

泓德量化精选混合型证券投资基金

2023 年中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人:泓德基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

送出日期:2023 年 08 月 30 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年8月29日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2023年1月1日起至2023年6月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	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	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	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	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	58
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	59
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	59
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	59
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	59
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	59
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	59
7.12 投资组合报告附注	59
§8 基金份额持有人信息	61
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	61

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	61
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	62
§9 开放式基金份额变动	62
§10 重大事件揭示	62
10.1 基金份额持有人大会决议	62
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	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	62
10.4 基金投资策略的改变	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	63
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	63
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	63
10.8 其他重大事件	66
§11 影响投资者决策的其他重要信息	67
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	67
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	67
§12 备查文件目录	67
12.1 备查文件目录	67
12.2 存放地点	68
12.3 查阅方式	68

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泓德量化精选混合型证券投资基金
基金简称	泓德量化精选混合
基金主代码	006336
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年09月06日
基金管理人	泓德基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	176,338,001.41份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过数量化投资模型，在严格控制风险的前提下，合理配置资产权重，精选个股，追求超越业绩比较基准的投资回报和资产长期稳健增值。
投资策略	本基金基于业绩比较基准来确定组合波动、回撤限制目标，根据不同资产的风险特征进行配置，追求超越业绩比较基准的投资回报和资产长期稳健增值。投资策略上通过对经济增长、通胀、流动性和风险偏好等数据进行跟踪，利用定性定量分析、风险测算及组合优化，最终形成大类资产配置决策。在股票投资方面，本基金结合基金管理人内部研究平台，采用"自下而上"的数量化选股策略，在纪律化模型约束下，依照模型构建投资组合，严格控制各类风险，并根据市场状况及变化，定期对模型进行回溯和调整，提高模型有效性。债券投资方面，采取久期调整、收益率曲线配置和券种配置等积极投资策略。
业绩比较基准	中证500指数收益率×80%+中国债券综合全价指数收益率×20%
风险收益特征	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

	<p>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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李晓春	郭明
	联系电话	010-59850177	010-66105799
	电子邮箱	lixiaochun@hongdefund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4009-100-888	95588
传真		010-59322130	010-66105798
注册地址		西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦1206室	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		北京市西城区德胜门外大街125号	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		100088	100140
法定代表人		王德晓	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网	www.hongdefund.com

址	
基金中期报告备置地点	北京市西城区德胜门外大街125号

2.5 其他相关资料

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2023年01月01日-2023年06月30日)	
	本期已实现收益	1,874,854.56
本期利润	5,601,150.48	
加权平均基金份额本期利润	0.0312	
本期加权平均净值利润率	2.15%	
本期基金份额净值增长率	2.14%	
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2023年06月30日)	
	期末可供分配利润	72,768,788.07
	期末可供分配基金份额利润	0.4127
	期末基金资产净值	250,121,071.07
	期末基金份额净值	1.4184
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2023年06月30日)	
	基金份额累计净值增长率	41.84%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.42%	0.84%	-0.60%	0.74%	2.02%	0.10%
过去三个月	-4.51%	0.79%	-4.12%	0.66%	-0.39%	0.13%
过去六个月	2.14%	0.74%	2.14%	0.63%	0.00%	0.11%
过去一年	-8.43%	0.94%	-5.26%	0.77%	-3.17%	0.17%
过去三年	0.19%	1.31%	3.29%	0.95%	-3.10%	0.36%
自基金合同生效起至今	41.84%	1.32%	15.52%	1.01%	26.32%	0.31%

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×80%+中国债券综合全价指数收益率×20%

基准指数的构建原则如下：

（1）中证500指数由中证指数有限公司编制并发布。它的样本选自沪深两个证券市场，其成份股包含了500只沪深300指数成份股之外的A股市场中流动性好、代表性强的中小市值股票，综合反映了沪深证券市场中中小市值公司的整体状况。

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

（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80%、20%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

泓德量化精选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
(2019年09月06日-2023年06月30日)



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

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金基金管理人为泓德基金管理有限公司（以下简称“公司”），成立于2015年3月3日，是经中国证监会证监许可[2015]258号文批准设立的由专业人士发起设立的公募基金管理公司。公司注册资本为人民币1.43亿元，公司注册地拉萨市。目前，公司股东及其出资比例为：王德晓先生25.91%，阳光资产管理股份有限公司20.98%，泓德基业（西藏）企业管理有限公司20.00%，珠海市基业长青投资中心（有限合伙）11.26%，南京民生租赁股份有限公司9.38%，江苏岛村实业发展有限公司9.38%，上海捷朔信息技术有限公司3.10%。

