

泓德慧享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:中国邮政储蓄银行股份有限公司

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。

基金托管人中国邮政储蓄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	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
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	14
§5 托管人报告	14
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	18
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53
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	53
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	54
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	54
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	54
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
7.12 投资组合报告附注	54
§8 基金份额持有人信息	57
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	57

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	58
§9 开放式基金份额变动	58
§10 重大事件揭示	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	59
10.4 基金投资策略的改变	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	59
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	60
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	62
§12 备查文件目录	62
12.1 备查文件目录	62
12.2 存放地点	62
12.3 查阅方式	62

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泓德慧享混合型证券投资基金	
基金简称	泓德慧享混合	
基金主代码	011781	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021年09月06日	
基金管理人	泓德基金管理有限公司	
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	250,848,356.90份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	泓德慧享混合A	泓德慧享混合C
下属分级基金的交易代码	011781	011782
报告期末下属分级基金的份额总额	250,751,260.39份	97,096.51份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，通过合理的资产配置，综合运用多种投资策略，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金通过分析宏观经济和资本市场发展趋势，评估各类资产的预期收益与风险，合理确定本基金在股票、债券等各类别资产上的投资比例并适时做出动态调整。本基金股票投资从基本面分析入手，根据个股的估值水平优选个股。债券投资采取适当的久期配置策略、个券选择策略、信用债投资策略、可转换债券投资策略、可交换债券投资策略、证券公司短期公司债券投资策略、资产支持证券投资策略相结合的方法。本基金本着谨慎原则，从风险管理角度出发，适度参与股指期货、国债期货投资。
业绩比较基准	中证800指数收益率×10%+中证港股通综合指数收益率×5%+中国债券综合全价指数收益率×85%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其长期预期风险与预期收

	<p>益低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。</p> <p>本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港证券市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、投资于香港证券市场的风险、以及通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险等特有风险。</p>
--	--

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	中国邮政储蓄银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李晓春	张立学
	联系电话	010-59850177	010-68858113
	电子邮箱	lixiaochun@hongdefund.com	zhanglixue@psbcoa.com.cn
客户服务电话		4009-100-888	95580
传真		010-59850195	010-68858120
注册地址		西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦1206室	北京市西城区金融大街3号
办公地址		北京市西城区德胜门外大街125号	北京市西城区金融大街3号A座
邮政编码		100088	100808
法定代表人		王德晓	刘建军

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
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)	
	泓德慧享混合A	泓德慧享混合C
本期已实现收益	-22,018,855.21	-9,674.05
本期利润	-7,495,768.51	-3,654.70
加权平均基金份额本期利润	-0.0299	-0.0364
本期加权平均净值利润率	-3.39%	-4.12%
本期基金份额净值增长率	-3.26%	-3.45%
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	-28,972,972.68	-11,170.54
期末可供分配基金份额利润	-0.1155	-0.1150
期末基金资产净值	222,550,789.34	86,183.02
期末基金份额净值	0.8875	0.8876
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	-11.25%	-11.24%

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

泓德慧享混合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	-0.88%	0.29%	0.04%	0.08%	-0.92%	0.21%
过去三个月	0.52%	0.32%	0.99%	0.11%	-0.47%	0.21%
过去六个月	-3.26%	0.64%	2.29%	0.14%	-5.55%	0.50%
过去一年	-5.58%	0.49%	1.33%	0.14%	-6.91%	0.35%
自基金合同生效起至今	-11.25%	0.39%	0.12%	0.16%	-11.37%	0.23%

泓德慧享混合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	-0.90%	0.29%	0.04%	0.08%	-0.94%	0.21%
过去三个月	0.42%	0.32%	0.99%	0.11%	-0.57%	0.21%
过去六个月	-3.45%	0.64%	2.29%	0.14%	-5.74%	0.50%
过去一年	-5.94%	0.49%	1.33%	0.14%	-7.27%	0.35%
自基金合同生效起至今	-11.24%	0.39%	0.12%	0.16%	-11.36%	0.23%

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

本基金的业绩比较基准为：中证800指数收益率*10%+中证港股通综合指数收益率*5%+中国债券综合全价指数收益率*85%

基准指数的构建原则如下：

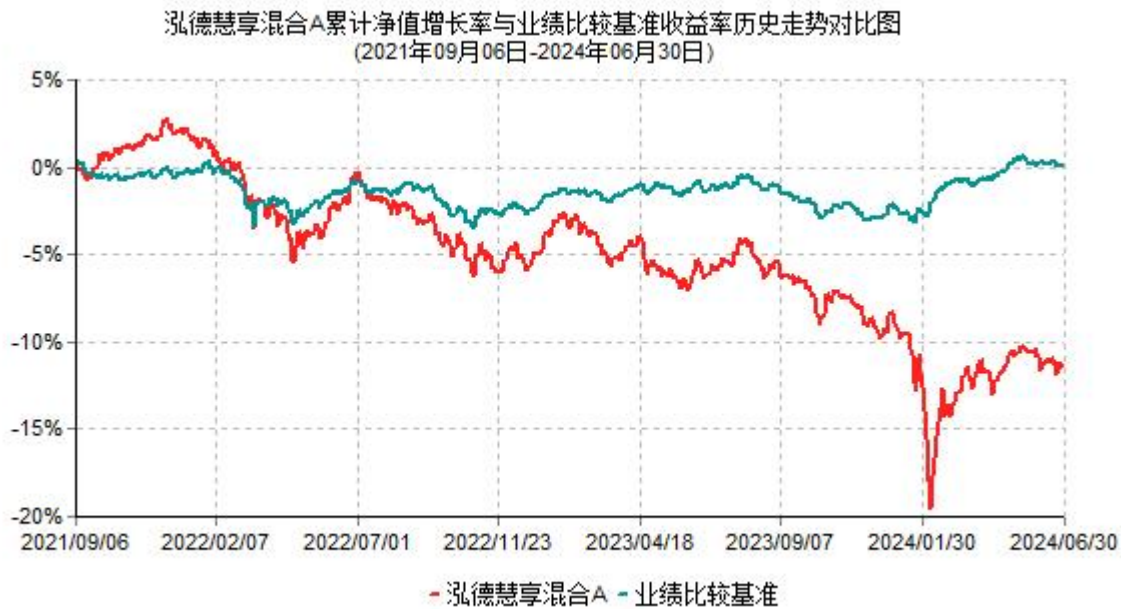
(1) 中证800指数是由中证指数有限公司编制的，其成份股是由沪深300指数和中证500指数成份股一起构成，中证800指数综合反映沪深股票市场内大中小市值公司的整体状况，较好地反映了A股市场的总体趋势。

