

# 泓德优质治理灵活配置混合型证券投资基金

## 2022 年中期报告

2022 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:2022 年 08 月 26 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2022年8月25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2022年1月1日起至2022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	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	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	12
§6 中期财务会计报告(未经审计)	12
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产(基金净值)变动表	16
6.4 报表附注	19
§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	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55
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	56
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	56
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	56
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	56
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	56
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	58

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 .....	58
§10 重大事件揭示 .....	58
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	58
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 .....	58
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 .....	62
§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....	63
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 .....	63
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	63
§12 备查文件目录 .....	63
12.1 备查文件目录 .....	63
12.2 存放地点 .....	63
12.3 查阅方式 .....	63

## § 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	931,614,427.51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机制投资于香港证券市场，除了需要承担与境内证券

	<p>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		010-59322130	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5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5号
邮政编码		100088	100140
法定代表人		王德晓	陈四清

### 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 (2022年01月01日- 2022年06月30日)
本期已实现收益	-146,199,899.62
本期利润	-153,570,000.34
加权平均基金份额本期利润	-0.1615
本期加权平均净值利润率	-19.17%
本期基金份额净值增长率	-15.41%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2022年06月30日)
期末可供分配利润	-158,572,212.19
期末可供分配基金份额利润	-0.1702
期末基金资产净值	801,340,094.13
期末基金份额净值	0.8602
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2022年06月30日)
基金份额累计净值增长率	-13.98%

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	8.20%	1.28%	6.51%	0.83%	1.69%	0.45%
过去三个月	5.71%	1.59%	4.36%	1.14%	1.35%	0.45%
过去六个月	-15.41%	1.61%	-7.27%	1.18%	-8.14%	0.43%
过去一年	-21.13%	1.41%	-10.40%	0.98%	-10.73%	0.43%
自基金合同生效起至今	-13.98%	1.28%	-7.61%	0.93%	-6.37%	0.35%

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。

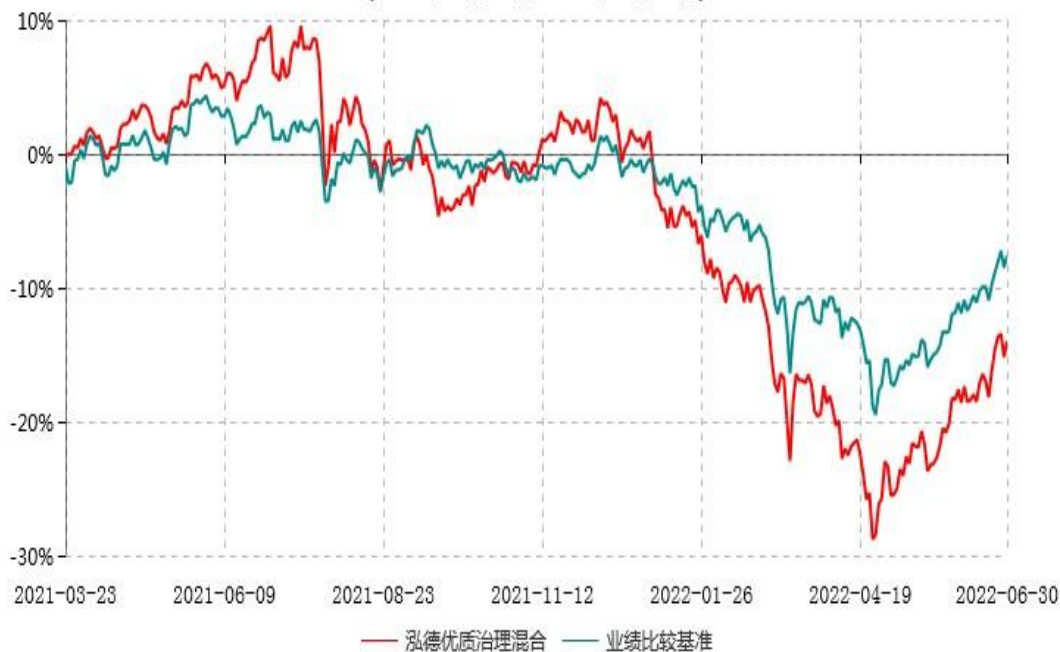
（3）中国债券综合全价指数是由中债金融估值中心有限公司编制，样本债券涵盖的范围全面，具有广泛的市场代表性，涵盖主要交易市场（银行间市场、交易所市场等）、不同发行主体（政府、企业等）和期限（长期、中期、短期等），能够很好地反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势。

（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-2022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1.43亿元，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（西藏）企业管理有限公司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%。

公司始终坚持“持有人利益优先”原则，聚焦主动投资管理，坚持长期价值投资，深度研究创造价值，追求长期、稳定、持续的一致性获利，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。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	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		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	-	14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

本基金的投资理念属于“基本面+量化双擎驱动”，报告期内的投资管理过程主要聚焦在以下两个方面：一是，深化标的企业长期基本面大逻辑的认知；二是，优化量化多因子模型的收益预测及风险管理能力。从股价驱动信息的角度来看，低频基本面因子，比如商业模式、竞争格局、结构性竞争优势、治理结构、管理层（自由现金流的优秀配置者），从绝对估值的角度决定了企业绝大部分的价值，同时也决定了公司的长期价值曲线；高频基本面因子，比如短期经营业绩、短期景气周期，从绝对估值的角度虽然只决定了企业少部分的价值，但却是公司中期股价波动的核心驱动因素；中高频量化因子，比如流动性、低频量价、动量、机构行为等，从绝对估值的角度虽然并不决定企业的价值，但是是公司短期股价波动的核心解释因素之一。

