

# 泓德臻远回报灵活配置混合型证券投资基金

## 2020 年中期报告

2020 年 06 月 30 日

基金管理人:泓德基金管理有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

送出日期:2020 年 08 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2020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2020年01月01日起至2020年06月30日止。

## 1.2 目录

|                                         |    |
|-----------------------------------------|----|
| §1 重要提示及目录                              | 2  |
| 1.1 重要提示                                | 2  |
| 1.2 目录                                  | 3  |
| §2 基金简介                                 | 5  |
| 2.1 基金基本情况                              | 5  |
| 2.2 基金产品说明                              | 5  |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 6  |
| 2.4 信息披露方式                              | 6  |
| 2.5 其他相关资料                              | 7  |
| §3 主要财务指标和基金净值表现                        | 7  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 7  |
| 3.2 基金净值表现                              | 8  |
| §4 管理人报告                                | 9  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 9  |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 10 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 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 | 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 中期财务会计报告(未经审计)                       | 14 |
| 6.1 资产负债表                               | 14 |
| 6.2 利润表                                 | 16 |
| 6.3 所有者权益(基金净值)变动表                      | 17 |
| 6.4 报表附注                                | 19 |
| §7 投资组合报告                               | 39 |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 39 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 40 |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细       | 41 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 43 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 45 |
| 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      | 46 |
| 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   | 46 |
| 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   | 46 |
| 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      | 46 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明               | 46 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明               | 46 |
| 7.12 投资组合报告附注                           | 47 |
| §8 基金份额持有人信息                            | 48 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构                   | 48 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况                | 48 |

|                                    |    |
|------------------------------------|----|
| 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   | 48 |
| §9 开放式基金份额变动                       | 48 |
| §10 重大事件揭示                         | 49 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议                   | 49 |
| 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   | 49 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼        | 49 |
| 10.4 基金投资策略的改变                     | 49 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况              | 49 |
| 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      | 49 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况             | 49 |
| 10.8 其他重大事件                        | 51 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息                 | 53 |
| 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 | 53 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息                | 53 |
| §12 备查文件目录                         | 53 |
| 12.1 备查文件目录                        | 53 |
| 12.2 存放地点                          | 53 |
| 12.3 查阅方式                          | 53 |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                     |
|------------|---------------------|
| 基金名称       | 泓德臻远回报灵活配置混合型证券投资基金 |
| 基金简称       | 泓德臻远回报混合            |
| 基金主代码      | 005395              |
| 基金运作方式     | 契约型开放式              |
| 基金合同生效日    | 2018年05月04日         |
| 基金管理人      | 泓德基金管理有限公司          |
| 基金托管人      | 招商银行股份有限公司          |
| 报告期末基金份额总额 | 2,751,430,510.87份   |
| 基金合同存续期    | 不定期                 |

### 2.2 基金产品说明

|      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
|------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标 | 本基金在严格控制风险的前提下，通过合理的资产配置，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 | <p>本基金通过研究宏观经济未来长期运行趋势及调控政策规律，结合对股票、债券等大类资产运行趋势、风险收益对比及估值情况等进行的综合分析，进行本基金资产在股票、债券等大类资产的配置。</p> <p>在A股投资方面，本基金主要采取自上而下和自下而上相结合的方法进行股票投资。在行业投资层面，本基金选择长期成长行业进行重点投资。在个股投资层面，本基金重点投资于长期成长行业中具有竞争优势的上市公司。在港股通标的股票投资层面，在对A、H股溢价水平进行重点分析和趋势预测的前提下，本基金管理人将优选香港市场与国内A股在部分行业形成有效互补的行业和上市公司。</p> <p>本基金债券投资采取适当的久期策略、信用策略、时机策略和可转换债券投资策略相结合的方法。</p> <p>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。权证投资以控制风险和锁定收益为主要目的。</p> |

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
|--------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率×75%+中证综合债券指数收益率×25%                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 风险收益特征 | <p>本基金为混合型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的品种，其长期预期风险与预期收益特征低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。</p> <p>本基金除了投资于A股市场优质企业外，还可在法律法规规定的范围内投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险（港股市场实行T+0回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比A股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对基金的投资收益造成损失）、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险（在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）等。</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                | 招商银行股份有限公司             |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 李晓春                       | 张燕                     |
|         | 联系电话 | 010-59850177              | 0755-83199084          |
|         | 电子邮箱 | lixiaochun@hongdefund.com | yan_zhang@cmbchina.com |
| 客户服务电话  |      | 4009-100-888              | 95555                  |
| 传真      |      | 010-59322130              | 0755-83195201          |
| 注册地址    |      | 西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦1206室        | 深圳市深南大道7088号招商银行大厦     |
| 办公地址    |      | 北京市西城区德胜门外大街125号          | 深圳市深南大道7088号招商银行大厦     |
| 邮政编码    |      | 100088                    | 518040                 |
| 法定代表人   |      | 王德晓                       | 李建红                    |

### 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（2020年01月01日- 2020年06月30日） |
|---------------|-------------------------------|
| 本期已实现收益       | 108,595,438.21                |
| 本期利润          | 707,099,986.67                |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.2878                        |
| 本期加权平均净值利润率   | 23.07%                        |
| 本期基金份额净值增长率   | 24.09%                        |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末（2020年06月30日）             |
| 期末可供分配利润      | 168,706,578.59                |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0613                        |
| 期末基金资产净值      | 4,027,759,902.41              |
| 期末基金份额净值      | 1.4639                        |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末（2020年06月30日）             |
| 基金份额累计净值增长率   | 64.68%                        |

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段             | 份额净值<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | ①-③    | ②-④   |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|---------------------------|--------|-------|
| 过去一个月          | 11.89%       | 0.99%               | 5.53%              | 0.67%                     | 6.36%  | 0.32% |
| 过去三个月          | 29.42%       | 1.11%               | 9.55%              | 0.67%                     | 19.87% | 0.44% |
| 过去六个月          | 24.09%       | 1.67%               | 2.09%              | 1.13%                     | 22.00% | 0.54% |
| 过去一年           | 53.93%       | 1.33%               | 8.26%              | 0.91%                     | 45.67% | 0.42% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 64.68%       | 1.41%               | 11.44%             | 1.02%                     | 53.24% | 0.39% |

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×75%+中证综合债券指数收益率×25%

基准指数的构建原则如下：

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

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

（3）由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照75%、25%的比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

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



泓德臻远回报灵活配置混合型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2018年05月04日-2020年06月30日)



注：根据基金合同的约定，本基金建仓期为6个月，截至报告期末，本基金的各项投资比例符合基金合同关于投资范围及投资限制规定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金基金管理人为泓德基金管理有限公司（以下简称“公司”），成立于2015年3月3日，是经中国证监会证监许可[2015]258号文批准设立的我国第一家由专业人士发起设立的公募基金管理公司。公司注册资本为人民币14300万元，公司注册地拉萨市。目前，公司股东及其出资比例为：王德晓先生25.91%，阳光资产管理股份有限公司20.98%，泓德基业控股股份有限公司20.00%，珠海市基业长青股权投资基金（有限合伙）11.26%，南京民生租赁股份有限公司9.38%，江苏岛村实业发展有限公司9.38%，上海捷朔信息技术有限公司3.10%。

截至2020年6月30日，公司总资产管理规模为847.69亿元，其中公募基金管理规模621.39亿元，专户产品管理规模226.31亿元。2020年上半年，公司新发行4只公募基金产品，其中混合型基金3只，债券型基金1只。自成立起至2020年6月30日，公司累计发行了29只公募基金产品：其中混合型基金17只，具体包括泓德优选成长混合、泓德泓富混合、泓德远见回报混合、泓德泓业混合、泓德泓益量化混合、泓德泓信混合、泓德泓汇混合、泓德泓华混合、泓德优势领航混合、泓德致远混合、泓德臻远回报混合、泓德三年封闭丰泽混合、泓德研究优选混合、泓德量化精选混合、泓德丰润三年持有期混合、

