
泓德优质治理灵活配置混合型证券投资基金

2023 年中期报告

2023 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:2023 年 08 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2023年8月29日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2023年1月1日起至2023年6月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48
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	48
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	49
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	49
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	49
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	49
7.12 投资组合报告附注	49
§8 基金份额持有人信息	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	50
§9 开放式基金份额变动	51
§10 重大事件揭示	51
10.1 基金份额持有人大会决议	51
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	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	51
10.4 基金投资策略的改变	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	52
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	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	52
10.8 其他重大事件	55
§11 影响投资者决策的其他重要信息	56
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	56
§12 备查文件目录	56
12.1 备查文件目录	56
12.2 存放地点	57
12.3 查阅方式	57

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	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	852,833,039.23份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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

	<p>机制投资于香港证券市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、投资于香港证券市场的风险、以及通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险等特有风险。</p> <p>本基金可投资于新三板精选层股票，可能面临新三板市场因投资环境、投资标的以及交易规则等差异带来的流动性风险、挂牌公司经营风险、挂牌公司降层风险、终止挂牌的风险和精选层市场股价波动风险等特有风险。</p>
--	-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		泓德基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李晓春	郭明
	联系电话	010-59850177	010-66105799
	电子邮箱	lixiaochun@hongdefund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4009-100-888	95588
传真		010-59322130	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55号
办公地址		北京市西城区德胜门外大街125号	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		100088	100140
法定代表人		王德晓	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	北京市西城区德胜门外大街125号

点	
---	--

2.5 其他相关资料

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2023年01月01日-2023年06月30日)	
	本期已实现收益	-54,261,533.73
本期利润	-53,439,204.68	
加权平均基金份额本期利润	-0.0610	
本期加权平均净值利润率	-8.31%	
本期基金份额净值增长率	-8.11%	
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2023年06月30日)	
	期末可供分配利润	-271,176,332.17
	期末可供分配基金份额利润	-0.3180
	期末基金资产净值	592,203,543.89
	期末基金份额净值	0.6944
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2023年06月30日)	
	基金份额累计净值增长率	-30.56%

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	2.94%	1.00%	1.00%	0.69%	1.94%	0.31%
过去三个月	-5.15%	0.97%	-3.58%	0.64%	-1.57%	0.33%
过去六个月	-8.11%	0.91%	0.22%	0.64%	-8.33%	0.27%
过去一年	-19.27%	1.04%	-9.09%	0.77%	-10.18%	0.27%
自基金合同生效起至今	-30.56%	1.18%	-16.01%	0.86%	-14.55%	0.32%

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-2023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		
苏昌景	本基金的基金经理、量化 投资部总监	2021-0 3-23	-	15 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》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，由于经济复苏弱于预期，主题投资和存量博弈成为A股市场最核心的特征。分行业看，得益于数字经济和AI主题，传媒、通信和计算机大幅跑赢市场；房地产和大宗商品行业受到房地产复苏动能放缓及PPI下行的拖累而跑输市场；曾经最受机构投资者追捧的食品饮料和电气设备等行业则在低迷的宏观背景下面临了资金的持续外流。

报告期内，本基金坚持基本面趋势的投资理念构建优质治理型公司组合，由于上半年主题投资和存量博弈的市场核心特征，组合业绩表现欠佳。

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0.6944元，本报告期内，基金份额净值增长率为-8.11%，同期业绩比较基准收益率为0.22%。

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，宏观政策的适度宽松可能会给市场带来一定支撑并提供下行保护，鉴于当前估值水平低、风险溢价高企及出现系统性风险的可能性较低，市场整体的下行风险可控。我们认为潜在的宏观政策宽松或将是最重要的市场上行催化剂，其中，货币、财政和房地产政策的放宽有助于改善市场情绪；主要的不确定性来自国内消费复苏放缓、全球需求弱于预期等下行风险。

我们将努力发挥自身投资方法的广度优势，在公司选择层面聚焦以下三个方面的投资机会：一是人工智能新产业趋势之下增长前景明确的TMT成长股；二是调整后已具备更高安全边际且下半年迎来边际改善的新能源和军工等高端制造行业；三是在政策拐点渐进的背景下具备一定防御属性的高现金价值的周期龙头企业以及大众消费品行业。

