

# 易方达如意安诚六个月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：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：二〇二四年八月三十日

## § 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

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
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	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	13
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
§ 5 托管人报告	14
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	14
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	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45
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	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47

7.12	本报告期投资基金情况	47
7.13	投资组合报告附注	51
§ 8	基金份额持有人信息	51
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
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	52
§ 9	开放式基金份额变动	52
§ 10	重大事件揭示	53
10.1	基金份额持有人大会决议	53
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	53
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	53
10.4	基金投资策略的改变	53
10.5	本报告期持有的基金发生的重大影响事件	53
10.6	为基金进行审计的会计师事务所情况	53
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	53
10.8	基金租用证券公司交易单元的有关情况	54
10.9	其他重大事件	55
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	55
11.1	影响投资者决策的其他重要信息	55
§ 12	备查文件目录	55
12.1	备查文件目录	55
12.2	存放地点	56
12.3	查阅方式	56

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	易方达如意安诚六个月持有期混合型基金中基金（FOF）	
基金简称	易方达如意安诚六个月持有混合（FOF）	
基金主代码	018312	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 12 月 21 日	
基金管理人	易方达基金管理有限公司	
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	44,700,668.55 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	易方达如意安诚六个月持有混合（FOF）A	易方达如意安诚六个月持有混合（FOF）C
下属分级基金的交易代码	018312	018313
报告期末下属分级基金的份额总额	12,686,761.63 份	32,013,906.92 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过大类资产的合理配置及基金精选，在控制整体风险的前提下，力争实现资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金将秉承稳健的投资风格，严格控制投资组合风险，力争为投资者获得长期投资回报。本基金的主要投资策略包括资产配置策略、基金筛选策略、基金配置策略。本基金的长期资产配置将以固定收益类资产为主，在此基础上，基金管理人将通过定性分析和定量分析相结合的方式对未来市场环境进行预测和判断，确定基金资产在权益类资产和固定收益类资产间的配置比例，并随着各类资产风险收益特征的相对变化，动态调整组合中各类资产的配置比例。基金筛选策略是基金配置策略的基础，本基金所投资的全部基金都应是通过基金筛选策略选择出的标的基金。对被动型基金和主动型基金将使用不同的筛选方法。在通过资产配置策略获得目标资产配置比例、通过基金筛选策略获得标的基金池后，本基金将通过基金配置策略完成具体的基金组合构建。本基金将通过公开披露的数据和信息估算拟投资基金的最新资产配置比例，根据目标资产配置比例的要求以及对未来市场走势的研判，确定最终的基金配置组合。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×18%+中证港股通综合指数收益率×2%+中债新综合指数（财富）收益率×80%
风险收益特征	本基金为混合型基金中基金（FOF），理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金、股票型基金中基金（FOF），高于债券型基金、债券型基金中基金（FOF）、货币市场基金和货币型基金中基金（FOF）。本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港证券市

	场，除了需要承担市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、投资于香港证券市场的风险、以及通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险等特有风险。本基金通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险详见招募说明书。
--	---

### 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		易方达基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王玉	任航
	联系电话	020-85102688	010-66060069
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400 881 8088	95599
传真		020-38798812	010-68121816
注册地址		广东省珠海市横琴新区荣粤道 188号6层	北京市东城区建国门内大街69 号
办公地址		广州市天河区珠江新城珠江东 路30号广州银行大厦40-43楼； 广东省珠海市横琴新区荣粤道 188号6层	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		510620； 519031	100031
法定代表人		刘晓艳	谷澍

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.efunds.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人的办公地址

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	易方达基金管理有限公司	广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州 银行大厦40-43楼；广东省珠海市横琴新区 荣粤道188号6层

§ 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 日至 2024 年 6 月 30 日）	
	易方达如意安诚六个月持有混合（FOF）A	易方达如意安诚六个月持有混合（FOF）C
本期已实现收益	2,718,858.31	3,232,940.96
本期利润	3,640,663.29	2,183,662.59
加权平均基金份额本期利润	0.0307	0.0262
本期加权平均净值利润率	3.00%	2.57%
本期基金份额净值增长率	2.31%	2.16%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
	易方达如意安诚六个月持有混合（FOF）A	易方达如意安诚六个月持有混合（FOF）C
期末可供分配利润	347,454.26	824,890.00
期末可供分配基金份额利润	0.0274	0.0258
期末基金资产净值	13,034,215.89	32,838,796.92
期末基金份额净值	1.0274	1.0258
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
	易方达如意安诚六个月持有混合（FOF）A	易方达如意安诚六个月持有混合（FOF）C
基金份额累计净值增长率	2.74%	2.58%

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.期末可供分配利润，为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

易方达如意安诚六个月持有混合（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	-0.70%	0.18%	0.05%	0.09%	-0.75%	0.09%
过去三个月	0.68%	0.14%	1.18%	0.14%	-0.50%	0.00%
过去六个月	2.31%	0.12%	3.38%	0.17%	-1.07%	-0.05%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	2.74%	0.12%	4.58%	0.17%	-1.84%	-0.05%

