

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）

2023 年中期报告

2023 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：中国邮政储蓄银行股份有限公司

送出日期：二〇二三年八月三十日

§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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 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 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§2	基金简介	5
2.1	基金基本情况	5
2.2	基金产品说明	5
2.3	基金管理人和基金托管人	6
2.4	信息披露方式	6
2.5	其他相关资料	6
§3	主要财务指标和基金净值表现	7
3.1	主要会计数据和财务指标	7
3.2	基金净值表现	7
§4	管理人报告	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	13
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8	报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§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真实、准确和完整发表意见	15
§6	半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1	资产负债表	15
6.2	利润表	16
6.3	净资产（基金净值）变动表	17
6.4	报表附注	19
§7	投资组合报告	39
7.1	期末基金资产组合情况	39
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	40
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	40
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	40
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	41
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	41
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	41
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	41
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	41
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	42

7.12	本报告期投资基金情况	42
7.13	投资组合报告附注	50
§8	基金份额持有人信息	51
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	52
8.4	发起式基金发起资金持有份额情况	52
§9	开放式基金份额变动	53
§10	重大事件揭示	53
10.1	基金份额持有人大会决议	53
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	53
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	53
10.4	基金投资策略的改变	53
10.5	本报告期持有的基金发生的重大影响事件	54
10.6	为基金进行审计的会计师事务所情况	54
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	54
10.8	基金租用证券公司交易单元的有关情况	54
10.9	其他重大事件	56
§11	影响投资者决策的其他重要信息	56
11.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	56
§12	备查文件目录	57
12.1	备查文件目录	57
12.2	存放地点	57
12.3	查阅方式	57

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	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）	
基金简称	易方达汇诚养老 2038 三年持有混合发起式（FOF）	
基金主代码	006860	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 4 月 30 日	
基金管理人	易方达基金管理有限公司	
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	202,909,805.40 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	易方达汇诚养老 2038 三年持有混合发起式（FOF）A	易方达汇诚养老 2038 三年持有混合发起式（FOF）Y
下属分级基金的交易代码	006860	017316
报告期末下属分级基金的份额总额	171,374,589.72 份	31,535,215.68 份

注：自 2022 年 11 月 16 日起，本基金增设 Y 类份额类别，份额首次确认日为 2022 年 11 月 25 日。

2.2 基金产品说明

投资目标	在投资管理过程中遵循各个阶段既定的投资比例，动态调整大类资产配置，控制基金下行风险，力争追求基金长期稳健增值。
投资策略	本基金属于目标日期策略基金，基金管理人根据设计的下滑曲线确定权益类资产与非权益类资产的配置比例，随着所设定目标日期的临近，本基金从整体趋势上将逐步降低权益类资产的配置比例，增加非权益类资产的配置比例。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。
业绩比较基准	基金合同生效日至 2023 年 12 月 31 日：45%×沪深 300 指数收益率+50%×中债新综合财富指数收益率+5%×活期存款利率；2024 年 1 月 1 日至 2028 年 12 月 31 日：40%×沪深 300 指数收益率+55%×中债新综合财富指数收益率+5%×活期存款利率；2029 年 1 月 1 日至 2033 年 12 月 31 日：30%×沪深 300 指数收益率+65%×中债新综合财富指数收益率+5%×活期存款利率；2034 年 1 月 1 日至 2038 年 12 月 31 日：20%×沪深 300 指数收益率+75%×中债新综合财富指数收益率+5%×活期存款利率
风险收益特征	本基金属于采用目标日期策略的基金中基金，2038 年 12 月 31 日为本基金的目标日期。从基金合同生效日至目标日期止，本基金的预期风险与预期收益水平将随着时间的流逝逐步降低。基金合同生效日至 2038 年 12 月

	31 日，理论上本基金的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）。
--	--

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	中国邮政储蓄银行股份有限公司
信 息 披 露 负 责 人	姓名	王玉	韩笑微
	联系电话	020-85102688	010-68858113
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	hanxiaowei@psbcoa.com.cn
客户服务电话		400 881 8088	95580
传真		020-38798812	010-68858120
注册地址		广东省珠海市横琴新区荣粤道 188号6层	北京市西城区金融大街3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	北京市西城区金融大街3号A座
邮政编码		510620	100808
法定代表人		刘晓艳	刘建军

2.4 信息披露方式

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

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（2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日）	
	易方达汇诚养老 2038 三年持有混合发起式（FOF）A	易方达汇诚养老 2038 三年持有混合发起式（FOF）Y
本期已实现收益	-771,014.95	-51,430.94
本期利润	2,417,042.68	-389,740.45
加权平均基金份额本期利润	0.0141	-0.0164
本期加权平均净值利润率	1.12%	-1.31%
本期基金份额净值增长率	1.16%	1.35%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
	易方达汇诚养老 2038 三年持有混合发起式（FOF）A	易方达汇诚养老 2038 三年持有混合发起式（FOF）Y
期末可供分配利润	41,661,383.46	7,584,580.53
期末可供分配基金份额利润	0.2431	0.2405
期末基金资产净值	213,035,973.18	39,119,796.21
期末基金份额净值	1.2431	1.2405
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
	易方达汇诚养老 2038 三年持有混合发起式（FOF）A	易方达汇诚养老 2038 三年持有混合发起式（FOF）Y
基金份额累计净值增长率	24.31%	1.08%

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

易方达汇诚养老 2038 三年持有混合发起式（FOF）A

阶段	份额净值增	份额净值增	业绩比较基	业绩比较基	①—③	②—④
----	-------	-------	-------	-------	-----	-----

	长率①	长率标准差 ②	准收益率③	准收益率标 准差④		
过去一个月	1.33%	0.47%	0.75%	0.39%	0.58%	0.08%
过去三个月	-2.23%	0.43%	-1.48%	0.37%	-0.75%	0.06%
过去六个月	1.16%	0.43%	1.08%	0.38%	0.08%	0.05%
过去一年	-4.28%	0.47%	-4.51%	0.44%	0.23%	0.03%
过去三年	8.66%	0.59%	3.53%	0.54%	5.13%	0.05%
自基金合同生 效起至今	24.31%	0.58%	10.72%	0.54%	13.59%	0.04%

易方达汇诚养老 2038 三年持有混合发起式（FOF）Y

阶段	份额净值增 长率①	份额净值增 长率标准差 ②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①－③	②－④
过去一个月	1.36%	0.47%	0.75%	0.39%	0.61%	0.08%
过去三个月	-2.14%	0.43%	-1.48%	0.37%	-0.66%	0.06%
过去六个月	1.35%	0.43%	1.08%	0.38%	0.27%	0.05%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生 效起至今	1.08%	0.44%	2.45%	0.39%	-1.37%	0.05%

