

# 泓德瑞嘉三年持有期混合型证券投资基金

## 2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人:泓德基金管理有限公司

基金托管人:平安银行股份有限公司

送出日期:2023 年 03 月 30 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。本年度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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年3月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本年度报告财务资料经审计，普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自2022年1月1日起至2022年12月31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	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 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	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
§6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	21
7.3 净资产（基金净值）变动表	23
7.4 报表附注	26
§8 投资组合报告	64
8.1 期末基金资产组合情况	64
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	65
8.3 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	66
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	69
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	71
8.6 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	72
8.7 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	72
8.8 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	72
8.9 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	72

8.10 本基金投资股指期货的投资政策	72
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	72
8.12 投资组合报告附注	73
§9 基金份额持有人信息	74
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	74
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	75
9.3 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	75
§10 开放式基金份额变动	75
§11 重大事件揭示	76
11.1 基金份额持有人大会决议	76
11.2 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	76
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	76
11.4 基金投资策略的改变	76
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	76
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	76
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	77
11.8 其他重大事件	78
§12 影响投资者决策的其他重要信息	79
12.1 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	80
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	80
§13 备查文件目录	80
13.1 备查文件目录	80
13.2 存放地点	80
13.3 查阅方式	80

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	泓德瑞嘉三年持有期混合型证券投资基金	
基金简称	泓德瑞嘉三年持有期混合	
基金主代码	012107	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021年05月25日	
基金管理人	泓德基金管理有限公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,400,464,992.46份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	泓德瑞嘉三年持有期混合A	泓德瑞嘉三年持有期混合C
下属分级基金的交易代码	012107	012108
报告期末下属分级基金的份额总额	1,310,594,245.15份	89,870,747.31份

### 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，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	本基金通过分析宏观经济和资本市场发展趋势，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。本基金股票投资从基本面分析入手，根据个股的估值水平优选个股。针对新三板精选层挂牌公司，本基金将重点关注流动性良好的优质公司，通过定性和定量相结合的方法进行自下而上的选择，积极寻找具有良好治理结构、竞争优势和良好成长潜力的公司纳入本基金的股票投资组合。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、可交换债券投资策略、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。
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	<p>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。</p> <p>本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港证券市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、投资于香港证券市场的风险、以及通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险等特有风险。</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	平安银行股份有限公司
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	95511-3
传真	010-59322130	0755-82080387
注册地址	西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦1206室	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号
办公地址	北京市西城区德胜门外大街125号	广东省深圳市福田区益田路5023号平安金融中心B座26楼
邮政编码	100088	518001
法定代表人	王德晓	谢永林

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.hongdefund.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	中国上海市浦东新区东育路588号前滩中心42楼
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、基金净值表现及利润分配情况

## 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	2022年		2021年05月25日(基金合同生效日)-2021年12月31日	
	泓德瑞嘉三年持有期混合A	泓德瑞嘉三年持有期混合C	泓德瑞嘉三年持有期混合A	泓德瑞嘉三年持有期混合C
本期已实现收益	-171,388,157.16	-11,992,954.89	2,579,796.07	-32,842.48
本期利润	-233,440,160.44	-16,234,044.67	-1,723,746.62	-332,575.18
加权平均基金份额本期利润	-0.1784	-0.1811	-0.0013	-0.0037
本期加权平均净值利润率	-21.22%	-21.63%	-0.13%	-0.38%
本期基金份额净值增长率	-17.89%	-18.23%	-0.13%	-0.37%
3.1.2 期末数据和指标	2022年末		2021年末	

期末可供分配利润	-235,971,469.54	-16,652,240.27	-1,743,146.23	-334,460.01
期末可供分配基金份额利润	-0.1800	-0.1853	-0.0013	-0.0037
期末基金资产净值	1,074,622,775.61	73,218,507.04	1,304,555,947.29	89,108,862.40
期末基金份额净值	0.8200	0.8147	0.9987	0.9963
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	2022年末		2021年末	
基金份额累计净值增长率	-18.00%	-18.53%	-0.13%	-0.37%

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

泓德瑞嘉三年持有期混合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
过去三个月	7.87%	1.18%	2.83%	0.98%	5.04%	0.20%
过去六个月	-7.26%	1.12%	-9.29%	0.87%	2.03%	0.25%
过去一年	-17.89%	1.32%	-15.88%	1.02%	-2.01%	0.30%
自基金合同生效起至今	-18.00%	1.14%	-17.50%	0.92%	-0.50%	0.22%

泓德瑞嘉三年持有期混合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
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----



过去三个月	7.75%	1.18%	2.83%	0.98%	4.92%	0.20%
过去六个月	-7.45%	1.12%	-9.29%	0.87%	1.84%	0.25%
过去一年	-18.23%	1.31%	-15.88%	1.02%	-2.35%	0.29%
自基金合同生效起至今	-18.53%	1.14%	-17.50%	0.92%	-1.03%	0.22%

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：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

泓德瑞嘉三年持有期混合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  
(2021年05月25日-2022年12月31日)

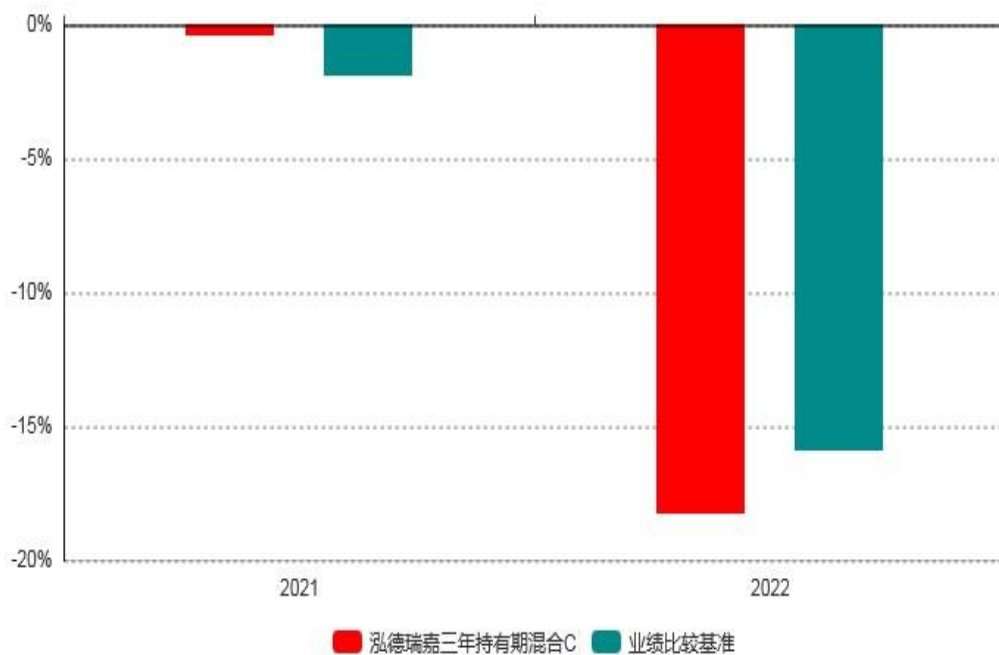
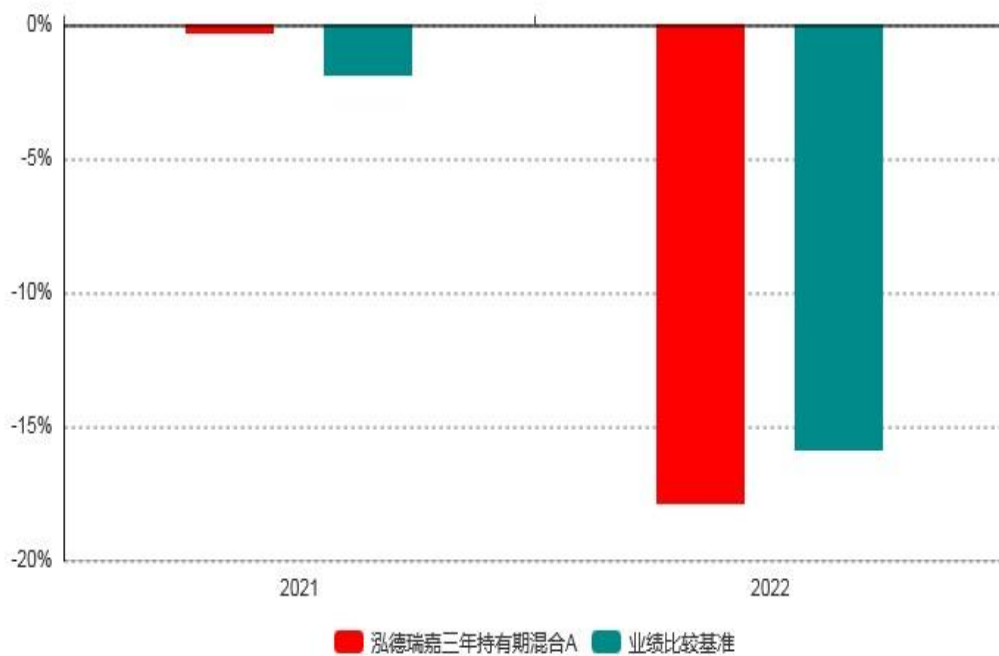


