

# 泓德泓信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	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§6 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	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	56
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	57
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	57
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	57
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	57
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	57
7.12 投资组合报告附注	57
§8 基金份额持有人信息	58
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	58

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	59
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 .....	59
§9 开放式基金份额变动 .....	59
§10 重大事件揭示 .....	59
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	59
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	60
10.4 基金投资策略的改变 .....	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	60
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 .....	60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	60
10.8 其他重大事件 .....	63
§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....	65
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	65
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	65
§12 备查文件目录 .....	65
12.1 备查文件目录 .....	65
12.2 存放地点 .....	65
12.3 查阅方式 .....	65

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	泓德泓信混合
基金主代码	002801
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年06月01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	89,561,555.02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，通过股票与债券等资产的合理配置，力争为投资者带来稳健的投资回报。
投资策略	本基金运用自上而下和自下而上相结合的方法进行大类资产配置，从宏观经济环境、国家政策导向、产业转型与变革等多个角度，积极挖掘新经济环境下的投资机遇，精选具有核心竞争优势和持续成长能力的优质上市公司。对于债券投资策略，本基金通过对宏观经济、货币政策、财政政策、资金流动性等影响市场利率的主要因素进行深入研究，结合新券发行情况，综合分析市场利率和信用利差的变动趋势，采取久期调整、收益率曲线配置和券种配置等积极投资策略，把握债券市场投资机会，以获取稳健的投资收益。同时，本基金将本着谨慎原则，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	沪深300指数收益率×50%+中证综合债券指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于较高风险、较高收益的品种，其长期风险与收益特征低于股票型基金，高

	于债券型基金、货币市场基金。
--	----------------

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		泓德基金管理有限公司	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	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.hongdefund.com
基金中期报告备置地点	北京市西城区德胜门外大街125号

## 2.5 其他相关资料

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

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2023年01月01日-2023年06月30日)
本期已实现收益	-24,292,140.88
本期利润	-5,322,261.82
加权平均基金份额本期利润	-0.0614
本期加权平均净值利润率	-3.44%
本期基金份额净值增长率	-4.12%
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	67,201,876.06
期末可供分配基金份额利润	0.7503
期末基金资产净值	156,763,431.08
期末基金份额净值	1.7503
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	75.03%

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	1.37%	0.84%	0.85%	0.43%	0.52%	0.41%
过去三个月	0.27%	0.78%	-1.69%	0.41%	1.96%	0.37%

过去六个月	-4.12%	0.81%	1.08%	0.42%	-5.20%	0.39%
过去一年	-15.98%	0.97%	-5.21%	0.49%	-10.77%	0.48%
过去三年	12.70%	1.26%	3.20%	0.60%	9.50%	0.66%
自基金合同生效起至今	75.03%	1.12%	30.35%	0.58%	44.68%	0.54%

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：沪深300指数收益率×50%+中证综合债券指数收益率×50%  
基准指数的构建原则如下：

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

（2）中证综合债券指数是中国全市场债券指数，以2001年12月31日为基期，基点为100点，并于2002年12月31日起发布。中证综合债券指数的样本具有广泛的市场代表性，其样本范围涵盖银行间市场和交易所市场，成分债券包括国债、企业债券、央行票据等所有主要债券种类。

（3）由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照50%、50%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



泓德泓信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  
(2016年06月01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 2-10	-	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，我们逐步使用机器学习方法搭建量化投资模型实现投资组合的构建和优化，二季度以后净值表现较好。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末泓德泓信混合基金份额净值为1.7503元，本报告期内，基金份额净值增长率为-4.12%，同期业绩比较基准收益率为1.08%。

## 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。

市场大概率仍将维持“存量市”的特征不变，以结构性机会为主，这种市场环境仍将适合具备广度优势和灵活优势的量化投资方法。我们将持续不断地对以使用机器学习的方法构建投资模型进行深化和丰富，力争以更有效的方式输出稳定的超额收益。

## 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67,201,876.06元，其中：未分配利润已实现部分为69,157,164.85元，未分配利润未实现部分为-1,955,288.79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的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对泓德基金管理有限公司编制和披露的本基金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：泓德泓信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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	10,521,683.80	3,117,257.35
结算备付金		867,529.78	103,315.37
存出保证金		33,906.74	19,242.57
交易性金融资产	6.4.7.2	153,825,114.63	172,031,384.54
其中：股票投资		143,506,526.71	161,902,521.53
基金投资		-	-
债券投资		10,318,587.92	10,128,863.01
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		798.80	1,146.21
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		165,249,033.75	175,272,346.04

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
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		7,970,253.39	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		96,847.95	135,151.22
应付托管费		18,158.98	25,340.86
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.58	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	400,341.77	114,970.26
负债合计		8,485,602.67	275,462.34
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	89,561,555.02	95,858,119.39
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	67,201,876.06	79,138,764.31
净资产合计		156,763,431.08	174,996,883.70
负债和净资产总计		165,249,033.75	175,272,346.04

注：报告截止日2023年06月30日，基金份额净值1.7503元，基金份额总额89,561,555.02份。

## 6.2 利润表

会计主体：泓德泓信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
<b>一、营业总收入</b>		-4,484,759.00	-41,132,390.45
1.利息收入		9,484.14	31,093.10
其中：存款利息收入	6.4.7.9	9,484.14	23,403.52
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		-	7,689.58
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-23,483,433.16	-7,798,240.16
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-24,891,204.40	-9,342,181.60
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	136,758.41	255,835.62
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	1,271,012.83	1,288,105.82
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	18,969,879.06	-33,415,260.78
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	19,310.96	50,017.39

减：二、营业总支出		837,502.82	1,428,046.56
1. 管理人报酬		617,426.60	1,110,493.05
2. 托管费		115,767.52	208,217.46
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		0.13	0.18
8. 其他费用	6.4.7.16	104,308.57	109,335.87
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-5,322,261.82	-42,560,437.01
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-5,322,261.82	-42,560,437.01
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-5,322,261.82	-42,560,437.01