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2023年6月30日，期末可供分配利润为-271,176,332.17元，其中：未分配利润已实现部分为-271,176,332.17元，未分配利润未实现部分为10,546,836.83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，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、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2023年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：泓德优质治理灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2023年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	20,211,669.23	28,962,693.00
结算备付金		1,558,823.78	1,498,411.60
存出保证金		184,847.95	200,558.44
交易性金融资产	6.4.7.2	571,116,887.56	648,967,980.38
其中：股票投资		529,679,330.57	605,981,383.13
基金投资		-	-
债券投资		41,437,556.99	42,986,597.25
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		4,412,202.39	9,905,552.11
应收股利		710,757.64	-
应收申购款		3,651.22	64,210.32
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		598,198,839.77	689,599,405.85

负债和净资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		3,559,100.77	8,658,952.56
应付赎回款		329,496.86	145,144.96
应付管理人报酬		728,050.21	873,522.61
应付托管费		121,341.71	145,587.11
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		162.09	227.27
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	1,257,144.24	959,788.38
负债合计		5,995,295.88	10,783,222.89
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	852,833,039.23	898,236,006.78
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-260,629,495.34	-219,419,823.82
净资产合计		592,203,543.89	678,816,182.96
负债和净资产总计		598,198,839.77	689,599,405.85

注：报告截止日2023年06月30日，基金份额净值0.6944元，基金份额总额852,833,039.23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：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
----	-----	----	---------

		2023年01月01日至 2023年06月30日	2022年01月01日至202 2年06月30日
一、营业总收入		-47,729,684.96	-146,477,559.91
1.利息收入		66,037.59	69,035.00
其中：存款利息收入	6.4.7.9	66,037.59	54,333.63
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	14,701.37
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-48,629,813.07	-139,222,621.03
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-55,502,726.37	-146,762,050.38
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	1,605,993.37	908,581.12
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-	-
股利收益	6.4.7.13	5,266,919.93	6,630,848.23
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	822,329.05	-7,370,100.72
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	11,761.47	46,126.84

减：二、营业总支出		5,709,519.72	7,092,440.43
1. 管理人报酬		4,798,802.21	5,983,880.10
2. 托管费		799,800.34	997,313.39
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		88.69	49.51
8. 其他费用	6.4.7.16	110,828.48	110,866.21
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-53,439,204.68	-153,570,000.34
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-53,439,204.68	-153,570,000.34
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-53,439,204.68	-153,570,000.34

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：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023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）	898,236,006.78	-	-219,419,823.82	678,816,182.96
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）	898,236,006.78	-	-219,419,823.82	678,816,182.96
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-45,402,967.55	-	-41,209,671.52	-86,612,639.07
（一）、综合收益总额	-	-	-53,439,204.68	-53,439,204.68
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-45,402,967.55	-	12,229,533.16	-33,173,434.39
其中：1.基金申购款	2,789,592.64	-	-740,502.48	2,049,090.16
2.基金赎回款	-48,192,560.19	-	12,970,035.64	-35,222,524.55
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（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）	852,833,039.23	-	-260,629,495.34	592,203,543.89

项目	上年度可比期间 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	-	16,436,756.28	987,818,592.12
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-39,767,408.33	-	-146,711,089.66	-186,478,497.99
（一）、综合收益总额	-	-	-153,570,000.34	-153,570,000.34
（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	-	-130,274,333.38	801,340,094.13

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

王德晓

李娇

王玲

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泓德优质治理灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、全国中小企业股份转让系统精选层挂牌股票(以下简称“新三板精选层股票”)、港股通机制下允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债、可转换债券(含

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

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2023年1月1日至2023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2023年6月30日的财务状况以及2023年1月1日至2023年6月30日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

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

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。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 2023年06月30日
活期存款	20,211,669.23
等于：本金	20,209,789.08
加：应计利息	1,880.15
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	20,211,669.23

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日

	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	518,997,297.67	-	529,679,330.57	10,682,032.90
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	97,109.04	21,229,809.04	272,151.83
	银行间市场	19,979,920.00	20,207,747.95	64,080.00
	合计	20,077,029.04	41,437,556.99	336,231.83
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	559,837,765.84	260,856.99	571,116,887.56	11,018,264.73

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 2023年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	69.87
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,157,895.42

其中：交易所市场	1,157,895.42
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	99,178.95
合计	1,257,144.24

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	898,236,006.78	898,236,006.78
本期申购	2,789,592.64	2,789,592.64
本期赎回（以“-”号填列）	-48,192,560.19	-48,192,560.19
本期末	852,833,039.23	852,833,039.23

