

易方达如意安泰一年持有期混合型基金中基金 （FOF）

2021 年中期报告

2021 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：二〇二一年八月二十八日

§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 2021 年 8 月 26 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 2021 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	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
§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）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
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	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	38
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	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	39
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	39
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	39
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	39
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	39
7.12 本报告期投资基金情况	39

7.13	投资组合报告附注	43
§8	基金份额持有人信息	44
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	44
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	45
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的情况	45
§9	开放式基金份额变动	45
§10	重大事件揭示	45
10.1	基金份额持有人大会决议	45
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	46
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	46
10.4	基金投资策略的改变	46
10.5	本报告期持有的基金发生的重大影响事件	46
10.6	为基金进行审计的会计师事务所情况	46
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	46
10.8	基金租用证券公司交易单元的有关情况	46
10.9	其他重大事件	48
§11	备查文件目录	49
11.1	备查文件目录	49
11.2	存放地点	49
11.3	查阅方式	49

§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	449,487,363.94 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	382,698,959.95 份	66,788,403.99 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。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	张南	秦一楠
	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宝华路6号105室-42891（集中办公区）	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	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	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	http://www.efunds.com.cn
基金中期报告备置地点	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 43 楼

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

§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（2021 年 1 月 1 日至 2021 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	1,821,195.06	19,082.83
本期利润	11,705,301.21	724,245.98
加权平均基金份额本期利润	0.0306	0.0402
本期加权平均净值利润率	2.96%	3.88%
本期基金份额净值增长率	3.01%	2.86%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 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	3,707,305.73	470,752.52
期末可供分配基金份额利润	0.0097	0.0070
期末基金资产净值	401,196,729.68	69,836,346.93
期末基金份额净值	1.0483	1.0456
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 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	4.83%	4.56%

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	0.67%	0.11%	-0.02%	0.09%	0.69%	0.02%
过去三个月	1.97%	0.11%	1.48%	0.10%	0.49%	0.01%
过去六个月	3.01%	0.18%	2.04%	0.14%	0.97%	0.04%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	4.83%	0.16%	4.18%	0.13%	0.65%	0.03%

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	0.64%	0.11%	-0.02%	0.09%	0.66%	0.02%
过去三个月	1.90%	0.11%	1.48%	0.10%	0.42%	0.01%
过去六个月	2.86%	0.18%	2.04%	0.14%	0.82%	0.04%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	4.56%	0.16%	4.18%	0.13%	0.38%	0.03%

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 2021 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：1.本基金合同于2020年8月14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,建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同(第十二部分二、投资范围,三、投资策略和四、投资限制)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4.83%,C类基金份额净值增长率为4.56%,同期业绩比较基准收益率为4.18%。

§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。本基金管理人拥有公募、社保、年金、特定客户资产管理、QDII、基本养老保险基金投资等业务资格，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、多资产投资、海外投资、FOF 投资等领域全面布局，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期混合型基金中基金（FOF）的基金经理、易方达汇诚养老目标日期 2038 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）的基金经理助理（自 2019 年 07 月 11 日至 2021 年 04 月 21 日）	2020-08-14	-	6 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。

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《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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 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。本基金管理人规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 15 次，均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。

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

2021 年上半年，在我国对新冠疫情的有效防控、宏观政策的有效调控下，我国经济持续稳定恢复、稳中向好。

稳定的宏观经济环境下，上半年上证综指整体上涨 3.4%，沪深 300 仅上涨 0.2%，市场整体维持震荡行情，但内部分化较大。行业来看，家电、非银金融、国防军工等去年涨幅较大行业上半年均下跌 10% 以上；但有色、钢铁、化工等周期行业和电子、新能源等先进制造行业均上涨 10% 以上。十年期国债到期收益率先上后下，最终基本维持在年初位置附近。

本基金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，为投资者严格控制投资组合的下行风险，力争实现基金资产的持续稳健增值。

本基金在权益市场和债券市场的波动增大的环境中，以货币基金、债券基金、低风险的混合型基金为主要的投资标的，避免组合在市场波动中遭遇过大的回撤；考虑到核心资产面临的压力对于多空对冲基金并非利好，赎回了大部分多空对冲基金；配置的权益型基金进行了风格切换，转化至今年以来收益风险比更高的价值成长风格型基金中，提升组合的预期收益水平。配置比例经过了压力测试，以确保组合的回撤能够控制在合理的范围内。