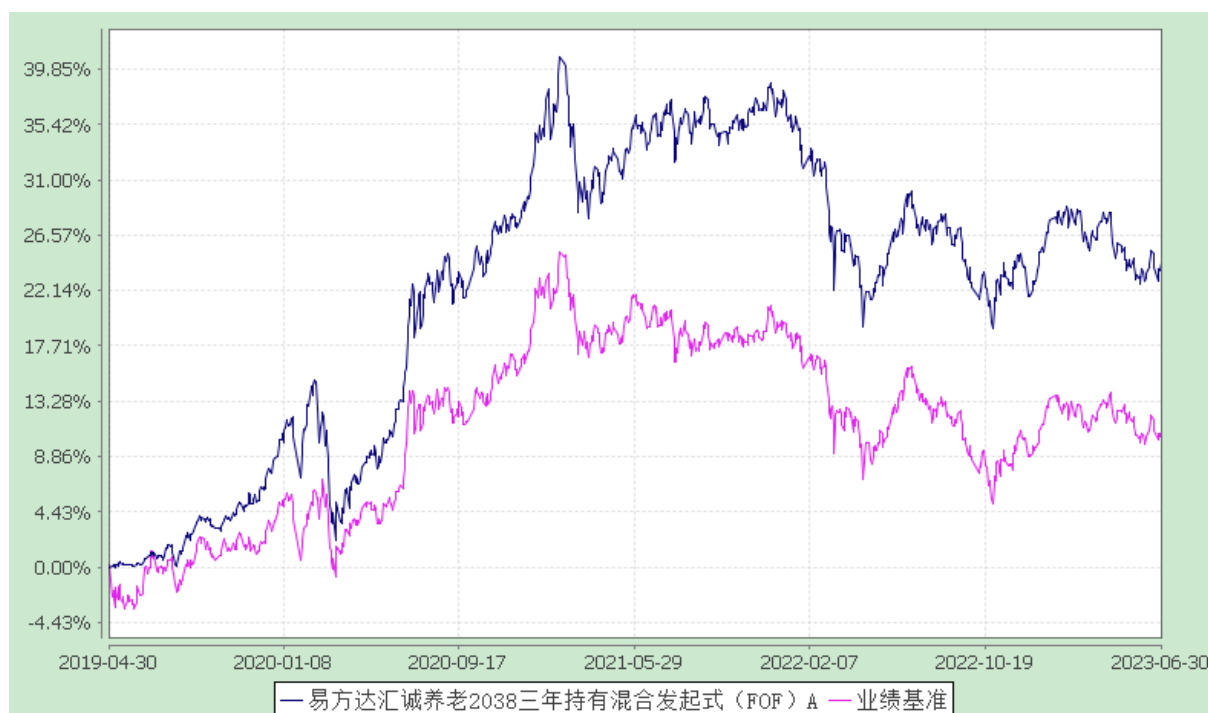
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达汇诚养老目标日期 2038 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）

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

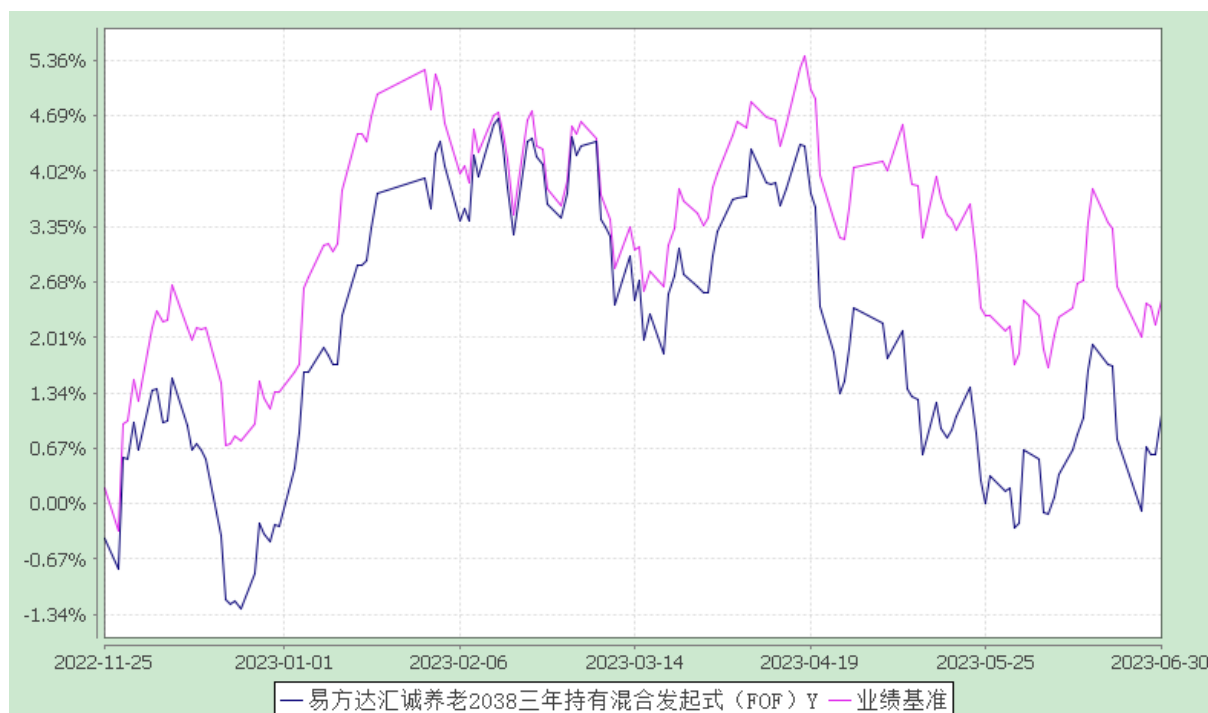
易方达汇诚养老 2038 三年持有混合发起式（FOF）A

（2019 年 4 月 30 日至 2023 年 6 月 30 日）



易方达汇诚养老 2038 三年持有混合发起式（FOF）Y

（2022 年 11 月 25 日至 2023 年 6 月 30 日）



注：1.自 2022 年 11 月 16 日起，本基金增设 Y 类份额类别，份额首次确认日为 2022 年 11 月 25 日，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

2.自基金合同生效至报告期末，A 类基金份额净值增长率为 24.31%，同期业绩比较基准收益率为 10.72%；Y 类基金份额净值增长率为 1.08%，同期业绩比较基准收益率为 2.45%。