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	-229,406,177.66	9,986,353.84	-219,419,823.82
本期利润	-54,261,533.73	822,329.05	-53,439,204.68
本期基金份额交易产生的变动数	12,491,379.22	-261,846.06	12,229,533.16
其中：基金申购款	-750,674.29	10,171.81	-740,502.48
基金赎回款	13,242,053.51	-272,017.87	12,970,035.64
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-271,176,332.17	10,546,836.83	-260,629,495.34

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2023年01月01日至2023年06月30日
活期存款利息收入	40,995.82
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	23,364.23
其他	1,677.54
合计	66,037.59

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
卖出股票成交总额	1,564,366,566.10
减：卖出股票成本总额	1,615,526,163.52
减：交易费用	4,343,128.95
买卖股票差价收入	-55,502,726.37

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
	2023年01月01日至2023年06月30日
债券投资收益——利息收入	340,747.92
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,265,245.45
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	1,605,993.37

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

	2023年01月01日至2023年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	58,259,719.16
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	56,357,184.99
减：应计利息总额	634,118.44
减：交易费用	3,170.28
买卖债券差价收入	1,265,245.45

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 2023年01月01日至2023年06月30日
股票投资产生的股利收益	5,266,919.93
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	5,266,919.93

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
1.交易性金融资产	822,329.05
——股票投资	39,482.74
——债券投资	782,846.31
——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	822,329.05

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
基金赎回费收入	10,045.25
基金转换费收入	1,716.22
合计	11,761.47

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 2023年01月01日至2023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	2,649.53
账户维护费	9,000.00
合计	110,828.48

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

本基金管理人于2023年8月12日发布《泓德基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，自2023年8月14日起，本基金的管理费年费率调整为1.20%，托管费年费率调整为0.20%。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
泓德基金管理有限公司（以下简称“泓德基金”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（以下简称“中国工商银行”）	基金托管人、基金销售机构

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 2023年01月01日至2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,798,802.21	5,983,880.10
其中：支付销售机构的客户维护费	1,051,467.83	1,373,812.33

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	上年度可比期间
	2023年01月01日至2023年06月30日	2022年01月01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	799,800.34	997,313.39

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		上年度可比期间	
	2023年01月01日至2023年06月30日		2022年01月01日至2022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	20,211,669.23	40,995.82	26,777,622.20	32,613.58

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（2023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
301358	湖南裕能	2023-02-01	6个月以上	限售股	23.77	42.89	939	22,320.03	40,273.71	-
001286	陕西能源	2023-03-31	6个月以上	限售股	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
301260	格力博	2023-01-20	6个月以上	限售股	30.85	23.63	1,215	37,482.75	28,710.45	-
301246	宏源药业	2023-03-10	6个月以上	限售股	50.00	30.71	776	38,800.00	23,830.96	-
001287	中电港	2023-03-30	6个月以上	限售股	11.88	21.02	971	11,535.48	20,410.42	-
301317	鑫磊股份	2023-01-12	6个月以上	限售股	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98	-

301439	泓淋电力	2023-03-10	6个月以上	限售股	19.99	16.90	949	18,970.51	16,038.10	-
301345	涛涛车业	2023-03-10	6个月以上	限售股	73.45	46.64	256	18,803.20	11,939.84	-
603135	中重科技	2023-03-29	6个月以上	限售股	17.80	17.89	628	11,178.40	11,234.92	-
601065	江盐集团	2023-03-31	6个月以上	限售股	10.36	11.84	818	8,474.48	9,685.12	-
301386	未来电器	2023-03-21	6个月以上	限售股	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-
601133	柏诚股份	2023-03-31	6个月以上	限售股	11.66	12.26	664	7,742.24	8,140.64	-
603125	常青科技	2023-03-30	6个月以上	限售股	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80	-
001328	登康口腔	2023-03-29	6个月以上	限售股	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-
001282	三联锻造	2023-05-15	6个月以上	限售股	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-
001360	南矿集团	2023-03-31	6个月以上	限售股	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-
001324	长青科技	2023-05-12	6个月以上	限售股	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-

001367	海森药业	2023-03-30	6个月以上	限售股	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
603172	万丰股份	2023-04-28	6个月以上	限售股	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-

注：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设定限售期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。

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3.58%(上年度末：3.31%)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于本报告期期末，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度

指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。于本报告期末，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。