泓德瑞嘉三年持有期混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2021年05月25日-2022年12月31日)



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。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金合同自2021年5月25日生效，生效当年净值增长率及业绩比较基准收益率按实际存续期计算，未按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金于2021年5月25日（基金合同生效日）至2022年12月31日止会计期间未进行利润分配。

## §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%，珠海市基业长青投资中心（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		
王克玉	本基金的基金经理、公司副总经理、权益投资部总监	2021-05-25	-	20年	硕士研究生，具有基金从业资格，曾任本公司投研总监，长盛基金管理有限公司基金经理、权益投资部副总监，国都证券有限公司分析师，天相投资顾问有限公司分析师，元大京华证券上海代表处研究

					员。
--	--	--	--	--	----

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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《泓德基金管理有限公司公平交易制度》。公司通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

##### 4.3.2 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）的本年度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。

##### 4.3.3 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

2022年资本市场的运行跌宕起伏。万得全A指数全年下跌了18.66%，在过去多年的投资历程中并不是特别极差的收益水平；但这样的收益率是在年内还产生了两次非常大力度的反弹之后的结果。第一次是4月末最低点到二季度末，约两个月的时间里万得全A和创业板指数分别反弹了24%和31%，景气度高的行业，比如汽车、新能源等反弹幅度普遍超过50%；第二次是从10月末开始，目前还在进行过程中。

组合在年初布局时，对经济下行和企业盈利压力有一定预期，但是对资本市场流动性的判断相对乐观，因此在年初投资上相对积极，仓位保持在比价高的水平，组合结构相对均衡。这样的组合结构在3月份之后市场大幅下跌过程中具备相对优势，但是在4月末的组合优化幅度偏小导致反弹幅度不佳。在上市公司中报披露之后我们仔细分析了市场结构和公司的业绩情况，对组合的投资方向进行了适度的集中，特别是我们长期跟踪研究的软件、电子等行业的标的估值处于非常有吸引力的水平，在这种情况下我们把组合更多的向长期回报空间比较大的成长股方面调整；不足之处在于10月末的组合调整过程中对消费行业的机会把握力度不足。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末泓德瑞嘉三年持有期混合A基金份额净值为0.8200元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-17.89%，同期业绩比较基准收益率为-15.88%；截至报告期末泓德瑞嘉三年持有期混合C基金份额净值为0.8147元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-18.23%，同期业绩比较基准收益率为-15.88%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

### 4.5.1 对宏观经济和证券市场展望

从2021年二季度开始全球经济环境的波动使得过去非常稳定的投资环境发生了很大的变化。2021年下半年受到供需错配的影响，上游原材料价格开始大幅度上涨，特别是能源价格在22年还继续上涨，对全球的通胀造成很大的压力。但从2022年三季度以来受需求等多方面的影响，集装箱运价、芯片、能源等多种生产资料的价格又开始快速下跌，相关产业链进入快速去库存阶段。

对资本市场而言，通过持续的制度建设，市场体系中的各方参与者，包括投资者、上市公司持续的优胜劣汰，这将形成非常良好的运行机制。特别是在2022年下半年我们看到越来越多的上市公司推出回购、提高分红比例等方案，成为稳定市场的重要力量，有效的降低了市场的波动。长期看随着注册制的全面推行，随着越来越多具备长期发展竞争力的企业上市，证券市场将有机会给投资者提供合理的长期收益率。

### 4.5.2 本基金下阶段投资策略

资本市场长期收益来源于有竞争力的企业的持续涌现，在中国这样还处于中高速发展阶段、产业升级迭代持续进行的经济体中，产业研究也需要非常重视。在过去一年多的时间里，尽管宏观环境、产业政策等各方面都面临着比较大的波动，但我们看到中国有众多特别专注、专业的上市公司在自身领域快速发展，推动了自身企业和产业链综合竞争力的持续提升。从这个角度出发我对未来资本市场的投资机会非常乐观，自己的组合也会更加集中于这类企业，短期的市场波动更是给组合优化提供的良好机会。

在市场整体估值水平比较合理的情况下，下一个阶段组合将重点关注终端需求空间大，中国企业的竞争力持续提升，而短期市场定价有所偏离的行业，主要包括电子、软件、化工材料和医药，这将是今后一个阶段研究和投资的重点。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人继续完善内部控制体系和内部控制制度，健全管理制度和业务规章，依据国家相关法律法规、内部控制制度、内部管理制度和业务规章、基金合同以及基金招募说明书对本基金的投资、销售、运营等业务中的内部控制完善程度和执行情况进行持续的监察稽核，对监察稽核中发现的问题及时提示，督促改进并跟踪改进效果。

本报告期内，本基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

(1) 根据法律法规的要求，推动各业务单元更新、完善内部制度及业务流程。识别业务活动中的关键风险点，确定关键控制活动，持续完善内部控制措施。

(2) 对合同、协议等法律文件及实务运作中存在的法律风险进行识别及防范。

(3) 通过事前合规审核、持续优化合规监控系统、加强合规培训等方面，对业务活动中存在的合规风险进行识别及评估，完成各类合规管理工作。

(4) 按计划完成定期稽核工作，检查内容覆盖公司主要业务部门和业务环节，并对整改情况进行跟踪。

(5) 认真贯彻落实反洗钱各项法律法规，切实履行金融机构的反洗钱法定义务，将反洗钱工作贯穿于公司各项业务流程。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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，2022年度未实施利润分配。

