

---

# 泓德智选启元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:华泰证券股份有限公司

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。

基金托管人华泰证券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	6
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	9
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	12
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	13
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	13
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	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	48
7.1 期末基金资产组合情况	48
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
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	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	80
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	81
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	82
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	82
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	82
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	82
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	82
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	82
7.12 投资组合报告附注	83
§8 基金份额持有人信息	84
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	84
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	84

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 .....	85
§9 开放式基金份额变动 .....	85
§10 重大事件揭示 .....	86
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	86
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 .....	86
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	86
10.4 基金投资策略的改变 .....	86
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	86
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 .....	86
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	87
10.8 其他重大事件 .....	88
§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....	89
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 .....	89
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	89
§12 备查文件目录 .....	89
12.1 备查文件目录 .....	89
12.2 存放地点 .....	89
12.3 查阅方式 .....	89

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	泓德智选启元混合型证券投资基金	
基金简称	泓德智选启元混合	
基金主代码	019982	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023年11月21日	
基金管理人	泓德基金管理有限公司	
基金托管人	华泰证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	190,128,221.24份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	泓德智选启元混合A	泓德智选启元混合C
下属分级基金的交易代码	019982	019983
报告期末下属分级基金的份额总额	80,717,994.66份	109,410,226.58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，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金通过研究宏观经济周期及调控政策规律，通过分析宏观与微观经济指标、市场指标及政策因素，动态调整基金资产在股票、债券、货币市场工具等类别资产间的分配比例，控制市场风险，提高配置效率。在股票投资中，本基金运用基金管理人开发的"多因子选股模型"以及基本面选股等多种策略进行股票选择并据此构建股票投资组合。在债券投资中，本基金采取适当的久期策略、个券选择策略、可转换债券及可交换债券投资策略、证券公司短期公司债券投资策略和资产支持证券投资策略。此外，本基金将在风险可控的前提下，本着谨慎原则，适度参与股指期货与国债期货投资，以调整投资组合的风险暴露程度，降低系统性风险。
业绩比较基准	中证500指数收益率×90%+中国债券综合全价指

	数收益率×10%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其长期预期风险与预期收益低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。

### 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	华泰证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李晓春	李双均
	联系电话	010-59850177	025-83389842
	电子邮箱	lixiaochun@hongdefund.com	lishuangjun@htsc.com
客户服务电话		4009-100-888	95597
传真		010-59850195	025-83387215
注册地址		西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦1206室	江苏省南京市江东中路228号
办公地址		北京市西城区德胜门外大街125号	江苏省南京市江东中路228号
邮政编码		100088	210009
法定代表人		王德晓	张伟

### 2.4 信息披露方式

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

### 2.5 其他相关资料

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

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2024年01月01日-2024年06月30日)	
	泓德智选启元混合 A	泓德智选启元混合 C
本期已实现收益	-3,157,325.27	-26,458,282.96
本期利润	-6,406,982.40	-31,158,891.36
加权平均基金份额本期利润	-0.1136	-0.2224
本期加权平均净值利润率	-12.52%	-24.48%
本期基金份额净值增长率	-11.76%	-11.94%
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	-10,625,286.71	-14,635,673.12
期末可供分配基金份额利润	-0.1316	-0.1338
期末基金资产净值	70,092,707.95	94,774,553.46
期末基金份额净值	0.8684	0.8662
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	-13.16%	-13.38%

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

泓德智选启元混合A

阶段	份额净值	份额净值	业绩比较	业绩比较	①-③	②-④
----	------	------	------	------	-----	-----

	增长率①	增长率标准差②	基准收益率③	基准收益率标准差④		
过去一个月	-5.21%	0.95%	-6.15%	0.86%	0.94%	0.09%
过去三个月	-4.31%	1.06%	-5.73%	1.03%	1.42%	0.03%
过去六个月	-11.76%	1.44%	-7.75%	1.44%	-4.01%	0.00%
自基金合同生效起至今	-13.16%	1.33%	-11.07%	1.33%	-2.09%	0.00%

## 泓德智选启元混合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	-5.25%	0.95%	-6.15%	0.86%	0.90%	0.09%
过去三个月	-4.41%	1.06%	-5.73%	1.03%	1.32%	0.03%
过去六个月	-11.94%	1.44%	-7.75%	1.44%	-4.19%	0.00%
自基金合同生效起至今	-13.38%	1.32%	-11.07%	1.33%	-2.31%	-0.01%

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500指数收益率×90%+中国债券综合全价指数收益率×10%

基准指数的构建原则如下：

（1）中证500指数是中证指数有限公司编制的，反映沪深证券市场内中小市值公司的整体状况的指数，具有良好的市场代表性和市场影响力，适合作为本基金A股投资部分的业绩基准。

（2）中国债券综合全价指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制，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。

（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90%、10%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



注：1、本基金的基金合同于2023年11月21日生效，截至2024年6月30日止，本基金成立未满1年。

2、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，同时在产品的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		
苏昌景	本基金的基金经理、量化投资部总监	2023-11-21	-	16年	硕士研究生，具有基金从业资格，曾任本公司研究部研究员，国都证券股份有限公司研究所研究员、资产管理总部总经理助理、投资经理。
李子昂	本基金的基金经理	2023-11-29	-	10年	硕士研究生，具有基金从业资格，曾任本公司多资产投资部投资经理，北京隆慧投资有限公司投资管理部投资经理，华商基金管理有限公司量化投资部量化研究员，泰达宏利基金管理有限

					公司风险管理与基金评估部助理专员。
--	--	--	--	--	-------------------

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

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，宏观经济总体平稳，但外部环境复杂多变，有效内需依然不足，经济面临新旧动能切换的阵痛。资本市场大幅波动，微盘小票下跌明显，只有红利资产一枝独秀。我们在年初遇到了一轮超额收益的回撤，而后随着市场逐渐稳定，叠加我们对深度

学习模型做了优化和迭代，产品的Alpha也表现出了修复的态势。今年以来，我们发现传统的基本面模型表现出了更好的收益特性，基本面和量价的有机融合可能更好地适应当前复杂快变的市场环境，同时，因子有效性也受因子拥挤程度影响，大量资金的涌入也会加快量价因子的失效，这就需要我们不断更迭特征、优化模型，找到新的超额逻辑。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末泓德智选启元混合A基金份额净值为0.8684元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-11.76%，同期业绩比较基准收益率为-7.75%；截至报告期末泓德智选启元混合C基金份额净值为0.8662元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-11.94%，同期业绩比较基准收益率为-7.75%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

三中全会强调要坚定不移完成全年经济社会发展目标任务，这需要更有力的财政政策支持，短期专项债和3000亿特别国债将更好地推动设备更新和消费品的以旧换新，从而拉动经济增长；人民币汇率相对稳定是货币政策的大前提，随着下半年美联储可能进入降息周期，人民币汇率压力可能迎来边际下降，货币政策的空间也有望随之打开。国内经济依然要做好两大循环，对内扩大内需，提振消费，同时支持新兴产业和未来产业；对外，在推动国内企业“走出去”的同时，也要加速落实“引进来”的政策，当然，下半年的美国大选依旧扑朔迷离，中美贸易也仍有较大的不确定性，外循环的挑战倍增。当前位置，我们长期看好量化投资的价值，新技术的不断涌现也让行业焕发生机，我们也会不断学习，并努力迭代出更好的深度学习模型，力争为投资者创造价值。

#### 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-25,260,959.83元，其中：泓德智选启元混合A期末可供分配利润为-10,625,286.71元（泓德智选启元混合A的未分配利润已实现部分为-9,848,132.56元，未分配利润未实现部分为-777,154.15元），泓德智选启元混合C期末可供分配利润为-14,635,673.12元（泓德智选启元混合C的未分配利润已实现部分为-13,590,885.44元，未分配利润未实现部分为-1,044,787.68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

在本报告期内，本基金托管人-华泰证券股份有限公司严格遵守了基金合同和各项法律法规的相关规定，履行了基金托管人应尽的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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，华泰证券对基金管理人的投资运作行为依基金合同约定进行了监督，对本基金资产净值计算、利润分配、费用开支进行了复核，未发现基金管理人存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

华泰证券作为基金托管人，复核了本基金2024年中期报告中的有关财务数据、收益分配、投资组合报告等财务信息相关内容，相关内容真实、准确和完整。

### §6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：泓德智选启元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	18,227,532.84	22,313,094.89
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	147,074,149.00	240,200,971.82
其中：股票投资		147,046,146.91	240,200,971.82
基金投资		-	-
债券投资		28,002.09	-
资产支持证券 投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		228,626.37	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		165,530,308.21	262,514,066.71
<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		-	-
应付赎回款		349,166.97	-
应付管理人报酬		166,060.36	265,981.08
应付托管费		20,757.52	33,247.66
应付销售服务费		32,168.72	74,655.57
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.01	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	94,893.22	20,000.00
负债合计		663,046.80	393,884.31
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	190,128,221.24	266,461,389.34
未分配利润	6.4.7.8	-25,260,959.83	-4,341,206.94
净资产合计		164,867,261.41	262,120,182.40
负债和净资产总计		165,530,308.21	262,514,066.71

注：报告截止日2024年06月30日，基金份额总额190,128,221.24份，其中A类基金份额总额为80,717,994.66份，基金份额净值为0.8684元；C类基金份额总额为109,410,226.58份，基金份额净值为0.8662元。

## 6.2 利润表

会计主体：泓德智选启元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0 6月30日
一、营业总收入		-36,024,085.12

1.利息收入		94,645.15
其中：存款利息收入	6.4.7.9	94,645.15
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		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-28,467,798.31
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-30,518,128.91
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	67,086.49
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.12	-
股利收益	6.4.7.13	1,983,244.11
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	-7,950,265.53
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	299,333.57
<b>减：二、营业总支出</b>		1,541,788.64
1.管理人报酬		1,060,485.16
2.托管费		132,560.62
3.销售服务费		251,750.37
4.投资顾问费		-
5.利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6.信用减值损失		-
7.税金及附加		0.09
8.其他费用	6.4.7.16	96,992.40
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-37,565,873.76</b>



减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-37,565,873.76
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-37,565,873.76

注：本基金合同于2023年11月21日生效，无上年度可比期间。

### 6.3 净资产变动表

会计主体：泓德智选启元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	266,461,389.34	-4,341,206.94	262,120,182.40
二、本期期初净资产	266,461,389.34	-4,341,206.94	262,120,182.40
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-76,333,168.10	-20,919,752.89	-97,252,920.99
（一）、综合收益总额	-	-37,565,873.76	-37,565,873.76
（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）	-76,333,168.10	16,646,120.87	-59,687,047.23
其中：1.基金申购款	135,135,639.83	-12,916,908.50	122,218,731.33
2.基金赎回款	-211,468,807.93	29,563,029.37	-181,905,778.56
（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	190,128,221.24	-25,260,959.83	164,867,261.41