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，以全市场擅长进行信用下沉的基金为辅的投资策略。

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。

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。

4.4.2 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 1.0483 元，本报告期份额净值增长率为 3.01%，同期业绩比较基准收益率为 2.04%；C 类基金份额净值为 1.0456 元，本报告期份额净值增长率为 2.86%，同期业绩比较基准收益率为 2.04%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，宏观经济环境可能会维持稳定。经济维持在相对景气的位置运行，政策提供合理的支持，并通过主动、逐步的调整解决不稳固、不均衡的问题。

我们认为目前央行和其他当局对经济的理解是优于市场的，政策也会根据经济本身动态调整，能够维持相对稳定的宏观环境。根据历史经验，这样的宏观环境下一般难以出现整体性的大牛市或大熊市，更多的出现结构性机会。

市场来看，下半年 A 股上市公司企业盈利稳定，但微观交易结构较为拥挤。历史来看在交易拥挤逐步修正的过程中小市值公司、当期业绩高增速公司、合理估值（业绩增速和估值匹配）公司表现更好。

综合宏观环境和市场环境，符合业绩高增长、估值合理、机构持仓不拥挤的标的依旧存在结构性行情。

但需要重视的是，当前的投资环境和过去几年明显不同。2017-2020 年，宏观环境充满了不确定性，中美贸易摩擦、金融去杠杆、新冠疫情等，叠加外资和机构资金占比提升，市场偏好于长期盈利确定性较高的公司；而今年上半年稳定的宏观环境和存量资金博弈的市场下，市场转而追逐业绩高增长、估值合理的公司。

长期盈利确定性高的公司是相对稳定的；但业绩高增长、估值合理的标的是会根据公司业绩增速预期的变化、估值的变化而不断变化的，下半年目前来看强周期和先进制造行业较为吻合。

不能够再以“躺赢”的思维去投资，纵然主线维持业绩高增长、估值合理不变，但标的可能时刻在变化，要想稳定获取超额收益需要根据环境实时去优化自身的投资组合，这一点涉及到对企业未来盈利增长的判断和当前估值水平是否合理的分析，需要很强的专业技能。

本基金将重点配置于以下方向的基金：

1.货币基金和短债基金：中国流动性边际收紧、经济复苏和通胀上行的环境对于债券资产存在逆风，需控制组合的利率风险和信用风险。本基金将配置于短久期的货币基金和短债基金，利用货币基金摊余成本法估值优势，降低组合波动，控制组合下行风险。

2.低仓位运作的打新策略基金：在权益资产长期具备更高配置价值，但短期存在估值调整风险的背景下，低仓位运作的打新策略基金一方面能够控制最大回撤，另一方面能够获取部分权益市场上行的收益，还可最大限度获取打新收益增强。本基金将配置于底仓策略稳健、整体仓位不高、打新能力较强的打新策略基金，为组合增强收益。

本基金将通过货债组合叠加打新策略的基金组合方式，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。

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。

§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 2021 年 1 月 1 日至 2021 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：易方达如意安泰一年持有期混合型基金中基金（FOF）

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	4,470,972.63	909,889.52
结算备付金		-	94,059.73
存出保证金		-	8,706.96
交易性金融资产	6.4.7.2	462,523,438.27	390,075,857.58
其中：股票投资		-	-
基金投资		442,777,438.27	370,355,527.38
债券投资		19,746,000.00	19,720,330.20
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		1,600,068.97	5,000,000.00
应收利息	6.4.7.5	407,907.45	197,924.05
应收股利		69,508.76	679.68
应收申购款		2,153,383.97	14,042.18
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		471,225,280.05	396,301,159.70
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		34,369.03	92,496.86
应付托管费		53,981.31	44,853.42
应付销售服务费		14,592.95	2,087.19
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	89,260.15	60,000.00
负债合计		192,203.44	199,437.47
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	449,487,363.94	389,227,447.44

未分配利润	6.4.7.10	21,545,712.67	6,874,274.79
所有者权益合计		471,033,076.61	396,101,722.23
负债和所有者权益总计		471,225,280.05	396,301,159.70

注：1.本基金合同生效日为 2020 年 8 月 14 日，2020 年度实际报告期间为 2020 年 8 月 14 日至 2020 年 12 月 31 日。

2.报告截止日 2021 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.0483 元，C 类基金份额净值 1.0456 元；基金份额总额 449,487,363.94 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 382,698,959.95 份，C 类基金份额总额 66,788,403.99 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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、收入		13,083,035.03
1.利息收入		218,970.19
其中：存款利息收入	6.4.7.11	8,445.37
债券利息收入		210,524.82
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,231,783.08
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-
基金投资收益	6.4.7.13	110,458.67
债券投资收益	6.4.7.14	-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	2,121,324.41
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	10,589,269.30
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	43,012.46
减：二、费用		653,487.84
1. 管理人报酬		228,554.46
2. 托管费		287,894.32