##### 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0.8602元，本报告期内，基金份额净值增长率为-15.41%，同期业绩比较基准收益率为-7.27%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年的证券市场，后续疫后修复和稳增长政策持续发力之下，悲观时刻即将过去，基本面与企业盈利大概率将实现企稳回升。同时，“宽信用”政策提振下，市场情绪和风险偏好也将很大程度回升，中长期来看，调整之后的优质权益资产的配置属于正当时。

从本基金的投资目标上来讲，我们致力于打造投资风格稳定鲜明、相对偏股混合型基金长期具备稳定较好超额收益的主动量化产品。在公募基金平台之上，如何扬长避短做到上述目标是作为一名量化背景的基金经理需要考虑的事情。本基金选择的一条可行的路径是，遵循基本面趋势投资的理念，围绕着股价驱动信息三个方面（低频基本面因子、高频基本面因子、以及中高频量化因子），打造好“基本面+量化双擎驱动”的投资体系，重视组合风险收益的性价比。

#### 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，设立基金估值小组，估值小组负责指导和监督整个估值流程。估值小组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小组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2022年06月30日，期末可供分配利润为-158,572,212.19元，其中：未分配利润已实现部分为-158,572,212.19元，未分配利润未实现部分为28,297,878.81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

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，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、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2022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 中期财务会计报告(未经审计)

## 6.1 资产负债表

会计主体：泓德优质治理灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2022年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	26,777,622.20	25,701,020.43
结算备付金		6,257,413.72	693,926.87
存出保证金		291,476.98	185,449.32
交易性金融资产	6.4.7.2	773,412,519.17	936,760,796.95
其中：股票投资		716,914,050.65	871,790,846.95
基金投资		-	-
债券投资		56,498,468.52	64,969,950.00
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	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	26,291,494.31
应收股利		2,090,179.19	-
应收申购款		33,059.11	6,861.06
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.7.5	-	805,457.12
资产总计		808,862,270.37	990,445,006.06
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年06月30日</b>	<b>上年度末 2021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		-	-
应付清算款		5,345,398.19	35.77
应付赎回款		505,231.30	494,512.79
应付管理人报酬		950,588.24	1,058,544.28
应付托管费		158,431.39	176,424.04
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		84.34	57.63
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	562,442.78	896,839.43
负债合计		7,522,176.24	2,626,413.94
<b>净资产:</b>			
实收基金	6.4.7.7	931,614,427.51	971,381,835.84
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-130,274,333.38	16,436,756.28
净资产合计		801,340,094.13	987,818,592.12
负债和净资产总计		808,862,270.37	990,445,006.06

注：报告截止日2022年6月30日，基金份额净值0.8602元，基金份额总额931,614,427.51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：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2022年01月01日至 2022年06月30日	上年度可比期间 2021年03月23日（基金 合同生效日）至2021 年06月30日
一、营业总收入		-146,477,559.91	91,462,654.13
1. 利息收入		69,035.00	1,510,395.86
其中：存款利息收入	6.4.7.9	54,333.63	517,939.76
债券利息收入		-	550,629.06
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		14,701.37	441,827.04
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		-139,222,621.03	10,452,525.26
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-146,762,050.38	8,071,029.21
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	908,581.12	64,540.44
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	6,630,848.23	2,316,955.61
以摊余成本计量的 金融资产终止确认 产生的收益		-	-
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	-7,370,100.72	79,110,673.47
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	46,126.84	389,059.54
<b>减：二、营业总支出</b>		7,092,440.43	5,851,044.48
1. 管理人报酬		5,983,880.10	4,100,610.49
2. 托管费		997,313.39	683,435.10
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		331.22	-
其中：卖出回购金融资产支出		331.22	-
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		49.51	0.21
8. 其他费用	6.4.7.16	110,866.21	1,066,998.68
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-153,570,000.34	85,611,609.65
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-153,570,000.34	85,611,609.65
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-153,570,000.34	85,611,609.65

### 6.3 净资产（基金净值）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：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	971,381,835.84	-	16,436,756.28	987,818,592.12



加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 (基金净值)	971,381,835. 84	-	16,436,756.2 8	987,818,592. 12
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-39,767,408. 33	-	-146,711,08 9.66	-186,478,49 7.99
(一)、综合收益总额	-	-	-153,570,00 0.34	-153,570,00 0.34
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-39,767,408. 33	-	6,858,910.68	-32,908,497. 65
其中：1. 基金申购款	7,111,126.56	-	-896,292.40	6,214,834.16
2. 基金赎回款	-46,878,534. 89	-	7,755,203.08	-39,123,331. 81
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产 (基金净值)	931,614,427. 51	-	-130,274,33 3.38	801,340,094. 13
项 目	上年度可比期间 2021年03月23日(基金合同生效日)至2021年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 (基金净值)	982,700,703. 83	-	-	982,700,703. 83

加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 (基金净值)	982,700,703. 83	-	-	982,700,703. 83
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-135,901,19 0.70	-	76,693,337.5 0	-59,207,853. 20
(一)、综合收益总额	-	-	85,611,609.6 5	85,611,609.6 5
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-135,901,19 0.70	-	-8,918,272.1 5	-144,819,46 2.85
其中：1. 基金申购款	10,028,801.7 3	-	773,368.48	10,802,170.2 1
2. 基金赎回款	-145,929,99 2.43	-	-9,691,640.6 3	-155,621,63 3.06
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产 (基金净值)	846,799,513. 13	-	76,693,337.5 0	923,492,850. 63

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2022年1月1日至2022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2022年6月30日的财务状况以及2022年1月1日至2022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