注：本基金合同于2023年11月21日生效，无上年度可比期间。

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

泓德智选启元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[2023]2444号《关于准予泓德智选启元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《泓德智选启元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266,435,025.34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(2023)第0557号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泓德智选启元混合型证券投资基金基金合同》于2023年11月21日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为266,461,389.34份，其中认购资金利息折合26,364.00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，基金托管人为华泰证券股份有限公司。

根据《泓德智选启元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、销售服务费收取方式等不同，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《泓德智选启元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包括国内依法发行上市的股票（含主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公

开发行的次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券、证券公司短期公司债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。基金的投资组合比例为：本基金投资于股票资产（含存托凭证）占基金资产的比例为60%-95%。每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证500指数收益率×90%+中国债券综合全价指数收益率×10%。

### 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》、《泓德智选启元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 重要会计政策和会计估计

#### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

#### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

##### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

#### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

##### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

##### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

#### 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

#### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### (3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，

包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映

公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

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

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 6.4.4.7 实收基金

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

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

#### 6.4.4.8 损益平准金

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

#### 6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率（对于贴现债为按发行价计算的利率）或合同利率计算的利息及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 6.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券



投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

## 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。

(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	8,724,673.79
等于：本金	8,720,320.97
加：应计利息	4,352.82
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	9,502,859.05
等于：本金	9,502,037.07

加：应计利息	821.98
减：坏账准备	-
合计	18,227,532.84

#### 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	157,027,196.54	-	147,046,146.91	-9,981,049.63
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	28,000.00	28,002.09	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	28,000.00	28,002.09	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	157,055,196.54	2.09	147,074,149.00	-9,981,049.63

#### 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	0.82
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	92,492.40
其他应付	2,400.00
合计	94,893.22

## 6.4.7.7 实收基金

## 6.4.7.7.1 泓德智选启元混合A

金额单位：人民币元

项目 (泓德智选启元混合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	42,080,923.58	42,080,923.58
本期申购	96,077,697.68	96,077,697.68
本期赎回（以“-”号填列）	-57,440,626.60	-57,440,626.60
本期末	80,717,994.66	80,717,994.66

## 6.4.7.7.2 泓德智选启元混合C

金额单位：人民币元

项目 (泓德智选启元混合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	224,380,465.76	224,380,465.76

本期申购	39,057,942.15	39,057,942.15
本期赎回（以“-”号填列）	-154,028,181.33	-154,028,181.33
本期末	109,410,226.58	109,410,226.58

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 泓德智选启元混合A

单位：人民币元

项目 (泓德智选启元混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-349,683.43	-320,612.79	-670,296.22
本期期初	-349,683.43	-320,612.79	-670,296.22
本期利润	-3,157,325.27	-3,249,657.13	-6,406,982.40
本期基金份额交易产生的变动数	-6,341,123.86	2,793,115.77	-3,548,008.09
其中：基金申购款	-14,388,795.83	4,841,544.64	-9,547,251.19
基金赎回款	8,047,671.97	-2,048,428.87	5,999,243.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-9,848,132.56	-777,154.15	-10,625,286.71

##### 6.4.7.8.2 泓德智选启元混合C

单位：人民币元

项目 (泓德智选启元混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,960,739.41	-1,710,171.31	-3,670,910.72
本期期初	-1,960,739.41	-1,710,171.31	-3,670,910.72
本期利润	-26,458,282.96	-4,700,608.40	-31,158,891.36
本期基金份额交易产生的变动数	14,828,136.93	5,365,992.03	20,194,128.96
其中：基金申购款	-6,143,034.73	2,773,377.42	-3,369,657.31
基金赎回款	20,971,171.66	2,592,614.61	23,563,786.27
本期已分配利润	-	-	-

本期末	-13,590,885.44	-1,044,787.68	-14,635,673.12
-----	----------------	---------------	----------------

**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	76,516.58
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	18,128.57
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	94,645.15

**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	751,012,771.54
减：卖出股票成本总额	780,020,535.69
减：交易费用	1,510,364.76
买卖股票差价收入	-30,518,128.91

**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	26.43
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	67,060.06
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	67,086.49
----	-----------

#### 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	296,097.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	229,000.00
减：应计利息总额	25.10
减：交易费用	11.84
买卖债券差价收入	67,060.06

#### 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	1,983,244.11
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,983,244.11

#### 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	-7,950,265.53

—股票投资	-7,950,265.53
—债券投资	-
—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	-7,950,265.53

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	299,333.57
合计	299,333.57

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	32,820.06
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
账户维护费	4,500.00
合计	96,992.40



## 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
华泰证券股份有限公司（以下简称“华泰证券”）	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

#### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华泰证券	936,662,847.80	64.83%

#### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例
华泰证券	218,517.00	73.80%

#### 6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	675,606.34	64.83%	-	-

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 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2024年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,060,485.16
其中：应支付销售机构的客户维护费	382,110.52
应支付基金管理人的净管理费	678,374.64

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
当期发生的基金应支付的托管费	132,560.62

注：支付基金托管人华泰证券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		
	泓德智选启元混合A	泓德智选启元混合C	合计
泓德基金	0.00	11,066.71	11,066.71
华泰证券	0.00	174,378.25	174,378.25
合计	0.00	185,444.96	185,444.96

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

泓德智选启元混合A

份额单位：份

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
报告期初持有的基金份额	-

报告期间申购/买入总份额	12,285,002.66
报告期间因拆分变动份额	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-
报告期末持有的基金份额	12,285,002.66
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	6.46%

注：期间申购/买入总份额为基金转换（入）份额。

#### 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	
	期末余额	当期利息收入
华泰证券- 托管户	8,724,673.79	76,516.58
华泰证券- 证券户	6,841,157.68	4,704.95

注：本基金托管户的银行存款由基金托管人华泰证券存放在中国工商银行南京奥体支行，按银行同业利率计息；本基金证券户的存款为本基金存放于华泰证券基金专用证券账户中的证券交易结算资金，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

报告期内，本基金参与了华泰联合证券有限责任公司（基金托管人华泰证券股份有限公司的控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的关联方）承销期内承销的苏州西典新能源电气股份有限公司、成都华微电子科技股份有限公司、上海龙旗科技股份有限公司的首次公开发行人民币普通股（A股）网下申购。

#### 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	569	40,097.24	106,977.69	备注2（1）
603350	安乃达	2024-06-26	5个交易日	新股未上市	20.56	20.56	815	16,756.40	16,756.40	-
603285	键邦股份	2024-06-28	5个交易日	新股未上市	18.65	18.65	791	14,752.15	14,752.15	-
688692	达梦数据	2024-06-04	6个月以上	限售股	86.96	174.93	60	5,217.60	10,495.80	-
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	-
688709	成都华微	2024-01-31	6个月以上	限售股	15.69	18.79	474	7,437.06	8,906.46	-
301538	骏鼎达	2024-03-13	6个月以上	限售股	55.82	91.24	95	3,795.76	8,667.80	备注2（2）

301536	星宸科技	2024-03-20	6个月以上	限售股	16.16	32.27	256	4,136.96	8,261.12	-
301591	肯特股份	2024-02-20	6个月以上	限售股	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-
301565	中仑新材	2024-06-13	6个月以上	限售股	11.88	18.98	383	4,550.04	7,269.34	-
688691	灿芯股份	2024-04-02	6个月以上	限售股	19.86	42.51	170	3,376.20	7,226.70	-
301580	爱迪特	2024-06-19	6个月以上	限售股	44.95	65.93	106	4,764.70	6,988.58	-
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	-
688584	上海合晶	2024-02-01	6个月以上	限售股	22.66	15.89	343	7,772.38	5,450.27	-
688695	中创股份	2024-03-06	6个月以上	限售股	22.43	31.55	168	3,768.24	5,300.40	-
601033	永兴股份	2024-01-11	6个月以上	限售股	16.20	15.96	332	5,378.40	5,298.72	-
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	-

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	-
603341	龙旗科技	2024-02-23	6个月以上	限售股	26.00	37.49	77	2,002.00	2,886.73	-
603375	盛景微	2024-01-17	6个月以上	限售股	38.18	38.90	71	2,710.78	2,761.90	-
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)
001379	腾达科技	2024-01-11	6个月以上	限售股	16.98	13.48	185	3,141.30	2,493.80	-
603312	西典新能	2024-01-04	6个月以上	限售股	29.02	25.36	90	2,611.80	2,282.40	-
001359	平安电工	2024-03-19	6个月以上	限售股	17.39	20.60	99	1,721.61	2,039.40	-
603344	星德胜	2024-03-13	6个月以上	限售股	19.18	22.66	84	1,611.12	1,903.44	-
603350	安乃达	2024-06-26	6个月以上	新股未上市且限售	20.56	20.56	91	1,870.96	1,870.96	-
603381	永臻股份	2024-06-19	6个月以上	限售股	23.35	25.13	73	1,704.55	1,834.49	-
603285	键邦股份	2024-06-28	6个月以	新股未上	18.65	18.65	88	1,641.20	1,641.20	-

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113685	升24转债	2024-06-17	17个交易日	新债未上市	100.00	100.01	280	28,000.00	28,002.09	-

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

于2024年6月30日，本基金持有63,400股ST富通(股票代码“000836”)成本总额为人民币124,334.22元。根据相关公告，该股票自2024年6月18日起停牌，于2024年8月12日被终止上市。基金管理人于2024年6月22日发布《泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金所持股票估值方法调整的提示性公告》，经与相关托管人协商一致，自2024年6月21日起，对“ST富通”(股票代码“000836”)按照0元进行估值，详见基金管理人在规定媒介披露的相关公告。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购



本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于本报告期期末，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为0.02%(上年度末：0%)。

### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

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

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注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	18,227,532.84	-	-	-	18,227,532.84
交易性金融资	-	-	28,002.09	147,046,146.91	147,074,149.00

产					
应收申购款	-	-	-	228,626.37	228,626.37
资产总计	18,227,532.84	-	28,002.09	147,274,773.28	165,530,308.21
负债					
应付赎回款	-	-	-	349,166.97	349,166.97
应付管理人报酬	-	-	-	166,060.36	166,060.36
应付托管费	-	-	-	20,757.52	20,757.52
应付销售服务费	-	-	-	32,168.72	32,168.72
应交税费	-	-	-	0.01	0.01
其他负债	-	-	-	94,893.22	94,893.22
负债总计	-	-	-	663,046.80	663,046.80
利率敏感度缺口	18,227,532.84	-	28,002.09	146,611,726.48	164,867,261.41
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	22,313,094.89	-	-	-	22,313,094.89
交易性金融资产	-	-	-	240,200,971.82	240,200,971.82

