

# 泓德致远混合型证券投资基金

## 2021 年中期报告

2021 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:招商银行股份有限公司

送出日期:2021 年 08 月 25 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年8月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2021年1月1日起至2021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	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	12
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	12
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 中期财务会计报告(未经审计)	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	18
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	47
7.1 期末基金资产组合情况	47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
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	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54
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	54
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	55
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	55
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	55
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
7.12 投资组合报告附注	56
§8 基金份额持有人信息	57
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	57
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58

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.....	58
§9 开放式基金份额变动.....	59
§10 重大事件揭示.....	59
10.1 基金份额持有人大会决议.....	59
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.....	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	59
10.4 基金投资策略的改变.....	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	59
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.....	59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	59
10.8 其他重大事件.....	63
§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	泓德致远混合型证券投资基金	
基金简称	泓德致远混合	
基金主代码	004965	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年08月30日	
基金管理人	泓德基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,354,078,012.36份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	泓德致远混合A	泓德致远混合C
下属分级基金的交易代码	004965	004966
报告期末下属分级基金的份额总额	1,795,666,064.25份	558,411,948.11份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在有效控制风险的前提下，通过合理的资产配置，综合运用多种投资策略，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金以获取基金资产的长期稳健增值为目标，通过定性分析与定量分析相结合的方法分析宏观经济和资本市场发展趋势，采用“自上而下”的分析视角，综合考量宏观经济发展前景，评估各类资产的预期收益与风险，合理确定本基金在股票、债券等各类别资产上的投资比例并适时做出动态调整。股票投资方面，本基金从基本面分析入手，根据个股的估值水平优选个股，重点配置当前业绩优良、市场认同度较高、在可预见的未来其行业处于景气周期中的股票。行业配置将综合考虑国家经济政策、经济周期、行业发展前景、行业的相对估值水平、行业竞争格局，在此基础上精选上市公司，选取具有持续经营能力的上市公司。本基金债券投资采取适当的久期策略、信用策略、时机策略和可转换债券投资策略相结合的方法。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。权证投资以控制风险和锁定收益为主要目的。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×40%+中证综合债券指数收益率×60%
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于较高风险、较高收益的品种，其长期风险与收益特征低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。

### 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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李晓春
	联系电话	010-59850177
	电子邮箱	lixiaochun@hongdefund.com
客户服务电话	4009-100-888	95555
传真	010-59322130	0755-83195201
注册地址	西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦1206室	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址	北京市西城区德胜门外大街125号	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码	100088	518040
法定代表人	王德晓	缪建民

### 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点	北京市西城区德胜门外大街125号

## 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 (2021年01月01日-2021年06月30日)	
	泓德致远混合A	泓德致远混合C
本期已实现收益	373,392,826.67	91,114,879.28
本期利润	67,251,737.66	15,288,849.18
加权平均基金份额本期利润	0.0309	0.0261
本期加权平均净值利润率	1.54%	1.34%
本期基金份额净值增长率	1.92%	1.51%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2021年06月30日)	
期末可供分配利润	1,084,898,966.76	307,477,560.30
期末可供分配基金份额利润	0.6042	0.5506
期末基金资产净值	3,688,221,038.47	1,112,130,023.75
期末基金份额净值	2.0540	1.9916
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2021年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	105.40%	99.16%

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

泓德致远混合A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.52%	0.52%	-0.69%	0.33%	1.21%	0.19%
过去三个月	4.52%	0.65%	2.19%	0.39%	2.33%	0.26%
过去六个月	1.92%	0.85%	1.66%	0.53%	0.26%	0.32%
过去一年	25.39%	0.84%	11.94%	0.53%	13.45%	0.31%
过去三年	91.39%	0.92%	29.28%	0.54%	62.11%	0.38%
自基金合同生效起至今	105.40%	0.88%	28.09%	0.51%	77.31%	0.37%

泓德致远混合C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.46%	0.52%	-0.69%	0.33%	1.15%	0.19%
过去三个月	4.31%	0.65%	2.19%	0.39%	2.12%	0.26%
过去六个月	1.51%	0.85%	1.66%	0.53%	-0.15%	0.32%
过去一年	24.40%	0.84%	11.94%	0.53%	12.46%	0.31%
过去三年	86.81%	0.92%	29.28%	0.54%	57.53%	0.38%
自基金合同生效起至今	99.16%	0.88%	28.09%	0.51%	71.07%	0.37%

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×40%+中证综合债券指数收益率×60%

基准指数的构建原则如下：

(1) 沪深 300 指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国 A 股市场指数，它的样本选自沪深两个证券市场，覆盖了大部分流通市值，其成份股票为中国 A 股市场中代表性强、流动性高的股票，能够反映 A 股市场总体发展趋势。

(2) 中证综合债券指数是中国全市场债券指数，以 2001 年 12 月 31 日为基期，基点为 100 点，并

于 2002 年 12 月 31 日起发布。中证综合债券指数的样本具有广泛的市场代表性，其样本范围涵盖银行间市场和交易所市场，成分债券包括国债、企业债券、央行票据等所有主要债券种类。

(3) 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 40%、60%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变动的比较

泓德致远混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2017年08月30日-2021年06月30日)



泓德致远混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2017年08月30日-2021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”），成立于2015年3月3日，是经中国证监会证监许可[2015]258号文批准设立的我国第一家由专业人士发起设立的公募基金管理公司。公司注册资本为人民币14300万元，公司注册地拉萨市。目前，公司股东及其出资比例为：王德晓先生25.91%，阳光资产管理股份有限公司20.98%，泓德基业控股股份有限公司20.00%，珠海市基业长青股权投资基金（有限合伙）11.26%，南京民生租赁股份有限公司9.38%，江苏岛村实业发展有限公司9.38%，上海捷朔信息技术有限公司3.10%。

截至2021年6月30日，公司总资产管理规模为1398.04亿元，其中公募基金管理规模1153.88亿元，专户产品管理规模为244.16亿元。2021年上半年，公司新发行3只公募基金产品，均为混合型基金产品。自成立起至2021年6月30日，公司累计发行34只公募基金产品：其中混合型基金22只，具体包括泓德优选成长混合、泓德泓富混合、泓德远见回报混合、泓德泓业混合、泓德泓益量化混合、泓德泓信混合、泓德泓汇混合、泓德泓华混合、泓德优势领航混合、泓德致远混合、泓德臻远回报混合、泓德三年封闭丰泽混合、泓德研究优选混合、泓德量化精选混合、泓德丰润三年持有期混合、泓德睿泽混合、