(2) 中证港股通综合指数是由中证指数有限公司编制，选取符合港股通资格的普通股作为样本股，采用自由流通市值加权计算，是反映港股通范围内上市公司的整体状况和走势的具有代表性的一种股价指数。

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

(4) 由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照10%、5%、85%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变动的比较



泓德慧享混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2021年09月06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	证券	说明
----	----	--------	----	----

		金经理（助理） 期限		从业 年限	
		任职 日期	离任 日期		
赵端端	本基金的基金经理	2021-09-06	-	10年	硕士研究生，具有基金从业资格，资管行业从业经验18年，曾任天安财产保险股份有限公司资产管理中心固定收益部资深投资经理，阳光资产管理股份有限公司固定收益投资部高级投资经理，嘉实基金管理有限公司机构业务部产品经理。
姚学康	本基金的基金经理	2022-03-24	-	10年	硕士研究生，具有基金从业资格，资管行业从业经验13年，曾任华夏久盈资产管理有限责任公司固定收益投资中心投资经理，安信证券研究中心宏观分析师。

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

上半年债券市场趋势走牛。房地产销售持续走低、地方债务得到管控，这两大高杠杆部门的融资需求持续萎缩，应当是过去两年、预计也是未来一段时间内，债市基础配置力量的关键来源。CPI和PPI的持续弱势，也引发了大家的高度关注和警惕，并增强了债市的做多趋势。

上半年，权益市场波动较大、板块和风格显著分化。居民部门的持续去杠杆，可能是权益市场缺乏稳定性的重要背景。年初在风格切换背景下，中小盘市场剧烈动荡。春节之后行情修复。但5月底以来再度趋弱，特别是上市公司年报发布后，投资者对大规模退市的忧虑也加剧了市场的波动。决策层面喊话沟通后，市场情绪有所缓和。

经济层面，从高频数据看，年初动能是有所回暖的，这可能与外需的牵引有关联。中央经济工作会议以及两会的偏积极定调可能也对原材料存货行为产生了正向的扰动。进入第二季度，尽管专项债资金扩容、特别国债支持两重建设、设备更新、消费品以旧换新、517地产新政等系列政策轮番上场，但受制于项目匹配难度较大、地方财力紧张，各类政策落地节奏总体是偏慢的，最终经济活动未能延续回暖势头，第二季度GDP同比录得4.7%，较第一季度的5.3%回落了0.6个百分点，各方面预期转弱。

上半年慧享在纯债策略层面，维持了偏高的久期。权益仓位年初仓位较高，对组合形成了拖累，而后仓位控制在较低水平上。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末泓德慧享混合A基金份额净值为0.8875元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-3.26%，同期业绩比较基准收益率为2.29%；截至报告期末泓德慧享混

合C基金份额净值为0.8876元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-3.45%，同期业绩比较基准收益率为2.29%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

7月中旬二十届三中全会召开，会议通过了《中共中央关于进一步全面深化改革、推进中国式现代化的决定》。7月底，第二季度政治局会议召开，要求“坚定不移完成全年经济社会发展目标任务”。这些重磅会议预计能够对各方面预期起到积极的提振。

后续需要紧密跟踪现有政策的落地进展，观察这些政策能否扭转当前总需求偏弱、物价偏低的局面。在经济动能实质性改观之前，宽松货币政策和资金充裕预计还会维持。

下半年，产品在纯债层面维持偏高的久期，可能是有益的；含权类资产波动较大，在策略性价比的对比上要保持紧密的跟踪，在权益类总仓位的调节上，也要保持适度的灵活。

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-28,984,143.22元,其中:泓德慧享混合A期末可供分配利润为-28,972,972.68元(泓德慧享混合A的未分配利润已实现部

分为-28,972,972.68元，未分配利润未实现部分为772,501.63元），泓德慧享混合C期末可供分配利润为-11,170.54元（泓德慧享混合C的未分配利润已实现部分为-11,170.54元，未分配利润未实现部分为257.05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

本报告期内，中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在泓德慧享混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内，本基金未进行利润分配。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据真实、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：泓德慧享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
资产：			

货币资金	6.4.7.1	946,581.18	1,283,948.92
结算备付金		1,241,434.82	6,630.20
存出保证金		46,882.29	7,117.87
交易性金融资产	6.4.7.2	248,555,638.58	261,536,676.91
其中：股票投资		31,720,902.77	57,931,168.13
基金投资		-	-
债券投资		216,834,735.81	203,605,508.78
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	1,800,000.00	-
应收清算款		329,267.35	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	22.03
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		252,919,804.22	262,834,395.93
负债和净资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		29,506,584.48	32,214,838.44
应付清算款		451,421.31	-
应付赎回款		88.80	4,950.18
应付管理人报酬		146,188.21	155,262.42
应付托管费		36,547.06	38,815.59
应付销售服务费		27.69	36.89

应付投资顾问费		-	-
应交税费		3,464.86	3,962.98
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	138,509.45	187,324.61
负债合计		30,282,831.86	32,605,191.11
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	250,848,356.90	250,952,420.69
未分配利润	6.4.7.8	-28,211,384.54	-20,723,215.87
净资产合计		222,636,972.36	230,229,204.82
负债和净资产总计		252,919,804.22	262,834,395.93