易方达如意安诚六个月持有混合（FOF）C

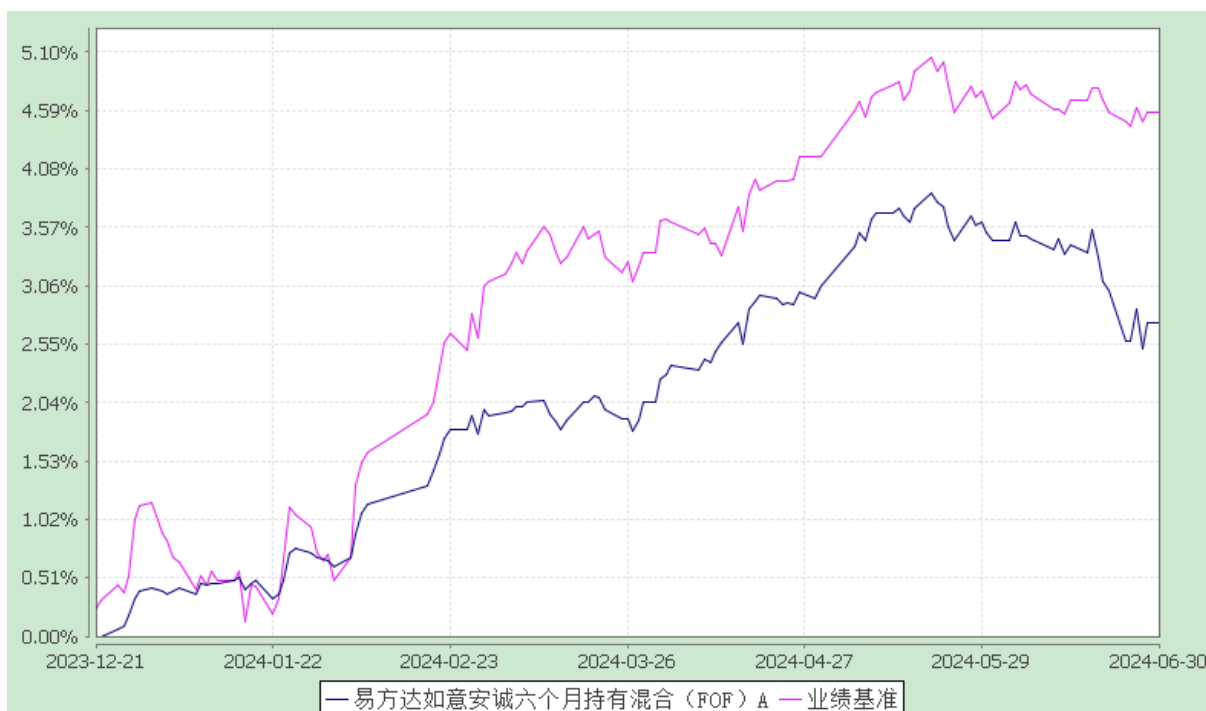
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-0.72%	0.18%	0.05%	0.09%	-0.77%	0.09%
过去三个月	0.60%	0.14%	1.18%	0.14%	-0.58%	0.00%
过去六个月	2.16%	0.12%	3.38%	0.17%	-1.22%	-0.05%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	2.58%	0.12%	4.58%	0.17%	-2.00%	-0.05%

### 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

易方达如意安诚六个月持有期混合型基金中基金（FOF）  
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

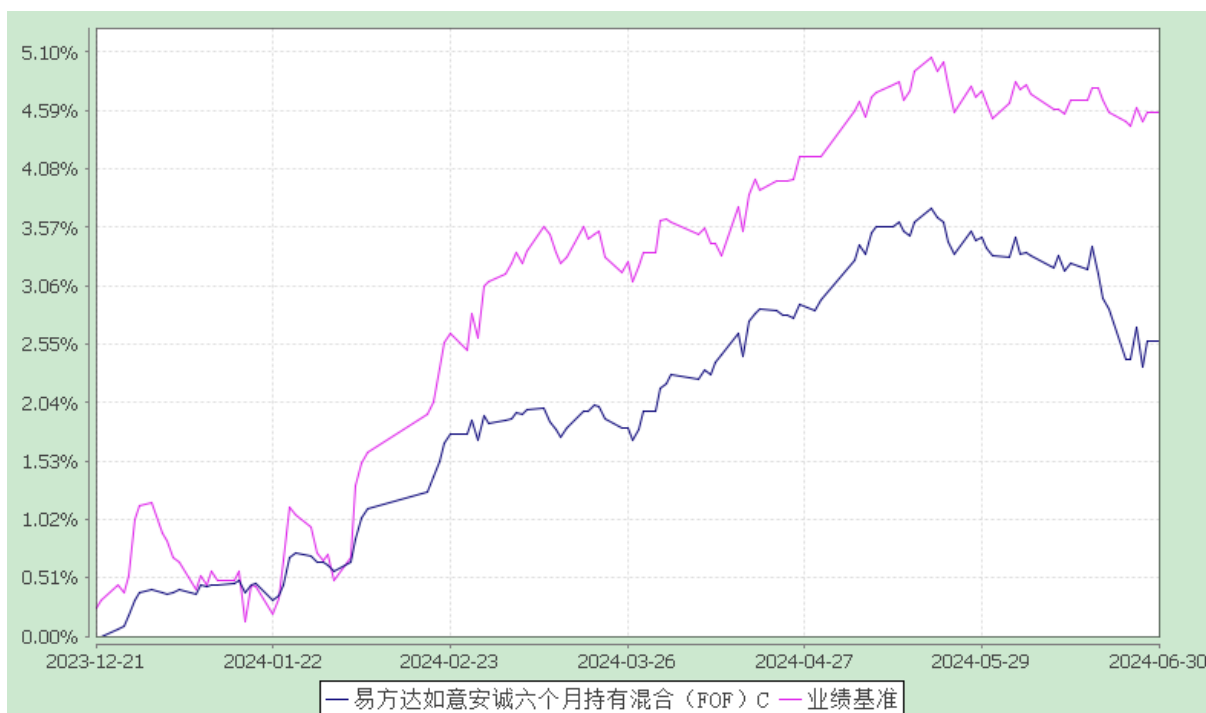
（2023 年 12 月 21 日至 2024 年 6 月 30 日）

易方达如意安诚六个月持有混合（FOF）A





## 易方达如意安诚六个月持有混合（FOF）C



注：1.本基金合同于2023年12月21日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2.按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时，本基金的基金总资产超过基金净资产的140%，为被动超标；除此之外，其他各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

3.自基金合同生效至报告期末，A类基金份额净值增长率为2.74%，同期业绩比较基准收益率为4.58%；C类基金份额净值增长率为2.58%，同期业绩比较基准收益率为4.58%。

## § 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

经中国证监会证监基金字[2001]4号文批准，本基金管理人成立于2001年4月17日，注册资本13,244.2万元人民币。本基金管理人拥有包括公募、社保、基本养老保险、年金、特定客户资产管理、QDII、投资顾问等在内的多类业务资格，在主动权益、指数投资、债券、多资产、另类资产等投资领域全面布局，为境内外客户提供资产管理解决方案。

#### 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		
张振琪	本基金的基金经理，易方达如意安泰一年持有混合（FOF）、易方达如意安和一年持有混合（FOF）、易方达汇诚养老 2043 三年持有混合（FOF）、易方达汇诚养老 2033 三年持有混合发起式（FOF）、易方达汇诚养老 2038 三年持有混合发起式（FOF）、易方达汇享稳健养老一年持有混合（FOF）的基金经理	2023-12-21	-	7 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任易方达基金管理有限公司研究员、投资经理。

注：1.对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理/基金经理助理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

