

# 泓德致远混合型证券投资基金

## 2024 年中期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人:泓德基金管理有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

送出日期:2024 年 08 月 29 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年8月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2024年1月1日起至2024年6月30日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51
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	52
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	52
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	52
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	52
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	52
7.12 投资组合报告附注	53
§8 基金份额持有人信息	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	55
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 .....	55
§9 开放式基金份额变动 .....	56
§10 重大事件揭示 .....	56
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	56
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 .....	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	56
10.4 基金投资策略的改变 .....	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	57
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 .....	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	57
10.8 其他重大事件 .....	61
§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....	61
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 .....	61
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	61
§12 备查文件目录 .....	61
12.1 备查文件目录 .....	61
12.2 存放地点 .....	61
12.3 查阅方式 .....	61

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	泓德致远混合型证券投资基金	
基金简称	泓德致远混合	
基金主代码	004965	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年08月30日	
基金管理人	泓德基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	767,049,635.72份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	泓德致远混合A	泓德致远混合C
下属分级基金的交易代码	004965	004966
报告期末下属分级基金的份额总额	660,821,592.70份	106,228,043.02份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在有效控制风险的前提下，通过合理的资产配置，综合运用多种投资策略，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金通过定性分析与定量分析相结合的方法分析宏观经济和资本市场发展趋势，采用"自上而下"的分析视角，综合考量宏观经济发展前景，评估各类资产的预期收益与风险，合理确定本基金在股票、债券等各类别资产上的投资比例并适时做出动态调整。股票投资方面，本基金从基本面分析入手，根据个股的估值水平优选个股，重点配置当前业绩优良、市场认同度较高、在可预见的未来其行业处于景气周期中的股票。本基金债券投资采取适当的久期策略、信用策略、时机策略和可转换债券投资策略相结合的方法。本基金本着谨慎原则，从风险管理角度出发，适度参与股指期货、国债期货投资。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×40%+中证综合债券指数收

	益率×60%
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于较高风险、较高收益的品种，其长期风险与收益特征低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		泓德基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李晓春	张姗
	联系电话	010-59850177	400-61-95555
	电子邮箱	lixiaochun@hongdefund.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		4009-100-888	400-61-95555
传真		010-59850195	0755-83195201
注册地址		西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦1206室	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址		北京市西城区德胜门外大街125号	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		100088	518040
法定代表人		王德晓	缪建民

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.hongdefund.com
基金中期报告备置地点	北京市西城区德胜门外大街125号

### 2.5 其他相关资料

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

## §3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2024年01月01日-2024年06月30日)	
	泓德致远混合A	泓德致远混合C
本期已实现收益	-113,304,223.18	-17,553,973.78
本期利润	-36,359,850.84	-5,639,250.03
加权平均基金份额本期利润	-0.0529	-0.0509
本期加权平均净值利润率	-3.25%	-3.28%
本期基金份额净值增长率	-3.13%	-3.18%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2024年06月30日)	
期末可供分配利润	352,333,366.79	48,108,666.15
期末可供分配基金份额利润	0.5332	0.4529
期末基金资产净值	1,062,410,235.36	162,563,103.22
期末基金份额净值	1.6077	1.5303
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2024年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	60.77%	53.03%

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

泓德致远混合A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	-2.63%	0.37%	-0.81%	0.19%	-1.82%	0.18%
过去三个月	-0.99%	0.51%	0.22%	0.29%	-1.21%	0.22%
过去六个月	-3.13%	0.65%	2.79%	0.35%	-5.92%	0.30%
过去一年	-13.34%	0.58%	-0.46%	0.34%	-12.88%	0.24%
过去三年	-21.73%	0.67%	-6.44%	0.41%	-15.29%	0.26%
自基金合同 生效起至今	60.77%	0.80%	19.83%	0.47%	40.94%	0.33%

## 泓德致远混合C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	-2.63%	0.37%	-0.81%	0.19%	-1.82%	0.18%
过去三个月	-1.02%	0.51%	0.22%	0.29%	-1.24%	0.22%
过去六个月	-3.18%	0.65%	2.79%	0.35%	-5.97%	0.30%
过去一年	-13.55%	0.58%	-0.46%	0.34%	-13.09%	0.24%
过去三年	-23.16%	0.67%	-6.44%	0.41%	-16.72%	0.26%
自基金合同 生效起至今	53.03%	0.80%	19.83%	0.47%	33.20%	0.33%

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×40%+中证综合债券指数收益率×60%  
基准指数的构建原则如下：

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

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



有主要债券种类。

(3) 由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照40%、60%的比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

泓德致远混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2017年08月30日-2024年06月30日)



泓德致远混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2017年08月30日-2024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”或“泓德基金”），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。

泓德基金自成立以来，始终以“客户利益最大化”为己任，聚焦主动投资管理。公司建立了科学规范的公司治理结构，全面有效的风险管理体系，稳健的运营保障体系，专业高效的市场服务体系，中长期的激励约束机制，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。泓德基金坚持长期价值投资理念，以更好地保障客户利益为出发点，强调投资长周期性，同时在产品设计以及产品销售环节配合投资理念的落地执行。

公司已覆盖从公募到专户、从股票投资到固定收益投资、从低风险到高风险等不同产品类型，公募基金产品涵盖股票型、债券型、混合型、货币型等基金品种。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王克玉	本基金的基金经理、公司副总经理、权益投资部总监	2023-02-21	-	21年	硕士研究生，具有基金从业资格，曾任本公司投研总监，长盛基金管理有限公司基金经理、权益投资部副总监，国都证券有限公司分析师，天相投资顾问有限公司分析师，元大京华证券上海代表处研究员。

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

分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的含义遵从中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，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