注：报告截止日2024年06月30日，基金份额总额250,848,356.90份，其中A类基金份额总额为250,751,260.39份，基金份额净值为0.8875元；C类基金份额总额为97,096.51份，基金份额净值为0.8876元。

6.2 利润表

会计主体：泓德慧享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2023年06月30日
一、营业总收入		-6,007,563.49	5,068,757.40
1.利息收入		31,106.21	118,384.95
其中：存款利息收入	6.4.7.9	17,341.66	33,291.88
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		13,764.55	85,093.07
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”		-20,567,823.41	-2,171,847.91

填列)			
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-24,984,486.98	-2,328,011.53
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	4,250,281.56	-242,252.36
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	166,382.01	398,415.98
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	14,529,106.05	6,556,611.60
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	47.66	565,608.76
减：二、营业总支出		1,491,859.72	2,383,043.92
1.管理人报酬		877,862.70	1,304,436.07
2.托管费		219,465.62	326,109.00
3.销售服务费		176.06	356.68
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		283,215.71	627,043.91
其中：卖出回购金融资产 支出		283,215.71	627,043.91
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		3,032.03	7,319.31
8.其他费用	6.4.7.16	108,107.60	117,778.95
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		-7,499,423.21	2,685,713.48
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”		-7,499,423.21	2,685,713.48

号填列)			
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-7,499,423.21	2,685,713.48

6.3 净资产变动表

会计主体：泓德慧享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	250,952,420.69	-20,723,215.87	230,229,204.82
二、本期期初净资产	250,952,420.69	-20,723,215.87	230,229,204.82
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-104,063.79	-7,488,168.67	-7,592,232.46
（一）、综合收益总额	-	-7,499,423.21	-7,499,423.21
（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）	-104,063.79	11,254.54	-92,809.25
其中：1.基金申购款	67,953.54	-8,325.39	59,628.15
2.基金赎回款	-172,017.33	19,579.93	-152,437.40
（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	250,848,356.90	-28,211,384.54	222,636,972.36
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	622,845,799.02	-30,597,089.63	592,248,709.39
二、本期期初净资产	622,845,799.02	-30,597,089.63	592,248,709.39
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-371,858,917.12	15,501,180.47	-356,357,736.65
（一）、综合收益总额	-	2,685,713.48	2,685,713.48
（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）	-371,858,917.12	12,815,466.99	-359,043,450.13
其中：1.基金申购款	302,408.35	-12,275.34	290,133.01
2.基金赎回款	-372,161,325.47	12,827,742.33	-359,333,583.14
（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	250,986,881.90	-15,095,909.16	235,890,972.74

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

泓德慧享混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2021]650号《关于准予泓德慧享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《泓德慧享混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式。存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集300,077,398.23元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2021)第0887号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泓德慧享混合型证券投资基金基金合同》于2021年9月6日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为300,096,852.37份，其中认购资金利息折合19,454.14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，基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

根据《泓德慧享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《泓德慧享混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、港股通机制下允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券、证券公司短期公司债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为0%-30%，其中投资于港股通标的股票占股票资产的比例不超过50%，投资于同业存单的比例不超过基金资产的20%，投资于可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券的比例不得超过基金资产的20%。每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳

的交易保证金后，持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证800指数收益率×10%+中证港股通综合指数收益率×5%+中国债券综合全价指数收益率×85%。

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》、《泓德慧享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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税

[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

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

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。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。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 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	946,581.18
等于：本金	946,414.24
加：应计利息	166.94
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	946,581.18

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	34,000,266.63	-	31,720,902.77	-2,279,363.86	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	91,088,027.55	666,725.32	92,627,990.77	873,237.90
	银行间市场	121,022,382.00	1,438,745.04	124,206,745.04	1,745,618.00
	合计	212,110,409.55	2,105,470.36	216,834,735.81	2,618,855.90
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	

其他	-	-	-	-
合计	246,110,676.18	2,105,470.36	248,555,638.58	339,492.04

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

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	1,800,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	1,800,000.00	-

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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	49,001.85
其中：交易所市场	46,038.80
银行间市场	2,963.05
应付利息	-

预提费用	89,507.60
合计	138,509.45

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 泓德慧享混合A

金额单位：人民币元

项目 (泓德慧享混合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	250,834,512.93	250,834,512.93
本期申购	14,124.53	14,124.53
本期赎回（以“-”号填列）	-97,377.07	-97,377.07
本期末	250,751,260.39	250,751,260.39

6.4.7.7.2 泓德慧享混合C

金额单位：人民币元

项目 (泓德慧享混合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	117,907.76	117,907.76
本期申购	53,829.01	53,829.01
本期赎回（以“-”号填列）	-74,640.26	-74,640.26
本期末	97,096.51	97,096.51

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 泓德慧享混合A

单位：人民币元

项目 (泓德慧享混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-6,963,991.71	-13,749,714.51	-20,713,706.22
本期期初	-6,963,991.71	-13,749,714.51	-20,713,706.22

本期利润	-22,018,855.21	14,523,086.70	-7,495,768.51
本期基金份额交易产生的变动数	9,874.24	-870.56	9,003.68
其中：基金申购款	-1,685.34	-284.73	-1,970.07
基金赎回款	11,559.58	-585.83	10,973.75
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-28,972,972.68	772,501.63	-28,200,471.05

6.4.7.8.2 泓德慧享混合C

单位：人民币元

项目 (泓德慧享混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-2,988.81	-6,520.84	-9,509.65
本期期初	-2,988.81	-6,520.84	-9,509.65
本期利润	-9,674.05	6,019.35	-3,654.70
本期基金份额交易产生的变动数	1,492.32	758.54	2,250.86
其中：基金申购款	-5,969.04	-386.28	-6,355.32
基金赎回款	7,461.36	1,144.82	8,606.18
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-11,170.54	257.05	-10,913.49

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	4,421.78
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	12,680.70
其他	239.18
合计	17,341.66