#### 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《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无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

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人制定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等，并重视交易执行环节的公平交易措施，以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统内的公平交易模块，以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，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 31 次，其中 26 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，5 次为不同基金经理管理的基金因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

#### 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

2024 年上半年，出口驱动的制造业投资、工业生产等偏强，而国内需求相关度更高的消费、建筑业投资，以及信用扩张等略偏弱，背后驱动逻辑主要是海外补库带动全球制造业进入上行周期，我国经济结构性转型过程中，地产对内需的拉动力减弱，而新的增长动能未能较好接续。

资产价格方面，股票市场上半年走势一波三折。年初极端交易结构带来的流动性问题使得资产价格出现大幅调整，在政策陆续出台稳定市场信心后，资产价格也快速修复，逐步回归基本面定价逻辑，二季度经济数据的边际弱化以及对于长期经济上行空间的下修，使得股票市场再次转为震荡下行。结构方面，市值分化明显，大市值股票表现明显好于小市值股票；行业方面，具有红利属性的银行、煤炭、公用事业等行业表现居前，而综合、计算机、商贸零售等行业表现靠后。债券市场方面，“资产荒”的情况一直持续，虽然央行提示关注长期收益率的变化，但在宽松的流动性环境下，国内债券到期收益率延续震荡下行。全球大类资产方面，美股和日股表现较好，涨幅超过 10%，商品方面，黄金与原油价格涨幅也超过 10%，美债利率受降息预期影响先上后下，全区间来看，10 年期美债上行超过 45bp。

年初以来，我们密切跟踪经济高频数据变化，以期能够及时修正对于经济底部修复节奏的预期，在这一过程中，资本市场价格受预期波动影响经常会出现过度定价，我们也通过积极应对增强组合在当前市场环境下的适应性。本基金于 2023 年 12 月 21 日成立，报告期内打开赎回，考虑到客户持有体验与潜在负债端变化，组合操作偏向稳健。建仓初期以配置债券基金和低仓位打新基金为主，之后随着安全垫积累及市场环境变化再逐步提升权益基金比例。在报告期内，本基金主要进行以下操作：

在资产配置层面，主要是基于市场潜在风险及各类资产的风险补偿进行配置调整。年初市场对长期问题的悲观预期快速反映在股价中，风险情绪快速释放，市场潜在风险反而在下跌过程中不断下降，权益类资产的潜在风险补偿大幅提升，因此，在这一过程中组合开始提升权益类基金比例，并在底部增加了转债仓位，在较高债底的基础上获取潜在上行期权。进入 3 月后，市场修复了之前

流动性冲击带来的跌幅，组合减缓了权益资产的建仓节奏，小幅兑现转债收益，并提升了组合债券部分久期。而后随着市场调整，组合更多进行结构调整，保持股票配置比例低于中枢水平。6月股票市场调整加剧，转债受退市和信用风险影响，资金面出现一定负反馈，风险释放过程中可能存在超调带来的投资机会，同时产品打开赎回，组合快速调整以应对负债端变化，在控制整体风险预算不超限的情况下，组合在月底小幅增加权益和转债资产配置。

结构配置层面，目前权益资产部分保持超配价值风格，但在细分策略层面，主要提升价值质量策略比例。新“国九条”出台后，对于资本市场未来发展方向有较强指引作用，长期对于质量、公司治理、资本配置关注度提升，因此组合二季度在市场反弹后主要减仓了小盘风格基金，并提升了对质量因子的暴露。行业层面表现为超配周期、稳定板块，低配消费、医药板块，上半年主要增加制造板块配置，主要是考虑全球产业周期以及国内新旧动能换挡背景下，对于新质生产力中“商业模式+竞争格局”较好的板块关注度提升，因此小幅增加了科技制造板块选股能力较强的基金经理管理的基金产品。

债券方面，基本面向上弹性不足，债券策略胜率维持，但汇率制约下赔率空间难以打开，因此组合维持配置交易能力较强的纯债基金，右侧跟踪资金面及关键宏观变量变化。6月中旬开始，转债受退市和信用风险影响加速调整，部分品种估值性价比大幅提升，考虑到当前债券利率处于历史低位，配置转债机会成本较低，组合在控制整体风险预算不超限的情况下，将少量纯债基金调整为可投转债的一级债基。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 类基金份额净值为 1.0274 元，本报告期份额净值增长率为 2.31%，同期业绩比较基准收益率为 3.38%；C 类基金份额净值为 1.0258 元，本报告期份额净值增长率为 2.16%，同期业绩比较基准收益率为 3.38%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，我国经济的主要拉动力或将有所转变，当前出口是我国经济的一大亮点，而外部经贸环境的不确定性也在不断提升，美国经济开始出现衰退迹象，而即将到来的美国大选也加剧了贸易政策的不确定性。如果出口退坡则更加需要依靠内需，从近期召开的中共中央政治局会议，我们可以看到稳增长政策加码的迹象，会议准确指出当前经济形势中的若干问题，同时对下半年稳增长政策赋予更大空间，不仅是已确定政策的加快、全面落实，还要“及早储备并适时推出一批增量政策举措”。此外，党的二十届三中全会为我国中长期的改革指明了方向，其中包含 300 多项重要改革举措，后续随着条件成熟的改革措施落地，或对稳定市场中长期信心发挥作用。

目前市场在不断定价基本面的短期边际走弱和长期向上弹性不足，这一背景下，高确定性的债券和高质量红利资产仍可作为底仓配置，但随着市场悲观预期的逐步定价，政策或者数据上边际的正向变化都可能带来情绪反转。具体策略层面，权益资产具有较高的配置价值，结构方面在红利的基础上，可考虑叠加超跌板块中胜率提升的方向；债券保持中性略高久期基础上关注市场资金面边际变化，尽量提升右侧操作效率。此外，下半年，美联储有望进入降息周期，海外债券在较高赔率基础上胜率有所提升，关注美债配置价值。

组合将继续保持基于“投资性价比”和“风险预算”进行配置的策略，以获取确定性收益为首要投资目标，在控制组合整体风险的情况下，对收益增强确定性较高的方向进行配置，通过 FOF 产品“多资产、多策略”的特点平抑波动，降低组合脆弱性，努力实现在预期风险水平下更有竞争力的收益水平。