本基金截至2022年12月31日，期末可供分配利润为-252,623,709.81元，其中：泓德瑞嘉三年持有期混合A期末可供分配利润为-235,971,469.54元（泓德瑞嘉三年持有期混合A的未分配利润已实现部分为-169,075,822.02元，未分配利润未实现部分为-66,895,647.52元），泓德瑞嘉三年持有期混合C期末可供分配利润为-16,652,240.27元（泓德瑞嘉三年持有期混合C的未分配利润已实现部分为-12,055,072.03元，未分配利润未实现部分为-4,597,168.24元）。

#### 4.9 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，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

#### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见



本报告期，本托管人复核的财务指标、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真实、准确、完整。

## §6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2023)第21140号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	泓德瑞嘉三年持有期混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容 我们审计了泓德瑞嘉三年持有期混合型证券投资基金(以下简称"泓德瑞嘉三年持有期混合基金")的财务报表,包括2022年12月31日的资产负债表,2022年度的利润表和净资产(基金净值)变动表以及财务报表附注。(二) 我们的意见 我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")、中国证券投资基金业协会(以下简称"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,公允反映了泓德瑞嘉三年持有期混合基金2022年12月31日的财务状况以及2022年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的"注册会计师对财务报表审计的责任"部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于泓德瑞嘉三年持有期混合基金,并履行了职业道</p>

	德方面的其他责任。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>泓德瑞嘉三年持有期混合基金的基金管理人泓德基金管理有限公司(以下简称"基金管理人")管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估泓德瑞嘉三年持有期混合基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算泓德瑞嘉三年持有期混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督泓德瑞嘉三年持有期混合基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:(一)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风</p>

	<p>险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。(二)了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。(三)评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。(四)对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能对泓德瑞嘉三年持有期混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致泓德瑞嘉三年持有期混合基金不能持续经营。(五)评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容,并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	陈熹	俞伟敏
会计师事务所的地址	中国上海市浦东新区东育路588号前滩中心42楼	
审计报告日期	2023-03-27	

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：泓德瑞嘉三年持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2022年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末	上年度末
----	-----	-----	------

		2022年12月31日	2021年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	21,027,731.16	57,356,144.01
结算备付金		545,732.04	928,556.96
存出保证金		287,162.13	354,962.87
交易性金融资产	7.4.7.2	1,098,185,171.30	1,287,626,161.75
其中：股票投资		1,037,166,489.11	1,226,064,161.75
基金投资		-	-
债券投资		61,018,682.19	61,562,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-8,986.98	-
应收清算款		30,017,973.98	57,843,426.66
应收股利		-	211,876.00
应收申购款		2,011.31	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	1,258,740.61
资产总计		1,150,056,794.94	1,405,579,868.86
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		15.95	9,262,463.41
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,474,840.38	1,761,834.31

应付托管费		245,806.76	293,639.04
应付销售服务费		25,092.37	30,044.68
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	469,756.83	567,077.73
负债合计		2,215,512.29	11,915,059.17
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	1,400,464,992.46	1,395,742,415.93
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	-252,623,709.81	-2,077,606.24
净资产合计		1,147,841,282.65	1,393,664,809.69
负债和净资产总计		1,150,056,794.94	1,405,579,868.86

注：报告截止日2022年12月31日，基金份额总额1,400,464,992.46份，其中A类基金份额总额为1,310,594,245.15份，基金份额净值为0.8200元；C类基金份额总额为89,870,747.31份，基金份额净值为0.8147元。

## 7.2 利润表

会计主体：泓德瑞嘉三年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年01月01日至2 022年12月31日	上年度可比期间 2021年05月25日（基 金合同生效日）至2 021年12月31日
一、营业总收入		-228,558,342.49	15,580,045.04
1.利息收入		886,820.72	3,454,599.15
其中：存款利息收入	7.4.7.9	804,614.56	2,054,298.02
债券利息收入		-	1,141,141.17
资产支持证券利息收 入		-	-

买入返售金融资产收入		82,206.16	259,159.96
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-163,152,070.15	16,728,721.28
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-179,372,411.12	9,731,805.76
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	1,293,668.21	560,797.55
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.12	-	-
股利收益	7.4.7.13	14,926,672.76	6,436,117.97
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）	7.4.7.14	-66,293,093.06	-4,603,275.39
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		21,115,862.62	17,636,366.84
1. 管理人报酬		17,637,821.97	12,409,875.18
2. 托管费		2,939,636.95	2,068,312.50
3. 销售服务费		300,403.34	211,865.77
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失		-	-

7. 税金及附加		0.36	1.10
8. 其他费用	7.4.7.16	238,000.00	2,946,312.29
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-249,674,205.11	-2,056,321.80
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-249,674,205.11	-2,056,321.80
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-249,674,205.11	-2,056,321.80

### 7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：泓德瑞嘉三年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年12月31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）	1,395,742,415.93	-	-2,077,606.24	1,393,664,809.69
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）	1,395,742,415.93	-	-2,077,606.24	1,393,664,809.69
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	4,722,576.53	-	-250,546,103.57	-245,823,527.04

(一)、综合收益总额	-	-	-249,674,205.11	-249,674,205.11
(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)	4,722,576.53	-	-871,898.46	3,850,678.07
其中: 1.基金申购款	4,722,576.53	-	-871,898.46	3,850,678.07
2.基金赎回款	-	-	-	-
(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)	1,400,464,992.46	-	-252,623,709.81	1,147,841,282.65
项目	上年度可比期间			
	2021年05月25日(基金合同生效日)至2021年12月31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)	1,393,821,237.38	-	-	1,393,821,237.38
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）	1,393,821,237.38	-	-	1,393,821,237.38
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,921,178.55	-	-2,077,606.24	-156,427.69
（一）、综合收益总额	-	-	-2,056,321.80	-2,056,321.80
（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）	1,921,178.55	-	-21,284.44	1,899,894.11
其中：1.基金申购款	1,921,178.55	-	-21,284.44	1,899,894.11
2.基金赎回款	-	-	-	-
（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）	1,395,742,415.93	-	-2,077,606.24	1,393,664,809.69

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

泓德瑞嘉三年持有期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]1132号《关于准予泓德瑞嘉三年持有期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《泓德瑞嘉三年持有期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，对于每份基金份额，锁定期从起始日开始，至起始日次三年的年度对日的前一日止。在锁定期内，基金份额持有人不能提出赎回申请，锁定期届满后的下一个工作日起可以提出赎回申请。对于每份认购份额，起始日指基金合同生效日；对于每份申购份额，起始日指该基金份额申购申请确认日。年度对日指某一日期在后续日历年中的对应日期，若该对应日为非工作日或该日历年实际不存在对应日期的，则顺延至下一工作日。存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集1,393,779,071.19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0513号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泓德瑞嘉三年持有期混合型证券投资基金基金合同》于2021年5月25日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为1,393,821,237.38份，其中认购资金利息折合42,166.19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，基金托管人为平安银行股份有限公司。

根据《泓德瑞嘉三年持有期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《泓德瑞嘉三年持有期混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资目标为在严格控制风险的前提下，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。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、存托凭证）、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）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资于其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。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。本基金的投资组合比例为：股票资产（含存托凭证）占基金资产的比例为60%-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%，投资于新三板精选层股票的比例不超过基金资产的15%。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，本基金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%。