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：泓德泓信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）	95,858,119.39	-	79,138,764.31	174,996,883.70
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）	95,858,119.39	-	79,138,764.31	174,996,883.70
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-6,296,564.37	-	-11,936,888.25	-18,233,452.62
（一）、综合收益总额	-	-	-5,322,261.82	-5,322,261.82
（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）	-6,296,564.37	-	-6,614,626.43	-12,911,190.80
其中：1.基金申购款	7,485,072.91	-	5,492,123.79	12,977,196.70
2.基金赎回款	-13,781,637.28	-	-12,106,750.22	-25,888,387.50
（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）	89,561,555.02	-	67,201,876.06	156,763,431.08

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）	146,543,912.04	-	198,885,780.09	345,429,692.13
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）	146,543,912.04	-	198,885,780.09	345,429,692.13
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-13,251,726.32	-	-54,510,461.90	-67,762,188.22
（一）、综合收益总额	-	-	-42,560,437.01	-42,560,437.01
（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）	-13,251,726.32	-	-11,950,024.89	-25,201,751.21
其中：1.基金申购款	5,260,684.96	-	5,692,303.72	10,952,988.68
2.基金赎回款	-18,512,411.28	-	-17,642,328.61	-36,154,739.89
（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)	133,292,185.72	-	144,375,318.19	277,667,503.91

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

泓德泓信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[2016]967号《关于准予泓德泓信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《泓德泓信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,自基金合同生效之日起至18个月后对应日的前一个工作日(含该日)止的期间内采用封闭式运作方式,如不存在该对应日的,顺延至下一工作日,封闭期结束后转为开放式运作,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集847,529,845.47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(2016)第699号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2016年6月1日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为847,544,853.76份,其中认购资金利息折合15,008.29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《泓德泓信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股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证等权益类品种,国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、短期融资券、超短期融资券、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转换债券)、可交换债券、资产支持证券、中小企业私募债、证券公司短期公司债券、中期票据、债券回购和银行存款、同业存单等固定收益类投资工具,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。本基金的投资组合比例为：封闭期内股票资产占基金资产的比例范围为0%-100%；转为开放式运作后股票资产占基金资产的比例范围为0%-95%。本基金如果投资股指期货、国债期货，则在封闭期内，每个交易日日终扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应保持不低于交易保证金一倍的现金；转为开放式运作后，每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应保持现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于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：沪深300指数收益率×50%+中证综合债券指数收益率×50%。

#### 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》、《泓德泓信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[2015]101

号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

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

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

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

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	
	2023年06月30日	
活期存款	10,521,683.80	
等于：本金	10,521,403.02	
加：应计利息	280.78	
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	10,521,683.80	

## 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	144,422,850.18	-	143,506,526.71	-916,323.47	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	163,300.00	16.32	165,374.81	2,058.49
	银行间市场	10,075,720.00	77,213.11	10,153,213.11	280.00
	合计	10,239,020.00	77,229.43	10,318,587.92	2,338.49

资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	154,661,870.18	77,229.43	153,825,114.63	-913,984.98

#### 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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	316,039.21
其中：交易所市场	315,864.21
银行间市场	175.00
应付利息	-
预提费用	84,302.56
合计	400,341.77

#### 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	95,858,119.39	95,858,119.39
本期申购	7,485,072.91	7,485,072.91
本期赎回（以“-”号填列）	-13,781,637.28	-13,781,637.28
本期末	89,561,555.02	89,561,555.02

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	100,834,247.65	-21,695,483.34	79,138,764.31
本期利润	-24,292,140.88	18,969,879.06	-5,322,261.82
本期基金份额交易产生的变动数	-7,384,941.92	770,315.49	-6,614,626.43
其中：基金申购款	5,776,840.01	-284,716.22	5,492,123.79
基金赎回款	-13,161,781.93	1,055,031.71	-12,106,750.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	69,157,164.85	-1,955,288.79	67,201,876.06

## 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
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	3,968.16
其他	205.57
合计	9,484.14



**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	523,136,511.71
减：卖出股票成本总额	546,829,585.74
减：交易费用	1,198,130.37
买卖股票差价收入	-24,891,204.40

**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	113,933.60
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	22,824.81
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	136,758.41

**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	10,294,210.77
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	10,071,180.00

减：应计利息总额	200,027.19
减：交易费用	178.77
买卖债券差价收入	22,824.81

#### 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	1,271,012.83
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	1,271,012.83

#### 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	18,969,879.06
——股票投资	18,963,160.57
——债券投资	6,718.49
——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	18,969,879.06
----	---------------

#### 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	13,616.86
基金转换费收入	5,694.10
合计	19,310.96

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	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	1,406.01
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	104,308.57

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

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

本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

## 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	617,426.60	1,110,493.05
其中：支付销售机构的客户维护费	9,202.35	19,091.52

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0.80%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×0.80%/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	115,767.52	208,217.46

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0.15%的年费率每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

#### 6.4.10.3 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

份额单位：份

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
报告期初持有的基金份额	11,609,107.83	8,556,780.69
报告期间申购/买入总份额	0.00	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	11,609,107.83	8,556,780.69
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	12.96%	6.42%

##### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023年06月30日		上年度末 2022年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
王德晓	2,450,942.86	2.74%	997.51	0.00%

泓德基业 (西藏) 企 业管理有 限公司	13,363,814.14	14.92%	9,000,503.13	9.39%
-------------------------------	---------------	--------	--------------	-------

注：于2022年12月31日，王德晓持有本基金份额占基金总份额的比例为0.001%。

#### 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 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	
	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	10,521,683.80	5,310.41	10,608,096.24	22,027.92

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
3013 17	鑫磊 股份	2023- 01-12	6个 月以 上	限售 股	20.67	26.17	406	8,39 2.02	10,62 5.02	-