本基金是一只定位中低风险的稳健型 FOF 产品，在组合管理过程中会更多关注投资者的获得感，力争在控制组合下行风险的基础上为投资者获得稳定的投资回报，也由衷感谢广大投资者的理解和信任。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，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要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

易方达如意安诚六个月持有混合（FOF）A:本报告期内未实施利润分配。

易方达如意安诚六个月持有混合（FOF）C:本报告期内未实施利润分配。

#### 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

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

### § 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—易方达基金管理有限公司 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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，易方达基金管理有限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，易方达基金管理有限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：易方达如意安诚六个月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	17,284,223.43	4,227,840.97
结算备付金		-	-
存出保证金		829.23	-
交易性金融资产	6.4.7.2	45,106,369.06	210,952,351.39
其中：股票投资		-	-
基金投资		43,081,000.19	202,307,348.65
债券投资		2,025,368.87	8,645,002.74
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	-	-
应收清算款		3,851,709.62	-
应收股利		0.41	2,157.47
应收申购款		5,426.50	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		66,248,558.25	215,182,349.83
<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		-	-
应付赎回款		20,247,286.47	-
应付管理人报酬		6,597.81	15,530.84
应付托管费		17,308.40	7,864.54
应付销售服务费		16,812.36	7,164.56
应付投资顾问费		-	-

应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	87,540.40	-
负债合计		20,375,545.44	30,559.94
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	44,700,668.55	214,262,051.77
未分配利润	6.4.7.8	1,172,344.26	889,738.12
净资产合计		45,873,012.81	215,151,789.89
负债和净资产总计		66,248,558.25	215,182,349.83

注：1.本基金合同生效日为 2023 年 12 月 21 日，2023 年度实际报告期间为 2023 年 12 月 21 日至 2023 年 12 月 31 日。

2.报告截止日 2024 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.0274 元，C 类基金份额净值 1.0258 元；基金份额总额 44,700,668.55 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 12,686,761.63 份，C 类基金份额总额 32,013,906.92 份。

## 6.2 利润表

会计主体：易方达如意安诚六个月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
<b>一、营业总收入</b>		6,224,031.51
1.利息收入		33,393.10
其中：存款利息收入	6.4.7.9	33,170.70
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		222.40
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		6,199,561.36
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-
基金投资收益	6.4.7.11	4,900,368.02
债券投资收益	6.4.7.12	97,044.45
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	1,202,148.89
其他投资收益		-



3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-127,473.39
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	118,550.44
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>399,705.63</b>
1. 管理人报酬		48,386.44
2. 托管费		135,469.58
3. 销售服务费		127,484.01
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	6.4.7.19	-
7. 税金及附加		123.35
8. 其他费用	6.4.7.20	88,242.25
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>5,824,325.88</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>5,824,325.88</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>5,824,325.88</b>

注：本基金合同生效日为 2023 年 12 月 21 日，截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

### 6.3 净资产变动表

会计主体：易方达如意安诚六个月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	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	214,262,051.77	889,738.12	215,151,789.89
二、本期期初净资产	214,262,051.77	889,738.12	215,151,789.89
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-169,561,383.22	282,606.14	-169,278,777.08
（一）、综合收益总额	-	5,824,325.88	5,824,325.88

（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）	-169,561,383.22	-5,541,719.74	-175,103,102.96
其中：1.基金申购款	755,315.58	22,754.54	778,070.12
2.基金赎回款	-170,316,698.80	-5,564,474.28	-175,881,173.08
（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	44,700,668.55	1,172,344.26	45,873,012.81

注：本基金合同生效日为 2023 年 12 月 21 日，截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

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：

基金管理人负责人：刘晓艳，主管会计工作负责人：陈荣，会计机构负责人：王永铿

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

易方达如意安诚六个月持有期混合型证券投资基金（FOF）（以下简称“本基金”）根据中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2023]723 号《关于准予易方达如意安诚六个月持有期混合型证券投资基金（FOF）注册的批复》进行募集，由易方达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《易方达如意安诚六个月持有期混合型证券投资基金（FOF）基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达如意安诚六个月持有期混合型证券投资基金（FOF）基金合同》于 2023 年 12 月 21 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 214,262,051.77 份基金份额，其中认购资金利息折合 144,190.70 份基金份额。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、

中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、本基金合同和财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 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本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

##### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

##### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

##### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

#### 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

#### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### (3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

#### 6.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑在资产负债表日无须付出不必要的额外成本和努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二

阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金(1)具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且(2)交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。对于曾经实施份额拆分或折算的基金，由于基金份额拆分或折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日或基金份额折算日根据拆分前或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。对于已开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司(以下简称“证金公司”)出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息，以及出借证券发生除送股、转增股份外

其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为当期损益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1)在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2)本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为对应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3)基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4)本基金各基金份额类别在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同。同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

(5)在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可调整基金收益的分配原则和支付方式，不需召开基金份额持有人大会审议；

(6)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国证券投资基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资

流通受限股票估值指引(试行)》，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

(4) 对于基金投资，根据中基协发[2017]3号《关于发布〈基金中基金估值业务指引(试行)〉的通知》之附件《基金中基金估值业务指引(试行)》，采用如下方法估值：

(a) 对于交易型开放式指数基金、境内上市定期开放式基金及封闭式基金，按所投资基金估值日的收盘价估值；

(b) 对于境内上市开放式基金(LOF)及其他境内非货币市场基金，按所投资基金估值日的份额净值估值；

(c) 对于境内上市交易型货币市场基金，如所投资基金披露份额净值，则按所投资基金估值日的份额净值估值；如所投资基金披露万份(百份)收益，则按所投资基金前一估值日后至估值日期间(含节假日)的万份(百份)收益计提估值日基金收益；

(d) 对于境内非上市货币市场基金按所投资基金前一估值日后至估值日期间(含节假日)的万份收益计提估值日基金收益。

如遇所投资基金不公布基金份额净值、进行折算或拆分、估值日无交易等特殊情况，本基金根据以下原则进行估值：

(a) 以所投资基金的基金份额净值估值的，若所投资基金与基金中基金估值频率一致但未公布估值日基金份额净值，按其最近公布的基金份额净值为基础估值；

(b) 以所投资基金的收盘价估值的，若估值日无交易，且最近交易日后市场环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后市场环境发生了重大变化的，可使用最新的基金份额净值为基础或参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素调整最近交易市价，确定公允价值；