泓德睿泽混合、泓德睿享一年持有期混合；股票型基金1只，具体为泓德战略转型股票；债券型基金9只，具体包括泓德裕泰债券、泓德裕康债券、泓德裕荣纯债、泓德裕和纯债、泓德裕祥债券、泓德裕泽一年定开债券、泓德裕鑫一年定开债券、泓德裕丰中短债、泓德裕瑞三年定开债券；货币基金2只，具体为泓德泓利货币、泓德添利货币。同时，公司管理多只特定客户资产管理计划。

#### 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<br>经理（助理）<br>期限 |          | 证<br>券<br>从<br>业<br>年<br>限 | 说明                                                                                                                                                                  |
|-----|-------------------------------------------------------------------|-------------------------|----------|----------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |                                                                   | 任职<br>日期                | 离任<br>日期 |                            |                                                                                                                                                                     |
| 邬传雁 | 公司副总经理、事业二部总监，泓德远见回报混合、泓德致远混合、泓德臻远回报混合、泓德三年封闭丰泽混合、泓德丰润三年持有期混合基金经理 | 2018-05-04              | -        | 6年                         | 硕士研究生，具有基金从业资格，资管行业从业经验20年，曾任幸福人寿保险股份有限公司总裁助理兼投资管理中心总经理，阳光保险集团股份有限公司资产投资管理中心投资负责人，阳光财产保险股份有限公司资金运用部总经理助理，光大永明人寿保险公司投资部投资分析主管，光大证券股份有限公司研究所分析师，华泰财产保险公司投资管理中心基金部副经理。 |

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》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》及其各项实施细则、《泓德臻远回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，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

本报告期内未出现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

2020年上半年，本基金坚定地坚持“风控第一、事前风控、长期投资”的投资理念。一季度A股市场在受全球性突发新冠疫情的冲击出现系统性波动时，本基金在市场下跌时坚定地增加优质股票的买入力度，有效规避了因市场情绪冲击可能导致的操作策略风险。而且，在整个上半年本基金持续维持偏高的股票配置比例，没有进行任何短期降低股票配置比例的操作。

在广泛阅读和对外与专家沟通学习基础上，上半年本基金持续改善上市公司股票评价模型，增加了针对重大突发危机风险应对机制评估、无形资产评估、团队成员自驱动力评估等新的思维模式。一个企业投入资源和人力开发的高效的IT系统、组织构架、制度流程，以及多年构建和积累的优秀的企业文化，都会在企业未来的价值创造中发挥持续的卓越的贡献，这些其实也是企业的无形资产。无形资产的合理评估对我们合理认识现代企业的投资价值已经必不可少。

上半年本基金对企业基业长青问题的再思考有了有效进展。一个企业是否能基业长青，核心创始人的自我反思、纠错能力，以及整个团队的危机意识非常重要。一个企业能够基业长青的必要条件之一是，在现有经营欣欣向荣的时候能看到产品或管理方面的长期风险，坚决地通过延展培育下一个前瞻性产品，或者通过企业制度企业文化升级来培育企业的第二次（第三次甚至第四次）增长曲线。

整个上半年，本基金继续维持偏长期成长股票的组合结构，维持个股组合结构的相对稳定性，没有针对行业或产业短期趋势做任何调整，只是在对少数上市公司管理和治理情况反复考证的情况下进行调整，主要是增加了少量港股通股票的配置。上半年本基金绝大部分时间用于多维度考证持仓股票和潜在投资对象的管理能力方面，备选股票特别是港股通股票名单继续得到有效扩充。

股票组合的集中度明显下降。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末泓德臻远回报混合基金份额净值为1.4639元，本报告期内，基金份额净值增长率为24.09%，同期业绩比较基准收益率为2.09%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

#### 4.5.1 宏观经济和行业展望

宏观经济的大转型趋势已经非常清晰，科学技术（包括企业管理技术）向传统经济赋能成为核心的经济动能。劳动力人口红利的下降和资本稀缺性的下降正在改变许多行业的长期价值和风险。

本基金上半年对职业教育行业的长期投资价值的研究认知有了新的突破。

近一百年来，随着科技、公共医疗卫生、食品安全、生活理念诸多方面的综合进步，人类平均寿命持续上升，并仍保持上升趋势；相反随着技术革新频率加快，企业与行业的平均寿命呈下降趋势。显而易见地，越来越多的人在一辈子中会发生职业转换，职业教育的产业空间在全球范围被广阔地打开了。

而且，随着人类文化持续进化，教育特别是职业教育的内容正在长期扩展趋势中，除了传统的知识教育，经验教育以及价值观、思维模式等相关教育内容越来越重要。人们正在发现，过时的思维模式或价值观正在成为在职场取得成功的最大绊脚石。

#### 4.5.2 证券市场展望

本基金继续认为长期而言，债券市场处于长期偏牛的市场趋势中，但由于利率债绝对收益率较低，仅能满足资产保值需要，对许多追求长期资产增值的投资者而言缺乏足够吸引力。在适当承担信用风险前提下信用债的长期持有收益即使略高，对整个资产组合的增值作用也比较有限。

本基金预期，全球性新冠疫情过后，为了恢复经济，全球主要国家将在较长时间将实行宏观偏宽松政策，超长期结构型的牛市会在最近三年出现明显加速现象。

在偏牛的A股市场中，大量可转债不断触发赎回条款，偏债性的可转债规模正在而且将继续越来越少。

### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及本基金合同约定，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。

本基金管理人制订了证券投资基金估值政策与估值程序，设立基金估值小组，参考行业协会估值意见和独立第三方机构估值数据，确保基金估值的公平、合理。

本基金管理人制订的证券投资基金估值政策与估值程序确定了估值目的、估值日、估值对象、估值程序、估值方法以及估值差错处理、暂停估值和特殊情形处理等事项。本基金管理人设立了由公司总经理、督察长、投研总监、固定收益部、监察稽核部、运营支持部等部门负责人组成的基金估值小组，负责研究、指导并执行基金估值业务。小组成员均具有多年证券、基金从业经验，具备基金估值运作、行业研究、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进行利润分配。

本基金截至2020年6月30日，期末可供分配利润为168,706,578.59元，其中：未分配利润已实现部分为168,706,578.59元，未分配利润未实现部分为1,107,622,812.95元。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