84 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、另类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		
汪玲	本基金的基金经理，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）、易方达汇智稳健养老一年持有混合（FOF）、易方达汇智平衡养老三年持有混合（FOF）、易方达如意安和一年持有混合（FOF）、易方达汇欣平衡养老三年持有混合（FOF）、易方达如意兴安一年持有混合（FOF）的基金经理，FOF 投资决策委员会委员	2019-04-30	-	15 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任合众人寿保险股份有限公司资产管理中心基金研究员、基金投资经理，合众资产管理股份有限公司组合管理部基金投资经理，中国人寿养老保险股份有限公司投资中心组合管理部高级组合基金投资经理。
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）的基金经理	2022-12-31	-	6 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 23 次，其中 20 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，3 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

在去年底今年初，市场普遍的判断是国内经济逐步复苏、财政货币政策着力于稳增长，国内看好权益资产，看空长久期债券资产；美联储加息进入尾声，美国经济出现轻度衰退，随后便从 2 季度开始降息，美国看空股票，看多长久期债券。

但从这半年各类资产的价格表现来看，市场年初的预期基本上都出现了方向性偏差。根据万得资讯的数据统计，截止 2023 年 6 月 30 日，国内主要股票宽基指数均出现了小幅下跌，而 10 年期国债收益率却扎扎实实的下行了 20bp，走出了一波小牛市；标普 500 指数在上半年上涨幅度接近 10%，纳斯达克指数的涨幅接近 15%，而美国 10 年期国债收益率出现宽幅震荡，到半年末又回到了 3.8%

左右的高位。

首先，在基金选择层面，立足于分散配置不同投资策略的优质基金，以适应不同的市场环境，带来更好的投资体验，我们持续挖掘符合我们标准的优质基金，不断优化持仓品种。希望通过分散化持有不同投资策略、不同投资风格的优秀基金，让不同的基金在组合中发挥不同的作用，使得超额收益来源更加多元化，增强超额收益的稳定性。基金选择是本基金投资操作的重点，基于长期经验的积累和养老基金的投资目标，我们总结了以下的基金选择标准：1、投资策略长期有效，即基金的投资策略在长期来看是有效的，“有效”意味着通过该策略能够获取超额收益，“长期有效”意味着获取超额收益需要拉长时间，短期不一定必然能够获取超额收益；2、投资策略不漂移，即基金的投资策略相对稳定，不随着市场的变化出现漂移；3、投资策略可理解，即我们对基金的投资策略能理解、有认知，在市场短期变化的过程中能够有信心拿得住；4、收益风险特征可接受，即基金过去所表现出来的收益风险特征符合我们的预期和需求。

在市场不断变化的过程中，尤其是像今年这样的结构快速轮动的市场环境，使得我们对基金投资策略有效性的理解更加深刻了。某些看似无懈可击的投资策略，其实面临很大的人性挑战和超高能力要求，即使过去的投资业绩都非常优秀，也不能说明其业绩未来的持续性。通过多角度审视基金投资策略可能面临的风险点，我们更加倾向于选择那些在任何市场情况下，都能够安心拿住的基金。

其次，在资产配置层面，今年上半年市场结构性机会层出不穷，变幻莫测。

去年底大家对宏观经济复苏的预期较强，跟经济增长相关度较高的股票出现了不错的上涨。但到 2 季度，随着经济数据的不及预期，这类股票出现回落，震荡走低。

随后由人工智能 ChatGPT（OpenAI 公司研发的聊天机器人程序）掀起的 AI 相关科技行业出现大幅上涨，成为今年市场上最耀眼的板块。由于 AI 相关产业尚处于产业发展初期，技术变化快，应用前景尚不明朗，相关板块的股票呈现出涨跌快、波动大的特点。AI 相关股票的表现看上去非常诱人，但是一轮行情下来，最终真正赚到钱的投资者可能少之又少。

伴随其中的是以低估值高分红为代表的大盘价值股，一改往年疲弱的走势，取得了一定的绝对收益。除此之外，还有小盘股和微盘股，今年上半年也录得了一定的涨幅。

今年上半年所观察到的这些市场风格的变化其实并不是刚刚才发生的，而是在 2、3 年前就已经开始了。市场风格的变化在中期维度呈现出明显的“均值回归”特点。这恰如霍华德·马克斯在《周期》这本书中所描述的：投资人的心理和情绪也像钟摆一样周期性摆动。当一类资产或一种投资方法被市场认为是好的或对的，投资者会不断强化这类资产的价值或这类投资方法的有效性，而忽视其大幅高估的风险。小盘、红利、大盘价值等风格在过去 2 年相对主动偏股基金持续获取正的超额收益，

大盘成长风格在过去 3 年多的时间中持续取得负超额。这是我们过去一直超配小盘、低估值、价值等风格的部分原因，未来我们将重点关注大盘成长类风格可能存在的投资机会。

在面对快速轮动的结构性行情和纷繁复杂的市场变化的时候，我们仍然坚持通过优选基金获取长期超额收益，遵循“资产性价比比较”的方法，来审视整体组合的风险暴露，不断卖出那些性价比已经很低的资产，买入那些性价比已经很高的资产，这使得我们整个组合始终处于性价比更优的状态。这样的投资方法让我们能够相对从容的应对市场的快速变化，拨开迷雾，认清基金业绩表现背后的驱动因素。

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 1.2431 元，本报告期份额净值增长率为 1.16%，同期业绩比较基准收益率为 1.08%；Y 类基金份额净值为 1.2405 元，本报告期份额净值增长率为 1.35%，同期业绩比较基准收益率为 1.08%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，我们对中国未来经济持续增长和股市的长期回报充满信心，过去几年市场认可度非常高的高质量的核心资产，经过 2-3 年的下跌，股价已经回到了相对合理的位置，我们将持续关注这类资产未来的投资机会。

我们将继续立足于优选基金和资产配置，不断提升 FOF 投资组合的性价比，希望通过 FOF 产品给持有人提供一项服务：通过选择优质基金和配置性价比更高的资产，将资产原有的大幅波动变得相对平滑一些，提升产品的收益风险比，使得产品的预期收益不降低而风险相对更小，让投资者能够安心拿住，最终赚到钱。这是 FOF 基金最核心的价值所在，也是我们追求的投资目标。

本基金是养老目标日期基金，将遵循稳健投资的理念，立足养老产品的定位，秉承勤勉尽责的态度，为持有人创造更加优异而稳健的长期投资回报。

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

易方达汇诚养老 2038 三年持有混合发起式（FOF）A:本报告期内未实施利润分配。

易方达汇诚养老 2038 三年持有混合发起式（FOF）Y: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

本报告期内，中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在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）（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§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）