(c) 如果所投资基金前一估值日至估值日期间发生分红除权、折算或拆分，基金管理人应根据基金份额净值或收盘价、单位基金份额分红金额、折算拆分比例、持仓份额等因素合理确定公允价值。



#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《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》、财税[2015]101号《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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)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。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。

对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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2)对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，股票的股息、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。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 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。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 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	17,284,223.43
等于：本金	17,269,548.73
加：应计利息	14,674.70
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
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	-
合计	17,284,223.43

##### 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	-	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	2,000,295.81	22,448.87	2,025,368.87	2,624.19
交易所				

	市场				
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	2,000,295.81	22,448.87	2,025,368.87	2,624.19
资产支持证券		-	-	-	-
基金		42,305,719.02	-	43,081,000.19	775,281.17
其他		-	-	-	-
合计		44,306,014.83	22,448.87	45,106,369.06	777,905.36

**6.4.7.3 衍生金融资产/负债**

**6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额**

本基金本报告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**

本基金本报告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**

本基金本报告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**

本基金本报告期末无其他资产。

**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	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	87,540.40
合计	87,540.40

**6.4.7.7 实收基金**

易方达如意安诚六个月持有混合（FOF）A

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	127,214,298.10	127,214,298.10
本期申购	169,395.38	169,395.38
本期赎回（以“-”号填列）	-114,696,931.85	-114,696,931.85
本期末	12,686,761.63	12,686,761.63

## 易方达如意安诚六个月持有混合（FOF）C

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	87,047,753.67	87,047,753.67
本期申购	585,920.20	585,920.20
本期赎回（以“-”号填列）	-55,619,766.95	-55,619,766.95
本期末	32,013,906.92	32,013,906.92

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

## 6.4.7.8 未分配利润

## 易方达如意安诚六个月持有混合（FOF）A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-5,032.52	537,562.54	532,530.02
本期期初	-5,032.52	537,562.54	532,530.02
本期利润	2,718,858.31	921,804.98	3,640,663.29
本期基金份额交易产生的变动数	-1,922,394.38	-1,903,344.67	-3,825,739.05
其中：基金申购款	1,463.34	3,824.08	5,287.42
基金赎回款	-1,923,857.72	-1,907,168.75	-3,831,026.47
本期已分配利润	-	-	-
本期末	791,431.41	-443,977.15	347,454.26

## 易方达如意安诚六个月持有混合（FOF）C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-10,608.11	367,816.21	357,208.10
本期期初	-10,608.11	367,816.21	357,208.10
本期利润	3,232,940.96	-1,049,278.37	2,183,662.59
本期基金份额交易产生的变动数	-1,279,458.62	-436,522.07	-1,715,980.69
其中：基金申购款	4,693.88	12,773.24	17,467.12
基金赎回款	-1,284,152.50	-449,295.31	-1,733,447.81
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,942,874.23	-1,117,984.23	824,890.00

#### 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	33,062.45
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	102.65
其他	5.60
合计	33,170.70

#### 6.4.7.10 股票投资收益

本基金本报告期无股票投资收益。

#### 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	305,380,564.32
减：卖出/赎回基金成本总额	300,440,642.04
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	1,027.87
减：交易费用	38,526.39
基金投资收益	4,900,368.02

#### 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	72,637.64

债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	24,406.81
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	97,044.45

#### 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	8,421,681.96
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	8,277,124.19
减：应计利息总额	120,150.96
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	24,406.81

#### 6.4.7.13 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.15 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	-
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	1,202,148.89
合计	1,202,148.89

#### 6.4.7.16 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	-127,473.39
——股票投资	-
——债券投资	-6,665.81
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-120,807.58
——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	-127,473.39

#### 6.4.7.17 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	-
其他	118,550.44
合计	118,550.44

#### 6.4.7.18 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）	147,869.57
当期持有基金产生的应支付管理费 （元）	442,947.63
当期持有基金产生的应支付托管费 （元）	115,249.04

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

#### 6.4.7.19 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.20 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	29,179.54
信息披露费	58,360.86
证券出借违约金	-
银行汇划费	701.85

合计	88,242.25
----	-----------

注：本报告期内，基金管理人自主承担本基金的信息披露费 1,311.27 元、审计费 656.53 元。

#### 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，本基金无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作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

本报告期内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
易方达基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

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

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

###### 6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

##### 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
当期发生的基金应支付的管理费	48,386.44
其中：应支付销售机构的客户维护费	275,914.38
应支付基金管理人的净管理费	-227,527.94

注：1.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。本基金管理费按前一日基金资产净值扣除前一日所持有本基金管理人管理的其他基金公允价值后的余额（若为负数，则取0）的0.6%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值扣除前一日所持有的基金管理人管理的其他基金公允价值后的余额，若为负数，则 E 取 0

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，在月初 5 个工作日内按照与基金管理人协商一致的方式进行资金支付。若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付等，支付日期顺延。

2.对于基金中基金、ETF 联接基金等特殊类型的基金产品，由于基金管理人不得对基金财产中持有的自身管理的基金部分收取管理费，但客户维护费的收取标准并不调减，可能出现净管理费为负值的情况。

#### 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
当期发生的基金应支付的托管费	135,469.58

注：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。本基金托管费按前一日基金资产净值扣除前一日所持有基金托管人托管的其他基金公允价值后的余额（若为负数，则取0）的0.15%年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值扣除前一日所持有的基金托管人托管的其他基金公允价值后的余额，若为负数，则 E 取 0

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，在月初 5 个工作日内按照与基金管理人协商一致的方式进行资金支付。若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付等，支付日期顺延。

## 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达如意安诚六个月持有混合(FOF) A	易方达如意安诚六个月持有混合(FOF) C	合计
易方达基金管理有限公司	-	1.82	1.82
中国农业银行	-	98,364.84	98,364.84
合计	-	98,366.66	98,366.66

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.3%，按前一日 C 类基金资产净值的 0.3% 年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.3\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，在月初 5 个工作日内按照与基金管理人协商一致的方式进行资金支付。若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付等，支付日期顺延。

## 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

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场债券（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

本基金本报告期末未发生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。

## 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

本基金本报告期末未发生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。

## 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自有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人未运用自有资金投资本基金。

## 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

易方达如意安诚六个月持有混合（FOF）A

无。

#### 易方达如意安诚六个月持有混合（FOF）C

无。

#### 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	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行-活期存款	17,284,223.43	33,062.45

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国农业银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末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

