

易方达如意安诚六个月持有期混合型基金中基金（FOF）

2024 年第 1 季度报告

2024 年 3 月 31 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

报告送出日期：二〇二四年四月二十日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 4 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 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 |
| 报告期末基金份额总额 | 214,264,148.73 份 |
| 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 |

| | |
|--------|--|
| | <p>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。</p> |
| 业绩比较基准 | <p>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%</p> |
| 风险收益特征 | <p>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）。</p> <p>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。</p> |
| 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 |

| | | |
|-----------------|----------------------|----------------------|
| 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 | 127,214,788.38 份 | 87,049,360.35 份 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期 (2024年1月1日-2024年3月31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 |
| 1.本期已实现收益 | 655,686.67 | 382,803.49 |
| 2.本期利润 | 2,077,138.88 | 1,354,970.23 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0163 | 0.0156 |
| 4.期末基金资产净值 | 129,824,466.60 | 88,761,568.00 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.0205 | 1.0197 |

注：1.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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 | 净值增长率① | 净值增长率标准差 | 业绩比较基准收益 | 业绩比较基准收益 | ①—③ | ②—④ |
|----|--------|----------|----------|----------|-----|-----|
|----|--------|----------|----------|----------|-----|-----|

| | | ② | 率③ | 率标准差 ④ | | |
|------------|-------|-------|-------|-----------|--------|--------|
| 过去三个月 | 1.62% | 0.09% | 2.17% | 0.20% | -0.55% | -0.11% |
| 过去六个月 | - | - | - | - | - | - |
| 过去一年 | - | - | - | - | - | - |
| 过去三年 | - | - | - | - | - | - |
| 过去五年 | - | - | - | - | - | - |
| 自基金合同生效起至今 | 2.05% | 0.09% | 3.35% | 0.20% | -1.30% | -0.11% |

易方达如意安诚六个月持有混合（FOF）C

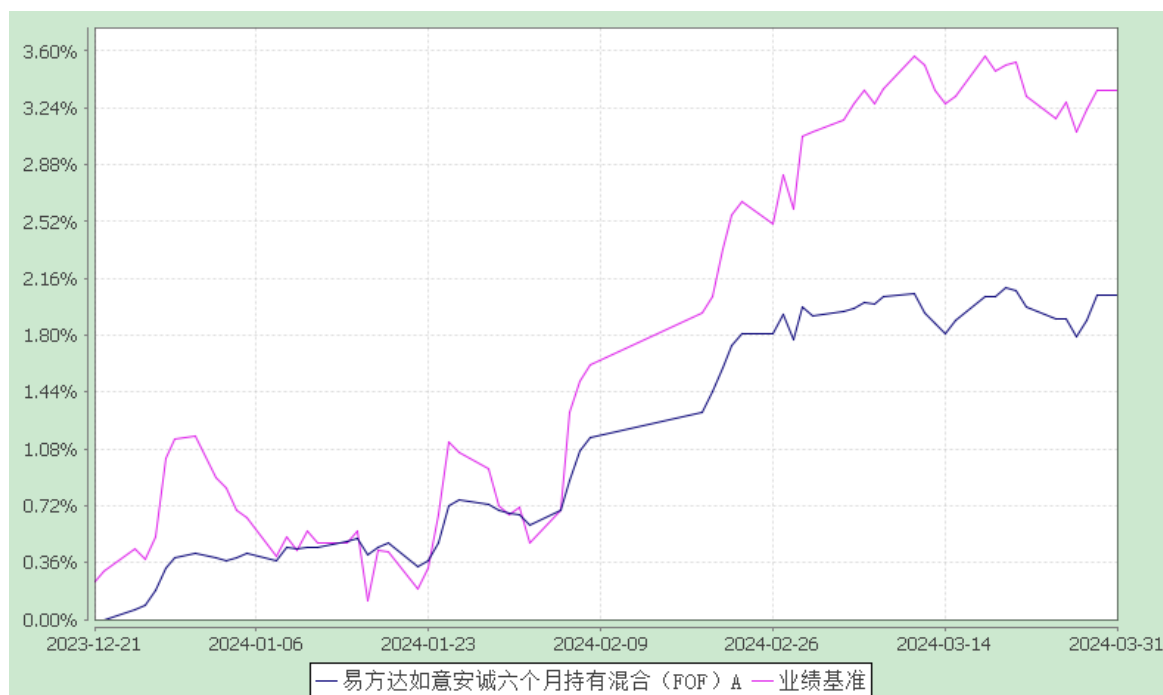
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差 ② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差 ④ | ①—③ | ②—④ |
|------------|--------|---------------|------------|-------------------|--------|--------|
| 过去三个月 | 1.55% | 0.09% | 2.17% | 0.20% | -0.62% | -0.11% |
| 过去六个月 | - | - | - | - | - | - |
| 过去一年 | - | - | - | - | - | - |
| 过去三年 | - | - | - | - | - | - |
| 过去五年 | - | - | - | - | - | - |
| 自基金合同生效起至今 | 1.97% | 0.09% | 3.35% | 0.20% | -1.38% | -0.11% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