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	148,862,870.63
减：卖出股票成本总额	173,546,061.78
减：交易费用	301,295.83
买卖股票差价收入	-24,984,486.98

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	2,876,216.25
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,374,065.31
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	4,250,281.56

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	71,554,232.67
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	69,463,049.20

减：应计利息总额	713,753.35
减：交易费用	3,364.81
买卖债券差价收入	1,374,065.31

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	166,382.01
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	166,382.01

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	14,529,106.05
——股票投资	12,624,804.96
——债券投资	1,904,301.09
——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	14,529,106.05
----	---------------

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	47.66
合计	47.66

注：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。

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	29,835.26
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	108,107.60

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
中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下简称“中国邮政储蓄银行”）	基金托管人

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	877,862.70	1,304,436.07
其中：应支付销售机构的客户维护费	445.15	568.29
应支付基金管理人的净管理费	877,417.55	1,303,867.78

注：支付基金管理人泓德基金的管理人报酬按前一日基金资产净值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 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	219,465.62	326,109.00

注：支付基金托管人中国邮政储蓄银行的托管费按前一日基金资产净值0.20%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：
日托管费=前一日基金资产净值×0.20%/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		
	泓德慧享混合A	泓德慧享混合C	合计
泓德基金	0.00	8.06	8.06
合计	0.00	8.06	8.06
获得销售服务费的各关联方名称	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销售服务费		
	泓德慧享混合A	泓德慧享混合C	合计
泓德基金	0.00	8.84	8.84
合计	0.00	8.84	8.84

注：支付基金销售机构的C类基金份额销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值0.40%的年费率每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付给泓德基金，再由泓德基金计算并支付给各基金销售机构。A类基金份额不收取销售服务费。其计算公式为：
日销售服务费=前一日C类基金份额基金资产净值×0.40%/当年天数。

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

泓德慧享混合A

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024年06月30日		上年度末 2023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
自然人股东	100.00	0.00%	100.00	0.00%

注：本报告期末，自然人股东持有本基金份额占总份额的比例为0.00004%（上年度末：同）

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
中国邮政储蓄银行	946,581.18	4,421.78	886,529.98	15,170.62

注：本基金的银行存款由基金托管人中国邮政储蓄银行保管，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

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

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

截至本报告期末2024年6月30日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额10,506,584.48元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
240205	24国开05	2024-07-04	103.94	109,000	11,329,188.99
合计				109,000	11,329,188.99

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2024年6月30日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额19,000,000.00元，于2024年7月1日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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。

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	13,202,995.89	13,068,027.40
合计	13,202,995.89	13,068,027.40

注：于2024年06月30日，未评级部分为国债（2023年12月31日，同）。债券信用评级取自第三方评级机构。

6.4.13.2.2 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	136,020,141.63	154,278,678.09
AAA以下	15,877,162.01	5,824,754.55
未评级	51,734,436.28	30,434,048.74
合计	203,631,739.92	190,537,481.38

注：于2024年6月30日，未评级部分为公司债、国债和政策性金融债（2023年12月31日：未评级部分为公司债和国债）。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，除附注6.4.12.3中列示的卖出回购金融资产款余额将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同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，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

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

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。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	946,581.18	-	-	-	946,581.18
结算备付金	1,241,434.82	-	-	-	1,241,434.82
存出保证金	46,882.29	-	-	-	46,882.29
交易性金融资产	86,809,289.71	107,848,044.42	22,177,401.68	31,720,902.77	248,555,638.58
买入返售金融资产	1,800,000.00	-	-	-	1,800,000.00
应收清算款	-	-	-	329,267.35	329,267.35
资产总计	90,844,188.00	107,848,044.42	22,177,401.68	32,050,170.12	252,919,804.22
负债					
卖出回购金融资产款	29,506,584.48	-	-	-	29,506,584.48
应付清算款	-	-	-	451,421.31	451,421.31

应付赎回款	-	-	-	88.80	88.80
应付管理人报酬	-	-	-	146,188.21	146,188.21
应付托管费	-	-	-	36,547.06	36,547.06
应付销售服务费	-	-	-	27.69	27.69
应交税费	-	-	-	3,464.86	3,464.86
其他负债	-	-	-	138,509.45	138,509.45
负债总计	29,506,584.48	-	-	776,247.38	30,282,831.86
利率敏感度缺口	61,337,603.52	107,848,044.42	22,177,401.68	31,273,922.74	222,636,972.36
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	1,283,948.92	-	-	-	1,283,948.92
结算备付金	6,630.20	-	-	-	6,630.20
存出保证金	7,117.87	-	-	-	7,117.87
交易性金融资产	13,068,027.40	188,815,192.83	1,722,288.55	57,931,168.13	261,536,676.91
应收申购款	-	-	-	22.03	22.03

资产总计	14,365,724.39	188,815,192.83	1,722,288.55	57,931,190.16	262,834,395.93
负债					
卖出回购金融资产款	32,214,838.44	-	-	-	32,214,838.44
应付赎回款	-	-	-	4,950.18	4,950.18
应付管理人报酬	-	-	-	155,262.42	155,262.42
应付托管费	-	-	-	38,815.59	38,815.59
应付销售服务费	-	-	-	36.89	36.89
应交税费	-	-	-	3,962.98	3,962.98
其他负债	-	-	-	187,324.61	187,324.61
负债总计	32,214,838.44	-	-	390,352.67	32,605,191.11
利率敏感度缺口	-17,849,114.05	188,815,192.83	1,722,288.55	57,540,837.49	230,229,204.82

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	1,382,092.63	1,113,631.24
		市场利率上升25个基点	-1,362,557.68	-1,102,816.07

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	31,720,902.77	14.25	57,931,168.13	25.16
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	31,720,902.77	14.25	57,931,168.13	25.16

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%	-	21,659,503.11
	业绩比较基准下降5%	-	-21,659,503.11

注：于本报告期期末，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为14.25%，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

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	70,443,924.49	94,275,907.98
第二层次	178,111,714.09	167,260,768.93