公司始终坚持“持有人利益优先”原则，聚焦主动投资管理，坚持长期价值投资，深度研究创造价值，追求长期、稳定、持续的一致性获利，致力于成为能持续为客户创造价值的、受人尊重的专业化资产管理公司。公司已覆盖从公募到专户、从股票投资到固定收益投资、从低风险到高风险等不同产品类型，公募基金产品涵盖股票型、债券型、混合型、货币型等基金品种。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券 从 业 年 限	说明
		任职 日期	离任 日期		
苏昌景	本基金的基金经理、量化 投资部总监	2019-0 9-06	-	15 年	硕士研究生，具有基金从 业资格，曾任本公司研究 部研究员，国都证券股份 有限公司研究所研究员、 资产管理总部总经理助 理、投资经理。
张天洋	本基金的基金经理	2022-0 1-28	-	5 年	硕士研究生，具有基金从 业资格，资管行业从业经 验8年，曾任本公司量化投 资部投资经理，美国MPG Operations LLC量化研究 员，美国Princeton Alpha Management LP量化研究 员。

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023上半年度，市场参与者对经济复苏的强烈预期在实际的市场环境中经历了一定的调整和持续的变化，A股市场的整体行情也随之出现了明显的起伏，不同板块之间阶段性地出现了较大的分化。本基金在2023年上半年度坚持“基本面+量化”双擎驱动的策略框架，并保持了分散化、多样化的投资特征，在市场情绪阶段性波动较大的情况下避免了在风格和板块上进行过度的集中，而继续追求均衡格局下的超额收益。团队在短周期因子、人工智能模型等方面对量化多因子体系进行了拓展，力求在充满变化的资本市场环境中为客户带来更稳健的回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末泓德量化精选混合基金份额净值为1.4184元，本报告期内，基金份额净值增长率为2.14%，同期业绩比较基准收益率为2.14%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

国内方面，上半年强预期与弱现实之间的冲击成为了市场的主要矛盾之一，这虽然带来了较大的市场波动，但也使得市场参与者的预期得到了一定的调整。尤其在刺激和调控政策方面，市场对于未来半年的预期很可能更加趋向于克制，也为实际政策的出台铺垫了一个较为理性的市场环境。国际方面，一些海外经济体在上半年一定程度上规避了先前市场所担忧的灰天鹅事件，例如欧洲的能源危机和美国的银行危机，但通货膨胀、利率操作等因素仍使得其未来的经济表现具有不确定性。

在这样的前景下，本基金将继续贯彻“长周期的公司基本面研究”与“短周期的股价多因子预测”相结合的投资理念，同时进一步深化、多样化团队的研究工作，加强团队量化研究在投资组合层面的体现，力图使产品对于不确定的未来市场环境具有更好的适应性、能够给客户带来更好的投资体验。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持投资品种进行估值。

本基金管理人制定了证券投资基金估值政策与估值程序,设立基金估值小组,估值小组负责指导和监督整个估值流程。估值小组成员均具有多年证券、基金从业经验,熟悉相关法律法规,具备投资、研究、基金估值运作、风险管理或法律合规等领域的专业胜任能力。基金经理参与估值原则和方法的讨论,但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任,当存有异议时,托管人有责任要求基金管理公司作出合理解释,通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值小组采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

本基金截至2023年6月30日,期末可供分配利润为72,768,788.07元,其中:未分配利润已实现部分为72,768,788.07元,未分配利润未实现部分为1,014,281.59元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人--泓德基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对泓德基金管理有限公司编制和披露的本基金2023年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：泓德量化精选混合型证券投资基金

报告截止日：2023年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	4,761,531.40	4,028,057.98
结算备付金		835,437.07	587,692.20
存出保证金		60,484.46	53,725.40
交易性金融资产	6.4.7.2	244,797,526.89	249,268,398.07
其中：股票投资		234,337,218.77	238,820,157.35
基金投资		-	-
债券投资		10,460,308.12	10,448,240.72
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-

