本基金在进行国内依法发行上市的股票及港股通标的股票投资时，主要采用三大类量化模型分别用以评估资产定价、控制风险和优化交易。基于模型结果，基金管理人结合市场环境和股票特性，精选个股产出投资组合。</p> <p>6、存托凭证投资策略</p> <p>本基金投资存托凭证的策略依照上述境内上市交易的股票投资策略执行。</p> <p>7、资产支持证券的投资策略</p> <p>本基金将通过研究宏观经济、提前偿还率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化，并通过研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响。</p> |
| 业绩比较基准 | 中证 800 指数收益率 \times X + 中证全债指数收益率 (1-X)。 |
| 风险收益特征 | 本基金是一只养老目标日期基金。以 2040 年 12 月 31 日为目标日期，本基金的风险与收益水平会随着投资者目标日期期限的临近而逐步降低。在前期，本基金设定的长期目标波动率适中，进而权益类资产配置比例适中。随后，本基金逐步降低长期目标波动率并调整各类资产配置比例，相应预期风险及收益水平将逐步降低。本基金的预期风险收益水平低于股票型基金、股票型基金中基金，但高于货币市场基金、货币型基金中基金、债券型基金、债券型基金中基金。本基金可投资港股通标的股票，本基金还面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。 |
| 基金管理人 | 景顺长城基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 招商银行股份有限公司 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2023 年 10 月 1 日-2023 年 12 月 31 日） |
|-----------------|---------------------------------------|
| 1. 本期已实现收益 | -738, 203. 10 |
| 2. 本期利润 | -2, 559, 515. 01 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0. 0232 |
| 4. 期末基金资产净值 | 91, 795, 658. 84 |
| 5. 期末基金份额净值 | 0. 8141 |

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、上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。

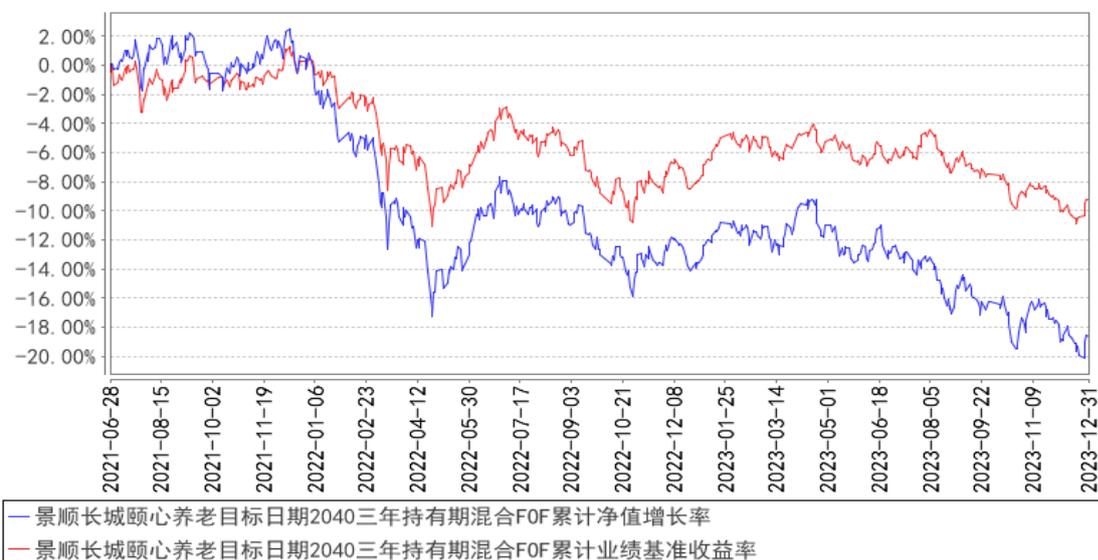
3.2 基金净值表现

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

| 阶段 | 净值增长率 ① | 净值增长率 标准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较基 准收益率标 准差④ | ①—③ | ②—④ |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月 | -2.81% | 0.60% | -1.88% | 0.33% | -0.93% | 0.27% |
| 过去六个月 | -6.97% | 0.57% | -3.19% | 0.35% | -3.78% | 0.22% |
| 过去一年 | -5.87% | 0.54% | -1.43% | 0.34% | -4.44% | 0.20% |
| 自基金合同 生效起至今 | -18.59% | 0.63% | -9.23% | 0.48% | -9.36% | 0.15% |