除下文6.4.5.1会计政策变更的说明中涉及的变更外,本报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于2017年颁布了修订后的《企业会计准则第22号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号—金融资产转移》、《企业会计准则第24号—套期会计》及《企业会计准则第37号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”),财政部、中国银行保险监督管理委员会于2020年12月30日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,公募证券投资基金自2022年1月1日起执行新金融工具准则。此外,中国证监会于2022年颁布了修订后的《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>》,本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金2022年1月1日至2022年6月30日止期间的财务报表,对本基金财务报表的影响列示如下:

##### 1 会计政策变更的性质、内容和原因

###### (a) 金融资产和金融负债的分类

###### 新金融工具准则

金融工具,是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时,确认相关的金融资产或金融负债。

###### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为:以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

###### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具（主要为股票投资）按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

原金融工具准则（截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则）

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资

产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

## (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### (b) 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

#### 新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

(c) 收入/(损失)的确认和计量

新金融工具准则

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

## 2 当期报表中受影响的项目名称和调整金额

### (a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整2022年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021年度的比较财务报表未重列。于2021年12月31日及2022年1月1日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

于2022年1月1日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收利息、应收证券清算款和应收申购款，金额分别为25,701,020.43元、693,926.87元、185,449.32元、0.00元、805,457.12元、26,291,494.31元和6,861.06元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、其他资产-应收利息、应收清算款和应收申购款，金额分别为25,703,497.50元、696,200.12元、185,506.82元、-6,768.49元、0.00元、26,291,494.31元和6,861.06元。



原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为936,760,796.95元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为937,568,214.74元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为35.77元、494,512.79元、1,058,544.28元、176,424.04元、814,994.50元和1,844.93元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为35.77元、494,512.79元、1,058,544.28元、176,424.04元、814,994.50元和1,844.93元。

于2021年12月31日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于2022年1月1日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b) 修订后的《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>》

根据中国证监会于2022年颁布的修订后的《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>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

#### 6.4.5.2 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。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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日
活期存款	26,777,622.20
等于：本金	26,775,401.07
加：应计利息	2,221.13
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	26,777,622.20

## 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	689,445,501.30	-	716,914,050.65	27,468,549.35
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	52,677.69	25,860,583.59	422,872.08
	银行间市场	489,884.93	30,637,884.93	-42,760.00
	合计	542,562.62	56,498,468.52	380,112.08
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	745,021,295.1	542,562.62	773,412,519.1	27,848,661.43

	2		7	
--	---	--	---	--

#### 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 2022年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,464.22
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	461,799.61
其中：交易所市场	461,501.61
银行间市场	298.00
应付利息	-
预提费用	99,178.95
合计	562,442.78

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	971,381,835.84	971,381,835.84
本期申购	7,111,126.56	7,111,126.56

本期赎回（以“-”号填列）	-46,878,534.89	-46,878,534.89
本期末	931,614,427.51	931,614,427.51

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
本期期初	-16,163,063.72	32,599,820.00	16,436,756.28
本期利润	-146,199,899.62	-7,370,100.72	-153,570,000.34
本期基金份额交易产生的变动数	3,790,751.15	3,068,159.53	6,858,910.68
其中：基金申购款	-517,873.96	-378,418.44	-896,292.40
基金赎回款	4,308,625.11	3,446,577.97	7,755,203.08
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-158,572,212.19	28,297,878.81	-130,274,333.38

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
活期存款利息收入	32,613.58
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	18,528.52
其他	3,191.53
合计	54,333.63

#### 6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
卖出股票成交总额	892,101,416.07
减：卖出股票成本总额	1,036,286,633.53

减：交易费用	2,576,832.92
买卖股票差价收入	-146,762,050.38

#### 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
	2022年01月01日至2022年06月30日
债券投资收益——利息收入	605,540.88
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	303,040.24
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	908,581.12

##### 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
	2022年01月01日至2022年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	69,572,034.20
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	68,389,012.63
减：应计利息总额	878,931.50
减：交易费用	1,049.83
买卖债券差价收入	303,040.24

#### 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
	2022年01月01日至2022年06月30日
股票投资产生的股利收益	6,630,848.23
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	6,630,848.23

## 6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
1. 交易性金融资产	-7,370,100.72
——股票投资	-6,597,578.39
——债券投资	-772,522.33
——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	-7,370,100.72

## 6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
基金赎回费收入	42,151.82
基金转换费收入	3,975.02

合计	46,126.84
----	-----------

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 2022年01月01日至2022年06月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	2,687.26
账户维护费	9,000.00
合计	110,866.21

#### 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

本报告期内，公司股东“泓德基业控股股份有限公司”名称变更为“泓德基业（西藏）企业管理有限公司”，其他存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
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

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 2022年01月01日 至2022年06月30 日	上年度可比期间 2021年03月23日（基金合同 生效日）至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,983,880.10	4,100,610.49
其中：支付销售机构的客户维护费	1,373,812.33	1,142,772.75

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1.50%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。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日 至2022年06月30 日	上年度可比期间 2021年03月23日（基金合同生 效日）至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	997,313.39	683,435.10

注：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。

#### 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

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 2022年01月01日至2022年06月30日		上年度可比期间 2021年03月23日（基金合同生效日） 至2021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	26,777,622.20	32,613.58	73,658,559.05	262,774.77

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（2022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
603338	浙江鼎力	2022-01-12	6个月	限售股	71.90	50.10	139,082	9,999.99	6,968.00	-
600938	中国海油	2022-04-14	6个月以上	限售股	10.80	15.86	84,004	907,243.20	1,332,303.44	-
301139	元道通信	2022-06-30	6个交易日	新股未上市	38.46	38.46	5,085	195,569.10	195,569.10	-
301239	普瑞眼科	2022-06-22	9个交易日	新股未上市	33.65	33.65	5,172	174,037.80	174,037.80	-
6882	理工	2022	6个	限售	65.2	45.3	3,185	207,	144,	-