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 2023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	20,211,669.23	-	-	-	20,211,669.23
结算备付金	1,558,823.78	-	-	-	1,558,823.78
存出保证金	184,847.95	-	-	-	184,847.95
交易性金融资产	20,207,747.95	21,229,809.04	-	529,679,330.57	571,116,887.56
应收清算款	-	-	-	4,412,202.39	4,412,202.39
应收股利	-	-	-	710,757.64	710,757.64
应收申购款	-	-	-	3,651.22	3,651.22
资产总计	42,163,088.91	21,229,809.04	-	534,805,941.82	598,198,839.77
负债					
应付清算款	-	-	-	3,559,100.77	3,559,100.77
应付赎回款	-	-	-	329,496.86	329,496.86
应付管理人报酬	-	-	-	728,050.21	728,050.21
应付托管费	-	-	-	121,341.71	121,341.71

应交税费	-	-	-	162.09	162.09
其他负债	-	-	-	1,257,144.24	1,257,144.24
负债总计	-	-	-	5,995,295.88	5,995,295.88
利率敏感度缺口	42,163,088.91	21,229,809.04	-	528,810,645.94	592,203,543.89
上年度末 2022年 12月31 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	28,962,693.00	-	-	-	28,962,693.00
结算备付金	1,498,411.60	-	-	-	1,498,411.60
存出保证金	200,558.44	-	-	-	200,558.44
交易性金融资产	20,536,060.27	4,392,378.08	18,058,158.90	605,981,383.13	648,967,980.38
应收清算款	-	-	-	9,905,552.11	9,905,552.11
应收申购款	-	-	-	64,210.32	64,210.32
资产总计	51,197,723.31	4,392,378.08	18,058,158.90	615,951,145.56	689,599,405.85
负债					
应付清算款	-	-	-	8,658,952.56	8,658,952.56
应付赎回款	-	-	-	145,144.96	145,144.96
应付管理人报酬	-	-	-	873,522.61	873,522.61
应付托管费	-	-	-	145,587.11	145,587.11
应交税费	-	-	-	227.27	227.27
其他负债	-	-	-	959,788.38	959,788.38
负债总计	-	-	-	10,783,222.89	10,783,222.89

计					
利率敏感度缺口	51,197,723.31	4,392,378.08	18,058,158.90	605,167,922.67	678,816,182.96

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期期末，本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券（若有）公允价值占基金资产净值的比例为7.00%(上年度末：6.33%)，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 2023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	-	54,564,159.37	-	54,564,159.37
应收股利	-	710,757.64	-	710,757.64
资产合计	-	55,274,917.01	-	55,274,917.01
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	-	55,274,917.01	-	55,274,917.01
项目	上年度末 2022年12月31日			
	美元折	港币折合人	其他币	合计

	合人民币	人民币	种折合人民币	
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	138,523,130.64	-	138,523,130.64
资产合计	-	138,523,130.64	-	138,523,130.64
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	-	138,523,130.64	-	138,523,130.64

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 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
	港币相对人民币升值5%	2,763,745.85	6,926,156.53
	港币相对人民币贬值5%	-2,763,745.85	-6,926,156.53

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 2023年06月30日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	529,679,330.57	89.44	605,981,383.13	89.27
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	529,679,330.57	89.44	605,981,383.13	89.27

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 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
	业绩比较基准上升5%	34,740,457.31	39,274,727.59
	业绩比较基准下降5%	-34,740,457.31	-39,274,727.59

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 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	550,656,178.73	618,620,093.30
第二层次	20,207,747.95	29,010,883.63
第三层次	252,960.88	1,337,003.45
合计	571,116,887.56	648,967,980.38

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2023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(2022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	529,679,330.57	88.55
	其中：股票	529,679,330.57	88.55
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	41,437,556.99	6.93
	其中：债券	41,437,556.99	6.93
	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	21,770,493.01	3.64
8	其他各项资产	5,311,459.20	0.89
9	合计	598,198,839.77	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54,564,159.37元，占期末净值比例9.21%。

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	17,940,865.00	3.03
C	制造业	345,063,576.90	58.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.01
E	建筑业	8,140.64	0.00

F	批发和零售业	20,410.42	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	6,820,540.85	1.15
I	信息传输、软件和信息技术服务业	75,728,349.92	12.79
J	金融业	21,971,640.00	3.71
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	7,526,200.00	1.27
S	综合	-	-
	合计	475,115,171.20	80.23