301358	湖南裕能	2023-02-01	6个月以上	限售股	23.77	42.89	241	5,728.57	10,336.49	-
301260	格力博	2023-01-20	6个月以上	限售股	30.85	23.63	306	9,440.10	7,230.78	-
603135	中重科技	2023-03-29	6个月以上	限售股	17.80	17.89	161	2,865.80	2,880.29	-
601065	江盐集团	2023-03-31	6个月以上	限售股	10.36	11.84	187	1,937.32	2,214.08	-
601133	柏诚股份	2023-03-31	6个月以上	限售股	11.66	12.26	160	1,865.60	1,961.60	-
603172	万丰股份	2023-04-28	6个月以上	限售股	14.58	16.13	112	1,632.96	1,806.56	-
001282	三联锻造	2023-05-15	6个月以上	限售股	27.93	33.03	53	1,480.29	1,750.59	-
001324	长青科技	2023-05-12	6个月以上	限售股	18.88	19.60	68	1,283.84	1,332.80	-
603125	常青科技	2023-03-30	6个月以上	限售股	25.98	24.53	54	1,402.92	1,324.62	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
127086	恒邦转债	2023-06-12	17个交易日	新债未上	100.00	100.01	1,580	158,000.00	158,013.16	-

			日	市					
--	--	--	---	---	--	--	--	--	--

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0.11%(上年度末：0%)。

#### 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发行的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理

人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。于本报告期末，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	10,521,683.80	-	-	-	10,521,683.80
结算备付金	867,529.78	-	-	-	867,529.78
存出保证金	33,906.74	-	-	-	33,906.74
交易性金融资产	10,153,213.11	-	165,374.81	143,506,526.71	153,825,114.63
应收申购款	-	-	-	798.80	798.80
资产总计	21,576,333.43	-	165,374.81	143,507,325.51	165,249,033.75
负债					
应付清算款	-	-	-	7,970,253.39	7,970,253.39
应付管理人报酬	-	-	-	96,847.95	96,847.95
应付托管费	-	-	-	18,158.98	18,158.98
应交税费	-	-	-	0.58	0.58
其他负债	-	-	-	400,341.77	400,341.77
负债总计	-	-	-	8,485,602.67	8,485,602.67
利率敏感度缺口	21,576,333.43	-	165,374.81	135,021,722.84	156,763,431.08
上年度末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

2022 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	3,117,257.35	-	-	-	3,117,257.35
结算备付金	103,315.37	-	-	-	103,315.37
存出保证金	19,242.57	-	-	-	19,242.57
交易性金融资产	10,128,863.01	-	-	161,902,521.53	172,031,384.54
应收申购款	-	-	-	1,146.21	1,146.21
资产总计	13,368,678.30	-	-	161,903,667.74	175,272,346.04
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	135,151.22	135,151.22
应付托管费	-	-	-	25,340.86	25,340.86
其他负债	-	-	-	114,970.26	114,970.26
负债总计	-	-	-	275,462.34	275,462.34
利率敏感度缺口	13,368,678.30	-	-	161,628,205.40	174,996,883.70

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6.58%(上年度末：5.79%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(上年度末：同)。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

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

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	143,506,526.71	91.54	161,902,521.53	92.52
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	143,506,526.71	91.54	161,902,521.53	92.52

#### 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%	12,302,376.51	17,231,457.31
	业绩比较基准下降5%	-12,302,376.51	-17,231,457.31

#### 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	143,472,425.53	161,170,716.93
第二层次	10,311,226.27	10,128,863.01
第三层次	41,462.83	731,804.60
合计	153,825,114.63	172,031,384.54

###### 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	143,506,526.71	86.84
	其中：股票	143,506,526.71	86.84
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	10,318,587.92	6.24
	其中：债券	10,318,587.92	6.24
	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	11,389,213.58	6.89
8	其他各项资产	34,705.54	0.02

9	合计	165,249,033.75	100.00
---	----	----------------	--------

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,483,999.20	0.95
B	采矿业	5,879,978.00	3.75
C	制造业	91,473,451.03	58.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,453,408.00	1.57
E	建筑业	1,179,523.60	0.75
F	批发和零售业	4,599,079.88	2.93
G	交通运输、仓储和邮政业	7,031,144.20	4.49
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,279,467.40	3.37
J	金融业	9,552,439.80	6.09
K	房地产业	4,518,368.00	2.88
L	租赁和商务服务业	2,181,083.00	1.39
M	科学研究和技术服务业	2,957,221.00	1.89
N	水利、环境和公共设施管理业	1,828,633.60	1.17
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	863,062.00	0.55
Q	卫生和社会工作	218,164.00	0.14
R	文化、体育和娱乐业	2,007,504.00	1.28
S	综合	-	-
	合计	143,506,526.71	91.54

## 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	300697	电工合金	124,400	1,490,312.00	0.95



2	605050	福然德	112,800	1,393,080.00	0.89
3	301017	漱玉平民	72,900	1,388,016.00	0.89
4	003013	地铁设计	75,900	1,385,175.00	0.88
5	300130	新国都	48,400	1,371,172.00	0.87
6	603676	卫信康	98,500	1,361,270.00	0.87
7	002973	侨银股份	116,900	1,356,040.00	0.87
8	603132	金徽股份	119,500	1,355,130.00	0.86
9	605336	帅丰电器	78,700	1,353,640.00	0.86
10	605008	长鸿高科	94,800	1,351,848.00	0.86
11	002978	安宁股份	42,100	1,351,831.00	0.86
12	002907	华森制药	88,800	1,351,536.00	0.86
13	300878	维康药业	59,500	1,350,650.00	0.86
14	002287	奇正藏药	56,500	1,350,350.00	0.86
15	601512	中新集团	144,700	1,350,051.00	0.86
16	600876	凯盛新能	84,200	1,343,832.00	0.86
17	600956	新天绿能	153,900	1,342,008.00	0.86
18	605296	神农集团	62,560	1,340,035.20	0.85
19	605378	野马电池	57,300	1,335,663.00	0.85
20	600007	中国国贸	71,900	1,331,588.00	0.85
21	300059	东方财富	93,764	1,331,448.80	0.85
22	603103	横店影视	78,200	1,316,888.00	0.84
23	605099	共创草坪	58,900	1,315,237.00	0.84
24	603628	清源股份	82,900	1,312,307.00	0.84
25	605179	一鸣食品	118,900	1,293,632.00	0.83
26	002399	海普瑞	106,900	1,226,143.00	0.78
27	601319	中国人保	209,200	1,221,728.00	0.78
28	603948	建业股份	56,600	1,216,900.00	0.78
29	603697	有友食品	130,120	1,193,200.40	0.76
30	301286	侨源股份	39,300	1,159,350.00	0.74
31	605333	沪光股份	69,900	1,156,146.00	0.74
32	601318	中国平安	24,100	1,118,240.00	0.71