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

景顺长城颐心养老目标日期2040三年持有期混合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：基金的投资组合比例为：投资经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金的比例不低于本基金资产的 80%；本基金投资于股票、股票型基金、混合型基金和商品基金（含商品期货基金和黄金 ETF）等品种的比例合计原则上不超过 60%；其中商品基金投资占基金资产比例不超过 10%；投资单只基金的比例不高于本基金资产净值的 20%。本基金保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本

基金不得持有具有复杂、衍生品性质的基金份额，包括中国证监会认定的其他基金份额。本基金投资于港股通标的股票不超过股票资产的 50%。本基金的建仓期为自 2021 年 6 月 28 日基金合同生效日起 6 个月。建仓期结束时，本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。

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 | | |
| 薛显志 | 本基金的基金经理 | 2021 年 6 月 28 日 | - | 12 年 | 经济学硕士，CFA，FRM。2011 年 7 月加入本公司，历任总经理办公室风险管理助理、风险管理专员、量化及 ETF 投资部量化及 ETF 专员，自 2015 年 2 月起先后担任量化及 ETF 投资部基金经理、专户投资部投资经理，现任养老及资产配置部基金经理。具有 12 年证券、基金行业从业经验。 |
| 王勇 | 本基金的基金经理 | 2023 年 9 月 6 日 | - | 18 年 | 经济学博士。曾任长江证券资产管理事业部投资经理，嘉吉投资投资部项目经理，新华资产基金投资部总经理。2022 年 9 月加入本公司，担任公司总经理助理、首席资产配置官、养老及资产配置部总经理，自 2023 年 9 月起担任养老及资产配置部基金经理，现任公司总经理助理、首席资产配置官、养老及资产配置部总经理、基金经理。具有 18 年证券、基金行业从业经验。 |

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写，“离任日期”为根据公司决定的解聘日期（公告前一日）；对此后的非首任基金经理，“任职日期”指根据公司决定聘任后的公告日期，“离任日期”指根据公司决定的解聘日期（公告前一日）；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资

资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》和《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《景顺长城颐心养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本管理人管理的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% 的交易共有 9 次，为投资组合的投资策略需要而发生的同日反向交易，按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2023 年四季度，国内政策继续发力，中央金融工作会议和中央经济工作会议等会议相继召开，释放了重要的政策信号，稳增长政策陆续出台，如一线城市房地产政策持续优化有望促进房地产市场需求回升，万亿国债项目清单陆续下达有望形成实物工作量，年底再次下调存款利率也为后期降息打开空间。国内经济数据持续回暖，新近数据显示社零同比增速加快，制造业投资同比增速稳中有升，制造业高端化、智能化、绿色化特点突出，出口同比增速转正，核心 CPI 亦保持稳定。然而市场忽略了经济基本面、资金面、政策面和情绪面的改善而过于悲观，四季度上证指数下跌 4.36%，沪深 300 指数下跌 7.00%，创业板指下跌 5.62%。

展望后市，政策将陆续出台和持续发力，政策底部已现，经济亦在复苏的通道中，预期货币及财政政策仍将继续维持宽松以助力稳增长，美联储也有望开启降息，且 A 股市场估值极具吸引力，所以我们坚定看好国内权益市场的表现。在市场短期相对缺乏增量资金且流动性相对宽松的环境下，有业绩支撑的成长风格预计仍将占优，中期受益于经济复苏和增量资金流入的核心资产和顺周期板块也值得关注。结构上来我们长期看好科技、制造等成长板块，红利、贵金属、顺周