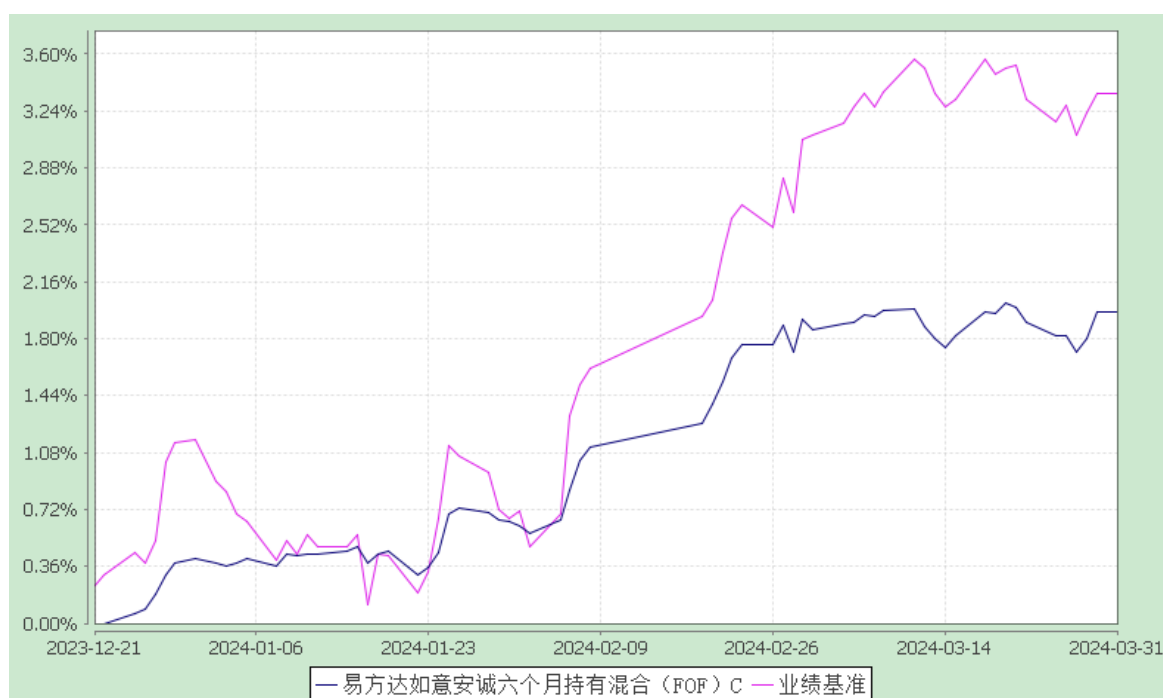
易方达如意安诚六个月持有期混合型基金中基金（FOF）
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2023 年 12 月 21 日至 2024 年 3 月 31 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，自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同的有关约定。本报告期本基金处于建仓期内。

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 2.05%，同期业绩比

较基准收益率为 3.35%；C 类基金份额净值增长率为 1.97%，同期业绩比较基准收益率为 3.35%。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|---|-------------|------|--------|---------------------------------------|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 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，“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遵规守信情况的说明

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 公平交易专项说明

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、决策流程和交易流程，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，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 10 次，其中 8 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，2 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 报告期内基金投资策略和运作分析

