

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 年中期报告

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

送出日期：2024 年 8 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、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的法律责任。本中期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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>1</b>
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>4</b>
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>5</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 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	14
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>15</b>
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	19
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>42</b>
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
7.3 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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46
7.6 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	46
7.7 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	46

7.8	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	46
7.9	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	46
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	46
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	46
7.12	本报告期投资基金情况	47
7.13	投资组合报告附注	52
<b>§ 8</b>	<b>基金份额持有人信息</b>	<b>54</b>
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
8.3	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	55
<b>§ 9</b>	<b>开放式基金份额变动</b>	<b>55</b>
<b>§ 10</b>	<b>重大事件揭示</b>	<b>56</b>
10.1	基金份额持有人大会决议	56
10.2	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	56
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4	基金投资策略的改变	56
10.5	本报告期持有的基金发生的重大影响事件	56
10.6	为基金进行审计的会计师事务所情况	57
10.7	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	57
10.8	基金租用证券公司交易单元的有关情况	57
10.9	其他重大事件	59
<b>§ 11</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息</b>	<b>60</b>
11.1	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	60
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	61
<b>§ 12</b>	<b>备查文件目录</b>	<b>61</b>
12.1	备查文件目录	61
12.2	存放地点	61
12.3	查阅方式	61

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	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	
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	
报告期末基金份 额总额	46,581,592.76 份	
基金合同存续期	不定期	
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

### 2.2 基金产品说明

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“目标风险策略基金”，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	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。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。

	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。
--	---

### 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		安信基金管理有限责任公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孙晓奇	任航
	联系电话	0755-82509999	010-66060069
	电子邮箱	service@essencefund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008-088-088	95599
传真		0755-82799292	010-68121816
注册地址		深圳市福田区福田街道福安社区福华一路 119 号安信金融大厦 29 楼	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		深圳市福田区福田街道福安社区福华一路 119 号安信金融大厦 27-29 楼	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		518026	100031
法定代表人		刘入领	谷澍

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.essencefund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	安信基金管理有限责任公司	深圳市福田区福田街道福安社区福华一路 119 号安信金融大厦 27 楼

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 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	报告期(2024 年 1 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
本期已实现收益	-859,954.39	-2,795.43

本期利润	-605,955.21	-2,191.17
加权平均基金份额本期利润	-0.0135	-0.0130
本期加权平均净值利润率	-1.25%	-1.20%
本期基金份额净值增长率	-1.00%	-0.82%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)	
期末可供分配利润	3,511,519.98	16,630.38
期末可供分配基金份额利润	0.0757	0.0810
期末基金资产净值	49,887,759.10	221,984.02
期末基金份额净值	1.0757	1.0810
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	7.57%	-2.67%

注：1、基金业绩指标不包括持有人认（申）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、对期末可供分配利润，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。

### 3.2 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	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
过去一个月	-1.54%	0.29%	-0.48%	0.13%	-1.06%	0.16%

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	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
过去一个月	-1.50%	0.29%	-0.48%	0.13%	-1.02%	0.16%
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%

注：根据《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》的约定，本基金的业绩比较基准为：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%。中证 800 指数是中证指数有限公司编制的，反映沪深证券市场内大中小市值公司的整体状况的指数，具有良好的市场代表性和市场影响力，适合作为本基金股票型基金和混合型基金等权益类资产投资的业绩比较基准。恒生指数是由恒生指数服务有限公司编制，以香港股票市场中的 50 家上市股票为成份股样本，以其发行量为权数的加权平均股价指数，是反映香港股市价幅趋势最有影响的一种股价指数。中债综合（全价）指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制的具有代表性的债券市场指数。根据本基金的投资范围和投资比例，选用上述业绩比较基准能够客观、合理地反映本基金的风险收益特征。由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合合同要求，基准指数每日按照 20%、5%、70%、5%的比例采取再平衡，再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

### 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

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证券投资基金（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

安信基金管理有限责任公司经中国证监会批准，成立于 2011 年 12 月，总部位于深圳，注册资本 5.0625 亿元人民币，股东及股权结构为：五矿资本控股有限公司持有 39.84% 的股权，国投证券股份有限公司持有 33.95% 的股权，佛山市顺德区新碧贸易有限公司持有 20.28% 的股权，中广核财务有限责任公司持有 5.93% 的股权。

截至 2024 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 92 只开放式基金具体如下：安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金、安信目标收益债券型证券投资基金、安信平稳增长混合型发起式证券投资基金、安信现金管理货币市场基金、安信宝利债券型证券投资基金（LOF）（原安信宝利分级债券型证券投资基金）、安信永利信用定期开放债券型证券投资基金、安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金、安信价值精选股票型证券投资基金、安信现金增利货币市场基金、安信消费医药主题股票型证券投资基金、安信中证一带一路主题指数型证券投资基金（原安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金）、安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金、安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金、安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金、安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金、安信新回报灵活配置混合型证券投资基金、安信新优选灵活配置混合型证券投资基金、安信新目标灵活配置混合型证券投资基金、安信新价值灵活配置混合型证券投资基金、安信新成长灵活配置混合型证券投资基金、安信尊享纯债债券型证券投资基金、安信活期宝货币市场基金、安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金、安信中国制造 2025 沪港深灵活配置混合型证券投资基金、安信企业价值优选混合型证券投资基金（原安信合作创新主题沪港深灵活配置混合型证券投资基金）、安信工业 4.0 主题沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金、安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金、安信尊享添益债券型证券投资基金、安信比较优势灵活配置混合型证券投资基金、安信永盛定期开放债券型发起式证券投资基金、安信永鑫增强债券型证券投资基金（原安信永鑫定期开放债券型证券投资基金）、安信量化优选股票型发起式证券投资基金、安信恒利增强债券型证券投资基金、安信中证 500 指数增强型证券投资基金、安信聚利增强债券型证券投资基金、安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金（原安信新起点灵活配置混合型证券投资基金）、安信鑫日享中短债债券型证券投资基金、安信核心竞争力灵活配置混合型证券投资基金、安信中短利率债债券型证券投资基金（LOF）、安信中证深圳科技创新主题指数型证券投资基金（LOF）、安信民稳增长混合型证券投资基金、安信价值驱动三年持有期混合型发