第三层次	-	-
合计	248,555,638.58	261,536,676.91

6.4.14.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于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	31,720,902.77	12.54
	其中：股票	31,720,902.77	12.54
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	216,834,735.81	85.73
	其中：债券	216,834,735.81	85.73
	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	1,800,000.00	0.71
	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	2,188,016.00	0.87
8	其他各项资产	376,149.64	0.15
9	合计	252,919,804.22	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	23,937,174.91	10.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	128,719.00	0.06
E	建筑业	1,208,353.00	0.54
F	批发和零售业	1,137,406.00	0.51
G	交通运输、仓储和邮政业	287,018.00	0.13
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,024,894.27	0.91
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,028,641.00	0.46
N	水利、环境和公共设施管理业	1,968,696.59	0.88
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-

S	综合	-	-
	合计	31,720,902.77	14.25

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通机制投资的港股。

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	301105	鸿铭股份	12,100	302,379.00	0.14
2	300948	冠中生态	33,100	292,935.00	0.13
3	688013	天臣医疗	19,299	286,397.16	0.13
4	301279	金道科技	8,800	214,544.00	0.10
5	301359	东南电子	8,645	210,938.00	0.09
6	300717	华信新材	11,900	204,561.00	0.09
7	002857	三晖电气	14,300	197,197.00	0.09
8	301192	泰祥股份	11,000	189,860.00	0.09
9	300517	海波重科	21,700	185,969.00	0.08
10	688115	思林杰	7,849	185,079.42	0.08
11	300645	正元智慧	14,200	179,346.00	0.08
12	688307	中润光学	8,591	177,747.79	0.08
13	301390	经纬股份	5,300	175,642.00	0.08
14	300889	爱克股份	15,600	175,032.00	0.08
15	300816	艾可蓝	7,500	174,750.00	0.08
16	001336	楚环科技	7,900	172,615.00	0.08
17	300689	澄天伟业	11,900	170,170.00	0.08
18	688681	科汇股份	16,580	169,281.80	0.08
19	301197	工大科雅	12,900	169,248.00	0.08
20	301178	天亿马	8,200	169,166.00	0.08
21	300906	日月明	8,100	167,913.00	0.08

22	301055	张小泉	14,100	167,226.00	0.08
23	300907	康平科技	8,800	167,112.00	0.08
24	688613	奥精医疗	13,124	167,068.52	0.08
25	301053	远信工业	8,300	165,668.00	0.07
26	300980	祥源新材	10,500	165,480.00	0.07
27	301287	康力源	6,200	165,230.00	0.07
28	300865	大宏立	10,300	165,212.00	0.07
29	605287	德才股份	13,100	164,929.00	0.07
30	300399	天利科技	18,700	164,373.00	0.07
31	300984	金沃股份	7,400	164,206.00	0.07
32	001373	翔腾新材	6,400	163,776.00	0.07
33	300920	润阳科技	10,850	163,184.00	0.07
34	301107	瑜欣电子	6,500	163,150.00	0.07
35	301353	普莱得	6,500	163,085.00	0.07
36	003036	泰坦股份	20,400	162,996.00	0.07
37	300789	唐源电气	12,290	162,719.60	0.07
38	688203	海正生材	19,128	162,588.00	0.07
39	301131	聚赛龙	4,500	162,585.00	0.07
40	301237	和顺科技	7,100	162,306.00	0.07
41	688616	西力科技	14,291	162,059.94	0.07
42	688501	青达环保	11,836	161,916.48	0.07
43	300876	蒙泰高新	9,400	161,492.00	0.07
44	301226	祥明智能	9,700	161,408.00	0.07
45	300845	捷安高科	14,850	160,825.50	0.07
46	300971	博亚精工	8,600	160,562.00	0.07
47	688355	明志科技	11,954	160,422.68	0.07
48	001234	泰慕士	9,400	159,706.00	0.07
49	301079	邵阳液压	12,500	159,500.00	0.07
50	300804	广康生化	7,300	159,140.00	0.07
51	300626	华瑞股份	21,200	158,788.00	0.07
52	688420	美腾科技	7,676	158,739.68	0.07

53	301001	凯淳股份	9,000	158,670.00	0.07
54	688078	龙软科技	6,882	158,492.46	0.07
55	605155	西大门	17,280	158,112.00	0.07
56	002802	洪汇新材	17,800	158,064.00	0.07
57	688291	金橙子	9,167	157,855.74	0.07
58	301300	远翔新材	7,200	157,752.00	0.07
59	688528	秦川物联	19,604	156,635.96	0.07
60	688056	莱伯泰科	7,056	156,360.96	0.07
61	603079	圣达生物	15,500	155,620.00	0.07
62	688466	金科环境	13,033	155,353.36	0.07
63	003041	真爱美家	12,700	155,067.00	0.07
64	688215	瑞晟智能	6,569	154,962.71	0.07
65	688026	洁特生物	15,550	154,878.00	0.07
66	301023	江南奕帆	5,100	154,785.00	0.07
67	301130	西点药业	6,600	154,638.00	0.07
68	301006	迈拓股份	13,200	154,308.00	0.07
69	301027	华蓝集团	17,400	153,816.00	0.07
70	605122	四方新材	15,800	153,576.00	0.07
71	300649	杭州园林	14,700	153,321.00	0.07
72	301057	汇隆新材	13,400	153,296.00	0.07
73	600793	宜宾纸业	17,100	153,216.00	0.07
74	001259	利仁科技	7,100	153,147.00	0.07
75	301037	保立佳	17,280	153,100.80	0.07
76	688655	迅捷兴	14,561	152,890.50	0.07
77	603029	天鹅股份	11,000	152,790.00	0.07
78	605033	美邦股份	12,300	152,766.00	0.07
79	301163	宏德股份	7,500	152,400.00	0.07
80	002826	易明医药	19,200	152,256.00	0.07
81	688671	碧兴物联	7,334	152,033.82	0.07
82	003023	彩虹集团	9,500	151,525.00	0.07
83	300675	建科院	13,500	151,200.00	0.07