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	16,262,344.23	2.75
日常消费品	9,625,471.20	1.63
能源	24,765,304.78	4.18
医疗保健	3,911,039.16	0.66
合计	54,564,159.37	9.21

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	601899	紫金矿业	1,214,500	13,808,865.00	2.33

2	01138	中远海能	1,850,000	13,406,511.18	2.26
3	601138	工业富联	505,500	12,738,600.00	2.15
4	002555	三七互娱	350,000	12,208,000.00	2.06
5	600600	青岛啤酒	110,000	11,399,300.00	1.92
6	00883	中国海洋石油	1,100,000	11,358,793.60	1.92
7	002025	航天电器	160,000	10,208,000.00	1.72
8	000989	九芝堂	720,000	9,964,800.00	1.68
9	02367	巨子生物	300,000	9,625,471.20	1.63
10	002436	兴森科技	620,000	9,610,000.00	1.62
11	600498	烽火通信	450,000	9,166,500.00	1.55
12	688072	拓荆科技	21,000	8,945,370.00	1.51
13	688017	绿的谐波	55,035	8,937,684.00	1.51
14	000807	云铝股份	700,000	8,911,000.00	1.50
15	600941	中国移动	95,000	8,863,500.00	1.50
16	601318	中国平安	190,000	8,816,000.00	1.49
17	002156	通富微电	388,900	8,789,140.00	1.48
18	000063	中兴通讯	190,000	8,652,600.00	1.46
19	600079	人福医药	320,000	8,620,800.00	1.46
20	688522	纳睿雷达	160,000	8,563,200.00	1.45
20	300161	华中数控	160,000	8,563,200.00	1.45
22	002459	晶澳科技	200,080	8,343,336.00	1.41
23	603699	纽威股份	550,000	8,184,000.00	1.38
24	688409	富创精密	75,000	8,175,000.00	1.38
25	603129	春风动力	50,000	8,095,000.00	1.37
26	688777	中控技术	127,600	8,010,728.00	1.35
27	000933	神火股份	600,064	7,800,832.00	1.32
28	688300	联瑞新材	163,872	7,661,016.00	1.29
29	688111	金山办公	16,000	7,555,520.00	1.28
30	300413	芒果超媒	220,000	7,526,200.00	1.27
31	02331	李宁	190,000	7,383,676.83	1.25
32	01368	特步国际	1,000,000	7,357,400.40	1.24

33	688036	传音控股	50,000	7,350,000.00	1.24
34	002230	科大讯飞	107,100	7,278,516.00	1.23
35	600690	海尔智家	300,000	7,044,000.00	1.19
36	600298	安琪酵母	194,500	7,042,845.00	1.19
37	688521	芯原股份	97,196	6,990,336.32	1.18
38	300750	宁德时代	30,000	6,863,700.00	1.16
39	600258	首旅酒店	359,923	6,820,540.85	1.15
40	300316	晶盛机电	95,000	6,735,500.00	1.14
41	002644	佛慈制药	550,000	6,710,000.00	1.13
42	000733	振华科技	70,000	6,709,500.00	1.13
43	300033	同花顺	38,000	6,660,640.00	1.12
44	601601	中国太保	250,000	6,495,000.00	1.10
45	600150	中国船舶	190,100	6,256,191.00	1.06
46	605117	德业股份	40,080	5,993,964.00	1.01
47	688362	甬矽电子	180,000	5,992,200.00	1.01
48	002028	思源电气	120,100	5,611,072.00	0.95
49	000651	格力电器	150,000	5,476,500.00	0.92
50	688235	百济神州	50,000	5,455,500.00	0.92
51	688581	安杰思	40,000	4,899,600.00	0.83
52	300979	华利集团	100,000	4,874,000.00	0.82
53	688066	航天宏图	79,844	4,862,499.60	0.82
54	300567	精测电子	50,000	4,757,500.00	0.80
55	688290	景业智能	66,199	4,416,135.29	0.75
56	000768	中航西飞	160,000	4,280,000.00	0.72
57	688337	普源精电	69,961	4,215,849.86	0.71
58	300188	美亚柏科	200,000	4,158,000.00	0.70
59	600489	中金黄金	400,000	4,132,000.00	0.70
60	300896	爱美客	9,000	4,004,550.00	0.68
61	002850	科达利	30,100	3,980,725.00	0.67
62	300395	菲利华	80,000	3,936,000.00	0.66
63	301035	润丰股份	50,000	3,928,500.00	0.66