33	601881	中国银河	95,400	1,107,594.00	0.71
34	603025	大豪科技	87,820	1,085,455.20	0.69
35	600897	厦门空港	51,300	1,061,397.00	0.68
36	688718	唯赛勃	59,800	1,035,138.00	0.66
37	300750	宁德时代	3,900	892,281.00	0.57
38	605098	行动教育	21,800	863,062.00	0.55
39	300852	四会富仕	20,600	854,076.00	0.54
40	603639	海利尔	46,700	836,864.00	0.53
41	603556	海兴电力	32,000	807,680.00	0.52
42	601939	建设银行	124,100	776,866.00	0.50
43	603878	武进不锈	88,860	750,867.00	0.48
44	003029	吉大正元	22,600	733,370.00	0.47
45	301015	百洋医药	25,800	716,208.00	0.46
46	605389	长龄液压	24,700	713,089.00	0.45
47	300976	达瑞电子	14,000	709,800.00	0.45
48	002815	崇达技术	56,800	707,160.00	0.45
49	002933	新兴装备	24,000	704,880.00	0.45
50	001266	宏英智能	24,142	701,325.10	0.45
51	300797	钢研纳克	37,900	698,876.00	0.45
52	603511	爱慕股份	40,600	698,320.00	0.45
52	603261	立航科技	20,300	698,320.00	0.45
54	003002	壶化股份	43,900	694,498.00	0.44
55	605319	无锡振华	43,600	691,932.00	0.44
56	000828	东莞控股	75,600	691,740.00	0.44
57	603663	三祥新材	46,100	689,195.00	0.44
58	301207	华兰疫苗	20,600	685,156.00	0.44
59	605567	春雪食品	53,300	683,839.00	0.44
60	605058	澳弘电子	30,400	682,480.00	0.44
61	600826	兰生股份	66,200	679,874.00	0.43
62	600834	申通地铁	82,300	677,329.00	0.43
63	688093	世华科技	33,747	676,964.82	0.43

64	001203	大中矿业	60,800	675,488.00	0.43
65	002879	长缆科技	41,000	675,270.00	0.43
66	002237	恒邦股份	62,000	675,180.00	0.43
67	002768	国恩股份	27,900	674,901.00	0.43
68	002724	海洋王	77,700	674,436.00	0.43
69	002818	富森美	50,900	673,407.00	0.43
70	605167	利柏特	69,500	672,760.00	0.43
71	600828	茂业商业	181,521	671,627.70	0.43
72	002594	比亚迪	2,600	671,502.00	0.43
73	605288	凯迪股份	15,600	671,424.00	0.43
74	300900	广联航空	23,300	671,273.00	0.43
75	605199	葫芦娃	44,300	670,702.00	0.43
76	600817	宇通重工	59,900	670,281.00	0.43
77	601988	中国银行	170,800	667,828.00	0.43
78	603689	皖天然气	76,100	667,397.00	0.43
79	002980	华盛昌	19,900	665,854.00	0.42
80	603530	神马电力	42,800	665,540.00	0.42
81	002238	天威视讯	96,000	665,280.00	0.42
82	002156	通富微电	29,400	664,440.00	0.42
83	603983	丸美股份	20,500	663,175.00	0.42
84	002996	顺博合金	54,800	663,080.00	0.42
85	600184	光电股份	50,400	661,752.00	0.42
86	000550	江铃汽车	47,800	661,552.00	0.42
87	001872	招商港口	38,200	659,714.00	0.42
88	603992	松霖科技	43,000	659,620.00	0.42
89	000708	中信特钢	41,600	658,944.00	0.42
90	002901	大博医疗	21,200	658,896.00	0.42
91	601698	中国卫通	33,100	658,028.00	0.42
92	300871	回盛生物	39,900	657,552.00	0.42
93	600377	宁沪高速	66,800	656,644.00	0.42
94	601038	一拖股份	55,900	656,266.00	0.42

95	301220	亚香股份	18,900	644,679.00	0.41
96	002950	奥美医疗	61,000	633,180.00	0.40
97	300965	恒宇信通	13,200	624,888.00	0.40
98	605339	南侨食品	31,300	623,183.00	0.40
99	601899	紫金矿业	54,300	617,391.00	0.39
100	601138	工业富联	24,200	609,840.00	0.39
101	002868	绿康生化	15,900	586,074.00	0.37
102	300796	贝斯美	46,400	558,192.00	0.36
103	300502	新易盛	8,200	557,354.00	0.36
104	300308	中际旭创	3,700	545,565.00	0.35
105	600990	四创电子	16,900	534,716.00	0.34
106	000021	深科技	26,700	533,733.00	0.34
107	600030	中信证券	26,400	522,192.00	0.33
108	603355	莱克电气	20,500	520,905.00	0.33
109	603071	物产环能	31,200	517,608.00	0.33
110	600415	小商品城	58,200	496,446.00	0.32
111	300909	汇创达	18,600	491,412.00	0.31
112	605388	均瑶健康	38,100	484,251.00	0.31
113	002275	桂林三金	26,700	480,867.00	0.31
114	003019	宸展光电	23,300	477,650.00	0.30
115	603013	亚普股份	30,100	471,968.00	0.30
116	601601	中国太保	18,100	470,238.00	0.30
117	002111	威海广泰	48,400	461,736.00	0.29
118	601360	三六零	34,700	435,138.00	0.28
119	301137	哈焊华通	23,200	414,584.00	0.26
120	688510	航亚科技	20,000	397,800.00	0.25
121	601898	中煤能源	46,300	390,772.00	0.25
122	601628	中国人寿	10,600	370,576.00	0.24
123	002602	世纪华通	47,900	363,561.00	0.23
124	600508	上海能源	24,000	352,320.00	0.22
125	000429	粤高速 A	42,600	333,984.00	0.21