其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-1,438.28
应收清算款		1,362,898.45	4,048,871.08
应收股利		-	-
应收申购款		12,109.12	12,856.82
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		251,829,987.39	257,998,163.27
负债和净资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	2,121,758.26
应付赎回款		759,410.87	9,869.14
应付管理人报酬		306,666.45	329,822.01
应付托管费		51,111.09	54,970.33
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		2.39	2.24
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	591,725.52	544,218.11
负债合计		1,708,916.32	3,060,640.09
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	176,338,001.41	183,581,214.45
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	73,783,069.66	71,356,308.73

净资产合计		250,121,071.07	254,937,523.18
负债和净资产总计		251,829,987.39	257,998,163.27

注：报告截止日2023年06月30日，基金份额净值1.4184元，基金份额总额176,338,001.41份。

6.2 利润表

会计主体：泓德量化精选混合型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年01月01日至 2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至202 2年06月30日
一、营业总收入		7,973,524.75	-62,325,471.55
1.利息收入		25,365.81	46,887.67
其中：存款利息收入	6.4.7.9	17,773.69	37,951.30
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		7,592.12	8,936.37
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		4,214,350.92	-47,929,103.36
其中：股票投资收益	6.4.7.10	2,307,764.43	-50,593,346.80
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	171,778.31	163,537.17
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	1,734,808.18	2,500,706.27

以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.14	3,726,295.92	-14,483,131.41
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	7,512.10	39,875.55
减：二、营业总支出		2,372,374.27	2,859,979.48
1. 管理人报酬		1,939,224.84	2,356,883.80
2. 托管费		323,204.14	392,813.98
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		0.75	0.18
8. 其他费用	6.4.7.16	109,944.54	110,281.52
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		5,601,150.48	-65,185,451.03
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		5,601,150.48	-65,185,451.03
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		5,601,150.48	-65,185,451.03

6.3 净资产(基金净值)变动表

会计主体：泓德量化精选混合型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	183,581,214.45	-	71,356,308.73	254,937,523.18
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	183,581,214.45	-	71,356,308.73	254,937,523.18
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-7,243,213.04	-	2,426,760.93	-4,816,452.11
（一）、综合收益总额	-	-	5,601,150.48	5,601,150.48
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-7,243,213.04	-	-3,174,389.55	-10,417,602.59
其中：1.基金申购款	8,199,783.26	-	4,037,599.59	12,237,382.85
2.基金赎回款	-15,442,996.30	-	-7,211,989.14	-22,654,985.44
（三）、本期向基金份额持有	-	-	-	-

人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	176,338,001.41	-	73,783,069.66	250,121,071.07
项目	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	216,384,615.84	-	183,630,387.30	400,015,003.14
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	216,384,615.84	-	183,630,387.30	400,015,003.14
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-21,539,401.14	-	-76,687,684.04	-98,227,085.18
(一)、综合收益总额	-	-	-65,185,451.03	-65,185,451.03
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减)	-21,539,401.14	-	-11,502,233.01	-33,041,634.15

少以“-”号填列)				
其中：1.基金申购款	4,085,015.65	-	2,230,354.27	6,315,369.92
2.基金赎回款	-25,624,416.79	-	-13,732,587.28	-39,357,004.07
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	194,845,214.70	-	106,942,703.26	301,787,917.96

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

泓德量化精选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[2018]1231号《关于准予泓德量化精选混合型证券投资基金注册的批复》准予注册，并经中国证监会2019年7月18日机构部函[2019]1803号文准予延期募集，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《泓德量化精选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629,630,904.71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(2019)第0532号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泓德量化精选混合型证券投资基金基金合同》于2019

年9月6日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为629,793,546.24份，其中认购资金利息折合162,641.53份基金份额。本基金的基金管理人为泓德基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泓德量化精选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为：股票投资占基金资产的比例为60%-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×80%+中国债券综合全价指数收益率×20%。

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》、《泓德量化精选混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2023年1月1日至2023年6月30日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2023年6月30日的财务状况以及2023年1月1日至2023年6月30日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[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 2023年06月30日
活期存款	4,761,531.40
等于：本金	4,760,891.95
加：应计利息	639.45
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	4,761,531.40

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	242,155,459.07	-	234,337,218.77	-7,818,240.30	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	278,800.00	19.51	307,095.01	28,275.50
	银行间市场	10,069,600.00	77,213.11	10,153,213.11	6,400.00
	合计	10,348,400.00	77,232.62	10,460,308.12	34,675.50
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	252,503,859.07	77,232.62	244,797,526.89	-7,783,564.80	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	58.00