泓德睿享一年持有期混合、泓德瑞兴三年持有期混合、泓德卓远混合、泓德优质治理混合、泓德睿源三年持有期混合、泓德瑞嘉三年持有期混合；股票型基金1只，具体为泓德战略转型股票；债券型基金9只，具体包括泓德裕泰债券、泓德裕康债券、泓德裕荣纯债、泓德裕和纯债、泓德裕祥债券、泓德裕泽一年定开债券、泓德裕鑫一年定开债券、泓德裕丰中短债、泓德裕瑞三年定开债券；货币基金2只，具体为泓德泓利货币、泓德添利货币。同时，公司管理多只特定客户资产管理计划。

#### 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		
邬传雁	公司副总经理，泓德远见回报混合、泓德致远混合、泓德臻远回报混合、泓德三年封闭丰泽混合、泓德丰润三年持有期混合、泓德卓远混合基金经理	2017-08-30	-	7年	硕士研究生，具有基金从业资格，资管行业从业经验21年，曾任幸福人寿保险股份有限公司总裁助理兼投资管理中心总经理，阳光保险集团股份有限公司资产投资管理中心投资负责人，阳光财产保险股份有限公司资金运用部总经理助理，光大永明人寿保险公司投资部投资分析主管，光大证券股份有限公司研究所分析师，华泰财产保险公司投资管理中心基金部副经理。

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期，对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他有关法律法规的规定，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

本报告期内未出现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

今年上半年本基金对市场运行规律进行了观察和反思，我们看到A股市场出现了一些比较突出的特征：即在一段时间内，某一个股价驱动因素被市场高度关注，其中部分股票也在短期内出现了明显高估或低估，这种现象在最近一两年的市场中表现显著。原因值得深思。在本基金看来，这或许正是传统估值模型在无形资产不断崛起的背景下遭遇挑战的结果。

过去我们曾多次论述当下经济转型期的主要特征，其中最重要的一点就是企业的价值创造由技术和设备等有形资产向以管理和文化为代表的无形资产迁移，而且后者在价值创造中的权重不断提升并逐渐发展为核心力量，这让我们过去所采用的针对有形资产的估值方法面临挑战—估值作为曾经投资最倚重的锚，在投资者的心中开始动摇，而在动摇的过程中，资金也开始为投资寻找新的锚。所以我们看到，最近几个季度的A股市场中，越来越多的投资者转向高度关注上市公司短期盈利表现，年度、半年度甚至季度利润超预期的公司受到了较多资金的追捧；而短期利润低于预期的公司，即使长期基本面向好，也暂时被市场所抛弃，从而出现了定期报告披露前后，一些长期基本面一般而短期利润超预期的股票阶段性高估，长期基本面比较好而短期利润低于或者不符合预期的股票阶段性低估的现象。

本基金认为，从长期投资的角度来看，短期利润高于或低于预期和估值的高低并不具备必然联系。着眼于长期较低风险较高回报的投资，不能因为短期利润高于或者超出

预期，就简单判断为该股票的估值偏低而去追捧；相反地，对于长期基本面及成长性均较好的股票，我们也不能因为短期利润暂时低于预期就简单判断为估值偏高。市场参与者过多追求上市公司短期盈利的结果，可能推动一部分长期基本面一般的公司股价快速上涨甚至阶段性高估。

过去一段时间，本基金始终坚持客观分析企业长期估值的视角：对于长期基本面向好，短期利润不符合或略低于预期的公司，我们把握股价下跌机会坚定加仓；相反，对于长期基本面虽然向好但存在一定隐忧的公司，如果短期利润高于预期、股价被持续推高，我们则会从长期估值分析角度进行适当减仓。

总体而言，上半年本基金依然坚定站在长期主义的视角，保持股票配置比例和组合结构的相对稳定，没有因为市场中短期预期的变化进行配置比例和结构的调整。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末泓德致远混合A基金份额净值为2.0540元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.92%，同期业绩比较基准收益率为1.66%；截至报告期末泓德致远混合C基金份额净值为1.9916元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.51%，同期业绩比较基准收益率为1.66%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

基于对长期经济转型的思考和他分析，本基金认为资本市场长期运行规律正发生较大的变化，在坚持长期投资理念不动摇的情况下，我们的投资框架和投资方法也在遭遇挑战。正如我们所看到的，一些管理和文化非常卓越的公司，它们在重重压力之下依靠科技、服务、管理创新强势地崛起，突破地域的界限，它们布局全球，不断开拓，构建出不断向上向外衍生的无形的护城河，这些公司估值的天花板是我们目前的估值方法无法触及的。在这种背景下，我们的投资不应再退回到传统的追逐短期盈利表现的茧房中去。

企业的价值创造需要从需求中来，从社会中来，投资的价值创造也是如此。正所谓“不谋全局，不足谋一域”，本基金认为，我们的投资首先需要建立在理解经济发展的全局及运行规律的基础上，在不断接近、吻合客观经济世界发展特征的思维框架下来讨论我们的投资标的。当然，经济世界的变化是复杂的，我们很难用一种思维模式分析清楚，所以才需要不断增加思维的视角，不断拼图，更新认知，我想这是投研工作者当下和未来需要做的工作。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及本基金合同约定，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。本基金管理人制订了证券投资基金估值政策与估值程序，设立基金估值小组，参考行业协会估值意见和独立第三方机构估值数据，确保基金估值的公平、合理。

本基金管理人制订的证券投资基金估值政策与估值程序确定了估值目的、估值日、估值对象、估值程序、估值方法以及估值差错处理、暂停估值和特殊情形处理等事项。

本基金管理人设立了由公司总经理、督察长、投研总监、固定收益部、监察稽核部、运营支持部等部门负责人组成的基金估值小组，负责研究、指导并执行基金估值业务。小组成员均具有多年证券、基金从业经验，具备基金估值运作、行业研究、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2021年6月30日，期末可供分配利润为1,392,376,527.06元，其中：泓德致远混合A期末可供分配利润为1,084,898,966.76元（泓德致远混合A的未分配利润已实现部分为1,084,898,966.76元，未分配利润未实现部分为807,656,007.46元），泓德致远混合C期末可供分配利润为307,477,560.30元（泓德致远混合C的未分配利润已实现部分为307,477,560.30元，未分配利润未实现部分为246,240,515.34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

本报告期内本基金不存在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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

#### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

### 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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 中期财务会计报告(未经审计)