资产总计	22,313,094.89	-	-	240,200,971.82	262,514,066.71
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	265,981.08	265,981.08
应付托管费	-	-	-	33,247.66	33,247.66
应付销售服务费	-	-	-	74,655.57	74,655.57
其他负债	-	-	-	20,000.00	20,000.00
负债总计	-	-	-	393,884.31	393,884.31
利率敏感度缺口	22,313,094.89	-	-	239,807,087.51	262,120,182.40

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期期末，本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券（若有）公允价值占基金资产净值的比例为0.02%(上年度末：0%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(上年度末：同)。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

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

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	147,046,146.91	89.19	240,200,971.82	91.64
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	147,046,146.91	89.19	240,200,971.82	91.64

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于本报告期期末，本基金成立尚未满一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

## 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	146,765,070.41	240,175,510.11
第二层次	63,022.80	-
第三层次	246,055.79	25,461.71
合计	147,074,149.00	240,200,971.82

#### 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	147,046,146.91	88.83
	其中：股票	147,046,146.91	88.83
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	28,002.09	0.02
	其中：债券	28,002.09	0.02
	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	18,227,532.84	11.01
8	其他各项资产	228,626.37	0.14
9	合计	165,530,308.21	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	355,606.00	0.22
B	采矿业	7,848,671.00	4.76
C	制造业	92,540,661.16	56.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,143,901.20	3.12
E	建筑业	1,743,479.00	1.06



F	批发和零售业	6,210,350.12	3.77
G	交通运输、仓储和邮政业	4,129,746.00	2.50
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,013,837.09	4.86
J	金融业	11,765,429.40	7.14
K	房地产业	2,815,292.00	1.71
L	租赁和商务服务业	1,268,784.30	0.77
M	科学研究和技术服务业	373,213.32	0.23
N	水利、环境和公共设施管理业	1,494,564.72	0.91
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	176,972.00	0.11
R	文化、体育和娱乐业	2,422,123.60	1.47
S	综合	743,516.00	0.45
	合计	147,046,146.91	89.19

### 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	600941	中国移动	7,300	784,750.00	0.48
2	600739	辽宁成大	92,700	775,899.00	0.47
3	002128	电投能源	35,900	757,490.00	0.46
4	601128	常熟银行	97,620	738,983.40	0.45
5	603228	景旺电子	20,500	651,900.00	0.40
6	601919	中远海控	41,400	641,286.00	0.39
7	601058	赛轮轮胎	44,800	627,200.00	0.38
8	600566	济川药业	19,500	618,345.00	0.38
9	000975	银泰黄金	37,900	617,391.00	0.37
10	603993	洛阳钼业	72,400	615,400.00	0.37

11	000166	申万宏源	135,800	585,298.00	0.36
12	688018	乐鑫科技	5,652	557,739.36	0.34
13	600547	山东黄金	20,200	553,076.00	0.34
14	000830	鲁西化工	47,400	549,366.00	0.33
15	000786	北新建材	18,400	545,744.00	0.33
16	601601	中国太保	19,500	543,270.00	0.33
17	300628	亿联网络	13,600	500,072.00	0.30
18	000725	京东方 A	117,600	480,984.00	0.29
19	600285	羚锐制药	19,700	476,937.00	0.29
20	002532	天山铝业	58,400	473,624.00	0.29
21	600066	宇通客车	18,200	469,560.00	0.28
22	600315	上海家化	26,400	469,392.00	0.28
23	601717	郑煤机	30,900	457,320.00	0.28
24	600039	四川路桥	57,500	453,675.00	0.28
25	600967	内蒙一机	63,000	453,600.00	0.28
26	002422	科伦药业	14,600	442,818.00	0.27
27	601825	沪农商行	65,700	441,504.00	0.27
28	002237	恒邦股份	38,300	440,833.00	0.27
29	000532	华金资本	36,200	436,572.00	0.26
30	600999	招商证券	31,300	435,383.00	0.26
31	300783	三只松鼠	19,800	433,026.00	0.26
32	601665	齐鲁银行	87,300	428,643.00	0.26
33	603299	苏盐井神	44,700	424,650.00	0.26
34	600968	海油发展	102,900	423,948.00	0.26
35	300529	健帆生物	15,500	421,755.00	0.26
36	601139	深圳燃气	63,000	420,840.00	0.26
37	600095	湘财股份	69,500	414,220.00	0.25
38	603025	大豪科技	29,800	411,836.00	0.25
39	600864	哈投股份	86,000	408,500.00	0.25
40	300760	迈瑞医疗	1,400	407,274.00	0.25
41	601211	国泰君安	29,900	405,145.00	0.25

42	600998	九州通	82,794	404,034.72	0.25
43	600938	中国海油	12,100	399,300.00	0.24
44	601138	工业富联	14,500	397,300.00	0.24
45	603897	长城科技	22,300	391,365.00	0.24
46	601101	昊华能源	42,500	390,575.00	0.24
47	688016	心脉医疗	3,960	388,278.00	0.24
48	002106	莱宝高科	35,600	388,040.00	0.24
49	600803	新奥股份	18,600	386,880.00	0.23
50	000600	建投能源	61,400	386,820.00	0.23
51	600390	五矿资本	94,600	383,130.00	0.23
52	600707	彩虹股份	56,000	381,360.00	0.23
53	002938	鹏鼎控股	9,500	377,720.00	0.23
54	000758	中色股份	73,800	374,904.00	0.23
55	600489	中金黄金	25,300	374,440.00	0.23
56	600475	华光环能	42,900	373,659.00	0.23
57	002517	恺英网络	38,800	370,540.00	0.22
58	601328	交通银行	49,500	369,765.00	0.22
59	002463	沪电股份	10,100	368,650.00	0.22
60	000877	天山股份	67,900	366,660.00	0.22
61	001286	陕西能源	31,800	366,654.00	0.22
62	002636	金安国纪	56,800	360,680.00	0.22
63	002267	陕天然气	47,400	358,344.00	0.22
64	000923	河钢资源	20,800	358,176.00	0.22
65	002203	海亮股份	44,600	355,908.00	0.22
66	300679	电连技术	8,800	354,024.00	0.21
67	600183	生益科技	16,700	351,702.00	0.21
68	002550	千红制药	64,900	349,811.00	0.21
69	003006	百亚股份	14,700	348,390.00	0.21
70	600988	赤峰黄金	21,300	348,042.00	0.21
71	600114	东睦股份	24,100	346,799.00	0.21
72	002215	诺普信	46,500	346,425.00	0.21

73	002519	银河电子	70,500	346,155.00	0.21
74	002053	云南能投	28,400	343,356.00	0.21
75	300170	汉得信息	55,900	343,226.00	0.21
76	600161	天坛生物	14,040	342,576.00	0.21
77	603699	纽威股份	19,900	340,688.00	0.21
78	600219	南山铝业	89,100	339,471.00	0.21
79	603583	捷昌驱动	16,600	338,308.00	0.21
80	300502	新易盛	3,200	337,760.00	0.20
81	603368	柳药集团	19,300	337,750.00	0.20
82	603609	禾丰股份	50,900	332,886.00	0.20
83	688776	国光电气	6,000	332,400.00	0.20
84	002214	大立科技	29,100	328,248.00	0.20
85	600584	长电科技	10,300	326,613.00	0.20
86	300390	天华新能	18,800	322,984.00	0.20
87	002384	东山精密	15,600	322,920.00	0.20
88	600694	大商股份	19,090	320,902.90	0.19
89	601198	东兴证券	40,300	320,788.00	0.19
90	000738	航发控制	15,900	319,113.00	0.19
91	601318	中国平安	7,700	318,472.00	0.19
92	601500	通用股份	59,100	315,594.00	0.19
93	002064	华峰化学	43,900	314,763.00	0.19
94	002867	周大生	24,100	314,746.00	0.19
95	000728	国元证券	51,900	314,514.00	0.19
96	601607	上海医药	16,300	311,493.00	0.19
97	600916	中国黄金	32,300	310,726.00	0.19
98	002139	拓邦股份	29,200	310,104.00	0.19
99	300752	隆利科技	22,800	309,624.00	0.19
100	600673	东阳光	43,600	306,944.00	0.19
101	603267	鸿远电子	9,000	306,900.00	0.19
102	603355	莱克电气	14,200	306,720.00	0.19
103	002558	巨人网络	32,300	304,912.00	0.18

104	601958	金钼股份	28,900	300,849.00	0.18
105	601108	财通证券	45,000	297,450.00	0.18
106	301165	锐捷网络	9,800	292,432.00	0.18
107	002500	山西证券	62,100	291,870.00	0.18
108	600551	时代出版	41,120	291,129.60	0.18
109	600436	片仔癀	1,400	290,038.00	0.18
110	000999	华润三九	6,810	289,969.80	0.18
111	000776	广发证券	23,100	281,127.00	0.17
112	002028	思源电气	4,200	280,980.00	0.17
113	688728	格科微	23,000	278,530.00	0.17
114	601609	金田股份	48,800	276,208.00	0.17
115	000543	皖能电力	31,200	276,120.00	0.17
116	002273	水晶光电	16,200	275,076.00	0.17
117	600269	赣粤高速	53,200	275,044.00	0.17
118	000630	铜陵有色	76,100	274,721.00	0.17
119	002296	辉煌科技	26,500	273,215.00	0.17
120	601989	中国重工	55,200	272,136.00	0.17
121	002475	立讯精密	6,900	271,239.00	0.16
122	603995	甬金股份	15,400	269,808.00	0.16
123	688510	航亚科技	14,600	268,786.00	0.16
124	601187	厦门银行	50,400	268,632.00	0.16
125	300638	广和通	15,700	268,470.00	0.16
126	002008	大族激光	12,900	268,320.00	0.16
127	002245	蔚蓝锂芯	34,600	268,150.00	0.16
128	301206	三元生物	10,900	267,922.00	0.16
129	603681	永冠新材	21,000	267,750.00	0.16
130	000517	荣安地产	99,900	267,732.00	0.16
131	688578	艾力斯	4,200	267,708.00	0.16
132	600266	城建发展	71,500	267,410.00	0.16
133	601865	福莱特	13,300	267,330.00	0.16
134	600420	国药现代	25,000	267,000.00	0.16