应付证券出借违约金	-
应付交易费用	502,407.37
其中：交易所市场	502,232.37
银行间市场	175.00
应付利息	-
预提费用	89,260.15
合计	591,725.52

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	183,581,214.45	183,581,214.45
本期申购	8,199,783.26	8,199,783.26
本期赎回（以“-”号填列）	-15,442,996.30	-15,442,996.30
本期末	176,338,001.41	176,338,001.41

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	73,876,578.40	-2,520,269.67	71,356,308.73
本期利润	1,874,854.56	3,726,295.92	5,601,150.48
本期基金份额交易产生的变动数	-2,982,644.89	-191,744.66	-3,174,389.55
其中：基金申购款	3,734,225.17	303,374.42	4,037,599.59
基金赎回款	-6,716,870.06	-495,119.08	-7,211,989.14
本期已分配利润	-	-	-
本期末	72,768,788.07	1,014,281.59	73,783,069.66

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
活期存款利息收入	11,120.47
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	6,159.01
其他	494.21
合计	17,773.69

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
卖出股票成交总额	575,706,059.66
减：卖出股票成本总额	571,912,127.03
减：交易费用	1,486,168.20
买卖股票差价收入	2,307,764.43

6.4.7.11 债券投资收益**6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
债券投资收益——利息收入	130,796.92
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	40,981.39
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	171,778.31

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	10,428,985.96
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	10,167,780.00
减：应计利息总额	220,041.21
减：交易费用	183.36
买卖债券差价收入	40,981.39

6.4.7.12 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
股票投资产生的股利收益	1,734,808.18
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	1,734,808.18

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
1.交易性金融资产	3,726,295.92
——股票投资	3,710,603.42
——债券投资	15,692.50

——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	3,726,295.92

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
基金赎回费收入	6,097.31
基金转换费收入	1,414.79
合计	7,512.10

注：1、本基金的赎回费率随着持有期限的增加而递减，将不低于赎回费总额的25%计入基金财产。

2、本基金的转换费由申购补差费和赎回费两部分构成，其中不低于赎回费25%的部分归入转出基金的基金资产。

6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	2,084.39
账户维护费	18,000.00

其他	600.00
合计	109,944.54

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

本基金管理人于2023年8月12日发布《泓德基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，自2023年8月14日起，本基金的管理费年费率调整为1.20%，托管费年费率调整为0.20%。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日

当期发生的基金应支付的管理费	1,939,224.84	2,356,883.80
其中：支付销售机构的客户维护费	505,889.86	611,952.90

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 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023 年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	323,204.14	392,813.98

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2023年01月01日至 2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至 2022年06月30日
报告期初持有的基金份额	48,980,365.20	48,980,365.20
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	48,980,365.20	48,980,365.20
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	27.78%	25.14%

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023年06月30日		上年度末 2022年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
泓德基业(西藏)企业管理有限公司	3,859,436.51	2.19%	3,859,436.51	2.10%

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	4,761,531.40	11,120.47	15,405,235.66	21,925.63

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2023年06月30日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001286	陕西能源	2023-03-31	6个月以上	限售股	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
301317	鑫磊股份	2023-01-12	6个月以上	限售股	20.67	26.17	598	12,360.66	15,649.66	-
301358	湖南裕能	2023-02-01	6个月以上	限售股	23.77	42.89	355	8,438.35	15,225.95	-
301260	格力博	2023-01-20	6个月以上	限售股	30.85	23.63	458	14,129.30	10,822.54	-
301246	宏源药业	2023-03-10	6个月以上	限售股	50.00	30.71	304	15,200.00	9,335.84	-
001287	中电港	2023-03-30	6个月以上	限售股	11.88	21.02	386	4,585.68	8,113.72	-
301386	未来电器	2023-03-21	6个月以上	限售股	29.99	23.79	282	8,457.18	6,708.78	-
301439	泓淋电力	2023-03-10	6个月以上	限售股	19.99	16.90	393	7,856.07	6,641.70	-
603135	中重科技	2023-03-29	6个月以上	限售股	17.80	17.89	285	5,073.00	5,098.65	-
301345	涛涛车业	2023-03-10	6个月以	限售股	73.45	46.64	100	7,345.00	4,664.00	-