报告期末（2024 年 6 月 30 日），本基金持有基金管理人易方达基金管理有限公司所管理的基金合计 39,221,137.98 元，占本基金资产净值的比例为 85.50%。

本报告期内，基金管理人自主承担本基金的信息披露费 1,311.27 元、审计费 656.53 元。

##### 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	
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）		32,670.29
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）		138,572.48
当期持有基金产生的应支付管理费（元）		421,592.99
当期持有基金产生的应支付托管费（元）		111,689.74
当期交易所交易基金产生的交易费（元）		35.82

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

根据相关法律法规及本基金合同的约定，基金管理人不得对基金中基金财产中持有的自身管理的基金部分收取基金中基金的管理费，基金托管人不得对基金中基金财产中持有的自身托管的基金部分收取基金中基金的托管费。基金管理人运用本基金财产申购自身管理的其他基金的（ETF 除外），应当通过直销渠道申购且不收取申购费、赎回费（按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并计入基金资产的赎回费用除外）、销售服务等销售费用，其中申购费、赎回费在实际申购、赎回时按上述规定执行，销售服务费由本基金管理人从被投资基金收取后返还至本基金基金资产。

#### 6.4.11 利润分配情况

##### 易方达如意安诚六个月持有混合（FOF）A

本报告期内未发生利润分配。

##### 易方达如意安诚六个月持有混合（FOF）C

本报告期内未发生利润分配。

#### 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

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有股票。

##### 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为 0，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为 0，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

本基金本报告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

本基金管理人按照“自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工”的思路，将风险控制嵌

入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。从投资决策的层次看，投资决策委员会、投资总监、基金投资部门总经理和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控，并根据其不同权限实施风险控制；从岗位职能的分工上看，基金经理、监察合规管理部门、集中交易部门、核算部以及投资风险管理部从不同角度、不同环节对投资的全过程实行风险监控和管理；从投资管理的流程看，已经形成了一套贯穿“事前的风险定位、事中的风险管理和事后的风险评估”的健全的风险监控体系。

本基金为混合型基金中基金（FOF），理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金、股票型基金中基金（FOF），高于债券型基金、债券型基金中基金（FOF）、货币市场基金和货币型基金中基金（FOF）。

本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港证券市场，除了需要承担市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、投资于香港证券市场的风险、以及通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险等特有风险。本基金通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险详见招募说明书。日常经营活动中本基金面临的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险，本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上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，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指包括债券发行人出现拒绝支付利息或到期时拒绝支付本息的违约风险，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下跌的风险，及因交易对手违约而产生的交割风险。本基金管理人建立了内部信用评级制度，通过严格的备选库制度和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，在银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险。本基金在场外申赎基金份额均通过该基金的基金管理人的直销柜台办理，同时基于内部评价系统对基金管理公司及其管理基金的评级，将投资于管理规范、业绩优良的基金管理公司管理的基金，因此，本基金违约风险可能性很小。

于 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 0.00%(2023 年 12 月 31 日：0.00%)。

##### 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	0.00	0.00

A-1 以下	0.00	0.00
未评级	2,025,368.87	8,645,002.74
合计	2,025,368.87	8,645,002.74

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的短期融资券。

3. 债券投资以全价列示。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债和央票。

3. 债券投资以全价列示。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	0.00	0.00

AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指包括因市场交易量不足，导致基金管理人不能以合理价格及时进行证券交易的风险，或投资组合无法应付客户赎回要求所引起的违约风险。本基金采用分散投资、控制流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时公司已经建立全覆盖、多维度以压力测试为核心的开放式基金流动性风险监测与预警制度，投资风险管理部独立于投资部门负责流动性压力测试的实施与评估。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。于 2024 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

##### 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按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金组合的流动性指标进行持续的监测和分析。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

本基金持有单只基金的市值，不高于本基金资产净值的 20%，且不持有其他基金中基金。本基金的基金管理人管理的全部基金中基金持有单只基金(ETF 联接基金除外)不超过被投资基金净资产的 20%，被投资基金净资产规模以最近定期报告披露的规模为准。本基金投资于一家公司发行的证券(不含本基金所投资的基金份额)市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的发行的证券(不含本基金所投资的基金份额)不超过该证券存量余额的 10%。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易/基金销售机构申购、赎回。

在本基金开放日，本基金投资于流通受限基金不高于本基金资产净值的 10%。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指因受各种因素影响而引起的基金所持证券及其衍生品市场价格不利波动，使基金资产面临损失的风险，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财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。投资管理人通过久期、凸度、VAR 等方法评估组合面临的利率风险敞口，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	17,284,223.43	-	-	-	17,284,223.43
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	829.23	-	-	-	829.23
交易性金融资产	2,025,368.87	-	-	43,081,000.19	45,106,369.06
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	3,851,709.62	3,851,709.62
应收股利	-	-	-	0.41	0.41
应收申购款	-	-	-	5,426.50	5,426.50
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-



资产总计	19,310,421.53	-	-	46,938,136.72	66,248,558.25
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	20,247,286.47	20,247,286.47
应付管理人报酬	-	-	-	6,597.81	6,597.81
应付托管费	-	-	-	17,308.40	17,308.40
应付销售服务费	-	-	-	16,812.36	16,812.36
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	87,540.40	87,540.40
负债总计	-	-	-	20,375,545.44	20,375,545.44
利率敏感度缺口	19,310,421.53	-	-	26,562,591.28	45,873,012.81
<b>上年度末</b>					
<b>2023 年 12 月 31 日</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
资产					
货币资金	4,227,840.97	-	-	-	4,227,840.97
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	8,645,002.74	-	-	202,307,348.65	210,952,351.39
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	2,157.47	2,157.47
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	12,872,843.71	-	-	202,309,506.12	215,182,349.88

					3
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	15,530.84	15,530.84
应付托管费	-	-	-	7,864.54	7,864.54
应付销售服务费	-	-	-	7,164.56	7,164.56
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-
负债总计	-	-	-	30,559.94	30,559.94
利率敏感度缺口	12,872,843.71	-	-	202,278,946.18	215,151,789.89

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 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	1,859.92	12,001.70
	2.市场利率上升25个基点	-1,856.40	-11,978.64

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 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基金、证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金的基金管理人采用 Barra 风险管