135	002282	博深股份	41,600	265,824.00	0.16
136	688208	道通科技	11,000	265,540.00	0.16
137	601066	中信建投	13,800	265,512.00	0.16
138	601126	四方股份	13,800	265,236.00	0.16
139	300307	慈星股份	44,500	264,775.00	0.16
140	002020	京新药业	25,200	263,844.00	0.16
141	688132	邦彦技术	15,200	263,720.00	0.16
142	000990	诚志股份	35,400	263,376.00	0.16
143	001965	招商公路	22,200	263,292.00	0.16
144	601600	中国铝业	34,500	263,235.00	0.16
145	000338	潍柴动力	16,200	263,088.00	0.16
146	600761	安徽合力	12,100	261,844.00	0.16
147	603156	养元饮品	12,300	261,621.00	0.16
148	002318	久立特材	11,200	261,296.00	0.16
149	601598	中国外运	46,400	261,232.00	0.16
150	000959	首钢股份	96,000	261,120.00	0.16
151	600030	中信证券	14,300	260,689.00	0.16
152	300100	双林股份	24,200	260,634.00	0.16
153	300424	航新科技	21,300	260,499.00	0.16
154	603103	横店影视	18,800	260,192.00	0.16
155	688678	福立旺	24,000	259,920.00	0.16
156	002678	珠江钢琴	71,700	259,554.00	0.16
157	300409	道氏技术	30,300	259,368.00	0.16
158	002557	洽洽食品	9,200	259,348.00	0.16
159	600866	星湖科技	46,900	258,888.00	0.16
160	600993	马应龙	9,700	258,699.00	0.16
161	300002	神州泰岳	31,800	258,216.00	0.16
162	601375	中原证券	75,600	257,796.00	0.16
163	000036	华联控股	79,500	257,580.00	0.16
164	000750	国海证券	88,400	257,244.00	0.16
165	000589	贵州轮胎	50,700	257,049.00	0.16

166	603529	爱玛科技	9,400	256,902.00	0.16
167	001338	永顺泰	26,200	256,760.00	0.16
168	002340	格林美	40,300	256,711.00	0.16
169	600480	凌云股份	26,100	256,563.00	0.16
170	600096	云天化	13,200	256,344.00	0.16
171	600612	老凤祥	4,400	256,036.00	0.16
172	603929	亚翔集成	10,700	255,730.00	0.16
173	002984	森麒麟	10,600	255,354.00	0.15
174	600132	重庆啤酒	4,200	254,940.00	0.15
175	002567	唐人神	47,400	254,064.00	0.15
176	600507	方大特钢	67,900	253,946.00	0.15
177	002727	一心堂	16,800	253,512.00	0.15
178	000623	吉林敖东	18,900	253,260.00	0.15
179	002534	西子洁能	25,300	253,253.00	0.15
180	300841	康华生物	5,000	253,200.00	0.15
181	600971	恒源煤电	21,200	253,128.00	0.15
182	603031	安孚科技	11,200	252,896.00	0.15
183	301219	腾远钴业	6,600	252,516.00	0.15
184	000042	中洲控股	63,900	252,405.00	0.15
185	002970	锐明技术	7,000	252,210.00	0.15
186	601636	旗滨集团	39,000	251,550.00	0.15
187	688253	英诺特	6,600	251,526.00	0.15
188	600525	长园集团	59,000	251,340.00	0.15
189	002491	通鼎互联	74,300	251,134.00	0.15
190	002594	比亚迪	1,000	250,250.00	0.15
191	002241	歌尔股份	12,800	249,728.00	0.15
192	000825	太钢不锈	73,800	249,444.00	0.15
193	688138	清溢光电	11,600	249,400.00	0.15
194	601098	中南传媒	20,000	248,400.00	0.15
195	601001	晋控煤业	15,000	247,800.00	0.15
196	603755	日辰股份	10,700	247,491.00	0.15

197	300017	网宿科技	31,300	247,270.00	0.15
198	000576	甘化科工	41,200	247,200.00	0.15
199	600399	抚顺特钢	43,900	247,157.00	0.15
200	000739	普洛药业	18,200	246,974.00	0.15
201	002835	同为股份	14,600	246,594.00	0.15
202	688297	中无人机	7,443	245,842.29	0.15
203	000096	广聚能源	25,800	245,100.00	0.15
204	300227	光韵达	44,700	244,509.00	0.15
205	600422	昆药集团	13,700	244,271.00	0.15
206	688188	柏楚电子	1,317	243,052.35	0.15
207	601975	招商南油	67,400	241,966.00	0.15
208	002688	金河生物	66,600	241,758.00	0.15
209	300774	倍杰特	37,000	241,610.00	0.15
210	000020	深华发 A	24,400	241,560.00	0.15
211	600598	北大荒	19,300	241,057.00	0.15
212	601339	百隆东方	46,200	240,702.00	0.15
213	000509	华塑控股	93,600	240,552.00	0.15
214	002852	道道全	33,400	240,480.00	0.15
215	601686	友发集团	47,800	240,434.00	0.15
216	600282	南钢股份	48,200	240,036.00	0.15
217	002109	兴化股份	74,500	239,890.00	0.15
218	600233	圆通速递	15,300	239,445.00	0.15
219	300440	运达科技	45,400	238,350.00	0.14
220	300724	捷佳伟创	4,400	237,644.00	0.14
221	603707	健友股份	20,000	237,600.00	0.14
222	000529	广弘控股	40,400	237,552.00	0.14
223	603112	华翔股份	22,600	237,526.00	0.14
224	000551	创元科技	27,100	236,583.00	0.14
225	603956	威派格	44,500	236,295.00	0.14
226	601366	利群股份	52,500	236,250.00	0.14
227	300212	易华录	14,000	235,620.00	0.14



228	600997	开滦股份	34,300	235,298.00	0.14
229	600676	交运股份	84,900	235,173.00	0.14
230	688076	诺泰生物	3,000	234,840.00	0.14
231	300940	南极光	18,400	234,416.00	0.14
232	300267	尔康制药	112,200	233,376.00	0.14
233	002724	海洋王	52,400	233,180.00	0.14
234	605299	舒华体育	28,700	233,044.00	0.14
235	688509	正元地信	80,400	232,356.00	0.14
236	000510	新金路	83,800	232,126.00	0.14
237	002905	金逸影视	37,400	231,880.00	0.14
238	002672	东江环保	65,200	231,460.00	0.14
239	601015	陕西黑猫	82,600	231,280.00	0.14
240	601231	环旭电子	14,400	231,120.00	0.14
241	002873	新天药业	27,700	229,910.00	0.14
242	600488	津药药业	66,800	229,124.00	0.14
243	600348	华阳股份	23,000	229,080.00	0.14
244	601808	中海油服	13,300	228,760.00	0.14
245	601336	新华保险	7,600	228,228.00	0.14
246	600983	惠而浦	30,500	227,225.00	0.14
247	000949	新乡化纤	66,400	225,760.00	0.14
248	600862	中航高科	12,000	225,360.00	0.14
249	002745	木林森	27,900	224,874.00	0.14
250	300497	富祥药业	24,900	222,357.00	0.13
251	600201	生物股份	30,500	219,905.00	0.13
252	600312	平高电气	11,300	219,785.00	0.13
253	301090	华润材料	33,300	219,114.00	0.13
254	603501	韦尔股份	2,200	218,614.00	0.13
255	002266	浙富控股	77,900	217,341.00	0.13
256	002179	中航光电	5,700	216,885.00	0.13
257	688029	南微医学	3,506	215,829.36	0.13
258	002793	罗欣药业	60,200	215,516.00	0.13

259	601727	上海电气	58,200	215,340.00	0.13
260	600295	鄂尔多斯	21,580	214,073.60	0.13
261	601009	南京银行	20,400	211,956.00	0.13
262	601608	中信重工	55,200	210,312.00	0.13
263	600050	中国联通	44,700	210,090.00	0.13
264	300633	开立医疗	5,300	209,774.00	0.13
265	600828	茂业商业	88,500	209,745.00	0.13
266	300850	新强联	13,900	208,778.00	0.13
267	600521	华海药业	12,200	208,010.00	0.13
268	601216	君正集团	56,200	207,378.00	0.13
269	600888	新疆众和	29,300	207,151.00	0.13
270	600369	西南证券	57,700	206,566.00	0.13
271	603008	喜临门	11,900	206,227.00	0.13
272	600660	福耀玻璃	4,300	205,970.00	0.12
273	600019	宝钢股份	30,800	204,820.00	0.12
274	601158	重庆水务	42,600	204,480.00	0.12
275	601117	中国化学	24,700	203,528.00	0.12
276	002773	康弘药业	9,400	203,510.00	0.12
277	300182	捷成股份	54,700	202,937.00	0.12
278	603171	税友股份	7,500	202,800.00	0.12
279	600782	新钢股份	60,800	201,856.00	0.12
280	600036	招商银行	5,900	201,721.00	0.12
281	300251	光线传媒	23,900	200,999.00	0.12
282	600959	江苏有线	75,700	199,848.00	0.12
283	300708	聚灿光电	22,200	199,800.00	0.12
284	603160	汇顶科技	2,900	199,375.00	0.12
285	603806	福斯特	13,560	199,332.00	0.12
286	000069	华侨城 A	97,200	198,288.00	0.12
287	002138	顺络电子	7,200	197,712.00	0.12
288	000797	中国武夷	84,800	197,584.00	0.12
289	600406	国电南瑞	7,900	197,184.00	0.12

290	300389	艾比森	16,000	196,480.00	0.12
291	688123	聚辰股份	3,200	194,656.00	0.12
292	000423	东阿阿胶	3,100	194,060.00	0.12
293	601162	天风证券	88,900	193,802.00	0.12
294	600887	伊利股份	7,500	193,800.00	0.12
295	002697	红旗连锁	41,700	193,071.00	0.12
296	002302	西部建设	37,100	192,920.00	0.12
297	603688	石英股份	6,500	192,465.00	0.12
298	002379	宏创控股	32,800	192,208.00	0.12
299	600987	航民股份	27,200	192,032.00	0.12
300	002841	视源股份	6,500	191,945.00	0.12
301	600486	扬农化工	3,400	191,930.00	0.12
302	688151	华强科技	15,400	191,730.00	0.12
303	002549	凯美特气	37,400	191,114.00	0.12
304	600909	华安证券	45,300	190,713.00	0.12
305	300533	冰川网络	13,600	188,768.00	0.11
306	688006	杭可科技	10,800	188,460.00	0.11
307	603338	浙江鼎力	3,100	187,302.00	0.11
308	603323	苏农银行	38,900	187,109.00	0.11
309	301127	天源环保	15,800	186,756.00	0.11
310	688766	普冉股份	1,920	186,566.40	0.11
311	000933	神火股份	9,200	186,116.00	0.11
312	300767	震安科技	21,900	185,712.00	0.11
313	600737	中粮糖业	19,300	185,087.00	0.11
314	002911	佛燃能源	20,230	184,902.20	0.11
315	603899	晨光股份	5,900	184,552.00	0.11
316	601398	工商银行	32,200	183,540.00	0.11
317	603185	弘元绿能	10,698	182,828.82	0.11
318	600642	申能股份	20,700	182,781.00	0.11
319	603556	海兴电力	3,900	182,637.00	0.11
320	688111	金山办公	800	182,000.00	0.11