			上							
601065	江盐集团	2023-03-31	6个月以上	限售股	10.36	11.84	328	3,398.08	3,883.52	-
601133	柏诚股份	2023-03-31	6个月以上	限售股	11.66	12.26	280	3,264.80	3,432.80	-
001328	登康口腔	2023-03-29	6个月以上	限售股	20.68	25.49	121	2,502.28	3,084.29	-
001282	三联锻造	2023-05-15	6个月以上	限售股	27.93	33.03	93	2,597.49	3,071.79	-
001360	南矿集团	2023-03-31	6个月以上	限售股	15.38	14.87	166	2,553.08	2,468.42	-
603125	常青科技	2023-03-30	6个月以上	限售股	25.98	24.53	95	2,468.10	2,330.35	-
001324	长青科技	2023-05-12	6个月以上	限售股	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
001367	海森药业	2023-03-30	6个月以上	限售股	44.48	39.48	53	2,357.44	2,092.44	-
603172	万丰股份	2023-04-28	6个月以上	限售股	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
1231	金埔	2023-	19个	新债	100.0	100.0	138	13,80	13,80	-

98	转债	06-08	工作日	未上市	0	2		0.00	2.09	
----	----	-------	-----	-----	---	---	--	------	------	--

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户,选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的设定限售期的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股,在新股上市后的约定期限内不能自由转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

于本报告期期末，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为0.12%(上年度末：0.11%)。

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 2023 年 06 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	4,761,531.40	-	-	-	4,761,531.40
结算备付金	835,437.07	-	-	-	835,437.07
存出保证金	60,484.46	-	-	-	60,484.46
交易性金融资产	10,153,213.11	293,292.92	13,802.09	234,337,218.77	244,797,526.89
应收清算款	-	-	-	1,362,898.45	1,362,898.45
应收申购款	-	-	-	12,109.12	12,109.12
资产总计	15,810,666.04	293,292.92	13,802.09	235,712,226.34	251,829,987.39
负债					
应付赎回款	-	-	-	759,410.87	759,410.87
应付管理人报酬	-	-	-	306,666.45	306,666.45
应付托管费	-	-	-	51,111.09	51,111.09
应交税费	-	-	-	2.39	2.39
其他负债	-	-	-	591,725.52	591,725.52
负债总计	-	-	-	1,708,916.32	1,708,916.32
利率敏感度缺口	15,810,666.04	293,292.92	13,802.09	234,003,310.02	250,121,071.07

上年度末 2022 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	4,028,057.98	-	-	-	4,028,057.98
结算备付金	587,692.20	-	-	-	587,692.20
存出保证金	53,725.40	-	-	-	53,725.40
交易性金融资产	10,168,753.42	279,487.30	-	238,820,157.35	249,268,398.07
买入返售金融资产	-1,438.28	-	-	-	-1,438.28
应收清算款	-	-	-	4,048,871.08	4,048,871.08
应收申购款	-	-	-	12,856.82	12,856.82
资产总计	14,836,790.72	279,487.30	-	242,881,885.25	257,998,163.27
负债					
应付清算款	-	-	-	2,121,758.26	2,121,758.26
应付赎回款	-	-	-	9,869.14	9,869.14
应付管理人报酬	-	-	-	329,822.01	329,822.01
应付托管费	-	-	-	54,970.33	54,970.33
应交税费	-	-	-	2.24	2.24
其他负债	-	-	-	544,218.11	544,218.11
负债总计	-	-	-	3,060,640.09	3,060,640.09
利率敏感度缺口	14,836,790.72	279,487.30	-	239,821,245.16	254,937,523.18

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4.18%(上年度末：4.10%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(上年度末：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	234,337,218.77	93.69	238,820,157.35	93.68

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	234,337,218.77	93.69	238,820,157.35	93.68

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化5%，其他变量不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
	业绩比较基准上升5%	13,369,274.42	14,617,255.32
	业绩比较基准下降5%	-13,369,274.42	-14,617,255.32

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	234,488,237.51	238,062,266.10

第二层次	10,167,015.20	10,168,753.42
第三层次	142,274.18	1,037,378.55
合计	244,797,526.89	249,268,398.07

6.4.14.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2023年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2022年12月31日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	234,337,218.77	93.05
	其中：股票	234,337,218.77	93.05
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	10,460,308.12	4.15
	其中：债券	10,460,308.12	4.15