84	301081	严牌股份	20,100	150,750.00	0.07
85	301198	喜悦智行	18,800	150,588.00	0.07
86	300535	达威股份	12,700	149,860.00	0.07
87	300923	研奥股份	8,800	149,600.00	0.07
88	003017	大洋生物	9,200	149,592.00	0.07
89	002963	豪尔赛	14,600	149,358.00	0.07
90	605298	必得科技	17,970	149,151.00	0.07
91	301063	海锅股份	10,400	149,136.00	0.07
92	600148	长春一东	12,500	148,750.00	0.07
93	688129	东来技术	11,904	148,680.96	0.07
94	688597	煜邦电力	21,349	148,589.04	0.07
95	002830	名雕股份	15,100	148,584.00	0.07
96	301010	晶雪节能	12,900	148,479.00	0.07
97	300823	建科智能	12,200	148,230.00	0.07
98	688638	誉辰智能	4,747	148,153.87	0.07
99	301043	绿岛风	6,200	147,994.00	0.07
100	300611	美力科技	19,400	147,828.00	0.07
101	300960	通业科技	9,800	147,686.00	0.07
102	300605	恒锋信息	16,300	147,678.00	0.07
103	605003	众望布艺	9,200	147,660.00	0.07
104	300509	新美星	31,500	147,420.00	0.07
105	688069	德林海	10,944	147,087.36	0.07
106	300753	爱朋医疗	13,400	146,730.00	0.07
107	003003	天元股份	18,400	146,648.00	0.07
108	605255	天普股份	12,200	146,644.00	0.07
109	300371	汇中股份	17,500	146,475.00	0.07
110	301032	新柴股份	21,800	146,278.00	0.07
111	300886	华业香料	8,900	146,138.00	0.07
112	688557	兰剑智能	6,304	146,126.72	0.07
113	300961	深水海纳	18,700	145,860.00	0.07
114	002809	红墙股份	20,300	145,551.00	0.07

115	300703	创源股份	18,000	145,440.00	0.07
116	688511	天微电子	6,679	145,401.83	0.07
117	002144	宏达高科	17,300	145,320.00	0.07
118	688227	品高股份	11,995	145,259.45	0.07
119	301234	五洲医疗	6,700	145,055.00	0.07
120	001231	农心科技	10,300	144,921.00	0.07
121	688395	正弦电气	10,167	144,879.75	0.07
122	603073	彩蝶实业	10,000	144,600.00	0.06
123	603332	苏州龙杰	19,600	144,452.00	0.06
124	600128	苏豪弘业	22,600	143,962.00	0.06
125	001202	炬申股份	12,700	143,891.00	0.06
126	000985	大庆华科	11,400	143,640.00	0.06
127	300995	奇德新材	9,300	143,406.00	0.06
128	301113	雅艺科技	7,200	143,208.00	0.06
129	301118	恒光股份	9,600	143,136.00	0.06
130	002357	富临运业	27,900	143,127.00	0.06
131	600272	开开实业	16,600	142,760.00	0.06
132	300746	汉嘉设计	22,700	142,556.00	0.06
133	600099	林海股份	20,700	142,416.00	0.06
134	688379	华光新材	10,378	142,282.38	0.06
135	603214	爱婴室	12,600	142,254.00	0.06
136	003011	海象新材	10,600	142,146.00	0.06
137	001260	坤泰股份	10,200	142,086.00	0.06
138	002715	登云股份	12,000	142,080.00	0.06
139	688350	富淼科技	12,450	142,054.50	0.06
140	300992	泰福泵业	9,000	142,020.00	0.06
141	603937	丽岛新材	18,300	142,008.00	0.06
142	300621	维业股份	19,100	141,913.00	0.06
143	300651	金陵体育	11,700	141,804.00	0.06
144	002780	三夫户外	15,700	141,771.00	0.06
145	688448	磁谷科技	7,500	141,600.00	0.06

145	002883	中设股份	16,000	141,600.00	0.06
147	300246	宝莱特	23,400	141,570.00	0.06
148	301065	本立科技	8,900	141,510.00	0.06
149	688669	聚石化学	12,472	141,183.04	0.06
150	688156	路德环境	10,670	141,164.10	0.06
151	002209	达意隆	18,500	141,155.00	0.06
152	688314	康拓医疗	7,494	141,037.08	0.06
153	688058	宝兰德	6,756	140,727.48	0.06
154	301022	海泰科	7,100	140,225.00	0.06
155	600857	宁波中百	24,800	140,120.00	0.06
156	605189	富春染织	13,100	139,646.00	0.06
157	300899	上海凯鑫	7,500	139,350.00	0.06
158	688367	工大高科	11,418	139,299.60	0.06
159	688485	九州一轨	17,848	139,214.40	0.06
160	300614	百川畅银	15,300	139,077.00	0.06
161	002853	皮阿诺	18,700	138,941.00	0.06
162	301336	趣睡科技	4,700	138,744.00	0.06
163	002921	联诚精密	13,800	138,138.00	0.06
164	603637	镇海股份	22,600	137,860.00	0.06
165	002718	友邦吊顶	13,200	137,808.00	0.06
166	600689	上海三毛	20,400	137,700.00	0.06
166	301066	万事利	17,000	137,700.00	0.06
168	600137	浪莎股份	11,600	137,692.00	0.06
169	688455	科捷智能	17,115	137,433.45	0.06
170	603045	福达合金	13,800	137,034.00	0.06
171	688163	赛伦生物	11,287	137,024.18	0.06
172	300955	嘉亨家化	10,800	136,836.00	0.06
173	301075	多瑞医药	8,600	136,740.00	0.06
174	603696	安记食品	20,100	136,278.00	0.06
175	688171	纬德信息	9,016	135,961.28	0.06
176	002890	弘宇股份	16,900	135,538.00	0.06

