

泓德优质治理灵活配置混合型证券投资基金

2024 年中期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人:泓德基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

送出日期:2024 年 08 月 29 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年8月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2024年1月1日起至2024年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	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
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	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	57
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	58
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	58
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	58
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	58
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	58
7.12 投资组合报告附注	58
§8 基金份额持有人信息	59
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	59

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	60
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	60
§9 开放式基金份额变动	60
§10 重大事件揭示	60
10.1 基金份额持有人大会决议	60
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	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	61
10.4 基金投资策略的改变	61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	61
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	61
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	61
10.8 其他重大事件	65
§11 影响投资者决策的其他重要信息	65
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	65
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	66
§12 备查文件目录	66
12.1 备查文件目录	66
12.2 存放地点	66
12.3 查阅方式	66

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泓德优质治理灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	泓德优质治理混合
基金主代码	011530
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021年03月23日
基金管理人	泓德基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	794,753,082.14份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，重点挖掘优质治理型公司的投资机会，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金根据对宏观经济、市场面、政策面等因素进行定量与定性相结合的分析研究，动态调整基金资产在各大类资产间的分配比例，控制市场风险，提高配置效率。本基金强调公司治理结构的研究，着重考察公司治理结构是否良好，是否具有持续的竞争优势以及股票估值是否合理，重点挖掘股票价格低于公司内在价值的优质治理型公司的投资机会。债券投资采取适当的久期配置策略、个券选择策略、可转换债券投资策略、证券公司短期公司债券投资策略、资产支持证券投资策略。本基金本着谨慎原则，从风险管理角度出发，适度参与股指期货、国债期货投资。
业绩比较基准	中证800指数收益率×70%+中证港股通综合指数收益率×10%+中国债券综合全价指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其长期预期风险与预期收益低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通

	<p>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。</p> <p>本基金可投资于新三板精选层股票，可能面临新三板市场因投资环境、投资标的以及交易规则等差异带来的流动性风险、挂牌公司经营风险、挂牌公司降层风险、终止挂牌的风险和精选层市场股价波动风险等特有风险。</p>
--	---

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		泓德基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李晓春	郭明
	联系电话	010-59850177	010-66105799
	电子邮箱	lixiaochun@hongdefund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4009-100-888	95588
传真		010-59850195	010-66105798
注册地址		西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦1206室	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		北京市西城区德胜门外大街125号	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		100088	100140
法定代表人		王德晓	廖林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.hongdefund.com
基金中期报告备置地	北京市西城区德胜门外大街125号

点	
---	--

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	泓德基金管理有限公司	北京市西城区德胜门外大街125号

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2024年01月01日-2024年06月30日)	
	本期已实现收益	13,499,462.95
本期利润	19,040,249.46	
加权平均基金份额本期利润	0.0238	
本期加权平均净值利润率	3.84%	
本期基金份额净值增长率	4.02%	
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2024年06月30日)	
	期末可供分配利润	-300,774,082.42
	期末可供分配基金份额利润	-0.3784
	期末基金资产净值	493,978,999.72
	期末基金份额净值	0.6216
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2024年06月30日)	
	基金份额累计净值增长率	-37.84%

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，采用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（为期末余额，不是当期发生数）。

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

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	-3.18%	0.64%	-3.02%	0.42%	-0.16%	0.22%
过去三个月	0.08%	0.76%	-1.28%	0.64%	1.36%	0.12%
过去六个月	4.02%	0.96%	0.00%	0.80%	4.02%	0.16%
过去一年	-10.48%	0.85%	-8.28%	0.73%	-2.20%	0.12%
过去三年	-43.00%	1.12%	-25.29%	0.83%	-17.71%	0.29%
自基金合同生效起至今	-37.84%	1.09%	-22.97%	0.82%	-14.87%	0.27%

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

本基金的业绩比较基准为：中证800指数收益率×70%+中证港股通综合指数收益率×10%+中国债券综合全价指数收益率×20%

基准指数的构建原则如下：

(1) 中证800指数是由中证指数有限公司编制的，其成份股是由沪深300指数和中证500指数成份股一起构成，中证800指数综合反映沪深股票市场内大中小市值公司的整体状况，较好地反映了A股市场的总体趋势。

(2) 中证港股通综合指数是由中证指数有限公司编制，选取符合港股通资格的普通股作为样本股，采用自由流通市值加权计算，是反映港股通范围内上市公司的整体状况和走势的具有代表性的一种股价指数。

(3) 中国债券综合全价指数是由中债金融估值中心有限公司编制，样本债券涵盖的范围全面，具有广泛的市场代表性，涵盖主要交易市场（银行间市场、交易所市场等）、不同发行主体（政府、企业等）和期限（长期、中期、短期等），能够很好地反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势。

(4) 由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照70%、10%、20%的比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

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

泓德优质治理灵活配置混合型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势
对比图
(2021年03月23日-2024年06月30日)



注：根据基金合同的约定，本基金建仓期为6个月，截至报告期末，本基金的各项投资比例符合基金合同关于投资范围及投资限制规定。

§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

本基金基金管理人为泓德基金管理有限公司（以下简称“公司”或“泓德基金”），成立于2015年3月3日，是经中国证监会证监许可[2015]258号文批准设立的公募基金管理公司。公司注册资本为人民币1.43亿元，公司注册地拉萨市。

泓德基金自成立以来，始终以“客户利益最大化”为己任，聚焦主动投资管理。公司建立了科学规范的公司治理结构，全面有效的风险管理体系，稳健的运营保障体系，专业高效的市场服务体系，中长期的激励约束机制，致力于成为能持续为客户创造价值的、受人尊重的专业化资产管理公司。泓德基金坚持长期价值投资理念，以更好地保障客户利益为出发点，强调投资长周期性，同时在产品设计以及产品销售环节配合投资理念的落地执行。

公司已覆盖从公募到专户、从股票投资到固定收益投资、从低风险到高风险等不同产品类型，公募基金产品涵盖股票型、债券型、混合型、货币型等基金品种。

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	证券	说明
----	----	--------	----	----

		基金经理（助理） 期限		从业 年限	
		任职 日期	离任 日期		
苏昌景	本基金的基金经理、 量化投资部总监	2021- 03-23	-	16年	硕士研究生，具有基金从业资格，曾任本公司研究部研究员，国都证券股份有限公司研究所研究员、资产管理总部总经理助理、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中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

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《中华人民共和国证券投资基金法》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，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

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

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《泓德基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

本报告期内，本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（1日内、3日内、5日内）的同向交易价差进行了专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未出现超过该证券当日成交量的5%的情况。本报告期，未发现本基金存在异常交易行为。

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

上半年市场对经济的定价偏悲观，与经济高相关性的行业持续回落，高股息率的传统防御性行业、受益于大宗商品涨价的行业以及出口优势行业表现相对较好；风格方面，大盘股大幅跑赢小盘股，这一方面是由于市场风险偏好持续下降，投资者重视大盘股尤其是红利股的盈利可靠性，另一方面也受新国九条加大对于上市公司违法行为的监管力度影响，投资者远离存在较多经营不善企业的中小盘股。