起式证券投资基金、安信价值回报三年持有期混合型证券投资基金、安信丰泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金、安信价值成长混合型证券投资基金、安信稳健增利混合型证券投资基金、安信价值发现两年定期开放混合型证券投资基金（LOF）、安信禧悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、安信成长动力一年持有期混合型证券投资基金、安信尊享添利利率债债券型证券投资基金、安信永顺一年定期开放债券型发起式证券投资基金、安信平稳双利 3 个月持有期混合型证券投资基金、安信成长精选混合型证券投资基金、安信稳健聚申一年持有期混合型证券投资基金、安信创新先锋混合型发起式证券投资基金、安信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、安信稳健回报 6 个月持有期混合型证券投资基金、安信浩盈 6 个月持有期混合型证券投资基金、安信医药健康主题股票型发起式证券投资基金、安信平稳合盈一年持有期混合型证券投资基金、安信永盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金、安信均衡成长 18 个月持有期混合型证券投资基金、安信招信一年持有期混合型证券投资基金、安信价值启航混合型证券投资基金、安信宏盈 18 个月持有期混合型证券投资基金、安信稳健汇利一年持有期混合型证券投资基金、安信民安回报一年持有期混合型证券投资基金、安信优质企业三年持有期混合型证券投资基金、安信平衡增利混合型证券投资基金、安信永宁一年定期开放债券型发起式证券投资基金、安信丰穗一年持有期混合型证券投资基金、安信楚盈一年持有期混合型证券投资基金、安信远见成长混合型证券投资基金、安信港股通精选混合型发起式证券投资基金、安信恒鑫增强债券型证券投资基金、安信新能源主题股票型发起式证券投资基金、安信华享纯债债券型证券投资基金、安信臻享三个月定期开放债券型证券投资基金、安信洞见成长混合型证券投资基金、安信稳健启航一年持有期混合型证券投资基金、安信睿见优选混合型证券投资基金、安信永泽一年定期开放债券型发起式证券投资基金、安信数字经济股票型证券投资基金、安信稳健增益 6 个月持有期混合型证券投资基金、安信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、安信红利精选混合型证券投资基金、安信 90 天滚动持有债券型证券投资基金、安信长鑫增强债券型证券投资基金、安信青享纯债债券型证券投资基金、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）、安信 30 天滚动持有债券型证券投资基金、安信 60 天滚动持有债券型证券投资基金。

#### 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		
占冠良	本基金的基金经理, FOF 投资部总经	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

	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、基金经理的“任职日期”根据公司决定的公告（生效）日期填写，基金经理助理的“任职日期”根据公司决定的聘任日期填写、“离职日期”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。

#### 4.1.3 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合规守信情况的说明

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》等有关法律法规、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 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，未出现违反公平交易制度的情况，亦未受到监管机构的相关调查。

##### 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 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

上半年，经济和市场环境可以概括为“经济平淡、预期谨慎”。总体上，经济平淡运行，偏内

需的投资、消费等数据较多低于预期，偏外需的出口数据相对维持强劲。CPI 在 0 附近小幅波动运行，PPI 降幅逐月收窄，上游资源行业普遍好于下游消费行业。叠加内需不足及央行整顿银行手工贴息，M1 出现二季度连续三月负增长。5 月 17 日地产多项重磅政策公布，地产二手市场有所活跃，成交环比显著提升，新房市场仍然平淡，地产相关投资、开工等数据也均未见好转。

经济的平淡，映射到股票市场，则表现为投资者的预期谨慎。半年来看，虽然宽基指数上证综指仅为小幅下跌，但其间结构差异巨大。防守性的大盘蓝筹高股息资产，包括银行、电力、能源等，受资金追捧表现突出，取得一定的正收益表现；而更反映经济现状的偏成长偏小盘以及偏消费的计算机、传媒、商贸、社服、地产、医药等板块均出现-20%以上的跌幅，食品饮料、纺织以及偏周期的钢铁、化工、建材等板块也均出现-10%以上的跌幅。整体上，大盘优于小盘，价值优于成长。为数不多的成长主题，包括 AI 主题的光模块、果链的消费电子，在上半年整体表现较好。

上半年禧悦养老 FOF 的业绩表现不理想，主要在于投资管理中出现两次组合的偏离损失。一次是 1 月中下旬开始的小盘股暴跌，一次是 5 月中下旬的市场阴跌。前者有预期面因素，也有量化资金面因素，后者则更多在于短期政策刺激上涨后回归经济基本面时预期谨慎下的资金止盈行为。我们在前者时结构有偏离，而后者时基于地产政策的重大转向而对预期乐观，仓位过于积极，导致承受了一定的损失。

在国内市场之外，我们对海外资产，包括权益和债券，有一定的投资关注，并有一定比例的投资。从结果上看，对组合起到一定的大类资产风险收益优化的效果。

#### 4.4.2 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-1.00%；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-0.82%；同期业绩比较基准收益率为 1.73%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从方向上，我们依然认为，5 月 17 日是个重要的转折点，意味着中央对地产的态度，从防风险转变为从稳经济角度出发全局性而非区域性的稳地产目标。虽然中国经济在长期上依然存在诸如人口老龄化、全要素生产率等问题，但在中期，这一转变将支持中国经济企稳运行。至少，经济将相较于出政策之前的预期，应该有所好转。如果经济继续超预期地走弱下滑，从政策精神的延续上，有理由相信中央将继续出台全区性的稳地产政策，以支持经济。这是我们转向积极的核心所在。

从经济方向到股市节奏，我们之前对市场的短期走势偏于乐观。我们不得不认识到当下市场

积弱难返的特征。居民部门资产负债表的改善需要时间，稳经济的各项政策发挥实效需要时间，这个时间可能相比过去中国经济高速发展期的逆周期调控政策的发挥实效时间要来的长，过程会更为缓慢。而 A 股市场的投资者，在经过近两年多的屡屡预期落空的教训之后，已经更为谨慎，不见兔子不撒鹰，在没有看到真实的改善的经济数据之前，就难以出现反映到投资行为上的真正乐观。在短期有较好的上涨表现之后，兑现收益落袋为安的思维就会导致股价的回调，波动震荡成为阶段常态。

后续，经济层面总体将继续保持当前态势，相对平淡。7 月份的三中全会是重要关注事项，其中传达的经济政策纲领可能影响市场偏中长期的预期。而地产政策及销售数据是直接影响当下预期的重要变量，需要重点跟踪。若能继续有大力度政策，对市场的支撑刺激作用是显而易见的。海外的联储降息及美国大选的影响，短期而言是重要但是偏次要的因素。

总体而言，在见到好转的经济数据，或者更积极重磅的政策信号之前，市场可能继续表现为震荡的格局。经济不大幅恶化的情形下，市场向下有估值的支撑（当下的沪深 300 的股息率达到 3.2%，远超 10 年期国债利率），向上暂时无法看到分子端盈利的大幅改善。结构性的板块行情特征也继续演绎，市场需要时间换空间，等待正面政策在经济层面的实际见效。在此之前，高股息、主题成长、有一定韧性的出海等，依旧是市场资金关注的方向。若经济有正面环比较明显的向好，质量资产乃至成长资产可能成为重要的市场发力方向，美联储降息对此会有一些的助力。

立足当下，放眼未来。在 FOF 投资管理中，基于当下的经济平淡，市场预期谨慎，对市场短期保持中性观点，要适当防范市场失速风险；而在中期，我们认为可能的倒逼政策以及居民资产负债表的持续改善等，周期的力量终将显现，内需有较大可能出现明显的改善。此时可能是 A 股市场较好的投资窗口期。更长期地，中国在面临人口老龄化、中美竞争等压力上，寻求新质生产力带来的高质量发展的经济远景，需要我们紧密跟踪实际状况。