177	301167	建研设计	11,600	135,024.00	0.06
178	002760	凤形股份	10,200	134,640.00	0.06
179	300665	飞鹿股份	26,500	134,355.00	0.06
180	688296	和达科技	13,708	133,241.76	0.06
181	688393	安必平	8,666	132,849.78	0.06
182	000586	汇源通信	16,900	132,665.00	0.06
183	688178	万德斯	12,863	132,617.53	0.06
184	002910	庄园牧场	21,100	130,820.00	0.06
185	600051	宁波联合	24,700	130,169.00	0.06
186	603159	上海亚虹	12,500	130,125.00	0.06
187	688718	唯赛勃	15,171	129,712.05	0.06
188	688329	艾隆科技	8,713	129,475.18	0.06
189	300564	筑博设计	15,100	128,803.00	0.06
190	001210	金房能源	9,700	128,719.00	0.06
191	688607	康众医疗	10,346	128,497.32	0.06
192	688217	睿昂基因	6,458	127,480.92	0.06
193	002820	桂发祥	17,200	127,108.00	0.06
194	000590	启迪药业	24,100	127,007.00	0.06
195	301098	金埔园林	16,700	126,419.00	0.06
196	301273	瑞晨环保	8,100	126,117.00	0.06
197	603810	丰山集团	15,000	125,400.00	0.06
198	688096	京源环保	24,635	124,406.75	0.06
199	300838	浙江力诺	12,100	124,388.00	0.06
200	688251	井松智能	6,694	124,307.58	0.06
201	688659	元琛科技	20,495	122,970.00	0.06
202	300854	中兰环保	12,300	122,262.00	0.05
203	300929	华骐环保	16,700	122,244.00	0.05
204	688067	爱威科技	8,499	121,960.65	0.05
205	300749	顶固集创	22,600	119,780.00	0.05
206	688335	复洁环保	14,666	119,527.90	0.05
207	301040	中环海陆	11,800	116,938.00	0.05

208	688679	通源环境	16,779	116,781.84	0.05
209	688309	恒誉环保	9,434	113,113.66	0.05
210	688193	仁度生物	4,094	107,631.26	0.05
211	301125	腾亚精工	9,016	89,168.24	0.04

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	003003	天元股份	1,012,993.00	0.44
2	301022	海泰科	844,002.00	0.37
3	688013	天臣医疗	843,386.43	0.37
4	600793	宜宾纸业	789,089.00	0.34
5	002209	达意隆	735,338.00	0.32
6	300971	博亚精工	730,920.00	0.32
7	002780	三夫户外	713,340.00	0.31
8	002144	宏达高科	710,911.00	0.31
9	688217	睿昂基因	699,354.76	0.30
10	301001	凯淳股份	657,128.00	0.29
11	301163	宏德股份	656,740.00	0.29
12	688215	瑞晟智能	655,867.97	0.28
13	001210	金房能源	654,854.60	0.28
14	300106	西部牧业	653,296.00	0.28
15	301198	喜悦智行	644,845.63	0.28
16	002883	中设股份	643,885.00	0.28
17	688350	富淼科技	627,304.10	0.27
18	688393	安必平	623,057.13	0.27
19	603657	春光科技	609,939.00	0.26
20	688335	复洁环保	601,394.62	0.26

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	601966	玲珑轮胎	2,829,999.00	1.23
2	300059	东方财富	2,345,700.56	1.02
3	600309	万华化学	2,053,660.00	0.89
4	002142	宁波银行	2,009,789.22	0.87
5	002311	海大集团	1,858,744.66	0.81
6	688029	南微医学	1,812,917.87	0.79
7	603259	药明康德	1,807,999.00	0.79
8	600519	贵州茅台	1,765,380.00	0.77
9	600938	中国海油	1,735,268.44	0.75
10	605499	东鹏饮料	1,670,014.00	0.73
11	601100	恒立液压	1,646,468.00	0.72
12	600048	保利发展	1,523,522.00	0.66
13	300750	宁德时代	1,494,583.80	0.65
14	300760	迈瑞医疗	1,459,089.00	0.63
15	603596	伯特利	1,406,362.00	0.61
16	300782	卓胜微	1,236,864.00	0.54
17	300124	汇川技术	1,141,352.00	0.50
18	688777	中控技术	1,104,741.25	0.48
19	601021	春秋航空	1,085,085.00	0.47
20	002597	金禾实业	1,047,141.00	0.45

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	134,710,991.46
卖出股票收入（成交）总额	148,862,870.63

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	34,002,449.44	15.27
2	央行票据	-	-
3	金融债券	103,438,902.45	46.46
	其中：政策性金融债	20,787,502.73	9.34
4	企业债券	30,459,726.58	13.68
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	10,210,635.62	4.59
7	可转债(可交换债)	38,723,021.72	17.39
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	216,834,735.81	97.39

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	230021	23付息国债21	200,000	20,799,453.55	9.34
2	240205	24国开05	200,000	20,787,502.73	9.34
3	019709	23国债16	130,000	13,202,995.89	5.93
4	2028025	20浦发银行二级01	100,000	10,549,685.25	4.74
5	092280065	22工行二级资本债03A	100,000	10,525,274.32	4.73

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22中国银行二级01（证券代码：2228006）、22建设银行二级01（证券代码：2228039）、24广发01（证券代码：148583）、20平安人寿（证券代码：2023005）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。

2024年04月03日，22中国银行二级01（证券代码：2228006）发行人中国银行股份有限公司因办理经常项目资金收付未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理审查被国家外汇管理局北京市分局处40万元人民币罚款没收违法所得2236.13元人民币。

2023年12月28日，22中国银行二级01（证券代码：2228006）发行人中国银行股份有限公司因部分重要信息系统识别不全面、灾备建设和灾难恢复能力不符合监管要求、重要信息系统投产及变更未向监管部门报告且投产及变更长期不规范引发重要信息系统较大及以上突发事件等被国家金融监督管理总局罚款430万元。

