

易方达如意安泰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：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 | 7 |
| § 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 | 8 |
| § 4 管理人报告 | 10 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 10 |
| 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 | 13 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 15 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 15 |
| 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 | 15 |
| § 5 托管人报告 | 15 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 15 |
| 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 | 16 |
| 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 | 16 |
| § 6 半年度财务会计报告（未经审计） | 16 |
| 6.1 资产负债表 | 16 |
| 6.2 利润表 | 17 |
| 6.3 净资产变动表 | 19 |
| 6.4 报表附注 | 20 |
| § 7 投资组合报告 | 41 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 41 |
| 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 | 42 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 42 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 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 | 43 |
| 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 | 43 |
| 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 | 43 |
| 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 | 43 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 | 44 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 44 |

| | | |
|------|------------------------------|----|
| 7.12 | 本报告期投资基金情况 | 44 |
| 7.13 | 投资组合报告附注 | 48 |
| § 8 | 基金份额持有人信息 | 49 |
| 8.1 | 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 49 |
| 8.2 | 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 50 |
| 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 | 50 |
| § 9 | 开放式基金份额变动 | 50 |
| § 10 | 重大事件揭示 | 50 |
| 10.1 | 基金份额持有人大会决议 | 50 |
| 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 | 51 |
| 10.3 | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 51 |
| 10.4 | 基金投资策略的改变 | 51 |
| 10.5 | 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 | 51 |
| 10.6 | 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 51 |
| 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 | 51 |
| 10.8 | 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 51 |
| 10.9 | 其他重大事件 | 52 |
| § 11 | 备查文件目录 | 53 |
| 11.1 | 备查文件目录 | 53 |
| 11.2 | 存放地点 | 53 |
| 11.3 | 查阅方式 | 53 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|---------------------------|---------------------|
| 基金名称 | 易方达如意安泰一年持有期混合型基金中基金（FOF） | |
| 基金简称 | 易方达如意安泰一年持有混合（FOF） | |
| 基金主代码 | 009213 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2020 年 8 月 14 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 | 836,571,722.89 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 易方达如意安泰一年持有混合（FOF）A | 易方达如意安泰一年持有混合（FOF）C |
| 下属分级基金的交易代码 | 009213 | 009214 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 162,504,014.26 份 | 674,067,708.63 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策略，在控制整体下行风险的前提下，力争实现基金资产的持续稳健增值。 |
| 投资策略 | <p>1、资产配置策略</p> <p>基于获取持续稳健的投资收益的目标，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、固定收益类资产和商品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。</p> <p>2、基金投资策略</p> <p>对于债券型基金，基金管理人将通过归因分析拆解拟投资基金的组合收益来源，明确基金在久期、信用和杠杆各个部分的收益贡献。之后，将基于自身对组合久期和期限结构的判断，结合债券各类属资产的配置策略，确定具体的投资对象及其投资比例。对于含权债券型基金，基金管理人将同样运用归因分析方法评估其在权益资产配置、择时及选股方面的能力，从而确定其在组合收益增强方面的效果，对于表现持续优异稳定的基金也将进行配置。</p> <p>对于混合型基金，基金管理人将着重考察拟投资基金获取绝对收益的能力。在分析方法上，与含权债券型基金的方法类似，即运用归因分析方法评估其在权益资产配置、择时及选股能力、固定收益资产配置、信用及杠杆水平等各个部分的收益贡献，选择能够持续获取稳定收益、风格稳定、逻辑自洽的标的进行配置。</p> <p>对于股票型基金，基金管理人将按照细分类型将股票型基金划分为主动型</p> |

| | |
|--------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| | 股票基金及被动型股票基金。对于主动型股票基金，基金管理人将结合公开披露的数据，利用基金定量评价体系对基金的投资业绩、基金经理的投资行为、基金经理的投资逻辑三个方面进行评估，得到量化评价结果，选择评分较高的基金进行配置。对于被动型股票基金，本基金将综合考虑市场代表性、运作时间、基金规模、流动性、跟踪误差以及费率水平等指标，选择适合的标的进行配置。 |
| 业绩比较基准 | 中债新综合指数（财富）收益率×90%+沪深 300 指数收益率×10% |
| 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，除了需要承担与境内证券投资基金类似的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。 |

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 | 证券时报 |
| 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） | |
|---------------|--------------------------------------|---------------------|
| | 易方达如意安泰一年持有混合（FOF）A | 易方达如意安泰一年持有混合（FOF）C |
| 本期已实现收益 | 1,940,678.85 | 6,716,999.74 |
| 本期利润 | 5,689,679.15 | 21,455,416.99 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0323 | 0.0296 |
| 本期加权平均净值利润率 | 2.89% | 2.68% |
| 本期基金份额净值增长率 | 2.91% | 2.75% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2024 年 6 月 30 日) | |
| | 易方达如意安泰一年持有混合（FOF）A | 易方达如意安泰一年持有混合（FOF）C |
| 期末可供分配利润 | 13,551,522.40 | 47,648,285.37 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0834 | 0.0707 |
| 期末基金资产净值 | 183,500,099.90 | 752,427,347.66 |
| 期末基金份额净值 | 1.1292 | 1.1162 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2024 年 6 月 30 日) | |
| | 易方达如意安泰一年持有混合（FOF）A | 易方达如意安泰一年持有混合（FOF）C |
| 基金份额累计净值增长率 | 12.92% | 11.62% |

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

易方达如意安泰一年持有混合（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 | -0.31% | 0.12% | 0.44% | 0.05% | -0.75% | 0.07% |
| 过去三个月 | 1.26% | 0.12% | 1.36% | 0.08% | -0.10% | 0.04% |
| 过去六个月 | 2.91% | 0.15% | 3.51% | 0.09% | -0.60% | 0.06% |
| 过去一年 | 3.17% | 0.13% | 4.31% | 0.09% | -1.14% | 0.04% |
| 过去三年 | 7.72% | 0.12% | 9.70% | 0.11% | -1.98% | 0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 12.92% | 0.13% | 14.29% | 0.11% | -1.37% | 0.02% |