海外资产方面，我们会继续保持关注。中美竞争、逆全球化下的全球权益资产，在大类资产配置中的风险收益优化效果可能进一步显现。美联储降息，欧洲降息等，对海外债券市场也有直接的正面影响，对比当下国内的较低的债券收益率水平，有较好的投资性价比优势。当然，汇率因素是重要的需要衡量的不确定因素。

我们希望能够充分认识到当下的市场特征、短中期的市场演绎可能的基础上，做好收益和风险的平衡，做好主观研判和投资框架纪律的平衡，在知行结合上做到更好。

#### 4.6 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、证监会的相关规定以及基金合同的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规及基金合同要求履行估值及净值计算的复核责任。

会计师事务所定期对估值调整采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。

本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，设立估值委员会。估值委员会负责审定公司基金估值业务管理制度，建立健全估值决策体系，确定不同基金产品及投资品种的估值方法，保证基金估值业务准确真实地反映基金相关金融资产和金融负债的公允价值。估值委员会负责人由公司分管投资的公司领导担任，估值委员会成员由投资研究相关部门、监察稽核部、风险管理部和运营部分别委派一名或多名代表组成，以上人员均具备必要的经验、专业胜任能力和相关工作经验。估值委员会各成员职责分工如下：投资研究相关部门负责关注市场变化、证券发行机构重大事件等可能对估值产生重大影响的因素，向估值委员会提出合理的估值建议，确保估值的公允性；运营部负责日常估值业务的具体执行，及时准确完成基金估值，并负责和托管行沟通协调核对；风险管理部协助评估相关估值模型及参数，向估值委员会提出建议；监察稽核部负责定期或不定期对估值政策、程序及相关方法的一致性进行检查，确保估值政策和程序的一贯性。当估值委员会委员同时为基金经理时，涉及其相关持仓品种估值调整时采取回避机制，保持估值调整的客观性和独立性。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。

截至报告期末本基金管理人已签约的定价服务机构为中债金融估值中心有限公司和中证指数有限公司，由其按约定提供相关债券品种和流通受限股票的估值参考数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规规定和本基金合同的约定及实际运作情况，本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 4.8 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

本报告期内，本基金出现了连续 20 个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，时间范围为 2024 年 1 月 15 日至 2024 年 3 月 26 日。

## § 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—安信基金管理有限责任公司 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有

人利益的行为。

## 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

本托管人认为，安信基金管理有限责任公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

## 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，安信基金管理有限责任公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

# § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：安信禧悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	448,508.33	2,416,665.15
结算备付金		14,941.25	34,334.84
存出保证金		4,579.61	2,889.51
交易性金融资产	6.4.7.2	49,511,005.52	48,973,868.60
其中：股票投资		1,277,104.11	1,277,234.62
基金投资		43,509,984.02	44,341,655.26
债券投资		4,723,917.39	3,354,978.72
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	1,700,000.00
应收清算款		31,858.44	52,165.26
应收股利		5,247.51	1.03
应收申购款		253,419.64	16,681.01

递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	2,601.29	2,764.70
资产总计		50,272,161.59	53,199,370.10
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年6月30日</b>	<b>上年度末 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		21,378.99	1,726,539.99
应付赎回款		74,709.78	339,067.44
应付管理人报酬		26,232.99	25,480.96
应付托管费		4,854.78	5,264.28
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		29.62	9.22
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	35,212.31	98,164.60
负债合计		162,418.47	2,194,526.49
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	46,581,592.76	46,938,670.40
未分配利润	6.4.7.8	3,528,150.36	4,066,173.21
净资产合计		50,109,743.12	51,004,843.61
负债和净资产总计		50,272,161.59	53,199,370.10

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 46,581,592.76 份，其中安信禧悦稳健养老一年持有混合（FOF）A 基金份额总额 46,376,239.12 份，基金份额净值 1.0757 元；安信禧悦稳健养老一年持有混合（FOF）Y 基金份额总额 205,353.64 份，基金份额净值 1.0810 元。

## 6.2 利润表

会计主体：安信禧悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024年1月1日至2024 年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年6月30日
<b>一、营业总收入</b>		-392,482.51	1,276,560.68
1. 利息收入		3,653.44	3,452.32
其中：存款利息收入	6.4.7.9	3,516.28	3,335.06
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		137.16	117.26
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-666,140.53	9,878.25
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-160,085.59	-106,440.44
基金投资收益	6.4.7.11	-617,364.26	-300,861.57
债券投资收益	6.4.7.12	86,470.04	76,815.68
资产支持证券投资	6.4.7.13	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	24,839.28	340,364.58
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）	6.4.7.17	254,603.44	1,248,815.23
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	15,401.14	14,414.88
<b>减：二、营业总支出</b>		215,663.87	238,305.63
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	150,810.61	169,501.03
2. 托管费	6.4.10.2.2	27,854.58	32,435.70
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		1,161.76	444.74
其中：卖出回购金融资产支出		1,161.76	444.74
6. 信用减值损失	6.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		9.88	30.14
8. 其他费用	6.4.7.21	35,827.04	35,894.02
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-608,146.38	1,038,255.05
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-608,146.38	1,038,255.05
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-608,146.38	1,038,255.05

### 6.3 净资产变动表

会计主体：安信禧悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 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	46,938,670.40	-	4,066,173.21	51,004,843.61
二、本期期初净资产	46,938,670.40	-	4,066,173.21	51,004,843.61
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-357,077.64	-	-538,022.85	-895,100.49
（一）、综合收益总额	-	-	-608,146.38	-608,146.38
（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）	-357,077.64	-	70,123.53	-286,954.11
其中：1. 基金申购款	6,021,269.99	-	469,292.75	6,490,562.74
2. 基金赎回款	-6,378,347.63	-	-399,169.22	-6,777,516.85
（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、本期期末净资产	46,581,592.76	-	3,528,150.36	50,109,743.12
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 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	49,087,947.14	-	4,367,579.73	53,455,526.87
二、本期期初净资产	49,087,947.14	-	4,367,579.73	53,455,526.87
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-3,348,623.79	-	615,413.41	-2,733,210.38

（一）、综合收益总额	-	-	1,038,255.05	1,038,255.05
（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）	-3,348,623.79	-	-422,841.64	-3,771,465.43
其中：1. 基金申购款	3,769,475.09	-	390,247.09	4,159,722.18
2. 基金赎回款	-7,118,098.88	-	-813,088.73	-7,931,187.61
（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、本期期末净资产	45,739,323.35	-	4,982,993.14	50,722,316.49

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

刘入领	廖维坤	苗杨
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

安信禧悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（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”）2019 年 11 月 26 日下发的证监许可[2019]2532 号文“关于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）注册的批复”的核准，由安信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《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》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金募集期间为 2020 年 5 月 18 日至 2020 年 6 月 5 日，募集结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2020）验字第 60962175\_H09 号验资报告。经向中国证监会备案，《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》于 2020 年 6 月 9 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 420,409,668.59 份，其中认购资金利息