报告期内，我们延续去年底产品的投资策略并持续进行优化：首先，通过“基本面量化模型”甄选构建优质低估“价值股票池”，模型侧重企业“经营稳定性”、“长期成长能力”、“潜在分红能力”以及“估值安全边际”四个维度的考量；然后，通过“多因子量化模型”进行股票的短周期定价，模型在上述价值股票池中进行专项训练，不断强化对价值类股票的定价能力和动态适应能力；最后，在组合层面进行风险管理，控制行业偏离、估值、盈利、波动性等，风险管理着眼于控制组合的潜在最大回撤，致力于在相对低回撤的基础上创造有竞争力的投资回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末泓德优质治理混合基金份额净值为0.6216元，本报告期内，基金份额净值增长率为4.02%，同期业绩比较基准收益率为0.00%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前A股市场的股权风险溢价已经高于历史长期均值一个标准差，尽管短期内市场受新增资金匮乏的影响或持续处于盘整阶段，但后续随着房地产和财政政策进一步放松，A股估值还是有望在下半年出现温和回升。

在全球局势复杂化加剧、上市公司监管趋严的背景下，低估值且经营稳定的上市公司具备非常高的安全边际，不过部分高股息的股息率吸引力确实已经下降不少。我们仍然坚持前期几个报告期的判断，公司治理优异并且能够持续提高股东回报的低估值企业将是未来几年市场最大的机会所在，本产品的投资策略也将采用系统化的投资方法持续聚焦和挖掘优质低估企业的投资机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格按照《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，对基金所持投资品种进行估值。

本基金管理人制定了证券投资基金估值政策与估值程序,设立基金估值委员会,估值委员会负责指导和监督整个估值流程。估值委员会成员均具有多年证券、基金从业经验,熟悉相关法律法规,具备投资、研究、基金估值运作、风险管理或法律合规等领域的专业胜任能力。基金经理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。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任,当存有异议时,托管人有责任要求基金管理公司作出合理解释,通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已分别与中债金融估值中心有限公司和中证指数有限公司签署服务协议,由其分别按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种和在交易所市场交易或挂牌的部分债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定以及本基金基金合同第十六部分中对基金利润分配原则的约定,本基金本报告期内未实施利润分配。

本基金截至2024年06月30日,期末可供分配利润为-300,774,082.42元,其中:未分配利润已实现部分为-295,660,943.82元,未分配利润未实现部分为-5,113,138.60元。

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

本报告期内,本基金管理人无应说明的预警信息。

§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,本基金托管人在对本基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，本基金的管理人--泓德基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现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

本托管人依法对泓德基金管理有限公司编制和披露的本基金2024年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、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：泓德优质治理灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2024年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	30,735,974.71	5,968,142.16
结算备付金		3,277,144.35	1,671,086.33
存出保证金		207,324.46	131,097.95
交易性金融资产	6.4.7.2	462,754,690.94	475,629,350.04
其中：股票投资		442,281,341.21	454,990,606.67
基金投资		-	-
债券投资		20,473,349.73	20,638,743.37
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		191,458.66	1,879,841.81
应收股利		-	-

应收申购款		3,419.11	4,177.38
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		497,170,012.23	485,283,695.67
负债和净资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	1,756,957.73
应付赎回款		837,458.73	115,874.73
应付管理人报酬		494,564.92	485,930.97
应付托管费		82,427.49	80,988.47
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	0.46
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	1,776,561.37	1,208,505.51
负债合计		3,191,012.51	3,648,257.87
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	794,753,082.14	805,954,003.19
未分配利润	6.4.7.8	-300,774,082.42	-324,318,565.39
净资产合计		493,978,999.72	481,635,437.80
负债和净资产总计		497,170,012.23	485,283,695.67

注：报告截止日2024年06月30日，基金份额净值0.6216元，基金份额总额794,753,082.14份。

6.2 利润表

会计主体：泓德优质治理灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至202 3年06月30日
一、营业总收入		22,591,845.37	-47,729,684.96
1.利息收入		64,407.74	66,037.59
其中：存款利息收入	6.4.7.9	54,566.64	66,037.59
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		9,841.10	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-” 填列）		16,985,561.40	-48,629,813.07
其中：股票投资收益	6.4.7.10	11,100,004.59	-55,502,726.37
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	356,268.85	1,605,993.37
资产支持证券投资 收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-	-
股利收益	6.4.7.13	5,529,287.96	5,266,919.93
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	6.4.7.14	5,540,786.51	822,329.05
4.汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.15	1,089.72	11,761.47
减：二、营业总支出		3,551,595.91	5,709,519.72

1.管理人报酬		2,957,827.86	4,798,802.21
2.托管费		492,971.36	799,800.34
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		-	-
7.税金及附加		0.09	88.69
8.其他费用	6.4.7.16	100,796.60	110,828.48
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		19,040,249.46	-53,439,204.68
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		19,040,249.46	-53,439,204.68
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		19,040,249.46	-53,439,204.68

6.3 净资产变动表

会计主体：泓德优质治理灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06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	805,954,003.19	-324,318,565.39	481,635,437.80
二、本期期初净资产	805,954,003.19	-324,318,565.39	481,635,437.80
三、本期增减变动额（减少以“-”号	-11,200,921.05	23,544,482.97	12,343,561.92

填列)			
(一)、综合收益总额	-	19,040,249.46	19,040,249.46
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-11,200,921.05	4,504,233.51	-6,696,687.54
其中: 1.基金申购款	19,517,150.08	-7,178,618.00	12,338,532.08
2.基金赎回款	-30,718,071.13	11,682,851.51	-19,035,219.62
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	794,753,082.14	-300,774,082.42	493,978,999.72
项目	上年度可比期间		
	2023年01月01日至2023年06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	898,236,006.78	-219,419,823.82	678,816,182.96
二、本期期初净资产	898,236,006.78	-219,419,823.82	678,816,182.96
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-45,402,967.55	-41,209,671.52	-86,612,639.07
(一)、综合收益总额	-	-53,439,204.68	-53,439,204.68
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产	-45,402,967.55	12,229,533.16	-33,173,434.39

产减少以“-”号填列)			
其中：1.基金申购款	2,789,592.64	-740,502.48	2,049,090.16
2.基金赎回款	-48,192,560.19	12,970,035.64	-35,222,524.55
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	852,833,039.23	-260,629,495.34	592,203,543.89

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：

王德晓

李娇

王玲

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

泓德优质治理灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2021]256号《关于准予泓德优质治理灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》准予注册，由泓德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《泓德优质治理灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式。存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集982,586,664.64元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2021)第0330号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泓德优质治理灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2021年3月23日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为982,700,703.83份，其中认购资金利息折合114,039.19份基金份额。本基金的基金管理人为泓德基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泓德优质治理灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、全国中小企业股份转让系

统精选层挂牌股票（以下简称“新三板精选层股票”）、港股通机制下允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券、证券公司短期公司债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金所投资新三板精选层挂牌公司被调出精选层的，自调出之日起，基金管理人不得新增投资该股票，并应当逐步将该股票调出投资组合。基金所投资新三板精选层挂牌公司因转板上市被调出精选层的除外。基金的投资组合比例为：本基金投资于股票资产占基金资产的比例为0%-95%，其中投资于港股通标的股票占股票资产的比例不超过50%，投资于同业存单的比例不超过基金资产的20%。每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证800指数收益率×70%+中证港股通综合指数收益率×10%+中国债券综合全价指数收益率×20%。

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》、《泓德优质治理灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会、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