期和稳增长链等也有一定的投资价值。

本基金将在紧密跟踪下滑曲线的基础上根据市场环境动态调整资产及子基金的配置，以期获得长期资本增值。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2023 年 4 季度，本基金份额净值增长率为-2.81%，业绩比较基准收益率为-1.88%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金为发起式基金，在本报告期内未触及《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条规定的条件。

§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 | 12,267,890.00 | 13.33 |
| | 其中：股票 | 12,267,890.00 | 13.33 |
| 2 | 基金投资 | 73,166,006.48 | 79.52 |
| 3 | 固定收益投资 | 4,158,208.77 | 4.52 |
| | 其中：债券 | 4,158,208.77 | 4.52 |
| | 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 | 979,066.86 | 1.06 |
| 8 | 其他资产 | 1,438,164.16 | 1.56 |
| 9 | 合计 | 92,009,336.27 | 100.00 |

注：报告期末，本基金因客户申购，导致持仓经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金被动低于本基金资产的 80%，已在基金合同规定的期限内调整达标。

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

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|----------|--------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 622,440.00 | 0.68 |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 6,909,230.00 | 7.53 |

| | | | |
|---|------------------|---------------|-------|
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 987,360.00 | 1.08 |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | 749,760.00 | 0.82 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 2,285,100.00 | 2.49 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 714,000.00 | 0.78 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 12,267,890.00 | 13.36 |

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

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1 | 601138 | 工业富联 | 68,000 | 1,028,160.00 | 1.12 |
| 2 | 000065 | 北方国际 | 88,000 | 987,360.00 | 1.08 |
| 3 | 601717 | 郑煤机 | 78,000 | 986,700.00 | 1.07 |
| 4 | 000933 | 神火股份 | 58,000 | 974,400.00 | 1.06 |
| 5 | 688111 | 金山办公 | 3,000 | 948,600.00 | 1.03 |
| 6 | 002230 | 科大讯飞 | 18,000 | 834,840.00 | 0.91 |
| 7 | 688776 | 国光电气 | 8,000 | 779,120.00 | 0.85 |
| 8 | 600183 | 生益科技 | 42,000 | 769,020.00 | 0.84 |
| 9 | 600258 | 首旅酒店 | 48,000 | 749,760.00 | 0.82 |
| 10 | 002707 | 众信旅游 | 100,000 | 714,000.00 | 0.78 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------|--------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 4,158,208.77 | 4.53 |
| 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 | 4,158,208.77 | 4.53 |

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 | 019703 | 23 国债 10 | 41,000 | 4,158,208.77 | 4.53 |

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括股指期货。

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

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

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

本报告期内未出现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或者在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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

本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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 13,680.19 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | 17,830.00 |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 1,399,911.40 |
| 6 | 其他应收款 | 6,742.57 |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 1,438,164.16 |

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§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 | 004719 | 景顺长城睿成混合 C | 契约型开放式 | 4,406,519.99 | 5,949,242.64 | 6.48 | 是 |
| 2 | 000386 | 景顺长城景颐双利债券 C | 契约型开放式 | 3,848,766.73 | 5,857,822.96 | 6.38 | 是 |
| 3 | 008810 | 安信民稳增长混合 C | 契约型开放式 | 3,975,248.91 | 5,029,882.45 | 5.48 | 否 |
| 4 | 004011 | 华泰柏瑞鼎利混合 C | 契约型开放式 | 3,047,431.87 | 4,650,381.03 | 5.07 | 否 |
| 5 | 007604 | 景顺长城中短债债券 C | 契约型开放式 | 3,985,684.20 | 4,400,195.36 | 4.79 | 是 |
| 6 | 002797 | 景顺长城景盈双利债券 C | 契约型开放式 | 3,726,039.97 | 4,389,647.69 | 4.78 | 是 |
| 7 | 513330 | 华夏恒生互联网科技业 ETF(QDII) | 交易型开放式 (ETF) | 12,000,000.00 | 4,176,000.00 | 4.55 | 否 |
| 8 | 588000 | 华夏上证科创板 50 成份 ETF | 交易型开放式 (ETF) | 4,600,000.00 | 4,126,200.00 | 4.49 | 否 |
| 9 | 512010 | 易方达沪深 300 医药 ETF | 交易型开放式 (ETF) | 10,000,000.00 | 4,110,000.00 | 4.48 | 否 |
| 10 | 512480 | 国联安中证全指半导体 ETF | 交易型开放式 (ETF) | 5,000,000.00 | 4,020,000.00 | 4.38 | 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