易方达如意安泰一年持有混合（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 | -0.34% | 0.12% | 0.44% | 0.05% | -0.78% | 0.07% |
| 过去三个月 | 1.19% | 0.12% | 1.36% | 0.08% | -0.17% | 0.04% |
| 过去六个月 | 2.75% | 0.15% | 3.51% | 0.09% | -0.76% | 0.06% |
| 过去一年 | 2.86% | 0.13% | 4.31% | 0.09% | -1.45% | 0.04% |
| 过去三年 | 6.75% | 0.12% | 9.70% | 0.11% | -2.95% | 0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 11.62% | 0.13% | 14.29% | 0.11% | -2.67% | 0.02% |

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

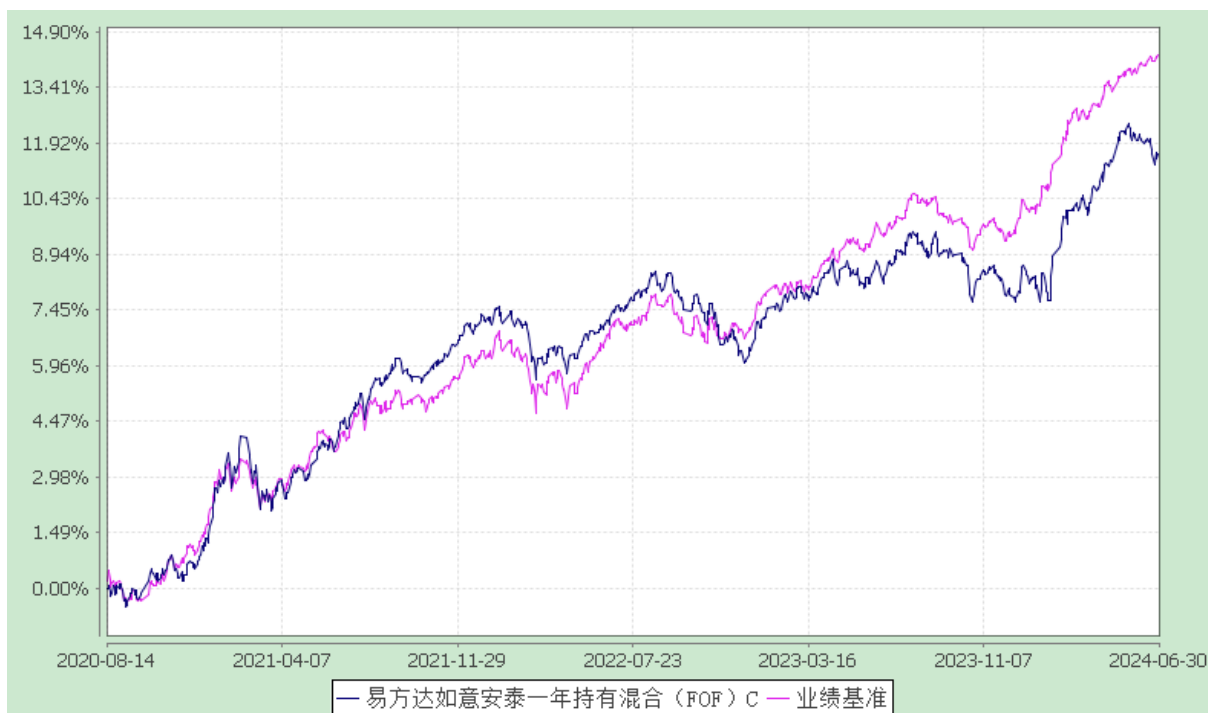
易方达如意安泰一年持有期混合型基金中基金（FOF）
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2020 年 8 月 14 日至 2024 年 6 月 30 日）

易方达如意安泰一年持有混合（FOF）A



易方达如意安泰一年持有混合（FOF）C



注：自基金合同生效至报告期末，A 类基金份额净值增长率为 12.92%，同期业绩比较基准收益率为 14.29%；C 类基金份额净值增长率为 11.62%，同期业绩比较基准收益率为 14.29%。

§ 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 | | |
| 张浩然 | 本基金的基金经理，易方达优选多资产三个月持有混合（FOF）、易方达优势价值一年持有混合（FOF）、易方达优势领航六个月持有混合（FOF）、易方达优势回报混合（FOF-LOF）（自 2022 年 03 月 23 日至 2024 年 01 月 10 日）、易方达优势长兴三个月持有混合（FOF）、易方达优势驱动一年持有混合（FOF）、易方达汇康稳健养老一年持有混合（FOF）、易方达如意招享混合（FOF-LOF）、易方达优选星汇六个月持有混合（FOF）、易方达稳健腾享六个月持有混合（FOF）的基金经理，FOF 投资部总经理助理 | 2020-08-14 | - | 9 年 | 硕士研究生，具有基金从业资格。曾任中国人寿资产管理有限公司基金投资部助理研究员，易方达基金管理有限公司研究员、投资经理、基金经理助理。 |
| 张振琪 | 本基金的基金经理，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）、易方达如意安诚六个月持有混合（FOF）、易方达汇享稳健养老一年持有混合（FOF）的基金经理 | 2021-12-22 | - | 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，全球股市呈现普涨的状态，MSCI 全球指数上涨 10.3%。A 股市场延续弱势。上证综指小幅下跌，中证全指下跌超 8%，录得过去 20 年时间最长的持续回撤。市场风格持续分化，

代表大市值的沪深 300 小幅上涨而代表中小市值的中证 500 和中证 1000 跌幅明显。经济复苏偏弱，市场情绪较差，资金不断涌入相对抗跌的红利类资产，包括银行、煤炭、石油石化、家电、电力及公用事业等行业；债券资产也获得资金青睐，十年期国债收益率从 2.5% 上方一路下行至 2.2% 附近；此外出海、资源品涨价、人工智能也都迎来一波表现，而机构偏好的电力设备及新能源、食品饮料、医药则继续被抛售。