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

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

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

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

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

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

**§ 6 中期财务会计报告(未经审计)****6.1 资产负债表**

会计主体：泓德臻远回报灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2020年06月30日

单位：人民币元

| 资 产         | 附注号     | 本期末<br>2020年06月30日 | 上年度末<br>2019年12月31日 |
|-------------|---------|--------------------|---------------------|
| <b>资 产：</b> |         |                    |                     |
| 银行存款        | 6.4.7.1 | 132,942,170.11     | 122,217,621.33      |
| 结算备付金       |         | 5,077,738.54       | 19,245,846.92       |
| 存出保证金       |         | 1,581,667.87       | 6,271,980.14        |
| 交易性金融资产     | 6.4.7.2 | 3,886,956,010.87   | 2,327,014,406.56    |
| 其中：股票投资     |         | 3,729,059,150.37   | 2,253,691,688.46    |
| 基金投资        |         | -                  | -                   |
| 债券投资        |         | 157,896,860.50     | 73,322,718.10       |
| 资产支持证券投资    |         | -                  | -                   |
| 贵金属投资       |         | -                  | -                   |
| 衍生金融资产      | 6.4.7.3 | -                  | -                   |
| 买入返售金融资产    | 6.4.7.4 | -                  | -                   |
| 应收证券清算款     |         | -                  | -                   |
| 应收利息        | 6.4.7.5 | 1,425,070.45       | 1,061,576.67        |

|                 |            |                            |                             |
|-----------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 应收股利            |            | 1,270,439.11               | -                           |
| 应收申购款           |            | 93,308,672.98              | 17,649,679.41               |
| 递延所得税资产         |            | -                          | -                           |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                          | -                           |
| 资产总计            |            | 4,122,561,769.93           | 2,493,461,111.03            |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2020年06月30日</b> | <b>上年度末<br/>2019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       |            | -                          | -                           |
| 应付证券清算款         |            | 45,736,769.67              | 46,865,012.23               |
| 应付赎回款           |            | 42,613,346.61              | 11,040,423.01               |
| 应付管理人报酬         |            | 4,459,511.90               | 2,754,062.63                |
| 应付托管费           |            | 743,251.99                 | 459,010.42                  |
| 应付销售服务费         |            | -                          | -                           |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 1,036,894.38               | 896,311.73                  |
| 应交税费            |            | 88.03                      | 106.56                      |
| 应付利息            |            | -                          | -                           |
| 应付利润            |            | -                          | -                           |
| 递延所得税负债         |            | -                          | -                           |
| 其他负债            | 6.4.7.8    | 212,004.94                 | 199,440.45                  |
| 负债合计            |            | 94,801,867.52              | 62,214,367.03               |
| <b>所有者权益:</b>   |            |                            |                             |
| 实收基金            | 6.4.7.9    | 2,751,430,510.87           | 2,060,818,489.03            |
| 未分配利润           | 6.4.7.10   | 1,276,329,391.54           | 370,428,254.97              |
| 所有者权益合计         |            | 4,027,759,902.41           | 2,431,246,744.00            |
| 负债和所有者权益总计      |            | 4,122,561,769.93           | 2,493,461,111.03            |

注：报告截止日2020年6月30日，基金份额净值1.4639元，基金份额总额2,751,430,510.87份。

## 6.2 利润表

会计主体：泓德臻远回报灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2020年01月01日至2020年06月30日

单位：人民币元

| 项 目                        | 附注号      | 本期2020年01月01<br>日至2020年06月3<br>0日 | 上年度可比期间<br>2019年01月01日至201<br>9年06月30日 |
|----------------------------|----------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 一、收入                       |          | 737,891,703.29                    | 105,634,228.18                         |
| 1. 利息收入                    |          | 1,892,386.29                      | 447,609.73                             |
| 其中：存款利息收入                  | 6.4.7.11 | 407,657.51                        | 49,471.81                              |
| 债券利息收入                     |          | 1,484,728.78                      | 396,589.15                             |
| 资产支持证券利息<br>收入             |          | -                                 | -                                      |
| 买入返售金融资产<br>收入             |          | -                                 | 1,548.77                               |
| 证券出借利息收入                   |          | -                                 | -                                      |
| 其他利息收入                     |          | -                                 | -                                      |
| 2. 投资收益（损失以“-”<br>填列）      |          | 129,769,590.20                    | 17,984,856.69                          |
| 其中：股票投资收益                  | 6.4.7.12 | 109,422,921.84                    | 14,729,755.73                          |
| 基金投资收益                     |          | -                                 | -                                      |
| 债券投资收益                     | 6.4.7.13 | 78,131.25                         | -66,000.00                             |
| 资产支持证券投资<br>收益             |          | -                                 | -                                      |
| 贵金属投资收益                    |          | -                                 | -                                      |
| 衍生工具收益                     | 6.4.7.14 | -                                 | -                                      |
| 股利收益                       | 6.4.7.15 | 20,268,537.11                     | 3,321,100.96                           |
| 3. 公允价值变动收益（损<br>失以“-”号填列） | 6.4.7.16 | 598,504,548.46                    | 86,743,919.25                          |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”<br>号填列）     |          | -                                 | -                                      |
| 5. 其他收入（损失以“-”             | 6.4.7.17 | 7,725,178.34                      | 457,842.51                             |



|                            |          |                |                |
|----------------------------|----------|----------------|----------------|
| 号填列)                       |          |                |                |
| <b>减：二、费用</b>              |          | 30,791,716.62  | 4,285,003.44   |
| 1. 管理人报酬                   |          | 22,948,733.85  | 3,092,287.09   |
| 2. 托管费                     |          | 3,824,788.97   | 515,381.18     |
| 3. 销售服务费                   |          | -              | -              |
| 4. 交易费用                    | 6.4.7.18 | 3,878,046.29   | 567,270.51     |
| 5. 利息支出                    |          | -              | 8,233.91       |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |          | -              | 8,233.91       |
| 6. 税金及附加                   |          | 91.24          | 106.43         |
| 7. 其他费用                    | 6.4.7.19 | 140,056.27     | 101,724.32     |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |          | 707,099,986.67 | 101,349,224.74 |
| <b>减：所得税费用</b>             |          | -              | -              |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |          | 707,099,986.67 | 101,349,224.74 |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泓德臻远回报灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2020年01月01日至2020年06月30日

单位：人民币元

| 项 目                        | 本期<br>2020年01月01日至2020年06月30日 |                |                  |
|----------------------------|-------------------------------|----------------|------------------|
|                            | 实收基金                          | 未分配利润          | 所有者权益合计          |
| 一、期初所有者权益（基金净值）            | 2,060,818,489.03              | 370,428,254.97 | 2,431,246,744.00 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）   | -                             | 707,099,986.67 | 707,099,986.67   |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以 | 690,612,021.84                | 198,801,149.90 | 889,413,171.74   |

|                                        |                                    |                  |                   |
|----------------------------------------|------------------------------------|------------------|-------------------|
| “-”号填列)                                |                                    |                  |                   |
| 其中: 1. 基金申购款                           | 2,646,030,013.85                   | 702,737,113.53   | 3,348,767,127.38  |
| 2. 基金赎回款                               | -1,955,417,992.01                  | -503,935,963.63  | -2,459,353,955.64 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | -                                  | -                | -                 |
| 五、期末所有者权益(基金净值)                        | 2,751,430,510.87                   | 1,276,329,391.54 | 4,027,759,902.41  |
| 项 目                                    | 上年度可比期间<br>2019年01月01日至2019年06月30日 |                  |                   |
|                                        | 实收基金                               | 未分配利润            | 所有者权益合计           |
| 一、期初所有者权益(基金净值)                        | 432,217,774.48                     | -73,218,301.89   | 358,999,472.59    |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -                                  | 101,349,224.74   | 101,349,224.74    |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)      | -55,762,542.47                     | -1,842,302.80    | -57,604,845.27    |
| 其中: 1. 基金申购款                           | 146,898,029.25                     | 8,439,688.77     | 155,337,718.02    |
| 2. 基金赎回款                               | -202,660,571.72                    | -10,281,991.57   | -212,942,563.29   |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | -                                  | -                | -                 |
| 五、期末所有者权益(基金净值)                        | 376,455,232.01                     | 26,288,620.05    | 402,743,852.06    |

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

王德晓

李娇

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

泓德臻远回报灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2017]2027号《关于准予泓德臻远回报灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准,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《泓德臻远回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集435,864,010.53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(2018)第0319号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泓德臻远回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2018年5月4日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为436,072,293.94份,其中认购资金利息折合208,283.41份基金份额。本基金的基金管理人为泓德基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泓德臻远回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、内地与香港股票市场交易互联互通机制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、中小企业私募债、证券公司短期公司债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、权证、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的投资组合比例:股票投资占基金资产的比例为0%-95%,其中投资于港股通标的股票占股票投资的比例为0%-50%。本基金每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后,保持现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×75%+中证综合债券指数收益率×25%。