上半年A股市场呈现剧烈震荡、大幅分化的格局，整体看万得全A指数下跌8%，沪深300指数和上证综指持平，但是中证1000、科创50等风格指数下跌超过15%。一季度A股市场表现非常极致，在一月底陷入了流动性危机，大量资管产品的趋同性交易导致市场短期内的非理性波动，最终靠外力在春节前后才恢复正常；二季度市场整体表现对比一季度更弱，上证指数和沪深300指数分别下跌了超过2%，中证1000指数跌幅达到10%。总结看市场在上半年整体走势偏弱，影响因素主要是经济基本面和流动性缺失。上半年上涨公司数量占比约15%，主要是集中在资源、银行、公用事业等传统的低估值、高分

红行业中，除此以外的行业大都下跌，跌幅居前的包括房地产、消费、医药，以及计算机、传媒和电力设备等。

组合净值在过去两个季度表现较弱，主要还是受到了行业和市场风格的双重影响。在过去一个阶段组合持续增加对红利类资产的投资比例，降低成长股的比例，组合表现跟过去相比体现出一定的差异。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末泓德致远混合A基金份额净值为1.6077元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-3.13%，同期业绩比较基准收益率为2.79%；截至报告期末泓德致远混合C基金份额净值为1.5303元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-3.18%，同期业绩比较基准收益率为2.79%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

##### 4.5.1 对宏观经济和证券市场展望

2023年下半年开始由于房地产的持续下行，对消费者信心、政府支出等很多方面产生共振下行，这种情况目前还在继续，在2024年上半年我们看到部分企业开始显著控制人员成本，经济活力进一步收缩；相对应的是海外需求在通胀影响下一直处于相对活跃的状态。但是从经济周期循环的角度看，在经过全面的收缩之后，随着环境的变化和政策的大幅度调整，经济活动在重新积累向上的力量。

过去一年处于证券市场规则快速优化的阶段，监管部门正对市场运行中长期存在的一些问题进行集中的制度优化，特别是针对提高投资者回报推出了有明确目标的要求，使得市场定位越来越向改善投资者回报的方向发展。

##### 4.5.2 本基金下阶段投资策略

目前A股的整体估值水平保持在非常有吸引力的状况已经持续了一段时间，但是出口与内需、国际与国内等多方面的分化以及整体稳健的经济政策，促成了不同行业、不同规模的企业间的巨大分化。随着海外出口型企业的压力逐渐显现，叠加国内房地产相关政策大幅度调整之后开始逐渐显现效果，下半年更关注反转型的投资机会。对上市公司而言经历过一次激烈的压力测试之后企业的综合能力和竞争环境改善明显，盈利能力的恢复和提高值得重点跟踪。

未来一个阶段组合的主要投资方向包括稳定回报类资产和消费类行业，也会小部分保持在TMT领域的投资。目前国内内需消费品公司在需求端价格压力和渠道压力之下已经大多数下跌到极低估值状况，对于投资者而言这是难得的一次机遇，特别是中低端的消费品需求将长期存在且增长，市场格局相比较三年前有了显著改善的情况下，预计估值和盈利同向提升将给组合带来很好的收益。在稳定回报类资产领域，会继续加强对优质的基础设施类公司的评估，并在具备充分的安全边际的情况下增加投资。

在A股市场大幅度扩容之后，我们也在重新思考怎么样提高组合的长期收益。今后将在保持组合风格相对均衡的状况下，更广泛的筛选投资标的，对投资性价比优异的投资机会将努力提高投资比例。

#### 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,设立基金估值委员会,估值委员会负责指导和监督整个估值流程。估值委员会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委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已分别与中债金融估值中心有限公司和中证指数有限公司签署服务协议,由其分别按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种和在交易所市场交易或挂牌的部分债券品种的估值数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定以及本基金基金合同第十六部分中对基金利润分配原则的约定,本基金本报告期内未实施利润分配。

本基金截至2024年06月30日,期末可供分配利润为400,442,032.94元,其中:泓德致远混合A期末可供分配利润为352,333,366.79元(泓德致远混合A的未分配利润已实现部分为352,333,366.79元,未分配利润未实现部分为49,255,275.87元),泓德致远混合C期末可供分配利润为48,108,666.15元(泓德致远混合C的未分配利润已实现部分为48,108,666.15元,未分配利润未实现部分为8,226,394.05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,本基金管理人无应说明的预警信息。

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

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

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

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

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

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

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：泓德致远混合型证券投资基金

报告截止日：2024年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	323,701,345.56	87,443,701.62
结算备付金		441,678.39	551,143.30
存出保证金		97,104.57	110,867.10
交易性金融资产	6.4.7.2	901,110,050.39	1,185,777,066.74
其中：股票投资		584,081,262.43	672,469,456.20
基金投资		-	-
债券投资		317,028,787.96	513,307,610.54

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	-	80,078,780.84
应收清算款		2,853,048.24	2,270,202.06
应收股利		-	-
应收申购款		73,455.98	172,070.56
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		1,228,276,683.13	1,356,403,832.22
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年06月30日</b>	<b>上年度末 2023年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	1,348,539.73
应付赎回款		1,532,432.02	2,676,010.42
应付管理人报酬		1,235,019.28	1,385,856.57
应付托管费		154,377.41	173,232.07
应付销售服务费		13,650.91	15,637.63
应付投资顾问费		-	-
应交税费		2,462.76	11,154.33
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	365,402.17	357,119.06
负债合计		3,303,344.55	5,967,549.81
<b>净资产：</b>			

实收基金	6.4.7.7	767,049,635.72	819,217,209.48
未分配利润	6.4.7.8	457,923,702.86	531,219,072.93
净资产合计		1,224,973,338.58	1,350,436,282.41
负债和净资产总计		1,228,276,683.13	1,356,403,832.22