82	导航	-03-10	月以上	股	1	7		693.85	503.45	
688175	高凌信息	2022-03-08	6个月以上	限售股	51.68	32.23	2,851	147,339.68	91,887.73	-
301233	盛帮股份	2022-06-24	8个交易日	新股未上市	41.52	41.52	1,418	58,875.36	58,875.36	-
301217	铜冠铜箔	2022-01-20	6个月以上	限售股	17.27	14.83	2,799	48,338.73	41,509.17	-
301215	中汽股份	2022-02-28	6个月以上	限售股	3.80	6.39	4,743	18,023.40	30,307.77	-
301236	软通动力	2022-03-08	6个月以上	限售股	72.88	31.38	945	45,914.40	29,654.10	备注5(1)
301150	中一科技	2022-04-14	6个月以上	限售股	163.56	82.76	343	37,455.24	28,386.68	备注5(2)
301206	三元生物	2022-01-26	6个月以上	限售股	109.30	45.69	607	44,266.50	27,733.83	备注5(3)
301207	华兰疫苗	2022-02-10	6个月以上	限售股	56.88	56.42	469	26,676.72	26,460.98	-
301216	万凯新材	2022-03-21	6个月以上	限售股	35.68	29.84	882	31,469.76	26,318.88	-
301302	华如科技	2022-06-16	6个月以上	限售股	52.03	56.42	466	24,245.98	26,291.72	-
3011	军信	2022	6个	限售	34.8	16.1	1,608	37,3	25,9	备注5

09	股份	-04-06	月以上	股	1	4		16.3 2	53.1 2	(4)
3012 01	诚达 药业	2022 -01- 12	6个 月以 上	限售 股	72.6 9	71.5 4	353	25,6 59.5 7	25,2 53.6 2	-
3012 19	腾远 钴业	2022 -03- 10	6个 月以 上	限售 股	173. 98	87.8 2	273	26,4 44.9 6	23,9 74.8 6	备注5 (5)
3012 68	铭利 达	2022 -03- 29	6个 月以 上	限售 股	28.5 0	34.8 7	641	18,2 68.5 0	22,3 51.6 7	-
3011 39	元道 通信	2022 -06- 30	6个 月以 上	新股 未上 市且 限售	38.4 6	38.4 6	566	21,7 68.3 6	21,7 68.3 6	-
3012 63	泰恩 康	2022 -03- 22	6个 月以 上	限售 股	19.9 3	31.3 8	682	13,5 92.2 6	21,4 01.1 6	-
3011 22	采纳 股份	2022 -01- 19	6个 月以 上	限售 股	50.3 1	70.3 7	301	15,1 43.3 1	21,1 81.3 7	-
3011 02	兆讯 传媒	2022 -03- 15	6个 月以 上	限售 股	39.8 8	31.0 9	642	25,6 02.9 6	19,9 59.7 8	-
3011 87	欧圣 电气	2022 -04- 13	6个 月以 上	限售 股	21.3 3	22.5 4	876	18,6 85.0 8	19,7 45.0 4	-
3012 39	普瑞 眼科	2022 -06- 22	6个 月以 上	新股 未上 市且 限售	33.6 5	33.6 5	575	19,3 48.7 5	19,3 48.7 5	-
3012 56	华融 化学	2022 -03-	6个 月以	限售 股	8.05	10.0 8	1,831	14,7 39.5	18,4 56.4	-

		14	上					5	8	
3008 34	星辉 环材	2022 -01- 06	6个 月以 上	限售 股	55.5 7	30.0 3	606	33,6 75.4 2	18,1 98.1 8	-
3011 23	奕东 电子	2022 -01- 14	6个 月以 上	限售 股	37.2 3	25.3 9	656	24,4 22.8 8	16,6 55.8 4	-
3011 03	何氏 眼科	2022 -03- 14	6个 月以 上	限售 股	42.5 0	32.0 2	507	16,5 75.0 0	16,2 34.1 4	备注5 (6)
3011 20	新特 电气	2022 -04- 11	6个 月以 上	限售 股	13.7 3	15.4 9	1,032	14,1 69.3 6	15,9 85.6 8	-
3012 35	华康 医疗	2022 -01- 21	6个 月以 上	限售 股	39.3 0	37.9 3	418	16,4 27.4 0	15,8 54.7 4	-
3011 51	冠龙 节能	2022 -03- 30	6个 月以 上	限售 股	30.8 2	21.4 6	703	21,6 66.4 6	15,0 86.3 8	-
3012 48	杰创 智能	2022 -04- 13	6个 月以 上	限售 股	39.0 7	29.8 7	472	18,4 41.0 4	14,0 98.6 4	-
3011 48	嘉戎 技术	2022 -04- 14	6个 月以 上	限售 股	38.3 9	23.9 0	516	19,8 09.2 4	12,3 32.4 0	-
3012 58	富士 莱	2022 -03- 21	6个 月以 上	限售 股	48.3 0	41.6 8	295	14,2 48.5 0	12,2 95.6 0	-
3012 59	艾布 鲁	2022 -04- 18	6个 月以 上	限售 股	18.3 9	24.9 4	483	8,88 2.37	12,0 46.0 2	-
3010 97	天益 医疗	2022 -03-	6个 月以	限售 股	52.3 7	47.8 3	249	13,0 40.1	11,9 09.6	-