### 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》、各项具体会计准则及相关规定(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》、《泓德臻远回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2020年01月01日至2020年06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2020年06月30日的财务状况以及2020年01月01日至2020年06月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

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

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

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

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

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

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

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

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

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目           | 本期末<br>2020年06月30日 |
|--------------|--------------------|
| 活期存款         | 132,942,170.11     |
| 定期存款         | —                  |
| 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         | —                  |
| 合计           | 132,942,170.11     |

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            |       | 本期末2020年06月30日   |                  |                |
|---------------|-------|------------------|------------------|----------------|
|               |       | 成本               | 公允价值             | 公允价值变动         |
| 股票            |       | 2,984,843,012.03 | 3,729,059,150.37 | 744,216,138.34 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -                | -                | -              |
| 债券            | 交易所市场 | 7,642,865.57     | 8,307,860.50     | 664,994.93     |
|               | 银行间市场 | 149,867,940.00   | 149,589,000.00   | -278,940.00    |
|               | 合计    | 157,510,805.57   | 157,896,860.50   | 386,054.93     |
| 资产支持证券        |       | -                | -                | -              |
| 基金            |       | -                | -                | -              |
| 其他            |       | -                | -                | -              |
| 合计            |       | 3,142,353,817.60 | 3,886,956,010.87 | 744,602,193.27 |

#### 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 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2020年06月30日 |
|------------|--------------------|
| 应收活期存款利息   | 14,314.38          |
| 应收定期存款利息   | -                  |
| 应收其他存款利息   | -                  |
| 应收结算备付金利息  | 3,377.21           |
| 应收债券利息     | 1,406,521.64       |
| 应收资产支持证券利息 | -                  |

|            |              |
|------------|--------------|
| 应收买入返售证券利息 | -            |
| 应收申购款利息    | -            |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -            |
| 应收出借证券利息   | -            |
| 其他         | 857.22       |
| 合计         | 1,425,070.45 |

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2020年06月30日 |
|-------------|--------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 1,036,594.38       |
| 银行间市场应付交易费用 | 300.00             |
| 合计          | 1,036,894.38       |

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2020年06月30日 |
|-------------|--------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                  |
| 应付赎回费       | 102,241.88         |
| 应付证券出借违约金   | -                  |
| 预提费用        | 109,398.38         |
| 应付转出费       | 364.68             |
| 合计          | 212,004.94         |

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期2020年01月01日至2020年06月30日 |      |
|----|---------------------------|------|
|    | 基金份额（份）                   | 账面金额 |

|               |                   |                   |
|---------------|-------------------|-------------------|
| 上年度末          | 2,060,818,489.03  | 2,060,818,489.03  |
| 本期申购          | 2,646,030,013.85  | 2,646,030,013.85  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -1,955,417,992.01 | -1,955,417,992.01 |
| 本期末           | 2,751,430,510.87  | 2,751,430,510.87  |

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分            | 未分配利润合计          |
|----------------|----------------|------------------|------------------|
| 上年度末           | 35,953,967.91  | 334,474,287.06   | 370,428,254.97   |
| 本期利润           | 108,595,438.21 | 598,504,548.46   | 707,099,986.67   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 24,157,172.47  | 174,643,977.43   | 198,801,149.90   |
| 其中：基金申购款       | 89,656,668.42  | 613,080,445.11   | 702,737,113.53   |
| 基金赎回款          | -65,499,495.95 | -438,436,467.68  | -503,935,963.63  |
| 本期已分配利润        | -              | -                | -                |
| 本期末            | 168,706,578.59 | 1,107,622,812.95 | 1,276,329,391.54 |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期2020年01月01日至2020年06月30日 |
|-----------|---------------------------|
| 活期存款利息收入  | 349,286.17                |
| 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 | 46,891.84                 |
| 其他        | 11,479.50                 |
| 合计        | 407,657.51                |

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目       | 本期<br>2020年01月01日至2020年06月30日 |
|----------|-------------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 1,019,129,091.69              |



|            |                |
|------------|----------------|
| 减：卖出股票成本总额 | 909,706,169.85 |
| 买卖股票差价收入   | 109,422,921.84 |

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

| 项目                      | 本期<br>2020年01月01日至2020年06月30日 |
|-------------------------|-------------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 40,298,692.87                 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 39,119,875.23                 |
| 减：应收利息总额                | 1,100,686.39                  |
| 买卖债券差价收入                | 78,131.25                     |

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2020年01月01日至2020年06月30日 |
|---------------|-------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 20,268,537.11                 |
| 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            | 20,268,537.11                 |

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2020年01月01日至2020年06月30日 |
|------------|-------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | 598,504,548.46                |

|                        |                |
|------------------------|----------------|
| ——股票投资                 | 598,263,130.83 |
| ——债券投资                 | 241,417.63     |
| ——资产支持证券投资             | —              |
| ——基金投资                 | —              |
| ——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                     | 598,504,548.46 |

## 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2020年01月01日至2020年06月30日 |
|---------|-------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 7,291,454.45                  |
| 基金转换费收入 | 433,723.89                    |
| 合计      | 7,725,178.34                  |

注：1、本基金的赎回费率随着持有期限的增加而递减，将不低于赎回费总额的25%计入基金财产。  
2、本基金的转换费由申购补差费和赎回费两部分构成，其中不低于赎回费25%的部分归入转出基金的基金资产。

## 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2020年01月01日至2020年06月30日 |
|-----------|-------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 3,877,446.29                  |
| 银行间市场交易费用 | 600.00                        |
| 合计        | 3,878,046.29                  |

**6.4.7.19 其他费用**

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2020年01月01日至2020年06月30日 |
|---------|-------------------------------|
| 审计费用    | 49,726.04                     |
| 信息披露费   | 59,672.34                     |
| 证券出借违约金 | -                             |
| 汇划手续费   | 21,657.89                     |
| 账户维护费   | 9,000.00                      |
| 合计      | 140,056.27                    |

**6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

截至财务报表批准日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

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

本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

**6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

**6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易****6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易**

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

**6.4.10.2 关联方报酬****6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2020年01月01日至2020年06月30日 | 上年度可比期间<br>2019年01月01日至2019年06月30日 |
|-----------------|-------------------------------|------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 22,948,733.85                 | 3,092,287.09                       |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 10,238,142.38                 | 1,158,734.56                       |

注：支付基金管理人泓德基金的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 × 1.50%/当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2020年01月01日至2020年06月30日 | 上年度可比期间<br>2019年01月01日至2019年06月30日 |
|----------------|-------------------------------|------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 3,824,788.97                  | 515,381.18                         |

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 × 0.25%/当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的管理人于本报告期及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

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

本报告期末及上年度末除管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2020年01月01日至2020年06月30日 |            | 上年度可比期间<br>2019年01月01日至2019年06月30日 |           |
|-------|-------------------------------|------------|------------------------------------|-----------|
|       | 期末余额                          | 当期利息收入     | 期末余额                               | 当期利息收入    |
| 招商银行  | 132,942,170.11                | 349,286.17 | 5,952,566.57                       | 45,368.67 |