注：报告截止日2024年06月30日，基金份额总额767,049,635.72份，其中A类基金份额总额为660,821,592.70份，基金份额净值为1.6077元；C类基金份额总额为106,228,043.02份，基金份额净值为1.5303元。

## 6.2 利润表

会计主体：泓德致远混合型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至202 3年06月30日
一、营业总收入		-33,109,866.43	82,657,773.31
1.利息收入		567,053.67	511,324.13
其中：存款利息收入	6.4.7.9	419,031.73	424,739.96
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		148,021.94	86,584.17
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-” 填列）		-122,558,632.67	-24,399,411.84
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-151,185,843.10	-43,414,116.46
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	18,517,791.80	12,967,741.12
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	10,109,418.63	6,046,963.50
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	88,859,096.09	106,450,269.01
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	22,616.48	95,592.01
<b>减：二、营业总支出</b>		8,889,234.44	13,067,799.96
1.管理人报酬		7,702,450.27	10,643,761.45
2.托管费		962,806.33	1,330,470.19
3.销售服务费		85,457.93	953,657.28
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		2,673.27	2,659.41
8.其他费用	6.4.7.16	135,846.64	137,251.63
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-41,999,100.87	69,589,973.35
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-41,999,100.87	69,589,973.35
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-41,999,100.87	69,589,973.35

### 6.3 净资产变动表

会计主体：泓德致远混合型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	819,217,209.48	531,219,072.93	1,350,436,282.41
二、本期期初净资产	819,217,209.48	531,219,072.93	1,350,436,282.41
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-52,167,573.76	-73,295,370.07	-125,462,943.83
（一）、综合收益总额	-	-41,999,100.87	-41,999,100.87
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-52,167,573.76	-31,296,269.20	-83,463,842.96
其中：1.基金申购款	28,983,324.04	18,300,025.78	47,283,349.82
2.基金赎回款	-81,150,897.80	-49,596,294.98	-130,747,192.78
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	767,049,635.72	457,923,702.86	1,224,973,338.58
项目	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,046,897,623.71	813,801,209.38	1,860,698,833.09

二、本期期初净资产	1,046,897,623.71	813,801,209.38	1,860,698,833.09
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-143,843,686.27	-52,113,166.19	-195,956,852.46
（一）、综合收益总额	-	69,589,973.35	69,589,973.35
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-143,843,686.27	-121,703,139.54	-265,546,825.81
其中：1.基金申购款	35,028,110.50	29,869,643.40	64,897,753.90
2.基金赎回款	-178,871,796.77	-151,572,782.94	-330,444,579.71
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	903,053,937.44	761,688,043.19	1,664,741,980.63

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

王德晓

李娇

王玲

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

泓德致远混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2017]1195号《关于准予泓德致远混合型证券投资基金注册的批复》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《泓德致远混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金自成立之初为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集493,656,281.49元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第851号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泓德致远混合型证券投资基金基金合同》于2017年8月30日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为493,834,527.04份，其中认购资金利息折合178,245.55份基金份额。本基金的基金管理人为泓德基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泓德致远混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债、可转换债券、中小企业私募债、证券公司短期公司债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具(含同业存单)、权证、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为0-50%。本基金每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×40%+中证综合债券指数收益率×60%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《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》、《泓德致远混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2024年1月1日至2024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2024年6月30日的财务状况以及2024年1月1日至2024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。根据财政部、国家税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

(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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
活期存款	323,701,345.56
等于：本金	323,668,395.24
加：应计利息	32,950.32
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	323,701,345.56

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	698,870,839.52	-	584,081,262.43	-114,789,577.09	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	270,093,961.85	2,707,728.97	286,419,580.31	13,617,889.49
	银行间市场	30,080,080.00	586,207.65	30,609,207.65	-57,080.00
	合计	300,174,041.85	3,293,936.62	317,028,787.96	13,560,809.49
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	999,044,881.37	3,293,936.62	901,110,050.39	-101,228,767.60	

### 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 2024年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	71.74
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	255,932.05
其中：交易所市场	255,032.05
银行间市场	900.00
应付利息	-
预提费用	109,398.38
合计	365,402.17

#### 6.4.7.7 实收基金

##### 6.4.7.7.1 泓德致远混合A

金额单位：人民币元

项目 (泓德致远混合A)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	703,771,019.32	703,771,019.32
本期申购	27,732,482.60	27,732,482.60
本期赎回（以“-”号填列）	-70,681,909.22	-70,681,909.22
本期末	660,821,592.70	660,821,592.70

##### 6.4.7.7.2 泓德致远混合C

金额单位：人民币元

项目 (泓德致远混合C)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额



上年度末	115,446,190.16	115,446,190.16
本期申购	1,250,841.44	1,250,841.44
本期赎回（以“-”号填列）	-10,468,988.58	-10,468,988.58
本期末	106,228,043.02	106,228,043.02

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

##### 6.4.7.8.1 泓德致远混合A

单位：人民币元

项目 (泓德致远混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	489,580,631.83	-25,377,398.77	464,203,233.06
本期期初	489,580,631.83	-25,377,398.77	464,203,233.06
本期利润	-113,304,223.18	76,944,372.34	-36,359,850.84
本期基金份额交易产生的变动数	-23,943,041.86	-2,311,697.70	-26,254,739.56
其中：基金申购款	17,715,333.07	-92,299.54	17,623,033.53
基金赎回款	-41,658,374.93	-2,219,398.16	-43,877,773.09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	352,333,366.79	49,255,275.87	401,588,642.66

##### 6.4.7.8.2 泓德致远混合C

单位：人民币元

项目 (泓德致远混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	70,233,549.56	-3,217,709.69	67,015,839.87
本期期初	70,233,549.56	-3,217,709.69	67,015,839.87
本期利润	-17,553,973.78	11,914,723.75	-5,639,250.03
本期基金份额交易产生的变动数	-4,570,909.63	-470,620.01	-5,041,529.64
其中：基金申购款	652,319.90	24,672.35	676,992.25
基金赎回款	-5,223,229.53	-495,292.36	-5,718,521.89