### 6.1 资产负债表

会计主体：泓德致远混合型证券投资基金

报告截止日：2021年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	137,598,844.42	557,717,168.24
结算备付金		14,949.66	1,794,433.37
存出保证金		424,409.47	480,089.85
交易性金融资产	6.4.7.2	4,653,809,896.89	5,447,924,988.93
其中：股票投资		2,381,070,182.28	2,970,767,554.62
基金投资		-	-
债券投资		2,272,739,714.61	2,477,157,434.31
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		48,537,483.19	-
应收利息	6.4.7.5	7,744,939.87	9,230,191.18
应收股利		-	-
应收申购款		2,510,657.22	37,196,345.63
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		4,850,641,180.72	6,054,343,217.20
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年06月30日</b>	<b>上年度末 2020年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	12,258,332.87
应付赎回款		43,404,988.18	37,124,472.02
应付管理人报酬		4,878,784.69	5,774,942.45
应付托管费		609,848.09	721,867.78
应付销售服务费		741,468.82	660,590.47
应付交易费用	6.4.7.7	384,581.78	509,427.42
应交税费		10,725.82	10,729.76
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	259,721.12	304,341.71
负债合计		50,290,118.50	57,364,704.48
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	2,354,078,012.36	2,989,920,349.22
未分配利润	6.4.7.10	2,446,273,049.86	3,007,058,163.50
所有者权益合计		4,800,351,062.22	5,996,978,512.72
负债和所有者权益总计		4,850,641,180.72	6,054,343,217.20

注：报告截止日2021年6月30日，基金份额总额2,354,078,012.36份，其中A类基金份额总额为1,795,666,064.25份，基金份额净值为2.0540元；C类基金份额总额为558,411,948.11份，基金份额净值为1.9916元。

## 6.2 利润表

会计主体：泓德致远混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年01月01日至 2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至202 0年06月30日
<b>一、收入</b>		126,327,944.23	355,230,621.89
1. 利息收入		11,984,269.26	4,442,312.24
其中：存款利息收入	6.4.7.11	477,320.99	422,442.85
债券利息收入		11,506,948.27	4,019,869.39
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		488,897,680.25	147,559,712.61
其中：股票投资收益	6.4.7.12	464,979,608.00	109,869,778.79
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	14,323,213.70	31,561,977.02
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	9,594,858.55	6,127,956.80
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-381,967,119.11	195,899,199.43
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	7,413,113.83	7,329,397.61
<b>减：二、费用</b>		43,787,357.39	17,446,526.90

1. 管理人报酬		33,001,764.51	13,162,472.78
2. 托管费		4,125,220.58	1,645,309.16
3. 销售服务费		4,546,794.87	774,983.87
4. 交易费用	6.4.7.18	1,926,795.20	1,716,289.38
5. 利息支出		16,550.39	-
其中：卖出回购金融资产支出		16,550.39	-
6. 税金及附加		8,038.72	3,515.10
7. 其他费用	6.4.7.19	162,193.12	143,956.61
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		82,540,586.84	337,784,094.99
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		82,540,586.84	337,784,094.99

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泓德致远混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,989,920,349.22	3,007,058,163.50	5,996,978,512.72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	82,540,586.84	82,540,586.84
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-635,842,336.86	-643,325,700.48	-1,279,168,037.34
其中：1. 基金申购款	902,712,435.72	918,782,470.94	1,821,494,906.66

2. 基金赎回款	-1,538,554,772.58	-1,562,108,171.42	-3,100,662,944.00
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	2,354,078,012.36	2,446,273,049.86	4,800,351,062.22
项 目	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,471,116,509.40	585,456,083.52	2,056,572,592.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	337,784,094.99	337,784,094.99
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	231,680,543.84	157,574,329.23	389,254,873.07
其中：1. 基金申购款	1,810,628,483.81	883,882,647.10	2,694,511,130.91
2. 基金赎回款	-1,578,947,939.97	-726,308,317.87	-2,305,256,257.84
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,702,797,053.24	1,080,814,507.74	2,783,611,560.98

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	王德晓	李娇
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

泓德致远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[2017]1195号《关于准予泓德致远混合型证券投资基金注册的批复》核准,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《泓德致远混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金自成立之初为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集493,656,281.49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(2017)第851号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泓德致远混合型证券投资基金基金合同》于2017年8月30日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为493,834,527.04份,其中认购资金利息折合178,245.55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,基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《泓德致远混合型证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购费、申购费、销售服务费等收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。收取认(申)购费,不收取销售服务费的,称为A类基金份额;收取销售服务费,不收取认(申)购费的,称为C类基金份额。本基金A类基金份额、C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值,计算公式为:计算日某类基金份额净值=计算日该类基金份额的基金资产净值/计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泓德致远混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、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、中小企业私募债、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)、货币市场工具(含同业存单)、权证、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)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。本基金的投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例为0-50%。本基金每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后,

保持现金或到期日在一年期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。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×40%+中证综合债券指数收益率×60%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泓德致远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2021年1月1日至2021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2021年6月30日的财务状况以及2021年1月1日至2021年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金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[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非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
活期存款	137,598,844.42
定期存款	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
合计	137,598,844.42

## 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2021年06月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		1,826,997,271.37	2,381,070,182.28	554,072,910.91
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	2,061,199,661.27	2,102,645,714.61	41,446,053.34
	银行间市场	169,881,230.00	170,094,000.00	212,770.00
	合计	2,231,080,891.27	2,272,739,714.61	41,658,823.34
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		4,058,078,162.64	4,653,809,896.89	595,731,734.25

## 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 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应收活期存款利息	14,979.17
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-

应收结算备付金利息	6.70
应收债券利息	7,729,763.00
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	191.00
合计	7,744,939.87

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
交易所市场应付交易费用	383,477.58
银行间市场应付交易费用	1,104.20
合计	384,581.78

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	140,706.38
应付证券出借违约金	-
预提费用	119,014.74
合计	259,721.12

#### 6.4.7.9 实收基金

##### 6.4.7.9.1 泓德致远混合A

金额单位：人民币元

项目 (泓德致远混合A)	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	2,451,835,363.08	2,451,835,363.08
本期申购	619,979,581.03	619,979,581.03
本期赎回(以“-”号填列)	-1,276,148,879.86	-1,276,148,879.86
本期末	1,795,666,064.25	1,795,666,064.25

## 6.4.7.9.2 泓德致远混合C

金额单位：人民币元

项目 (泓德致远混合C)	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	538,084,986.14	538,084,986.14
本期申购	282,732,854.69	282,732,854.69
本期赎回(以“-”号填列)	-262,405,892.72	-262,405,892.72
本期末	558,411,948.11	558,411,948.11

