

安信禧悦稳健养老目标一年持有期混合型
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：安信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国农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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 7 月 17 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 | 安信禧悦稳健养老一年持有混合（FOF） |
| 基金主代码 | 009460 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2020 年 6 月 9 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 46,581,592.76 份 |
| 投资目标 | 本基金为目标风险基金，在明确大类资产仓位约束以实现总体风险控制的基础上，通过合理的战术资产配置、基金优选等，力求基金资产实现相对长期的低波动稳健增值，满足投资者的养老需求。 |
| 投资策略 | 本基金定位为风险策略基金，通过明确的权益资产仓位限制，控制基金组合的总体风险，并通过实时动态的风险度量与风险预算机制进行基金的战术资产配置。基金投资方面，本基金采用定量分析和定性分析相结合的方式，定量分析通过基金历史净值数据和持仓数据等，进行量化指标的筛选；定性分析通过对基金经理的调研，基金公司的风控、投研文化等研究分析进行二次优选，构造基金标的组合。本基金的股票投资策略作为权益型基金投资的补充，将在小比例的仓位控制范围内进行。本基金的债券投资策略作为债券型基金投资的补充，为积极增厚债券资产投资收益率为目标。此外，本基金还将在合理时机进行多资产的组合优化投资，并适当投资于资产支持证券。 |
| 业绩比较基准 | 中证 800 指数收益率×20%+恒生指数（人民币计价）收益率×5%+中债综合（全价）指数收益率×70%+银行活期存款利率（税后）×5% |

| | | |
|-----------------|--|----------------------|
| 风险收益特征 | <p>本基金为混合型基金中基金，是目标风险系列基金中风险收益特征相对稳健的基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金、货币市场基金、债券型基金中基金和货币型基金中基金，低于股票型基金和股票型基金中基金。</p> <p>本基金通过港股通投资于香港证券市场，会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。</p> <p>根据《证券期货投资者适当性管理办法》及其配套规则，基金管理人及本基金其他销售机构将定期或不定期对本基金产品风险等级进行重新评定，因而本基金的产品风险等级具体结果应以各销售机构提供的最新评级结果为准。</p> | |
| 基金管理人 | 安信基金管理有限责任公司 | |
| 基金托管人 | 中国农业银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 安信禧悦稳健养老一年持有混合（FOF）A | 安信禧悦稳健养老一年持有混合（FOF）Y |
| 下属分级基金的交易代码 | 009460 | 018361 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 46,376,239.12 份 | 205,353.64 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） | |
|-----------------|-------------------------------------|----------------------|
| | 安信禧悦稳健养老一年持有混合（FOF）A | 安信禧悦稳健养老一年持有混合（FOF）Y |
| 1. 本期已实现收益 | 40,864.14 | 273.32 |
| 2. 本期利润 | -237,987.19 | -1,798.63 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0051 | -0.0099 |
| 4. 期末基金资产净值 | 49,887,759.10 | 221,984.02 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.0757 | 1.0810 |

注：1、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。

2、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。

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

安信禧悦稳健养老一年持有混合（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④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | -0.51% | 0.30% | 0.51% | 0.19% | -1.02% | 0.11% |
| 过去六个月 | -1.00% | 0.41% | 1.73% | 0.24% | -2.73% | 0.17% |
| 过去一年 | -2.99% | 0.33% | -0.38% | 0.23% | -2.61% | 0.10% |
| 过去三年 | 0.22% | 0.37% | -4.20% | 0.26% | 4.42% | 0.11% |
| 自基金合同生效起至今 | 7.57% | 0.39% | 1.18% | 0.27% | 6.39% | 0.12% |

安信禧悦稳健养老一年持有混合（FOF）Y

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | -0.41% | 0.30% | 0.51% | 0.19% | -0.92% | 0.11% |
| 过去六个月 | -0.82% | 0.41% | 1.73% | 0.24% | -2.55% | 0.17% |
| 过去一年 | -2.63% | 0.33% | -0.38% | 0.23% | -2.25% | 0.10% |
| 自基金合同生效起至今 | -2.67% | 0.32% | -0.98% | 0.22% | -1.69% | 0.10% |

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

安信禧悦稳健养老一年持有混合（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



安信禧悦稳健养老一年持有混合（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：1、本基金基金合同生效日为2020年6月9日。

2、本基金合同规定，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。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

3、根据基金管理人2023年5月9日《关于安信禧悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）修改基金合同等法律文件的公告》，自2023年5月9日起，本基金增加Y类份额。