本期已分配利润	-	-	-
本期末	48,108,666.15	8,226,394.05	56,335,060.20

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年01月01日至2024年06月30日	
活期存款利息收入	412,756.33	
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	5,599.95	
其他	675.45	
合计	419,031.73	

#### 6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年01月01日至2024年06月30日	
卖出股票成交总额	377,561,743.79	
减：卖出股票成本总额	527,977,902.36	
减：交易费用	769,684.53	
买卖股票差价收入	-151,185,843.10	

#### 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	
	2024年01月01日至2024年06月30日	
债券投资收益——利息收入	4,588,980.11	
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	13,928,811.69	
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	18,517,791.80

**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 2024年01月01日至2024年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	263,237,972.11
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	246,699,858.02
减：应计利息总额	2,599,004.95
减：交易费用	10,297.45
买卖债券差价收入	13,928,811.69

**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 2024年01月01日至2024年06月30日
股票投资产生的股利收益	10,109,418.63
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	10,109,418.63

**6.4.7.14 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
------	----

	2024年01月01日至2024年06月30日
1.交易性金融资产	88,859,096.09
——股票投资	89,045,150.31
——债券投资	-186,054.22
——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	88,859,096.09

#### 6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
基金赎回费收入	22,550.20
基金转换费收入	66.28
合计	22,616.48

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
	2024年01月01日至2024年06月30日
审计费用	49,726.04

信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
汇划手续费	7,848.26
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	135,846.64

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至20 24年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至20 23年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	7,702,450.27	10,643,761.45
其中：应支付销售机构的客户维护费	3,072,094.63	4,312,072.93
应支付基金管理人的净管理费	4,630,355.64	6,331,688.52

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1.20%的年费率每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：  
日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.20%/当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024 年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	962,806.33	1,330,470.19

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值0.15%的年费率每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：  
日托管费=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售 服务费的 各关联方 名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泓德致远混合A	泓德致远混合C	合计
泓德基金	0.00	317.65	317.65
招商银行	0.00	10,433.64	10,433.64
合计	0.00	10,751.29	10,751.29
获得销售	上年度可比期间		

服务费的各关联方名称	2023年01月01日至2023年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泓德致远混合A	泓德致远混合C	合计
泓德基金	0.00	10,750.95	10,750.95
招商银行	0.00	111,885.07	111,885.07
合计	0.00	122,636.02	122,636.02

注：截至2023年9月12日止，支付基金销售机构的C类基金份额销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值0.80%的年费率每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付给泓德基金，再由泓德基金计算并支付给各基金销售机构。A类基金份额不收取销售服务费。其计算公式为：

日销售服务费=前一日C类基金份额基金资产净值×0.80%/当年天数。

根据《泓德基金管理有限公司关于泓德致远混合型证券投资基金C类份额开展销售费率及赎回费率优惠活动的公告》，自2023年9月13日起，支付基金销售机构的C类基金份额销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值0.10%的年费率每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付给泓德基金，再由泓德基金计算并支付给各基金销售机构。A类基金份额不收取销售服务费。其计算公式为：

日销售服务费=前一日C类基金份额基金资产净值×0.10%/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 2024年01月01日至2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日

	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	323,701,345.56	412,756.33	174,855,703.26	420,652.49

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

**6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

**6.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

**6.4.11 利润分配情况**

本基金本报告期内未进行利润分配。

**6.4.12 期末（2024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
301589	诺瓦星云	2024-02-01	6个月以上	限售股	126.89	188.01	1,244	87,680.99	233,884.44	备注2（1）
688692	达梦数据	2024-06-04	6个月以上	限售股	86.96	174.93	175	15,218.00	30,612.75	-
603285	键邦股份	2024-06-28	5个交易日	新股未上市	18.65	18.65	1,158	21,596.70	21,596.70	-
601033	永兴股份	2024-01-11	6个月以上	限售股	16.20	15.96	1,258	20,379.60	20,077.68	-
688709	成都	2024-01-3	6个	限售	15.69	18.79	1,045	16,396.05	19,635.55	-



	华微	1	月以上	股						
603350	安乃达	2024-06-26	5个交易日	新股未上市	20.56	20.56	945	19,429.20	19,429.20	-
301536	星辰科技	2024-03-20	6个月以上	限售股	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-
688584	上海合晶	2024-02-01	6个月以上	限售股	22.66	15.89	866	19,623.56	13,760.74	-
301538	骏鼎达	2024-03-13	6个月以上	限售股	55.82	91.24	150	5,972.74	13,686.00	备注2 (2)
301565	中仑新材	2024-06-13	6个月以上	限售股	11.88	18.98	711	8,446.68	13,494.78	-
301580	爱迪特	2024-06-19	6个月以上	限售股	44.95	65.93	202	9,079.90	13,317.86	-
603341	龙旗科技	2024-02-23	6个月以上	限售股	26.00	37.49	298	7,748.00	11,172.02	-
688691	灿芯股份	2024-04-02	6个月以上	限售股	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-
301566	达利凯普	2023-12-22	6个月以上	限售股	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-
301392	汇成真空	2024-05-28	6个月以上	限售股	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
3015	肯特	2024	6个	限售	19.43	36.98	219	4,25	8,09	-