本基金本报告期末未持有公开募集基础设施证券投资基金。

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

本基金本报告期末未持有公开募集基础设施证券投资基金。

6.2 当期交易及持有基金产生的费用

| 项目 | 本期费用 2023 年 10 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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) | 531.17 | - |
| 当期交易基金产生的赎回费(元) | 542.20 | - |
| 当期持有基金产生的应支付销售服务费(元) | 31,146.22 | 17,364.69 |
| 当期持有基金产生的应支付管理费(元) | 110,756.15 | 40,149.43 |
| 当期持有基金产生的应支付托管费(元) | 22,672.48 | 8,063.17 |

注：1、上述交易基金产生的申购费包含场外基金申购/转入费用及场内基金买入交易费用，交易基金产生的赎回费包含场外基金赎回/转出费用及场内基金卖出交易费用；

2、上述费用为根据所投资基金的招募说明书列明的计算方法对销售服务费、管理费和托管费进行的估算；销售服务费、管理费和托管费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；

3、本基金申购、赎回本基金的基金管理人管理的其他基金(ETF 除外)，应当通过基金管理人的直销渠道且不得收取申购费、赎回费(按规定应当收取并记入被投资基金其他收入部分的赎回费除外)、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，故当期交易基金产生的申购费为零，当期交易基金产生的赎回费仅为按规定应当收取并记入被投资基金其他收入部分的赎回费。相关销售服务费已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，由基金管理人从被投资基金收取后向本基金返还，当期持有基金产生的应支付销售服务费为管理人当期应向本基金返还的销售服务费，相关披露金额根据本基金对被投资基金的实际持仓、被投资基金的基金合同约定的费率和方法估算。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已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，相关披露金额根据本基金对被投资基金的实际持仓、被投资基金的基金合同约定的费率和方法估算。

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

| | |
|---------------------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 109,595,460.99 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 3,149,886.87 |
| 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 | 112,745,347.86 |

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

§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 | 10,001,389.03 |
| 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 | 10,001,389.03 |

| | |
|---------------------------|------|
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%) | 8.87 |
|---------------------------|------|

8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人本期末未运用固有资金投资本基金。

§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 | 10,001,389.03 | 8.87 | 10,000,000.00 | 42.69 | 3年 |
| 基金管理人高级管理人员 | - | - | - | - | 不适用 |
| 基金经理等人员 | 36,973.03 | 0.03 | - | - | 不适用 |
| 基金管理人股东 | - | - | - | - | 不适用 |
| 其他 | - | - | - | - | 不适用 |
| 合计 | 10,038,362.06 | 8.90 | 10,000,000.00 | 42.69 | - |

注：份额总数为不包含利息的认购份额。

§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、中国证监会准予景顺长城颐心养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）募集注册的文件；
- 2、《景顺长城颐心养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同》；
- 3、《景顺长城颐心养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）招募说明书》；
- 4、《景顺长城颐心养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）托管协议》；
- 5、景顺长城基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程；
- 6、其他在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、定期报告及临时公告。

11.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

11.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司

2024 年 1 月 22 日