§ 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 | 说明 |
|----|----|-------------|------|----|
|----|----|-------------|------|----|

| | | 任职日期 | 离任日期 | 年限 | |
|-----|---------------------|----------------|------|------|--|
| 占冠良 | 本基金的基金经理，FOF 投资部总经理 | 2020 年 6 月 9 日 | - | 22 年 | 占冠良先生，管理学硕士。历任招商证券股份有限公司研究部研究员，大成基金管理有限公司研究部研究员、投资部基金经理，南方基金管理有限公司专户投资管理部投资经理，安信基金管理有限责任公司研究部总经理、基金经理。现任安信基金管理有限责任公司 FOF 投资部总经理。现任安信禧悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、安信平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）的基金经理。 |

注：1、此处的“任职日期”、“离任日期”根据公司决定的公告（生效）日期填写。

2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

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

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

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》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规、监管部门的相关规定及基金合同的约定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

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》和公司制定的公平交易相关制度，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

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行为。本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易不存在成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

二季度，经济总体运行依旧偏弱。结构上，偏外需的出口数据好于预期，偏内需的消费、投资等数据普遍略低于预期，而上游周期又相对好于中下游的制造消费。尤其，在清理整改手工补息影响下，金融数据出现超出预期的大幅下滑。政策方面，财政、货币等宽松支持政策力度相对有限。值得重视的是，5月17日中央出台一系列包含首套房首付比、贷款利率下限、房产收储资金支持等政策，反映了对地产行业平稳健康发展的积极支持态度。

A股市场在二季度的表现，从宽基指数上看，呈现震荡下跌，指数波幅并不大，但在5月17日地产政策出台前后有较明显的变化，之前市场走势偏强，小幅波动并未出现明显调整，但在政策出台前后，在地产及地产链带动下市场有较强的上涨。在政策热度之后，市场开始进入“冷静期”，基于短期难见数据立即好转而市场上涨难以为继的判断，投资者普遍选择兑现止盈操作，市场走势持续阴跌。整个二季度，偏价值的防守类资产，包括电力、银行、能源等，以及极少部分的成长类资产（电子、通信等）表现相对优秀，有微幅上涨，其余基本表现为下跌，尤其偏终端消费的传媒、商贸、社服、轻工、食饮等，跌幅居前。地产板块在二季度跌宕起伏，指数在二季度仍然出现较大跌幅。

禧悦养老 FOF 在二季度的表现不如人意。全季度，基于经济平淡但修复的预期，我们认为市场短期风险较小，得益于优选基金的良好表现以及略微积极的投资于部分含权的转债及纯债基金，在5月17日之前组合净值表现较好；在5月17日地产政策之后，我们基于政策重大转向对经济支持的判断，在股市判断上偏向乐观，权益资产比例有所上升，承受了6月份市场连续下跌带来的损失，净值出现明显回调。后续，我们将在跟踪把握经济基本面状况的基础上，进一步提高组合与市场节奏的匹配适应性，以期实现更稳健良好的净值表现。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末安信禧悦稳健养老一年持有混合（FOF）A 基金份额净值为 1.0757 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.51%；安信禧悦稳健养老一年持有混合（FOF）Y 基金份额净值为 1.0810 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.41%；同期业绩比较基准收益率为 0.51%。

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 | 1,277,104.11 | 2.54 |

| | | | |
|---|-------------------|---------------|--------|
| | 其中：股票 | 1,277,104.11 | 2.54 |
| 2 | 基金投资 | 43,509,984.02 | 86.55 |
| 3 | 固定收益投资 | 4,723,917.39 | 9.40 |
| | 其中：债券 | 4,723,917.39 | 9.40 |
| | 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 | 463,449.58 | 0.92 |
| 8 | 其他资产 | 297,706.49 | 0.59 |
| 9 | 合计 | 50,272,161.59 | 100.00 |

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股市值为 94,225.08 元，占净值比例 0.19%。

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 | - | - |
| B | 采矿业 | 63,570.00 | 0.13 |
| C | 制造业 | 714,271.60 | 1.43 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| 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 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 322,467.43 | 0.64 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | 82,570.00 | 0.16 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| 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 | 1,182,879.03 | 2.36 |

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别 | 公允价值（人民币） | 占基金资产净值比例（%） |
|----------|-----------|--------------|
| 能源 | - | - |
| 原材料 | - | - |
| 工业 | - | - |
| 非日常生活消费品 | 49,394.24 | 0.10 |
| 日常消费品 | - | - |
| 医疗保健 | - | - |
| 金融 | - | - |
| 信息技术 | - | - |
| 通讯业务 | - | - |
| 公用事业 | - | - |
| 房地产 | 44,830.84 | 0.09 |
| 合计 | 94,225.08 | 0.19 |