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

## 6.4.7.10 未分配利润

## 6.4.7.10.1 泓德致远混合A

单位：人民币元

项目 (泓德致远混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,062,430,527.71	1,427,037,380.78	2,489,467,908.49
本期利润	373,392,826.67	-306,141,089.01	67,251,737.66
本期基金份额交易产生的变动数	-350,924,387.62	-313,240,284.31	-664,164,671.93
其中：基金申购款	285,471,815.46	360,062,372.25	645,534,187.71
基金赎回款	-636,396,203.08	-673,302,656.56	-1,309,698,859.64
本期已分配利润	-	-	-

本期末	1,084,898,966.76	807,656,007.46	1,892,554,974.22
-----	------------------	----------------	------------------

## 6.4.7.10.2 泓德致远混合C

单位：人民币元

项目 (泓德致远混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	211,139,396.30	306,450,858.71	517,590,255.01
本期利润	91,114,879.28	-75,826,030.10	15,288,849.18
本期基金份额交易产生的变动数	5,223,284.72	15,615,686.73	20,838,971.45
其中：基金申购款	126,355,042.52	146,893,240.71	273,248,283.23
基金赎回款	-121,131,757.80	-131,277,553.98	-252,409,311.78
本期已分配利润	-	-	-
本期末	307,477,560.30	246,240,515.34	553,718,075.64

## 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
活期存款利息收入	464,494.78
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	8,661.01
其他	4,165.20
合计	477,320.99

## 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
卖出股票成交总额	916,538,322.25
减：卖出股票成本总额	451,558,714.25

买卖股票差价收入	464,979,608.00
----------	----------------

## 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	994,313,338.03
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	975,448,467.35
减：应收利息总额	4,541,656.98
买卖债券差价收入	14,323,213.70

## 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

## 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
股票投资产生的股利收益	9,594,858.55
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	9,594,858.55

## 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
1. 交易性金融资产	-381,967,119.11
——股票投资	-451,862,095.11

——债券投资	69,894,976.00
——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	-381,967,119.11

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
基金赎回费收入	7,306,579.55
基金转换费收入	106,534.28
合计	7,413,113.83

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。

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
交易所市场交易费用	1,925,620.20
银行间市场交易费用	1,175.00
合计	1,926,795.20

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
审计费用	59,507.37
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	24,578.38
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	162,193.12

#### 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
招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）	基金托管人、基金销售机构

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	上年度可比期间
----	----	---------

	2021年01月01日至2021年06月30日	2020年01月01日至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	33,001,764.51	13,162,472.78
其中：支付销售机构的客户维护费	12,964,165.96	7,969,517.05

注：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 2021年01月01日至2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	4,125,220.58	1,645,309.16

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值0.15%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×0.15%/当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泓德致远混合A	泓德致远混合C	合计
泓德基金	0.00	20,110.30	20,110.30
招商银行	0.00	305,881.36	305,881.36
合计	0.00	325,991.66	325,991.66
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泓德致远混合A	泓德致远混合C	合计
泓德基金	0.00	51,148.72	51,148.72
招商银行	0.00	146,048.11	146,048.11
合计	0.00	197,196.83	197,196.83

注：支付销售机构的C类基金份额销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值0.80%的年费率每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付给泓德基金，再由泓德基金计算并支付给各基金销售机构。A类基金份额不收取销售服务费。其计算公式为：

日销售服务费=前一日C类基金份额基金资产净值×0.80%/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

本基金的管理人于本报告期及上年度可比期间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

本报告期末及上年度末除管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 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 2021年01月01日至2021年06月30日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020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
招商银行	137,598,844.42	464,494.78	150,536,995.45	406,570.84

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，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（2021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	可流通日	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
6009	三峡	2021	2021	限售	2.65	5.67	907,76	2,40	5,14	-

05	能源	-06-02	-12-10	股			3	5,57 1.95	7,01 6.21	
688819	天能股份	2021-01-07	2021-07-19	限售股	41.79	43.69	28,382	1,186,083.78	1,240,009.58	-
688626	翔宇医疗	2021-03-23	2021-10-08	限售股	28.82	104.16	3,652	105,250.64	380,392.32	-
688079	美迪凯	2021-02-23	2021-09-02	限售股	10.19	18.40	10,622	108,238.18	195,444.80	-
688345	博力威	2021-06-03	2021-12-13	限售股	25.91	55.53	2,332	60,422.12	129,495.96	-
688097	博众精工	2021-04-29	2021-11-12	限售股	11.27	28.01	3,983	44,888.41	111,563.83	-
300919	中伟股份	2020-12-15	2021-07-02	限售股	24.60	163.00	610	15,006.00	99,430.00	-
688639	华恒生物	2021-04-14	2021-10-22	限售股	23.16	42.28	2,302	53,314.32	97,328.56	-
688201	信安世纪	2021-04-13	2021-10-21	限售股	26.78	45.41	2,129	57,014.62	96,677.89	-
688499	利元亨	2021-06-23	2021-07-01	新股未上市	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-
300979	华利集团	2021-04-15	2021-10-26	限售股	33.22	87.50	925	30,728.50	80,937.50	-
6883	康拓	2021	2021	限售	17.3	74.4	1,085	18,8	80,8	-

14	医疗	-05-11	-11-18	股	4	8		13.90	10.80	
688117	圣诺生物	2021-05-26	2021-12-03	限售股	17.90	35.97	1,672	29,928.80	60,141.84	-
688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	新股未上市	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2021-07-05	新股未上市	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70	-
300973	立高食品	2021-04-08	2021-10-15	限售股	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-
688597	煜邦电力	2021-06-09	2021-12-17	限售股	5.88	10.16	3,907	22,973.16	39,695.12	-
688092	爱科科技	2021-03-12	2021-09-22	限售股	19.11	33.21	1,137	21,728.07	37,759.77	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-
300953	震裕科技	2021-03-11	2021-09-22	限售股	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
301009	可靠股份	2021-06-08	2021-12-17	限售股	12.54	27.89	801	10,044.54	22,339.89	-
300941	创识科技	2021-02-02	2021-08-09	限售股	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06	-
3010	百洋	2021	2021	限售	7.64	38.8	462	3,52	17,9	-