320	000050	深天马 A	25,000	182,000.00	0.11
322	000519	中兵红箭	12,300	180,441.00	0.11
323	600403	大有能源	69,900	180,342.00	0.11
324	688408	中信博	1,954	179,924.32	0.11
325	605222	起帆电缆	11,700	179,478.00	0.11
326	300308	中际旭创	1,300	179,244.00	0.11
327	600837	海通证券	20,900	178,904.00	0.11
328	001331	胜通能源	12,900	178,665.00	0.11
329	002001	新和成	9,300	178,560.00	0.11
330	603985	恒润股份	15,000	178,500.00	0.11
331	688234	天岳先进	3,800	178,296.00	0.11
332	002252	上海莱士	22,600	176,732.00	0.11
333	000553	安道麦A	38,800	176,152.00	0.11
334	601019	山东出版	14,900	176,118.00	0.11
335	600332	白云山	6,000	175,980.00	0.11
336	000915	华特达因	5,800	174,928.00	0.11
337	600879	航天电子	22,300	173,271.00	0.11
338	600366	宁波韵升	33,100	172,782.00	0.10
339	603766	隆鑫通用	25,300	171,534.00	0.10
340	002843	泰嘉股份	11,200	171,472.00	0.10
341	002837	英维克	8,000	171,120.00	0.10
341	002585	双星新材	34,500	171,120.00	0.10
343	002212	天融信	35,100	170,937.00	0.10
344	000761	本钢板材	68,100	170,931.00	0.10
345	603486	科沃斯	3,600	169,848.00	0.10
346	600309	万华化学	2,100	169,806.00	0.10
347	601811	新华文轩	12,100	169,521.00	0.10
348	002043	兔宝宝	16,300	169,031.00	0.10
349	002643	万润股份	16,900	169,000.00	0.10
350	605198	安德利	6,400	168,960.00	0.10
351	002120	韵达股份	21,800	168,732.00	0.10

352	601228	广州港	55,200	168,360.00	0.10
353	600558	大西洋	46,700	168,120.00	0.10
354	605188	国光连锁	21,600	167,400.00	0.10
355	603298	杭叉集团	8,400	164,976.00	0.10
356	300320	海达股份	20,200	164,832.00	0.10
357	601377	兴业证券	32,500	164,450.00	0.10
358	601916	浙商银行	59,400	163,944.00	0.10
359	600062	华润双鹤	8,300	162,514.00	0.10
360	002706	良信股份	23,600	161,896.00	0.10
361	600688	上海石化	62,000	161,820.00	0.10
362	003021	兆威机电	3,500	161,525.00	0.10
363	601298	青岛港	16,800	160,608.00	0.10
364	002371	北方华创	500	159,945.00	0.10
365	605196	华通线缆	15,200	159,904.00	0.10
366	601018	宁波港	47,000	159,800.00	0.10
367	002615	哈尔斯	25,700	159,340.00	0.10
368	002225	濮耐股份	38,400	157,056.00	0.10
369	688169	石头科技	400	157,040.00	0.10
370	000651	格力电器	4,000	156,880.00	0.10
371	000785	居然之家	63,300	153,819.00	0.09
372	688276	百克生物	5,400	153,198.00	0.09
373	600415	小商品城	20,500	152,110.00	0.09
374	601666	平煤股份	13,500	151,200.00	0.09
375	002739	万达电影	12,500	151,125.00	0.09
376	600058	五矿发展	22,800	150,480.00	0.09
377	002777	久远银海	10,000	149,900.00	0.09
378	002595	豪迈科技	3,900	148,863.00	0.09
379	600177	雅戈尔	20,900	148,808.00	0.09
380	000002	万科A	21,400	148,302.00	0.09
381	002925	盈趣科技	11,700	148,239.00	0.09
382	600809	山西汾酒	700	147,616.00	0.09

383	002917	金奥博	16,600	147,408.00	0.09
384	603939	益丰药房	6,000	147,300.00	0.09
385	600519	贵州茅台	100	146,739.00	0.09
386	300976	达瑞电子	3,200	146,720.00	0.09
387	000403	派林生物	5,500	146,630.00	0.09
388	688223	晶科能源	20,600	146,260.00	0.09
389	603393	新天然气	4,200	145,908.00	0.09
390	002182	宝武镁业	12,920	145,737.60	0.09
391	603703	盛洋科技	14,500	145,435.00	0.09
392	300418	昆仑万维	4,500	145,080.00	0.09
393	002948	青岛银行	43,000	144,910.00	0.09
394	688036	传音控股	1,880	143,895.20	0.09
395	600795	国电电力	23,900	143,161.00	0.09
396	300866	安克创新	2,000	142,420.00	0.09
397	002004	华邦健康	37,200	141,360.00	0.09
398	603166	福达股份	28,600	140,140.00	0.09
399	601163	三角轮胎	9,200	140,024.00	0.08
400	002391	长青股份	30,700	138,764.00	0.08
401	600817	宇通重工	16,900	138,580.00	0.08
402	605077	华康股份	9,050	138,012.50	0.08
403	300194	福安药业	36,900	138,006.00	0.08
404	301391	卡莱特	3,140	137,469.20	0.08
405	600126	杭钢股份	33,400	137,274.00	0.08
406	600939	重庆建工	59,100	137,112.00	0.08
407	000823	超声电子	16,100	137,011.00	0.08
408	002376	新北洋	25,300	136,367.00	0.08
409	603233	大参林	9,525	136,207.50	0.08
410	600261	阳光照明	50,400	136,080.00	0.08
411	300388	节能国祯	24,500	135,730.00	0.08
412	600350	山东高速	15,300	135,405.00	0.08
413	002637	赞宇科技	16,000	135,360.00	0.08

414	603680	今创集团	20,500	135,300.00	0.08
415	001914	招商积余	13,500	135,270.00	0.08
416	300016	北陆药业	30,600	134,946.00	0.08
417	300453	三鑫医疗	21,100	134,829.00	0.08
418	603507	振江股份	4,100	134,562.00	0.08
419	002997	瑞鹄模具	4,200	134,274.00	0.08
420	603999	读者传媒	28,300	133,859.00	0.08
421	603990	麦迪科技	15,200	132,392.00	0.08
422	600604	市北高新	38,200	132,172.00	0.08
423	002255	海陆重工	27,000	132,030.00	0.08
424	600617	国新能源	52,780	131,950.00	0.08
425	600372	中航机载	11,000	131,670.00	0.08
426	002845	同兴达	9,900	130,878.00	0.08
427	603535	嘉诚国际	8,100	130,734.00	0.08
428	603132	金徽股份	9,500	130,720.00	0.08
429	603195	公牛集团	1,695	130,718.40	0.08
430	600160	巨化股份	5,400	130,302.00	0.08
431	002032	苏泊尔	2,600	130,260.00	0.08
432	601069	西部黄金	11,200	130,256.00	0.08
433	002876	三利谱	5,400	130,248.00	0.08
434	601698	中国卫通	9,200	129,628.00	0.08
435	002546	新联电子	39,800	129,350.00	0.08
436	600511	国药股份	4,200	129,318.00	0.08
437	002597	金禾实业	6,500	129,285.00	0.08
438	002922	伊戈尔	5,900	128,974.00	0.08
439	002541	鸿路钢构	7,600	128,972.00	0.08
440	002507	涪陵榨菜	10,500	128,625.00	0.08
441	000726	鲁泰A	19,400	128,428.00	0.08
442	002274	华昌化工	17,300	128,366.00	0.08
443	300289	利德曼	33,300	128,205.00	0.08
444	002026	山东威达	15,400	127,820.00	0.08

445	603028	赛福天	22,600	127,238.00	0.08
446	002224	三力士	33,000	127,050.00	0.08
447	000027	深圳能源	17,400	127,020.00	0.08
448	003019	宸展光电	5,000	126,650.00	0.08
449	002812	恩捷股份	4,000	126,600.00	0.08
450	002429	兆驰股份	26,200	126,022.00	0.08
451	300037	新宙邦	4,400	125,664.00	0.08
452	002469	三维化学	21,900	124,830.00	0.08
453	600872	中炬高新	5,500	124,795.00	0.08
454	000059	华锦股份	29,700	124,443.00	0.08
455	600637	东方明珠	20,400	124,032.00	0.08
456	600167	联美控股	23,800	123,998.00	0.08
457	603871	嘉友国际	7,000	123,830.00	0.08
458	600483	福能股份	10,600	123,596.00	0.07
459	600252	中恒集团	56,700	123,039.00	0.07
460	000402	金融街	52,300	122,905.00	0.07
461	002353	杰瑞股份	3,500	122,780.00	0.07
462	688122	西部超导	3,200	122,624.00	0.07
463	600755	厦门国贸	17,100	122,607.00	0.07
464	603577	汇金通	17,600	122,144.00	0.07
465	000958	电投产融	33,300	121,878.00	0.07
466	002946	新乳业	13,900	121,764.00	0.07
467	600529	山东药玻	4,800	121,632.00	0.07
468	688425	铁建重工	33,000	121,440.00	0.07
469	600376	首开股份	57,800	121,380.00	0.07
469	002096	易普力	10,200	121,380.00	0.07
471	002152	广电运通	11,600	121,336.00	0.07
472	688167	炬光科技	2,200	121,000.00	0.07
473	300662	科锐国际	7,500	120,975.00	0.07
474	002240	盛新锂能	9,000	120,780.00	0.07
475	002330	得利斯	33,000	120,450.00	0.07



476	000967	盈峰环境	28,400	120,132.00	0.07
477	600517	国网英大	27,700	119,941.00	0.07
478	600416	湘电股份	12,000	119,280.00	0.07
479	000930	中粮科技	23,700	119,211.00	0.07
480	001289	龙源电力	6,900	119,025.00	0.07
481	000969	安泰科技	15,000	118,950.00	0.07
482	600032	浙江新能	16,300	118,664.00	0.07
483	000031	大悦城	50,700	118,638.00	0.07
484	000970	中科三环	15,500	118,575.00	0.07
485	002414	高德红外	20,000	117,800.00	0.07
486	000039	中集集团	12,700	117,602.00	0.07
487	300260	新莱应材	5,600	117,264.00	0.07
488	002294	信立泰	4,400	117,172.00	0.07
489	300257	开山股份	11,600	117,160.00	0.07
490	002575	群兴玩具	26,600	117,040.00	0.07
491	601568	北元集团	31,500	116,865.00	0.07
492	603056	德邦股份	8,900	116,590.00	0.07
493	601628	中国人寿	3,700	114,885.00	0.07
494	300999	金龙鱼	4,200	114,870.00	0.07
495	000932	华菱钢铁	25,900	114,737.00	0.07
496	601061	中信金属	16,700	114,729.00	0.07
497	301327	华宝新能	2,000	114,600.00	0.07
498	002737	葵花药业	4,900	114,562.00	0.07
499	600829	人民同泰	20,400	114,444.00	0.07
499	002399	海普瑞	13,200	114,444.00	0.07
501	003022	联泓新科	8,300	113,793.00	0.07
502	600500	中化国际	32,600	113,774.00	0.07
503	601969	海南矿业	17,900	113,486.00	0.07
504	601106	中国一重	49,100	113,421.00	0.07
505	000401	冀东水泥	27,900	113,274.00	0.07
506	002065	东华软件	24,900	112,548.00	0.07