	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	5,596,968.47	2.22
8	其他各项资产	1,435,492.03	0.57
9	合计	251,829,987.39	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	4,318,966.00	1.73
B	采矿业	8,600,019.00	3.44
C	制造业	121,569,640.22	48.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,256,105.47	3.70
E	建筑业	2,267,793.80	0.91
F	批发和零售业	8,705,800.80	3.48
G	交通运输、仓储和邮政业	19,547,504.00	7.82
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	26,432,513.86	10.57
J	金融业	18,270,118.00	7.30
K	房地产业	4,103,060.00	1.64
L	租赁和商务服务业	962,473.00	0.38
M	科学研究和技术服务业	4,314,942.00	1.73
N	水利、环境和公共设施管理业	1,289,986.62	0.52
O	居民服务、修理和其他服务业	458,344.00	0.18
P	教育	49,698.00	0.02
Q	卫生和社会工作	4,088,680.00	1.63

R	文化、体育和娱乐业	101,574.00	0.04
S	综合	-	-
	合计	234,337,218.77	93.69

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通机制投资的港股。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	300059	东方财富	460,320	6,536,544.00	2.61
2	600030	中信证券	326,500	6,458,170.00	2.58
3	600612	老凤祥	51,710	3,613,494.80	1.44
4	600998	九州通	347,766	3,609,811.08	1.44
5	688002	睿创微纳	80,000	3,584,000.00	1.43
6	603885	吉祥航空	230,500	3,556,615.00	1.42
7	601567	三星医疗	281,500	3,555,345.00	1.42
8	688148	芳源股份	287,500	3,507,500.00	1.40
9	000338	潍柴动力	275,600	3,433,976.00	1.37
10	300143	盈康生命	302,000	3,424,680.00	1.37
11	688213	思特威	66,572	3,404,492.08	1.36
12	688258	卓易信息	50,900	3,396,557.00	1.36
13	000708	中信特钢	213,300	3,378,672.00	1.35
14	601088	中国神华	109,200	3,357,900.00	1.34
15	300433	蓝思科技	285,400	3,356,304.00	1.34
16	688425	铁建重工	692,700	3,331,887.00	1.33
17	600861	北京人力	143,200	3,322,240.00	1.33
18	002458	益生股份	268,600	3,317,210.00	1.33
19	688173	希荻微	144,581	3,308,013.28	1.32

20	603058	永吉股份	335,700	3,273,075.00	1.31
21	688083	中望软件	22,548	3,266,979.72	1.31
22	600583	海油工程	555,700	3,250,845.00	1.30
23	688236	春立医疗	130,400	3,194,800.00	1.28
24	600011	华能国际	340,600	3,153,956.00	1.26
25	300065	海兰信	254,300	3,150,777.00	1.26
26	601111	中国国航	382,300	3,150,152.00	1.26
27	600580	卧龙电驱	206,200	3,012,582.00	1.20
28	002928	华夏航空	354,900	2,998,905.00	1.20
29	600570	恒生电子	65,400	2,896,566.00	1.16
30	688798	艾为电子	48,720	2,881,788.00	1.15
31	600519	贵州茅台	1,700	2,874,700.00	1.15
32	688095	福昕软件	22,540	2,848,605.20	1.14
33	688711	宏微科技	48,290	2,817,238.60	1.13
34	688315	诺禾致源	105,700	2,806,335.00	1.12
35	002142	宁波银行	110,650	2,799,445.00	1.12
36	601717	郑煤机	220,400	2,743,980.00	1.10
37	002345	潮宏基	344,600	2,708,556.00	1.08
38	688819	天能股份	73,400	2,704,056.00	1.08
39	601006	大秦铁路	307,000	2,281,010.00	0.91
40	603899	晨光股份	49,000	2,187,360.00	0.87
41	601021	春秋航空	37,300	2,143,631.00	0.86
42	600886	国投电力	166,800	2,110,020.00	0.84
43	601229	上海银行	352,900	2,029,175.00	0.81
44	600048	保利发展	154,300	2,010,529.00	0.80
45	688177	百奥泰	74,100	1,979,211.00	0.79
46	000002	万科 A	139,000	1,948,780.00	0.78
47	600956	新天绿能	216,000	1,883,520.00	0.75
48	601816	京沪高铁	354,000	1,862,040.00	0.74
49	688020	方邦股份	37,100	1,853,887.00	0.74
50	600029	南方航空	305,300	1,840,959.00	0.74