		25	上					3	7	
3011 16	益客 食品	2022 -01- 10	6个 月以 上	限售 股	11.4 0	20.4 6	577	6,57 7.80	11,8 05.4 2	-
3012 37	和顺 科技	2022 -03- 16	6个 月以 上	限售 股	56.6 9	41.8 6	261	14,7 96.0 9	10,9 25.4 6	-
3011 37	哈焊 华通	2022 -03- 14	6个 月以 上	限售 股	15.3 7	15.9 9	644	9,89 8.28	10,2 97.5 6	-
3011 96	唯科 科技	2022 -01- 04	6个 月以 上	限售 股	64.0 8	37.5 2	271	17,3 65.6 8	10,1 67.9 2	-
3012 22	浙江 恒威	2022 -03- 02	6个 月以 上	限售 股	33.9 8	28.9 6	332	11,2 81.3 6	9,61 4.72	-
3012 88	清研 环境	2022 -04- 14	6个 月以 上	限售 股	19.0 9	19.9 8	452	8,62 8.68	9,03 0.96	-
3011 35	瑞德 智能	2022 -04- 01	6个 月以 上	限售 股	31.9 8	26.2 6	338	10,8 09.2 4	8,87 5.88	-
3011 81	标榜 股份	2022 -02- 11	6个 月以 上	限售 股	40.2 5	30.5 9	257	10,3 44.2 5	7,86 1.63	-
3011 58	德石 股份	2022 -01- 07	6个 月以 上	限售 股	15.6 4	20.3 8	379	5,92 7.56	7,72 4.02	-
3012 28	实朴 检测	2022 -01- 21	6个 月以 上	限售 股	20.0 8	20.3 4	373	7,48 9.84	7,58 6.82	-
3012 79	金道 科技	2022 -04-	6个 月以	限售 股	31.2 0	22.8 1	296	9,23 5.20	6,75 1.76	-

		06	上							
301233	盛帮股份	2022-06-24	6个月以上	新股未上市且限售	41.52	41.52	158	6,560.16	6,560.16	-

注：1、根据中国证监会《上市公司证券发行管理办法》、《创业板上市公司证券发行管理暂行办法》《上市公司非公开发行股票实施细则》、《关于修改〈上市公司证券发行管理办法〉的决定》、《关于修改〈创业板上市公司证券发行管理暂行办法〉的决定》以及《关于修改〈上市公司非公开发行股票实施细则〉的决定》，本基金所认购的2020年2月14日(含)后发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起6个月内不得转让。

2、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。

3、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。

4、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。

5、上述流通受限股票持有期间分红情况如下：

(1) 该股票于2022年6月9日实施权益分派方案：以资本公积向全体股东每10股转增5股。

(2) 该股票于2022年6月10日实施权益分派方案：每10股派发现金红利20元（含税），同时，以资本公积向全体股东每10股转增5股。

(3) 该股票于2022年6月17日实施权益分派方案：每10股派发现金红利10.00元（含税），同时，以资本公积向全体股东每10股转增5股。

(4) 该股票于2022年6月17日实施权益分派方案：每10股派发现金红利3.80元（含税），同时，以资本公积向全体股东每10股转增5股。

(5) 该股票于2022年5月24日实施权益分派方案：每10股派发现金股利39.90元（含税），同时，以资本公积向全体股东每10股转增8股。

(6) 该股票于2022年6月1日实施权益分派方案：每10股派发现金股利6元（含税），同时，以资本公积转增股本的方式向全体股东每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

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

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，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3.23%(上年度末：2.52%)。

##### 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(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期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 2022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	26,777,622.20	-	-	-	26,777,622.20
结算备付金	6,257,413.72	-	-	-	6,257,413.72
存出保证金	291,476.98	-	-	-	291,476.98
交易性金融资产	30,637,884.93	15,735,141.31	10,125,442.28	716,914,050.65	773,412,519.17
应收股利	-	-	-	2,090,179.19	2,090,179.19
应收申购款	-	-	-	33,059.11	33,059.11
资产总计	63,964,397.83	15,735,141.31	10,125,442.28	719,037,288.95	808,862,270.37
负债					
应付清算款	-	-	-	5,345,398.19	5,345,398.19
应付赎回款	-	-	-	505,231.30	505,231.30

应付管理人报酬	-	-	-	950,588.24	950,588.24
应付托管费	-	-	-	158,431.39	158,431.39
应交税费	-	-	-	84.34	84.34
其他负债	-	-	-	562,442.78	562,442.78
负债总计	-	-	-	7,522,176.24	7,522,176.24
利率敏感度缺口	63,964,397.83	15,735,141.31	10,125,442.28	711,515,112.71	801,340,094.13
上年度末 2021 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	25,701,020.43	-	-	-	25,701,020.43
结算备付金	693,926.87	-	-	-	693,926.87
存出保证金	185,449.32	-	-	-	185,449.32
交易性金融资产	40,066,000.00	14,405,000.00	10,498,950.00	871,790,846.95	936,760,796.95
应收证券清算款	-	-	-	26,291,494.31	26,291,494.31
应收申购款	-	-	-	6,861.06	6,861.06
其他资产	-	-	-	805,457.12	805,457.12
资产总计	66,646,396.62	14,405,000.00	10,498,950.00	898,894,659.44	990,445,006.06
负债					
应付证券清算款	-	-	-	35.77	35.77
应付赎回款	-	-	-	494,512.79	494,512.79
应付管理人报酬	-	-	-	1,058,544.28	1,058,544.28
应付托管费	-	-	-	176,424.04	176,424.04
应交税费	-	-	-	57.63	57.63
其他负债	-	-	-	896,839.43	896,839.43
负债总计	-	-	-	2,626,413.94	2,626,413.94
利率敏感度缺口	66,646,396.62	14,405,000.00	10,498,950.00	896,268,245.50	987,818,592.12