股市是经济的晴雨表，股市的表现往往是现实的映射。市场表现的背后存在现实中的逻辑支持：

1、美联储降息时点渐近，海外主要国家逐个进入降息周期，带动了全球风险资产的上涨；2、全球制造业进入复苏周期，设备投资需求旺盛，我国出口增速维持高位，出海板块的业绩存在支撑；3、中国经济逐步复苏，阶段性高增长的机会相对稀缺，红利板块稳定的业绩增长和持续的分红相对吸引力提升；4、人工智能产业趋势持续，算力需求旺盛，且逐步迎来扩散，无人驾驶、人形机器人进入大众视野。

以偏股基金指数和中证 800 全收益指数的相对收益率衡量主动基金的超额收益，主动基金连续三年跑输被动指数，超额收益回撤幅度接近了 2008 年以来的最大值。这一现象背后的原因依旧是风格分化，主动权益基金历史上超配质量、成长风格，而对于价值、红利风格整体低配。

本基金在 2024 年上半年秉承稳健的投资风格，结合市场环境灵活运用多种投资策略，通过对货币市场基金、债券型基金、混合型基金的分散化配置，为投资者严格控制投资组合的下行风险。

在资产配置层面，本基金基于回撤水平和市场的风险水平对仓位进行灵活调整，上半年基本在回撤可控的基础上，维持了权益资产的配置比例，在转债资产性价比较高的时期阶段性增加了转债基金的配置。

在货币基金、债券基金的遴选上，本基金通过归因分析拆解拟投资基金的组合收益来源，明确基金在久期、信用和杠杆各个部分的收益贡献进行评估，在考虑了基金费用水平后，选择以基金管理人旗下基金为主的投资策略。

在含权债券型基金的遴选上，本基金运用归因分析方法评估其在权益资产配置、择时及选股方面的能力，在考虑了基金费用水平后，选择以基金管理人旗下基金为主，以全市场投资风格存在差异，能够形成较好互补的基金为辅的投资策略。本期增加了部分含权债券型基金的配置比例。

在低风险的混合型基金的遴选上，本基金重点选择了权益仓位较低（30% 以下），投资策略包含打新策略的基金品种，在较高收益风险比的基础上，为投资者获取确定性较高的打新收益增强；在考虑了基金费用水平和策略容量后，本基金选择了基金管理人旗下的打新策略基金。本期降低了部分打新策略基金的配置比例。

在高风险的混合型基金的股票型基金的遴选上，本基金在全市场范围内重点选择了重视估值水

平、潜在回撤水平较低的深度价值风格基金品种，适度配置了长期价值、价值成长、均衡成长、积极成长等多元风格的基金，希望在控制风险的基础上获取股票市场的长期收益。本期增加了内部基金的配置比例。

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 1.1292 元，本报告期份额净值增长率为 2.91%，同期业绩比较基准收益率为 3.51%；C 类基金份额净值为 1.1162 元，本报告期份额净值增长率为 2.75%，同期业绩比较基准收益率为 3.51%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在去年年报中，我们和投资人讨论了股票市场长期回报和人均 GDP（国内生产总值）增长之间的关系，提出了长期来看对于投资回报的影响，最重要的是上市公司对于股东的净回购水平，包括回购、分红水平；其次是进入市场时的估值水平。

因此提示投资者，不必因为对于经济增长水平的担忧便盲目悲观，更何况这种担忧很可能是短期的。更应该注意到：1、当前 A 股和港股的估值水平处于历史极低的位置；2、越来越多的上市公司开始关注投资者回报，开始增加回购和分红的数量；尽管当前投资体验感较差，但是较低的市场估值和可能提升的回购和股息水平，提供了潜在的长期回报。

因此，我们对于长期中国权益资产的表现并不悲观，更关注其中的投资机会。

在今年上半年，我们观察到了风格进一步的极致分化，主动基金相对被动指数的超额回撤达到历史极值附近、红利风格的电力龙头股息率已经下降至质量风格的白酒龙头的股息率水平。在这样的背景下，我们对于不同风格的思考如下：

1、红利：避险属性下降，周期属性上升

当下红利指数的前三大行业为银行、煤炭和交通运输。其中主要包括了两类红利公司，一类是以水电行业为代表的稳定分红的公司，其分红水平较为稳定；一类是类似于煤炭行业的周期分红的公司，其分红水平受到经济周期、产业周期波动的影响。

稳定分红类公司过去 3 年持续跑赢市场，股息率已经下降到了较低位置，当前支持其估值的十年期国债收益率也快速下降到了历史低位，一旦经济复苏，国债收益率反转上行，稳定分红的分红吸引力将快速下降。

周期分红类公司的分红水平受到经济周期的影响，由于其中资源行业占比较高，在美国继续刺激经济、带动全球需求，也引发全球通胀、资源品涨价的背景下，过去几年的利润、分红水平均位于高位。在资源品价格已经在高位的背景下，分红的持续性可能会受到影响。

整体而言，红利风格一方面整体股息率有所降低，另一方面股息率背后的质量有所下降，投资者应当对于红利风格更加谨慎。

2、质量：分红提升的潜力

当下质量指数的前三大行业为食品饮料、医药生物和电力设备，具备较高的 ROE（净资产收益率）水平。理论上当前政策鼓励分红的利好的是高质量风格。因为红利风格已经维持较高的分红水平，能够继续提升的空间很小；而质量风格高 ROE 代表较强的赚钱水平，也代表能够分红的空间较大。

因此如果是希望获得红利进行投资，当下反而应该淡化红利风格，更应该关注质量风格。

但是，高 ROE 并不一定代表着高分红，期间有两个前提假设：一是当前的高 ROE 能够持续，二是上市公司能够合理地分配利润，将到手的利润以股息或者回购的方式回馈股东。因此需要警惕在当前经济环境下 ROE 不断降低的行业，例如内生需求不足对于高端消费潜在的影响，也要警惕不愿意分红的“铁公鸡”，在质量风格中寻找超额收益的机会。