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

## 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

## 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

## 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

## 6.4.12 期末（2020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      | 可流通日       | 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 |
| 002841               | 视源股份 | 2020-01-22 | 2020-07-22 | 限售股    | 78.31 | 98.24  | 350,000  | 27,408,500.00 | 34,384,000.00 | -  |
| 601816               | 京沪高铁 | 2020-01-08 | 2020-07-16 | 限售股    | 4.88  | 6.17   | 906,536  | 4,423,895.68  | 5,593,327.12  | -  |
| 688085               | 三友医疗 | 2020-03-30 | 2020-10-09 | 限售股    | 20.96 | 67.62  | 8,807    | 184,594.72    | 595,529.34    | -  |
| 688004               | 博汇科技 | 2020-06-05 | 2020-12-14 | 限售股    | 28.77 | 71.90  | 2,500    | 71,925.00     | 179,750.00    | -  |
| 688516               | 奥特维  | 2020-05-14 | 2020-11-23 | 限售股    | 23.28 | 43.10  | 3,440    | 80,083.20     | 148,264.00    | -  |
| 688377               | 迪威尔  | 2020-06-29 | 2020-07-08 | 新股未上市  | 16.42 | 16.42  | 7,894    | 129,619.48    | 129,619.48    | -  |
| 6880                 | 国盾   | 2020       | 2020       | 新股     | 36.1  | 36.1   | 2,830    | 102,          | 102,          | -  |

|        |      |            |            |          |       |       |       |           |           |   |
|--------|------|------------|------------|----------|-------|-------|-------|-----------|-----------|---|
| 27     | 量子   | -06-30     | -07-09     | 未上市      | 8     | 8     |       | 389.40    | 389.40    |   |
| 688528 | 秦川物联 | 2020-06-19 | 2021-01-04 | 新股未上市且限售 | 11.33 | 11.33 | 8,337 | 94,458.21 | 94,458.21 | - |
| 688600 | 皖仪科技 | 2020-06-23 | 2020-07-03 | 新股未上市    | 15.50 | 15.50 | 5,468 | 84,754.00 | 84,754.00 | - |
| 300847 | 中船汉光 | 2020-06-29 | 2020-07-09 | 新股未上市    | 6.94  | 6.94  | 1,421 | 9,861.74  | 9,861.74  | - |
| 300845 | 捷安高科 | 2020-06-24 | 2020-07-03 | 新股未上市    | 17.63 | 17.63 | 470   | 8,286.10  | 8,286.10  | - |
| 300843 | 胜蓝股份 | 2020-06-23 | 2020-07-02 | 新股未上市    | 10.01 | 10.01 | 751   | 7,517.51  | 7,517.51  | - |
| 300840 | 酷特智能 | 2020-06-30 | 2020-07-08 | 新股未上市    | 5.94  | 5.94  | 1,185 | 7,038.90  | 7,038.90  | - |
| 300846 | 首都在线 | 2020-06-22 | 2020-07-01 | 新股未上市    | 3.37  | 3.37  | 1,131 | 3,811.47  | 3,811.47  | - |

注：1、根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后6个月内，不得转让所受让的股份。

2、本基金参与网下申购获得的新股，在新股上市之前及上市之后的约定期限（若有）内不得转让；本基金参与网上申购获得的新股，在新股上市之前不得转让。此外，根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

#### 6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行招商银行，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2020年6月30日，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0.21%(2019年12月31日：0.54%)。

### 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2020年6月30日，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(所有者权益)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公司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2020年6月30日，本基金主动投资于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2020年6月30日，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主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2020年<br>06月30<br>日 | 1年以内           | 1-5年         | 5年以上         | 不计息              | 合计               |
|----------------------------|----------------|--------------|--------------|------------------|------------------|
| 资产                         |                |              |              |                  |                  |
| 银行存款                       | 132,942,170.11 | -            | -            | -                | 132,942,170.11   |
| 结算备付金                      | 5,077,738.54   | -            | -            | -                | 5,077,738.54     |
| 存出保证金                      | 1,581,667.87   | -            | -            | -                | 1,581,667.87     |
| 交易性金融资产                    | 149,589,000.00 | 4,144,612.50 | 4,163,248.00 | 3,729,059,150.37 | 3,886,956,010.87 |

|                 |                |              |              |                  |                  |
|-----------------|----------------|--------------|--------------|------------------|------------------|
| 应收利息            | -              | -            | -            | 1,425,070.45     | 1,425,070.45     |
| 应收股利            | -              | -            | -            | 1,270,439.11     | 1,270,439.11     |
| 应收申购款           | -              | -            | -            | 93,308,672.98    | 93,308,672.98    |
| 资产总计            | 289,190,576.52 | 4,144,612.50 | 4,163,248.00 | 3,825,063,332.91 | 4,122,561,769.93 |
| 负债              |                |              |              |                  |                  |
| 应付证券清算款         | -              | -            | -            | 45,736,769.67    | 45,736,769.67    |
| 应付赎回款           | -              | -            | -            | 42,613,346.61    | 42,613,346.61    |
| 应付管理人报酬         | -              | -            | -            | 4,459,511.90     | 4,459,511.90     |
| 应付托管费           | -              | -            | -            | 743,251.99       | 743,251.99       |
| 应付交易费用          | -              | -            | -            | 1,036,894.38     | 1,036,894.38     |
| 应交税费            | -              | -            | -            | 88.03            | 88.03            |
| 其他负债            | -              | -            | -            | 212,004.94       | 212,004.94       |
| 负债总计            | -              | -            | -            | 94,801,867.52    | 94,801,867.52    |
| 利率敏感度缺口         | 289,190,576.52 | 4,144,612.50 | 4,163,248.00 | 3,730,261,465.39 | 4,027,759,902.41 |
| 上年度末2019年12月31日 | 1年以内           | 1-5年         | 5年以上         | 不计息              | 合计               |
| 资产              |                |              |              |                  |                  |
| 银行存款            | 122,217,621.33 | -            | -            | -                | 122,217,621.33   |
| 结算备付金           | 19,245,846.92  | -            | -            | -                | 19,245,846.92    |
| 存出保证金           | 6,271,980.14   | -            | -            | -                | 6,271,980.14     |
| 交易性金融资产         | 60,170,000.00  | 6,202,002.30 | 6,950,715.80 | 2,253,691,688.46 | 2,327,014,406.56 |
| 应收利             | -              | -            | -            | 1,061,576.67     | 1,061,576.67     |

|         |                |              |              |                  |                  |
|---------|----------------|--------------|--------------|------------------|------------------|
| 息       |                |              |              |                  |                  |
| 应收申购款   | -              | -            | -            | 17,649,679.41    | 17,649,679.41    |
| 资产总计    | 207,905,448.39 | 6,202,002.30 | 6,950,715.80 | 2,272,402,944.54 | 2,493,461,111.03 |
| 负债      |                |              |              |                  |                  |
| 应付证券清算款 | -              | -            | -            | 46,865,012.23    | 46,865,012.23    |
| 应付赎回款   | -              | -            | -            | 11,040,423.01    | 11,040,423.01    |
| 应付管理人报酬 | -              | -            | -            | 2,754,062.63     | 2,754,062.63     |
| 应付托管费   | -              | -            | -            | 459,010.42       | 459,010.42       |
| 应付交易费用  | -              | -            | -            | 896,311.73       | 896,311.73       |
| 应交税费    | -              | -            | -            | 106.56           | 106.56           |
| 其他负债    | -              | -            | -            | 199,440.45       | 199,440.45       |
| 负债总计    | -              | -            | -            | 62,214,367.03    | 62,214,367.03    |
| 利率敏感度缺口 | 207,905,448.39 | 6,202,002.30 | 6,950,715.80 | 2,210,188,577.51 | 2,431,246,744.00 |