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公允价值占基金资产净值的比例为 7.05%(上年度末：6.58%)，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。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

#### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日			
	美元折 合人民 币	港币折合人民 币	其他币 种折合 人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	160,949,168. 09	-	160,949,168. 09
应收股利	-	2,090,179.19	-	2,090,179.19
资产合计	-	163,039,347. 28	-	163,039,347. 28
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口 净额	-	163,039,347. 28	-	163,039,347. 28
项目	上年度末 2021年12月31日			
	美元折 合人民 币	港币折合人民 币	其他币 种折合 人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	156,719,835. 03	-	156,719,835. 03
资产合计	-	156,719,835. 03	-	156,719,835. 03
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-

资产负债表外汇风险敞口	-	156,719,835.	-	156,719,835.
净额		03		03

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除外汇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 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
	港币相对人民币升值5%	8,151,967.36	7,835,991.75
	港币相对人民币贬值5%	-8,151,967.36	-7,835,991.75

#### 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 2022年06月30日		上年度末 2021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	716,914,050.65	89.46	871,790,846.95	88.25
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	716,914,050.65	89.46	871,790,846.95	88.25

#### 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 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
	业绩比较基准上升5%	51,200,047.24	-
	业绩比较基准下降5%	-51,200,047.24	-

注：于上年度末，本基金成立尚未满一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

#### 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

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末	上年度末
---------------	-----	------

	2022年06月30日	2021年12月31日
第一层次	733,065,492.22	890,323,562.75
第二层次	31,114,044.46	42,035,060.67
第三层次	9,232,982.49	4,402,173.53
合计	773,412,519.17	936,760,796.95

#### 6.4.14.2 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2022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(2021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	716,914,050.65	88.63
	其中：股票	716,914,050.65	88.63
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	56,498,468.52	6.98
	其中：债券	56,498,468.52	6.98
	资产支持证券	-	-

4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	33,035,035.92	4.08
8	其他各项资产	2,414,715.28	0.30
9	合计	808,862,270.37	100.00

注：本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币160,949,168.09元，占期末净值比例20.09%。

## 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	15,211,611.44	1.90
C	制造业	452,180,694.14	56.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	21,401.16	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	22,615,872.88	2.82
J	金融业	18,175,706.60	2.27
K	房地产业	18,027,450.00	2.25
L	租赁和商务服务业	19,959.78	0.00
M	科学研究和技术服务业	13,970,624.33	1.74
N	水利、环境和公共设施管理业	50,331.54	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	10,297,230.69	1.29



R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	5,394,000.00	0.67
	合计	555,964,882.56	69.38

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例 (%)
非日常生活消费品	40,227,162.68	5.02
能源	12,394,815.99	1.55
金融	11,263,057.55	1.41
医疗保健	12,280,528.40	1.53
信息技术	27,990,093.50	3.49
通讯业务	41,692,907.03	5.20
房地产	15,100,602.94	1.88
合计	160,949,168.09	20.09

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

### 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	00700	腾讯控股	76,700	23,246,185.07	2.90
2	03690	美团-W	123,300	20,477,404.82	2.56
3	600519	贵州茅台	9,900	20,245,500.00	2.53
4	601012	隆基绿能	300,821	20,043,703.23	2.50
5	600309	万华化学	197,300	19,136,127.00	2.39
6	300750	宁德时代	35,816	19,125,744.00	2.39
7	01024	快手-W	246,800	18,446,721.96	2.30

8	300059	东方财富	715,579	18,175,706.60	2.27
9	600048	保利发展	1,032,500	18,027,450.00	2.25
10	600809	山西汾酒	51,000	16,564,800.00	2.07
11	300896	爱美客	27,229	16,337,672.29	2.04
12	601689	拓普集团	235,100	16,087,893.00	2.01
13	300395	菲利华	357,100	16,069,500.00	2.01
14	603606	东方电缆	206,842	15,844,097.20	1.98
15	00688	中国海外发展	712,000	15,100,602.94	1.88
16	603596	伯特利	187,900	15,065,822.00	1.88
17	002271	东方雨虹	281,500	14,488,805.00	1.81
18	02382	舜宇光学科技	129,458	14,159,960.82	1.77
19	601899	紫金矿业	1,487,600	13,879,308.00	1.73
20	00883	中国海洋石油	1,399,000	12,394,815.99	1.55
20	600938	中国海油	84,004	1,332,303.44	0.17
21	02331	李宁	220,000	13,677,908.86	1.71
22	601100	恒立液压	219,945	13,575,005.40	1.69
23	688050	爱博医疗	60,000	13,452,000.00	1.68
24	300760	迈瑞医疗	42,400	13,279,680.00	1.66
25	600563	法拉电子	62,110	12,742,487.60	1.59
26	300775	三角防务	264,100	12,716,415.00	1.59
27	02269	药明生物	200,000	12,280,528.40	1.53
28	603259	药明康德	117,500	12,218,825.00	1.52
29	00968	信义光能	1,100,000	11,401,393.08	1.42
30	600176	中国巨石	648,100	11,283,421.00	1.41
31	02328	中国财险	1,614,000	11,263,057.55	1.41
32	688008	澜起科技	169,032	10,239,958.56	1.28
33	300850	新强联	114,962	10,235,066.86	1.28
34	603806	福斯特	156,091	10,227,082.32	1.28
35	603882	金城医学	122,200	10,087,610.00	1.26
36	688326	经纬恒润	64,934	9,549,194.04	1.19
37	600862	中航高科	310,000	8,711,000.00	1.09