本财务报表由本基金的基金管理人泓德基金管理有限公司于2023年3月27日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称"中国基金业协会")颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泓德瑞嘉三年持有期混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2022年度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12月31日的财务状况以及2022年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。比较财务报表的实际编制期间为2021年5月25日（基金合同生效日）至2021年12月31日。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 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的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。

#### 7.4.4.4 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。

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。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 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扣除按票面利率（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及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额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及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税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扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税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。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称"指引")，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 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，财政部于2022年颁布了《关于印发<资产管理产品相关会计处理规定>的通知》(财会[2022]14号)，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年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

##### (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股利，金额分别为 57,356,144.01 元、928,556.96 元、354,962.87 元、0.00 元、1,258,740.61 元、57,843,426.66 元和 211,876.00 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、应收清算款和应收股利，金额分别为 57,380,730.78 元、929,190.69 元、355,212.44 元、-22,582.20 元、0.00 元、57,843,426.66 元和 211,876.00 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 1,287,626,161.75 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 1,288,882,014.49 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、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费和应付交易费用，金额分别为 9,262,463.41 元、1,761,834.31 元、293,639.04 元、30,044.68 元和 407,077.73 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、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费和其他负债-应付交易费用，金额分别为 9,262,463.41 元、1,761,834.31 元、293,639.04 元、30,044.68 元和 407,077.73 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) 《资产管理产品相关会计处理规定》

根据《资产管理产品相关会计处理规定》，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。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 7.4.5.3 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。

### 7.4.6 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。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
活期存款	21,027,731.16	57,356,144.01
等于：本金	21,007,497.08	57,356,144.01
加：应计利息	20,234.08	-
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	-	-
合计	21,027,731.16	57,356,144.01

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022年12月31日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,107,980,387.56	-	1,037,166,489.11	-70,813,898.45
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	60,147,470.00	953,682.19	61,018,682.19	-82,470.00
	合计	60,147,470.00	953,682.19	61,018,682.19	-82,470.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,168,127,857.56	953,682.19	1,098,185,171.30	-70,896,368.45
项目		上年度末 2021年12月31日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,230,435,647.14	-	1,226,064,161.75	-4,371,485.39
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	1,281,000.00	-	1,281,000.00	-
	银行间市场	60,512,790.00	-	60,281,000.00	-231,790.00
	合计	61,793,790.00	-	61,562,000.00	-231,790.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,292,229,437.14	-	1,287,626,161.75	-4,603,275.39

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

### 7.4.7.4 买入返售金融资产

#### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-8,986.98	-
银行间市场	-	-
合计	-8,986.98	-
项目	上年度末 2021年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 7.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
应收利息	-	1,258,740.61
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	1,258,740.61

### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	369,756.83	407,077.73
其中：交易所市场	369,756.83	407,077.73
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	100,000.00	160,000.00
合计	469,756.83	567,077.73

#### 7.4.7.7 实收基金

##### 7.4.7.7.1 泓德瑞嘉三年持有期混合A

金额单位：人民币元

项目 (泓德瑞嘉三年持有期混合A)	本期 2022年01月01日至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,306,299,093.52	1,306,299,093.52
本期申购	4,295,151.63	4,295,151.63
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,310,594,245.15	1,310,594,245.15

##### 7.4.7.7.2 泓德瑞嘉三年持有期混合C

金额单位：人民币元

项目 (泓德瑞嘉三年持有期混合C)	本期 2022年01月01日至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	89,443,322.41	89,443,322.41
本期申购	427,424.90	427,424.90
本期赎回（以“-”号填列）	-	-



本期末	89,870,747.31	89,870,747.31
-----	---------------	---------------

注：申购含转换入份额。

#### 7.4.7.8 未分配利润

##### 7.4.7.8.1 泓德瑞嘉三年持有期混合A

单位：人民币元

项目 (泓德瑞嘉三年持有期 混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	2,617,536.63	-4,360,682.86	-1,743,146.23
本期利润	-171,388,157.16	-62,052,003.28	-233,440,160.44
本期基金份额交易产生的变动数	-305,201.49	-482,961.38	-788,162.87
其中：基金申购款	-305,201.49	-482,961.38	-788,162.87
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-169,075,822.02	-66,895,647.52	-235,971,469.54

##### 7.4.7.8.2 泓德瑞嘉三年持有期混合C

单位：人民币元

项目 (泓德瑞嘉三年持有期 混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-31,173.32	-303,286.69	-334,460.01
本期利润	-11,992,954.89	-4,241,089.78	-16,234,044.67
本期基金份额交易产生的变动数	-30,943.82	-52,791.77	-83,735.59
其中：基金申购款	-30,943.82	-52,791.77	-83,735.59
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-12,055,072.03	-4,597,168.24	-16,652,240.27

## 7.4.7.9 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12月31日	上年度可比期间 2021年05月25日（基金合同生效 日）至2021年12月31日
活期存款利息收入	776,265.22	1,997,312.07
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	22,662.87	50,948.87
其他	5,686.47	6,037.08
合计	804,614.56	2,054,298.02

## 7.4.7.10 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12月31日	上年度可比期间 2021年05月25日（基金合同生效 日）至2021年12月31日
卖出股票成交总额	1,197,614,414.36	543,865,165.79
减：卖出股票成本总额	1,373,649,292.91	534,133,360.03
减：交易费用	3,337,532.57	-
买卖股票差价收入	-179,372,411.12	9,731,805.76

## 7.4.7.11 债券投资收益

## 7.4.7.11.1 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12月31日	上年度可比期间 2021年05月25日（基金合同生效 日）至2021年12月31日
债券投资收益——利息收入	1,562,573.51	-
债券投资收益——买卖债券 （债转股及债券到期兑付） 差价收入	-268,905.30	560,797.55

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	1,293,668.21	560,797.55

#### 7.4.7.11.2 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12月31日	上年度可比期间 2021年05月25日（基金合同生效日） 至2021年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	63,957,765.51	1,876,114.30
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	62,122,990.00	1,315,000.00
减：应计利息总额	2,103,212.76	316.75
减：交易费用	468.05	-
买卖债券差价收入	-268,905.30	560,797.55

#### 7.4.7.12 衍生工具收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

#### 7.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至 2022年12月31日	上年度可比期间 2021年05月25日（基金合同生 效日）至2021年12月31日
股票投资产生的股利收益	14,926,672.76	6,436,117.97
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	14,926,672.76	6,436,117.97

## 7.4.7.14 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20 22年12月31日	上年度可比期间 2021年05月25日（基金合同生效日） 至2021年12月31日
1.交易性金融资产	-66,293,093.06	-4,603,275.39
——股票投资	-66,442,413.06	-4,371,485.39
——债券投资	149,320.00	-231,790.00
——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	-66,293,093.06	-4,603,275.39

## 7.4.7.15 其他收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他收入。

## 7.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至 2022年12月31日	上年度可比期间 2021年05月25日（基金合同生效 日）至2021年12月31日
审计费用	100,000.00	90,000.00
信息披露费	120,000.00	70,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费	18,000.00	4,500.00

开户费	-	400.00
交易费用	-	2,781,412.29
合计	238,000.00	2,946,312.29

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 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。