3. 销售服务费		27,027.52
4. 交易费用	6.4.7.19	8,729.39
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	6.4.7.20	101,282.15
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		12,429,547.19
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		12,429,547.19

注：本基金合同生效日为 2020 年 8 月 14 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 所有者权益（基金净值）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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	389,227,447.44	6,874,274.79	396,101,722.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	12,429,547.19	12,429,547.19
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	60,259,916.50	2,241,890.69	62,501,807.19
其中：1.基金申购款	60,259,916.50	2,241,890.69	62,501,807.19
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	449,487,363.94	21,545,712.67	471,033,076.61

注：本基金合同生效日为 2020 年 8 月 14 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：邱毅华

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》、各项具体会计准则及相关规定(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》、《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》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基金净值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。

(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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	4,470,972.63
定期存款	-
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	-
合计	4,470,972.63

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	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	19,694,502.40	19,746,000.00
	银行间市场	-	-
	合计	19,694,502.40	19,746,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	427,274,069.80	442,777,438.27	15,503,368.47
其他	-	-	-
合计	446,968,572.20	462,523,438.27	15,554,866.07

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

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 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	815.26
应收定期存款利息	-

应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	407,092.19
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	-
合计	407,907.45

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

本基金本报告期末无应付交易费用。

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021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	-
预提费用	89,260.15
合计	89,260.15

6.4.7.9 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 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	381,056,764.64	381,056,764.64
本期申购	1,642,195.31	1,642,195.31
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	382,698,959.95	382,698,959.95

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 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	8,170,682.80	8,170,682.80
本期申购	58,617,721.19	58,617,721.19
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	66,788,403.99	66,788,403.99

注：申购含红利再投、转换入份额,赎回含转换出份额。

6.4.7.10 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	1,875,901.21	4,863,332.26	6,739,233.47
本期利润	1,821,195.06	9,884,106.15	11,705,301.21
本期基金份额交易产生的变动数	10,209.46	43,025.59	53,235.05
其中：基金申购款	10,209.46	43,025.59	53,235.05
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,707,305.73	14,790,464.00	18,497,769.73

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	30,871.70	104,169.62	135,041.32
本期利润	19,082.83	705,163.15	724,245.98
本期基金份额交易产生的变动数	420,797.99	1,767,857.65	2,188,655.64
其中：基金申购款	420,797.99	1,767,857.65	2,188,655.64
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	470,752.52	2,577,190.42	3,047,942.94

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
	活期存款利息收入
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	21.19
其他	45.02
合计	8,445.37

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期无股票投资收益。

6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	32,595,134.35
减：卖出/赎回基金成本总额	32,484,675.68
基金投资收益	110,458.67

6.4.7.14 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021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	2,121,324.41
合计	2,121,324.41

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1.交易性金融资产	10,589,269.30
——股票投资	-
——债券投资	25,669.80
——资产支持证券投资	-
——基金投资	10,563,599.50
——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	10,589,269.30

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	-
其他	43,012.46
合计	43,012.46

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	-
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	8,729.39
其中：申购费	-
赎回费	7,164.09
交易费	-
转换费	1,565.30
合计	8,729.39

6.4.7.19.1 持有基金产生的费用

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	51,460.44
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	1,041,686.52
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	254,867.32

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。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	3,022.00
银行间账户维护费	9,000.00
合计	101,282.15

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 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 2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	228,554.46
其中：支付销售机构的客户维护费	503,016.90

注：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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	287,894.32

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 2021年1月1日至2021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	-	2,808.65	2,808.65
中国农业银行	-	7,668.53	7,668.53
合计	-	10,477.18	10,477.18

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固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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 2021年1月1日至2021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	4,470,972.63	8,379.16

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（2021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 404,291,711.14 元，占本基金资产净值的比例为 85.83%。

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	本期费用 2021年1月1日至2021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）	2,154.70	
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	51,460.44	
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	845,618.58	
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	215,547.43	
当期交易所交易基金产生的交易费（元）	-	
当期交易基金产生的转换费（元）	1,565.30	

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（2021 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 2021 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 2021 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、集中交易室、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）。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

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金管理人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 2021 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%(2020 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 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	20,153,092.19	19,916,897.57
合计	20,153,092.19	19,916,897.57

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为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 2021年6月30日	上年度末 2020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 2021年6月30日	上年度末 2020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 2021年6月30日	上年度末 2020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 2021年6月30日	上年度末 2020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 2021年6月30日	上年度末 2020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