3、成长：稀缺的高增长的机会

在经济增速缓慢下台阶，转向高质量增长的阶段，高增长的机会会愈加稀缺，但是对于经济也更加重要，因此政策会以更大的力度给予支持，当下的“新质生产力”便是这一特征的体现。

高增长的机会来源于从 0 到 1 的创新，无论是人工智能、人形机器人、低空经济、创新药等等都是如此。但是也应该注意到，从 0 到 1 的调整对于企业通常是九死一生，难度较高，而一旦失败在当前的制度下可能面临小市值的退市风险。

有一部分公司主营业务稳健增长，处于渗透率提升、尚不足 30% 的成长阶段，同时还能够受益于新技术的进步，相当于享有爆发性增长的期权。新质生产力的发展要求正在持续驱动新技术的进步，这一类机会在当下应该重点关注。

综上所述，当下买红利本质是在买周期；当下买质量本质在买未来的红利；当下买成长，本质是在买稀缺的高增长的机会。

结合以上认知，本基金对于红利风格的基金会维持低配，仅考虑持有全球定价的资源行业、有分红能力的央国企的基金；对于质量风格的基金维持平配，尽可能地规避 ROE 下行的风险，关注潜在提升分红的逻辑；对于成长风格的基金维持高配，寻找持有主营业务稳健增长同时享有新质生产力期权的公司的基金，包括汽车、医药、互联网等行业。

对于债券型基金，在对于经济不悲观的假设下，认为利率进一步下行的空间有限；而在不对经济复苏做强假设的背景下，利率上行空间也不是很大。2024 年下半年仍主要将以获取票息的思路看待债券型基金的投资。

本基金重视投资组合的风险管理，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

易方达如意安泰一年持有混合(FOF)A:本报告期内未实施利润分配。

易方达如意安泰一年持有混合(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合规守信、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：易方达如意安泰一年持有期混合型证券投资基金（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 |
|------------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资产： | | | |
| 货币资金 | 6.4.7.1 | 15,875,806.51 | 24,606,948.75 |
| 结算备付金 | | - | - |
| 存出保证金 | | 1,792.66 | 2,447.91 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 921,028,915.81 | 1,093,369,157.95 |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | 878,806,978.13 | 1,049,772,000.14 |
| 债券投资 | | 42,221,937.68 | 43,597,157.81 |
| 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 | | 5,690,862.36 | 3,335,814.36 |
| 应收股利 | | - | 0.70 |
| 应收申购款 | | 342,276.12 | 134,339.59 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.5 | - | - |
| 资产总计 | | 942,939,653.46 | 1,121,448,709.26 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2024 年 6 月 30 日 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
| 负债： | | | |
| 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 | | 6,571,951.10 | 10,343,049.45 |
| 应付管理人报酬 | | 60,165.09 | 76,857.74 |
| 应付托管费 | | 102,920.25 | 104,390.89 |
| 应付销售服务费 | | 187,661.86 | 231,908.69 |
| 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 | 89,507.60 | 180,000.00 |
| 负债合计 | | 7,012,205.90 | 10,936,206.77 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.7 | 836,571,722.89 | 1,020,288,353.21 |
| 未分配利润 | 6.4.7.8 | 99,355,724.67 | 90,224,149.28 |
| 净资产合计 | | 935,927,447.56 | 1,110,512,502.49 |
| 负债和净资产总计 | | 942,939,653.46 | 1,121,448,709.26 |

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.1292 元，C 类基金份额净值 1.1162 元；基金份额总额 836,571,722.89 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 162,504,014.26 份，C 类基金份额总额 674,067,708.63 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达如意安泰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 |
|----------------------------|----------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| 一、营业总收入 | | 29,448,315.05 | 40,462,689.95 |
| 1.利息收入 | | 79,624.39 | 377,250.75 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.9 | 79,624.39 | 377,250.75 |
| 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 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 10,304,643.91 | 20,281,780.38 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.10 | - | - |
| 基金投资收益 | 6.4.7.11 | 6,158,426.38 | 7,181,078.03 |
| 债券投资收益 | 6.4.7.12 | 391,395.13 | 51,053.46 |
| 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 | 3,754,822.40 | 13,049,648.89 |
| 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 | 18,487,417.55 | 19,030,707.56 |
| 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 | 576,629.20 | 772,951.26 |
| 减：二、营业总支出 | | 2,303,218.91 | 4,010,286.23 |
| 1. 管理人报酬 | | 402,327.06 | 812,120.61 |
| 2. 托管费 | | 613,707.35 | 957,976.18 |
| 3. 销售服务费 | | 1,192,591.98 | 2,135,100.18 |
| 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 | | - | - |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.20 | 94,592.52 | 105,089.26 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 27,145,096.14 | 36,452,403.72 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 27,145,096.14 | 36,452,403.72 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | 27,145,096.14 | 36,452,403.72 |

6.3 净资产变动表

会计主体：易方达如意安泰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 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产 | 1,020,288,353.21 | 90,224,149.28 | 1,110,512,502.49 |
| 二、本期期初净资产 | 1,020,288,353.21 | 90,224,149.28 | 1,110,512,502.49 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -183,716,630.32 | 9,131,575.39 | -174,585,054.93 |
| （一）、综合收益总额 | - | 27,145,096.14 | 27,145,096.14 |
| （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） | -183,716,630.32 | -18,013,520.75 | -201,730,151.07 |
| 其中：1.基金申购款 | 40,700,160.94 | 4,744,674.63 | 45,444,835.57 |
| 2.基金赎回款 | -224,416,791.26 | -22,758,195.38 | -247,174,986.64 |
| （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 | 836,571,722.89 | 99,355,724.67 | 935,927,447.56 |
| 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 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产 | 2,035,431,733.34 | 134,722,482.96 | 2,170,154,216.30 |
| 二、本期期初净资产 | 2,035,431,733.34 | 134,722,482.96 | 2,170,154,216.30 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -705,343,882.13 | -19,096,230.51 | -724,440,112.64 |

| | | | |
|------------------------------------------|------------------|----------------|------------------|
| 号填列) | | | |
| (一)、综合收益总额 | - | 36,452,403.72 | 36,452,403.72 |
| (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) | -705,343,882.13 | -55,548,634.23 | -760,892,516.36 |
| 其中: 1.基金申购款 | 67,577,937.57 | 5,832,691.17 | 73,410,628.74 |
| 2.基金赎回款 | -772,921,819.70 | -61,381,325.40 | -834,303,145.10 |
| (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 | 1,330,087,851.21 | 115,626,252.45 | 1,445,714,103.66 |