51	601908	京运通	265,800	1,608,090.00	0.64
52	002724	海洋王	178,700	1,551,116.00	0.62
53	600582	天地科技	261,100	1,522,213.00	0.61
54	000922	佳电股份	112,900	1,485,764.00	0.59
55	002123	梦网科技	108,500	1,441,965.00	0.58
56	301101	明月镜片	31,450	1,290,393.50	0.52
57	601369	陕鼓动力	140,100	1,276,311.00	0.51
58	688058	宝兰德	21,800	1,242,382.00	0.50
59	002154	报喜鸟	224,200	1,237,584.00	0.49
60	688023	安恒信息	7,000	1,222,970.00	0.49
61	600562	国睿科技	73,700	1,193,940.00	0.48
62	688318	财富趋势	11,620	1,161,651.40	0.46
63	603878	武进不锈	132,440	1,119,118.00	0.45
64	601311	骆驼股份	118,100	1,095,968.00	0.44
65	601857	中国石油	140,400	1,048,788.00	0.42
66	601611	中国核建	123,200	1,041,040.00	0.42
67	688319	欧林生物	47,900	1,036,077.00	0.41
68	002912	中新赛克	23,300	1,025,433.00	0.41
69	688508	芯朋微	17,400	1,009,026.00	0.40
70	603288	海天味业	21,320	998,842.00	0.40
71	600366	宁波韵升	112,300	996,101.00	0.40
72	301047	义翘神州	11,600	994,120.00	0.40
73	601619	嘉泽新能	216,400	984,620.00	0.39
74	603587	地素时尚	67,200	983,808.00	0.39
75	301116	益客食品	61,400	945,560.00	0.38
76	002180	纳思达	27,600	945,300.00	0.38
77	603345	安井食品	6,300	924,840.00	0.37
78	300408	三环集团	31,000	909,850.00	0.36
79	688386	泛亚微透	21,598	907,116.00	0.36
80	002233	塔牌集团	115,700	893,204.00	0.36
81	300853	申昊科技	25,200	884,520.00	0.35

82	600642	申能股份	126,200	882,138.00	0.35
83	000739	普洛药业	49,500	878,130.00	0.35
84	002852	道道全	67,500	872,775.00	0.35
85	002010	传化智联	161,900	861,308.00	0.34
86	300511	雪榕生物	111,600	848,160.00	0.34
87	300884	狄耐克	63,500	840,740.00	0.34
88	603027	千禾味业	39,500	834,240.00	0.33
89	603861	白云电器	78,800	756,480.00	0.30
90	600845	宝信软件	14,880	756,052.80	0.30
91	688186	广大特材	23,200	754,696.00	0.30
92	600755	厦门国贸	95,800	741,492.00	0.30
93	300203	聚光科技	35,300	715,531.00	0.29
94	688139	海尔生物	13,681	704,161.07	0.28
95	300103	达刚控股	111,800	686,452.00	0.27
96	688608	恒玄科技	5,600	677,768.00	0.27
97	688658	悦康药业	31,900	663,839.00	0.27
98	688234	天岳先进	8,700	643,278.00	0.26
99	688206	概伦电子	22,800	639,312.00	0.26
100	688072	拓荆科技	1,500	638,955.00	0.26
101	688288	鸿泉物联	25,000	635,500.00	0.25
102	688536	思瑞浦	2,900	632,200.00	0.25
103	605599	菜百股份	47,700	630,117.00	0.25
104	603309	维力医疗	40,500	626,535.00	0.25
105	601958	金钼股份	53,500	596,525.00	0.24
106	002293	罗莱生活	51,600	593,400.00	0.24
107	300320	海达股份	73,900	578,637.00	0.23
108	002609	捷顺科技	49,500	577,170.00	0.23
109	605100	华丰股份	32,300	569,449.00	0.23
110	688358	祥生医疗	11,100	566,100.00	0.23
111	688067	爱威科技	25,643	564,146.00	0.23
112	600019	宝钢股份	98,400	553,008.00	0.22