本基金2024年1月1日至2024年6月30日止期间的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2024年6月30日的财务状况以及2024年1月1日至2024年6月30日止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

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称"中国结算")提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/

深港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
活期存款	30,735,974.71
等于：本金	30,733,254.03
加：应计利息	2,720.68
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	-
减：坏账准备	-
合计	30,735,974.71

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	447,914,408.46	-	442,281,341.21	-5,633,067.25	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	-	
	银行间市场	20,236,840.00	305,349.73	20,473,349.73	-68,840.00
	合计	20,236,840.00	305,349.73	20,473,349.73	-68,840.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	468,151,248.46	305,349.73	462,754,690.94	-5,701,907.25	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	0.02

应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,687,053.75
其中：交易所市场	1,687,053.75
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	89,507.60
合计	1,776,561.37

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	805,954,003.19	805,954,003.19
本期申购	19,517,150.08	19,517,150.08
本期赎回（以“-”号填列）	-30,718,071.13	-30,718,071.13
本期末	794,753,082.14	794,753,082.14

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

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	-313,331,792.24	-10,986,773.15	-324,318,565.39
本期期初	-313,331,792.24	-10,986,773.15	-324,318,565.39
本期利润	13,499,462.95	5,540,786.51	19,040,249.46
本期基金份额交易产生的变动数	4,171,385.47	332,848.04	4,504,233.51
其中：基金申购款	-7,827,739.92	649,121.92	-7,178,618.00
基金赎回款	11,999,125.39	-316,273.88	11,682,851.51
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-295,660,943.82	-5,113,138.60	-300,774,082.42

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
活期存款利息收入	30,043.31
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	23,196.85
其他	1,326.48
合计	54,566.64

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
卖出股票成交总额	2,264,103,944.57
减：卖出股票成本总额	2,248,193,942.90
减：交易费用	4,809,997.08
买卖股票差价收入	11,100,004.59

6.4.7.11 债券投资收益**6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
债券投资收益——利息收入	295,926.62
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	60,342.23
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	356,268.85

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	20,744,515.06
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	20,201,920.00
减：应计利息总额	482,042.33
减：交易费用	210.50
买卖债券差价收入	60,342.23

6.4.7.12 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
股票投资产生的股利收益	5,529,287.96
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	5,529,287.96

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
1.交易性金融资产	5,540,786.51
——股票投资	5,639,706.51

——债券投资	-98,920.00
——资产支持证券投资	-
——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	5,540,786.51

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
基金赎回费收入	1,041.22
基金转换费收入	48.50
合计	1,089.72

注：1、本基金的赎回费率随着持有期限的增加而递减，将不低于赎回费总额的25%计入基金财产。

2、本基金的转换费由申购补差费和赎回费两部分构成，其中不低于赎回费25%的部分归入转出基金的基金资产。

6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
审计费用	29,835.26
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
汇划手续费	2,289.00

账户维护费	9,000.00
合计	100,796.60

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

截至财务报表批准日，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

本报告期不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。

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
泓德基金管理有限公司（以下简称“泓德基金”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（以下简称“中国工商银行”）	基金托管人、基金销售机构
李娇	基金管理人的自然人股东
温永鹏	基金管理人的自然人股东

注：下述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

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至20 24年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至20 23年06月30日

当期发生的基金应支付的管理费	2,957,827.86	4,798,802.21
其中：应支付销售机构的客户维护费	595,806.61	1,051,467.83
应支付基金管理人的净管理费	2,362,021.25	3,747,334.38

注：自2023年1月1日至2023年8月13日，支付基金管理人泓德基金的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.50%/当年天数。

根据《泓德基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，自2023年8月14日起，支付基金管理人泓德基金的管理人报酬按前一日基金资产净值1.20%的年费率每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.20%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024 年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	492,971.36	799,800.34

注：自2023年1月1日至2023年8月13日，支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

根据《泓德基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，自2023年8月14日起，支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024年06月30日		上年度末 2023年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
自然人股东	475,029.32	0.06%	0.00	0.00%

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	30,735,974.71	30,043.31	20,211,669.23	40,995.82

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2024年06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**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
301589	诺瓦星云	2024-02-01	6个月以上	限售股	126.89	188.01	1,101	77,656.68	206,999.01	备注2 (1)
688692	达梦数据	2024-06-04	6个月以上	限售股	86.96	174.93	175	15,218.00	30,612.75	-
603285	键邦股份	2024-06-28	5个交易日	新股未上市	18.65	18.65	1,158	21,596.70	21,596.70	-
603350	安乃达	2024-06-26	5个交易日	新股未上市	20.56	20.56	945	19,429.20	19,429.20	-
688709	成都华微	2024-01-31	6个月以上	限售股	15.69	18.79	899	14,105.31	16,892.21	-
301536	星辰科技	2024-03-20	6个月以上	限售股	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-
301538	骏鼎达	2024-03-13	6个月以上	限售股	55.82	91.24	150	5,972.74	13,686.00	备注2 (2)
301565	中仑新材	2024-06-13	6个月以上	限售股	11.88	18.98	711	8,446.68	13,494.78	-
301580	爱迪特	2024-06-19	6个月以上	限售股	44.95	65.93	202	9,079.90	13,317.86	-
688691	灿芯股份	2024-04-0	6个月以	限售股	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-

		2	上							
688584	上海合晶	2024-02-01	6个月以上	限售股	22.66	15.89	646	14,638.36	10,264.94	-
301566	达利凯普	2023-12-22	6个月以上	限售股	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-
601033	永兴股份	2024-01-11	6个月以上	限售股	16.20	15.96	610	9,882.00	9,735.60	-
603341	龙旗科技	2024-02-23	6个月以上	限售股	26.00	37.49	256	6,656.00	9,597.44	-
301392	汇成真空	2024-05-28	6个月以上	限售股	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
301591	肯特股份	2024-02-20	6个月以上	限售股	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-
301587	中瑞股份	2024-03-27	6个月以上	限售股	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-
001389	广合科技	2024-03-26	6个月以上	限售股	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-
301539	宏鑫科技	2024-04-03	6个月以上	限售股	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-
688695	中创股份	2024-03-06	6个月以上	限售股	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
688530	欧莱新材	2024-04-2	6个月以	限售股	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-

		9	上							
301588	美新科技	2024-03-06	6个月以上	限售股	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-
301502	华阳智能	2024-01-26	6个月以上	限售股	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-
603381	永臻股份	2024-06-19	6个月以上	限售股	23.35	25.13	178	4,156.30	4,473.14	-
603344	星德胜	2024-03-13	6个月以上	限售股	19.18	22.66	182	3,490.76	4,124.12	-
001359	平安电工	2024-03-19	6个月以上	限售股	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	-
603312	西典新能	2024-01-04	6个月以上	限售股	29.02	25.36	130	3,772.60	3,296.80	-
603082	北自科技	2024-01-23	6个月以上	限售股	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-
001379	腾达科技	2024-01-11	6个月以上	限售股	16.98	13.48	213	3,616.74	2,871.24	-
603375	盛景微	2024-01-17	6个月以上	限售股	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	-
001387	雪祺电气	2024-01-04	6个月以上	限售股	15.38	15.25	173	2,045.54	2,638.25	备注2 (3)
603285	键邦股份	2024-06-2	6个月以	新股未上	18.65	18.65	129	2,405.85	2,405.85	-