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	4,113,064.02	2,026,264.02
结算备付金		10,001.60	6,096.20
存出保证金		8,214.53	4,965.10
交易性金融资产	6.4.7.2	248,144,271.90	213,741,732.21
其中：股票投资		-	-
基金投资		235,764,048.89	202,827,102.46
债券投资		12,380,223.01	10,914,629.75
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		-	2,997,092.94
应收股利		718.07	-
应收申购款		171,505.53	1,677,745.19
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		252,447,775.65	220,453,895.66
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 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		46,518.11	11,073.28
应付管理人报酬		100,939.19	85,500.12
应付托管费		38,044.63	36,272.42
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		2,120.57	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	104,383.76	150,000.00
负债合计		292,006.26	282,845.82
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	202,909,805.40	179,205,394.71
未分配利润	6.4.7.8	49,245,963.99	40,965,655.13
净资产合计		252,155,769.39	220,171,049.84
负债和净资产总计		252,447,775.65	220,453,895.66

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.2431 元，Y 类基金份额净值 1.2405 元；基金份额总额 202,909,805.40 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 171,374,589.72 份，Y 类基金份额总额 31,535,215.68 份。

6.2 利润表

会计主体：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）

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		2,928,484.82	8,881,010.13
1.利息收入		33,769.98	29,685.70
其中：存款利息收入	6.4.7.9	33,180.39	25,793.55
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		589.59	3,892.15
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		24,003.46	50,387.72
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-	-
基金投资收益	6.4.7.11	-459,730.75	-27,872.47
债券投资收益	6.4.7.12	123,172.72	47,732.34

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	360,561.49	30,527.85
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	2,849,748.12	8,779,070.49
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	20,963.26	21,866.22
减：二、营业总支出		901,182.59	331,080.26
1. 管理人报酬		597,944.84	222,324.43
2. 托管费		228,284.36	98,404.19
3. 销售服务费		-	-
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		569.63	434.65
8. 其他费用	6.4.7.20	74,383.76	9,916.99
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,027,302.23	8,549,929.87
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,027,302.23	8,549,929.87
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		2,027,302.23	8,549,929.87

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：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）

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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（基金净值）	179,205,394.71	40,965,655.13	220,171,049.84
二、本期期初净资产（基金净值）	179,205,394.71	40,965,655.13	220,171,049.84
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	23,704,410.69	8,280,308.86	31,984,719.55

（一）、综合收益总额	-	2,027,302.23	2,027,302.23
（二）、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）	23,704,410.69	6,253,006.63	29,957,417.32
其中：1.基金申购款	24,411,142.14	6,438,113.83	30,849,255.97
2.基金赎回款	-706,731.45	-185,107.20	-891,838.65
（三）、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）	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	202,909,805.40	49,245,963.99	252,155,769.39
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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（基金净值）	20,060,138.08	7,645,560.13	27,705,698.21
二、本期期初净资产（基金净值）	20,060,138.08	7,645,560.13	27,705,698.21
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	150,034,629.96	43,160,042.74	193,194,672.70
（一）、综合收益总额	-	8,549,929.87	8,549,929.87
（二）、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）	150,034,629.96	34,610,112.87	184,644,742.83
其中：1.基金申购款	150,042,935.48	34,612,403.19	184,655,338.67
2.基金赎回款	-8,305.52	-2,290.32	-10,595.84
（三）、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）			
四、本期期末净资产（基金净值）	170,094,768.04	50,805,602.87	220,900,370.91

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：刘晓艳，主管会计工作负责人：陈荣，会计机构负责人：王永铿

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

易方达汇诚养老目标日期 2038 三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)(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[2019]801 号《关于准予易方达汇诚养老目标日期 2038 三年持有期混合型基金中基金(FOF)变更注册的批复》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)基金合同》公开募集。经向中国证监会备案,《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)基金合同》于 2019 年 4 月 30 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 10,000,000.00 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,基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。自 2022 年 11 月 16 日起,本基金增设 Y 类份额类别,份额首次确认日为 2022 年 11 月 25 日。

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》《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）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。

(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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	4,113,064.02
等于：本金	4,111,261.61
加：应计利息	1,802.41
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	4,113,064.02

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2023 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		155,993.01		
	市场	12,203,507.00		12,380,223.01	20,723.00
	银行间		-		
	市场	-		-	-
	合计	12,203,507.00	155,993.01	12,380,223.01	20,723.00
资产支持证券		-	-	-	-

基金	236,645,327.87	-	235,764,048.89	-881,278.98
其他	-	-	-	-
合计	248,848,834.87	155,993.01	248,144,271.90	-860,555.98

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 2023 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	104,383.76
合计	104,383.76

6.4.7.7 实收基金

易方达汇诚养老 2038 三年持有混合发起式（FOF）A

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	170,649,575.94	170,649,575.94

本期申购	1,431,745.23	1,431,745.23
本期赎回（以“-”号填列）	-706,731.45	-706,731.45
本期末	171,374,589.72	171,374,589.72

易方达汇诚养老 2038 三年持有混合发起式（FOF）Y

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	8,555,818.77	8,555,818.77
本期申购	22,979,396.91	22,979,396.91
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	31,535,215.68	31,535,215.68

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

易方达汇诚养老 2038 三年持有混合发起式（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	44,696,049.11	-5,647,222.10	39,048,827.01
本期利润	-771,014.95	3,188,057.63	2,417,042.68
本期基金份额交易产生的变动数	188,327.77	7,186.00	195,513.77
其中：基金申购款	371,815.15	8,805.82	380,620.97
基金赎回款	-183,487.38	-1,619.82	-185,107.20
本期已分配利润	-	-	-
本期末	44,113,361.93	-2,451,978.47	41,661,383.46

易方达汇诚养老 2038 三年持有混合发起式（FOF）Y

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	2,185,679.58	-268,851.46	1,916,828.12
本期利润	-51,430.94	-338,309.51	-389,740.45
本期基金份额交易产生的变动数	5,852,044.47	205,448.39	6,057,492.86
其中：基金申购款	5,852,044.47	205,448.39	6,057,492.86
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-

本期末	7,986,293.11	-401,712.58	7,584,580.53
-----	--------------	-------------	--------------

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	32,914.53
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	213.48
其他	52.38
合计	33,180.39

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	37,525,094.32
减：卖出/赎回基金成本总额	37,887,260.34
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	4,746.90
减：交易费用	92,817.83
基金投资收益	-459,730.75

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 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	129,631.42
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-6,458.70
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	123,172.72

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 2023年1月1日至2023年6月30日
----	----------------------------

卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	10,335,044.60
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	10,120,458.70
减：应计利息总额	221,044.60
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-6,458.70

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 2023年1月1日至2023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	360,561.49
合计	360,561.49

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1.交易性金融资产	2,849,748.12
——股票投资	-
——债券投资	27,620.60
——资产支持证券投资	-
——基金投资	2,822,127.52
——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	2,849,748.12