15	医药	-06- 22	-12- 30	股		3		9.68	39.4 6	
6882 26	威腾 电气	2021 -06- 28	2021 -07- 07	新股 未上 市	6.42	6.42	2,693	17,2 89.0 6	17,2 89.0 6	-
3009 82	苏文 电能	2021 -04- 19	2021 -10- 27	限售 股	15.8 3	45.2 9	317	5,01 8.11	14,3 56.9 3	-
3009 40	南极 光	2021 -01- 27	2021 -08- 03	限售 股	12.7 6	43.3 8	307	3,91 7.32	13,3 17.6 6	-
3006 14	百川 畅银	2021 -05- 18	2021 -11- 25	限售 股	9.19	40.3 8	329	3,02 3.51	13,2 85.0 2	-
3009 37	药易 购	2021 -01- 20	2021 -07- 27	限售 股	12.2 5	53.7 1	244	2,98 9.00	13,1 05.2 4	-
3010 13	利和 兴	2021 -06- 21	2021 -12- 29	限售 股	8.72	27.1 1	471	4,10 7.12	12,7 68.8 1	-
3009 42	易瑞 生物	2021 -02- 02	2021 -08- 09	限售 股	5.31	28.5 2	443	2,35 2.33	12,6 34.3 6	-
3009 33	中辰 股份	2021 -01- 15	2021 -07- 22	限售 股	3.37	10.4 4	1,112	3,74 7.44	11,6 09.2 8	-
3010 02	崧盛 股份	2021 -05- 27	2021 -12- 07	限售 股	18.7 1	57.6 2	201	3,76 0.71	11,5 81.6 2	-
6052 87	德才 股份	2021 -06- 28	2021 -07- 06	新股 未上 市	31.5 6	31.5 6	349	11,0 14.4 4	11,0 14.4 4	-
3009	嘉亨	2021	2021	限售	16.5	46.0	232	3,83	10,6	-

55	家化	-03-16	-09-24	股	3	7		4.96	88.24	
300996	普联软件	2021-05-26	2021-12-03	限售股	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300956	英力股份	2021-03-16	2021-09-27	限售股	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
300962	中金辐照	2021-03-29	2021-10-11	限售股	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300952	恒辉安防	2021-03-03	2021-09-13	限售股	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
301016	雷尔伟	2021-06-23	2021-12-30	限售股	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
300966	共同药业	2021-03-31	2021-10-11	限售股	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300945	曼卡龙	2021-02-03	2021-08-10	限售股	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021-02-18	2021-08-25	限售股	13.00	27.42	324	2,808.00	8,884.08	备注4
300931	通用电梯	2021-01-13	2021-07-21	限售股	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300961	深水海纳	2021-03-23	2021-09-30	限售股	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
3009	德固	2021	2021	限售	8.41	39.1	219	1,84	8,56	-

50	特	-02- 24	-09- 03	股		3		1.79	9.47	
6051 62	新中 港	2021 -06- 29	2021 -07- 07	新股 未上 市	6.07	6.07	1,377	8,35 8.39	8,35 8.39	-
3009 58	建工 修复	2021 -03- 18	2021 -09- 29	限售 股	8.53	27.2 2	300	2,55 9.00	8,16 6.00	-
3009 86	志特 新材	2021 -04- 21	2021 -11- 01	限售 股	14.7 9	30.5 7	264	3,90 4.56	8,07 0.48	-
3009 87	川网 传媒	2021 -04- 28	2021 -11- 11	限售 股	6.79	26.8 1	301	2,04 3.79	8,06 9.81	-
3009 78	东箭 科技	2021 -04- 15	2021 -10- 26	限售 股	8.42	13.6 0	593	4,99 3.06	8,06 4.80	-
3009 26	博俊 科技	2020 -12- 29	2021 -07- 12	限售 股	10.7 6	22.2 0	359	3,86 2.84	7,96 9.80	-
3009 93	玉马 遮阳	2021 -05- 17	2021 -11- 24	限售 股	12.1 0	19.2 9	410	4,96 1.00	7,90 8.90	-
3009 30	屹通 新材	2021 -01- 13	2021 -07- 21	限售 股	13.1 1	24.4 8	322	4,22 1.42	7,88 2.56	-
3009 85	致远 新能	2021 -04- 21	2021 -10- 29	限售 股	24.9 0	24.8 1	295	7,34 5.50	7,31 8.95	-
3009 71	博亚 精工	2021 -04- 07	2021 -10- 15	限售 股	18.2 4	28.2 9	245	4,46 8.80	6,93 1.05	-
3010	嘉益	2021	2021	限售	7.81	21.9	312	2,43	6,84	-

04	股份	-06-18	-12-27	股		4		6.72	5.28	
300991	创益通	2021-05-12	2021-11-22	限售股	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300927	江天化学	2020-12-29	2021-07-07	限售股	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300975	商络电子	2021-04-14	2021-10-21	限售股	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300963	中洲特材	2021-03-30	2021-10-11	限售股	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
301011	华立科技	2021-06-09	2021-12-17	限售股	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
300943	春晖智控	2021-02-03	2021-08-10	限售股	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300967	晓鸣股份	2021-04-02	2021-10-13	限售股	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300972	万辰生物	2021-04-08	2021-10-19	限售股	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300929	华骐环保	2021-01-12	2021-07-21	限售股	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300960	通业科技	2021-03-22	2021-09-29	限售股	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
3010	漱玉	2021	2022	新股	8.86	8.86	555	4,91	4,91	-

17	平民	-06-23	-01-05	未上市且限售				7.30	7.30	
300995	奇德新材	2021-05-17	2021-11-26	限售股	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
301007	德迈仕	2021-06-04	2021-12-16	限售股	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
300998	宁波方正	2021-05-25	2021-12-02	限售股	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301012	扬电科技	2021-06-15	2021-12-22	限售股	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
300992	泰福泵业	2021-05-17	2021-11-25	限售股	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
301010	晶雪节能	2021-06-09	2021-12-20	限售股	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	新股未上市且限售	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-

注：1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后6个月内不得转让。

2、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于6个月的限售期。

3、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。

4、上述流通受限股票持有期间分红情况如下：该股票于2021年6月4日实施权益分派方案：每10股派0.80元人民币现金（含税）；同时，以资本公积向全体股东每10股转增5股。

#### 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暂时停牌等流通受限股票。

#### 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

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

信用风险是指基金所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下降，或者债券回购交易到期时交易对手方不能履行付款或结算义务等，造成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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	170,094,000.00	94,723,500.00
合计	170,094,000.00	94,723,500.00