折合 174,459.70 份基金份额。本基金的基金管理人为安信基金管理有限责任公司，注册登记机构为安信基金管理有限责任公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据本基金的基金管理人安信基金管理有限责任公司于 2023 年 5 月 9 日发布的《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》以及更新的《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》的有关规定，经本基金管理人与基金托管人中国农业银行股份有限公司协商一致，本基金自 2023 年 5 月 9 日起增加 Y 类份额。本基金根据管理费、托管费以及业务类型的不同，将基金份额分为不同的类别。Y 类基金份额是指根据《暂行规定》针对个人养老金投资基金业务单独设立的、仅供个人养老金客户申购的一类基金份额。本基金不同基金份额类别之间不能相互转换。本基金 A 类和 Y 类基金份额分别设置基金代码，分别计算基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《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》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（包括 QDII 基金和香港互认基金）、国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板以及其他中国证监会核准上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、可转换债券（含可分离交易可转债的纯债部分）、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、永续债及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款等）、同业存单、货币市场工具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（但须符合中国证监会相关规定）。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，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。

本基金的投资组合比例为：本基金投资于经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金的资产比例不低于基金资产的 80%，其中，投资于货币市场基金的比例不超过基金资产的 15%；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）等品种的比例合计不得超过基金资产的 30%，投资于商品基金（含商品期货基金和黄金 ETF）的比例不超过基金资产的 10%；本基金应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：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%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 日止的经营成果和净资产变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

##### （1）印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

##### （2）增值税及附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券

取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，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，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按 7%、3%和 2%的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

### （3）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，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。

### （4）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息

所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

#### （5）境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	448,508.33
等于：本金	448,416.70
加：应计利息	91.63
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	448,508.33

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	1,410,336.98	-	1,277,104.11	-133,232.87
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	40,313.29	4,723,917.39	-35,725.83
	银行间市场	-	-	-
	合计	40,313.29	4,723,917.39	-35,725.83
资产支持证券	-	-	-	-
基金	42,350,243.69	-	43,509,984.02	1,159,740.33
其他	-	-	-	-
合计	48,479,910.60	40,313.29	49,511,005.52	990,781.63

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本期末无衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金于本期末无买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应收利息	-
其他应收款	2,601.29
待摊费用	-
合计	2,601.29

注：其他应收款为通过直销渠道申购且应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的销售服务费。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 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	2,890.93
其中：交易所市场	2,890.93
银行间市场	-
应付利息	-
应付信息披露费	24,863.02
应付审计费	7,458.36
合计	35,212.31

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

安信禧悦稳健养老一年持有混合（FOF）A

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	46,812,481.25	46,812,481.25
本期申购	5,941,020.85	5,941,020.85
本期赎回（以“-”号填列）	-6,377,262.98	-6,377,262.98
本期末	46,376,239.12	46,376,239.12

安信禧悦稳健养老一年持有混合（FOF）Y

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	126,189.15	126,189.15
本期申购	80,249.14	80,249.14
本期赎回（以“-”号填列）	-1,084.65	-1,084.65
本期末	205,353.64	205,353.64

注：申购含红利再投、转换入份额（如适用）；赎回含转换出份额（如适用）。

#### 6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

安信禧悦稳健养老一年持有混合（FOF）A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	8,053,290.46	-3,998,463.64	4,054,826.82
本期期初	8,053,290.46	-3,998,463.64	4,054,826.82
本期利润	-859,954.39	253,999.18	-605,955.21
本期基金份额交易产生的变动数	-139,707.90	202,356.27	62,648.37
其中：基金申购款	899,840.93	-438,122.26	461,718.67

基金赎回款	-1,039,548.83	640,478.53	-399,070.30
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,053,628.17	-3,542,108.19	3,511,519.98

安信禧悦稳健养老一年持有混合（FOF）Y

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	22,069.67	-10,723.28	11,346.39
本期期初	22,069.67	-10,723.28	11,346.39
本期利润	-2,795.43	604.26	-2,191.17
本期基金份额交易产生的变动数	12,945.36	-5,470.20	7,475.16
其中：基金申购款	13,117.15	-5,543.07	7,574.08
基金赎回款	-171.79	72.87	-98.92
本期已分配利润	-	-	-
本期末	32,219.60	-15,589.22	16,630.38

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	3,157.60
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	330.00
其他	28.68
合计	3,516.28

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	4,766,905.60
减：卖出股票成本总额	4,916,915.07
减：交易费用	10,076.12
买卖股票差价收入	-160,085.59

6.4.7.11 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	44,599,392.25
减：卖出/赎回基金成本总额	45,203,399.20
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	-
减：交易费用	13,357.31

基金投资收益	-617,364.26
--------	-------------

#### 6.4.7.12 债券投资收益

##### 6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	28,246.79
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	58,223.25
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	86,470.04

##### 6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	6,979,762.84
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	6,860,383.38
减：应计利息总额	60,798.07
减：交易费用	358.14
买卖债券差价收入	58,223.25

#### 6.4.7.13 资产支持证券投资收益

本基金于本期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金于本期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本基金于本期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	19,041.52
其中：证券出借权益补偿收入	-

基金投资产生的股利收益	5,797.76
合计	24,839.28

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	254,603.44
股票投资	-39,987.35
债券投资	-33,132.39
资产支持证券投资	-
基金投资	327,723.18
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	254,603.44

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	-
销售服务费返还	15,401.14
合计	15,401.14

注：上述销售服务费返还系本基金所投资的本基金管理人管理的其他基金所产生的销售服务费，根据相关法律法规及本基金合同约定，由基金管理人返还至本基金基金资产。

#### 6.4.7.19 持有基金产生的费用

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	44,347.38
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	144,891.42
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	33,545.67

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。该三项费用已在本基金所投资基金的净值中体现，不构成本基金的费用项目。

#### 6.4.7.20 信用减值损失

本基金于本期无信用减值损失。

#### 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	7,458.36
信息披露费	24,863.02
证券出借违约金	-
银行汇划费用	3,494.39
证券组合费	11.27
合计	35,827.04

#### 6.4.7.22 分部报告

截至本报告期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
安信基金管理有限责任公司（“安信基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人、基金销售机构
国投证券股份有限公司（“国投证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
五矿资本控股有限公司	基金管理人的股东
中广核财务有限责任公司	基金管理人的股东
佛山市顺德区新碧贸易有限公司	基金管理人的股东
安信乾盛财富管理（深圳）有限公司	基金管理人的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
国投证券	6,681,935.84	74.40	6,696,428.72	55.62

##### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金于本期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

##### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
国投证券	4,818.82	74.01	2,890.93	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
国投证券	4,643.21	54.64	1,701.43	54.87