		8	上	市且限售						
603350	安乃达	2024-06-26	6个月以上	新股未上市且限售	20.56	20.56	106	2,179.36	2,179.36	-

注：1、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

2、上述流通受限股票持有期间分红情况如下：

（1）该股票于2024年5月30日实施权益分派方案：每10股派发现金股利97.00元（含税），同时，以资本公积向全体股东每10股转增8股。

（2）该股票于2024年5月22日实施权益分派方案：每10股派发现金股利7.00元（含税），同时，以资本公积向全体股东每10股转增4股。

（3）该股票于2024年6月3日实施权益分派方案：每10股派发现金股利3.50元（含税），同时，以资本公积向全体股东每10股转增3股。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于2024年6月30日，本基金持有3,000股ST富通(股票代码“000836”)成本总额为人民币6,000元。根据相关公告，该股票自2024年6月18日起停牌，于2024年8月12日被终止上市。

基金管理人于2024年6月22日发布《泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金所持股票估值方法调整的提示性公告》，经与相关托管人协商一致，自2024年6月21日起，对“ST富通”(股票代码“000836”)按照0元进行估值，详见基金管理人在规定媒介披露的相关公告。

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

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

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

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。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。

本基金的基金管理人致力于全面内部控制体系的建设，建立了从董事会层面到各业务部门的风险管理组织架构。本基金的基金管理人在董事会下设风险控制委员会，主要负责制定基金管理人风险控制战略和控制政策等事项；督察长负责对基金管理人各业务环节合法合规运作进行监督检查，组织、指导基金管理人内部监察稽核工作，并可向董事会和中国证监会直接报告；在公司内部设立独立的监察稽核部，专职负责对基金管理人各部门、各业务的风险控制情况进行督促和检查，并适时提出整改建议。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

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同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于本报告期末，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%(上年度末：0.05%)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方

面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日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。

于本报告期期末，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即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严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《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的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券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上市公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股股票不得超过该上市公司可流通股股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

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，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。于本报告期期末，本基金持有流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。于本报告期期末，本基金确认的净赎回申请未超过7个工作日可变现资产的可变现价值。

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。

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

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产如下表所示：

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年 06月30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	30,735,974.71	-	-	-	30,735,974.71
结算备付金	3,277,144.35	-	-	-	3,277,144.35
存出保证金	207,324.46	-	-	-	207,324.46
交易性	20,473,349.73	-	-	442,281,341.21	462,754,690.94

金融资产					
应收清算款	-	-	-	191,458.66	191,458.66
应收申购款	-	-	-	3,419.11	3,419.11
资产总计	54,693,793.25	-	-	442,476,218.98	497,170,012.23
负债					
应付赎回款	-	-	-	837,458.73	837,458.73
应付管理人报酬	-	-	-	494,564.92	494,564.92
应付托管费	-	-	-	82,427.49	82,427.49
其他负债	-	-	-	1,776,561.37	1,776,561.37
负债总计	-	-	-	3,191,012.51	3,191,012.51
利率敏感度缺口	54,693,793.25	-	-	439,285,206.47	493,978,999.72
上年度末 2023年 12月31 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	5,968,142.16	-	-	-	5,968,142.16
结算备付金	1,671,086.33	-	-	-	1,671,086.33
存出保证金	131,097.95	-	-	-	131,097.95
交易性	20,416,728.77	222,014.60	-	454,990,606.67	475,629,350.04

金融资产					
应收清算款	-	-	-	1,879,841.81	1,879,841.81
应收申购款	-	-	-	4,177.38	4,177.38
资产总计	28,187,055.21	222,014.60	-	456,874,625.86	485,283,695.67
负债					
应付清算款	-	-	-	1,756,957.73	1,756,957.73
应付赎回款	-	-	-	115,874.73	115,874.73
应付管理人报酬	-	-	-	485,930.97	485,930.97
应付托管费	-	-	-	80,988.47	80,988.47
应交税费	-	-	-	0.46	0.46
其他负债	-	-	-	1,208,505.51	1,208,505.51
负债总计	-	-	-	3,648,257.87	3,648,257.87
利率敏感度缺口	28,187,055.21	222,014.60	-	453,226,367.99	481,635,437.80

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期期末，本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券（若有）公允价值占基金资产净值的比例为4.14%(上年度末：4.29%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(上年度末：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于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在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	442,281,341.21	89.53	454,990,606.67	94.47
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-

一权证投资				
其他	-	-	-	-
合计	442,281,341.21	89.53	454,990,606.67	94.47

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化5%，其他变量不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币元)	
		本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
	业绩比较基准上升5%	25,711,021.56	25,255,713.17
	业绩比较基准下降5%	-25,711,021.56	-25,255,713.17

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	441,786,315.22	454,736,533.63
第二层次	20,518,960.84	20,638,743.37
第三层次	449,414.88	254,073.04
合计	462,754,690.94	475,629,350.04

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；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，确定相关股票和债券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

于2024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(2023年12月31日：同)。

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。

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	442,281,341.21	88.96
	其中：股票	442,281,341.21	88.96
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	20,473,349.73	4.12
	其中：债券	20,473,349.73	4.12
	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	34,013,119.06	6.84
8	其他各项资产	402,202.23	0.08
9	合计	497,170,012.23	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

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	55,462,513.00	11.23
C	制造业	258,766,830.09	52.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	24,692,727.00	5.00
E	建筑业	10,790,715.00	2.18
F	批发和零售业	3,062,799.60	0.62
G	交通运输、仓储和邮政业	19,138,598.00	3.87
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	21,768,209.02	4.41
J	金融业	27,877,670.60	5.64
K	房地产业	12,085,128.00	2.45
L	租赁和商务服务业	4,336,002.00	0.88
M	科学研究和技术服务业	82,810.00	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	1,667,489.10	0.34
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	20,608.00	0.00
Q	卫生和社会工作	12,546.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	2,516,695.80	0.51
S	综合	-	-
	合计	442,281,341.21	89.53

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通机制投资的港股。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600938	中国海油	227,300	7,500,900.00	1.52
2	601728	中国电信	1,185,700	7,292,055.00	1.48
3	600760	中航沈飞	160,060	6,418,406.00	1.30
4	000333	美的集团	98,800	6,372,600.00	1.29
5	600887	伊利股份	246,000	6,356,640.00	1.29
6	600007	中国国贸	288,800	6,342,048.00	1.28
7	600027	华电国际	900,000	6,246,000.00	1.26
8	600050	中国联通	1,326,300	6,233,610.00	1.26
9	300750	宁德时代	34,200	6,157,026.00	1.25
10	002371	北方华创	19,000	6,077,910.00	1.23
11	601857	中国石油	580,600	5,991,792.00	1.21
12	601318	中国平安	143,200	5,922,752.00	1.20
13	688008	澜起科技	100,000	5,716,000.00	1.16
14	600219	南山铝业	1,470,100	5,601,081.00	1.13
15	600019	宝钢股份	828,500	5,509,525.00	1.12
16	600028	中国石化	868,400	5,488,288.00	1.11
17	601899	紫金矿业	300,000	5,271,000.00	1.07
18	000975	银泰黄金	309,400	5,040,126.00	1.02
19	002128	电投能源	232,900	4,914,190.00	0.99
20	601717	郑煤机	323,700	4,790,760.00	0.97
21	300760	迈瑞医疗	16,200	4,712,742.00	0.95
22	002311	海大集团	100,000	4,705,000.00	0.95
23	601058	赛轮轮胎	333,020	4,662,280.00	0.94
24	601600	中国铝业	605,700	4,621,491.00	0.94
25	000651	格力电器	115,000	4,510,300.00	0.91
26	000338	潍柴动力	272,800	4,430,272.00	0.90