注：以上分类采用财汇提供的国际通用行业分类标准。

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 | 002929 | 润建股份 | 10,913 | 317,677.43 | 0.63 |
| 2 | 688169 | 石头科技 | 400 | 157,040.00 | 0.31 |
| 3 | 002296 | 辉煌科技 | 12,200 | 125,782.00 | 0.25 |
| 4 | 603801 | 志邦家居 | 6,300 | 82,404.00 | 0.16 |
| 5 | 002947 | 恒铭达 | 2,200 | 77,440.00 | 0.15 |
| 6 | 002244 | 滨江集团 | 9,500 | 68,970.00 | 0.14 |
| 7 | 301525 | 儒竞科技 | 1,200 | 67,536.00 | 0.13 |
| 8 | 603486 | 科沃斯 | 1,300 | 61,334.00 | 0.12 |
| 9 | 601689 | 拓普集团 | 1,000 | 53,610.00 | 0.11 |
| 10 | 601899 | 紫金矿业 | 3,000 | 52,710.00 | 0.11 |

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 | 2,640,040.36 | 5.27 |
| 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） | 2,083,877.03 | 4.16 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 4,723,917.39 | 9.43 |

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 | 019709 | 23 国债 16 | 16,000 | 1,624,984.11 | 3.24 |
| 2 | 102220 | 国债 2220 | 6,000 | 610,113.86 | 1.22 |
| 3 | 113055 | 成银转债 | 3,160 | 397,983.39 | 0.79 |
| 4 | 113050 | 南银转债 | 2,910 | 364,949.16 | 0.73 |
| 5 | 019698 | 23 国债 05 | 3,000 | 303,676.03 | 0.61 |

**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合约。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金尚未在基金合同中明确股指期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与股指期货交易。

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**

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与国债期货交易。

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合约。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与

与国债期货交易。

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

报告期内本基金投资的前十名证券除南银转债（代码：113050 SH）、润建股份（代码：002929 SZ）、平煤转债（代码：113066 SH）外其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

1. 南京银行股份有限公司

2023年8月25日，南京银行股份有限公司因未依法履行职责被国家外汇管理局江苏省分局警告、罚款。

2. 润建股份有限公司

2023年8月19日，润建股份有限公司因未依法履行职责被国家税务总局广州市南沙区税务局南沙税务所责令改正。

2023年8月24日，润建股份有限公司因未按期申报税款被国家税务总局天津市蓟州区税务局文昌街税务所责令改正。

2023年10月-2024年6月，润建股份有限公司因未按期申报税款、违反税收管理规定、未按期申报税款被国家税务总局上海市浦东新区税务局第十一税务所、国家税务总局江门市新会区税务局三江税务分局、国家税务总局宁乡经济技术开发区税务局（宁乡市税务局）、国家税务总局祁东县税务局责令改正。

3. 平顶山天安煤业股份有限公司

2024年3月30日，平顶山天安煤业股份有限公司因未依法履行职责被国家矿山安全监察局河南局罚款。

以上证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

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没有超出基金合同规定的备选股票库，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|-------|----------|
| 1 | 存出保证金 | 4,579.61 |

| | | |
|---|---------|------------|
| 2 | 应收证券清算款 | 31,858.44 |
| 3 | 应收股利 | 5,247.51 |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 253,419.64 |
| 6 | 其他应收款 | 2,601.29 |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 297,706.49 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|--------|------------|--------------|
| 1 | 113055 | 成银转债 | 397,983.39 | 0.79 |
| 2 | 113050 | 南银转债 | 364,949.16 | 0.73 |
| 3 | 113648 | 巨星转债 | 298,150.78 | 0.59 |
| 4 | 127050 | 麒麟转债 | 210,880.03 | 0.42 |
| 5 | 113066 | 平煤转债 | 166,593.03 | 0.33 |
| 6 | 123107 | 温氏转债 | 145,128.90 | 0.29 |
| 7 | 123188 | 水羊转债 | 111,202.92 | 0.22 |
| 8 | 113588 | 润达转债 | 87,288.09 | 0.17 |
| 9 | 127045 | 牧原转债 | 71,009.61 | 0.14 |
| 10 | 127043 | 川恒转债 | 61,728.97 | 0.12 |
| 11 | 127037 | 银轮转债 | 56,887.76 | 0.11 |
| 12 | 110083 | 苏租转债 | 44,097.32 | 0.09 |
| 13 | 123150 | 九强转债 | 34,716.54 | 0.07 |
| 14 | 127032 | 苏行转债 | 12,570.30 | 0.03 |
| 15 | 123025 | 精测转债 | 10,904.41 | 0.02 |
| 16 | 110090 | 爱迪转债 | 5,901.90 | 0.01 |
| 17 | 123223 | 九典转 02 | 1,775.60 | 0.00 |
| 18 | 113044 | 大秦转债 | 1,202.65 | 0.00 |
| 19 | 123099 | 普利转债 | 905.67 | 0.00 |