理系统，通过标准差、跟踪误差、beta 值、VAR 等指标，监控投资组合面临的市场价格波动风险。

#### 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	-	-	-	-
交易性金融资产—基金投资	43,081,000.19	93.91	202,307,348.65	94.03
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	43,081,000.19	93.91	202,307,348.65	94.03

#### 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%	2,424,032.43	1,830,942.82
	2.业绩比较基准下降 5%	-2,424,032.43	-1,830,942.82

#### 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
第一层次	43,081,000.19
第二层次	2,025,368.87
第三层次	-
合计	45,106,369.06

#### 6.4.14.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；对于定期开放的基金投资，本基金不会于封闭期将相关基金列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具的公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末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

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括银行存款、买入返售金融资产、其他各类应收款项、卖出回购金融资产款和其他各类应付款项，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 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重要事项。

## § 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	43,081,000.19	65.03
3	固定收益投资	2,025,368.87	3.06
	其中：债券	2,025,368.87	3.06

	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	17,284,223.43	26.09
8	其他各项资产	3,857,965.76	5.82
9	合计	66,248,558.25	100.00

## 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

本基金本报告期末未持有境内股票。

## 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

本基金本报告期末未持有股票。

## 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

本基金本报告期内未进行股票投资交易。

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

本基金本报告期内未进行股票投资交易。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未进行股票投资交易。

## 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	2,025,368.87	4.42

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	2,025,368.87	4.42

#### 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	019733	24 国债 02	12,000	1,212,876.82	2.64
2	019709	23 国债 16	8,000	812,492.05	1.77

#### 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

本基金本报告期末未投资股指期货。

## 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

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

## 7.12 本报告期投资基金情况

### 7.12.1 投资政策及风险说明

#### 1.投资政策：

本基金将秉承稳健的投资风格，严格控制投资组合风险，力争为投资者获得稳定的投资回报。本基金的主要投资策略包括资产配置策略、基金筛选策略、组合构建策略。本基金的长期资产配置将以固定收益类资产为主，在此基础上，基金管理人将通过定性分析和定量分析相结合的方式对未来市场环境进行预测和判断，确定基金资产在权益类资产和固定收益类资产间的分配比例，并随着各类资产风险收益特征的相对变化，动态调整组合中各类资产的配置比例。基金管理人针对全市场基金建立了统一的基金评价体系，根据评价体系的分析结果建立了可选基金池，本基金所投资的全部基金都应是可选基金池中的基金。基金管理人针对不同类型的基金将采用不同的评价方法。本基金将通过对短周期内的基金多因子分解，结合公开披露的信息估算拟投资基金的最新的资产配置比例和短期的风格定位，通过优化求解的方法，得到匹配资产配置比例的最优基金组合。在此基础上，基金管理人可以结合其他定性因素对组合进行调整，形成最终的投资组合。

#### 2.风险说明：

本基金投资于经中国证监会依法核准或注册基金的资产不低于基金资产的 80%，由此可能面临如下风险：

（1）被投资基金的业绩风险。本基金投资于经中国证监会依法核准或注册基金的资产不低于基金资产的 80%，因此本基金投资目标的实现建立在被投资基金本身投资目标实现的基础上。如果由于被投资基金未能实现投资目标，则本基金存在达不到投资目标的风险。

（2）赎回资金到账时间较晚的风险。基金赎回的资金交收效率慢于基础证券市场交易的证券，

因此本基金赎回款实际到达投资者账户的时间可能晚于普通境内开放式基金，存在对投资者资金安排造成影响的风险。

（3）双重收费风险。本基金的投资范围包含全市场基金，投资于非本基金管理人管理的其他基金时，存在本基金与被投资基金各类基金费用的双重收取情况，相较于其他基金产品存在额外增加投资者投资成本的风险。

（4）可上市交易基金的二级市场投资风险。本基金可通过二级市场进行 ETF、LOF、封闭式基金的买卖交易，由此可能面临交易量不足所引起的流动性风险、交易价格与基金份额净值之间的折溢价风险以及被投资基金暂停交易或退市的风险等。

（5）被投资基金的运作风险。具体包括基金投资风格漂移风险、基金经理变更风险、基金实际运作风险以及基金产品设计开发创新风险等。此外，封闭式基金到期转开放、基金清算、基金合并等事件也会带来风险。虽然本基金管理人将会从基金风格、投资能力、管理团队、实际运作情况等多方面精选基金投资品种，但无法完全规避基金运作风险。

（6）被投资基金的基金管理人经营风险。基金的投资业绩会受到基金管理人的经营状况的影响。如基金管理人面临的管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争、人员素质等因素的变化均会导致基金投资业绩的波动。虽然本基金可以通过投资多样化分散这种非系统风险，但不能完全规避。特别地，在本基金投资策略的实施过程中，可将基金资产部分或全部投资于本基金管理人管理的其他基金，在这种情况下，本基金将无法通过投资多样化来分散这种非系统性风险。

（7）被投资基金的相关政策风险。本基金主要投资于各类其他基金，如遇国家金融政策发生重大调整，导致被投资基金的基金管理人、基金投资操作、基金运作方式发生较大变化，可能影响本基金的收益水平。

（8）可能较大比例投资于基金管理人旗下基金所面临的风险。基金的投资业绩会受到基金管理人的经营状况的影响，如基金管理人的管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争、人员素质等因素的变化均会导致基金投资业绩的波动。本基金的投资范围涵盖全市场的基金品种，基金管理人将采用客观、公平的评价方法进行标的池的构建以及可投资基金的筛选，本基金基金管理人所管理的基金一并纳入上述评价体系。在上述过程中，出于基金业绩、费率水平等因素，可能出现本基金基金管理人旗下基金的评分整体较高，本基金可能较大比例投资于本基金基金管理人旗下基金的情况，当本基金基金管理人发生经营风险时，本基金的投资业绩将受到较大影响。本基金基金管理人承诺按照法规及基金合同规定的方式和条件进行投资，公平对待基金财产，基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为认可此等关联交易情形的存在并自愿承担相关投资风险。