27	600582	天地科技	630,200	4,342,078.00	0.88
28	002027	分众传媒	707,100	4,285,026.00	0.87
29	002533	金杯电工	427,800	4,256,610.00	0.86
30	601668	中国建筑	790,100	4,195,431.00	0.85
31	001965	招商公路	353,700	4,194,882.00	0.85
32	601138	工业富联	150,000	4,110,000.00	0.83
33	000589	贵州轮胎	790,400	4,007,328.00	0.81
34	002475	立讯精密	101,200	3,978,172.00	0.81
35	603298	杭叉集团	200,000	3,928,000.00	0.80
36	601872	招商轮船	455,000	3,844,750.00	0.78
37	688036	传音控股	48,900	3,742,806.00	0.76
38	601168	西部矿业	207,400	3,722,830.00	0.75
39	601601	中国太保	130,700	3,641,302.00	0.74
40	603993	洛阳钼业	427,900	3,637,150.00	0.74
41	600941	中国移动	32,900	3,536,750.00	0.72
42	605368	蓝天燃气	254,100	3,465,924.00	0.70
43	003816	中国广核	747,600	3,461,388.00	0.70
44	601390	中国中铁	525,500	3,426,260.00	0.69
45	300857	协创数据	60,000	3,420,000.00	0.69
46	600036	招商银行	100,000	3,419,000.00	0.69
47	600309	万华化学	40,500	3,274,830.00	0.66
48	002215	诺普信	437,100	3,256,395.00	0.66
49	600529	山东药玻	128,000	3,243,520.00	0.66
50	002601	龙佰集团	173,200	3,216,324.00	0.65
51	300866	安克创新	44,990	3,203,737.90	0.65
52	300856	科思股份	100,000	3,201,000.00	0.65
53	002683	广东宏大	156,800	3,156,384.00	0.64
54	603878	武进不锈	482,300	3,154,242.00	0.64
55	601666	平煤股份	280,000	3,136,000.00	0.63
56	002415	海康威视	101,300	3,131,183.00	0.63
57	600901	江苏金租	619,360	3,127,768.00	0.63

58	002273	水晶光电	180,000	3,056,400.00	0.62
59	601336	新华保险	100,000	3,003,000.00	0.61
60	601985	中国核电	281,100	2,996,526.00	0.61
61	600332	白云山	101,500	2,976,995.00	0.60
62	688188	柏楚电子	16,100	2,971,255.00	0.60
63	600690	海尔智家	103,900	2,948,682.00	0.60
64	600018	上港集团	508,700	2,940,286.00	0.60
65	600346	恒力石化	203,000	2,831,850.00	0.57
66	002078	太阳纸业	201,000	2,803,950.00	0.57
67	601702	华峰铝业	150,000	2,739,000.00	0.55
68	601088	中国神华	61,700	2,737,629.00	0.55
69	600750	江中药业	116,800	2,699,248.00	0.55
70	603855	华荣股份	120,000	2,653,200.00	0.54
71	300274	阳光电源	42,000	2,605,260.00	0.53
72	002884	凌霄泵业	131,300	2,520,960.00	0.51
73	603699	纽威股份	146,800	2,513,216.00	0.51
74	003000	劲仔食品	206,900	2,493,145.00	0.50
75	600885	宏发股份	87,905	2,433,210.40	0.49
76	600660	福耀玻璃	50,000	2,395,000.00	0.48
77	002028	思源电气	35,200	2,354,880.00	0.48
78	600066	宇通客车	90,200	2,327,160.00	0.47
79	601000	唐山港	493,800	2,320,860.00	0.47
80	002025	航天电器	50,000	2,319,000.00	0.47
81	600426	华鲁恒升	86,300	2,299,032.00	0.47
82	000063	中兴通讯	80,000	2,237,600.00	0.45
83	000807	云铝股份	163,200	2,204,832.00	0.45
84	601816	京沪高铁	407,800	2,189,886.00	0.44
85	300628	亿联网络	59,000	2,169,430.00	0.44
86	605166	聚合顺	200,000	2,098,000.00	0.42
87	600282	南钢股份	419,300	2,088,114.00	0.42
88	000725	京东方 A	508,700	2,080,583.00	0.42

89	601633	长城汽车	81,700	2,067,010.00	0.42
90	688439	振华风光	30,685	2,039,018.25	0.41
91	600642	申能股份	230,600	2,036,198.00	0.41
92	003019	宸展光电	79,960	2,025,386.80	0.41
93	603558	健盛集团	200,000	1,990,000.00	0.40
94	601877	正泰电器	102,200	1,947,932.00	0.39
95	002422	科伦药业	62,200	1,886,526.00	0.38
96	688239	航宇科技	53,500	1,861,800.00	0.38
97	601328	交通银行	248,900	1,859,283.00	0.38
98	600873	梅花生物	180,000	1,803,600.00	0.37
99	000425	徐工机械	250,000	1,787,500.00	0.36
100	300408	三环集团	60,200	1,757,238.00	0.36
101	600285	羚锐制药	72,300	1,750,383.00	0.35
102	601288	农业银行	401,300	1,749,668.00	0.35
103	000543	皖能电力	197,600	1,748,760.00	0.35
104	002984	森麒麟	70,000	1,686,300.00	0.34
105	600985	淮北矿业	100,700	1,685,718.00	0.34
106	600183	生益科技	80,000	1,684,800.00	0.34
107	688281	华秦科技	20,000	1,666,400.00	0.34
108	002532	天山铝业	200,000	1,622,000.00	0.33
109	600096	云天化	80,000	1,553,600.00	0.31
110	000630	铜陵有色	423,000	1,527,030.00	0.31
111	600011	华能国际	154,200	1,483,404.00	0.30
112	002244	滨江集团	200,000	1,452,000.00	0.29
113	002064	华峰化学	201,300	1,443,321.00	0.29
114	601975	招商南油	400,000	1,436,000.00	0.29
115	601319	中国人保	277,100	1,427,065.00	0.29
116	300017	网宿科技	180,000	1,422,000.00	0.29
117	600188	兖矿能源	60,000	1,363,800.00	0.28
118	600048	保利发展	150,000	1,314,000.00	0.27
119	601939	建设银行	173,100	1,280,940.00	0.26