注：上述佣金费率由本基金的基金管理人在正常业务范围内按一般商业条款与对方协商约定，并扣除由交易所或登记结算公司收取的相关费用后的净额列示。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	150,810.61	169,501.03
其中：应支付销售机构的客户维护费	30,692.00	52,899.43
应支付基金管理人的净管理费	120,118.61	116,601.60

注：基金管理费每日计提，按月支付。本基金投资于本基金管理人所管理的基金的部分不收取管理费。本基金各类基金份额按照不同的年费率计提管理费，各类基金份额的管理费按前一日该类基金资产净值扣除其前一日所对应持有的本基金管理人管理的其他基金份额的资产后的余额（若为负数，则为 0）的年管理费率计提。本基金 A 类基金份额的年管理费率为 0.80%；本基金 Y 类基金份额的年管理费率为 0.40%。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times \text{各类基金份额的年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为各类基金份额每日应计提的基金管理费

E 为各类基金份额前一日的基金资产净值扣除其前一日所对应持有的本基金管理人管理的其他基金份额的资产后的余额，若为负数，则 E 取 0

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	27,854.58	32,435.70

注：基金托管费每日计提，按月支付。本基金投资于本基金托管人所托管的基金的部分不收取托管费。本基金各类基金份额按照不同的年费率计提托管费，各类基金份额的托管费按前一日该类基金资产净值扣除其前一日所对应持有的本基金托管人托管的其他基金份额的资产后的余额（若为负数，则为 0）的年托管费率计提。本基金 A 类基金份额的年托管费率为 0.15%；本基金 Y 类基金份额的年托管费率为 0.075%。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times \text{各类基金份额的年托管费率} \div \text{当年天数}$$

H 为各类基金份额每日应计提的基金托管费

E 为各类基金份额前一日的基金资产净值扣除其前一日所对应持有的本基金托管人托管的其他基金份额的资产后的余额，若为负数，则 E 取 0

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金于本期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 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

##### 6.4.10.4.1 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

本基金于本期及上年度可比期间均无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。

#### 6.4.10.4.2 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

本基金于本期及上年度可比期间均无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。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	本期 2024 年 1 月 1 日至 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
基金合同生效日 ( 2020 年 6 月 9 日 ) 持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	5,565,398.89	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减: 报告期间赎回/卖出总份 额	-	-
报告期末持有的基金份额	5,565,398.89	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	11.95%	-
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 5 月 9 日 ( 基金合同生 效日 ) 至 2023 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
基金合同生效日 ( 2020 年 6 月 9 日 ) 持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减: 报告期间赎回/卖出总份 额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	-

注：本基金管理人运用固有资金投资本基金所适用的费率/用与本基金法律文件的规定一致。

#### 6.4.10.5.2 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

安信禧悦稳健养老一年持有混合（FOF）A

关联方名称	本期末 2024年6月30日		上年度末 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（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）
安信乾盛 财富管理 （深圳）有 限公司	22,901,121.59	49.16	22,901,121.59	48.79

注：本基金其他关联方投资本基金所适用的费率/用与本基金法律文件的规定一致。

#### 6.4.10.6 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 2024年1月1日至2024年6月30 日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	448,508.33	3,157.60	731,217.31	2,999.87

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按约定利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 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安信基金管理有限责任公司所管理的基金合计 10,274,579.13 元（2023 年 12 月 31 日：11,932,227.98 元），占本基金资产净值的比例为 20.50%（2023 年 12 月 31 日：23.39%）。

##### 6.4.10.8.2 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 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6 月30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	15,401.14	14,414.88

服务费（元）		
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	34,742.70	27,070.22
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	9,528.10	7,224.21
当期交易基金产生的转换费（元）	-	4,292.99

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。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金于本期末未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金于本期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金于本期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额，无抵押债券。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额，无抵押债券。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金于本期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人坚持“风险管理创造价值”、“风险管理人人有责”、“合规风险零容忍”的理念，将风险管理融入到公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的控制。本基金管理人为全面、深入控制风险，建立了自下而上的三层风险管理体系。在业务操作层面由公司各部门和各级业务岗位进行业务一线风险的自控和互控。经理层下设的风险控制委员会、投资决策委员

会等专业委员会和监察稽核部、风险管理部组成公司风险管理的第二层防线，负责组织和协调公司内部的风险管理工作，查找、评估业务中的风险隐患，提出处理意见并监督执行。本基金管理人在董事会下设立合规与风险管理委员会、审计委员会和督察长作为风险管理的第三层防线，负责制定公司风险管理的框架、监督风险管理的执行情况并督促公司保护持有人的合法权益。

本基金主要的投资工具包括股票投资、债券投资、基金投资等金融工具，在日常经营活动中面临信用风险、流动性风险及市场风险等相关风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡。

本基金管理人通过定性和定量两种方式对本基金投资的金融工具进行风险管理。一方面从定性的角度出发，对本基金存在的风险、风险的严重程度及风险发生的可能性进行评估、分析和宏观控制；另一方面从定量分析的角度出发，通过金融建模和特定风险量化指标计算，在日常工作中实时地对各种量化风险进行跟踪、检查和预警，并通过相应决策将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

在基金投资过程中，信用风险主要是指因债券交易对手未履行合约责任，或者基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金管理人建立了严格的债券备选池制度以有效地控制信用风险，对债券发行人自身偿债能力及增信条款进行了充分的考虑并同时采取分散化投资方式防范信用风险。

本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场通过对交易对手的资信情况进行充分审慎的评估，同时对证券交割方式进行限制以控制交易对手的违约风险。

截至 2024 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 4.16%（2023 年 12 月 31 日：1.61%）。

##### 6.4.13.2.1 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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	1,624,984.11	2,535,493.15
合计	1,624,984.11	2,535,493.15

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为国债、政策性金融债、央票或其他未经第三方评级机构进行债项评级的债券。

#### 6.4.13.2.2 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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
AAA	1,132,524.75	627,915.39
AAA 以下	951,352.28	191,570.18
未评级	1,015,056.25	-
合计	3,098,933.28	819,485.57

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为国债、政策性金融债、央票或其他未经第三方评级机构进行债项评级的债券。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人要求赎回的基金资产超出基金持有的现金类资产规模，另一方面来自于基金持有的投资品种交易不活跃而带来的变现困难或不能以合理的价格变现。

##### 6.4.13.3.1 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》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。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。于本报告期末，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。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。除本报告“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”章节中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产