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：王永铨

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

易方达如意安泰一年持有期混合型基金中基金(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[2020]290号《关于准予易方达如意安泰一年持有期混合型基金中基金(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《易方达如意安泰一年持有期混合型基金中基金(FOF)基金合同》公开募集。经向中国证监会备案,《易方达如意安泰一年持有期混合型基金中基金(FOF)基金合同》于2020年8月14日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为388,412,567.67份基金份额,其中认购资金利息折合182,728.64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 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 | 15,875,806.51 |
| 等于：本金 | 15,873,102.85 |
| 加：应计利息 | 2,703.66 |
| 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 | 15,875,806.51 |

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 | 交易所市场 | 41,550,559.00 | 647,627.68 | 42,221,937.68 | 23,751.00 |
| | 银行间市场 | - | - | - | - |
| | 合计 | 41,550,559.00 | 647,627.68 | 42,221,937.68 | 23,751.00 |
| | 资产支持证券 | - | - | - | - |
| 基金 | | 840,602,004.94 | - | 878,806,978.13 | 38,204,973.19 |
| 其他 | | - | - | - | - |
| 合计 | | 882,152,563.94 | 647,627.68 | 921,028,915.81 | 38,228,724.19 |

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 | 89,507.60 |
| 合计 | 89,507.60 |

6.4.7.7 实收基金

易方达如意安泰一年持有混合（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 | 199,377,423.66 | 199,377,423.66 |
| 本期申购 | 21,515,674.27 | 21,515,674.27 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -58,389,083.67 | -58,389,083.67 |
| 本期末 | 162,504,014.26 | 162,504,014.26 |

易方达如意安泰一年持有混合（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 | 820,910,929.55 | 820,910,929.55 |
| 本期申购 | 19,184,486.67 | 19,184,486.67 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -166,027,707.59 | -166,027,707.59 |
| 本期末 | 674,067,708.63 | 674,067,708.63 |

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

易方达如意安泰一年持有混合（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 | 14,450,691.81 | 4,939,485.54 | 19,390,177.35 |
| 本期期初 | 14,450,691.81 | 4,939,485.54 | 19,390,177.35 |
| 本期利润 | 1,940,678.85 | 3,749,000.30 | 5,689,679.15 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -2,839,848.26 | -1,243,922.60 | -4,083,770.86 |

| | | | |
|----------|---------------|---------------|---------------|
| 其中：基金申购款 | 1,695,258.70 | 944,233.18 | 2,639,491.88 |
| 基金赎回款 | -4,535,106.96 | -2,188,155.78 | -6,723,262.74 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 13,551,522.40 | 7,444,563.24 | 20,996,085.64 |

易方达如意安泰一年持有混合（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 | 50,519,641.75 | 20,314,330.18 | 70,833,971.93 |
| 本期期初 | 50,519,641.75 | 20,314,330.18 | 70,833,971.93 |
| 本期利润 | 6,716,999.74 | 14,738,417.25 | 21,455,416.99 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -9,588,356.12 | -4,341,393.77 | -13,929,749.89 |
| 其中：基金申购款 | 1,281,469.52 | 823,713.23 | 2,105,182.75 |
| 基金赎回款 | -10,869,825.64 | -5,165,107.00 | -16,034,932.64 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 47,648,285.37 | 30,711,353.66 | 78,359,639.03 |

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 | 79,419.05 |
| 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 | 190.17 |
| 其他 | 15.17 |
| 合计 | 79,624.39 |

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 | 515,870,961.07 |
| 减：卖出/赎回基金成本总额 | 509,675,005.85 |
| 减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额 | - |
| 减：交易费用 | 37,528.84 |
| 基金投资收益 | 6,158,426.38 |

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 | 416,287.13 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | -24,892.00 |
| 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 | 391,395.13 |

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 | 30,921,150.00 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 30,324,892.00 |
| 减：应计利息总额 | 621,150.00 |
| 减：交易费用 | - |
| 买卖债券差价收入 | -24,892.00 |

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 | 3,754,822.40 |
| 合计 | 3,754,822.40 |

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 | 18,487,417.55 |

| | |
|----------------------------|---------------|
| ——股票投资 | - |
| ——债券投资 | 10,616.00 |
| ——资产支持证券投资 | - |
| ——基金投资 | 18,476,801.55 |
| ——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 | 18,487,417.55 |

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 | 576,629.20 |
| 合计 | 576,629.20 |

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） | 599,759.81 |
| 当期持有基金产生的应支付管理费（元） | 2,390,861.84 |
| 当期持有基金产生的应支付托管费（元） | 563,461.94 |

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 | 29,835.26 |
| 信息披露费 | 59,672.34 |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行汇划费 | 5,084.92 |
| 合计 | 94,592.52 |

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 |
| 广发证券股份有限公司 | 基金管理人股东、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

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金本报告期及上年度可比期间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 | 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 | 402,327.06 | 812,120.61 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 1,165,040.27 | 2,126,785.39 |
| 应支付基金管理人的净管理费 | -762,713.21 | -1,314,664.78 |

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0.60%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

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，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，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，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 | 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 | 613,707.35 | 957,976.18 |