##### 7.4.8.2 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。

#### 7.4.9 关联方关系

2022年4月21日，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”，2022年12月12日，公司股东“珠海市基业长青股权投资基金（有限合伙）”名称变更为“珠海市基业长青投资中心（有限合伙）”。以上股东对公司的出资金额、出资方式及持股比例均未发生变化。

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
平安银行股份有限公司（以下简称“平安银行”）	基金托管人、基金销售机构
王德晓	基金管理人股东
阳光资产管理股份有限公司	基金管理人股东
泓德基业(西藏)企业管理有限公司	基金管理人股东
珠海市基业长青投资中心（有限合伙）	基金管理人股东
南京民生租赁股份有限公司	基金管理人股东
江苏岛村实业发展有限公司	基金管理人股东
上海捷朔信息技术有限公司	基金管理人股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 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。

## 7.4.10.2 关联方报酬

## 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日 至2022年12月31 日	上年度可比期间 2021年05月25日（基金合同 生效日）至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	17,637,821.97	12,409,875.18
其中：支付销售机构的客户维护费	8,073,702.62	5,537,284.78

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。

## 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日 至2022年12月31 日	上年度可比期间 2021年05月25日（基金合同生 效日）至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,939,636.95	2,068,312.50

注：支付基金托管人平安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。

## 7.4.10.2.3 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 2022年01月01日至2022年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泓德瑞嘉三年持有期混合A	泓德瑞嘉三年持有期混合C	合计
泓德基金	0.00	313.51	313.51
平安银行	0.00	235,441.43	235,441.43
合计	0.00	235,754.94	235,754.94

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021年05月25日（基金合同生效日）至2021年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泓德瑞嘉三年持有期混合A	泓德瑞嘉三年持有期混合C	合计
泓德基金	0.00	182.91	182.91
平安银行	0.00	166,265.21	166,265.21
合计	0.00	166,448.12	166,448.12

注：支付基金销售机构的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0.40%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×0.40%/当年天数。

#### 7.4.10.3 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。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

泓德瑞嘉三年持有期混合A

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2022年01月01日至2022年12月31日	2021年05月25日（基金合同生效日）至2021年1月31日
基金合同生效日（2021年05月25日）持有的基金份额	0.00	0.00
报告期初持有的基金份额	0.00	0.00
报告期间申购/买入总份额	197,638.18	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	197,638.18	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.01%	0.00%

## 泓德瑞嘉三年持有期混合C

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2022年01月01日至2022年12月31日	2021年05月25日（基金合同生效日）至2021年12月31日
基金合同生效日（2021年05月25日）持有的基金份额	0.00	0.00
报告期初持有的基金份额	0.00	0.00
报告期间申购/买入总份额	60,000.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	60,000.00	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%

注：1. 本年度申购/买入总份额为强制调增份额。

2. 基金管理人在本年度投资本基金适用的申购费率按照本基金招募说明书的规定执行。

#### 7.4.10.4.2 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

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 7.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2022年01月01日至2022年12月31日		2021年05月25日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
平安银行	21,027,731.16	776,265.22	57,356,144.01	1,997,312.07

注：本基金的银行存款由基金托管人平安银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.6 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。



#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

报告期内，本基金参与了平安证券股份有限公司、国信证券股份有限公司（均为基金托管人平安银行股份有限公司的控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的关联方）承销期内承销的安徽铜冠铜箔集团股份有限公司、石家庄尚太科技股份有限公司、首创证券股份有限公司、深圳市好上好信息科技股份有限公司、北京永信至诚科技股份有限公司、内蒙古欧晶科技股份有限公司、邦彦技术股份有限公司的首次公开发行人民币普通股（A股）网下申购。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2022年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
688114	华大智造	2022-09-02	6个月以上	限售股	87.18	105.05	4,639	404,428.02	487,326.95	-
688432	有研硅	2022-11-03	6个月以上	限售股	9.91	11.24	20,044	198,636.04	225,294.56	-
301095	广立微	2022-07-28	6个月以上	限售股	58.00	86.49	740	42,920.00	64,002.60	-
301267	华夏眼科	2022-10-26	6个月以上	限售股	50.88	66.20	825	41,976.00	54,615.00	-
301308	江波龙	2022-07-27	6个月以上	限售股	55.67	56.72	819	45,593.73	46,453.68	-
3013	华宝	2022-	6个	限售	237.5	176.9	242	57,47	42,82	-

27	新能	09-08	月以上	股	0	7		5.00	6.74	
301239	普瑞眼科	2022-06-22	6个月以上	限售股	33.65	69.68	575	19,348.75	40,066.00	-
301367	怡和嘉业	2022-10-21	6个月以上	限售股	119.88	175.78	223	26,733.24	39,198.94	-
301165	锐捷网络	2022-11-14	6个月以上	限售股	32.38	31.61	1,077	34,873.26	34,043.97	-
301356	天振股份	2022-11-03	6个月以上	限售股	63.00	43.33	614	38,682.00	26,604.62	-
301195	北路智控	2022-07-25	6个月以上	限售股	71.17	73.04	330	23,486.10	24,103.20	-
301389	隆扬电子	2022-10-18	6个月以上	限售股	22.50	17.16	1,269	28,552.50	21,776.04	-
301330	熵基科技	2022-08-10	6个月以上	限售股	43.32	31.31	694	30,064.08	21,729.14	-
301152	天力锂能	2022-08-19	6个月以上	限售股	57.00	46.64	433	24,681.00	20,195.12	-
301391	卡莱特	2022-11-24	6个月以上	限售股	96.00	80.97	247	23,712.00	19,999.59	-
301171	易点天下	2022-08-10	6个月以上	限售股	18.18	17.72	985	17,907.30	17,454.20	-
301363	美好	2022-09-28	6个	限售	30.66	37.85	445	13,643.70	16,843.25	-

	医疗		月以上	股						
301115	建科股份	2022-08-23	6个月以上	限售股	42.05	24.04	685	28,804.25	16,467.40	-
301296	新巨丰	2022-08-26	6个月以上	限售股	18.19	14.90	1,042	18,953.98	15,525.80	-
301223	中荣股份	2022-10-13	6个月以上	限售股	26.28	18.13	815	21,418.20	14,775.95	-
301121	紫建电子	2022-08-01	6个月以上	限售股	61.07	49.77	290	17,710.30	14,433.30	-
301139	元道通信	2022-06-30	6个月以上	限售股	38.46	25.31	566	21,768.36	14,325.46	-
301335	天元宠物	2022-11-11	6个月以上	限售股	49.98	33.82	420	20,991.60	14,204.40	-
301377	鼎泰高科	2022-11-11	6个月以上	限售股	22.88	17.63	770	17,617.60	13,575.10	-
301311	昆船智能	2022-11-23	6个月以上	限售股	13.88	15.86	832	11,548.16	13,195.52	-
301230	泓博医药	2022-10-21	6个月以上	限售股	40.00	48.32	269	10,760.00	12,998.08	-
301365	矩阵股份	2022-11-14	6个月以上	限售股	34.72	23.87	516	17,915.52	12,316.92	-
301366	一博	2022-09-19	6个	限售	65.35	45.09	268	17,513.80	12,084.12	-