2023年12月27日，22建设银行二级01（证券代码：2228039）发行人中国建设银行股份有限公司因并表管理内部审计存在不足、母行对境外机构案件管理不到位、未及时

报告境外子行高级管理人员任职情况、监管检查发现问题整改不力被国家金融监督管理总局罚款170万元。

2023年11月22日，22建设银行二级01（证券代码：2228039）发行人中国建设银行股份有限公司因单个网点在同一会计年度内与超过3家保险公司开展保险业务合作、违规通过储蓄柜台销售投资连结型保险产品、代销利益不确定的保险产品未按规定提供完整合同材料等被国家金融监督管理总局处罚款合计2041.879382万元。

2024年03月22日，24广发01（证券代码：148583）发行人广发证券股份有限公司因参与首次公开发行证券网下询价过程中内部研究报告撰写不规范、询价流程不规范、询价相关内部制度不健全等被上海证券交易所予以监管警示。

2023年09月22日，24广发01（证券代码：148583）发行人广发证券股份有限公司因提供保荐(主承销)服务过程中未勤勉尽责、出具含有虚假记载的文件被中国证券监督管理委员会责令改正、给予警告、没收保荐业务收入943,396.23元并处罚1443396.23元。

2023年12月28日，20平安人寿（证券代码：2023005）发行人中国平安人寿保险股份有限公司因未按规定履行客户身份识别义务被中国人民银行深圳市分行罚款480万元。

2023年09月13日，20平安人寿（证券代码：2023005）发行人中国平安人寿保险股份有限公司因销售误导被国家金融监督管理总局常州监管分局处罚款6万元。

在上述公告公布后，本基金管理人对上述公司进行了进一步了解和视为，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	46,882.29
2	应收清算款	329,267.35
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	376,149.64

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	127039	北港转债	4,486,375.95	2.02
2	132026	G三峡EB2	3,365,870.96	1.51
3	113062	常银转债	3,303,540.99	1.48
4	113052	兴业转债	3,030,094.79	1.36
5	110079	杭银转债	2,898,413.59	1.30
6	118031	天23转债	2,237,714.71	1.01
7	110073	国投转债	1,731,834.74	0.78
8	128066	亚泰转债	1,489,112.98	0.67
9	118014	高测转债	1,303,576.25	0.59
10	127049	希望转2	1,035,025.75	0.46
11	127045	牧原转债	1,017,804.35	0.46
12	128063	未来转债	928,162.19	0.42
13	128131	崇达转2	886,611.51	0.40
14	111005	富春转债	881,822.16	0.40
15	113050	南银转债	877,884.58	0.39
16	123147	中辰转债	807,830.49	0.36
17	118029	富淼转债	715,601.92	0.32
18	123107	温氏转债	694,094.73	0.31
19	113653	永22转债	682,154.54	0.31
20	127031	洋丰转债	675,013.15	0.30
21	118033	华特转债	558,858.90	0.25
22	110085	通22转债	528,835.07	0.24
23	127025	冀东转债	517,429.86	0.23
24	118005	天奈转债	499,448.63	0.22

25	123071	天能转债	444,788.93	0.20
26	123169	正海转债	432,411.51	0.19
27	127083	山路转债	376,458.70	0.17
28	113675	新23转债	347,799.12	0.16
29	123145	药石转债	339,593.42	0.15
30	123160	泰福转债	324,010.36	0.15
31	127088	赫达转债	222,478.25	0.10
32	113593	沪工转债	221,113.42	0.10
33	118032	建龙转债	20,980.27	0.01
34	128125	华阳转债	18,500.19	0.01
35	113644	艾迪转债	2,153.18	0.00

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

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
泓德慧享混合A	197	1,272,849.04	250,409,683.80	99.86%	341,576.59	0.14%
泓德慧享	99	980.77	0.00	0.00%	97,096.51	100.00%

混合C						
合计	289	867,987.39	250,409,683.80	99.83%	438,673.10	0.17%

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	泓德慧享混合A	55,406.99	0.02%
	泓德慧享混合C	7,294.93	7.51%
	合计	62,701.92	0.02%

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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	泓德慧享混合A	0~10
	泓德慧享混合C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	泓德慧享混合A	0~10
	泓德慧享混合C	0~10
	合计	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	泓德慧享混合A	泓德慧享混合C
基金合同生效日(2021年09月06日)基金份额总额	200,071,798.34	100,025,054.03
本报告期期初基金份额总额	250,834,512.93	117,907.76
本报告期基金总申购份额	14,124.53	53,829.01
减：本报告期基金总赎回份额	97,377.07	74,640.26
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	250,751,260.39	97,096.51

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 基金管理人的重大人事变动

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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信建投证券	2	283,573,862.09	100.00%	208,684.64	100.00%	-

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：无。
- (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	成交金额	占当期债券回购成	成交金额	占当期权证成	成交金额	占当期基金成

		额的比例		交总额的 比例		交总额 的比例		交总额 的比例
中信建投证 券	60,334,088. 28	100.00%	1,730,800,00 0.00	100.00%	-	-	-	-

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、证券日报、中国证监会基金电子披露网站	2024-01-11
2	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加北京汇成基金销售有限公司为销售机构的公告	公司官网、证券日报、中国证监会基金电子披露网站	2024-01-18
3	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加北京雪球基金销售有限公司为销售机构的公告	公司官网、证券日报、中国证监会基金电子披露网站	2024-05-23
4	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加招商证券股份有限公司为销售机构的公告	公司官网、证券日报、中国证监会基金电子披露网站	2024-05-29

§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	2024/01/01-2024/06/30	250,409,683.80	0.00	0.00	250,409,683.80	99.83%

产品特有风险

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。

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。

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慧享混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《泓德慧享混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《泓德慧享混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《泓德慧享混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在规定报刊上披露的各项公告。

12.2 存放地点

地点为管理人地址：北京市西城区德胜门外大街125号

12.3 查阅方式

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

泓德基金管理有限公司
二〇二四年八月二十九日