64	09926	康方生物	120,000	3,911,039.16	0.66
65	603055	台华新材	350,000	3,888,500.00	0.66
66	300181	佐力药业	300,000	3,663,000.00	0.62
67	603283	赛腾股份	80,000	3,560,000.00	0.60
68	600845	宝信软件	70,000	3,556,700.00	0.60
69	300593	新雷能	150,000	3,436,500.00	0.58
70	300442	润泽科技	110,000	3,383,600.00	0.57
71	601728	中国电信	600,000	3,378,000.00	0.57
72	002864	盘龙药业	80,000	3,373,600.00	0.57
73	002675	东诚药业	200,000	2,942,000.00	0.50
74	688351	微电生理	150,000	2,920,500.00	0.49
75	603516	淳中科技	130,000	2,866,500.00	0.48
76	603043	广州酒家	99,940	2,824,304.40	0.48
77	600536	中国软件	55,000	2,578,400.00	0.44
78	688262	国芯科技	60,000	2,441,400.00	0.41
79	300138	晨光生物	120,000	2,148,000.00	0.36
80	301117	佳缘科技	30,000	1,938,600.00	0.33
81	688368	晶丰明源	15,000	1,908,150.00	0.32
82	03998	波司登	500,000	1,521,267.00	0.26
83	688551	科威尔	20,000	1,311,600.00	0.22
84	300470	中密控股	15,000	693,300.00	0.12
85	301358	湖南裕能	939	40,273.71	0.01
86	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.01
87	301260	格力博	1,215	28,710.45	0.00
88	301246	宏源药业	776	23,830.96	0.00
89	001287	中电港	971	20,410.42	0.00
90	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00
91	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
92	301345	涛涛车业	256	11,939.84	0.00
93	603135	中重科技	628	11,234.92	0.00
94	601065	江盐集团	818	9,685.12	0.00

95	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
96	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
97	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
98	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
99	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
100	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
101	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
102	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
103	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300059	东方财富	27,548,217.14	4.06
2	601012	隆基绿能	17,257,726.00	2.54
3	688029	南微医学	15,646,535.42	2.30
4	002415	海康威视	14,717,799.87	2.17
5	601318	中国平安	14,188,590.86	2.09
6	601966	玲珑轮胎	14,087,128.16	2.08
7	300188	美亚柏科	13,952,184.00	2.06
8	601636	旗滨集团	13,846,473.00	2.04
9	300012	华测检测	13,724,189.10	2.02
10	600600	青岛啤酒	13,371,973.00	1.97
11	000568	泸州老窖	13,292,041.66	1.96
12	002459	晶澳科技	12,712,988.00	1.87
13	300413	芒果超媒	12,638,108.00	1.86
14	300454	深信服	12,351,647.00	1.82
15	688789	宏华数科	12,258,825.79	1.81
16	600383	金地集团	12,198,999.00	1.80

17	601658	邮储银行	12,180,229.00	1.79
18	300558	贝达药业	12,003,991.80	1.77
19	00883	中国海洋石油	11,909,738.22	1.75
20	603486	科沃斯	11,478,211.00	1.69

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值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	300059	东方财富	25,693,961.80	3.79
2	06078	海吉亚医疗	18,598,546.81	2.74
3	00268	金蝶国际	17,940,207.86	2.64
4	06049	保利物业	17,801,013.18	2.62
5	300124	汇川技术	17,718,339.00	2.61
6	600309	万华化学	17,124,817.00	2.52
7	605060	联德股份	16,624,190.00	2.45
8	601012	隆基绿能	16,267,888.88	2.40
9	600329	达仁堂	15,550,131.00	2.29
10	300416	苏试试验	15,042,014.95	2.22
11	002027	分众传媒	14,899,617.00	2.19
12	02269	药明生物	14,365,954.61	2.12
13	002415	海康威视	14,088,726.00	2.08
14	603345	安井食品	13,749,675.20	2.03
15	300487	蓝晓科技	13,707,178.00	2.02
16	603233	大参林	13,468,325.60	1.98
17	000858	五粮液	13,321,934.00	1.96
18	601966	玲珑轮胎	13,145,345.00	1.94
19	688029	南微医学	13,042,740.95	1.92
20	601658	邮储银行	13,021,780.00	1.92