120	301003	江苏博云	57,200	1,230,372.00	0.25
121	301109	军信股份	79,950	1,195,252.50	0.24
122	603096	新经典	68,500	1,157,650.00	0.23
123	601006	大秦铁路	158,900	1,137,724.00	0.23
124	600710	苏美达	135,900	1,107,585.00	0.22
125	000708	中信特钢	79,700	1,081,529.00	0.22
126	600761	安徽合力	49,900	1,079,836.00	0.22
127	600064	南京高科	175,200	1,063,464.00	0.22
128	002139	拓邦股份	100,000	1,062,000.00	0.21
129	000999	华润三九	24,440	1,040,655.20	0.21
130	600551	时代出版	140,360	993,748.80	0.20
131	600325	华发股份	150,000	975,000.00	0.20
132	002255	海陆重工	198,000	968,220.00	0.20
133	600681	百川能源	287,000	967,190.00	0.20
134	002478	常宝股份	192,200	957,156.00	0.19
135	000090	天健集团	236,900	952,338.00	0.19
136	600167	联美控股	181,900	947,699.00	0.19
137	603556	海兴电力	20,000	936,600.00	0.19
138	300403	汉宇集团	136,800	934,344.00	0.19
139	601898	中煤能源	73,800	921,024.00	0.19
140	603611	诺力股份	54,000	920,160.00	0.19
141	688516	奥特维	21,680	906,440.80	0.18
142	002004	华邦健康	238,000	904,400.00	0.18
143	603897	长城科技	51,200	898,560.00	0.18
144	600510	黑牡丹	239,400	890,568.00	0.18
145	000933	神火股份	43,700	884,051.00	0.18
146	002913	奥士康	32,500	871,325.00	0.18
147	600919	江苏银行	112,700	837,361.00	0.17
148	300679	电连技术	20,000	804,600.00	0.16
149	601800	中国交建	89,300	798,342.00	0.16
150	000923	河钢资源	45,600	785,232.00	0.16

151	605319	无锡振华	43,500	769,950.00	0.16
152	600390	五矿资本	189,600	767,880.00	0.16
153	600033	福建高速	228,600	765,810.00	0.16
154	600648	外高桥	84,900	752,214.00	0.15
155	600248	陕建股份	202,600	735,438.00	0.15
156	600273	嘉化能源	101,600	725,424.00	0.15
157	002053	云南能投	59,000	713,310.00	0.14
158	600507	方大特钢	189,800	709,852.00	0.14
159	002274	华昌化工	95,100	705,642.00	0.14
160	002073	软控股份	94,400	697,616.00	0.14
161	002283	天润工业	154,200	661,518.00	0.13
162	603408	建霖家居	48,300	637,077.00	0.13
163	301015	百洋医药	26,900	632,957.00	0.13
164	603328	依顿电子	80,100	629,586.00	0.13
165	605196	华通线缆	53,700	564,924.00	0.11
166	600820	隧道股份	83,200	543,296.00	0.11
167	601139	深圳燃气	74,000	494,320.00	0.10
168	600475	华光环能	53,100	462,501.00	0.09
169	603368	柳药集团	24,500	428,750.00	0.09
170	600015	华夏银行	61,100	391,040.00	0.08
171	000157	中联重科	50,000	384,000.00	0.08
172	002267	陕天然气	43,100	325,836.00	0.07
173	600269	赣粤高速	44,800	231,616.00	0.05
174	601811	新华文轩	15,400	215,754.00	0.04
175	301589	诺瓦星云	1,101	206,999.01	0.04
176	601311	骆驼股份	25,800	206,916.00	0.04
177	002014	永新股份	21,100	200,028.00	0.04
178	002563	森马服饰	34,100	198,121.00	0.04
179	002706	良信股份	27,700	190,022.00	0.04
180	000404	长虹华意	35,600	189,748.00	0.04
181	002498	汉缆股份	57,500	189,175.00	0.04

182	002034	旺能环境	14,200	184,742.00	0.04
183	603187	海容冷链	14,800	172,568.00	0.03
184	603296	华勤技术	2,986	164,916.78	0.03
185	000598	兴蓉环境	16,200	121,824.00	0.02
186	688530	欧莱新材	3,437	69,099.55	0.01
187	300251	光线传媒	7,200	60,552.00	0.01
188	601991	大唐发电	19,800	59,598.00	0.01
189	601216	君正集团	15,700	57,933.00	0.01
190	000932	华菱钢铁	12,500	55,375.00	0.01
191	600517	国网英大	12,300	53,259.00	0.01
192	688002	睿创微纳	1,900	53,143.00	0.01
193	601298	青岛港	5,400	51,624.00	0.01
194	600968	海油发展	12,400	51,088.00	0.01
195	600998	九州通	10,320	50,361.60	0.01
196	603042	华脉科技	4,700	49,068.00	0.01
197	600692	亚通股份	9,100	48,048.00	0.01
198	301067	显盈科技	2,400	47,304.00	0.01
199	688210	统联精密	2,100	46,515.00	0.01
200	605066	天正电气	8,350	46,509.50	0.01
201	688685	迈信林	1,890	46,210.50	0.01
202	301321	翰博高新	4,000	46,040.00	0.01
203	603031	安孚科技	2,000	45,160.00	0.01
204	300279	和晶科技	10,800	45,036.00	0.01
205	300626	华瑞股份	6,000	44,940.00	0.01
206	300543	朗科智能	5,600	44,800.00	0.01
207	301057	汇隆新材	3,900	44,616.00	0.01
208	000020	深华发 A	4,500	44,550.00	0.01
209	300123	亚光科技	9,600	44,544.00	0.01
210	603683	晶华新材	5,600	44,464.00	0.01
211	300550	和仁科技	4,700	44,415.00	0.01
212	300521	爱司凯	4,300	44,290.00	0.01

213	688616	西力科技	3,900	44,226.00	0.01
214	603380	易德龙	2,200	44,176.00	0.01
215	688551	科威尔	1,400	44,100.00	0.01
216	600023	浙能电力	6,200	44,082.00	0.01
217	301515	港通医疗	2,300	44,022.00	0.01
218	688081	兴图新科	5,000	44,000.00	0.01
219	688678	福立旺	4,060	43,969.80	0.01
220	000509	华塑控股	17,100	43,947.00	0.01
221	688011	新光光电	2,900	43,935.00	0.01
222	000576	甘化科工	7,300	43,800.00	0.01
223	600854	春兰股份	12,800	43,776.00	0.01
224	603977	国泰集团	4,300	43,731.00	0.01
225	603159	上海亚虹	4,200	43,722.00	0.01
226	601186	中国铁建	5,100	43,707.00	0.01
227	002998	优彩资源	7,700	43,659.00	0.01
228	600905	三峡能源	10,000	43,600.00	0.01
229	002981	朝阳科技	2,380	43,577.80	0.01
230	688273	麦澜德	2,200	43,560.00	0.01
231	300030	阳普医疗	11,700	43,524.00	0.01
232	300694	蠡湖股份	5,100	43,401.00	0.01
233	600989	宝丰能源	2,500	43,325.00	0.01
234	300940	南极光	3,400	43,316.00	0.01
235	001260	坤泰股份	3,100	43,183.00	0.01
236	600025	华能水电	4,000	43,120.00	0.01
237	000568	泸州老窖	300	43,047.00	0.01
238	601868	中国能建	20,300	43,036.00	0.01
239	688571	杭华股份	8,100	42,849.00	0.01
240	300131	英唐智控	9,600	42,720.00	0.01
241	600362	江西铜业	1,800	42,624.00	0.01
242	600039	四川路桥	5,400	42,606.00	0.01
243	300173	福能东方	11,300	42,601.00	0.01