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
----	----------------------------

基金赎回费收入	-
其他	20,963.26
合计	20,963.26

6.4.7.18 持有基金产生的费用

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	75,897.49
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	1,150,626.31
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	213,562.63

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 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	14,876.39
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
合计	74,383.76

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、基金发起人
中国邮政储蓄银行股份有限公司	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 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	597,944.84	222,324.43
其中：支付销售机构的客户维护费	50,339.54	19,599.96

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）的一定比例计提。

（1）本基金 A 类基金份额的年管理费率为 0.90%，管理费的计算方法如下：

$$H = EA \times 0.90\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

$$EA = (\text{前一日的基金资产净值} - \text{前一日所持有的基金管理人管理的其他基金公允价值}) \times (\text{前一}$$

日 A 类基金资产净值/前一日基金资产净值），若为负数，则 EA 取 0

（2）本基金 Y 类基金份额的年管理费率为 0.45%，管理费的计算方法如下：

$$H = EY \times 0.45\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

$EY = (\text{前一日的基金资产净值} - \text{前一日所持有的基金管理人管理的其他基金公允价值}) \times (\text{前一日 Y 类基金资产净值} / \text{前一日基金资产净值})$ ，若为负数，则 EY 取 0

A 类基金份额及 Y 类基金份额的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. 客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用按照基金销售机构所销售基金的保有量作为基数进行计算，从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	228,284.36	98,404.19

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）的一定比例计提。

（1）本基金 A 类基金份额年托管费率为 0.20%，托管费的计算方法如下：

$$H = EA \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

$EA = (\text{前一日的基金资产净值} - \text{前一日所持有的基金托管人托管的其他基金公允价值}) \times (\text{前一日 A 类基金资产净值} / \text{前一日基金资产净值})$ ，若为负数，则 EA 取 0

（2）本基金 Y 类基金份额的年托管费率为 0.10%，托管费的计算方法如下：

$$H = EY \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

$EY = (\text{前一日的基金资产净值} - \text{前一日所持有的基金托管人托管的其他基金公允价值}) \times (\text{前一日 Y 类基金资产净值} / \text{前一日基金资产净值})$ ，若为负数，则 EY 取 0

A 类基金份额及 Y 类基金份额的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。

6.4.10.3 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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	易方达汇诚养老 2038三年持有混合 发起式（FOF）A	易方达汇诚养老 2038三年持有混合 发起式（FOF）Y	易方达汇诚养老 2038三年持有混合 发起式（FOF）A	易方达汇诚养老 2038三年持有混合 发起式（FOF）Y
报告期初持有的基金份额	158,760,120.48	-	10,000,000.00	-
报告期间申购/买入总份额	-	-	148,760,120.48	-
报告期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-	-	-
报告期末持有的基金份额	158,760,120.48	-	158,760,120.48	-
报告期末持有的基金份额占基金总额比例	92.6392%	-	93.3363%	-

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

易方达汇诚养老 2038 三年持有混合发起式（FOF）A

无。

易方达汇诚养老 2038 三年持有混合发起式（FOF）Y

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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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
中国邮政储蓄银行-活期存款	4,113,064.02	32,914.53	4,846,222.51	25,383.24

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国邮政储蓄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（2023 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 111,709,532.86 元，占本基金资产净值的比例为 44.30%。

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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）	-	1,746.88
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	19,476.60	30,295.45
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	340,981.01	178,413.55
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	83,994.79	43,650.66
当期交易所交易基金产生的交	29.85	256.01

易费（元）		
当期交易基金产生的转换费（元）	-	4,945.74

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

易方达汇诚养老 2038 三年持有混合发起式（FOF）A

本报告期内未发生利润分配。

易方达汇诚养老 2038 三年持有混合发起式（FOF）Y

本报告期内未发生利润分配。

6.4.12 期末（2023 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 2023 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 2023 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。

本基金属于采用目标日期策略的基金中基金，2038 年 12 月 31 日为本基金的目标日期。从基金合同生效日至目标日期止，本基金的预期风险与预期收益水平将随着时间的流逝逐步降低。基金合同生效日至 2038 年 12 月 31 日，理论上本基金的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 2023 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%(2022 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 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	12,380,223.01	10,914,629.75

合计	12,380,223.01	10,914,629.75
----	---------------	---------------

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 2023年6月30日	上年度末 2022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 2023年6月30日	上年度末 2022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 2023年6月30日	上年度末 2022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 2023年6月30日	上年度末 2022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 2023年6月30日	上年度末 2022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 2023 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约约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

本基金持有单只基金的市值，不高于本基金资产净值的 20%，且不持有其他基金中基金。本基金的基金管理人管理的全部基金中基金持有单只基金(ETF 联接基金除外)不超过被投资基金净资产

的 20%，被投资基金净资产规模以最近定期报告披露的规模为准。本基金投资于一家公司发行的证券(不含本基金所投资的基金份额)市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券(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 2023 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	4,113,064.02	-	-	-	4,113,064.02
结算备付金	10,001.60	-	-	-	10,001.60
存出保证金	8,214.53	-	-	-	8,214.53
交易性金融资产	12,380,223.01	-	-	235,764,048.89	248,144,271.90
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	718.07	718.07
应收申购款	-	-	-	171,505.53	171,505.53
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	16,511,503.16	-	-	235,936,272.49	252,447,775.65

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	-	-	-	46,518.11	46,518.11
应付管理人报酬	-	-	-	100,939.19	100,939.19
应付托管费	-	-	-	38,044.63	38,044.63
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	2,120.57	2,120.57
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	104,383.76	104,383.76
负债总计	-	-	-	292,006.26	292,006.26
利率敏感度缺口	16,511,503.16	-	-	235,644,266.23	252,155,769.39
上年度末 2022 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	2,026,264.02	-	-	-	2,026,264.02
结算备付金	6,096.20	-	-	-	6,096.20
存出保证金	4,965.10	-	-	-	4,965.10
交易性金融资产	10,914,629.75	-	-	202,827,102.46	213,741,732.21
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资 产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	2,997,092.94	2,997,092.94
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	1,677,745.19	1,677,745.19
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	12,951,955.07	-	-	207,501,940.59	220,453,895.66

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	-	-	-	11,073.28	11,073.28
应付管理人报酬	-	-	-	85,500.12	85,500.12
应付托管费	-	-	-	36,272.42	36,272.42
应付销售服务费	-	-	-	-	-
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	-	-	-	150,000.00	150,000.00
负债总计	-	-	-	282,845.82	282,845.82
利率敏感度缺口	12,951,955.07	-	-	207,219,094.77	220,171,049.84