126	600583	海油工程	53,200	311,220.00	0.20
127	000938	紫光股份	9,500	302,575.00	0.19
128	601336	新华保险	7,800	286,806.00	0.18
129	600582	天地科技	44,600	260,018.00	0.17
130	300866	安克创新	2,900	253,750.00	0.16
131	601668	中国建筑	43,600	250,264.00	0.16
132	300678	中科信息	5,000	249,950.00	0.16
133	600820	隧道股份	41,400	248,814.00	0.16
134	601618	中国中冶	62,100	246,537.00	0.16
135	688630	芯碁微装	2,800	235,256.00	0.15
136	603688	石英股份	2,000	227,680.00	0.15
137	000921	海信家电	8,400	226,380.00	0.14
138	688516	奥特维	1,200	226,080.00	0.14
139	600060	海信视像	9,000	222,750.00	0.14
140	688148	芳源股份	18,200	222,040.00	0.14
141	601137	博威合金	14,200	220,952.00	0.14
142	688560	明冠新材	7,891	219,290.89	0.14
143	002600	领益智造	31,400	216,974.00	0.14
144	600028	中国石化	34,100	216,876.00	0.14
145	002035	华帝股份	30,400	215,840.00	0.14
146	601857	中国石油	28,800	215,136.00	0.14
147	000823	超声电子	22,600	214,248.00	0.14
148	600708	光明地产	99,700	213,358.00	0.14
149	688599	天合光能	5,000	213,050.00	0.14
150	300856	科思股份	2,700	212,679.00	0.14
151	000860	顺鑫农业	6,300	212,247.00	0.14
152	000333	美的集团	3,600	212,112.00	0.14
153	601816	京沪高铁	40,300	211,978.00	0.14
154	000932	华菱钢铁	44,300	211,311.00	0.13
155	603129	春风动力	1,300	210,470.00	0.13
156	600036	招商银行	6,400	209,664.00	0.13

157	300894	火星人	8,200	209,428.00	0.13
158	601688	华泰证券	15,200	209,304.00	0.13
159	600926	杭州银行	17,800	209,150.00	0.13
160	002937	兴瑞科技	8,500	209,100.00	0.13
161	002273	水晶光电	17,500	208,950.00	0.13
162	000031	大悦城	57,000	208,620.00	0.13
163	000786	北新建材	8,500	208,335.00	0.13
164	000651	格力电器	5,700	208,107.00	0.13
165	601021	春秋航空	3,600	206,892.00	0.13
166	603605	珀莱雅	1,840	206,816.00	0.13
167	603197	保隆科技	3,800	206,150.00	0.13
168	002185	华天科技	22,400	206,080.00	0.13
169	603816	顾家家居	5,400	206,010.00	0.13
170	002572	索菲亚	11,800	205,556.00	0.13
171	002372	伟星新材	10,000	205,400.00	0.13
172	300494	盛天网络	8,100	200,799.00	0.13
173	000402	金融街	44,400	200,688.00	0.13
174	688120	华海清科	796	200,631.80	0.13
175	603127	昭衍新药	4,900	200,410.00	0.13
176	002706	良信股份	17,600	198,000.00	0.13
177	000596	古井贡酒	800	197,904.00	0.13
178	601929	吉视传媒	106,800	196,512.00	0.13
179	603369	今世缘	3,700	195,360.00	0.12
180	600138	中青旅	15,600	195,156.00	0.12
181	688696	极米科技	1,400	195,146.00	0.12
182	688639	华恒生物	2,140	193,627.20	0.12
183	688390	固德威	1,160	193,557.60	0.12
184	000568	泸州老窖	900	188,613.00	0.12
185	002916	深南电路	2,500	188,425.00	0.12
186	601222	林洋能源	21,900	179,361.00	0.11
187	603345	安井食品	1,200	176,160.00	0.11

188	600048	保利发展	12,900	168,087.00	0.11
189	600066	宇通客车	10,600	156,244.00	0.10
190	600475	华光环能	13,000	154,440.00	0.10
191	600681	百川能源	33,000	154,110.00	0.10
192	600612	老凤祥	2,200	153,736.00	0.10
193	600592	龙溪股份	14,500	153,700.00	0.10
194	600998	九州通	14,661	152,181.18	0.10
195	002674	兴业科技	12,300	151,905.00	0.10
196	603327	福蓉科技	12,740	151,351.20	0.10
197	300206	理邦仪器	10,000	150,800.00	0.10
198	601107	四川成渝	37,000	150,590.00	0.10
199	600020	中原高速	41,000	150,470.00	0.10
200	300532	今天国际	7,300	150,088.00	0.10
201	300545	联得装备	5,400	149,958.00	0.10
202	600273	嘉化能源	15,900	149,778.00	0.10
203	600035	楚天高速	36,600	149,328.00	0.10
204	603367	辰欣药业	9,800	148,764.00	0.09
205	001696	宗申动力	21,000	148,680.00	0.09
206	300127	银河磁体	8,200	148,666.00	0.09
207	000589	贵州轮胎	26,500	148,400.00	0.09
208	002249	大洋电机	26,000	148,200.00	0.09
209	301087	可孚医疗	3,000	147,900.00	0.09
210	600829	人民同泰	21,000	147,840.00	0.09
211	605066	天正电气	15,700	147,737.00	0.09
212	000528	柳工	18,700	147,730.00	0.09
213	002788	鹭燕医药	15,500	147,715.00	0.09
214	002533	金杯电工	18,100	147,696.00	0.09
215	301160	翔楼新材	4,200	147,630.00	0.09
216	601163	三角轮胎	9,300	147,591.00	0.09
217	603551	奥普家居	11,400	147,402.00	0.09
218	603279	景津装备	4,700	147,392.00	0.09