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2020年6月30日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为3.92%(2019年12月31日：3.02%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2019年12月31日：同)。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 |
|----|-----|
|----|-----|

|               | 2020年06月30日         |                |           |                |
|---------------|---------------------|----------------|-----------|----------------|
|               | 美元折合人民币             | 港币折合人民币        | 其他币种折合人民币 | 合计             |
| 以外币计价的资产      |                     |                |           |                |
| 交易性金融资产       | -                   | 632,232,566.00 | -         | 632,232,566.00 |
| 应收股利          | -                   | 1,270,439.11   | -         | 1,270,439.11   |
| 资产合计          | -                   | 633,503,005.11 | -         | 633,503,005.11 |
| 以外币计价的负债      |                     |                |           |                |
| 负债合计          | -                   | -              | -         | -              |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | -                   | 633,503,005.11 | -         | 633,503,005.11 |
| 项目            | 上年度末<br>2019年12月31日 |                |           |                |
|               | 美元折合人民币             | 港币折合人民币        | 其他币种折合人民币 | 合计             |
| 以外币计价的资产      |                     |                |           |                |
| 交易性金融资产       | -                   | 145,110,544.00 | -         | 145,110,544.00 |
| 资产合计          | -                   | 145,110,544.00 | -         | 145,110,544.00 |
| 以外币计价的负债      |                     |                |           |                |
| 负债合计          | -                   | -              | -         | -              |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | -                   | 145,110,544.00 | -         | 145,110,544.00 |

## 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

| 假设 | 除外汇以外的其他市场变量保持不变 |                                 |
|----|------------------|---------------------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动        | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额<br>(单位：人民币元) |

|  |             | 本期末<br>2020年06月30日 | 上年度末<br>2019年12月31日 |
|--|-------------|--------------------|---------------------|
|  | 港币相对人民币升值5% | 31,675,150.26      | 7,255,527.20        |
|  | 港币相对人民币贬值5% | -31,675,150.26     | -7,255,527.20       |

#### 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。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票投资占基金资产的比例范围0-95%，其中投资于港股通标的股票占股票投资的比例为0%-50%；每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。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<br>2020年06月30日 |                          | 上年度末<br>2019年12月31日 |                          |
|--------------|--------------------|--------------------------|---------------------|--------------------------|
|              | 公允价值               | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) | 公允价值                | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) |
| 交易性金融资产—股票投资 | 3,729,059,150.37   | 92.58                    | 2,253,691,688.46    | 92.70                    |
| 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            | 3,729,059,150.37 | 92.58 | 2,253,691,688.46 | 92.70 |

#### 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<br>2020年06月30日          | 上年度末<br>2019年12月31日 |
|    | 业绩比较基准上升5%              | 269,688,254.60              | 134,593,875.23      |
|    | 业绩比较基准下降5%              | -269,688,254.60             | -134,593,875.23     |

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 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。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于2020年6月30日，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中属于第一层次的余额为3,696,018,403.60元，属于第二层次的余额为190,937,607.27元，无属于第三层次的余额(2019年12月31日：第一层次2,216,889,538.22元，第二层次110,124,868.34元，无第三层次)。

##### (ii) 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。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2020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(2019年12月31日：同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

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。

(2)除公允价值外，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              | 3,729,059,150.37 | 90.45        |
|    | 其中：股票             | 3,729,059,150.37 | 90.45        |
| 2  | 基金投资              | —                | —            |
| 3  | 固定收益投资            | 157,896,860.50   | 3.83         |
|    | 其中：债券             | 157,896,860.50   | 3.83         |
|    | 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      | 138,019,908.65   | 3.35         |
| 8  | 其他各项资产            | 97,585,850.41    | 2.37         |

|   |    |                  |        |
|---|----|------------------|--------|
| 9 | 合计 | 4,122,561,769.93 | 100.00 |
|---|----|------------------|--------|

注：本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币632,232,566.00元，占期末净值比例15.70%。

## 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              | 2,557,258,723.42 | 63.49        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 12,766.32        | 0.00         |
| E  | 建筑业              | -                | -            |
| F  | 批发和零售业           | -                | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 5,593,327.12     | 0.14         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -                | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 192,986,226.07   | 4.79         |
| J  | 金融业              | 119,991.60       | 0.00         |
| K  | 房地产业             | -                | -            |
| L  | 租赁和商务服务业         | -                | -            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -                | -            |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 90,663.51        | 0.00         |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -                | -            |
| P  | 教育               | 75,356,280.00    | 1.87         |
| Q  | 卫生和社会工作          | -                | -            |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | 265,408,606.33   | 6.59         |
| S  | 综合               | -                | -            |
|    | 合计               | 3,096,826,584.37 | 76.89        |

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别 | 公允价值(人民币) | 占基金资产 |
|------|-----------|-------|
|------|-----------|-------|



|          |                | 产净值比例 (%) |
|----------|----------------|-----------|
| 非日常生活消费品 | 234,198,525.00 | 5.81      |
| 日常消费品    | 149,203,920.00 | 3.7       |
| 金融       | 51,019,012.00  | 1.27      |
| 医疗保健     | 2,668,000.00   | 0.07      |
| 信息技术     | 171,751,301.00 | 4.26      |
| 电信服务     | 23,391,808.00  | 0.58      |
| 合计       | 632,232,566.00 | 15.7      |

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称   | 数量(股)      | 公允价值(元)        | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|--------|------------|----------------|---------------|
| 1  | 002475 | 立讯精密   | 6,584,483  | 338,113,202.05 | 8.39          |
| 2  | 601012 | 隆基股份   | 7,906,347  | 322,025,513.31 | 8.00          |
| 3  | 002841 | 视源股份   | 3,144,513  | 312,493,933.76 | 7.76          |
| 4  | 600276 | 恒瑞医药   | 3,339,628  | 308,247,664.40 | 7.65          |
| 5  | 300124 | 汇川技术   | 7,882,056  | 299,439,307.44 | 7.43          |
| 6  | 002595 | 豪迈科技   | 14,650,188 | 285,092,658.48 | 7.08          |
| 7  | 603288 | 海天味业   | 2,096,480  | 260,802,112.00 | 6.48          |
| 8  | 600563 | 法拉电子   | 3,456,092  | 213,586,485.60 | 5.30          |
| 9  | 002410 | 广联达    | 2,754,009  | 191,954,427.30 | 4.77          |
| 10 | 300251 | 光线传媒   | 15,922,857 | 173,718,369.87 | 4.31          |
| 11 | 02382  | 舜宇光学科技 | 1,516,300  | 171,751,301.00 | 4.26          |
| 12 | 01579  | 颐海国际   | 2,056,000  | 149,203,920.00 | 3.70          |
| 13 | 06862  | 海底捞    | 4,648,000  | 138,835,760.00 | 3.45          |