	科技		月以上	股						
301283	聚胶股份	2022-08-26	6个月以上	限售股	52.69	51.41	235	12,382.15	12,081.35	-
301132	满坤科技	2022-08-03	6个月以上	限售股	26.80	24.48	468	12,542.40	11,456.64	-
301277	新天地	2022-11-09	6个月以上	限售股	27.00	25.78	439	11,853.00	11,317.42	-
301379	天山电子	2022-10-19	6个月以上	限售股	31.51	24.63	449	14,147.99	11,058.87	-
301273	瑞晨环保	2022-10-11	6个月以上	限售股	37.89	37.79	277	10,495.53	10,467.83	-
301318	维海德	2022-08-03	6个月以上	限售股	64.68	41.74	206	13,324.08	8,598.44	-
301313	凡拓数创	2022-09-22	6个月以上	限售股	25.25	29.14	247	6,236.75	7,197.58	-
301285	鸿日达	2022-09-21	6个月以上	限售股	14.60	12.60	565	8,249.00	7,119.00	-
301276	嘉曼服饰	2022-09-01	6个月以上	限售股	40.66	22.61	303	12,319.98	6,850.83	-
301388	欣灵电气	2022-10-26	6个月以上	限售股	25.88	21.60	292	7,556.96	6,307.20	-
301319	唯特	2022-09-22	6个	限售	47.75	53.27	115	5,491.25	6,126.05	-

	偶		月以上	股						
301309	万得凯	2022-09-08	6个月以上	限售股	39.00	24.46	228	8,892.00	5,576.88	-
301233	盛帮股份	2022-06-24	6个月以上	限售股	41.52	34.30	158	6,560.16	5,419.40	-
301316	慧博云通	2022-09-29	6个月以上	限售股	7.60	14.32	359	2,728.40	5,140.88	-

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。

#### 7.4.12.2 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。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 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。

##### 7.4.12.3.2 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。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 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。

#### 7.4.13.2 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0%(上年度末：0.09%)。

#### 7.4.13.3 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。

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，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.3.1 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7.4.12。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。

#### 7.4.13.4 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。

#### 7.4.13.4.1 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：

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年 12月31 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	21,027,731.16	-	-	-	21,027,731.16
结算备付金	545,732.04	-	-	-	545,732.04
存出保证金	287,162.13	-	-	-	287,162.13
交易性金融资产	61,018,682.19	-	-	1,037,166,489.11	1,098,185,171.30
买入返售金融资产	-8,986.98	-	-	-	-8,986.98
应收清算款	-	-	-	30,017,973.98	30,017,973.98
应收申购款	-	-	-	2,011.31	2,011.31
资产总计	82,870,320.54	-	-	1,067,186,474.40	1,150,056,794.94
负债					
应付清算款	-	-	-	15.95	15.95



应付管理人报酬	-	-	-	1,474,840.38	1,474,840.38
应付托管费	-	-	-	245,806.76	245,806.76
应付销售服务费	-	-	-	25,092.37	25,092.37
其他负债	-	-	-	469,756.83	469,756.83
负债总计	-	-	-	2,215,512.29	2,215,512.29
利率敏感度缺口	82,870,320.54	-	-	1,064,970,962.11	1,147,841,282.65
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	57,356,144.01	-	-	-	57,356,144.01
结算备付金	928,556.96	-	-	-	928,556.96
存出保证金	354,962.87	-	-	-	354,962.87
交易性金融资产	60,281,000.00	-	1,281,000.00	1,226,064,161.75	1,287,626,161.75
应收证券清算款	-	-	-	57,843,426.66	57,843,426.66
应收股利	-	-	-	211,876.00	211,876.00
其他资产	-	-	-	1,258,740.61	1,258,740.61
资产总计	118,920,663.84	-	1,281,000.00	1,285,378,205.02	1,405,579,868.86
负债					
应付证券清算款	-	-	-	9,262,463.41	9,262,463.41
应付管理人报	-	-	-	1,761,834.31	1,761,834.31

酬					
应付托管费	-	-	-	293,639.04	293,639.04
应付销售服务费	-	-	-	30,044.68	30,044.68
其他负债	-	-	-	567,077.73	567,077.73
负债总计	-	-	-	11,915,059.17	11,915,059.17
利率敏感度缺口	118,920,663.84	-	1,281,000.00	1,273,463,145.85	1,393,664,809.69

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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期期末，本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券（若有）公允价值占基金资产净值的比例为5.32%(上年度末：4.42%)，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)。

#### 7.4.13.4.2 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。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2022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	-	73,763,140.00	-	73,763,140.00
资产合计	-	73,763,140.00	-	73,763,140.00
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	-	73,763,140.00	-	73,763,140.00
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	-	150,185,133.00	-	150,185,133.00
应收股利	-	211,876.00	-	211,876.00
资产合计	-	150,397,009.00	-	150,397,009.00
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	-	150,397,009.00	-	150,397,009.00

#### 7.4.13.4.2.2 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12月31日	上年度末 2021年12月31日
	港币相对人民币升值5%	3,688,157.00	7,519,850.45
	港币相对人民币贬值5%	-3,688,157.00	-7,519,850.45

#### 7.4.13.4.3 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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31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	1,037,166,489.11	90.36	1,226,064,161.75	87.97
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	1,037,166,489.11	90.36	1,226,064,161.75	87.97

#### 7.4.13.4.3.2 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12月31日	上年度末 2021年12月31日
业绩比较基准上升5%	65,946,331.38	-
业绩比较基准下降5%	-65,946,331.38	-

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。

## 7.4.14 公允价值

### 7.4.14.1 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。

### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

#### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	1,035,695,335.09	1,183,807,086.72
第二层次	61,018,682.19	70,001,396.29
第三层次	1,471,154.02	33,817,678.74
合计	1,098,185,171.30	1,287,626,161.75

#### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

## 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

## 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	33,817,678.74	33,817,678.74
当期购买	-	41,499,197.99	41,499,197.99
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	11,291,471.40	11,291,471.40
转出第三层次	-	94,367,996.10	94,367,996.10
当期利得或损失总额	-	9,230,801.99	9,230,801.99
其中：计入损益的利得或损失	-	9,230,801.99	9,230,801.99
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,471,154.02	1,471,154.02
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	60,659.88	60,659.88
项目	上年度可比同期 2021年05月25日（基金合同生效日）至2021年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	17,885,168.23	17,885,168.23
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-

转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	15,932,510.51	15,932,510.51
其中:计入损益的利得或损失	-	15,932,510.51	15,932,510.51
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	33,817,678.74	33,817,678.74
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	15,932,510.51	15,932,510.51

注: 1.于2022年12月31日, 本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。于2022年度, 本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。

2.计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

#### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位: 人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	1,471,154.02	平均价格亚式期权模型	股价的预期年化波动率	18.91%-247.56%	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	33,817,678.74	平均价格亚式期权模型	股价的预期年化波动率	17.17%-274.17%	负相关

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2022年12月31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)。

#### 7.4.14.4 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。

#### 7.4.15 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。

### §8 投资组合报告

#### 8.1 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	1,037,166,489.11	90.18
	其中：股票	1,037,166,489.11	90.18
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	61,018,682.19	5.31
	其中：债券	61,018,682.19	5.31
	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	-8,986.98	0.00
	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	21,573,463.20	1.88
8	其他各项资产	30,307,147.42	2.64
9	合计	1,150,056,794.94	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73,763,140.00元，占期末净值比例6.43%。



## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 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	40,884,604.00	3.56
C	制造业	562,831,442.09	49.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	3,355,740.00	0.29
F	批发和零售业	1,305,970.00	0.11
G	交通运输、仓储和邮政业	10,896,324.00	0.95
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	297,952,598.24	25.96
J	金融业	82,553.38	0.01
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	10,368,028.00	0.90
M	科学研究和技术服务业	41,782.40	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	28,677,639.00	2.50
R	文化、体育和娱乐业	7,006,668.00	0.61
S	综合	-	-
	合计	963,403,349.11	83.93

### 8.2.2 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	14,767,008.00	1.29

医疗保健	20,742,480.00	1.81
信息技术	38,253,652.00	3.33
合计	73,763,140.00	6.43

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

### 8.3 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	600570	恒生电子	1,553,232	62,843,766.72	5.47
2	600309	万华化学	495,300	45,889,545.00	4.00
3	603596	伯特利	521,800	41,639,640.00	3.63
4	300558	贝达药业	781,947	38,526,528.69	3.36
5	601899	紫金矿业	3,646,400	36,464,000.00	3.18
6	688777	中控技术	398,706	36,214,465.98	3.16
7	300454	深信服	307,750	34,637,262.50	3.02
8	600941	中国移动	491,142	33,235,579.14	2.90
9	688536	思瑞浦	118,590	32,660,871.90	2.85
10	601636	旗滨集团	2,709,026	30,855,806.14	2.69
11	02382	舜宇光学科技	368,100	30,530,214.00	2.66
12	300782	卓胜微	263,600	30,129,480.00	2.62
13	300725	药石科技	371,833	29,932,556.50	2.61
14	300628	亿联网络	492,650	29,849,663.50	2.60
15	603160	汇顶科技	568,804	28,553,960.80	2.49
16	688521	芯原股份	618,443	27,254,783.01	2.37
17	688299	长阳科技	1,349,813	22,069,442.55	1.92
18	603882	金城医学	267,300	20,902,860.00	1.82
19	02269	药明生物	388,000	20,742,480.00	1.81
20	300003	乐普医疗	898,926	20,648,330.22	1.80
21	603228	景旺电子	1,008,800	20,418,112.00	1.78

22	688157	松井股份	221,700	19,398,750.00	1.69
23	601966	玲珑轮胎	836,669	17,134,981.12	1.49
24	688029	南微医学	201,380	16,539,339.40	1.44
25	688608	恒玄科技	135,343	15,429,102.00	1.34
26	02020	安踏体育	161,600	14,767,008.00	1.29
27	688111	金山办公	51,029	13,496,660.21	1.18
28	688300	联瑞新材	268,576	13,074,279.68	1.14
29	688798	艾为电子	116,002	11,081,671.06	0.97
30	002609	捷顺科技	1,224,300	11,018,700.00	0.96
31	601816	京沪高铁	2,214,700	10,896,324.00	0.95
32	688083	中望软件	55,722	10,842,386.76	0.94
33	688050	爱博医疗	46,377	10,699,173.90	0.93
34	603556	海兴电力	605,800	10,662,080.00	0.93
35	300768	迪普科技	806,650	10,615,514.00	0.92
36	002027	分众传媒	1,552,100	10,368,028.00	0.90
37	688297	中无人机	230,645	10,362,879.85	0.90
38	688030	山石网科	521,885	10,155,882.10	0.88
39	600498	烽火通信	729,200	9,581,688.00	0.83
40	688162	巨一科技	217,031	9,401,782.92	0.82
41	601728	中国电信	2,232,200	9,352,918.00	0.81
42	002241	歌尔股份	505,500	8,507,565.00	0.74
43	002242	九阳股份	504,400	8,312,512.00	0.72
44	600763	通策医疗	50,200	7,680,098.00	0.67
45	603699	纽威股份	663,300	7,362,630.00	0.64
46	688079	美迪凯	815,836	7,008,031.24	0.61
47	300413	芒果超媒	233,400	7,006,668.00	0.61
48	603345	安井食品	41,484	6,715,429.92	0.59
49	002465	海格通信	818,000	6,642,160.00	0.58
50	300379	东方通	268,800	5,491,584.00	0.48
51	600582	天地科技	963,600	5,010,720.00	0.44
52	600176	中国巨石	355,529	4,874,302.59	0.42

53	000338	潍柴动力	443,800	4,517,884.00	0.39
54	600028	中国石化	1,013,900	4,420,604.00	0.39
55	01810	小米集团-W	429,400	4,195,238.00	0.37
56	688800	瑞可达	39,192	4,181,002.56	0.36
57	603866	桃李面包	249,080	3,835,832.00	0.33
58	00268	金蝶国际	236,000	3,528,200.00	0.31
59	601668	中国建筑	618,000	3,355,740.00	0.29
60	603833	欧派家居	26,800	3,257,004.00	0.28
61	002572	索菲亚	150,100	2,725,816.00	0.24
62	600332	白云山	81,700	2,433,843.00	0.21
63	600183	生益科技	98,800	1,423,708.00	0.12
64	601933	永辉超市	357,800	1,305,970.00	0.11
65	688733	壹石通	30,331	1,142,568.77	0.10
66	603027	千禾味业	27,910	579,969.80	0.05
67	001323	慕思股份	17,100	566,352.00	0.05
68	688114	华大智造	4,639	487,326.95	0.04
69	301165	锐捷网络	10,769	364,638.09	0.03
70	688432	有研硅	20,044	225,294.56	0.02
71	301391	卡莱特	2,470	210,066.09	0.02
72	601136	首创证券	4,739	82,553.38	0.01
73	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.01
74	301095	广立微	740	64,002.60	0.01
75	603515	欧普照明	4,100	63,468.00	0.01
76	301267	华夏眼科	825	54,615.00	0.00
77	301308	江波龙	819	46,453.68	0.00
78	301327	华宝新能	242	42,826.74	0.00
79	301239	普瑞眼科	575	40,066.00	0.00
80	301367	怡和嘉业	223	39,198.94	0.00
81	301356	天振股份	614	26,604.62	0.00
82	301195	北路智控	330	24,103.20	0.00
83	301389	隆扬电子	1,269	21,776.04	0.00

84	301330	熵基科技	694	21,729.14	0.00
85	301152	天力锂能	433	20,195.12	0.00
86	301171	易点天下	985	17,454.20	0.00
87	301363	美好医疗	445	16,843.25	0.00
88	301115	建科股份	685	16,467.40	0.00
89	301296	新巨丰	1,042	15,525.80	0.00
90	301223	中荣股份	815	14,775.95	0.00
91	301121	紫建电子	290	14,433.30	0.00
92	301139	元道通信	566	14,325.46	0.00
93	301335	天元宠物	420	14,204.40	0.00
94	301377	鼎泰高科	770	13,575.10	0.00
95	301311	昆船智能	832	13,195.52	0.00
96	301230	泓博医药	269	12,998.08	0.00
97	301365	矩阵股份	516	12,316.92	0.00
98	301366	一博科技	268	12,084.12	0.00
99	301283	聚胶股份	235	12,081.35	0.00
100	301132	满坤科技	468	11,456.64	0.00
101	301277	新天地	439	11,317.42	0.00
102	301379	天山电子	449	11,058.87	0.00
103	301273	瑞晨环保	277	10,467.83	0.00
104	301318	维海德	206	8,598.44	0.00
105	301313	凡拓数创	247	7,197.58	0.00
106	301285	鸿日达	565	7,119.00	0.00
107	301276	嘉曼服饰	303	6,850.83	0.00
108	301388	欣灵电气	292	6,307.20	0.00
109	301319	唯特偶	115	6,126.05	0.00
110	301309	万得凯	228	5,576.88	0.00
111	301233	盛帮股份	158	5,419.40	0.00
112	301316	慧博云通	359	5,140.88	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