2024 年一季度，国内经济仍处于磨底阶段，但边际上出现好转迹象，1-2 月经济数据好于预期，生产数据延续偏强走势，需求端出口、制造业投资及春节期间消费有所修复，但地产问题制约仍存。从关注的前瞻社融数据来看，居民信贷和 M1 增速尚未看到显著回升趋势，后续经济增长动能修复情况仍需关注相关政策推进落地情况。海外方面，全球制造业 PMI（制造业采购经理指数）回升至荣枯线以上，制造业周期出现回升迹象，后续欧美有望逐步进入主动补库阶段，美国经济数据延续强劲，1-2 月通胀数据超出预期，虽然美联储年内降息预期未变，但市场对开启降息时点的预期逐步后移。

资产价格方面，虽然短期国内基本面情况变化不大，但市场对于中长期经济预期的调整和极端交易结构带来的流动性问题使得资产价格出现大幅波动。股票市场先跌后涨，且内部市值结构分化明显，中小市值股大幅调整，中证 1000 最大跌幅约 27%，之后快速反弹，全区间来看，上证 50 涨 3.82%，沪深 300 涨 3.10%，中证 500 跌 2.64%，中证 1000 跌 7.58%；行业方面，具有红利属性的银行、石油石化、煤炭、家用电器等行业涨幅靠前，而医药生物、计算机、电子、综合等行业跌幅较大。债券市场方面，国内债券到期收益率延续趋势性下行，1 年期国债下行 36bp，10 年期国债下行 27bp 至 2.29%，而 1 年期 MLF（中期借贷便利）利率维持在 2.5%，政策利率调整幅度滞后于市场利率。全球大类资产方面，日股涨幅超过 20%，标普 500 涨 10.16%，黄金

与原油价格涨幅也在 10%左右，美债利率有所上行，10 年期美债上行幅度超过 30bp。

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，在基本面数据延续温和修复的过程中，资本市场价格波动使得不同资产间估值差发生明显变化，在这一过程中，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，之后快速完成初步建仓，主要以配置纯债基金、二级债基以及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。2024 年一季度，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，年初市场对于长期问题的悲观预期快速反映在股价中，市场加速调整，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策略占比，在较高债底的基础上获取潜在上行期权。后续随着市场触底反弹，组合逐步延缓权益类基金的增配节奏。进入 3 月后，市场修复了之前流动性冲击带来的跌幅，组合从加仓权益资产转变为结构调整。

结构配置层面，目前权益资产部分超配价值风格，细分策略层面，主要以价值质量和价值成长策略为主，考虑质量和成长因子在经过过往 3 年的调整后，已经重新具备较高的配置价值，因此组合在价值的基础上逐步提升质量和成长因子暴露。行业层面表现为高配周期、制造、稳定板块，低配科技、医药板块。结构上超配周期主要是考虑在全球制造业周期回升的环境下，部分资源品受前期资本开支等因素影响供给具有刚性，随着海外通胀数据超预期，再通胀风险提升，同时叠加地缘政治等因素影响，资源品胜率和赔率都较高。而超配制造除全球制造业周期因素外，还考虑我国在制造业上的相对优势，以及新能源车的产业机会，在经过长期估值调整后，制造板块的配置价值有所提升。

债券方面，年初考虑到基本面数据短期向上弹性不大，货币政策保持宽松，债券资产的胜率较高，因此我们系统性提升组合久期，降低短债基金配置，提升中长期纯债基金占比。而随着利率的快速下行，长期收益空间在短期快速兑现，虽然债券资产胜率仍高，但赔率在不断下降，尤其是 3 月开始，各种利差被压缩到历史低位，同时微观交易结构变差，使得波动加大，在长期配置的基础上，组合适度调整纯债基金结构，更偏向中等久期票息策略为主的债基和交易能力较强的中长期纯债基金。

整体来看，组合保持基于“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实现资产的长期稳健增值，也由衷感谢广大投资者的理解和信任。