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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	1.市场利率下降 25 个基点	13,044.22	3,862.20
	2.市场利率上升 25 个基点	-13,020.49	-3,856.34

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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	235,764,048.89	93.50	202,827,102.46	92.12
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	235,764,048.89	93.50	202,827,102.46	92.12

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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	12,040,734.93	10,829,011.87
	2.业绩比较基准下降 5%	-12,040,734.93	-10,829,011.87

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 2023 年 6 月 30 日
第一层次	235,764,048.89
第二层次	12,380,223.01
第三层次	-
合计	248,144,271.90

6.4.14.2 公允价值所属层次间的重大变动

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；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，确定相关股票、债券和基金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	235,764,048.89	93.39
3	固定收益投资	12,380,223.01	4.90
	其中：债券	12,380,223.01	4.90
	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	4,123,065.62	1.63
8	其他各项资产	180,438.13	0.07
9	合计	252,447,775.65	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	12,380,223.01	4.91
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	12,380,223.01	4.91

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	019694	23 国债 01	71,000	7,178,784.71	2.85
2	019663	21 国债 15	45,000	4,590,650.96	1.82
3	019679	22 国债 14	6,000	610,787.34	0.24

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：

本基金属于目标日期策略基金，基金管理人根据设计的下滑曲线确定权益类资产与非权益类资产的配置比例，随着所设定目标日期的临近，本基金从整体趋势上将逐步降低权益类资产的配置比例，增加非权益类资产的配置比例。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。资产配置策略在根据下滑曲线确定的投资比例范围之内通过战略资产配置与战术资产配置确定各个大类资产的配置比例。本基金根据下滑曲线在不同时期均设定了权益类资产与非权益类资产投资比例范围。本基金的战略资产配置策略即在满足各个时间段约定的权益类资产与非权益类资产投资比例限制的前提下，确定股票、债券、商品、货币等各类资产的资产配置比例。战术资产配置是根据经济状况与市场环境对资产配置进行动态调整，进一步优化配置、增强收益的方法。本基金使用的战术资产配置策略主要基于对宏观经济面、政策面、基本面、技术面、估值面的深入分析，形成战术配置观点。通过战略资产配置策略与战术资产配置策略，本基金将最终形成目标资产配置比例，并以此指导后续基金的配置。基金筛选策略通过全方位的定量和定性分析筛选出符合基金管理人要求的标的基金，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。基金配置策略是通过对短周期内的基金多因子分解，结合公开披露的信息估算拟投资基金的最新的资产配置比例和短期的风格定位，通过优化求解的方法，得到匹配目标资产配置比例的最优基金组合。

2.风险说明：

本基金投资于其他基金的比例不低于本基金资产的 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 QDII 基金的特定风险。本基金可投资于 QDII 基金，主要存在如下风险：①QDII 基金主要投资境外市场，因此本基金投资 QDII 基金时，将间接承担境外市场波动以及汇率波动的风险；②按照目前的业务规则，QDII 基金的赎回款项将在 T+10 内进行支付（T 为赎回申请日），晚于普通境内基金的支付时间。因此，可能存在 QDII 基金赎回款到账时间较晚，本基金无法及时支付投资者赎回款项的风险；③由于投资 QDII 基金，正常情况下，本基金将于 T+2 日（T 日为开放日）对 T 日的基金资产净值进行估值，T+3 日对投资人申购、赎回申请的有效性进行确认，投资人可于 T+4 日到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况，这将导致投资者承担更长时间基金净值波动的风险。

（5）投资香港互认基金的特定风险

香港互认基金是指依照香港法律在香港设立、运作和公开销售，并经中国证监会批准在内地公开销售的单位信托、互惠基金或者其他形式的集体投资计划，香港互认基金管理人委托内地符合条件的机构作为代理人办理基金在境内的相关业务。本基金可投资于香港互认基金，主要存在如下风险：

1）香港互认基金境外投资风险

香港互认基金投资标的主要包括内地以外的其他司法管辖区（简称为“境外”）的金融工具，投资香港互认基金面临不同于内地投资标的的投资风险，包括但不限于境外投资的市场风险、政府管制风险、政治风险、法律风险、汇率风险、基金的税务风险、境外特殊标的的风险等，从而可能增加本基金的投资风险。

①境外投资市场风险

境外投资受到所投资市场宏观经济运行情况、货币政策、财政政策、产业政策、税法、汇率、交易规则、结算、托管以及其他运作风险等多种因素的影响，上述因素的波动和变化可能会使香港互认基金资产面临潜在风险。

②政府管制风险

境外市场与内地市场的管制程度和具体措施不同，当地政府可能通过对财政、货币、产业等方

面的政策进行管制，由此导致市场波动而影响香港互认基金收益。

③政治风险

因政治局势变化（如战争、罢工等）可能导致当地市场出现较大波动，从而给香港互认基金的投资收益造成直接或间接的影响。此外，香港互认基金所投资市场可能会不时采取某些管制措施，如资本或外汇管制、对公司或行业的国有化以及征收高额税收等，从而对香港互认基金收益带来不利影响。

④法律风险

由于境外市场法律法规的颁布或变更，可能导致香港互认基金的某些投资行为受到限制，从而使得香港互认基金资产面临损失的可能。

⑤汇率风险

香港互认基金的计价基础货币可能为美元、港币等外币，因此，本基金以人民币投资香港互认基金，可能承受由于人民币兑外币的汇率波动而产生的外汇风险。外币之间的汇率变化以及换汇费用将会影响本基金的投资收益。

⑥基金的税务风险

由于境外市场在税务方面的法律法规与内地存在一定差异，境外市场可能会要求香港互认基金就股息、利息、资本利得等收益向当地税务机构缴纳税金，该行为会使香港互认基金收益受到一定影响。此外，境外市场的税收规定可能发生变化，或者实施具有追溯力的修订，从而导致本基金在该市场缴纳额外税项，影响香港互认基金收益。

⑦境外特殊标的风险

不同于内地证券投资基金，香港互认基金的投资标的可能包括低于投资级别或未评级的债券、其他集合投资计划、房地产投资信托基金、商品、期权、股票挂钩票据等衍生工具等。

这些不同于内地的特殊投资标的存在特殊风险，可能使得香港互认基金资产面临损失。

2) 香港基金互认机制相关风险

香港互认基金在内地销售需持续满足相关法规及监管要求，如基金在运作过程中不符合互认基金的条件或香港基金互认机制终止，相关香港互认基金可能会暂停或终止在内地销售；此外，香港互认基金在内地销售还可能面临内地代理人、内地销售机构或内地登记结算机构的操作风险、技术风险，跨境数据传输和跨境资金结算的系统风险、税收风险等，从而可能增加本基金的投资风险。