负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 6.4.13.4 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。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的现金流量和投资品种的公允价值受市场利率变动而发生波动的风险。货币资金、结算备付金及债券投资等品种的公允价值均面临在市场利率上升时出现下降的风险。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，采用久期、凸度、VaR（在险价值）等量化风险指标评估基金的利率风险，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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	448,508.33	-	-	-	448,508.33
结算备付金	14,941.25	-	-	-	14,941.25
存出保证金	4,579.61	-	-	-	4,579.61
交易性金融资产	2,650,944.77	2,071,197.02	1,775.60	44,787,088.13	49,511,005.52
应收股利	-	-	-	5,247.51	5,247.51
应收申购款	-	-	-	253,419.64	253,419.64
应收清算款	-	-	-	31,858.44	31,858.44
其他资产	-	-	-	2,601.29	2,601.29
资产总计	3,118,973.96	2,071,197.02	1,775.60	45,080,215.01	50,272,161.59
负债					
应付赎回款	-	-	-	74,709.78	74,709.78
应付管理人报酬	-	-	-	26,232.99	26,232.99
应付托管费	-	-	-	4,854.78	4,854.78
应付清算款	-	-	-	21,378.99	21,378.99
应交税费	-	-	-	29.62	29.62
其他负债	-	-	-	35,212.31	35,212.31
负债总计	-	-	-	162,418.47	162,418.47
利率敏感度缺口	3,118,973.96	2,071,197.02	1,775.60	44,917,796.54	50,109,743.12
上年度末 2023年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

资产					
货币资金	2,416,665.15	-	-	-	2,416,665.15
结算备付金	34,334.84	-	-	-	34,334.84
存出保证金	2,889.51	-	-	-	2,889.51
交易性金融资产	2,535,493.15	780,600.30	38,885.27	45,618,889.88	48,973,868.60
买入返售金融资产	1,700,000.00	-	-	-	1,700,000.00
应收股利	-	-	-	1.03	1.03
应收申购款	-	-	-	16,681.01	16,681.01
应收清算款	-	-	-	52,165.26	52,165.26
其他资产	-	-	-	2,764.70	2,764.70
资产总计	6,689,382.65	780,600.30	38,885.27	45,690,501.88	53,199,370.10
负债					
应付赎回款	-	-	-	339,067.44	339,067.44
应付管理人报酬	-	-	-	25,480.96	25,480.96
应付托管费	-	-	-	5,264.28	5,264.28
应付清算款	-	-	-	1,726,539.99	1,726,539.99
应交税费	-	-	-	9.22	9.22
其他负债	-	-	-	98,164.60	98,164.60
负债总计	-	-	-	2,194,526.49	2,194,526.49
利率敏感度缺口	6,689,382.65	780,600.30	38,885.27	43,495,975.39	51,004,843.61

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。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	1. 市场利率下降25个基点	19,285.18	9,359.19
2. 市场利率上升25个基点	-19,058.26	-9,260.98	

#### 6.4.13.4.2 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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	94,225.08	-	94,225.08
应收股利	-	5,247.34	-	5,247.34
资产合计	-	99,472.42	-	99,472.42
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净额	-	99,472.42	-	99,472.42
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	385,927.38	-	385,927.38
资产合计	-	385,927.38	-	385,927.38
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净额	-	385,927.38	-	385,927.38

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除市场汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	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（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月）

			31 日 )
1. 所有外币相对人民币升值 5%		4,973.62	19,296.37
2. 所有外币相对人民币贬值 5%		-4,973.62	-19,296.37

#### 6.4.13.4.3 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。本基金主要投资于公开募集的证券投资基金，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。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金的资产比例不低于基金资产的 80%，其中，投资于货币市场基金的比例不超过基金资产的 15%；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）等品种的比例合计不得超过基金资产的 30%，投资于商品基金（含商品期货基金和黄金 ETF）的比例不超过基金资产的 10%；本基金应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。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（在险价值）等量化指标评估本基金潜在的价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,277,104.11	2.55	1,277,234.62	2.50
交易性金融资产—基金投资	43,509,984.02	86.83	44,341,655.26	86.94
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	44,787,088.13	89.38	45,618,889.88	89.44

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	1. 业绩比较基准上升5%	2,734,610.23	2,960,815.32
	2. 业绩比较基准下降5%	-2,734,610.23	-2,960,815.32

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	46,870,965.16	46,438,375.45
第二层次	2,640,040.36	2,535,493.15
第三层次	-	-
合计	49,511,005.52	48,973,868.60

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金于本期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 6.4.15 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事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 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	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	其他各项资产	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%。

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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

### 7.2.2 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。

### 7.3 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

金额单位：人民币元

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
11	00839	中教控股	12,000	49,394.24	0.10
12	03900	绿城中国	8,000	44,830.84	0.09
13	301383	天键股份	1,380	36,045.60	0.07
14	600835	上海机电	2,500	28,775.00	0.06
15	600383	金地集团	4,000	13,600.00	0.03
16	002155	湖南黄金	600	10,860.00	0.02
17	300406	九强生物	700	10,766.00	0.02
18	603816	顾家家居	200	6,458.00	0.01
19	300442	润泽科技	200	4,790.00	0.01
20	600150	中国船舶	100	4,071.00	0.01
21	300445	康斯特	100	1,610.00	0.00
22	601058	赛轮轮胎	100	1,400.00	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600901	江苏金租	592,598.70	1.16
2	002929	润建股份	531,061.00	1.04
3	002296	辉煌科技	180,384.00	0.35
4	300445	康斯特	175,707.00	0.34
5	300442	润泽科技	172,677.00	0.34
6	688169	石头科技	163,520.00	0.32
7	300274	阳光电源	145,367.00	0.29
8	601689	拓普集团	135,319.00	0.27
9	601838	成都银行	128,600.00	0.25
10	600383	金地集团	115,060.00	0.23
11	600546	山煤国际	113,490.00	0.22
12	601666	平煤股份	112,670.80	0.22
13	603801	志邦家居	111,472.00	0.22
14	601006	大秦铁路	109,819.71	0.22

15	601699	潞安环能	108,566.00	0.21
16	603313	梦百合	104,763.00	0.21
17	002947	恒铭达	101,220.00	0.20
18	688244	永信至诚	92,111.00	0.18
19	00268	金蝶国际	90,236.44	0.18
20	600150	中国船舶	88,729.00	0.17

注：本项的“累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600901	江苏金租	595,858.87	1.17
2	002929	润建股份	316,534.00	0.62
3	600919	江苏银行	254,923.50	0.50
4	300442	润泽科技	207,091.00	0.41
5	00839	中教控股	199,442.40	0.39
6	300445	康斯特	169,508.00	0.33
7	688244	永信至诚	147,956.00	0.29
8	300360	炬华科技	140,324.00	0.28
9	300274	阳光电源	138,765.00	0.27
10	601838	成都银行	133,970.00	0.26
11	000811	冰轮环境	131,536.00	0.26
12	601666	平煤股份	114,510.60	0.22
13	601006	大秦铁路	111,475.99	0.22
14	600546	山煤国际	107,869.00	0.21
15	01024	快手-W	101,254.83	0.20
16	601699	潞安环能	95,380.00	0.19
17	002919	名臣健康	94,098.00	0.18
18	603313	梦百合	90,714.00	0.18
19	601689	拓普集团	88,986.00	0.17
20	00268	金蝶国际	88,390.82	0.17

注：本项的“累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	4,956,771.91
卖出股票收入（成交）总额	4,766,905.60