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，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，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，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 | | |
| | 易方达如意安泰一年持有混合（FOF）A | 易方达如意安泰一年持有混合（FOF）C | 合计 |
| 易方达基金管理有限公司 | - | 1,502.08 | 1,502.08 |
| 中国农业银行 | - | 2,408.86 | 2,408.86 |
| 广发证券 | - | 1.82 | 1.82 |
| 合计 | - | 3,912.76 | 3,912.76 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 易方达如意安泰一年持有混合（FOF）A | 易方达如意安泰一年持有混合（FOF）C | 合计 |
| 易方达基金管理有限公司 | - | 1,776.27 | 1,776.27 |
| 中国农业银行 | - | 2,745.78 | 2,745.78 |
| 合计 | - | 4,522.05 | 4,522.05 |

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 0.30%，按前一日 C 类基金资产净值的 0.30% 年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

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

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性

支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日等，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

本基金本报告期及上年度可比期间未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

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金本报告期及上年度可比期间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 | | 上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日 | |
|-----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|---------------------------------|-----------------------------|
| | 易方达如意安泰一 年持有混合（FOF） A | 易方达如意安泰一 年持有混合（FOF） C | 易方达如意安泰一 年持有混合（FOF） A | 易方达如意安泰一 年持有混合（FOF） C |
| 报告期初持有的基 金份额 | 4,688,174.06 | - | 4,688,174.06 | - |
| 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 | 4,688,174.06 | - | - | - |
| 报告期末持有的基 金份额 | - | - | 4,688,174.06 | - |
| 报告期末持有的基 金份额占基金总份 额比例 | - | - | 1.9454% | - |

注：基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

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

易方达如意安泰一年持有混合（FOF）A

无。

易方达如意安泰一年持有混合（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 | | 上年度可比期间 | |
|-------------|----------------------|-----------|----------------------|------------|
| | 2024年1月1日至2024年6月30日 | | 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-活期存款 | 15,875,806.51 | 79,419.05 | 56,176,130.91 | 377,098.11 |

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

本基金本报告期及上年度可比期间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

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 811,102,957.17 元，占本基金资产净值的比例为 86.66%。

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 | 上年度可比期间 |
|----------------------|---------------------------------|---------------------------------|
| | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | 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） | - | 48,805.04 |
| 当期持有基金产生的应支付销售服务费（元） | 587,043.57 | 785,971.47 |
| 当期持有基金产生的应支付管理费（元） | 2,099,717.68 | 3,229,231.08 |
| 当期持有基金产生的应支付托管费（元） | 489,347.55 | 751,822.88 |
| 当期交易基金产生的转换费（元） | - | 47,716.95 |

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

易方达如意安泰一年持有混合（FOF）A

本报告期内未发生利润分配。

易方达如意安泰一年持有混合（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，除了需要承担与境内证券投资基金类似的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。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 | 42,221,937.68 | 43,597,157.81 |
| 合计 | 42,221,937.68 | 43,597,157.81 |

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 | 15,875,806.51 | - | - | - | 15,875,806.51 |
| 结算备付金 | - | - | - | - | - |
| 存出保证金 | 1,792.66 | - | - | - | 1,792.66 |
| 交易性金融资产 | 42,221,937.68 | - | - | 878,806,978.13 | 921,028,915.81 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - | - | - | - |
| 应收清算款 | - | - | - | 5,690,862.36 | 5,690,862.36 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | - | 342,276.12 | 342,276.12 |
| 递延所得税资产 | - | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 58,099,536.85 | - | - | 884,840,116.61 | 942,939,653.46 |
| 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 | - | - | - | 6,571,951.10 | 6,571,951.10 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 60,165.09 | 60,165.09 |
| 应付托管费 | - | - | - | 102,920.25 | 102,920.25 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 187,661.86 | 187,661.86 |
| 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 | - | - | - | 89,507.60 | 89,507.60 |
| 负债总计 | - | - | - | 7,012,205.90 | 7,012,205.90 |
| 利率敏感度缺口 | 58,099,536.85 | - | - | 877,827,910.71 | 935,927,447.56 |
| 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 | 24,606,948.75 | - | - | - | 24,606,948.75 |
| 结算备付金 | - | - | - | - | - |
| 存出保证金 | 2,447.91 | - | - | - | 2,447.91 |
| 交易性金融资产 | 43,597,157.81 | - | - | 1,049,772,000.14 | 1,093,369,157.95 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - | - | - | - |
| 应收清算款 | - | - | - | 3,335,814.36 | 3,335,814.36 |
| 应收股利 | - | - | - | 0.70 | 0.70 |
| 应收申购款 | - | - | - | 134,339.59 | 134,339.59 |
| 递延所得税资产 | - | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 68,206,554.47 | - | - | 1,053,242,154.79 | 1,121,448,709.26 |

| | | | | | |
|-----------|---------------|---|---|------------------|------------------|
| 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 | - | - | - | 10,343,049.45 | 10,343,049.45 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 76,857.74 | 76,857.74 |
| 应付托管费 | - | - | - | 104,390.89 | 104,390.89 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 231,908.69 | 231,908.69 |
| 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 | - | - | - | 180,000.00 | 180,000.00 |
| 负债总计 | - | - | - | 10,936,206.77 | 10,936,206.77 |
| 利率敏感度缺口 | 68,206,554.47 | - | - | 1,042,305,948.02 | 1,110,512,502.49 |

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 | 25,467.80 | 41,692.88 |
| | 2.市场利率上升25个基点 | -25,426.95 | -41,620.01 |

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 | 878,806,978.13 | 93.90 | 1,049,772,000.14 | 94.53 |
| 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 | 878,806,978.13 | 93.90 | 1,049,772,000.14 | 94.53 |

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% | 50,548,140.20 | 59,034,285.85 |
| 2.业绩比较基准下降 5% | -50,548,140.20 | -59,034,285.85 | |