①香港互认基金暂停或终止内地销售的风险

若基金管理人或互认基金不满足中国证监会规定的香港互认基金条件，或监管部门终止香港基金互认机制，相关的香港互认基金将可能无法继续在内地销售。此外，香港互认基金将受到全面的

额度限制。若在内地销售的全部香港互认基金的销售额度达到中国证监会和/或香港证监会和/或国家外汇管理局和/或其他监管机构规定的额度或者不时调整的额度，香港互认基金将暂停接受内地投资者的申购申请。

②内地代理人、内地销售机构或内地登记结算机构的操作风险、技术风险

内地投资者的申购、赎回由内地销售机构、内地代理人及/或内地登记结算机构与互认基金的基金管理人、行政管理人进行数据清算和资金交收，并由名义持有人代名持有内地投资者的基金份额。内地销售机构、内地代理人或内地登记结算机构在业务各环节操作过程中，因操作失误或违反操作规程等原因可能引致风险，可能因为技术系统的故障或者差错而影响清算交收的正常进行，或者导致投资者的利益受到影响。

③跨境数据传输和跨境资金结算的系统风险

申购、赎回香港互认基金的数据清算和资金交收将通过内地登记结算机构的基金登记结算系统平台和基金管理人或行政管理人采用的登记结算系统平台进行传输和交换，可能会发生并非由相关参与主体的过错而导致的技术系统故障或者差错而影响清算交收的正常进行。

④税收风险

由于中国内地与香港的税收政策存在差异，可能导致在内地销售的香港互认基金份额的资产回报有别于在香港销售的份额。同时，中国内地关于在内地销售的香港互认基金与内地普通证券投资基金之间在税收政策上也存在差异，例如香港互认基金份额转让需支付香港印花税以及份额转让定额税项，内地个人投资者从香港互认基金分配获得的收益需缴纳个人所得税等，以上税收差异可能使内地销售的互认基金份额的投资收益和回报受到影响。

⑤名义持有人机制风险

与内地基金的注册登记规则不同，内地投资者持有的互认基金份额将由名义持有人代名持有并以名义持有人的名义登记为份额持有人。内地投资者并不会被基金注册登记机构直接登记于份额持有人登记册上。虽然在此安排下内地投资者仍是互认基金份额的实益拥有人，但名义持有人是该等基金份额法律上的拥有人。在此情况下，内地投资者与互认基金管理人、受托人并无任何直接合约关系。内地投资者对互认基金管理人及 / 或受托人若有任何权利主张，可通过名义持有人向互认基金管理人及 / 或受托人提出，相应费用由内地投资者自行承担。

⑥强制赎回风险

对于内地销售的互认基金份额而言，若赎回部分基金份额将导致赎回后其持有的相应类别的基金份额的价值少于互认基金规定的最低持有额，互认基金管理人有权要求剩余的基金份额一并被全部赎回。除此之外，若互认基金管理人认为基金投资者继续持有互认基金份额存在违反任何法律法

规、基金合同约定或其他互认基金要求（如可能对互认基金或其他基金份额持有人产生不利的监管、税务或财政后果）的情况下，互认基金管理人可以强制赎回基金投资者持有的互认基金份额。

⑦基金份额净值计算和差错处理差异的风险

香港互认基金与内地公募基金根据适用的法规以及各自基金合同约定，其在基金份额净值计算、估值错误处理规则等方面存在差异，相应的过错责任方按基金合同约定承担赔偿责任的处理也会有所不同，由此可能增加本基金的相关投资风险。

（6）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。

（7）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。

（8）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。

（9）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。

（10）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	110008	易方达稳 健收益债 券 B	契约型开 放式	21,915,12 7.01	30,433,53 6.88	12.07	是
2	002351	易方达裕 祥回报债 券 A	契约型开 放式	12,118,64 0.86	18,783,89 3.33	7.45	是
3	161115	易方达岁 丰添利债 券(LOF)A	契约型开 放式	11,163,96 4.41	17,681,48 6.83	7.01	是
4	000621	易方达现 金增利货 币 B	契约型开 放式	9,000,673. 64	9,000,673. 64	3.57	是
5	016479	易方达裕 丰回报债 券 C	契约型开 放式	5,080,319. 72	8,463,812. 65	3.36	是
6	011066	大成高新 技术产业 股票 C	契约型开 放式	2,176,108. 49	8,182,167. 92	3.24	否
7	003293	易方达科 瑞灵活配 置混合	契约型开 放式	3,655,983. 27	7,116,371. 44	2.82	是
8	001603	易方达安 盈回报混 合 A	契约型开 放式	3,077,329. 70	6,474,701. 69	2.57	是
9	006102	浙商丰利 增强债券	契约型开 放式	3,336,581. 82	5,907,084. 45	2.34	否
10	001882	中欧价值 发现混合 E	契约型开 放式	2,261,638. 82	5,706,114. 74	2.26	否
11	519915	富国消费 主题混合 A	契约型开 放式	1,985,597. 87	5,063,274. 57	2.01	否
12	005847	富国沪港 深业绩驱 动混合 A	契约型开 放式	3,211,469. 95	5,046,825. 03	2.00	否
13	004965	泓德致远 混合 A	契约型开 放式	2,687,406. 33	4,985,407. 48	1.98	否
14	013331	富国中证	契约型开	2,501,932.	4,897,782.	1.94	否

		1000 指数 增强 (LOF)C	放式	31	69		
15	003292	嘉实优势 成长混合 A	契约型开 放式	3,896,336. 71	4,889,902. 57	1.94	否
16	515080	招商中证 红利 ETF	契约型开 放式	3,353,000. 00	4,808,202. 00	1.91	否
17	968050	摩根国际 债券人民 币对冲累 计	契约型开 放式	439,063.6 8	4,579,434. 18	1.82	否
18	016858	国金量化 多因子股 票 C	契约型开 放式	2,174,745. 52	4,503,897. 97	1.79	否
19	008246	圆信永丰 致优混合 C	契约型开 放式	2,216,394. 95	4,344,134. 10	1.72	否
20	001583	安信新常 态股票 A	契约型开 放式	2,693,428. 94	4,050,647. 78	1.61	否
21	001883	中欧新动 力混合 (LOF)E	契约型开 放式	1,287,467. 10	3,950,206. 56	1.57	否
22	001885	中欧新蓝 筹混合 E	契约型开 放式	2,029,689. 68	3,774,613. 90	1.50	否
23	005267	嘉实价值 精选股票	契约型开 放式	1,887,187. 08	3,625,286. 38	1.44	否
24	519773	交银数据 产业灵活 配置混合 A	契约型开 放式	1,625,271. 80	3,397,305. 64	1.35	否
25	001018	易方达新 经济混合	契约型开 放式	928,880.6 2	3,378,338. 81	1.34	是
26	519736	交银新成 长混合	契约型开 放式	990,927.5 2	3,324,561. 83	1.32	否
27	013142	华商乐享 互联灵活 配置混合 C	契约型开 放式	1,439,936. 31	3,287,374. 60	1.30	否
28	002593	富国美丽 中国混合 A	契约型开 放式	1,387,147. 45	3,162,696. 19	1.25	否
29	110023	易方达医 疗保健行	契约型开 放式	935,745.9 7	3,104,805. 13	1.23	是