91	股份	-02-20	月以上	股				5.17	8.62	
301587	中瑞股份	2024-03-27	6个月以上	限售股	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-
001389	广合科技	2024-03-26	6个月以上	限售股	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-
301539	宏鑫科技	2024-04-03	6个月以上	限售股	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-
688695	中创股份	2024-03-06	6个月以上	限售股	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
688530	欧莱新材	2024-04-29	6个月以上	限售股	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
301588	美新科技	2024-03-06	6个月以上	限售股	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-
301502	华阳智能	2024-01-26	6个月以上	限售股	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-
603381	永臻股份	2024-06-19	6个月以上	限售股	23.35	25.13	178	4,156.30	4,473.14	-
603344	星德胜	2024-03-13	6个月以上	限售股	19.18	22.66	182	3,490.76	4,124.12	-
001359	平安电工	2024-03-19	6个月以上	限售股	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	-
6033	西典	2024	6个	限售	29.02	25.36	130	3,77	3,29	-

12	新能	-01-04	月以上	股				2.60	6.80	
603082	北自科技	2024-01-23	6个月以上	限售股	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-
001379	腾达科技	2024-01-11	6个月以上	限售股	16.98	13.48	213	3,616.74	2,871.24	-
603375	盛景微	2024-01-17	6个月以上	限售股	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	-
001387	雪祺电气	2024-01-04	6个月以上	限售股	15.38	15.25	173	2,045.54	2,638.25	备注2 (3)
603285	键邦股份	2024-06-28	6个月以上	新股未上市且限售	18.65	18.65	129	2,405.85	2,405.85	-
603350	安乃达	2024-06-26	6个月以上	新股未上市且限售	20.56	20.56	106	2,179.36	2,179.36	-

注：1、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

2、上述流通受限股票持有期间分红情况如下：

(1) 该股票于2024年5月30日实施权益分派方案：每10股派发现金股利97.00元（含税），同时，以资本公积向全体股东每10股转增8股。

(2) 该股票于2024年5月22日实施权益分派方案：每10股派发现金股利7.00元（含税），同时，以资本公积向全体股东每10股转增4股。

(3) 该股票于2024年6月3日实施权益分派方案：每10股派发现金股利3.50元（含税），同时，以资本公积向全体股东每10股转增3股。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人致力于全面内部控制体系的建设，建立了从董事会层面到各业务部门的风险管理组织架构。本基金的基金管理人在董事会下设风险控制委员会，主要负责制定基金管理人风险控制战略和控制政策等事项；督察长负责对基金管理人各业务环节合法合规运作进行监督检查，组织、指导基金管理人内部监察稽核工作，并可向董事会和中国证监会直接报告；在公司内部设立独立的监察稽核部，专职负责对基金管理人各部门、各业务的风险控制情况进行督促和检查，并适时提出整改建议。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，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。

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

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	10,067,590.16	-
合计	10,067,590.16	-

注：于2024年6月30日，未评级部分为政策性金融债。债券信用评级取自第三方评级机构。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级的资产支持证券。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级的同业存单。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	233,010,177.46	367,345,174.64
AAA以下	53,409,402.85	74,176,241.91
未评级	20,541,617.49	71,786,193.99
合计	306,961,197.80	513,307,610.54

注：于2024年6月30日，未评级部分为政策性金融债(2023年12月31日，同)。债券信用评级取自第三方评级机构。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级的资产支持证券。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级的同业存单。

### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

于本报告期期末，本基金所承担的全部金融负债的合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%。于本报告期期末，本基金持有流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。于本报告期期末，本基金确认的净赎回申请未超过7个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产如下表所示：

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年06月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	323,701,345.56	-	-	-	323,701,345.56
结算备付金	441,678.39	-	-	-	441,678.39
存出保证金	97,104.57	-	-	-	97,104.57
交易性金融资产	76,688,989.84	235,967,766.86	4,372,031.26	584,081,262.43	901,110,050.39
应收清算款	-	-	-	2,853,048.24	2,853,048.24
应收申购款	-	-	-	73,455.98	73,455.98
资产总计	400,929,118.36	235,967,766.86	4,372,031.26	587,007,766.65	1,228,276,683.13
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,532,432.02	1,532,432.02
应付管理人报酬	-	-	-	1,235,019.28	1,235,019.28
应付托管费	-	-	-	154,377.41	154,377.41
应付销售服务费	-	-	-	13,650.91	13,650.91
应交税费	-	-	-	2,462.76	2,462.76
其他负债	-	-	-	365,402.17	365,402.17
负债总计	-	-	-	3,303,344.55	3,303,344.55
利率敏感度缺口	400,929,118.36	235,967,766.86	4,372,031.26	583,704,422.10	1,224,973,338.58
上年度末 2023年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	87,443,701.62	-	-	-	87,443,701.62
结算备付金	551,143.30	-	-	-	551,143.30
存出保证金	110,867.10	-	-	-	110,867.10
交易性金融资产	71,786,193.99	437,439,623.13	4,081,793.42	672,469,456.20	1,185,777,066.74
买入返售金融资产	80,078,780.84	-	-	-	80,078,780.84
应收清算款	-	-	-	2,270,202.06	2,270,202.06



应收申购款	-	-	-	172,070.56	172,070.56
资产总计	239,970,686.85	437,439,623.13	4,081,793.42	674,911,728.82	1,356,403,832.22
负债					
应付清算款	-	-	-	1,348,539.73	1,348,539.73
应付赎回款	-	-	-	2,676,010.42	2,676,010.42
应付管理人报酬	-	-	-	1,385,856.57	1,385,856.57
应付托管费	-	-	-	173,232.07	173,232.07
应付销售服务费	-	-	-	15,637.63	15,637.63
应交税费	-	-	-	11,154.33	11,154.33
其他负债	-	-	-	357,119.06	357,119.06
负债总计	-	-	-	5,967,549.81	5,967,549.81
利率敏感度缺口	239,970,686.85	437,439,623.13	4,081,793.42	668,944,179.01	1,350,436,282.41

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
	市场利率下降25个基点	1,454,243.43	2,735,266.54
	市场利率上升25个基点	-1,441,249.80	-2,708,812.12