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 | 825,194,262.43 |
| 第二层次 | 95,834,653.38 |
| 第三层次 | - |
| 合计 | 921,028,915.81 |

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 | 878,806,978.13 | 93.20 |
| 3 | 固定收益投资 | 42,221,937.68 | 4.48 |
| | 其中：债券 | 42,221,937.68 | 4.48 |

| | | | |
|---|-------------------|----------------|--------|
| | 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 | 15,875,806.51 | 1.68 |
| 8 | 其他各项资产 | 6,034,931.14 | 0.64 |
| 9 | 合计 | 942,939,653.46 | 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 | 42,221,937.68 | 4.51 |

| | | | |
|----|-----------|---------------|------|
| 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 | 42,221,937.68 | 4.51 |

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 | 019727 | 23 国债 24 | 287,000 | 29,222,064.80 | 3.12 |
| 2 | 019709 | 23 国债 16 | 128,000 | 12,999,872.88 | 1.39 |

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，严格控制投资组合的下行风险，力争为投资者获得稳定的投资回报。

（1）资产配置策略

基于获取持续稳健的投资收益的目标，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、固定收益类资产和商品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。

（2）基金投资策略

基金管理人根据基金评价分析体系建立了可选基金池，本基金所投资的全部基金都应是可选基金池中的基金。对于债券型基金，基金管理人将通过归因分析拆解拟投资基金的组合收益来源，明确基金在久期、信用和杠杆各个部分的收益贡献。之后，将基于自身对组合久期和期限结构的判断，结合债券各类属资产的配置策略，确定具体的投资对象及其投资比例。对于含权债券型基金，基金管理人将同样运用归因分析方法评估其在权益资产配置、择时及选股方面的能力，从而确定其在组合收益增强方面的效果，对于表现持续优异稳定的基金也将进行配置。对于混合型基金，基金管理人将着重考察拟投资基金获取绝对收益的能力。在分析方法上，与含权债券型基金的方法类似，即运用归因分析方法评估其在权益资产配置、择时及选股能力、固定收益资产配置、信用及杠杆水平等各个部分的收益贡献，选择能够持续获取稳定收益、风格稳定、逻辑自洽的标的进行配置。对于

股票型基金，基金管理人将按照细分类型将股票型基金划分为主动型股票基金及被动型股票基金。对于主动型股票基金，基金管理人将结合公开披露的数据，利用基金定量评价体系对基金的投资业绩、基金经理的投资行为、基金经理的投资逻辑三个方面进行评估，得到量化评价结果，选择评分较高的基金进行配置。对于被动型股票基金，本基金将综合考虑市场代表性、运作时间、基金规模、流动性、跟踪误差以及费率水平等指标，选择适合的标的进行配置。

2. 风险说明：

本基金是基金中基金，投资于其他基金的比例不低于本基金资产的 80%，被投资基金的净值变化将影响到本基金的业绩表现，被投资基金的相关风险会直接或间接成为本基金的风险。相关风险包括但不限于：

（1）被投资基金的业绩风险。本基金投资于其他基金的比例不低于基金资产的 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，则本基金存在达不成投资目标的风险。

（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）投资公募 REITs 的特有风险。公募 REITs 采用“公募基金+基础设施资产支持证券”的产品结构，主要特点如下：一是公募 REITs 与投资股票或债券的公募基金具有不同的风险收益特征，80% 以上基金资产投资于基础设施资产支持证券，并持有其全部份额，基金通过基础设施资产支持证券持有基础设施项目公司全部股权，穿透取得基础设施项目完全所有权或经营权利；二是公募 REITs 以获取基础设施项目租金、收费等稳定现金流为主要目的，收益分配比例不低于合并后基金年度可供分配金额的 90%；三是公募 REITs 采取封闭式运作，不开放申购与赎回，在证券交易所上市，场外份额持有人需将基金份额转托管至场内才可卖出或申报预受要约。

投资公募 REITs 可能面临以下风险，包括但不限于：

1) 基金价格波动风险。公募 REITs 大部分资产投资于基础设施项目，具有权益属性，受经济环境、运营管理等因素影响，基础设施项目市场价值及现金流情况可能发生变化，可能引起公募 REITs 价格波动，甚至存在基础设施项目遭遇极端事件（如地震、台风等）发生较大损失而影响基金价格的风险。

2) 基础设施项目运营风险。公募 REITs 投资集中度高, 收益率很大程度依赖基础设施项目运营情况, 基础设施项目可能因经济环境变化或运营不善等因素影响, 导致实际现金流大幅低于测算现金流, 存在基金收益率不佳的风险, 基础设施项目运营过程中租金、收费等收入的波动也将影响基金收益分配水平的稳定。此外, 公募 REITs 可直接或间接对外借款, 存在基础设施项目经营不达预期, 基金无法偿还借款的风险。

3) 流动性风险。公募 REITs 采取封闭式运作, 不开通申购赎回, 只能在二级市场交易, 存在流动性不足的风险。

4) 终止上市风险。公募 REITs 运作过程中可能因触发法律法规或交易所规定的终止上市情形而终止上市, 导致投资者无法在二级市场交易。

5) 税收等政策调整风险。公募 REITs 运作过程中可能涉及基金持有人、公募基金、资产支持证券、项目公司等多层面税负, 如果国家税收等政策发生调整, 可能影响投资运作与基金收益。

6) 公募 REITs 相关法律、行政法规、部门规章、规范性文件(以下简称法律法规)和交易所业务规则, 可能根据市场情况进行修改, 或者制定新的法律法规和业务规则, 投资者应当及时予以关注和了解。