4.5 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 1.0205 元，本报告期份额净值增长率为 1.62%，同期业绩比较基准收益率为 2.17%；C 类基金份额净值为 1.0197 元，本报告期份额净值增长率为 1.55%，同期业绩比较基准收益率为 2.17%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|----------|----------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 基金投资 | 205,184,132.92 | 93.83 |
| 3 | 固定收益投资 | 8,696,331.78 | 3.98 |
| | 其中：债券 | 8,696,331.78 | 3.98 |
| | 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 | 4,804,203.42 | 2.20 |
| 8 | 其他资产 | 1,466.36 | 0.00 |
| 9 | 合计 | 218,686,134.48 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|--------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 8,696,331.78 | 3.98 |
| 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 | 8,696,331.78 | 3.98 |

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例 |
|----|------|------|-------|---------|-----------|
|----|------|------|-------|---------|-----------|

| | | | | | |
|---|--------|----------|--------|--------------|------|
| | | | | | (%) |
| 1 | 019709 | 23 国债 16 | 86,000 | 8,696,331.78 | 3.98 |

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|----------|
| 1 | 存出保证金 | 665.72 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | 0.64 |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 800.00 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 1,466.36 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

§ 6 基金中基金

6.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

| 序号 | 基金代码 | 基金名称 | 运作方式 | 持有份额（份） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） | 是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金 |
|----|--------|-----------------|--------|---------------|---------------|--------------|------------------------|
| 1 | 020083 | 易方达投资级信用债债券D | 契约型开放式 | 18,654,793.81 | 21,915,651.77 | 10.03 | 是 |
| 2 | 020082 | 易方达信用债债券D | 契约型开放式 | 17,569,296.21 | 19,918,311.11 | 9.11 | 是 |
| 3 | 017156 | 易方达岁丰添利债券(LOF)C | 契约型开放式 | 12,171,837.89 | 19,714,725.83 | 9.02 | 是 |
| 4 | 005099 | 易方达富华纯债债券A | 契约型开放式 | 19,120,502.22 | 19,594,690.68 | 8.96 | 是 |
| 5 | 019606 | 易方达富惠纯债债券D | 契约型开放式 | 16,936,168.27 | 17,429,010.77 | 7.97 | 是 |
| 6 | 110036 | 易方达双债增强债券C | 契约型开放式 | 8,885,600.25 | 14,750,096.42 | 6.75 | 是 |
| 7 | 001818 | 易方达瑞兴混合E | 契约型开放式 | 9,558,160.52 | 13,285,843.12 | 6.08 | 是 |

| | | | | | | | |
|----|--------|------------|--------|---------------|---------------|------|---|
| 8 | 001343 | 易方达新享混合C | 契约型开放式 | 10,138,894.50 | 12,551,951.39 | 5.74 | 是 |
| 9 | 001836 | 易方达瑞祥混合E | 契约型开放式 | 7,687,938.95 | 11,109,071.78 | 5.08 | 是 |
| 10 | 017420 | 易方达裕祥回报债券C | 契约型开放式 | 6,970,159.44 | 11,089,523.67 | 5.07 | 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 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 工作日内公告（T 日为估值日）。

6.2 当期交易及持有基金产生的费用

| 项目 | 本期费用 2024年1月1日至2024年3月31日 | 其中：交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用 |
|----------------------|------------------------------|---------------------------------|
| 当期交易基金产生的申购费（元） | - | - |
| 当期交易基金产生的赎回费（元） | - | - |
| 当期持有基金产生的应支付销售服务费（元） | 59,095.00 | 58,122.11 |
| 当期持有基金产生的应支付管理费（元） | 212,132.43 | 210,104.69 |
| 当期持有基金产生的应支付托管费（元） | 57,904.28 | 57,566.25 |
| 当期交易所交易基金产生的交易费（元） | 35.82 | 35.82 |
| 当期交易基金产生的转换费（元） | - | - |

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）、销售服务费等销售费用，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。

6.3 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。 |
|------------------------|

§ 7 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 |
|----------------|------------------------------|------------------------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 127,214,298.10 | 87,047,753.67 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 490.28 | 1,606.68 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | - | - |
| 报告期期间基金拆分变动份额 | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 127,214,788.38 | 87,049,360.35 |

§ 8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 影响投资者决策的其他重要信息

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。

§ 10 备查文件目录

10.1 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基金中基金（FOF）注册的文件；
- 2.《易方达如意安诚六个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》；
- 3.《易方达如意安诚六个月持有期混合型基金中基金（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。

10.2 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。

10.3 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
二〇二四年四月二十日