244	600741	华域汽车	2,600	42,588.00	0.01
245	002736	国信证券	4,900	42,581.00	0.01
246	600888	新疆众和	6,000	42,420.00	0.01
247	688510	航亚科技	2,300	42,343.00	0.01
248	601890	亚星锚链	6,000	42,300.00	0.01
249	300502	新易盛	400	42,220.00	0.01
250	601211	国泰君安	3,100	42,005.00	0.01
251	688228	开普云	1,100	41,976.00	0.01
252	688253	英诺特	1,100	41,921.00	0.01
253	002774	快意电梯	6,600	41,910.00	0.01
254	688380	中微半导	2,500	41,800.00	0.01
255	600999	招商证券	3,000	41,730.00	0.01
256	600184	光电股份	4,900	41,699.00	0.01
257	300797	钢研纳克	4,500	41,670.00	0.01
258	002664	信质集团	3,500	41,650.00	0.01
259	688448	磁谷科技	2,200	41,536.00	0.01
260	300016	北陆药业	9,400	41,454.00	0.01
261	601225	陕西煤业	1,600	41,232.00	0.01
262	301228	实朴检测	4,400	41,140.00	0.01
263	603516	淳中科技	1,300	41,041.00	0.01
264	300018	中元股份	8,900	40,940.00	0.01
265	300883	龙利得	9,600	40,608.00	0.01
266	300528	幸福蓝海	6,400	40,192.00	0.01
267	688013	天臣医疗	2,699	40,053.16	0.01
268	688590	新致软件	3,100	39,990.00	0.01
269	003036	泰坦股份	5,000	39,950.00	0.01
270	688468	科美诊断	6,300	39,879.00	0.01
271	301065	本立科技	2,500	39,750.00	0.01
272	002540	亚太科技	7,500	39,675.00	0.01
273	688080	映翰通	1,300	39,429.00	0.01
274	300122	智飞生物	1,400	39,242.00	0.01

275	000567	海德股份	6,960	39,045.60	0.01
276	600089	特变电工	2,800	38,836.00	0.01
277	688776	国光电气	700	38,780.00	0.01
278	688365	光云科技	6,400	38,528.00	0.01
279	600276	恒瑞医药	1,000	38,460.00	0.01
280	002519	银河电子	7,800	38,298.00	0.01
281	601865	福莱特	1,900	38,190.00	0.01
282	603336	宏辉果蔬	12,600	37,926.00	0.01
283	603819	神力股份	3,600	37,800.00	0.01
284	000987	越秀资本	7,600	37,696.00	0.01
285	600222	太龙药业	8,900	37,380.00	0.01
286	300316	晶盛机电	1,300	37,349.00	0.01
287	300289	利德曼	9,700	37,345.00	0.01
288	000546	金圆股份	9,300	37,293.00	0.01
289	600016	民生银行	9,700	36,763.00	0.01
290	000931	中关村	10,300	36,359.00	0.01
291	300154	瑞凌股份	6,800	36,244.00	0.01
292	002300	太阳电缆	6,800	35,904.00	0.01
293	002276	万马股份	5,000	35,850.00	0.01
294	688478	晶升股份	1,200	34,944.00	0.01
295	000633	合金投资	8,800	34,672.00	0.01
296	002158	汉钟精机	2,000	33,440.00	0.01
297	300451	创业慧康	9,500	32,870.00	0.01
298	688231	隆达股份	2,300	32,798.00	0.01
299	300687	赛意信息	2,300	32,016.00	0.01
300	600713	南京医药	7,500	31,650.00	0.01
301	600875	东方电气	1,700	31,365.00	0.01
302	600926	杭州银行	2,400	31,320.00	0.01
303	300211	亿通科技	5,900	31,211.00	0.01
304	000895	双汇发展	1,300	30,901.00	0.01
305	600237	铜峰电子	5,900	30,798.00	0.01

306	002001	新和成	1,600	30,720.00	0.01
307	688692	达梦数据	175	30,612.75	0.01
308	000997	新大陆	2,100	29,211.00	0.01
309	000607	华媒控股	9,100	28,119.00	0.01
310	301298	东利机械	2,100	26,775.00	0.01
311	600768	宁波富邦	3,800	26,638.00	0.01
312	601928	凤凰传媒	2,400	26,304.00	0.01
313	300066	三川智慧	9,000	25,740.00	0.01
314	603811	诚意药业	4,100	25,625.00	0.01
315	301056	森赫股份	3,300	25,311.00	0.01
316	601018	宁波港	7,400	25,160.00	0.01
317	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.00
318	600662	外服控股	5,700	22,857.00	0.00
319	601825	沪农商行	3,400	22,848.00	0.00
320	601688	华泰证券	1,800	22,302.00	0.00
321	002463	沪电股份	600	21,900.00	0.00
322	000153	丰原药业	4,060	21,842.80	0.00
323	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.00
324	002648	卫星化学	1,200	21,576.00	0.00
325	600379	宝光股份	2,600	21,554.00	0.00
326	600455	博通股份	1,400	20,608.00	0.00
327	600030	中信证券	1,100	20,053.00	0.00
328	601916	浙商银行	7,200	19,872.00	0.00
329	603633	徕木股份	2,500	19,775.00	0.00
330	300230	永利股份	5,800	19,488.00	0.00
331	601818	光大银行	5,800	18,386.00	0.00
332	601699	潞安环能	1,000	18,130.00	0.00
333	688709	成都华微	899	16,892.21	0.00
334	600128	苏豪弘业	2,600	16,562.00	0.00
335	301536	星宸科技	481	15,521.87	0.00
336	605255	天普股份	1,200	14,424.00	0.00

337	600398	海澜之家	1,500	13,860.00	0.00
338	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
339	301565	中仑新材	711	13,494.78	0.00
340	301580	爱迪特	202	13,317.86	0.00
341	300808	久量股份	800	13,032.00	0.00
342	002172	澳洋健康	5,100	12,546.00	0.00
343	600880	博瑞传播	3,300	12,408.00	0.00
344	000027	深圳能源	1,600	11,680.00	0.00
345	002491	通鼎互联	3,400	11,492.00	0.00
346	002909	集泰股份	2,600	10,660.00	0.00
347	301559	中集环科	729	10,621.53	0.00
348	002966	苏州银行	1,400	10,500.00	0.00
349	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
350	688584	上海合晶	646	10,264.94	0.00
351	601117	中国化学	1,200	9,888.00	0.00
352	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
353	601033	永兴股份	610	9,735.60	0.00
354	603341	龙旗科技	256	9,597.44	0.00
355	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
356	600803	新奥股份	400	8,320.00	0.00
357	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
358	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
359	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
360	600909	华安证券	1,700	7,157.00	0.00
361	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
362	603999	读者传媒	1,400	6,622.00	0.00
363	600556	天下秀	1,800	6,552.00	0.00
364	301578	辰奕智能	153	6,054.21	0.00
365	300942	易瑞生物	1,000	5,990.00	0.00
366	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
367	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00

368	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
369	002340	格林美	800	5,096.00	0.00
370	600967	内蒙一机	700	5,040.00	0.00
371	603381	永臻股份	178	4,473.14	0.00
372	603344	星德胜	182	4,124.12	0.00
373	601577	长沙银行	500	4,090.00	0.00
374	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
375	001326	联域股份	99	3,550.14	0.00
376	601801	皖新传媒	500	3,465.00	0.00
377	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
378	688028	沃尔德	200	3,286.00	0.00
379	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
380	001379	腾达科技	213	2,871.24	0.00
381	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00
382	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00
383	600769	祥龙电业	400	2,516.00	0.00
384	688586	江航装备	200	1,860.00	0.00
385	688599	天合光能	100	1,692.00	0.00
386	601077	渝农商行	200	1,004.00	0.00
387	002660	茂硕电源	100	742.00	0.00
388	603176	汇通集团	100	373.00	0.00
389	000836	ST富通	3,000	-	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002371	北方华创	20,405,162.00	4.24
2	300750	宁德时代	19,731,500.43	4.10