#### 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)	占资金资产 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	001433	易方达瑞 景混合	契约型开 放式	2,403,751. 73	4,043,110. 41	8.81	是
2	017420	易方达裕 祥回报债 券 C	契约型开 放式	2,350,207. 21	3,779,133. 19	8.24	是
3	017156	易方达岁 丰添利债 券(LOF)C	契约型开 放式	2,198,594. 36	3,613,829. 55	7.88	是
4	001818	易方达瑞 兴混合 E	契约型开 放式	2,505,267. 55	3,547,458. 85	7.73	是
5	001836	易方达瑞 祥混合 E	契约型开 放式	2,385,996. 72	3,512,187. 17	7.66	是
6	000148	易方达高 等级信用 债债券 C	契约型开 放式	2,649,587. 92	3,092,599. 02	6.74	是
7	110036	易方达双 债增强债 券 C	契约型开 放式	1,807,156. 97	3,028,795. 08	6.60	是
8	020083	易方达投 资级信用 债债券 D	契约型开 放式	2,334,458. 57	2,752,326. 65	6.00	是
9	005099	易方达富 华纯债债 券 A	契约型开 放式	2,070,041. 78	2,131,729. 03	4.65	是
10	016479	易方达裕 丰回报债 券 C	契约型开 放式	1,228,102. 22	2,114,792. 02	4.61	是
11	019606	易方达富 惠纯债债 券 D	契约型开 放式	1,580,061. 39	1,643,105. 84	3.58	是
12	110008	易方达稳 健收益债 券 B	契约型开 放式	1,083,889. 64	1,464,226. 51	3.19	是
13	001832	易方达瑞 恒混合	契约型开 放式	389,809.7 7	965,168.9 9	2.10	是
14	011301	易方达智 造优势混 合 C	契约型开 放式	974,550.4 9	858,384.0 7	1.87	是
15	110009	易方达价	契约型开	749,096.6	811,646.2	1.77	是

		值精选混合	放式	9	6		
16	018413	大成竞争优势混合 C	契约型开放式	516,349.86	787,846.62	1.72	否
17	006533	易方达科融混合	契约型开放式	307,224.47	785,204.30	1.71	是
18	015779	景顺长城价值边际灵活配置混合 C	契约型开放式	487,884.71	783,445.27	1.71	否
19	011066	大成高新技术产业股票 C	契约型开放式	173,338.71	702,507.12	1.53	否
20	017167	景顺长城策略精选灵活配置混合 C	契约型开放式	192,056.82	529,116.54	1.15	否
21	014597	华泰柏瑞富利混合 C	契约型开放式	244,808.62	490,131.34	1.07	否
22	519772	交银新生活力灵活配置混合	契约型开放式	222,510.15	444,130.26	0.97	否
23	002910	易方达供给改革混合	契约型开放式	152,579.79	342,328.02	0.75	是
24	001076	易方达改革红利混合	契约型开放式	186,194.95	291,767.49	0.64	是
25	001898	易方达大健康主题混合	契约型开放式	138,597.36	241,852.39	0.53	是
26	019020	易方达医疗保健行业混合 C	契约型开放式	66,980.40	199,400.65	0.43	是
27	018454	大成互联网思维混合 C	契约型开放式	80,692.62	122,685.06	0.27	否
28	000621	易方达现金增利货币 B	契约型开放式	2,092.49	2,092.49	0.00	是

注：由于本基金可投资 QDII 基金且部分 QDII 基金 T 日的基金份额净值在 T+2 个工作日内公告，一般情况下，本基金 T 日的基金份额净值和基金份额累计净值在 T+3 个工作日内公告(T 日为估值日)。

### 7.13 投资组合报告附注

**7.13.1** 基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期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。

**7.13.2** 本基金本报告期没有投资股票，因此不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况。

#### 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	829.23
2	应收清算款	3,851,709.62
3	应收股利	0.41
4	应收利息	-
5	应收申购款	5,426.50
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,857,965.76

#### 7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

## § 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	持有份额	占总份

				额比例		额比例
易方达如意安诚 六个月持有混合 (FOF) A	196	64,728.38	497,405.36	3.92%	12,189,356.27	96.08%
易方达如意安诚 六个月持有混合 (FOF) C	549	58,313.13	140,126.00	0.44%	31,873,780.92	99.56%
合计	745	60,000.90	637,531.36	1.43%	44,063,137.19	98.57%

## 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	易方达如意安诚六个月 持有混合（FOF）A	301,093.77	2.3733%
	易方达如意安诚六个月 持有混合（FOF）C	811,156.87	2.5338%
	合计	1,112,250.64	2.4882%

## 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	易方达如意安诚六个月 持有混合（FOF）A	0
	易方达如意安诚六个月 持有混合（FOF）C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开 放式基金	易方达如意安诚六个月 持有混合（FOF）A	0
	易方达如意安诚六个月 持有混合（FOF）C	0
	合计	0

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达如意安诚六个月持有混 合（FOF）A	易方达如意安诚六个月持有混 合（FOF）C
基金合同生效日（2023 年 12 月 21	127,214,298.10	87,047,753.67

日) 基金份额总额		
本报告期期初基金份额总额	127,214,298.10	87,047,753.67
本报告期基金总申购份额	169,395.38	585,920.20
减: 本报告期基金总赎回份额	114,696,931.85	55,619,766.95
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	12,686,761.63	32,013,906.92

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开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

本报告期内本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内本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

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

### 10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本基金持有的基金在报告期未发生重大影响事件。

### 10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

### 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

本报告期，基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

#### 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，基金托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到稽查或处罚。

### 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	
长江证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内新增交易单元的证券公司为长江证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司。

b) 本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。本报告期内基金交易单元的选择标准如下：

- 1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- 2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- 3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

c) 基金交易单元的选择程序如下：

- 1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
- 2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

#### 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

长江证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	10,005,44 1.00	100.00 %	3,247,000. 00	100.00 %	-	-	895,670.6 0	100.00%

## 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	易方达如意安诚六个月持有期混合型证券投资基金（FOF）开放日常申购和定期定额投资业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-03-18
2	易方达基金管理有限公司旗下基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告	中国证券报	2024-04-20
3	易方达基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-04-23
4	易方达如意安诚六个月持有期混合型证券投资基金（FOF）开放日常赎回业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-06-08

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 影响投资者决策的其他重要信息

自 2024 年 6 月 27 日至 2024 年 6 月 30 日，基金管理人自主承担本基金的信息披露费、审计费等固定费用。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予易方达如意安诚六个月持有期混合型证券投资基金（FOF）注册的文件；
2. 《易方达如意安诚六个月持有期混合型证券投资基金（FOF）基金合同》；
3. 《易方达如意安诚六个月持有期混合型证券投资基金（FOF）托管协议》；
4. 《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照。

## 12.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

## 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇二四年八月三十日