**8.4.1 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	600309	万华化学	50,454,294.96	3.62
2	600570	恒生电子	48,932,088.91	3.51
3	601636	旗滨集团	43,882,758.44	3.15
4	300059	东方财富	39,951,973.60	2.87
5	600779	水井坊	34,737,339.78	2.49
6	300454	深信服	34,363,631.52	2.47
7	300782	卓胜微	33,720,497.18	2.42
8	688777	中控技术	33,414,217.41	2.40
9	300725	药石科技	32,145,583.26	2.31
10	688536	思瑞浦	31,113,453.51	2.23
11	601899	紫金矿业	30,532,150.00	2.19
12	603501	韦尔股份	29,935,523.58	2.15
13	600941	中国移动	29,090,652.18	2.09
14	300558	贝达药业	29,006,275.26	2.08
15	601933	永辉超市	28,444,492.00	2.04
16	603345	安井食品	25,662,026.28	1.84
17	601966	玲珑轮胎	25,238,156.00	1.81
18	000002	万科A	25,101,496.88	1.80
19	300628	亿联网络	24,446,240.42	1.75
20	688521	芯原股份	22,519,801.62	1.62

**8.4.2 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	79,639,590.60	5.71
2	600048	保利发展	62,557,820.52	4.49
3	603345	安井食品	56,001,136.28	4.02

4	603596	伯特利	44,676,616.85	3.21
5	601899	紫金矿业	38,341,745.00	2.75
6	603501	韦尔股份	37,317,728.39	2.68
7	600176	中国巨石	35,729,353.00	2.56
8	300059	东方财富	33,610,841.80	2.41
9	601668	中国建筑	33,279,739.00	2.39
10	600779	水井坊	31,470,583.62	2.26
11	02382	舜宇光学 科技	30,282,913.96	2.17
12	601186	中国铁建	29,884,412.00	2.14
13	600309	万华化学	28,772,771.00	2.06
14	601966	玲珑轮胎	27,434,337.00	1.97
15	601021	春秋航空	27,152,977.26	1.95
16	01810	小米集团 - W	26,664,301.82	1.91
17	002142	宁波银行	26,480,928.98	1.90
18	002916	深南电路	26,241,903.39	1.88
19	601636	旗滨集团	26,085,144.00	1.87
20	300628	亿联网络	22,078,180.00	1.58

#### 8.4.3 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	1,251,194,033.33
卖出股票收入（成交）总额	1,197,614,414.36

注：本项中8.4.1、8.4.2、8.4.3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。

#### 8.5 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	61,018,682.19	5.32
	其中：政策性金融债	61,018,682.19	5.32
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	61,018,682.19	5.32

#### 8.6 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	200402	20农发02	500,000	50,843,767.12	4.43
2	200407	20农发07	100,000	10,174,915.07	0.89

注：本基金本报告期末仅持有两只债券。

#### 8.7 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。

#### 8.8 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。

#### 8.9 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。

#### 8.10 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。

#### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 8.11.1 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。

### 8.11.2 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。

### 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 报告期内本基金投资的前十名证券除20农发02（证券代码：200402）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，20农发02（证券代码：200402）发行人中国农业发展银行因中国农业发展银行监管标准化数据(EAST)系统数据质量及数据报送中漏报不良贷款余额 EAST数据、逾期90天以上贷款余额EAST数据存在偏差、漏报贷款核销业务EAST数据、漏报抵押物价值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480万元。

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。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。

8.12.2 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。

### 8.12.3 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	287,162.13
2	应收清算款	30,017,973.98
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,011.31
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	30,307,147.42

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 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。

### 8.12.6 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。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
泓德瑞嘉三年持有期混合A	14,599	89,772.88	798,454.36	0.06%	1,309,795,790.79	99.94%
泓德瑞嘉三年持有期混合C	1,844	48,736.85	60,000.00	0.07%	89,810,747.31	99.93%
合计	16,343	85,692.04	858,454.36	0.06%	1,399,606,538.10	99.94%

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）。

## 9.2 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	泓德瑞嘉三年持有 期混合A	989,100.23	0.0755%
	泓德瑞嘉三年持有 期混合C	-	-
	合计	989,100.23	0.0706%

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）。

## 9.3 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	泓德瑞嘉三年持有 期混合A	50~100
	泓德瑞嘉三年持有 期混合C	0
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基 金	泓德瑞嘉三年持有 期混合A	50~100
	泓德瑞嘉三年持有 期混合C	0
	合计	50~100

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

	泓德瑞嘉三年持有期混 合A	泓德瑞嘉三年持有期混 合C
基金合同生效日(2021年05月25 日)基金份额总额	1,304,464,504.80	89,356,732.58

本报告期期初基金份额总额	1,306,299,093.52	89,443,322.41
本报告期基金总申购份额	4,295,151.63	427,424.90
减：本报告期基金总赎回份额	-	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,310,594,245.15	89,870,747.31

注：总申购份额含转换入份额。

## §11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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。

### 11.3 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。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

### 11.5 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。本报告期应支付给该会计师事务所的报酬100,000.00元，已连续为本基金提供审计服务2年。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

## 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	2	1,254,119,036.22	52.55%	897,780.63	52.42%	-
浙商证券	1	544,213,070.59	22.80%	391,490.45	22.86%	-
华安证券	2	423,011,099.68	17.73%	304,399.34	17.77%	-
西南证券	2	165,042,768.82	6.92%	119,044.47	6.95%	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-

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务。

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：华安证券、中泰证券

(2) 本基金报告期内停止租用交易单元：无

### 11.7.2 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	1,428,053.50	76.99%	30,000,000.00	33.33%	-	-	-	-
浙商证券	426,712.01	23.01%	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	60,000,000.00	66.67%	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-

### 11.8 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、上海证券报、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、上海证券报、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基金投资关联方承销期内承销证券的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2022-01-21
4	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、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2022-03-16
5	泓德基金管理有限公司关于泓德瑞嘉三年持有期混合型证券投资基金恢复申购、转换转入、定期定额投资业务	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2022-03-17

	的公告		
6	泓德基金管理有限公司高级管理人员变更公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2022-06-08
7	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华宝证券股份有限公司为销售机构的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2022-07-08
8	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加济安财富（北京）基金销售有限公司为销售机构的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2022-07-20
9	泓德基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2022-09-17
10	泓德基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2022-09-24
11	泓德基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2022-10-13
12	泓德基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2022-10-21
13	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加泰信财富基金销售有限公司的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2022-11-04
14	泓德基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2022-12-16
15	泓德基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2022-12-22

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准泓德瑞嘉三年持有期混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《泓德瑞嘉三年持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《泓德瑞嘉三年持有期混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《泓德瑞嘉三年持有期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。

### 13.2 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

### 13.3 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，客户服务热线：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  
二〇二三年三月三十日