注：于2021年06月30日，未评级部分为政策性金融债（2020年12月31日，同）。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级的资产支持证券。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级的同业存单。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	1,894,425,955.50	2,099,810,086.00
AAA以下	196,078,159.11	240,238,048.31
未评级	12,141,600.00	42,385,800.00
合计	2,102,645,714.61	2,382,433,934.31

注：于2021年6月30日，未评级部分为政策性金融债（2020年12月31日，同）。债券信用评级取自第三方评级机构。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级的资产支持证券。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级的同业存单。

### 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同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(所有者权益)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票不得超过该上市公司可流通股票的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票，不得超过该上市公司可流通股票的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，本基金主动投资于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一定程度上独立于市场利率变化，此外，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 2021年 06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	137,598,844.42	-	-	-	137,598,844.42
结算备付金	14,949.66	-	-	-	14,949.66
存出保证金	424,409.47	-	-	-	424,409.47
交易性金融资产	254,467,553.10	1,658,762,761.41	359,509,400.10	2,381,070,182.28	4,653,809,896.89

应收证券清算款	-	-	-	48,537,483.19	48,537,483.19
应收利息	-	-	-	7,744,939.87	7,744,939.87
应收申购款	-	-	-	2,510,657.22	2,510,657.22
资产总计	392,505,756.65	1,658,762,761.41	359,509,400.10	2,439,863,262.56	4,850,641,180.72
负债					
应付赎回款	-	-	-	43,404,988.18	43,404,988.18
应付管理人报酬	-	-	-	4,878,784.69	4,878,784.69
应付托管费	-	-	-	609,848.09	609,848.09
应付销售服务费	-	-	-	741,468.82	741,468.82
应付交易费用	-	-	-	384,581.78	384,581.78
应交税费	-	-	-	10,725.82	10,725.82
其他负债	-	-	-	259,721.12	259,721.12
负债总计	-	-	-	50,290,118.50	50,290,118.50
利率敏感度缺口	392,505,756.65	1,658,762,761.41	359,509,400.10	2,389,573,144.06	4,800,351,062.22
上年度末 2020年 12月31 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	557,717,168.24	-	-	-	557,717,168.24
结算备付金	1,794,433.37	-	-	-	1,794,433.37
存出保证金	480,089.85	-	-	-	480,089.85
交易性	124,906,500.	2,247,044,899.	105,206,034.	2,970,767,554.	5,447,924,988.

金融资产	00	85	46	62	93
应收利息	-	-	-	9,230,191.18	9,230,191.18
应收申购款	-	-	-	37,196,345.63	37,196,345.63
资产总计	684,898,191.46	2,247,044,899.85	105,206,034.46	3,017,194,091.43	6,054,343,217.20
负债					
应付证券清算款	-	-	-	12,258,332.87	12,258,332.87
应付赎回款	-	-	-	37,124,472.02	37,124,472.02
应付管理人报酬	-	-	-	5,774,942.45	5,774,942.45
应付托管费	-	-	-	721,867.78	721,867.78
应付销售服务费	-	-	-	660,590.47	660,590.47
应付交易费用	-	-	-	509,427.42	509,427.42
应交税费	-	-	-	10,729.76	10,729.76
其他负债	-	-	-	304,341.71	304,341.71

负债总计	-	-	-	57,364,704.48	57,364,704.48
利率敏感度缺口	684,898,191.46	2,247,044,899.85	105,206,034.46	2,959,829,386.95	5,996,978,512.72

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

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
	市场利率下降25个基点	20,893,873.03	24,382,291.94
	市场利率上升25个基点	-20,627,247.58	-24,059,936.33

#### 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或债券，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 2021年06月30日		上年度末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	2,381,070,182.28	49.60	2,970,767,554.62	49.54
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—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,381,070,182.28	49.60	2,970,767,554.62	49.54

#### 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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
	业绩比较基准上升5%	323,155,529.90	434,864,178.42
	业绩比较基准下降5%	-323,155,529.90	-434,864,178.42

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

## (a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

## (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

## (i) 各层次金融工具公允价值

于2021年6月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为4,463,024,775.80元，属于第二层次的余额为190,785,121.09元，无属于第三层次的余额(2020年12月31日：第一层次5,305,962,596.88元，第二层次141,962,392.05元，无第三层次)。

## (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，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。

## (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

## (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

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

## (d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)

1	权益投资	2,381,070,182.28	49.09
	其中：股票	2,381,070,182.28	49.09
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,272,739,714.61	46.85
	其中：债券	2,272,739,714.61	46.85
	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	137,613,794.08	2.84
8	其他各项资产	59,217,489.75	1.22
9	合计	4,850,641,180.72	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	11,290.28	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,718,390,804.01	35.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,160,036.60	0.11
E	建筑业	25,371.37	0.00
F	批发和零售业	95,577.58	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	445,400,541.07	9.28
J	金融业	34,721.10	0.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	6,265,440.00	0.13

N	水利、环境和公共设施管理业	44,438.33	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	18,429.70	0.00
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	205,623,532.24	4.28
S	综合	-	-
	合计	2,381,070,182.28	49.60

### 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	002841	视源股份	3,416,654	424,655,925.66	8.85
2	600276	恒瑞医药	5,459,207	371,062,299.79	7.73
3	002410	广联达	4,181,562	285,182,528.40	5.94
4	601012	隆基股份	3,112,126	276,481,273.84	5.76
5	002595	豪迈科技	6,967,792	186,040,046.40	3.88
6	300251	光线传媒	16,999,864	183,768,529.84	3.83
7	688188	柏楚电子	366,847	159,945,292.00	3.33
8	300124	汇川技术	1,660,500	123,308,730.00	2.57
9	603288	海天味业	769,827	99,269,191.65	2.07
10	600563	法拉电子	612,298	96,963,511.28	2.02
11	300866	安克创新	389,951	65,305,093.97	1.36
12	002475	立讯精密	669,816	30,811,536.00	0.64
13	002986	宇新股份	1,076,779	26,747,190.36	0.56
14	603096	新经典	658,680	21,855,002.40	0.46
15	603160	汇顶科技	76,927	9,972,047.01	0.21
16	300416	苏试试验	273,600	6,265,440.00	0.13
17	600905	三峡能源	907,763	5,147,016.21	0.11
18	688080	映翰通	39,158	1,864,703.96	0.04