|    |        |        |             |                  |       |
|----|--------|--------|-------------|------------------|-------|
| 14 | 603096 | 新经典    | 1, 553, 282 | 91, 690, 236. 46 | 2. 28 |
| 15 | 00667  | 中国东方教育 | 6, 993, 500 | 89, 586, 735. 00 | 2. 22 |
| 16 | 300416 | 苏试试验   | 3, 899, 185 | 88, 160, 572. 85 | 2. 19 |
| 17 | 603377 | 东方时尚   | 4, 550, 500 | 75, 356, 280. 00 | 1. 87 |
| 18 | 603160 | 汇顶科技   | 269, 876    | 60, 155, 360. 40 | 1. 49 |
| 19 | 603587 | 地素时尚   | 2, 022, 840 | 34, 084, 854. 00 | 0. 85 |
| 20 | 688080 | 映翰通    | 355, 493    | 32, 630, 702. 47 | 0. 81 |
| 21 | 01299  | 友邦保险   | 400, 000    | 26, 416, 000. 00 | 0. 66 |
| 22 | 01911  | 华兴资本控股 | 2, 297, 200 | 24, 603, 012. 00 | 0. 61 |
| 23 | 00772  | 阅文集团   | 490, 600    | 23, 391, 808. 00 | 0. 58 |
| 24 | 02678  | 天虹纺织   | 1, 020, 500 | 5, 776, 030. 00  | 0. 14 |
| 25 | 601816 | 京沪高铁   | 906, 536    | 5, 593, 327. 12  | 0. 14 |
| 26 | 01177  | 中国生物制药 | 200, 000    | 2, 668, 000. 00  | 0. 07 |
| 27 | 688023 | 安恒信息   | 2, 728      | 839, 951. 20     | 0. 02 |
| 28 | 688139 | 海尔生物   | 13, 249     | 742, 738. 94     | 0. 02 |
| 29 | 688085 | 三友医疗   | 8, 807      | 595, 529. 34     | 0. 01 |
| 30 | 688004 | 博汇科技   | 2, 500      | 179, 750. 00     | 0. 00 |
| 31 | 688516 | 奥特维    | 3, 440      | 148, 264. 00     | 0. 00 |
| 32 | 688377 | 迪威尔    | 7, 894      | 129, 619. 48     | 0. 00 |
| 33 | 002936 | 郑州银行   | 33, 885     | 116, 564. 40     | 0. 00 |
| 34 | 603087 | 甘李药业   | 1, 076      | 107, 922. 80     | 0. 00 |
| 35 | 688027 | 国盾量子   | 2, 830      | 102, 389. 40     | 0. 00 |
| 36 | 002985 | 北摩高科   | 782         | 97, 335. 54      | 0. 00 |
| 37 | 688528 | 秦川物联   | 8, 337      | 94, 458. 21      | 0. 00 |
| 38 | 688600 | 皖仪科技   | 5, 468      | 84, 754. 00      | 0. 00 |
| 39 | 601827 | 三峰环境   | 6, 723      | 63, 801. 27      | 0. 00 |
| 40 | 300837 | 浙矿股份   | 737         | 33, 187. 11      | 0. 00 |
| 41 | 002986 | 宇新股份   | 630         | 31, 783. 50      | 0. 00 |

|    |        |      |       |           |      |
|----|--------|------|-------|-----------|------|
| 42 | 002973 | 侨银环保 | 1,146 | 26,862.24 | 0.00 |
| 43 | 300824 | 北鼎股份 | 1,954 | 26,789.34 | 0.00 |
| 44 | 603530 | 神马电力 | 941   | 26,639.71 | 0.00 |
| 45 | 605166 | 聚合顺  | 1,641 | 26,009.85 | 0.00 |
| 46 | 300808 | 久量股份 | 1,297 | 25,680.60 | 0.00 |
| 47 | 603115 | 海星股份 | 1,299 | 24,525.12 | 0.00 |
| 48 | 300838 | 浙江力诺 | 909   | 22,243.23 | 0.00 |
| 49 | 603948 | 建业股份 | 860   | 19,324.20 | 0.00 |
| 50 | 300842 | 帝科股份 | 455   | 18,527.60 | 0.00 |
| 51 | 002976 | 瑞玛工业 | 536   | 18,052.48 | 0.00 |
| 52 | 603551 | 奥普家居 | 888   | 14,412.24 | 0.00 |
| 53 | 600956 | 新天绿能 | 2,533 | 12,766.32 | 0.00 |
| 54 | 300839 | 博汇股份 | 502   | 11,751.82 | 0.00 |
| 55 | 300847 | 中船汉光 | 1,421 | 9,861.74  | 0.00 |
| 56 | 300845 | 捷安高科 | 470   | 8,286.10  | 0.00 |
| 57 | 300843 | 胜蓝股份 | 751   | 7,517.51  | 0.00 |
| 58 | 300840 | 酷特智能 | 1,185 | 7,038.90  | 0.00 |
| 59 | 300846 | 首都在线 | 1,131 | 3,811.47  | 0.00 |
| 60 | 601318 | 中国平安 | 48    | 3,427.20  | 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  | 300124 | 汇川技术   | 146,002,374.46 | 6.01           |
| 2  | 02382  | 舜宇光学科技 | 139,451,539.50 | 5.74           |
| 3  | 06862  | 海底捞    | 135,388,434.91 | 5.57           |
| 4  | 600276 | 恒瑞医药   | 122,452,345.80 | 5.04           |
| 5  | 01579  | 颐海国际   | 120,720,794.18 | 4.97           |

|    |        |        |                |      |
|----|--------|--------|----------------|------|
| 6  | 002841 | 视源股份   | 118,729,057.54 | 4.88 |
| 7  | 603288 | 海天味业   | 97,426,479.44  | 4.01 |
| 8  | 300251 | 光线传媒   | 92,936,368.30  | 3.82 |
| 9  | 00667  | 中国东方教育 | 90,456,429.50  | 3.72 |
| 10 | 002475 | 立讯精密   | 87,399,065.93  | 3.59 |
| 11 | 600563 | 法拉电子   | 87,378,534.96  | 3.59 |
| 12 | 002595 | 豪迈科技   | 80,460,279.58  | 3.31 |
| 13 | 601012 | 隆基股份   | 79,729,296.53  | 3.28 |
| 14 | 002410 | 广联达    | 65,780,601.61  | 2.71 |
| 15 | 603096 | 新经典    | 61,158,273.00  | 2.52 |
| 16 | 603160 | 汇顶科技   | 59,403,804.55  | 2.44 |
| 17 | 300416 | 苏试试验   | 43,121,735.26  | 1.77 |
| 18 | 688080 | 映翰通    | 37,322,220.90  | 1.54 |
| 19 | 01299  | 友邦保险   | 26,351,745.55  | 1.08 |
| 20 | 00772  | 阅文集团   | 23,219,206.37  | 0.96 |

#### 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  | 601318 | 中国平安 | 132,461,043.94 | 5.45           |
| 2  | 603288 | 海天味业 | 113,568,010.10 | 4.67           |
| 3  | 002475 | 立讯精密 | 98,206,743.79  | 4.04           |
| 4  | 600276 | 恒瑞医药 | 73,466,650.93  | 3.02           |
| 5  | 601012 | 隆基股份 | 60,283,614.75  | 2.48           |
| 6  | 06862  | 海底捞  | 58,668,183.83  | 2.41           |
| 7  | 601021 | 春秋航空 | 55,528,950.81  | 2.28           |
| 8  | 002032 | 苏泊尔  | 53,397,014.37  | 2.20           |
| 9  | 300124 | 汇川技术 | 51,251,719.61  | 2.11           |
| 10 | 002841 | 视源股份 | 49,080,585.46  | 2.02           |

|    |        |        |               |      |
|----|--------|--------|---------------|------|
| 11 | 600563 | 法拉电子   | 43,591,407.74 | 1.79 |
| 12 | 002410 | 广联达    | 41,601,749.64 | 1.71 |
| 13 | 002311 | 海大集团   | 34,946,036.21 | 1.44 |
| 14 | 02382  | 舜宇光学科技 | 19,912,123.33 | 0.82 |
| 15 | 002837 | 英维克    | 19,484,478.94 | 0.80 |
| 16 | 000902 | 新洋丰    | 17,869,180.10 | 0.73 |
| 17 | 600085 | 同仁堂    | 10,888,903.86 | 0.45 |
| 18 | 603882 | 金域医学   | 8,209,746.44  | 0.34 |
| 19 | 300454 | 深信服    | 8,133,499.00  | 0.33 |
| 20 | 01810  | 小米集团—W | 7,885,077.44  | 0.32 |