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情况。

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 | 750003 | 安信目标收益债券C | 契约型开放式 | 5,176,844.64 | 6,748,016.99 | 13.47 | 是 |
| 2 | 000914 | 中加纯债债券 | 契约型开放式 | 3,485,639.26 | 3,773,204.50 | 7.53 | 否 |
| 3 | 002881 | 中加丰润纯债债券A | 契约型开放式 | 3,165,084.81 | 3,537,298.78 | 7.06 | 否 |
| 4 | 110018 | 易方达增强回报债券B | 契约型开放式 | 2,296,083.20 | 3,214,516.48 | 6.41 | 否 |
| 5 | 003638 | 安信永鑫增强债券C | 契约型开放式 | 3,006,573.37 | 3,159,006.64 | 6.30 | 是 |
| 6 | 519762 | 交银裕通纯债债券A | 契约型开放式 | 2,190,216.74 | 2,401,134.61 | 4.79 | 否 |
| 7 | 005284 | 华商可转债债券C | 契约型开放式 | 1,529,247.19 | 2,375,226.74 | 4.74 | 否 |
| 8 | 161716 | 招商双债增强(LOF)C | 上市契约型开放式(LOF) | 1,051,445.83 | 1,638,993.76 | 3.27 | 否 |
| 9 | 040023 | 华安可转债债券B | 契约型开放式 | 770,179.93 | 1,292,361.92 | 2.58 | 否 |
| 10 | 000290 | 鹏华全球高收益债(QDII) | 契约型开放式 | 1,984,242.66 | 1,175,465.35 | 2.35 | 否 |

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) | 1,847.36 | - |
| 当期交易基金产生的赎回费(元) | 67.70 | - |
| 当期持有基金产生的应支付销售服务费(元) | 24,303.11 | 7,866.56 |
| 当期持有基金产生的应支付管理费(元) | 77,621.07 | 17,361.43 |
| 当期持有基金产生的应支付托管费(元) | 17,933.18 | 4,741.38 |
| 当期交易基金产生的转换费(元) | 2,450.88 | - |
| 当期交易所交易基金产生的交易费(元) | 330.93 | - |

注：上述销售服务费、管理费、托管费是根据所投资基金的招募说明书列明的计算方法估算得出，已在所投资基金的净值中体现，不构成本基金的费用项目。

6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本报告期内，本基金所投资的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及大会表决意见等重大影响事件。

§ 7 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 安信禧悦稳健养老一年持有混合（FOF）A | 安信禧悦稳健养老一年持有混合（FOF）Y |
|---------------------------|----------------------|----------------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 47,001,175.55 | 162,332.59 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 289,246.08 | 44,105.70 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 914,182.51 | 1,084.65 |
| 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 | 46,376,239.12 | 205,353.64 |

§ 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

| 项目 | 安信禧悦稳健养老一年持有混合（FOF）A | 安信禧悦稳健养老一年持有混合（FOF）Y |
|--------------------------|----------------------|----------------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 5,565,398.89 | - |
| 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 | 5,565,398.89 | - |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 11.95 | - |

8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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 | 报告期内持有基金份额变化情况 | 报告期末持有基金情况 |
|---|----------------|------------|
|---|----------------|------------|

| 资 者 类 别 | 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 | 20240401-20240630 | 22,901,121.59 | - | - | 22,901,121.59 | 49.16 |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| <p>本基金如果出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%，则面临大额赎回的情况，可能导致：</p> <p>（1）基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20% 的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；</p> <p>（2）基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；</p> <p>（3）因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动；</p> <p>（4）基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；</p> <p>（5）大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。</p> | | | | | | | |

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予安信禧悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）募集的文件；
- 2、《安信禧悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》；
- 3、《安信禧悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）托管协议》；
- 4、《安信禧悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）招募说明书》；
- 5、中国证监会要求的其他文件。

10.2 存放地点

本基金管理人和基金托管人的住所。

10.3 查阅方式

上述文件可在安信基金管理有限责任公司互联网站上查阅，或者在营业时间内到安信基金管理有限责任公司查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人安信基金管理有限责任公司。

客户服务电话：4008-088-088

网址：<http://www.essencefund.com>

安信基金管理有限责任公司

2024 年 7 月 18 日