219	600269	赣粤高速	40,100	147,167.00	0.09
220	600173	卧龙地产	27,900	147,033.00	0.09
221	000517	荣安地产	48,200	147,010.00	0.09
222	002546	新联电子	23,900	146,985.00	0.09
223	601717	郑煤机	11,800	146,910.00	0.09
224	600308	华泰股份	39,480	146,865.60	0.09
225	002017	东信和平	11,200	146,832.00	0.09
226	002274	华昌化工	19,600	146,804.00	0.09
227	600368	五洲交通	40,330	146,801.20	0.09
228	603519	立霸股份	9,900	146,718.00	0.09
229	000404	长虹华意	21,200	146,704.00	0.09
230	002233	塔牌集团	19,000	146,680.00	0.09
230	000928	中钢国际	15,200	146,680.00	0.09
232	000885	城发环境	11,000	146,410.00	0.09
233	000048	京基智农	7,500	146,400.00	0.09
234	603339	四方科技	9,200	146,372.00	0.09
235	000906	浙商中拓	16,400	146,288.00	0.09
236	600510	黑牡丹	24,100	146,287.00	0.09
237	600251	冠农股份	16,200	146,286.00	0.09
238	603757	大元泵业	4,900	146,216.00	0.09
239	000685	中山公用	19,300	146,101.00	0.09
240	605158	华达新材	19,200	145,920.00	0.09
241	000731	四川美丰	17,900	145,885.00	0.09
242	300314	戴维医疗	6,900	145,866.00	0.09
243	002412	汉森制药	22,200	145,854.00	0.09
244	002014	永新股份	16,800	145,824.00	0.09
245	002867	周大生	8,200	145,796.00	0.09
246	002391	长青股份	21,200	145,644.00	0.09
247	603012	创力集团	23,600	145,612.00	0.09
248	002448	中原内配	20,800	145,600.00	0.09
249	601010	文峰股份	59,400	145,530.00	0.09



250	601699	潞安环能	8,900	145,248.00	0.09
251	601567	三星医疗	11,500	145,245.00	0.09
252	600639	浦东金桥	11,700	145,197.00	0.09
253	002108	沧州明珠	32,000	144,960.00	0.09
254	002215	诺普信	19,300	144,943.00	0.09
255	600888	新疆众和	18,300	144,936.00	0.09
256	600531	豫光金铅	23,000	144,900.00	0.09
257	002441	众业达	12,700	144,780.00	0.09
258	600064	南京高科	21,900	144,759.00	0.09
259	600750	江中药业	6,600	144,738.00	0.09
260	002588	史丹利	23,800	144,704.00	0.09
261	300815	玉禾田	9,720	144,633.60	0.09
262	300389	艾比森	7,100	144,627.00	0.09
263	688580	伟思医疗	2,000	144,600.00	0.09
264	600328	中盐化工	16,060	144,540.00	0.09
265	688551	科威尔	2,200	144,276.00	0.09
266	600362	江西铜业	7,600	144,248.00	0.09
267	002661	克明食品	13,100	144,231.00	0.09
268	600517	国网英大	25,300	144,210.00	0.09
269	002128	电投能源	10,900	144,098.00	0.09
270	605009	豪悦护理	3,000	144,000.00	0.09
271	600598	北大荒	10,800	143,964.00	0.09
272	300259	新天科技	35,900	143,959.00	0.09
273	600461	洪城环境	17,600	143,792.00	0.09
274	601877	正泰电器	5,200	143,780.00	0.09
275	603228	景旺电子	5,600	143,640.00	0.09
276	603215	比依股份	8,000	143,520.00	0.09
277	601216	君正集团	35,000	143,500.00	0.09
278	603156	养元饮品	5,800	143,260.00	0.09
279	688569	铁科轨道	3,400	143,038.00	0.09
280	002555	三七互娱	4,100	143,008.00	0.09

281	603889	新澳股份	19,000	142,690.00	0.09
282	000783	长江证券	24,600	142,680.00	0.09
283	605599	菜百股份	10,800	142,668.00	0.09
284	301103	何氏眼科	3,400	142,664.00	0.09
285	300729	乐歌股份	7,980	142,363.20	0.09
286	300857	协创数据	5,400	141,912.00	0.09
287	002131	利欧股份	61,300	140,990.00	0.09
288	600662	外服控股	24,600	140,712.00	0.09
289	002983	芯瑞达	5,700	140,619.00	0.09
290	603630	拉芳家化	8,800	140,536.00	0.09
291	601098	中南传媒	12,100	140,360.00	0.09
292	300303	聚飞光电	22,300	139,598.00	0.09
293	301086	鸿富瀚	2,750	139,425.00	0.09
294	603301	振德医疗	4,700	139,214.00	0.09
295	600329	达仁堂	3,100	139,159.00	0.09
296	601801	皖新传媒	14,800	138,972.00	0.09
297	300580	贝斯特	5,700	138,453.00	0.09
298	300997	欢乐家	9,500	138,415.00	0.09
299	600229	城市传媒	16,200	138,024.00	0.09
300	600419	天润乳业	8,500	137,870.00	0.09
301	600757	长江传媒	16,000	137,600.00	0.09
302	300513	恒实科技	9,900	137,115.00	0.09
303	002757	南兴股份	8,500	137,105.00	0.09
304	601328	交通银行	23,600	136,880.00	0.09
305	601728	中国电信	24,300	136,809.00	0.09
306	002027	分众传媒	20,000	136,200.00	0.09
307	300232	洲明科技	14,900	136,186.00	0.09
308	000997	新大陆	7,200	136,080.00	0.09
309	601928	凤凰传媒	11,900	135,660.00	0.09
310	688606	奥泰生物	2,596	135,537.16	0.09
311	300634	彩讯股份	5,000	132,000.00	0.08