#### 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 2024年06月30日		上年度末 2023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	584,081,262.43	47.68	672,469,456.20	49.80
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	584,081,262.43	47.68	672,469,456.20	49.80

#### 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 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
业绩比较基准上升5%	102,140,805.02	90,457,026.96
业绩比较基准下降5%	-102,140,805.02	-90,457,026.96

#### 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

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	869,960,775.52	1,105,134,506.30
第二层次	30,654,818.76	71,786,193.99
第三层次	494,456.11	8,856,366.45
合计	901,110,050.39	1,185,777,066.74

###### 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2024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(2023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	584,081,262.43	47.55
	其中：股票	584,081,262.43	47.55
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	317,028,787.96	25.81
	其中：债券	317,028,787.96	25.81
	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	324,143,023.95	26.39
8	其他各项资产	3,023,608.79	0.25
9	合计	1,228,276,683.13	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	293,628,810.07	23.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	47,812,710.00	3.90
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	117,830,395.60	9.62
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	81,431,150.25	6.65
J	金融业	9,874,272.00	0.81
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	8,839,300.00	0.72
M	科学研究和技术服务业	7,526,273.83	0.61
N	水利、环境和公共设施管理业	20,077.68	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	16,115,949.00	1.32
R	文化、体育和娱乐业	1,002,324.00	0.08
S	综合	-	-
	合计	584,081,262.43	47.68

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	601816	京沪高铁	8,857,100	47,562,627.00	3.88
2	601985	中国核电	3,501,500	37,325,990.00	3.05
3	002595	豪迈科技	855,598	32,658,175.66	2.67
4	603565	中谷物流	3,689,940	32,250,075.60	2.63

5	603338	浙江鼎力	478,600	28,917,012.00	2.36
6	600132	重庆啤酒	465,600	28,261,920.00	2.31
7	603345	安井食品	339,300	25,213,383.00	2.06
8	600009	上海机场	574,700	18,534,075.00	1.51
9	603596	伯特利	475,320	18,489,948.00	1.51
10	002352	顺丰控股	508,000	18,130,520.00	1.48
11	600941	中国移动	168,500	18,113,750.00	1.48
12	688050	爱博医疗	200,000	14,664,000.00	1.20
13	600763	通策医疗	254,100	13,734,105.00	1.12
14	600332	白云山	432,000	12,670,560.00	1.03
15	688777	中控技术	330,750	12,469,275.00	1.02
16	688005	容百科技	489,616	11,398,260.48	0.93
17	002153	石基信息	1,946,120	11,151,267.60	0.91
18	002410	广联达	1,107,600	10,610,808.00	0.87
19	300750	宁德时代	55,700	10,027,671.00	0.82
20	600570	恒生电子	477,964	8,440,844.24	0.69
21	001323	慕思股份	288,715	8,306,330.55	0.68
22	603659	璞泰来	577,600	8,161,488.00	0.67
23	002080	中材科技	618,900	7,983,810.00	0.65
24	002027	分众传媒	1,259,400	7,631,964.00	0.62
25	300413	芒果超媒	360,200	7,528,180.00	0.61
26	600309	万华化学	89,100	7,204,626.00	0.59
27	688800	瑞可达	195,885	5,500,450.80	0.45
28	003000	劲仔食品	428,600	5,164,630.00	0.42
29	688425	铁建重工	1,299,746	4,783,065.28	0.39
30	688271	联影医疗	42,817	4,697,024.90	0.38
31	688248	南网科技	156,389	4,633,806.07	0.38
32	688469	芯联集成	1,066,808	4,224,559.68	0.34
33	300454	深信服	80,100	4,047,453.00	0.33
34	688116	天奈科技	171,646	3,961,589.68	0.32
35	600886	国投电力	188,800	3,443,712.00	0.28

36	688733	壹石通	230,186	3,441,280.70	0.28
37	601766	中国中车	454,300	3,411,793.00	0.28
38	300866	安克创新	44,716	3,184,226.36	0.26
39	600025	华能水电	291,200	3,139,136.00	0.26
40	688315	诺禾致源	264,878	2,892,467.76	0.24
41	600019	宝钢股份	420,100	2,793,665.00	0.23
42	603799	华友钴业	125,050	2,767,356.50	0.23
43	688598	金博股份	91,854	2,599,468.20	0.21
44	688521	芯原股份	95,128	2,544,674.00	0.21
45	688536	思瑞浦	25,851	2,528,486.31	0.21
46	600741	华域汽车	154,100	2,524,158.00	0.21
47	002841	视源股份	84,200	2,486,426.00	0.20
48	603882	金域医学	87,600	2,381,844.00	0.19
49	601211	国泰君安	175,100	2,372,605.00	0.19
50	601688	华泰证券	183,700	2,276,043.00	0.19
51	688700	东威科技	81,630	2,139,522.30	0.17
52	000932	华菱钢铁	477,200	2,113,996.00	0.17
53	600779	水井坊	55,200	2,077,176.00	0.17
54	300760	迈瑞医疗	6,000	1,745,460.00	0.14
55	688608	恒玄科技	11,228	1,643,554.64	0.13
56	601600	中国铝业	213,300	1,627,479.00	0.13
57	601966	玲珑轮胎	83,700	1,537,569.00	0.13
58	003816	中国广核	327,100	1,514,473.00	0.12
59	601288	农业银行	347,200	1,513,792.00	0.12
60	601398	工商银行	261,100	1,488,270.00	0.12
61	601728	中国电信	241,100	1,482,765.00	0.12
62	000333	美的集团	22,900	1,477,050.00	0.12
63	601939	建设银行	197,300	1,460,020.00	0.12
64	600027	华电国际	206,800	1,435,192.00	0.12
65	000630	铜陵有色	381,700	1,377,937.00	0.11
66	688065	凯赛生物	30,033	1,363,197.87	0.11