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金采用分散投资、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。

于 2021 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(所有者权益)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。

本基金持有单只基金的市场价值，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

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的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 2021年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	4,470,972.63	-	-	-	4,470,972.63
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	19,746,000.00	-	-	442,777,438.27	462,523,438.27
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	1,600,068.97	1,600,068.97
应收利息	-	-	-	407,907.45	407,907.45
应收股利	-	-	-	69,508.76	69,508.76
应收申购款	-	-	-	2,153,383.97	2,153,383.97
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	24,216,972.63	-	-	447,008,307.42	471,225,280.05
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	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	34,369.03	34,369.03
应付托管费	-	-	-	53,981.31	53,981.31
应付销售服务费	-	-	-	14,592.95	14,592.95
应付交易费用	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	89,260.15	89,260.15
负债总计	-	-	-	192,203.44	192,203.44
利率敏感度缺口	24,216,972.63	-	-	446,816,103.98	471,033,076.6

					1
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	909,889.52	-	-	-	909,889.52
结算备付金	94,059.73	-	-	-	94,059.73
存出保证金	8,706.96	-	-	-	8,706.96
交易性金融资产	19,720,330.20	-	-	370,355,527.38	390,075,857.58
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	5,000,000.00	5,000,000.00
应收利息	-	-	-	197,924.05	197,924.05
应收股利	-	-	-	679.68	679.68
应收申购款	-	-	-	14,042.18	14,042.18
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	20,732,986.41	-	-	375,568,173.29	396,301,159.70
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	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	92,496.86	92,496.86
应付托管费	-	-	-	44,853.42	44,853.42
应付销售服务费	-	-	-	2,087.19	2,087.19
应付交易费用	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	60,000.00	60,000.00
负债总计	-	-	-	199,437.47	199,437.47

利率敏感度缺口	20,732,986.41	-	-	375,368,735.82	396,101,722.23
---------	---------------	---	---	----------------	----------------

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 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
	1.市场利率下降25个基点	2,124.05	26,020.77
2.市场利率上升25个基点	-2,121.34	-25,971.88	

注：本期末本基金未持有交易性债券投资(不包括可转债)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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 2021年6月30日		上年度末 2020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	442,777,438.27	94.00	370,355,527.38	93.50
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	442,777,438.27	94.00	370,355,527.38	93.50

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 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
	1.业绩比较基准上升 5%	20,405,899.39	20,971,740.68
	2.业绩比较基准下降 5%	-20,405,899.39	-20,971,740.68

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 6 月 30 日,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中属于第一层次的余额为 442,777,438.27 元,属于第二层次的余额为 19,746,000.00 元,无属于第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日:第一层次 370,355,527.38 元,第二层次 19,720,330.20 元,无属于第三层次的余额)。

(ii) 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,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的公允价值列入第一层次;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,确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2021年6月30日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2020年12月31日:同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外,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	442,777,438.27	93.96
3	固定收益投资	19,746,000.00	4.19
	其中：债券	19,746,000.00	4.19
	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	4,470,972.63	0.95
8	其他各项资产	4,230,869.15	0.90
9	合计	471,225,280.05	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	19,746,000.00	4.19
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	19,746,000.00	4.19

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	019640	20 国债 10	197,460	19,746,000.00	4.19

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 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。

7.11 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。

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：

（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

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）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	000171	易方达裕 丰回报债 券	契约型开 放式	23,183,17 4.15	50,353,85 4.25	10.69	是
2	002351	易方达裕 祥回报债	契约型开 放式	23,821,71 0.14	39,424,93 0.28	8.37	是