507	603737	三棵树	3,100	112,437.00	0.07
508	000898	鞍钢股份	52,800	111,936.00	0.07
509	600886	国投电力	6,100	111,264.00	0.07
510	601669	中国电建	19,800	110,682.00	0.07
511	601390	中国中铁	16,900	110,188.00	0.07
512	600893	航发动力	3,000	109,650.00	0.07
513	600535	天士力	8,700	109,446.00	0.07
514	300219	鸿利智汇	19,500	109,005.00	0.07
515	600123	兰花科创	12,100	108,295.00	0.07
516	300750	宁德时代	600	108,018.00	0.07
517	600885	宏发股份	3,900	107,952.00	0.07
518	605499	东鹏饮料	500	107,875.00	0.07
519	300136	信维通信	5,500	107,690.00	0.07
520	300558	贝达药业	3,300	107,415.00	0.07
521	600668	尖峰集团	13,500	107,325.00	0.07
522	301589	诺瓦星云	569	106,977.69	0.06
523	600035	楚天高速	24,900	106,821.00	0.06
524	600020	中原高速	30,100	106,554.00	0.06
525	000701	厦门信达	28,200	105,468.00	0.06
526	600057	厦门象屿	15,500	105,400.00	0.06
527	601616	广电电气	36,000	104,760.00	0.06
528	300001	特锐德	5,200	104,624.00	0.06
529	603305	旭升集团	9,900	104,544.00	0.06
530	603866	桃李面包	20,600	104,442.00	0.06
531	688088	虹软科技	3,600	103,896.00	0.06
532	300888	稳健医疗	4,100	103,730.00	0.06
533	002616	长青集团	24,000	103,680.00	0.06
534	688153	唯捷创芯	2,800	103,600.00	0.06
535	300595	欧普康视	6,600	103,488.00	0.06
536	600271	航天信息	14,000	103,040.00	0.06
537	603819	神力股份	9,800	102,900.00	0.06

537	603551	奥普科技	10,500	102,900.00	0.06
539	002531	天顺风能	11,500	102,810.00	0.06
540	603920	世运电路	5,200	102,648.00	0.06
541	301207	华兰疫苗	5,800	102,486.00	0.06
542	002213	大为股份	10,500	102,375.00	0.06
543	002983	芯瑞达	6,137	102,181.05	0.06
544	688798	艾为电子	1,800	101,916.00	0.06
545	002078	太阳纸业	7,300	101,835.00	0.06
546	002275	桂林三金	8,200	101,762.00	0.06
547	600308	华泰股份	32,400	101,736.00	0.06
548	600740	山西焦化	25,900	101,528.00	0.06
549	603351	威尔药业	5,000	101,300.00	0.06
550	300996	普联软件	6,900	101,223.00	0.06
551	603638	艾迪精密	7,200	101,016.00	0.06
552	002314	南山控股	48,700	100,809.00	0.06
553	300369	绿盟科技	19,700	100,667.00	0.06
554	002054	德美化工	20,500	100,655.00	0.06
555	300642	透景生命	8,600	100,104.00	0.06
556	300737	科顺股份	23,200	99,760.00	0.06
557	600663	陆家嘴	11,300	99,666.00	0.06
558	300088	长信科技	21,200	99,640.00	0.06
559	300058	蓝色光标	18,200	99,008.00	0.06
560	002373	千方科技	10,900	98,863.00	0.06
561	600704	物产中大	22,700	98,518.00	0.06
562	600638	新黄浦	26,100	98,397.00	0.06
563	601330	绿色动力	16,900	98,358.00	0.06
564	688019	安集科技	780	98,124.00	0.06
565	002749	国光股份	6,500	97,760.00	0.06
566	600150	中国船舶	2,400	97,704.00	0.06
567	002019	亿帆医药	7,900	97,644.00	0.06
568	300226	上海钢联	5,700	96,558.00	0.06

569	000790	华神科技	27,900	96,534.00	0.06
570	600609	金杯汽车	27,800	96,466.00	0.06
571	300571	平治信息	4,600	96,324.00	0.06
572	600016	民生银行	25,400	96,266.00	0.06
573	001213	中铁特货	24,300	95,985.00	0.06
574	002996	顺博合金	16,390	95,881.50	0.06
575	603986	兆易创新	1,000	95,620.00	0.06
576	002404	嘉欣丝绸	18,000	95,220.00	0.06
577	603595	东尼电子	4,600	94,714.00	0.06
578	002707	众信旅游	16,500	94,710.00	0.06
579	600963	岳阳林纸	25,800	94,686.00	0.06
580	300120	经纬辉开	18,100	93,939.00	0.06
581	300181	佐力药业	6,200	93,744.00	0.06
582	605259	绿田机械	4,800	93,648.00	0.06
583	000892	欢瑞世纪	37,400	93,500.00	0.06
584	600718	东软集团	11,300	93,451.00	0.06
585	600699	均胜电子	6,300	93,366.00	0.06
586	600578	京能电力	28,800	93,312.00	0.06
587	002130	沃尔核材	6,600	93,192.00	0.06
588	600089	特变电工	6,700	92,929.00	0.06
589	000066	中国长城	10,600	92,750.00	0.06
590	600025	华能水电	8,600	92,708.00	0.06
591	600926	杭州银行	7,100	92,655.00	0.06
592	600900	长江电力	3,200	92,544.00	0.06
593	600760	中航沈飞	2,300	92,230.00	0.06
594	300113	顺网科技	9,000	92,160.00	0.06
595	000538	云南白药	1,800	92,070.00	0.06
596	300763	锦浪科技	2,200	91,608.00	0.06
597	603466	风语筑	10,700	91,378.00	0.06
598	603019	中科曙光	2,200	91,300.00	0.06
599	002250	联化科技	19,000	91,200.00	0.06

600	000301	东方盛虹	11,400	90,858.00	0.06
601	600346	恒力石化	6,500	90,675.00	0.05
602	600710	苏美达	11,100	90,465.00	0.05
603	000965	天保基建	34,500	90,390.00	0.05
604	000561	烽火电子	14,100	90,381.00	0.05
605	000598	兴蓉环境	12,000	90,240.00	0.05
606	600820	隧道股份	13,800	90,114.00	0.05
607	002044	美年健康	23,800	89,964.00	0.05
608	600458	时代新材	8,900	89,890.00	0.05
609	002935	天奥电子	7,440	89,875.20	0.05
610	002286	保龄宝	16,300	89,813.00	0.05
611	002782	可立克	8,100	89,748.00	0.05
612	002544	普天科技	4,800	89,712.00	0.05
613	300451	创业慧康	25,900	89,614.00	0.05
614	603291	联合水务	7,300	89,498.00	0.05
615	688586	江航装备	9,600	89,280.00	0.05
616	300639	凯普生物	19,400	89,240.00	0.05
617	000828	东莞控股	9,900	89,199.00	0.05
618	002003	伟星股份	7,100	89,105.00	0.05
619	603444	吉比特	500	89,005.00	0.05
620	688187	时代电气	1,800	88,884.00	0.05
621	002163	海南发展	16,200	88,776.00	0.05
622	000060	中金岭南	20,900	88,616.00	0.05
623	002030	达安基因	17,700	88,500.00	0.05
624	000683	远兴能源	12,800	88,448.00	0.05
625	000032	深桑达A	5,900	88,382.00	0.05
626	002142	宁波银行	4,000	88,240.00	0.05
627	002025	航天电器	1,900	88,122.00	0.05
628	600576	祥源文旅	20,000	87,800.00	0.05
629	600328	中盐化工	12,700	87,122.00	0.05
630	603882	金域医学	3,200	87,008.00	0.05

631	002831	裕同科技	3,400	87,006.00	0.05
632	300122	智飞生物	3,100	86,893.00	0.05
633	603032	德新科技	7,600	86,868.00	0.05
634	300547	川环科技	5,300	86,655.00	0.05
635	601838	成都银行	5,700	86,583.00	0.05
636	300323	华灿光电	19,900	86,565.00	0.05
637	600906	财达证券	15,100	86,523.00	0.05
638	688588	凌志软件	12,600	86,310.00	0.05
639	600623	华谊集团	14,900	86,122.00	0.05
640	002563	森马服饰	14,800	85,988.00	0.05
641	002627	三峡旅游	17,800	85,974.00	0.05
642	600976	健民集团	1,700	85,850.00	0.05
643	002261	拓维信息	7,700	85,239.00	0.05
644	688375	国博电子	1,200	84,768.00	0.05
645	688012	中微公司	600	84,756.00	0.05
646	002311	海大集团	1,800	84,690.00	0.05
647	600575	淮河能源	21,700	84,413.00	0.05
648	601369	陕鼓动力	10,500	84,210.00	0.05
649	688575	亚辉龙	3,607	84,115.24	0.05
650	600655	豫园股份	16,300	83,945.00	0.05
651	600780	通宝能源	14,200	83,780.00	0.05
652	300693	盛弘股份	4,000	83,760.00	0.05
653	600773	西藏城投	8,100	83,592.00	0.05
654	002170	芭田股份	13,900	83,539.00	0.05
655	301338	凯格精机	2,600	83,538.00	0.05
656	000030	富奥股份	17,000	83,470.00	0.05
657	603786	科博达	1,300	83,395.00	0.05
658	600316	洪都航空	5,000	83,150.00	0.05
659	002646	天佑德酒	8,100	82,863.00	0.05
660	002048	宁波华翔	6,400	82,816.00	0.05
661	000016	深康佳 A	38,800	82,644.00	0.05