67	600018	上港集团	234,100	1,353,098.00	0.11
68	688099	晶晨股份	21,444	1,272,058.08	0.10
69	600887	伊利股份	47,800	1,235,152.00	0.10
70	600153	建发股份	135,200	1,207,336.00	0.10
71	300003	乐普医疗	80,700	1,197,588.00	0.10
72	002609	捷顺科技	157,600	1,194,608.00	0.10
73	002557	洽洽食品	38,400	1,082,496.00	0.09
74	300788	中信出版	40,400	1,002,324.00	0.08
75	600176	中国巨石	88,600	979,030.00	0.08
76	600795	国电电力	159,300	954,207.00	0.08
77	688270	臻镭科技	32,365	844,726.50	0.07
78	688300	联瑞新材	15,930	766,233.00	0.06
79	601658	邮储银行	150,600	763,542.00	0.06
80	300628	亿联网络	20,500	753,785.00	0.06
81	600498	烽火通信	45,700	726,630.00	0.06
82	603160	汇顶科技	10,427	716,856.25	0.06
83	600690	海尔智家	25,000	709,500.00	0.06
84	603712	七一二	26,800	487,492.00	0.04
85	601012	隆基绿能	23,300	326,666.00	0.03
86	601636	旗滨集团	46,200	297,990.00	0.02
87	301589	诺瓦星云	1,244	233,884.44	0.02
88	002050	三花智控	11,900	227,052.00	0.02
89	688162	巨一科技	6,405	124,769.40	0.01
90	301591	肯特股份	2,184	88,113.42	0.01
91	688692	达梦数据	175	30,612.75	0.00
92	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.00
93	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.00
94	601033	永兴股份	1,258	20,077.68	0.00
95	688709	成都华微	1,045	19,635.55	0.00
96	301536	星辰科技	481	15,521.87	0.00
97	688584	上海合晶	866	13,760.74	0.00



98	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
99	301565	中仑新材	711	13,494.78	0.00
100	301580	爱迪特	202	13,317.86	0.00
101	603341	龙旗科技	298	11,172.02	0.00
102	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
103	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
104	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
105	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
106	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
107	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
108	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
109	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
110	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
111	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
112	603381	永臻股份	178	4,473.14	0.00
113	603344	星德胜	182	4,124.12	0.00
114	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
115	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
116	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
117	001379	腾达科技	213	2,871.24	0.00
118	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00
119	001387	雪祺电气	173	2,638.25	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	603345	安井食品	29,812,509.34	2.21
2	603338	浙江鼎力	21,494,584.00	1.59

3	002352	顺丰控股	18,914,064.61	1.40
4	688050	爱博医疗	18,225,295.79	1.35
5	600941	中国移动	16,034,678.00	1.19
6	603596	伯特利	15,627,326.42	1.16
7	600009	上海机场	14,575,695.20	1.08
8	002080	中材科技	11,688,104.00	0.87
9	003000	劲仔食品	10,397,048.00	0.77
10	601766	中国中车	10,323,292.00	0.76
11	300750	宁德时代	10,321,939.00	0.76
12	603659	璞泰来	9,829,790.55	0.73
13	002410	广联达	8,138,248.80	0.60
14	600795	国电电力	7,883,837.00	0.58
15	603565	中谷物流	7,783,743.12	0.58
16	688598	金博股份	7,262,774.02	0.54
17	001323	慕思股份	6,350,551.50	0.47
18	600176	中国巨石	5,108,201.00	0.38
19	600438	通威股份	4,627,531.00	0.34
20	688248	南网科技	4,551,863.06	0.34

#### 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	600276	恒瑞医药	42,677,103.36	3.16
2	002841	视源股份	31,042,398.00	2.30
3	002410	广联达	24,455,027.42	1.81
4	603799	华友钴业	22,327,485.10	1.65
5	601658	邮储银行	19,693,384.00	1.46
6	002415	海康威视	19,239,549.40	1.42
7	600690	海尔智家	17,424,802.00	1.29

8	002595	豪迈科技	14,638,694.00	1.08
9	601985	中国核电	13,682,316.00	1.01
10	000002	万科A	13,669,598.00	1.01
11	600176	中国巨石	10,180,884.14	0.75
12	300788	中信出版	9,346,246.00	0.69
13	300454	深信服	9,322,886.80	0.69
14	600795	国电电力	8,436,619.00	0.62
15	601766	中国中车	7,478,491.00	0.55
16	300369	绿盟科技	6,848,329.00	0.51
17	300866	安克创新	6,543,663.90	0.48
18	300413	芒果超媒	6,419,068.00	0.48
19	002241	歌尔股份	5,470,858.00	0.41
20	688608	恒玄科技	5,071,832.83	0.38

#### 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	350,544,558.28
卖出股票收入（成交）总额	377,561,743.79

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	30,609,207.65	2.50
	其中：政策性金融债	30,609,207.65	2.50
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)	286,419,580.31	23.38
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	317,028,787.96	25.88

### 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	110059	浦发转债	969,300	106,889,916.01	8.73
2	113044	大秦转债	399,910	48,095,214.50	3.93
3	113021	中信转债	390,000	46,079,782.19	3.76
4	113052	兴业转债	211,420	22,879,380.05	1.87
5	210406	21农发06	200,000	20,541,617.49	1.68

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

#### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内本基金投资的前十名证券除中信转债（证券代码：113021）、中谷物流（证券代码：603565）外，其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2023年12月29日，中信转债（证券代码：113021）发行人中信银行股份有限公司因部分重要信息系统应认定未认定、相关系统未建灾备或灾难恢复能力不符合监管要求、同城数据中心长期存在基础设施风险隐患未得到整改、对外包数据中心的准入前尽职调查和日常管理不符合监管要求、部分数据中心存在风险隐患等被国家金融监督管理总局罚款400万元。