19	688389	普门科技	54,684	1,676,611.44	0.03
20	688819	天能股份	28,382	1,240,009.58	0.03
21	300999	金龙鱼	12,114	1,029,205.44	0.02
22	688626	翔宇医疗	3,652	380,392.32	0.01
23	688079	美迪凯	10,622	195,444.80	0.00
24	688345	博力威	2,332	129,495.96	0.00
25	688168	安博通	2,252	125,639.08	0.00
26	688097	博众精工	3,983	111,563.83	0.00
27	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.00
28	688639	华恒生物	2,302	97,328.56	0.00
29	688201	信安世纪	2,129	96,677.89	0.00
30	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.00
31	300979	华利集团	925	80,937.50	0.00
32	688314	康拓医疗	1,085	80,810.80	0.00
33	688117	圣诺生物	1,672	60,141.84	0.00
34	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
35	688585	上纬新材	4,922	52,173.20	0.00
36	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.00
37	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
38	688597	煜邦电力	3,907	39,695.12	0.00
39	688092	爱科科技	1,137	37,759.77	0.00
40	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
41	300787	海能实业	1,137	32,506.83	0.00
42	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
43	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
44	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
45	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
46	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
47	003032	传智教育	586	18,429.70	0.00
48	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
49	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00

50	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
51	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
52	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
53	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
54	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
55	301013	利和兴	471	12,768.81	0.00
56	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
57	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
58	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
59	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
60	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
61	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
62	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
63	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
64	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
65	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
66	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
67	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
68	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
69	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
70	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
71	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
72	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
73	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
74	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
75	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
76	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
77	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
78	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
79	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
80	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00

81	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
82	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
83	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
84	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
85	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
86	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
87	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
88	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
89	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
90	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
91	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
92	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
93	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
94	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
95	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
96	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
97	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
98	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
99	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
100	301010	晶雪节能	218	3,838.98	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	002410	广联达	129,396,851.88	2.16
2	600276	恒瑞医药	88,820,448.41	1.48
3	601012	隆基股份	62,200,152.32	1.04
4	002841	视源股份	11,283,463.00	0.19
5	300124	汇川技术	6,875,644.38	0.11

6	600905	三峡能源	3,436,527.95	0.06
7	688389	普门科技	1,494,966.28	0.02
8	688819	天能股份	1,186,083.78	0.02
9	688538	和辉光电	994,163.40	0.02
10	688425	铁建重工	388,259.34	0.01
11	300979	华利集团	307,152.12	0.01
12	688660	电气风电	278,734.72	0.00
13	688083	中望软件	276,468.50	0.00
14	688183	生益电子	228,453.48	0.00
15	688680	海优新材	195,482.30	0.00
16	688696	极米科技	167,429.96	0.00
17	688131	皓元医药	127,055.45	0.00
18	688276	百克生物	126,716.10	0.00
19	688619	罗普特	113,079.36	0.00
20	688161	威高骨科	111,159.18	0.00

#### 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	601012	隆基股份	269,445,525.05	4.49
2	300124	汇川技术	258,766,356.21	4.31
3	002475	立讯精密	114,561,621.40	1.91
4	603288	海天味业	90,737,177.45	1.51
5	002410	广联达	82,450,114.42	1.37
6	600563	法拉电子	22,905,441.62	0.38
7	600276	恒瑞医药	22,090,349.92	0.37
8	002841	视源股份	15,885,944.48	0.26
9	300416	苏试试验	4,268,807.65	0.07
10	600905	三峡能源	2,688,461.00	0.04
11	688521	芯原股份	1,764,650.27	0.03

12	688063	派能科技	1,599,188.86	0.03
13	688538	和辉光电	1,590,331.86	0.03
14	688425	铁建重工	1,120,952.83	0.02
15	300979	华利集团	778,800.20	0.01
16	688083	中望软件	761,221.00	0.01
17	688696	极米科技	688,278.00	0.01
18	688686	奥普特	622,112.10	0.01
19	688131	皓元医药	620,085.66	0.01
20	688680	海优新材	599,132.68	0.01

#### 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	313,723,437.02
卖出股票收入（成交）总额	916,538,322.25

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	182,235,600.00	3.80
	其中：政策性金融债	182,235,600.00	3.80
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)	2,090,504,114.61	43.55
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,272,739,714.61	47.35

#### 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	113021	中信转债	4,166,710	439,879,574.70	9.16
2	110059	浦发转债	4,119,300	421,939,899.00	8.79
3	110053	苏银转债	3,135,160	380,483,017.60	7.93
4	113044	大秦转债	2,916,950	300,183,324.50	6.25
5	110061	川投转债	2,135,340	279,708,186.60	5.83

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

##### 7.10.2 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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 7.11.3 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 报告期内本基金投资的前十名证券除中信转债(证券代码113021)、苏银转债(证券代码110053)、浦发转债(证券代码110059)外,其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查,不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。2021年2月5日,中信转债发行人中信银行股份有限公司因未按规定履行客户身份识别义务、未按规定保存客户身份资料和交易记录、未按规定报送大额交易报告和可疑交易报告、与身份不明的客户进行交易等原因被中国人民银行罚款2890万元。2021年3月17日,中信转债发行人中信银行股份有限公司因客户信息保护体制机制不健全、客户信息收集环节管理不规范、对客户敏感信息管理不善、系统权限管理存在漏洞等原因被中国银行保险监督管理委员会罚款450万元。2020年12月30日,苏银转债发行人江苏银行股份有限公司因个人贷款资金用途管控不严、发放流动资金贷款偿还银行承兑汇票垫款等原因被中国银行保险监督管理委员会江苏监管局罚款人民币240万元。2021年4月23日,浦发转债发行人上海浦东发展银行股份有限公司因2016年5月至2019年1月未按规定开展代销业务被中国银行保险监督管理委员会上海监管局责令改正,并处罚款共计760万元。2020年8月10日,浦发转债发行人上海浦东发展银行股份有限公司因2013年至2018年未按专营部门制规定开展同业业务等被中国保险监督管理委员会上海保监局责令改正,并处罚款共计2100万元。在上述公告公布后,本基金管理人对上述公司进行了进一步了解和他分析,认为上述处罚不会对投资价值构成实质性负面影响,因此本基金管理人对上述公司的投资判断未发生改变。

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	424,409.47
2	应收证券清算款	48,537,483.19
3	应收股利	-
4	应收利息	7,744,939.87
5	应收申购款	2,510,657.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	59,217,489.75
---	----	---------------