662	600585	海螺水泥	3,500	82,565.00	0.05
663	002100	天康生物	11,900	82,467.00	0.05
664	688599	天合光能	4,800	81,216.00	0.05
665	002978	安宁股份	2,900	80,794.00	0.05
666	600170	上海建工	37,500	80,625.00	0.05
667	301035	润丰股份	1,800	80,172.00	0.05
668	601658	邮储银行	15,800	80,106.00	0.05
669	002184	海得控制	8,900	79,922.00	0.05
670	600339	中油工程	25,600	79,872.00	0.05
671	000762	西藏矿业	4,400	79,552.00	0.05
672	300059	东方财富	7,500	79,200.00	0.05
673	002171	楚江新材	11,900	78,421.00	0.05
674	301139	元道通信	3,600	77,436.00	0.05
675	000951	中国重汽	5,400	77,328.00	0.05
676	603181	皇马科技	8,600	77,314.00	0.05
677	000848	承德露露	9,800	77,028.00	0.05
678	002222	福晶科技	3,410	76,827.30	0.05
679	301246	宏源药业	5,700	76,722.00	0.05
680	603113	金能科技	14,000	76,580.00	0.05
681	002276	万马股份	10,500	75,285.00	0.05
682	600429	三元股份	20,000	74,600.00	0.05
683	688349	三一重能	3,000	74,520.00	0.05
684	600456	宝钛股份	2,900	74,037.00	0.04
685	605168	三人行	2,810	73,987.30	0.04
686	600827	百联股份	10,000	73,800.00	0.04
687	603658	安图生物	1,600	73,712.00	0.04
688	300856	科思股份	2,300	73,623.00	0.04
689	688598	金博股份	2,600	73,580.00	0.04
690	000811	冰轮环境	7,600	73,340.00	0.04
691	688295	中复神鹰	3,600	73,080.00	0.04
692	300348	长亮科技	10,700	72,974.00	0.04

693	301015	百洋医药	3,100	72,943.00	0.04
694	002991	甘源食品	1,200	72,780.00	0.04
695	601089	福元医药	5,200	72,020.00	0.04
696	002017	东信和平	8,600	71,638.00	0.04
697	603883	老百姓	3,900	71,604.00	0.04
698	002145	中核钛白	21,800	71,504.00	0.04
699	301116	益客食品	8,000	71,440.00	0.04
700	000921	海信家电	2,200	70,928.00	0.04
701	002439	启明星辰	4,000	69,040.00	0.04
702	300573	兴齐眼药	420	68,880.00	0.04
703	003005	竞业达	3,300	68,772.00	0.04
704	688772	珠海冠宇	4,600	68,540.00	0.04
705	000528	柳工	6,100	68,259.00	0.04
706	002372	伟星新材	4,400	67,848.00	0.04
707	688333	铂力特	1,400	67,830.00	0.04
708	600925	苏能股份	13,400	67,670.00	0.04
709	600928	西安银行	20,600	67,362.00	0.04
710	000703	恒逸石化	9,500	67,355.00	0.04
711	601156	东航物流	3,300	67,155.00	0.04
712	605009	豪悦护理	1,700	67,048.00	0.04
713	002738	中矿资源	2,500	67,000.00	0.04
714	000636	风华高科	5,100	66,606.00	0.04
715	601633	长城汽车	2,600	65,780.00	0.04
715	300259	新天科技	26,000	65,780.00	0.04
717	300454	深信服	1,300	65,689.00	0.04
718	688017	绿的谐波	800	65,680.00	0.04
719	002408	齐翔腾达	11,700	65,520.00	0.04
720	603858	步长制药	4,300	65,145.00	0.04
721	603816	顾家家居	2,000	64,580.00	0.04
722	000333	美的集团	1,000	64,500.00	0.04
723	000058	深赛格	12,000	64,440.00	0.04



724	688225	亚信安全	5,600	63,448.00	0.04
725	000596	古井贡酒	300	63,321.00	0.04
726	601857	中国石油	6,100	62,952.00	0.04
727	600764	中国海防	3,200	62,816.00	0.04
728	603618	杭电股份	14,300	62,634.00	0.04
729	300080	易成新能	21,600	62,208.00	0.04
730	601702	华峰铝业	3,400	62,084.00	0.04
731	603878	武进不锈	9,400	61,476.00	0.04
732	002653	海思科	2,000	61,400.00	0.04
733	603128	华贸物流	10,600	61,162.00	0.04
734	002249	大洋电机	12,900	61,017.00	0.04
735	002440	闰土股份	11,200	60,816.00	0.04
736	603317	天味食品	5,200	59,332.00	0.04
737	001269	欧晶科技	2,100	58,380.00	0.04
738	002183	怡亚通	20,200	57,368.00	0.03
739	000960	锡业股份	3,700	57,313.00	0.03
740	002465	海格通信	5,500	56,980.00	0.03
741	688131	皓元医药	2,964	56,701.32	0.03
742	002223	鱼跃医疗	1,500	56,400.00	0.03
743	300065	海兰信	8,500	56,185.00	0.03
744	300795	米奥会展	3,200	56,096.00	0.03
745	603106	恒银科技	13,100	55,806.00	0.03
746	000997	新大陆	4,000	55,640.00	0.03
747	688516	奥特维	1,320	55,189.20	0.03
748	002705	新宝股份	3,900	54,873.00	0.03
749	600956	新天绿能	6,700	54,739.00	0.03
750	603712	七一二	3,000	54,570.00	0.03
751	601218	吉鑫科技	19,200	53,568.00	0.03
752	300433	蓝思科技	2,900	52,925.00	0.03
753	003816	中国广核	11,400	52,782.00	0.03
754	300682	朗新集团	6,200	52,762.00	0.03

755	002082	万邦德	12,500	52,625.00	0.03
756	600877	电科芯片	4,900	52,528.00	0.03
757	300379	东方通	6,500	52,520.00	0.03
758	300439	美康生物	5,700	52,212.00	0.03
759	600176	中国巨石	4,700	51,935.00	0.03
760	600562	国睿科技	3,800	51,908.00	0.03
761	603328	依顿电子	6,600	51,876.00	0.03
762	601166	兴业银行	2,900	51,098.00	0.03
763	600908	无锡银行	9,400	50,008.00	0.03
764	002895	川恒股份	2,700	49,437.00	0.03
765	600038	中直股份	1,200	49,332.00	0.03
766	002332	仙琚制药	4,300	49,063.00	0.03
767	000887	中鼎股份	4,000	48,960.00	0.03
768	600499	科达制造	5,800	48,894.00	0.03
769	603799	华友钴业	2,200	48,686.00	0.03
770	601908	京运通	19,200	48,576.00	0.03
771	300298	三诺生物	1,900	48,146.00	0.03
772	300498	温氏股份	2,400	47,568.00	0.03
773	002603	以岭药业	3,100	47,523.00	0.03
774	600395	盘江股份	7,900	47,479.00	0.03
775	601949	中国出版	8,000	47,280.00	0.03
776	600391	航发科技	3,100	47,275.00	0.03
777	688372	伟测科技	1,200	47,196.00	0.03
778	000029	深深房A	4,400	46,772.00	0.03
779	600549	厦门钨业	2,700	46,575.00	0.03
780	600810	神马股份	7,500	46,500.00	0.03
781	688596	正帆科技	1,400	46,200.00	0.03
781	603369	今世缘	1,000	46,200.00	0.03
783	600037	歌华有线	7,700	46,046.00	0.03
784	600610	中毅达	11,500	45,770.00	0.03
785	688819	天能股份	1,918	45,763.48	0.03

786	001267	汇绿生态	8,500	44,795.00	0.03
787	688209	英集芯	3,605	44,738.05	0.03
788	603308	应流股份	3,600	44,712.00	0.03
789	600118	中国卫星	2,000	44,460.00	0.03
790	300432	富临精工	6,900	44,436.00	0.03
791	300394	天孚通信	500	44,210.00	0.03
792	600508	上海能源	3,100	43,865.00	0.03
793	601990	南京证券	5,700	43,776.00	0.03
794	600198	大唐电信	8,500	43,775.00	0.03
795	300604	长川科技	1,600	43,472.00	0.03
796	601528	瑞丰银行	9,200	43,424.00	0.03
797	300919	中伟股份	1,400	43,386.00	0.03
798	600800	渤海化学	21,500	42,785.00	0.03
799	603456	九洲药业	3,100	42,532.00	0.03
800	600875	东方电气	2,300	42,435.00	0.03
801	600028	中国石化	6,700	42,344.00	0.03
802	002916	深南电路	400	42,308.00	0.03
803	601169	北京银行	7,200	42,048.00	0.03
804	600559	老白干酒	2,300	41,814.00	0.03
805	600323	瀚蓝环境	2,000	41,800.00	0.03
806	688239	航宇科技	1,200	41,760.00	0.03
807	600110	诺德股份	13,600	41,480.00	0.03
808	000607	华媒控股	13,400	41,406.00	0.03
809	002244	滨江集团	5,700	41,382.00	0.03
810	000513	丽珠集团	1,100	40,931.00	0.02
811	300408	三环集团	1,400	40,866.00	0.02
812	002283	天润工业	9,500	40,755.00	0.02
813	601872	招商轮船	4,800	40,560.00	0.02
814	601000	唐山港	8,600	40,420.00	0.02
815	600228	返利科技	8,300	40,338.00	0.02
816	300748	金力永磁	3,100	40,176.00	0.02

817	000555	神州信息	4,300	40,076.00	0.02
818	603558	健盛集团	4,000	39,800.00	0.02
819	603033	三维股份	3,400	39,780.00	0.02
820	600690	海尔智家	1,400	39,732.00	0.02
821	000950	重药控股	8,100	39,447.00	0.02
822	688378	奥来德	1,680	39,412.80	0.02
823	000708	中信特钢	2,900	39,353.00	0.02
824	000795	英洛华	7,100	39,334.00	0.02
825	300973	立高食品	1,400	39,326.00	0.02
826	601515	东峰集团	10,700	39,055.00	0.02
827	002466	天齐锂业	1,300	38,883.00	0.02
828	300142	沃森生物	3,400	38,692.00	0.02
829	600985	淮北矿业	2,300	38,502.00	0.02
830	600276	恒瑞医药	1,000	38,460.00	0.02
831	688686	奥普特	600	38,418.00	0.02
832	000998	隆平高科	3,900	38,337.00	0.02
833	601877	正泰电器	2,000	38,120.00	0.02
834	603915	国茂股份	3,700	38,073.00	0.02
835	688063	派能科技	949	37,684.79	0.02
836	688630	芯碁微装	600	37,542.00	0.02
837	601778	晶科科技	16,400	37,392.00	0.02
838	003035	南网能源	8,400	36,960.00	0.02
839	002099	海翔药业	7,200	36,792.00	0.02
840	000690	宝新能源	7,200	36,720.00	0.02
841	300993	玉马遮阳	4,100	36,654.00	0.02
842	601678	滨化股份	10,500	36,540.00	0.02
843	600825	新华传媒	9,500	36,005.00	0.02
844	300124	汇川技术	700	35,910.00	0.02
845	600206	有研新材	4,000	35,600.00	0.02
846	600481	双良节能	7,600	35,492.00	0.02
847	002035	华帝股份	5,600	34,888.00	0.02