38	300806	斯迪克	299,860	8,513,025.40	1.06
39	688111	金山办公	43,186	8,512,824.32	1.06
40	601208	东材科技	658,630	8,509,499.60	1.06
41	002463	沪电股份	560,000	8,265,600.00	1.03
42	300855	图南股份	190,500	7,960,995.00	0.99
43	688052	纳芯微	20,984	7,952,096.64	0.99
44	601058	赛轮轮胎	700,600	7,895,762.00	0.99
45	002812	恩捷股份	30,000	7,513,500.00	0.94
46	600111	北方稀土	200,000	7,032,000.00	0.88
47	605376	博迁新材	120,000	6,996,000.00	0.87
48	603338	浙江鼎力	139,082	6,968,008.20	0.87
49	603897	长城科技	220,000	6,853,000.00	0.86
50	300373	扬杰科技	90,000	6,412,500.00	0.80
51	688305	科德数控	80,000	6,109,600.00	0.76
52	01368	特步国际	500,000	6,071,849.00	0.76
53	688598	金博股份	20,559	6,058,737.30	0.76
54	000858	五粮液	30,000	6,057,900.00	0.76
55	300454	深信服	56,500	5,863,570.00	0.73
56	301035	润丰股份	66,005	5,442,112.25	0.68
57	600673	东阳光	600,000	5,394,000.00	0.67
58	601799	星宇股份	31,300	5,352,300.00	0.67
59	601702	华峰铝业	400,000	5,280,000.00	0.66
60	688789	宏华数科	20,000	3,292,600.00	0.41
61	002460	赣锋锂业	20,000	2,974,000.00	0.37
62	01347	华虹半导体	100,000	2,428,739.60	0.30
63	603260	合盛硅业	20,000	2,359,200.00	0.29
64	300627	华测导航	50,000	1,719,500.00	0.21
65	688202	美迪西	5,000	1,698,050.00	0.21
66	688356	键凯科技	7,000	1,692,670.00	0.21
67	003022	联泓新科	50,000	1,661,500.00	0.21
68	300428	立中集团	40,000	1,322,000.00	0.16

69	000933	神火股份	100,000	1,308,000.00	0.16
70	600460	士兰微	20,000	1,040,000.00	0.13
71	603297	永新光学	7,000	781,970.00	0.10
72	603986	兆易创新	5,000	711,050.00	0.09
73	002747	埃斯顿	10,700	262,150.00	0.03
74	301139	元道通信	5,651	217,337.46	0.03
75	301239	普瑞眼科	5,747	193,386.55	0.02
76	688282	理工导航	3,185	144,503.45	0.02
77	688175	高凌信息	2,851	91,887.73	0.01
78	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.01
79	301217	铜冠铜箔	2,799	41,509.17	0.01
80	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.00
81	301215	中汽股份	4,743	30,307.77	0.00
82	301236	软通动力	945	29,654.10	0.00
83	301150	中一科技	343	28,386.68	0.00
84	301206	三元生物	607	27,733.83	0.00
85	301207	华兰疫苗	469	26,460.98	0.00
86	301216	万凯新材	882	26,318.88	0.00
87	301302	华如科技	466	26,291.72	0.00
88	301109	军信股份	1,608	25,953.12	0.00
89	301201	诚达药业	353	25,253.62	0.00
90	301219	腾远钴业	273	23,974.86	0.00
91	301268	铭利达	641	22,351.67	0.00
92	301263	泰恩康	682	21,401.16	0.00
93	301122	采纳股份	301	21,181.37	0.00
94	301102	兆讯传媒	642	19,959.78	0.00
95	301187	欧圣电气	876	19,745.04	0.00
96	301256	华融化学	1,831	18,456.48	0.00
97	300834	星辉环材	606	18,198.18	0.00
98	301123	奕东电子	656	16,655.84	0.00
99	301103	何氏眼科	507	16,234.14	0.00

100	301120	新特电气	1,032	15,985.68	0.00
101	301235	华康医疗	418	15,854.74	0.00
102	301151	冠龙节能	703	15,086.38	0.00
103	301248	杰创智能	472	14,098.64	0.00
104	301148	嘉戎技术	516	12,332.40	0.00
105	301258	富士莱	295	12,295.60	0.00
106	301259	艾布鲁	483	12,046.02	0.00
107	301097	天益医疗	249	11,909.67	0.00
108	301116	益客食品	577	11,805.42	0.00
109	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
110	301237	和顺科技	261	10,925.46	0.00
111	301137	哈焊华通	644	10,297.56	0.00
112	301196	唯科科技	271	10,167.92	0.00
113	301222	浙江恒威	332	9,614.72	0.00
114	301288	清研环境	452	9,030.96	0.00
115	301135	瑞德智能	338	8,875.88	0.00
116	301181	标榜股份	257	7,861.63	0.00
117	301158	德石股份	379	7,724.02	0.00
118	301228	实朴检测	373	7,586.82	0.00
119	301279	金道科技	296	6,751.76	0.00

注：对于同时在A+H股上市的股票，合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

## 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	000002	万科A	30,302,740.00	3.07
2	600048	保利发展	28,459,957.00	2.88
3	600519	贵州茅台	19,251,145.00	1.95
4	688111	金山办公	17,304,652.03	1.75
5	601058	赛轮轮胎	16,970,722.00	1.72

6	00388	香港交易所	16,664,240.90	1.69
7	01024	快手-W	15,167,221.10	1.54
8	605376	博迁新材	15,062,795.00	1.52
9	03690	美团-W	15,034,624.09	1.52
10	002271	东方雨虹	15,026,698.00	1.52
11	00688	中国海外发展	14,995,920.34	1.52
12	600111	北方稀土	14,509,136.99	1.47
13	603259	药明康德	13,751,714.60	1.39
14	300454	深信服	13,501,469.20	1.37
15	300274	阳光电源	13,335,627.00	1.35
16	601689	拓普集团	13,141,432.19	1.33
17	603833	欧派家居	13,118,874.44	1.33
18	688008	澜起科技	12,995,866.26	1.32
19	002597	金禾实业	12,710,156.00	1.29
20	603806	福斯特	12,598,367.16	1.28