(5) 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。

(6) 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。

(7) 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。

(8) 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。

(9) 可能较大比例投资于基金管理人旗下基金所面临的特有风险。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 | 001433 | 易方达瑞 景混合 | 契约型开 放式 | 46,950,07 0.22 | 78,970,01 8.11 | 8.44 | 是 |
| 2 | 001806 | 易方达瑞 智混合 I | 契约型开 放式 | 49,397,73 8.87 | 67,921,89 0.95 | 7.26 | 是 |
| 3 | 002351 | 易方达裕 祥回报债 券 A | 契约型开 放式 | 41,392,93 8.06 | 66,849,59 4.97 | 7.14 | 是 |
| 4 | 000833 | 易方达富 华纯债债 券 C | 契约型开 放式 | 63,180,38 8.60 | 64,987,34 7.71 | 6.94 | 是 |
| 5 | 001835 | 易方达瑞 祥混合 I | 契约型开 放式 | 43,165,73 8.34 | 64,101,12 1.43 | 6.85 | 是 |
| 6 | 750002 | 安信目标 收益债券 A | 契约型开 放式 | 45,429,46 1.71 | 60,875,47 8.69 | 6.50 | 否 |
| 7 | 017621 | 易方达富 惠纯债债 券 C | 契约型开 放式 | 58,389,80 8.07 | 60,626,13 7.72 | 6.48 | 是 |
| 8 | 110036 | 易方达双 债增强债 券 C | 契约型开 放式 | 33,051,35 7.72 | 55,394,07 5.54 | 5.92 | 是 |
| 9 | 016479 | 易方达裕 丰回报债 券 C | 契约型开 放式 | 31,808,71 5.77 | 54,774,60 8.56 | 5.85 | 是 |
| 10 | 000436 | 易方达裕 惠定开混 | 契约型开 放式 | 31,969,41 9.02 | 53,612,71 5.70 | 5.73 | 是 |

| | | | | | | | |
|----|--------|------------------|--------|---------------|---------------|------|---|
| | | 合发起式 A | | | | | |
| 11 | 000206 | 易方达投资级信用债债券 C | 契约型开放式 | 42,591,989.97 | 50,139,290.59 | 5.36 | 是 |
| 12 | 000148 | 易方达高等级信用债债券 C | 契约型开放式 | 42,371,214.93 | 49,455,682.07 | 5.28 | 是 |
| 13 | 006319 | 易方达安瑞短债债券 A | 契约型开放式 | 47,516,176.87 | 48,143,390.40 | 5.14 | 是 |
| 14 | 001818 | 易方达瑞兴混合 E | 契约型开放式 | 33,730,603.18 | 47,762,534.10 | 5.10 | 是 |
| 15 | 110029 | 易方达科讯混合 | 契约型开放式 | 10,772,012.40 | 15,381,356.51 | 1.64 | 是 |
| 16 | 011301 | 易方达智造优势混合 C | 契约型开放式 | 17,455,155.27 | 15,374,500.76 | 1.64 | 是 |
| 17 | 110009 | 易方达价值精选混合 | 契约型开放式 | 12,228,514.41 | 13,249,595.36 | 1.42 | 是 |
| 18 | 015779 | 景顺长城价值边际灵活配置混合 C | 契约型开放式 | 4,252,423.88 | 6,828,542.27 | 0.73 | 否 |
| 19 | 019020 | 易方达医疗保健行业混合 C | 契约型开放式 | 1,464,258.21 | 4,359,096.69 | 0.47 | 是 |

注：由于本基金投资的基金 T 日的基金份额净值在 T+1 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+2 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 | 1,792.66 |
| 2 | 应收清算款 | 5,690,862.36 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 342,276.12 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 6,034,931.14 |

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 | 占总份额比例 | 持有份额 | 占总份额比例 |
| 易方达如意安泰一年持有混合(FOF) A | 10,148 | 16,013.40 | 22,681,392.37 | 13.96% | 139,822,621.89 | 86.04% |
| 易方达如意安泰一年持有混合(FOF) C | 1,296,896 | 519.75 | 0.00 | 0.00% | 674,067,708.63 | 100.00% |
| 合计 | 1,307,044 | 640.05 | 22,681,392.37 | 2.71% | 813,890,330.52 | 97.29% |

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 | 易方达如意安泰一年持有混合（FOF）A | 1,724,444.77 | 1.0612% |
| | 易方达如意安泰一年持有混合（FOF）C | 5,757.60 | 0.0009% |
| | 合计 | 1,730,202.37 | 0.2068% |

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 | 易方达如意安泰一年持有混合（FOF）A | 0 |
| | 易方达如意安泰一年持有混合（FOF）C | 0 |
| | 合计 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 易方达如意安泰一年持有混合（FOF）A | 0~10 |
| | 易方达如意安泰一年持有混合（FOF）C | 0 |
| | 合计 | 0~10 |

§9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 易方达如意安泰一年持有混合（FOF）A | 易方达如意安泰一年持有混合（FOF）C |
|---------------------------|---------------------|---------------------|
| 基金合同生效日（2020年8月14日）基金份额总额 | 380,471,762.98 | 7,940,804.69 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 199,377,423.66 | 820,910,929.55 |
| 本报告期基金总申购份额 | 21,515,674.27 | 19,184,486.67 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 58,389,083.67 | 166,027,707.59 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 162,504,014.26 | 674,067,708.63 |

§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) 本报告期内本基金无减少交易单元，无新增交易单元。

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、个股分析的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 | 28,811,156.00 | 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 | 易方达基金管理有限公司关于终止北京增财基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告 | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2024-01-13 |
| 2 | 易方达基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 | 证券时报 | 2024-01-19 |

| | | | |
|---|-------------------------------------|----------------------------|------------|
| | 4 季度报告提示性公告 | | |
| 3 | 易方达基金管理有限公司旗下基金 2023 年年度报告提示性公告 | 证券时报 | 2024-03-29 |
| 4 | 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 | 证券时报 | 2024-04-20 |
| 5 | 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 | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2024-04-23 |

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1.中国证监会准予易方达如意安泰一年持有期混合型证券投资基金（FOF）注册的文件；
- 2.《易方达如意安泰一年持有期混合型证券投资基金（FOF）基金合同》；
- 3.《易方达如意安泰一年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。

11.2 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。

11.3 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