848	603881	数据港	2,730	34,698.30	0.02
849	600031	三一重工	2,100	34,650.00	0.02
850	600848	上海临港	3,800	34,618.00	0.02
851	600000	浦发银行	4,200	34,566.00	0.02
852	300896	爱美客	200	34,420.00	0.02
853	002661	克明食品	4,600	34,362.00	0.02
854	688110	东芯股份	1,800	34,326.00	0.02
855	002733	雄韬股份	3,100	33,387.00	0.02
856	688281	华秦科技	400	33,328.00	0.02
857	000789	万年青	7,300	33,142.00	0.02
858	603569	长久物流	4,800	32,928.00	0.02
859	301370	国科恒泰	3,000	32,610.00	0.02
860	002556	辉隆股份	7,800	32,526.00	0.02
861	600017	日照港	12,100	32,307.00	0.02
862	605365	立达信	2,000	31,740.00	0.02
863	000837	秦川机床	4,300	31,648.00	0.02
864	000818	航锦科技	1,400	30,912.00	0.02
865	688050	爱博医疗	420	30,794.40	0.02
866	300253	卫宁健康	5,200	30,680.00	0.02
867	600104	上汽集团	2,200	30,492.00	0.02
868	300741	华宝股份	2,000	30,480.00	0.02
869	002027	分众传媒	5,000	30,300.00	0.02
870	002192	融捷股份	1,000	30,020.00	0.02
871	002487	大金重工	1,300	29,744.00	0.02
872	300224	正海磁材	3,200	29,632.00	0.02
873	600012	皖通高速	2,100	29,337.00	0.02
874	300476	胜宏科技	900	29,034.00	0.02
875	688033	天宜上佳	4,800	28,800.00	0.02
876	000568	泸州老窖	200	28,698.00	0.02
877	002299	圣农发展	2,100	28,644.00	0.02
878	300512	中亚股份	4,800	28,416.00	0.02

879	688190	云路股份	380	28,389.80	0.02
880	600583	海油工程	4,800	28,368.00	0.02
881	600061	国投资本	5,000	28,250.00	0.02
882	002174	游族网络	3,700	28,083.00	0.02
883	603288	海天味业	800	27,576.00	0.02
884	603489	八方股份	1,000	26,980.00	0.02
885	300770	新媒股份	800	26,704.00	0.02
886	603997	继峰股份	2,600	26,598.00	0.02
887	601279	英利汽车	7,100	26,483.00	0.02
888	688660	电气风电	9,000	25,920.00	0.02
889	603385	惠达卫浴	4,600	25,254.00	0.02
890	600728	佳都科技	6,600	24,486.00	0.01
891	603606	东方电缆	500	24,405.00	0.01
892	002624	完美世界	3,200	24,320.00	0.01
893	300183	东软载波	2,100	24,318.00	0.01
894	688091	上海谊众	1,000	22,590.00	0.01
895	600497	驰宏锌锗	4,200	22,428.00	0.01
896	002511	中顺洁柔	3,200	22,144.00	0.01
897	603713	密尔克卫	400	21,408.00	0.01
898	300414	中光防雷	3,200	21,152.00	0.01
899	600098	广州发展	3,200	20,480.00	0.01
900	002326	永太科技	2,500	19,550.00	0.01
901	603350	安乃达	906	18,627.36	0.01
902	688779	长远锂科	4,000	18,520.00	0.01
903	601225	陕西煤业	700	18,039.00	0.01
904	300861	美畅股份	900	17,415.00	0.01
905	688032	禾迈股份	149	17,102.22	0.01
906	600958	东方证券	2,200	16,720.00	0.01
907	300821	东岳硅材	2,400	16,416.00	0.01
908	603285	键邦股份	879	16,393.35	0.01
909	002791	坚朗五金	500	12,935.00	0.01

910	000858	五粮液	100	12,804.00	0.01
911	688692	达梦数据	60	10,495.80	0.01
912	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.01
913	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.01
914	688709	成都华微	474	8,906.46	0.01
915	301538	骏鼎达	95	8,667.80	0.01
916	301536	星辰科技	256	8,261.12	0.01
917	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
918	301565	中仑新材	383	7,269.34	0.00
919	688691	灿芯股份	170	7,226.70	0.00
920	301580	爱迪特	106	6,988.58	0.00
921	301578	辰奕智能	153	6,054.21	0.00
922	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
923	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
924	688584	上海合晶	343	5,450.27	0.00
925	688695	中创股份	168	5,300.40	0.00
926	601033	永兴股份	332	5,298.72	0.00
927	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
928	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
929	603341	龙旗科技	77	2,886.73	0.00
930	688292	浩瀚深度	183	2,829.18	0.00
931	603375	盛景微	71	2,761.90	0.00
932	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00
933	603004	鼎龙科技	149	2,525.55	0.00
934	001379	腾达科技	185	2,493.80	0.00
935	603312	西典新能	90	2,282.40	0.00
936	001359	平安电工	99	2,039.40	0.00
937	603344	星德胜	84	1,903.44	0.00
938	603381	永臻股份	73	1,834.49	0.00
939	000836	ST富通	63,400	-	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	688111	金山办公	2,524,128.55	0.96
2	603392	万泰生物	2,476,465.00	0.94
3	000651	格力电器	2,399,866.00	0.92
4	300896	爱美客	2,370,539.00	0.90
5	600919	江苏银行	2,237,006.00	0.85
6	601211	国泰君安	2,225,169.00	0.85
7	000100	TCL科技	2,189,399.00	0.84
8	300274	阳光电源	2,110,766.00	0.81
9	002141	*ST贤丰	2,011,342.00	0.77
10	605138	盛泰集团	1,884,084.00	0.72
11	000725	京东方A	1,861,329.00	0.71
12	601888	中国中免	1,852,431.00	0.71
13	603993	洛阳钼业	1,837,304.00	0.70
14	000933	神火股份	1,823,002.00	0.70
15	002128	电投能源	1,783,880.00	0.68
16	002490	ST墨龙	1,767,391.00	0.67
17	603501	韦尔股份	1,741,623.00	0.66
18	300111	向日葵	1,725,507.00	0.66
19	300232	洲明科技	1,712,913.00	0.65
20	601099	太平洋	1,639,382.00	0.63

## 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	600828	茂业商业	2,896,769.00	1.11
2	300502	新易盛	2,890,343.00	1.10
3	300308	中际旭创	2,857,379.00	1.09
4	601398	工商银行	2,600,433.00	0.99
5	300394	天孚通信	2,455,011.00	0.94
6	002578	闽发铝业	2,416,874.00	0.92
7	000651	格力电器	2,374,976.00	0.91
8	300274	阳光电源	2,364,513.00	0.90
9	300760	迈瑞医疗	2,364,499.00	0.90
10	002371	北方华创	2,361,158.00	0.90
11	300750	宁德时代	2,337,075.00	0.89
12	600919	江苏银行	2,335,777.00	0.89
13	002996	顺博合金	2,315,037.00	0.88
14	000100	TCL科技	2,295,582.00	0.88
15	300624	万兴科技	2,275,500.00	0.87
16	601006	大秦铁路	2,248,188.00	0.86
17	300512	中亚股份	2,246,078.00	0.86
18	688041	海光信息	2,245,889.32	0.86
19	601099	太平洋	2,244,566.00	0.86
20	000725	京东方 A	2,234,832.00	0.85

### 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	694,815,976.31
卖出股票收入（成交）总额	751,012,771.54

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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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)	28,002.09	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	28,002.09	0.02

#### 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	113685	升24转债	280	28,002.09	0.02

注:本基金本报告期末仅持有一只债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内本基金投资的前十名证券除景旺电子（证券代码：603228）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03月22日，景旺电子（证券代码：603228）发行人深圳市景旺电子股份有限公司因违反外汇登记管理规定被国家外汇管理局深圳市分局给予警告处罚款人民币4万元。

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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	228,626.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	228,626.37

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能存在尾差。

### §8 基金份额持有人信息

#### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
泓德智选启元混合A	622	129,771.70	13,854,662.01	17.16%	66,863,332.65	82.84%
泓德智选启元混合C	2,724	40,165.28	16,139,651.04	14.75%	93,270,575.54	85.25%
合计	3,318	57,302.06	29,994,313.05	15.78%	160,133,908.19	84.22%

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	占基金总份额比
----	------	--------	---------

		(份)	例
基金管理人所有从业人员持有本基金	泓德智选启元混合A	834.42	0.00%
	泓德智选启元混合C	3,392.93	0.00%
	合计	4,227.35	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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	泓德智选启元混合A	0
	泓德智选启元混合C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	泓德智选启元混合A	0
	泓德智选启元混合C	0
	合计	0

### §9 开放式基金份额变动

单位：份

	泓德智选启元混合A	泓德智选启元混合C
基金合同生效日(2023年11月21日)基金份额总额	42,080,923.58	224,380,465.76
本报告期期初基金份额总额	42,080,923.58	224,380,465.76
本报告期基金总申购份额	96,077,697.68	39,057,942.15

减：本报告期基金总赎回份额	57,440,626.60	154,028,181.33
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	80,717,994.66	109,410,226.58

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

2024年3月26日，本基金托管人发布公告，专门基金托管部门联席负责人冯伟到龄退休，变更后的部门负责人为卢小群。

### 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及其高级管理人员未收到稽查或处罚。

## 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	
华泰证券	2	936,662,847.80	64.83%	675,606.34	64.83%	-
开源证券	2	465,303,883.06	32.20%	335,616.59	32.20%	-
中银国际证券	2	42,871,216.61	2.97%	30,922.26	2.97%	-

注：1、本基金采用券商结算模式，本报告期内管理人选择华泰证券、开源证券、中银国际证券作为证券经纪商。

2、本基金采用证券公司交易结算模式，可免于执行《关于完善证券投资基金交易席位有关问题的通知》中关于交易佣金分仓的规定。

3、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。

4、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。

5、交易佣金包含已由证券经纪商扣收的相关交易费用。本基金本报告期内未租用其他证券公司交易单元进行证券投资。

### 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
华泰证券	218,517.00	73.80%	-	-	-	-	-	-
开源证券	77,580.00	26.20%	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-	-	-

### 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基金投资关联方承销期内承销证券的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2024-01-05
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、中国证券报、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泓德智选启元混合型证券投资基金增加中银国际证券股份有限公司为销售机构的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2024-01-25
4	泓德基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2024-02-01
5	泓德基金管理有限公司关于泓德智选启元混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2024-02-02
6	泓德基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2024-02-24
7	泓德基金管理有限公司关于	公司官网、中国证券报、中	2024-03-20



	旗下部分基金增加腾安基金销售（深圳）有限公司为销售机构并开通转换业务的公告	中国证监会基金电子披露网站	
8	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、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2024-05-29
9	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金所持股票估值方法调整的提示性公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2024-06-22

## §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智选启元混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《泓德智选启元混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《泓德智选启元混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《泓德智选启元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