		业混合					
30	001955	中欧养老混合 A	契约型开放式	921,332.66	2,980,234.76	1.18	否
31	163417	兴全合宜混合 (LOF)A	契约型开放式	2,037,149.00	2,930,031.41	1.16	否
32	001857	易方达现代服务混合	契约型开放式	1,567,546.79	2,791,800.83	1.11	是
33	006551	中庚价值领航混合	契约型开放式	1,150,622.57	2,583,147.67	1.02	否
34	501022	银华鑫盛灵活配置混合 (LOF)A	契约型开放式	1,102,960.85	2,510,338.89	1.00	否
35	110009	易方达价值精选混合	契约型开放式	2,095,381.78	2,394,392.76	0.95	是
36	519195	万家品质混合 A	契约型开放式	840,759.20	2,392,716.61	0.95	否
37	012940	中泰星元灵活配置混合 C	契约型开放式	977,165.92	2,309,336.22	0.92	否
38	010709	安信医药健康股票 A	契约型开放式	1,844,088.86	2,281,691.15	0.90	否
39	515900	博时央企创新驱动 ETF	契约型开放式	1,635,000.00	2,266,110.00	0.90	否
40	007549	中泰开阳价值优选混合 A	契约型开放式	1,107,155.55	2,187,960.80	0.87	否
41	007130	中庚小盘价值股票	契约型开放式	886,130.40	2,088,166.29	0.83	否
42	009274	融通健康产业灵活配置混合 C	契约型开放式	663,129.97	1,992,042.43	0.79	否
43	011230	创金合信数字经济主题股票 C	契约型开放式	1,255,492.78	1,839,673.57	0.73	否
44	450009	国富中小盘股票 A	契约型开放式	579,134.84	1,448,879.54	0.57	否

45	513690	博时恒生 高股息 ETF	契约型开 放式	1,603,400. 00	1,247,445. 20	0.49	否
46	513050	易方达中 证海外中 国互联网 50(QDII- ETF)	契约型开 放式	1,127,257. 00	1,126,129. 74	0.45	是
47	513100	国泰纳 斯达克 100(QDII- ETF)	契约型开 放式	842,947.0 0	927,241.7 0	0.37	否
48	009049	易方达高 端制造混 合发起式	契约型开 放式	410,064.5 4	711,133.9 3	0.28	是
49	519133	海富通改 革驱动混 合	契约型开 放式	199,980.4 9	436,777.3 9	0.17	否
50	515180	易方达中 证红利 ETF	契约型开 放式	192,900.0 0	248,455.2 0	0.10	是
51	501025	鹏华香港 银行指数 (LOF)A	契约型开 放式	137,497.0 0	145,801.8 2	0.06	否

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）。

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	8,214.53
2	应收清算款	-
3	应收股利	718.07

4	应收利息	-
5	应收申购款	171,505.53
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	180,438.13

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
易方达汇诚养老 2038 三年持有混 合发起式（FOF） A	2,085	82,194.05	158,760,120.48	92.64%	12,614,469.24	7.36%
易方达汇诚养老 2038 三年持有混 合发起式（FOF） Y	10,160	3,103.86	0.00	0.00%	31,535,215.68	100.00 %
合计	12,245	16,570.83	158,760,120.48	78.24%	44,149,684.92	21.76%

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	易方达汇诚养老 2038 三年持有混合发起式（FOF）A	1,596.35	0.0009%
	易方达汇诚养老 2038 三年持有混合发起式（FOF）Y	25,793.92	0.0818%
	合计	27,390.27	0.0135%

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	易方达汇诚养老 2038 三年持有混合发起式（FOF）A	0
	易方达汇诚养老 2038 三年持有混合发起式（FOF）Y	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	易方达汇诚养老 2038 三年持有混合发起式（FOF）A	0
	易方达汇诚养老 2038 三年持有混合发起式（FOF）Y	0
	合计	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	158,760,120.48	78.2417%	10,000,000.00	4.9283%	不少于 3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-

其他	-	-	-	-	-
合计	158,760,120.48	78.2417%	10,000,000.00	4.9283%	-

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达汇诚养老 2038 三年持有混合发起式（FOF）A	易方达汇诚养老 2038 三年持有混合发起式（FOF）Y
基金合同生效日（2019 年 4 月 30 日）基金份额总额	10,000,000.00	-
本报告期期初基金份额总额	170,649,575.94	8,555,818.77
本报告期基金总申购份额	1,431,745.23	22,979,396.91
减：本报告期基金总赎回份额	706,731.45	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	171,374,589.72	31,535,215.68

§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 2023 年 4 月 22 日发布公告，自 2023 年 4 月 22 日起聘任王骏先生为副总经理级高级管理人员（首席市场官）。

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**

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	易方达基金管理有限公司
受到稽查或处罚等措施的时间	2023-03-24
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会广东监管局
受到的具体措施类型	出具警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	个别规定及制度未严格执行
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	已整改完成
其他	/

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	
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-

银河证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元，新增交易单元的证券公司为东吴证券股份有限公司。

b) 本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。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
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	11,602,130.00	100.00%	4,000,000.00	100.00%	-	-	12,441,494.62	83.73%
兴业证券	-	-	-	-	-	-	2,418,016.61	16.27%
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
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基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告	中国证券报	2023-01-20
2	易方达基金管理有限公司旗下基金 2022 年年度报告提示性公告	中国证券报	2023-03-30
3	易方达基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-31
4	易方达基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告	中国证券报	2023-04-21
5	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-04-22
6	易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加招商银行费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-06-19

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2023 年 01 月 01 日~2023 年 06 月 30 日	158,760,120.48	0.00	0.00	158,760,120.48	78.24 %
产品特有风险							
报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者在满足最短持有期限后的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；如个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；本基金基金合同生效满三年后继续存续时，若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。							

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1.中国证监会关于准予易方达汇诚养老目标日期 2038 三年持有期混合型基金中基金（FOF）变更注册的批复；

2.《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）基金合同》；

3.《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）托管协议》；

4.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；

5.基金管理人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇二三年八月三十日