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

|              |                  |
|--------------|------------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 1,786,810,500.93 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 1,019,129,091.69 |

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      | 149,589,000.00 | 3.71         |
|    | 其中：政策性金融债 | 149,589,000.00 | 3.71         |
| 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) | 8,307,860.50   | 0.21         |
| 8  | 同业存单      | —              | —            |
| 9  | 其他        | —              | —            |

|    |    |                |      |
|----|----|----------------|------|
| 10 | 合计 | 157,896,860.50 | 3.92 |
|----|----|----------------|------|

## 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  | 200201 | 20国开01 | 600,000 | 60,084,000.00 | 1.49         |
| 2  | 200403 | 20农发03 | 600,000 | 59,448,000.00 | 1.48         |
| 3  | 190211 | 19国开11 | 300,000 | 30,057,000.00 | 0.75         |
| 4  | 113575 | 东时转债   | 35,450  | 4,163,248.00  | 0.10         |
| 5  | 113021 | 中信转债   | 21,210  | 2,220,474.90  | 0.06         |

## 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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

### 7.10.2 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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

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

7.12.2 基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

## 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额            |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 1,581,667.87  |
| 2  | 应收证券清算款 | -             |
| 3  | 应收股利    | 1,270,439.11  |
| 4  | 应收利息    | 1,425,070.45  |
| 5  | 应收申购款   | 93,308,672.98 |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 97,585,850.41 |

## 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  | 113021 | 中信转债 | 2,220,474.90 | 0.06         |
| 2  | 110034 | 九州转债 | 1,924,137.60 | 0.05         |

## 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值 | 占基金资产净值比 | 流通受限情况说明 |
|----|------|------|-------------|----------|----------|
|    |      |      |             |          |          |

|   |        |      |               |       |      |
|---|--------|------|---------------|-------|------|
|   |        |      |               | 例 (%) |      |
| 1 | 002841 | 视源股份 | 34,384,000.00 | 0.85  | 股东减持 |

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数<br>(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 |
| 57,382       | 47,949.37 | 944,644,198.92 | 34.33% | 1,806,786,311.95 | 65.67% |

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 持有份额总数（份）    | 占基金总份额比例 |
|------------------|--------------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 9,873,029.44 | 0.3588%  |

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目                             | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | >100              |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | >100              |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                            |                  |
|----------------------------|------------------|
| 基金合同生效日(2018年05月04日)基金份额总额 | 436,072,293.94   |
| 本报告期期初基金份额总额               | 2,060,818,489.03 |
| 本报告期基金总申购份额                | 2,646,030,013.85 |
| 减：本报告期基金总赎回份额              | 1,955,417,992.01 |
| 本报告期基金拆分变动份额               | -                |



本报告期期末基金份额总额

2,751,430,510.87

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

本报告期未发生公司和董事、监事和高级管理人员被中国证监会、证券业协会、证券交易所处罚或公开谴责，以及被财政、外汇和审计等部门施以重大处罚的情况。

本报告期内，本基金托管人涉及托管业务的高级管理人员未受到监管部门的稽查和处罚。

## 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 |    |
| 东兴   | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |

|        |   |                  |        |              |        |   |
|--------|---|------------------|--------|--------------|--------|---|
| 证券     |   |                  |        |              |        |   |
| 广发证券   | 2 | -                | -      | -            | -      | - |
| 太平洋证券  | 2 | 175,476,895.73   | 6.30%  | 124,879.78   | 6.36%  | - |
| 信达证券   | 2 | -                | -      | -            | -      | - |
| 中泰证券   | 2 | -                | -      | -            | -      | - |
| 中信建投证券 | 2 | 793,096,761.80   | 28.46% | 557,111.38   | 28.36% | - |
| 中信证券   | 2 | 1,817,886,322.31 | 65.24% | 1,282,135.75 | 65.28% | - |

注：1、本公司选择证券经营机构的标准

（1）研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为本公司提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告等，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

（2）资力雄厚，信誉良好。

（3）财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。

（4）经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚。

（5）内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。

（6）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本公司基金进行证券交易的需要，并能为本公司基金提供全面的信息服务。

2、本公司租用券商交易单元的程序

（1）研究机构提出服务意向，并提供相关研究报告；

（2）研究机构的研究报告需要有一定的试用期。试用期视服务情况和研究服务评价结果而定；

（3）研究部、投资部等部门试用研究机构的研究报告后，按照研究服务评价规定，对研究机构进行综合评价；

（4）试用期满后，评价结果符合条件，双方认为有必要继续合作，经公司领导审批后，我司与研究机构签定《研究服务协议》、《券商交易单元租用协议》，并办理基金专用交易单元租用手续。评价结果如不符合条件则终止试用；

（5）本公司每季度对签约机构的服务进行一次综合评价。经过评价，若本公司认为签约机构的服务不能满足要求，或签约机构违规受到国家有关部门的处罚，本公司有权终止签署的协议，并撤销租用的交易单元；

（6）交易单元租用协议期限为一年，到期后若双方没有异议可自动延期一年。

3、本基金租用证券公司交易单元均为共用交易单元。

4、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

(1) 本基金报告期内新增租用交易单元：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 |
| 东兴证券   | -            | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 广发证券   | -            | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 太平洋证券  | -            | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 信达证券   | -            | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 中泰证券   | -            | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 中信建投证券 | 9,207,692.87 | 100.00%      | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 中信证券   | -            | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |

### 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                                                     | 法定披露方式                   | 法定披露日期     |
|----|----------------------------------------------------------|--------------------------|------------|
| 1  | 泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加联储证券有限责任公司为销售机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠的公告 | 公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站 | 2020-02-08 |
| 2  | 泓德基金管理有限公司关于旗下基金增加中信证券华南股份有限公司为销售机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠的公告 | 公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站 | 2020-02-08 |
| 3  | 泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金参与申万宏源证券有限公司等销售机构费                     | 公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站 | 2020-02-18 |

|    |                                                        |                          |            |
|----|--------------------------------------------------------|--------------------------|------------|
|    | 率优惠活动的公告                                               |                          |            |
| 4  | 泓德基金管理有限公司关于推迟披露旗下公募基金2019年年度报告的公告                     | 公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站 | 2020-03-24 |
| 5  | 泓德基金管理有限公司关于暂停泰诚财富基金销售（大连）有限公司代销旗下基金业务的公告              | 公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站 | 2020-04-30 |
| 6  | 泓德基金管理有限公司关于根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修改旗下部分基金基金合同及托管协议的公告 | 公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站 | 2020-05-30 |
| 7  | 泓德基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在招商银行股份有限公司最低定期定额投资业务金额限制的公告       | 公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站 | 2020-05-30 |
| 8  | 泓德基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在珠海盈米基金销售有限公司最低申购、定期定额投资金额限制的公告    | 公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站 | 2020-06-04 |
| 9  | 泓德基金管理有限公司关于泓德臻远回报灵活配置混合型证券投资基金暂停申购、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 | 2020-06-20 |
| 10 | 泓德基金管理有限公司关于泓德臻远回报灵活配置混合型证券投资基金暂停申购、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 | 2020-06-24 |
| 11 | 泓德基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在蚂蚁                                | 公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站 | 2020-06-30 |

|  |                                    |  |  |
|--|------------------------------------|--|--|
|  | (杭州)基金销售有限公司<br>最低申购及定投金额起点的<br>公告 |  |  |
|--|------------------------------------|--|--|

## § 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臻远回报灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《泓德臻远回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《泓德臻远回报灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《泓德臻远回报灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在指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  
二〇二〇年八月二十九日