312	603508	思维列控	7,700	131,285.00	0.08
313	688077	大地熊	4,200	126,882.00	0.08
314	002851	麦格米特	3,300	120,351.00	0.08
315	300450	先导智能	3,200	115,744.00	0.07
316	603801	志邦家居	3,500	115,570.00	0.07
317	600389	江山股份	4,840	114,950.00	0.07
318	002318	久立特材	6,700	114,101.00	0.07
319	300316	晶盛机电	1,600	113,440.00	0.07
320	688388	嘉元科技	4,200	113,064.00	0.07
321	603338	浙江鼎力	2,000	112,020.00	0.07
322	688318	财富趋势	1,120	111,966.40	0.07
323	002565	顺灏股份	37,500	111,750.00	0.07
324	002539	云图控股	12,200	109,556.00	0.07
325	600933	爱柯迪	4,700	109,463.00	0.07
326	603982	泉峰汽车	6,600	109,428.00	0.07
327	688800	瑞可达	1,760	109,384.00	0.07
328	300035	中科电气	9,100	109,382.00	0.07
329	002056	横店东磁	6,000	109,260.00	0.07
330	002407	多氟多	5,500	109,230.00	0.07
331	601128	常熟银行	16,000	109,120.00	0.07
332	002635	安洁科技	7,900	109,020.00	0.07
333	601169	北京银行	23,500	108,805.00	0.07
334	300777	中简科技	2,300	108,698.00	0.07
335	002244	滨江集团	12,300	108,486.00	0.07
336	000727	冠捷科技	51,100	108,332.00	0.07
337	600153	建发股份	9,900	108,009.00	0.07
338	600690	海尔智家	4,600	108,008.00	0.07
339	000960	锡业股份	6,900	107,295.00	0.07
340	603032	德新科技	3,100	107,074.00	0.07
341	300618	寒锐钴业	3,300	106,953.00	0.07
342	603713	密尔克卫	1,200	106,908.00	0.07

343	000001	平安银行	9,500	106,685.00	0.07
344	603026	胜华新材	1,800	106,650.00	0.07
345	000560	我爱我家	40,200	106,530.00	0.07
346	002142	宁波银行	4,200	106,260.00	0.07
347	002810	山东赫达	5,900	106,200.00	0.07
348	688798	艾为电子	1,794	106,115.10	0.07
349	002483	润邦股份	18,200	105,560.00	0.07
350	300624	万兴科技	900	105,435.00	0.07
351	002918	蒙娜丽莎	6,800	104,992.00	0.07
352	002449	国星光电	11,800	104,902.00	0.07
353	002612	朗姿股份	4,400	104,632.00	0.07
354	603993	洛阳钼业	19,600	104,468.00	0.07
355	002662	京威股份	31,300	104,229.00	0.07
356	300627	华测导航	3,200	103,904.00	0.07
357	300115	长盈精密	8,700	103,617.00	0.07
358	002419	天虹股份	17,700	103,545.00	0.07
359	000725	京东方 A	25,300	103,477.00	0.07
360	002242	九阳股份	6,900	103,155.00	0.07
361	601390	中国中铁	13,600	103,088.00	0.07
362	301302	华如科技	2,800	103,040.00	0.07
362	002990	盛视科技	2,800	103,040.00	0.07
364	600438	通威股份	3,000	102,930.00	0.07
365	600959	江苏有线	30,400	102,752.00	0.07
366	002080	中材科技	5,000	102,600.00	0.07
367	601186	中国铁建	10,400	102,440.00	0.07
368	600808	马钢股份	39,800	102,286.00	0.07
369	600019	宝钢股份	18,200	102,284.00	0.07
370	600885	宏发股份	3,200	101,920.00	0.07
371	002568	百润股份	2,800	101,780.00	0.06
372	002425	凯撒文化	18,000	101,340.00	0.06
373	688233	神工股份	3,200	101,056.00	0.06

374	600657	信达地产	23,800	100,674.00	0.06
375	002841	视源股份	1,500	100,260.00	0.06
376	600363	联创光电	2,700	100,170.00	0.06
377	300682	朗新科技	4,300	100,104.00	0.06
378	600702	舍得酒业	800	99,160.00	0.06
379	001227	兰州银行	34,400	98,384.00	0.06
380	603899	晨光股份	2,200	98,208.00	0.06
381	000858	五粮液	600	98,142.00	0.06
382	603737	三棵树	1,500	98,130.00	0.06
383	603136	天目湖	3,800	98,040.00	0.06
384	605123	派克新材	900	97,785.00	0.06
385	601288	农业银行	27,700	97,781.00	0.06
386	600563	法拉电子	700	96,110.00	0.06
387	603833	欧派家居	1,000	95,800.00	0.06
388	688200	华峰测控	592	90,576.00	0.06
389	300447	全信股份	4,700	90,193.00	0.06
390	601126	四方股份	5,800	88,102.00	0.06
391	688050	爱博医疗	400	82,132.00	0.05
392	600133	东湖高新	12,100	79,739.00	0.05
393	002139	拓邦股份	6,100	79,605.00	0.05
394	603882	金城医学	1,000	75,500.00	0.05
395	601827	三峰环境	10,200	75,480.00	0.05
396	600929	雪天盐业	9,500	75,430.00	0.05
397	688617	惠泰医疗	200	74,750.00	0.05
398	300194	福安药业	19,000	73,720.00	0.05
399	002038	双鹭药业	7,300	73,657.00	0.05
400	300231	银信科技	8,200	73,062.00	0.05
401	603299	苏盐井神	7,300	72,854.00	0.05
402	600720	祁连山	6,309	71,733.33	0.05
403	300444	双杰电气	9,200	70,840.00	0.05
404	000338	潍柴动力	5,500	68,530.00	0.04

405	002745	木林森	7,400	68,080.00	0.04
406	605266	健之佳	800	67,064.00	0.04
407	000951	中国重汽	3,700	62,345.00	0.04
408	002545	东方铁塔	8,600	60,716.00	0.04
409	000050	深天马 A	6,600	60,588.00	0.04
410	688301	奕瑞科技	200	56,486.00	0.04
411	688037	芯源微	96	16,411.20	0.01
412	301317	鑫磊股份	406	10,625.02	0.01
413	301358	湖南裕能	241	10,336.49	0.01
414	301260	格力博	306	7,230.78	0.00
415	603135	中重科技	161	2,880.29	0.00
416	601065	江盐集团	187	2,214.08	0.00
417	601133	柏诚股份	160	1,961.60	0.00
418	603172	万丰股份	112	1,806.56	0.00
419	001282	三联锻造	53	1,750.59	0.00
420	001324	长青科技	68	1,332.80	0.00
421	603125	常青科技	54	1,324.62	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	000858	五粮液	3,948,177.00	2.26
2	603103	横店影视	2,882,527.00	1.65
3	603806	福斯特	2,747,408.00	1.57
4	600007	中国国贸	2,683,722.00	1.53
5	605198	安德利	2,662,681.00	1.52
6	688800	瑞可达	2,602,539.10	1.49
7	603676	卫信康	2,482,243.00	1.42
8	601698	中国卫通	2,465,712.00	1.41