注：“买入股票成本（成交）总额”、“卖出股票收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	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

## 7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	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

## 7.7 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。

## 7.8 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。

## 7.9 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。

## 7.10 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。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 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。

### 7.11.2 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，本基金暂不参与国债期货交易。

## 7.12 本报告期投资基金情况

### 7.12.1 投资政策及风险说明

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。定量研究方面，主动管理型基金是基金量化优选的重点，以实现基金优选组合的  $\alpha$ 。本基金将在公司相应的基金池制度基础上，进行进一步的贴合市场的实际投资优选。在主动管理型基金的量化优选中，注重 2-3 年较中长期的业绩表现和稳定性；注重“先风险剔除，后业绩择优”的量化选择思想；子基金风险方面不仅仅关注通常的波动率等指标，也注重市场下跌时的系统风险指标；子基金业绩方面，注重基金经理的综合性的主要投资能力，包括选股能力、行业配置能力、风格轮动适应能力等，且考虑各项能力的稳定性。通过这种多维度投资能力的中长期优异性及稳定性的量化选择，降低基金个体性风险，希望实现基金优选组合的长期稳定优异业绩。

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。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。

### 7.12.2 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	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
11	011066	大成高新技术产业股票 C	契约型 开放式	288,777.27	1,170,356.52	2.34	否
12	008187	淳厚信睿混合 C	契约型 开放式	516,151.09	933,097.94	1.86	否
13	100050	富国全球债券 (QDII)	契约型 开放式	696,838.46	907,492.73	1.81	否
14	019894	天弘通利混合 C	契约型 开放式	431,884.58	849,948.85	1.70	否
15	007950	招商量化精选股票 C	契约型 开放式	377,712.44	781,071.55	1.56	否
16	015779	景顺长城价值边际灵活配置混合 C	契约型 开放式	474,804.44	762,440.97	1.52	否
17	001044	嘉实新消费股票	契约型 开放式	308,259.04	735,506.07	1.47	否

18	016313	富国研究精选灵活配置混合 C	契约型 开放式	270,602.55	674,612.16	1.35	否
19	012715	长盛成长价值混合 C	契约型 开放式	366,152.82	639,302.82	1.28	否
20	014109	融通内需驱动混合 C	契约型 开放式	222,766.31	617,953.74	1.23	否
21	006337	华安安浦债券 A	契约型 开放式	446,255.97	509,088.81	1.02	否
22	005661	嘉实资源精选股票 C	契约型 开放式	163,391.13	451,890.85	0.90	否
23	008764	天弘越南市场股票(QDII)C	契约型 开放式	313,230.35	432,821.70	0.86	否
24	007574	宝盈新价值混合 C	契约型 开放式	146,478.65	422,151.47	0.84	否
25	016562	鹏华精选成长混合 C	契约型 开放式	491,705.43	386,873.83	0.77	否
26	011726	安信新常态股票 C	契约型 开放式	239,178.38	365,273.22	0.73	是
27	000390	华商优势行业混合	契约型 开放式	353,153.31	360,569.53	0.72	否
28	019449	摩根日本精选股票(QDII)C	契约型 开放式	214,526.62	345,087.52	0.69	否
29	020155	长盛量化红利混合 C	契约型 开放式	123,062.40	338,212.39	0.67	否
30	010696	工银金融地产混合 C	契约型 开放式	142,698.97	303,948.81	0.61	否
31	008348	中信建投甄选混合 C	契约型 开放式	160,815.32	286,460.33	0.57	否
32	017090	景顺长城能源基建混合 C	契约型 开放式	108,886.05	263,286.47	0.53	否
33	630002	华商盛世成长混合	契约型 开放式	44,242.89	221,740.94	0.44	否
34	515060	华夏中证全指房地产 ETF	交易型 开放式 (ETF)	220,000.00	122,540.00	0.24	否
35	513030	华安德国	交易型	73,000.00	99,937.00	0.20	否

		30 (DAX)ETF (QDII)	开放式 (ETF)				
36	006064	红土创新增强收益债券 C	契约型 开放式	67,820.66	94,833.63	0.19	否
37	159850	H 股 50	交易型 开放式 (ETF)	140,000.00	89,880.00	0.18	否
38	001917	招商量化精选股票 A	契约型 开放式	40,042.60	85,010.44	0.17	否
39	513180	华夏恒生科技 ETF (QDII)	交易型 开放式 (ETF)	160,000.00	78,240.00	0.16	否
40	018460	大成新锐产业混合 C	契约型 开放式	14,529.60	77,835.07	0.16	否
41	110009	易方达价值精选混合	契约型 开放式	68,292.39	73,994.80	0.15	否
42	159732	消费电子	交易型 开放式 (ETF)	105,000.00	70,560.00	0.14	否
43	513530	华泰柏瑞中证港股通 高股息投资 ETF (QDII)	交易型 开放式 (ETF)	49,000.00	66,493.00	0.13	否
44	512680	广发中证军工 ETF	交易型 开放式 (ETF)	70,000.00	63,070.00	0.13	否
45	501219	华夏智胜先锋股票 (LOF) A	上市契 约型开 放式 (LOF)	56,800.00	58,617.60	0.12	否
46	159740	恒生科技	交易型 开放式 (ETF)	120,000.00	57,360.00	0.11	否
47	166301	华高新趋势优选混合	上市契 约型开 放式 (LOF)	6,197.55	56,534.05	0.11	否

48	512810	华宝中证军工 ETF	交易型 开放式 (ETF)	55,000.00	55,495.00	0.11	否
49	163415	兴全模式	上市契 约型开 放式 (LOF)	16,000.00	49,104.00	0.10	否
50	512660	国泰中证军工 ETF	交易型 开放式 (ETF)	52,000.00	45,708.00	0.09	否
51	588000	华夏上证科创板 50 成份 ETF	交易型 开放式 (ETF)	60,000.00	44,700.00	0.09	否
52	513690	博时恒生高股息 ETF	交易型 开放式 (ETF)	50,000.00	42,000.00	0.08	否
53	159996	家电 ETF	交易型 开放式 (ETF)	24,000.00	26,976.00	0.05	否
54	512200	南方中证全指房地产 ETF	交易型 开放式 (ETF)	60,000.00	25,320.00	0.05	否
55	512760	国泰 CES 半导体芯片 ETF	交易型 开放式 (ETF)	15,000.00	11,985.00	0.02	否
56	515910	中金 MSCI 中国 A 股国 际质量 ETF	交易型 开放式 (ETF)	20,000.00	9,340.00	0.02	否
57	159680	1000 指增	交易型 开放式 (ETF)	9,600.00	8,467.20	0.02	否
58	159819	AI 智能	交易型 开放式 (ETF)	10,000.00	7,160.00	0.01	否
59	561100	富国中证消费电子主 题 ETF	交易型 开放式	5,000.00	3,480.00	0.01	否