		券					
3	000620	易方达现金增利货币 A	契约型开放式	35,772,312.54	35,772,312.54	7.59	是
4	001806	易方达睿智混合 I	契约型开放式	21,969,147.41	27,812,940.62	5.90	是
5	002602	易方达丰惠混合	契约型开放式	21,976,121.27	26,019,727.58	5.52	是
6	001249	易方达新利混合	契约型开放式	13,942,312.60	21,875,488.47	4.64	是
7	006013	易方达鑫转招利混合 A	契约型开放式	12,582,470.31	20,645,317.28	4.38	是
8	000032	易方达信用债债券 A	契约型开放式	18,214,936.25	20,233,151.19	4.30	是
9	000205	易方达投资级信用债债券 A	契约型开放式	17,699,115.04	20,176,991.15	4.28	是
10	000147	易方达高等级信用债债券 A	契约型开放式	17,985,611.51	20,143,884.89	4.28	是
11	006662	易方达安悦超短债债券 A	契约型开放式	19,766,752.32	20,057,323.58	4.26	是
12	001817	易方达瑞兴混合 I	契约型开放式	14,499,693.05	19,270,092.06	4.09	是
13	001835	易方达瑞祥混合 I	契约型开放式	12,877,886.95	17,604,071.46	3.74	是
14	001562	易方达瑞和混合	契约型开放式	8,242,503.77	13,567,161.21	2.88	是
15	001342	易方达新享混合 A	契约型开放式	7,518,225.80	10,999,164.35	2.34	是
16	161131	易方达 3 年封闭战略配售混合(LOF)	契约型开放式	9,200,125.00	10,607,744.13	2.25	是
17	000992	广发对冲套利定期开放混合	契约型开放式	7,489,887.64	10,261,146.07	2.18	否
18	519062	海富通阿尔法对冲混合 A	契约型开放式	8,634,715.03	10,128,520.73	2.15	否
19	001343	易方达新	契约型开	8,397,921.	10,043,91	2.13	是

		享混合 C	放式	02	3.54		
20	001441	易方达瑞 信混合 I	契约型开 放式	6,082,578. 65	8,898,812. 56	1.89	是
21	003134	易方达裕 鑫债券 C	契约型开 放式	5,395,677. 86	7,674,272. 62	1.63	是
22	160142	南方 3 年 封闭运作 战略配售 混合 (LOF)	契约型开 放式	5,603,624. 00	6,528,221. 96	1.39	否
23	161728	招商 3 年 封闭运作 战略配售 混合 (LOF)	契约型开 放式	5,090,000. 00	5,868,770. 00	1.25	否
24	501189	嘉实战略 配售混合 (LOF)	契约型开 放式	2,710,000. 00	3,273,680. 00	0.70	否
25	501188	汇添富 3 年封闭运 作战略配 售混合 (LOF)	契约型开 放式	1,960,702. 00	2,425,388. 37	0.51	否
26	001217	易方达新 收益混合 C	契约型开 放式	312,122.4 2	1,370,841. 67	0.29	是
27	003961	易方达瑞 程混合 A	契约型开 放式	333,344.4 4	1,135,571. 17	0.24	是
28	005827	易方达蓝 筹精选混 合	契约型开 放式	200,419.5 0	604,144.5 4	0.13	是

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,在本报告编制日
前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

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	-
2	应收证券清算款	1,600,068.97
3	应收股利	69,508.76
4	应收利息	407,907.45
5	应收申购款	2,153,383.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,230,869.15

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	3,986	96,010.78	31,003,385.94	8.10%	351,695,574.01	91.90%
易方达如意安泰一年持有混合(FOF) C	5,996	11,138.83	0.00	0.00%	66,788,403.99	100.00%
合计	9,982	45,029.79	31,003,385.94	6.90%	418,483,978.00	93.10%

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	0.00	0.0000%
	易方达如意安泰一年持有混合（FOF）C	970.40	0.0015%
	合计	970.40	0.0002%

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的情况

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
	易方达如意安泰一年持有混合（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	381,056,764.64	8,170,682.80
本报告期基金总申购份额	1,642,195.31	58,617,721.19
减：本报告期基金总赎回份额	-	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	382,698,959.95	66,788,403.99

§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

本基金管理人于 2021 年 1 月 23 日发布公告,自 2021 年 1 月 23 日起聘任娄利舟女士担任公司副总经理级高级管理人员。

2021 年 5 月,中国农业银行总行决定谭敦宇任托管业务部总裁。

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

本报告期,基金管理人和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。

报告期内,公司收到中国证券监督管理委员会广东监管局对公司及相关人员的监管措施。公司已及时按要求改正并报告。

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	

渤海证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东方财富	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

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。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
渤海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财	-	-	-	-	-	-	-	-

富									
方正证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金增加陆基金为销售机构的公告	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	2021-01-07
2	易方达基金管理有限公司旗下基金 2020 年第 4 季度报告提示性公告	证券时报	2021-01-21
3	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	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	2021-01-23
4	易方达基金管理有限公司旗下基金 2020 年年度报告提示性公告	证券时报	2021-03-30
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	2021-04-02
6	易方达基金管理有限公司旗下基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告	证券时报	2021-04-19
7	易方达基金管理有限公司关于调整旗下部分开放式基金申购、赎回、持有份额和定期定额投资最低数额限制的公告	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	2021-06-07

§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基金中基金（FOF）注册的文件；
- 2、《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》；
- 3、《易方达如意安泰一年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。

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

二〇二一年八月二十八日