9	301017	漱玉平民	2,383,442.00	1.36
10	601318	中国平安	2,363,617.00	1.35
11	300697	电工合金	2,329,693.00	1.33
12	301286	侨源股份	2,306,646.00	1.32
13	601668	中国建筑	2,211,589.00	1.26
14	601012	隆基绿能	2,174,426.80	1.24
15	300750	宁德时代	2,161,986.00	1.24
16	601728	中国电信	2,142,839.00	1.22
17	603527	众源新材	2,122,941.00	1.21
18	600563	法拉电子	2,120,191.00	1.21
19	605118	力鼎光电	2,119,632.00	1.21
20	002156	通富微电	2,116,163.00	1.21

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601012	隆基绿能	8,939,045.90	5.11
2	600048	保利发展	8,129,142.00	4.65
3	002311	海大集团	7,802,987.89	4.46
4	603259	药明康德	7,721,063.00	4.41
5	600309	万华化学	7,557,154.00	4.32
6	605499	东鹏饮料	6,852,542.00	3.92
7	000002	万科A	6,661,770.00	3.81
8	300059	东方财富	6,654,612.00	3.80
9	300750	宁德时代	5,988,549.00	3.42
10	603345	安井食品	5,758,107.00	3.29
11	601100	恒立液压	5,710,072.00	3.26
12	688029	南微医学	5,687,548.45	3.25
13	300760	迈瑞医疗	5,436,482.00	3.11
14	600519	贵州茅台	5,421,806.00	3.10

15	600779	水井坊	5,040,879.00	2.88
16	601966	玲珑轮胎	4,859,866.00	2.78
17	002142	宁波银行	4,722,933.56	2.70
18	300124	汇川技术	4,665,752.00	2.67
19	600570	恒生电子	4,609,166.00	2.63
20	603596	伯特利	4,604,377.00	2.63
21	600809	山西汾酒	4,436,071.00	2.53
22	000858	五粮液	3,848,149.00	2.20
23	300122	智飞生物	3,792,282.00	2.17
24	601021	春秋航空	3,665,255.20	2.09
25	603517	绝味食品	3,618,146.00	2.07

#### 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	509,470,430.35
卖出股票收入（成交）总额	523,136,511.71

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	10,153,213.11	6.48
	其中：政策性金融债	10,153,213.11	6.48
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)	165,374.81	0.11
8	同业存单	-	-



9	其他	-	-
10	合计	10,318,587.92	6.58

## 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	210303	21进出03	100,000	10,153,213.11	6.48
2	127086	恒邦转债	1,580	158,013.16	0.10
3	113669	景23转债	40	5,559.91	0.00
4	123195	蓝晓转02	13	1,801.74	0.00

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	33,906.74
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	798.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	34,705.54

**7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

**7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

**7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能存在尾差。

## §8 基金份额持有人信息

**8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

持有人 户数	户均持有的基金份 额	持有人结构	
		机构投资者	个人投资者

数(户)		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
557	160,792.74	75,919,953.02	84.77%	13,641,602.00	15.23%

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	3,568,557.08	3.9845%

## 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	0

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2016年06月01日)基金份额总额	847,544,853.76
本报告期期初基金份额总额	95,858,119.39
本报告期基金总申购份额	7,485,072.91
减：本报告期基金总赎回份额	13,781,637.28
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	89,561,555.02

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	300,685,592.05	29.14%	216,884.42	36.54%	-
华金	2	274,279,926.34	26.58%	46,981.49	7.92%	-

证券						
中信建投证券	4	229,323,987.22	22.22%	165,412.71	27.87%	-
长城证券	2	132,976,529.77	12.89%	95,917.72	16.16%	-
光大证券	2	59,878,302.77	5.80%	43,190.03	7.28%	-
中信证券	2	34,800,221.76	3.37%	25,099.41	4.23%	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源证券	2	-	-	-	-	-

太平洋证券	2	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中国中金财富证券	2	-	-	-	-	-
首创证券	3	-	-	-	-	-
安信证券	4	-	-	-	-	-

注：1、本公司选择证券经营机构的标准

- (1) 经营行为规范，内控制度健全，信誉良好。
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。
- (3) 研究实力较强，能及时为本公司提供高质量的研究服务。
- (4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本公司基金进行证券交易的需要，并能为本公司基金提供全面的信息服务。

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

				比例				
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华金证券	94,210.77	100.00%	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中国中金财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	泓德基金管理有限公司关于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、上海证券报、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关于旗下部分基金增加海通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	2023-02-17
3	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	2023-02-21

4	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、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2023-02-24
5	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加平安银行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	2023-02-25
6	泓德基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在销售机构申购起点金额的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-02
7	泓德基金管理有限公司关于泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金恢复大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-11
8	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东莞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	2023-03-29
9	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、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2023-05-18
10	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、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2023-05-26
11	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加开源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	2023-06-13
12	泓德基金管理有限公司关于泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金新增部分销售机构的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2023-06-21



## §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	23,916,118.00	0.00	0.00	23,916,118.00	26.70%
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泓信灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在规定报刊上披露的各项公告。

### 12.2 存放地点

地点为管理人地址：北京市西城区德胜门外大街125号

### 12.3 查阅方式

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

3、投资者可访问本基金管理人公司网站，网址：[www.hongdefund.com](http://www.hongdefund.com)

泓德基金管理有限公司

二〇二三年八月三十日