2023年11月16日，中信转债（证券代码：113021）发行人中信银行股份有限公司因违反高管准入管理相关规定、关联贷款管理不合规、绩效考核不符合规定、重大关联交易信息披露不充分等被国家金融监督管理总局罚没合计22475.18万元。

2024年04月12日，中谷物流（证券代码：603565）发行人上海中谷物流股份有限公司因公司募集资金管理和使用不规范被上海证券交易所监管警示。

2024年02月03日，中谷物流（证券代码：603565）发行人上海中谷物流股份有限公司因实际用于暂时补充流动资金的金额超出董事会审批的暂时补流额度、将募集资金暂时补充流动资金后用于购买理财或结构性存款而未严格监管用于主营业务被中国证券监督管理委员会上海监管局出具警示函。

在上述公告公布后，本基金管理人对上述公司进行了进一步了解和视为，认为上述处罚不会对投资价值构成实质性负面影响，因此本基金管理人对上述公司的投资判断未发生改变。本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合本基金管理人投资管理制度的规定。

7.12.2 基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

## 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	97,104.57
2	应收清算款	2,853,048.24
3	应收股利	-
4	应收利息	-

5	应收申购款	73,455.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,023,608.79

**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	110059	浦发转债	106,889,916.01	8.73
2	113044	大秦转债	48,095,214.50	3.93
3	113021	中信转债	46,079,782.19	3.76
4	113052	兴业转债	22,879,380.05	1.87
5	113641	华友转债	19,278,732.60	1.57
6	118022	锂科转债	15,469,537.62	1.26
7	123064	万孚转债	14,289,101.37	1.17
8	127032	苏行转债	7,542,180.82	0.62
9	127088	赫达转债	4,372,031.26	0.36
10	132026	G三峡EB2	1,523,703.89	0.12

**7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

**7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能存在尾差。

**§8 基金份额持有人信息**

**8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

份额	持	户均持有的	持有人结构
----	---	-------	-------

级别	有人户数 (户)	基金份额	机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
泓德致远混合A	51,263	12,890.81	29,941,377.56	4.53%	630,880,215.14	95.47%
泓德致远混合C	12,003	8,850.12	947,633.85	0.89%	105,280,409.17	99.11%
合计	62,705	12,232.67	30,889,011.41	4.03%	736,160,624.31	95.97%

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

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	泓德致远混合A	11,246.98	0.00%
	泓德致远混合C	11,512.95	0.01%
	合计	22,759.93	0.00%

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

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资	泓德致远混合A	0

和研究部门负责人持有本开放式基金	泓德致远混合C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	泓德致远混合A	0
	泓德致远混合C	0
	合计	0

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

	泓德致远混合A	泓德致远混合C
基金合同生效日(2017年08月30日)基金份额总额	285,632,769.76	208,201,757.28
本报告期期初基金份额总额	703,771,019.32	115,446,190.16
本报告期基金总申购份额	27,732,482.60	1,250,841.44
减：本报告期基金总赎回份额	70,681,909.22	10,468,988.58
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	660,821,592.70	106,228,043.02

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

本报告期基金管理人无重大人事变动。

#### (2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

### 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，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	2	160,752,906.32	22.14%	118,298.83	22.14%	-
广发证券	2	158,440,370.58	21.82%	116,593.88	21.82%	-
长江证券	2	115,701,041.03	15.93%	85,145.08	15.93%	-
东吴证券	2	79,424,818.45	10.94%	58,448.55	10.94%	-
国信证券	2	78,031,828.56	10.75%	57,424.66	10.75%	-

中银国际证券	2	52,399,347.06	7.22%	38,560.00	7.22%	-
首创证券	2	56,783,533.48	7.82%	41,785.52	7.82%	-
中泰证券	2	24,581,989.10	3.39%	18,090.47	3.39%	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
东亚前海证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
太平	2	-	-	-	-	-

洋证 券						
天风 证券	2	-	-	-	-	-
西南 证券	2	-	-	-	-	-
兴业 证券	2	-	-	-	-	-
中国 中金 财富 证券	2	-	-	-	-	-
中信 建投 证券	2	-	-	-	-	-
华安 证券	2	-	-	-	-	-
方正 证券	2	-	-	-	-	-
信达 证券	2	-	-	-	-	-

注：1、基金专用交易单元的选择标准如下：

- （1）该证券机构经营行为规范，内控制度健全；
- （2）财务状况良好，公司经营状况稳定；
- （3）具有基金投资运作所需的证券服务能力和水平。

2、基金专用交易单元的选择程序如下：

- （1）本基金管理人根据上述标准考察后选定证券经营机构；
- （2）基金管理人和被选中的证券经营机构签订协议。

3、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：东吴证券、东北证券、恒泰证券。
- （2）本基金报告期内停止租用交易单元：信达证券、中泰证券、方正证券、华安证券。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
中信证券	141,022,061.55	55.72%	160,000,000.00	44.44%	-	-	-	-
广发证券	12,277,514.05	4.85%	-	-	-	-	-	-
长江证券	9,166,828.97	3.62%	-	-	-	-	-	-
东吴证券	36,347,817.21	14.36%	-	-	-	-	-	-
国信证券	16,715,077.77	6.60%	200,000,000.00	55.56%	-	-	-	-
中银国际证券	23,906,509.36	9.45%	-	-	-	-	-	-
首创证券	7,780,627.80	3.07%	-	-	-	-	-	-
中泰证券	5,890,301.16	2.33%	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东亚前海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中国中金财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-

信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---	---	---

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海大智慧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	2024-01-11

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期间无单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准泓德致远混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《泓德致远混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《泓德致远混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《泓德致远混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在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  
二〇二四年八月二十九日