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	1,539,184,628.22
卖出股票收入（成交）总额	1,564,366,566.10

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,207,747.95	3.41
	其中：政策性金融债	20,207,747.95	3.41
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)	21,229,809.04	3.58
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	41,437,556.99	7.00

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	230401	23农发01	200,000	20,207,747.95	3.41
2	113044	大秦转债	70,000	8,086,131.51	1.37
3	113021	中信转债	70,000	8,058,024.11	1.36
4	113052	兴业转债	50,000	5,085,653.42	0.86

注：本基金本报告期末仅持有四只债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	184,847.95
2	应收清算款	4,412,202.39
3	应收股利	710,757.64
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,651.22

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,311,459.20

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	113044	大秦转债	8,086,131.51	1.37
2	113021	中信转债	8,058,024.11	1.36
3	113052	兴业转债	5,085,653.42	0.86

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
8,459	100,819.61	353,068,525.35	41.40%	499,764,513.88	58.60%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	2,589,949.56	0.3037%

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 究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	898,236,006.78
本报告期基金总申购份额	2,789,592.64
减：本报告期基金总赎回份额	48,192,560.19
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	852,833,039.23

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

2023年2月21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》，邬传雁离任公司副总经理；2023年5月18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》，温永鹏转任公司董事长，不再担任副总经理职务，胡康宁离任董事长。

（2）基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中泰证券	2	1,042,495,558.96	33.62%	751,947.13	33.38%	-
中信证券	2	886,056,450.52	28.58%	636,869.82	28.27%	-
广发证券	2	325,669,171.80	10.50%	234,904.94	10.43%	-
长城证券	2	274,323,495.31	8.85%	192,322.51	8.54%	-
渤海证券	1	161,767,660.21	5.22%	116,683.46	5.18%	-
民生证券	2	121,572,457.13	3.92%	112,003.25	4.97%	-
安信证券	4	124,886,722.32	4.03%	90,076.69	4.00%	-

海通 证券	1	53,203,168.82	1.72%	38,375.30	1.70%	-
国盛 证券	2	50,568,436.74	1.63%	36,476.16	1.62%	-
中信 建投 证券	4	47,786,869.32	1.54%	34,468.16	1.53%	-
太平 洋证 券	2	12,334,406.16	0.40%	8,896.74	0.39%	-
长江 证券	1	-	-	-	-	-
西部 证券	1	-	-	-	-	-
东北 证券	2	-	-	-	-	-
光大 证券	2	-	-	-	-	-
国金 证券	2	-	-	-	-	-
国信 证券	2	-	-	-	-	-
华安 证券	2	-	-	-	-	-
华金 证券	2	-	-	-	-	-
华泰 证券	2	-	-	-	-	-
华西 证券	2	-	-	-	-	-
平安 证券	2	-	-	-	-	-
申万 宏源 证券	2	-	-	-	-	-
西藏 东方 财富 证券	2	-	-	-	-	-
信达 证券	2	-	-	-	-	-

招商证券	2	-	-	-	-	-
中国中金财富证券	2	-	-	-	-	-
首创证券	3	-	-	-	-	-

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：华金证券
- (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
中泰证券	18,830,567.18	26.71%	-	-	-	-	-	-
中信证券	38,097,944.77	54.03%	-	-	-	-	-	-
广发证券	848,782.43	1.20%	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
渤海证券	8,895,820.10	12.62%	-	-	-	-	-	-
民生证券	3,640,116.78	5.16%	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	193,312.61	0.27%	-	-	-	-	-	-

国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中国中金财富 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	泓德基金管理有限公司关于调整旗下基金在中国工商银行股份有限公司最低申购及定投金额起点的公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2023-01-13
2	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	2023-02-21
3	泓德基金管理有限公司关于旗下基金参与部分销售机构基金转换费率优惠活动的公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2023-02-24
4	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加珠海盈米基金销售有限公司为销售机构的公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-23
5	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海好买	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-23

	基金销售有限公司为销售机构的公告		
6	泓德基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2023-05-18
7	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华西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	2023-05-26

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2023/01/01-2023/06/30	351,619,291.80	0.00	0.00	351,619,291.80	41.23%
产品特有风险							
<p>本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20%的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。</p> <p>在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p>							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

地点为管理人地址：北京市西城区德胜门外大街125号

12.3 查阅方式

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

泓德基金管理有限公司
二〇二三年八月三十日