			(ETF)				
60	159941	纳指 ETF	交易型 开放式 (ETF)	2,000.00	2,214.00	0.00	否
61	007245	安信鑫日享中短债债券 A	契约型 开放式	1,925.44	2,154.57	0.00	是
62	008204	交银稳利中短债债券 A	契约型 开放式	1,227.45	1,412.18	0.00	否
63	000893	工银创新动力股票	契约型 开放式	971.36	1,021.87	0.00	否
64	515070	华夏中证人工智能主题 ETF	交易型 开放式 (ETF)	1,000.00	915.00	0.00	否
65	018225	大成策略回报混合 C	契约型 开放式	741.02	829.13	0.00	否
66	010349	诺安低碳经济股票 C	契约型 开放式	435.12	809.76	0.00	否
67	675113	西部利得汇享债券 C	契约型 开放式	394.61	495.39	0.00	否
68	000905	鹏华安盈宝货币	契约型 开放式	488.12	488.12	0.00	否
69	003034	平安交易型货币 A	契约型 开放式	460.51	460.51	0.00	否
70	004167	安信活期宝货币 B	契约型 开放式	127.71	127.71	0.00	是

### 7.12.3 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

### 7.13 投资组合报告附注

#### 7.13.1 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

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。

7.13.2 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

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。

7.13.3 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	4,579.61
2	应收清算款	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	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	297,706.49

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	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

### 7.13.5 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不存在流通受限情况。

### 7.13.6 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。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	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（%）	持有份额	占总份额比例（%）
安信禧悦稳健养老一年持有混合(FOF) A	2,059	22,523.67	28,466,520.48	61.38	17,909,718.64	38.62

安信禧悦 稳健养老 一年持有 混合(FOF) Y	88	2,333.56	0.00	0.00	205,353.64	100.00
合计	2,144	21,726.49	28,466,520.48	61.11	18,115,072.28	38.89

注：机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	安信禧悦稳健养老一年持有混合（FOF）A	712,022.02	1.54
	安信禧悦稳健养老一年持有混合（FOF）Y	27,201.83	13.25
	合计	739,223.85	1.59

注：管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.3 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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	安信禧悦稳健养老一年持有混合（FOF）A	50~100
	安信禧悦稳健养老一年持有混合（FOF）Y	0
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	安信禧悦稳健养老一年持有混合（FOF）A	50~100
	安信禧悦稳健养老一年持有混合（FOF）Y	0
	合计	50~100

## § 9 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
基金合同生效日	420,409,668.59	-

（2020 年 6 月 9 日） 基金份额总额		
本报告期期初基金 份额总额	46,812,481.25	126,189.15
本报告期基金总申 购份额	5,941,020.85	80,249.14
减：本报告期基金总 赎回份额	6,377,262.98	1,084.65
本报告期基金拆分 变动份额	-	-
本报告期期末基金 份额总额	46,376,239.12	205,353.64

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未举行基金份额持有人大会。

### 10.2 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

#### 一、基金管理人的重大人事变动

本报告期内，经安信基金管理有限责任公司第五届董事会第二次会议审议通过，张翼飞先生自 2024 年 3 月 26 日起卸任公司副总经理担任公司首席投资官（混合资产 CIO）。经安信基金管理有限责任公司股东会 2024 年第三次会议、第五届董事会第三次会议审议通过，自 2024 年 5 月 20 日起公司董事长由王连志先生变更为王苏望先生。

#### 二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

本基金的基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内本基金无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管人托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 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。

## 10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），该事务所自本基金合同生效以来为本基金提供审计服务至今。

## 10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 10.7.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人、高级管理人员
受到稽查或处罚等措施的时间	2024 年 05 月 28 日
采取稽查或处罚等措施的机构	深圳证监局
受到的具体措施类型	责令改正、警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	违反《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》的规定
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	管理人已完成整改
其他	无

### 10.7.2 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到监管部门稽查或处罚。

## 10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.8.1 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 (%)	
国投证券	3	6,681,935.84	74.40	4,818.82	74.01	-
国盛证券	2	2,279,754.46	25.38	1,677.24	25.76	-
海通证券	2	19,798.00	0.22	14.57	0.22	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中金财富	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

注：根据中国证监会《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，本基金管理人制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序规定。基金管理人综合考虑券商的研究能力后，确定证券公司的选择，并与被选择的证券公司签订协议。

10.8.2 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 (%)
国投证券	8,412,079.72	69.21	1,800,000.00	16.67	-	-	10,433,030.62	74.03
国盛证券	3,648,306.85	30.02	9,000,000.00	83.33	-	-	3,659,442.00	25.97
海通证券	93,402.36	0.77	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
世	-	-	-	-	-	-	-	-

纪 证 券									
天 风 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
兴 业 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
银 河 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
招 商 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中 金 财 富	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中 信 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-

### 10.9 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	安信基金管理有限责任公司关于提醒投资者防范不法分子假冒本公司、本公司子公司、本公司员工名义从事诈骗活动的公告	证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报	2024 年 1 月 3 日
2	安信基金管理有限责任公司关于公司董事变更情况公告	证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报	2024 年 1 月 9 日
3	安信基金管理有限责任公司关于旗下 86 只基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告	证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报	2024 年 1 月 19 日
4	安信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金新增中航证券有限公司为基金销售服务机构的公告	证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报	2024 年 2 月 21 日
5	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）调整申购赎回确认时间和净值披露时间的公告	证券日报	2024 年 2 月 21 日

6	安信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金新增麦高证券有限责任公司为基金销售服务机构的公告	证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报	2024 年 3 月 7 日
7	安信基金管理有限责任公司高级管理人员变更公告	证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报	2024 年 3 月 27 日
8	安信基金管理有限责任公司关于 2024 年香港耶稣受难节、复活节旗下部分基金非港股通交易日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报	2024 年 3 月 27 日
9	安信基金管理有限责任公司关于旗下 86 只基金 2023 年年度报告提示性公告	证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报	2024 年 3 月 28 日
10	安信基金管理有限责任公司关于旗下 88 只基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告	证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报	2024 年 4 月 19 日
11	安信基金管理有限责任公司住所变更公告	证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报	2024 年 4 月 23 日
12	安信基金管理有限责任公司关于新增基金直销账户信息的公告	证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报	2024 年 4 月 26 日
13	安信基金管理有限责任公司关于 2024 年香港佛诞日旗下部分基金非港股通交易日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报	2024 年 5 月 13 日
14	安信基金管理有限责任公司关于 2024 年香港特别行政区成立纪念日旗下部分基金非港股通交易日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	证券日报, 证券时报, 中国证券报, 上海证券报	2024 年 6 月 27 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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	20240101-20240630	22,901,121.59	-	-	22,901,121.59	49.16
产品特有风险							
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：							
(1) 基金在短期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；

（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；

（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；

（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；

（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。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 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。

### 12.2 存放地点

本基金管理人和基金托管人的住所。

### 12.3 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 8 月 29 日