#### 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	000002	万科A	25,999,844.00	2.63
2	002142	宁波银行	25,687,659.66	2.60
3	600036	招商银行	22,503,553.50	2.28
4	002475	立讯精密	18,832,366.64	1.91
5	002179	中航光电	17,060,001.51	1.73
6	00291	华润啤酒	13,702,407.99	1.39
7	603583	捷昌驱动	13,117,753.00	1.33
8	600905	三峡能源	12,892,544.00	1.31
9	00388	香港交易所	12,637,136.05	1.28
10	300014	亿纬锂能	12,067,885.09	1.22

11	600887	伊利股份	11,904,279.00	1.21
12	002597	金禾实业	11,730,845.00	1.19
13	09633	农夫山泉	11,444,896.75	1.16
14	002138	顺络电子	11,276,467.38	1.14
15	600779	水井坊	11,028,201.00	1.12
16	02380	中国电力	11,003,802.36	1.11
17	603501	韦尔股份	10,727,714.87	1.09
18	300628	亿联网络	10,722,876.00	1.09
19	002332	仙琚制药	10,701,448.00	1.08
20	00941	中国移动	10,666,640.94	1.08

#### 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	888,007,415.62
卖出股票收入（成交）总额	892,101,416.07

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	30,637,884.93	3.82
	其中：政策性金融债	30,637,884.93	3.82
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)	25,860,583.59	3.23
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	56,498,468.52	7.05

## 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	210312	21进出12	200,000	20,333,561.64	2.54
2	190407	19农发07	100,000	10,304,323.29	1.29
3	127005	长证转债	69,995	8,101,075.56	1.01
4	113052	兴业转债	69,360	7,745,537.62	0.97
5	113044	大秦转债	70,000	7,634,065.75	0.95

## 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 报告期内本基金投资的前十名证券除21进出12（证券代码：210312）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。

2022年03月21日，21进出12（证券代码：210312）发行人中国进出口银行因中国进出口银行监管标准化数据(EAST)系统数据质量及数据报送存在漏报不良贷款余额EAST数据、漏报逾期90天以上贷款余额EAST数据、漏报贸易融资业务EAST数据、漏报贷款核销业务EAST数据等违法违规行为被中国银行保险监督管理委员会罚款420万元。

2021年07月13日，21进出12（证券代码：210312）发行人中国进出口银行因违规投资企业股权、个别高管人员未经核准实际履职、监管数据漏报错报、违规向地方政府购



买服务提供融资、违规变相发放土地储备贷款被中国银行保险监督管理委员会罚没 7345.6 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。本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合本基金管理人投资管理制度的规定。

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	291,476.98
2	应收清算款	-
3	应收股利	2,090,179.19
4	应收利息	-
5	应收申购款	33,059.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,414,715.28

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	127005	长证转债	8,101,075.56	1.01
2	113052	兴业转债	7,745,537.62	0.97
3	113044	大秦转债	7,634,065.75	0.95

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
9,789	95,169.52	353,890,800.45	37.99%	577,723,627.06	62.01%

## 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	2,709,277.77	0.2908%

## 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、基金投资和研发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	971,381,835.84
本报告期基金总申购份额	7,111,126.56
减：本报告期基金总赎回份额	46,878,534.89
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	931,614,427.51

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

2022年6月8日本基金管理人发布《泓德基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，王克玉先生、秦毅先生、李娇女士任公司副总经理。

(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、基金业协会、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	
中信建投证券	4	347,918,558.99	19.86%	246,151.19	19.74%	-
长江证券	1	2,209,518.43	0.13%	1,593.68	0.13%	-
长城证券	2	396,286,277.58	22.62%	280,157.42	22.47%	-
东北证券	2	138,486,316.27	7.90%	99,888.61	8.01%	-

国盛证券	2	289,899,235.04	16.55%	206,900.10	16.59%	-
华西证券	2	207,670,709.52	11.85%	147,714.06	11.85%	-
信达证券	2	77,216,965.49	4.41%	55,696.55	4.47%	-
中信证券	2	292,272,921.12	16.68%	208,664.52	16.74%	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	2	-	-	-	-	-
招商	2	-	-	-	-	-

证券						
中国中金财富证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	4	-	-	-	-	-

注：1、本公司选择证券经营机构的标准

- (1) 经营行为规范，内控制度健全，信誉良好。
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。
- (3) 研究实力较强，能及时为本公司提供高质量的研究服务。
- (4) 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  
要，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) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构；
- (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

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：渤海证券、中信证券
- (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
中信建投证券	1,096,265.90	1.90%	10,000,000.00	100.00%	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	770,526.40	1.34%	-	-	-	-	-	-
国盛证券	15,216,125.75	26.41%	-	-	-	-	-	-
华西证券	6,842,936.20	11.88%	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	33,681,223.00	58.47%	-	-	-	-	-	-

渤海证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中国中金财富 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-

### 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投资非公开发行股票的公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2022-01-14
2	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加国盛证券有限责任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	2022-01-19
3	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的公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2022-04-01
4	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加兴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	2022-04-27
5	泓德基金管理有限公司高级管理人员变更公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2022-06-08

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2022/01/01-2022/06/30	351,619,291.80	0.00	0.00	351,619,291.80	37.74%
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](http://www.hongdefund.com)

泓德基金管理有限公司  
二〇二二年八月二十六日