3	001965	招商公路	15,029,707.00	3.12
4	600309	万华化学	14,504,197.00	3.01
5	000568	泸州老窖	14,240,859.00	2.96
6	601318	中国平安	13,752,319.00	2.86
7	600901	江苏金租	13,404,307.20	2.78
8	002311	海大集团	13,161,648.00	2.73
9	601872	招商轮船	12,354,008.00	2.57
10	688036	传音控股	11,962,981.30	2.48
11	003000	劲仔食品	11,368,106.56	2.36
12	601766	中国中车	11,326,074.00	2.35
13	600801	华新水泥	11,211,027.00	2.33
14	601601	中国太保	10,951,673.00	2.27
15	601865	福莱特	10,866,488.00	2.26
16	601006	大秦铁路	10,795,546.00	2.24
17	000333	美的集团	9,874,742.00	2.05
18	600025	华能水电	9,860,397.00	2.05
19	600027	华电国际	9,769,779.00	2.03
20	002475	立讯精密	9,714,182.92	2.02
21	000589	贵州轮胎	9,668,683.00	2.01

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000568	泸州老窖	18,064,967.00	3.75
2	600519	贵州茅台	15,418,470.00	3.20
3	002371	北方华创	14,353,148.00	2.98
4	600801	华新水泥	13,641,434.00	2.83
5	601006	大秦铁路	12,805,873.00	2.66
6	601766	中国中车	12,790,372.00	2.66

7	300750	宁德时代	12,738,591.00	2.64
8	600309	万华化学	11,454,412.00	2.38
9	688036	传音控股	11,359,053.84	2.36
10	001965	招商公路	11,268,952.19	2.34
11	003000	劲仔食品	11,150,015.96	2.32
12	600901	江苏金租	10,671,373.00	2.22
13	603283	赛腾股份	10,627,501.00	2.21
14	600150	中国船舶	10,318,199.00	2.14
15	600025	华能水电	10,301,166.00	2.14
16	600872	中炬高新	10,250,617.00	2.13
17	600795	国电电力	10,047,823.00	2.09
18	601688	华泰证券	9,754,167.00	2.03
19	601865	福莱特	9,687,837.00	2.01
20	600406	国电南瑞	9,617,653.80	2.00

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,229,844,970.93
卖出股票收入（成交）总额	2,264,103,944.57

注：本项中7.4.1、7.4.2、7.4.3表中的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,473,349.73	4.14
	其中：政策性金融债	20,473,349.73	4.14
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	20,473,349.73	4.14

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	200203	20国开03	200,000	20,473,349.73	4.14

注：本基金本报告期末仅持有一只债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现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。

7.12.2 基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 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	207,324.46
2	应收清算款	191,458.66
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,419.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	402,202.23

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能存在尾差。

§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

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

7,500	105,967.08	368,803,933.64	46.40%	425,949,148.50	53.60%
-------	------------	----------------	--------	----------------	--------

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	3,959,791.01	0.50%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	>100

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2021年03月23日)基金份额总额	982,700,703.83
本报告期期初基金份额总额	805,954,003.19
本报告期基金总申购份额	19,517,150.08
减：本报告期基金总赎回份额	30,718,071.13
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	794,753,082.14

注：总申购份额含转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期，本基金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

(1) 基金管理人的重大人事变动

本报告期基金管理人无重大人事变动。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金基金管理人、基金财产以及基金托管人基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

自本基金基金合同生效日起普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务至今，本报告期内会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期未发生公司及其高级管理人员被中国证监会、基金业协会、证券交易所施以重大处罚或公开谴责，以及被财政、外汇和审计等部门施以重大处罚的情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
中信证券	2	1,195,231,659.70	26.61%	879,558.56	25.95%	-
华泰证券	2	1,039,575,517.66	23.14%	765,005.73	22.57%	-
海通证券	1	583,572,108.04	12.99%	429,448.03	12.67%	-

光大证券	2	476,750,565.47	10.61%	350,842.75	10.35%	-
民生证券	2	420,591,793.47	9.36%	393,627.97	11.61%	-
开源证券	2	309,515,759.61	6.89%	227,768.16	6.72%	-
中信建投证券	4	284,363,362.14	6.33%	209,264.44	6.17%	-
中泰证券	0	129,009,294.11	2.87%	94,933.49	2.80%	-
国投证券	2	53,557,287.94	1.19%	39,412.46	1.16%	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
第一创业证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国信	2	-	-	-	-	-

证券						
华金 证券	2	-	-	-	-	-
华西 证券	2	-	-	-	-	-
平安 证券	2	-	-	-	-	-
申万 宏源 证券	2	-	-	-	-	-
东方 财富 证券	2	-	-	-	-	-
信达 证券	2	-	-	-	-	-
招商 证券	2	-	-	-	-	-
中国 中金 财富 证券	2	-	-	-	-	-
甬兴 证券	2	-	-	-	-	-
首创 证券	2	-	-	-	-	-

注：1、基金专用交易单元的选择标准如下：

- （1）该证券机构经营行为规范，内控制度健全；
- （2）财务状况良好，公司经营状况稳定；
- （3）具有基金投资运作所需的证券服务能力和水平。

2、基金专用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选定证券经营机构；
- （2）基金管理人和被选中的证券经营机构签订协议。

3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

- (1) 本基金报告期内新增租用交易单元：甬兴证券。
- (2) 本基金报告期内停止租用交易单元：中泰证券、太平洋证券、华安证券、国投证券、首创证券。

10.7.2 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
中信证券	-	-	40,000,000.00	66.67%	-	-	-	-
华泰证券	262,515.06	100.00%	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	20,000,000.00	33.33%	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-

中国中金财富 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
甬兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 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	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海大智慧基金销售有限公司为销售机构的公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2024-01-11
2	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加北京汇成基金销售有限公司为销售机构的公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2024-01-18
3	泓德基金管理有限公司关于泓德优质治理灵活配置混合型证券投资基金参与蚂蚁（杭州）基金销售有限公司费率优惠活动的公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2024-02-28
4	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加北京雪球基金销售有限公司为销售机构的公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2024-05-23
5	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金所持股票估值方法调整的提示性公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2024-06-22

§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

机构	1	2024/01/01-20 24/06/30	351,619,291.80	0.00	0.00	351,619,291.80	44.24%
产品特有风险							
<p>本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额20%的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。</p> <p>在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，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。</p>							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准泓德优质治理灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《泓德优质治理灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《泓德优质治理灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《泓德优质治理灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在规定报刊上披露的各项公告。

12.2 存放地点

地点为管理人地址：北京市西城区德胜门外大街125号

12.3 查阅方式

- 1、投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件
- 2、投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人泓德基金管理有限公司，客户服务电话：4009-100-888
- 3、投资者可访问本基金管理人公司网站，网址：www.hongdefund.com

泓德基金管理有限公司
二〇二四年八月二十九日