## 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113021	中信转债	439,879,574.70	9.16
2	110059	浦发转债	421,939,899.00	8.79
3	110053	苏银转债	380,483,017.60	7.93
4	113044	大秦转债	300,183,324.50	6.25
5	110061	川投转债	279,708,186.60	5.83
6	113014	林洋转债	94,477,104.00	1.97
7	113009	广汽转债	72,231,953.10	1.50
8	123064	万孚转债	58,605,426.00	1.22
9	113577	春秋转债	15,114,238.70	0.31
10	128109	楚江转债	14,128,800.00	0.29
11	128029	太阳转债	13,031,940.81	0.27
12	123060	苏试转债	720,649.60	0.02

## 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

份额级别	持有人户	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	数 (户)		持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总份 额比例
泓德 致远 混合A	104, 370	17,204.81	126,098,835.14	7.02%	1,669,567,229. 11	92.98%
泓德 致远 混合C	39,0 38	14,304.32	6,517,975.40	1.17%	551,893,972.71	98.83%
合计	141, 718	16,611.00	132,616,810.54	5.63%	2,221,461,201. 82	94.37%

注：机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

## 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	泓德致远混 合A	17,549.21	0.0010%
	泓德致远混 合C	49,723.92	0.0089%
	合计	67,273.13	0.0029%

注：从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区 间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式 基金	泓德致远混合A	0
	泓德致远混合C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基 金	泓德致远混合A	0
	泓德致远混合C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	泓德致远混合A	泓德致远混合C
基金合同生效日(2017年08月30日)基金份额总额	285,632,769.76	208,201,757.28
本报告期期初基金份额总额	2,451,835,363.08	538,084,986.14
本报告期基金总申购份额	619,979,581.03	282,732,854.69
减：本报告期基金总赎回份额	1,276,148,879.86	262,405,892.72
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,795,666,064.25	558,411,948.11

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

本报告期未发生公司和董事、监事和高级管理人员被中国证监会、证券业协会、证券交易所处罚或公开谴责，以及被财政、外汇和审计等部门施以重大处罚的情况。

本报告期内，本基金托管人涉及托管业务的高级管理人员未受到监管部门的稽查和处罚。

### 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	428,297,368.94	35.20%	304,645.56	35.20%	-
中信建投证券	2	367,699,755.43	30.22%	261,543.88	30.22%	-
广发证券	2	182,307,253.35	14.98%	129,673.60	14.98%	-
海通证券	2	102,593,281.51	8.43%	72,971.69	8.43%	-
信达证券	2	42,286,967.00	3.48%	30,078.64	3.48%	-
中泰证券	2	36,660,598.45	3.01%	26,076.91	3.01%	-
东亚前海证券	2	32,393,361.12	2.66%	23,041.38	2.66%	-
长城证券	1	24,371,262.72	2.00%	17,335.69	2.00%	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东兴	2	-	-	-	-	-

证券						
方正证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
中国中金财富证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-

注：1、本公司选择证券经营机构的标准

(1) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为本公司提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告等，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

(2) 资力雄厚，信誉良好。

(3) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。

(4) 经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚。

(5) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。

(6) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本公司基金进行证券交易的需，并能为本公司基金提供全面的信息服。

2、本公司租用券商交易单元的程序

(1) 研究机构提出服务意向，并提供相关研究报告。

(2) 研究机构的研究报告需要有一定的试用期。试用期视服务情况和研究服务评价结果而定。

(3) 研究部、投资部等部门试用研究机构的研究报告后，按照研究服务评价规定，对研究机构进行综合评价。

(4) 试用期满后，评价结果符合条件，双方认为有必要继续合作，经公司领导审批后，我司与研究机构签定《研究服务协议》、《券商交易单元租用协议》，并办理基金专用交易单元租用手续。评价结果如不符合条件则终止试用。

(5) 本公司每季度对签约机构的服务进行一次综合评价。经过评价，若本公司认为签约机构的服务不能满足要求，或签约机构违规受到国家有关部门的处罚，本公司有权终止签署的协议，并撤销租用的交易单元。

(6) 交易单元租用协议期限为一年，到期后若双方没有异议可自动延期一年。

3、本基金租用证券公司交易单元均为共用交易单元

## 4、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：海通证券、华安证券、方正证券、东亚前海证券、长城证券、中金财富证券、东方证券、开源证券。

(2) 本基金报告期内停止租用交易单元：无。

## 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	937,393,359.60	66.99%	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	122,072,497.00	8.72%	-	-	-	-	-	-
广发证券	80,032,449.80	5.72%	-	-	-	-	-	-
海通证券	96,437,501.53	6.89%	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东亚前海证券	33,614,883.80	2.40%	-	-	-	-	-	-
长城证券	129,763,515.70	9.27%	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中国中金财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-

长江证券	-	-	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---	---

### 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泓德致远混合型证券投资基金暂停大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2021-01-07
2	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华林证券股份有限公司为销售机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠的公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2021-01-08
3	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华泰证券股份有限公司为销售机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠的公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2021-01-08
4	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加交通银行股份有限公司为销售机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠的公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2021-01-13
5	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金参与国泰君安证券股份有限公司费率优惠活动并调整最低申购及定投金额起点的公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2021-01-13
6	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加国金证券股份有限公司为销售机构及参与其费率优惠的公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2021-01-16
7	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金参与长江证券	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2021-01-30

	股份有限公司费率优惠活动的公告		
8	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加长城证券股份有限公司为销售机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠的公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2021-02-20
9	泓德基金管理有限公司关于北京植信基金销售有限公司开通定投及转换业务并调整申认购金额起点的公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-11
10	泓德基金管理有限公司关于泓德致远混合型证券投资基金增加天风证券股份有限公司为销售机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠的公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-24
11	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及开通定投和转换业务并参与其费率优惠的公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-31
12	泓德基金管理有限公司关于旗下基金参与北京汇成基金销售有限公司基金转换费率优惠的公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-01
13	泓德基金管理有限公司关于泓德致远混合型证券投资基金增加中国银河证券股份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	2021-04-02
14	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加宁波银行股份有限公司为销售机构及参与其费率优惠的公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-23

15	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加财通证券股份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	2021-04-29
16	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中泰证券股份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	2021-04-30
17	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加侧袋机制并相应修改法律文件的公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-30
18	泓德基金管理有限公司关于泓德致远混合型证券投资基金增加方正证券股份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	2021-05-15
19	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中信建投期货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	2021-05-20
20	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加第一创业证券股份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	2021-05-28
21	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加江海证券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	2021-06-23
22	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行股份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	2021-06-30

## § 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

本基金本报告期间无单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%的情况。

## 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致远混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《泓德致远混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《泓德致远混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《泓德致远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指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](http://www.hongdefund.com)

泓德基金管理有限公司  
二〇二一年八月二十五日