113	300342	天银机电	51,200	551,424.00	0.22
114	600741	华域汽车	29,200	539,032.00	0.22
115	300999	金龙鱼	13,400	535,866.00	0.21
116	300777	中简科技	11,200	529,312.00	0.21
117	300055	万邦达	71,200	512,640.00	0.20
118	000157	中联重科	74,800	504,900.00	0.20
119	002746	仙坛股份	61,100	481,468.00	0.19
120	300736	百邦科技	37,600	458,344.00	0.18
121	601519	大智慧	62,400	446,784.00	0.18
122	000089	深圳机场	54,300	377,385.00	0.15
123	002352	顺丰控股	8,100	365,229.00	0.15
124	301239	普瑞眼科	3,700	362,896.00	0.15
125	300279	和晶科技	59,900	334,841.00	0.13
126	688019	安集科技	2,000	329,660.00	0.13
127	600419	天润乳业	20,100	326,022.00	0.13
128	688510	航亚科技	16,300	324,207.00	0.13
129	002283	天润工业	48,600	312,012.00	0.12
130	002524	光正眼科	49,200	301,104.00	0.12
131	601898	中煤能源	34,400	290,336.00	0.12
132	601333	广深铁路	63,500	251,460.00	0.10
133	600115	中国东航	51,300	244,188.00	0.10
134	002073	软控股份	35,500	235,010.00	0.09
135	001872	招商港口	13,200	227,964.00	0.09
136	300226	上海钢联	7,000	226,800.00	0.09
137	300228	富瑞特装	32,600	208,640.00	0.08
138	688009	中国通号	35,700	207,060.00	0.08
139	688378	奥来德	4,100	202,540.00	0.08
140	301043	绿岛风	5,300	169,441.00	0.07
141	600528	中铁工业	16,800	165,984.00	0.07
142	603556	海兴电力	6,400	161,536.00	0.06
143	000852	石化机械	21,900	157,461.00	0.06

144	688733	壹石通	4,600	142,416.00	0.06
145	300971	博亚精工	4,400	115,500.00	0.05
146	688050	爱博医疗	500	102,665.00	0.04
147	002739	万达电影	8,100	101,574.00	0.04
148	688246	嘉和美康	2,400	100,488.00	0.04
149	603182	嘉华股份	5,500	83,160.00	0.03
150	688328	深科达	2,400	80,352.00	0.03
151	600353	旭光电子	8,700	71,340.00	0.03
152	603178	圣龙股份	5,300	65,296.00	0.03
153	300780	德恩精工	3,600	64,872.00	0.03
154	300626	华瑞股份	6,200	64,294.00	0.03
155	002199	东晶电子	7,300	62,123.00	0.02
156	300807	天迈科技	2,100	61,425.00	0.02
157	002931	锋龙股份	4,700	61,335.00	0.02
158	603798	康普顿	5,980	60,756.80	0.02
159	688260	昀冢科技	3,300	60,654.00	0.02
160	300984	金沃股份	2,300	60,329.00	0.02
161	002715	登云股份	4,100	60,229.00	0.02
162	301070	开勒股份	1,600	59,840.00	0.02
163	300611	美力科技	6,200	59,768.00	0.02
164	603679	华体科技	4,000	59,680.00	0.02
165	300818	耐普矿机	2,500	59,375.00	0.02
166	688655	迅捷兴	3,600	59,184.00	0.02
167	688081	兴图新科	3,080	59,043.60	0.02
168	603177	德创环保	4,700	58,656.00	0.02
169	688622	禾信仪器	1,651	58,610.50	0.02
170	300838	浙江力诺	3,200	58,464.00	0.02
171	000856	冀东装备	6,700	58,156.00	0.02
172	600689	上海三毛	6,200	57,970.00	0.02
172	300717	华信新材	3,400	57,970.00	0.02
174	688115	思林杰	1,500	57,945.00	0.02

175	603657	春光科技	3,300	57,915.00	0.02
176	301042	安联锐视	1,700	57,715.00	0.02
177	003023	彩虹集团	2,800	57,428.00	0.02
178	600192	长城电工	9,900	57,321.00	0.02
179	300876	蒙泰高新	2,200	57,310.00	0.02
180	002743	富煌钢构	9,900	56,925.00	0.02
181	002848	高斯贝尔	5,300	56,922.00	0.02
182	688096	京源环保	5,783	56,904.72	0.02
183	603615	茶花股份	6,000	56,640.00	0.02
184	002787	华源控股	7,800	56,550.00	0.02
185	688171	纬德信息	2,309	56,431.96	0.02
186	002696	百洋股份	9,000	56,160.00	0.02
187	000593	德龙汇能	8,300	56,108.00	0.02
188	688335	复洁环保	2,285	56,073.90	0.02
189	688021	奥福环保	2,162	56,039.04	0.02
190	300509	新美星	7,400	55,870.00	0.02
191	002890	弘宇股份	3,780	55,830.60	0.02
192	003001	中岩大地	3,400	55,692.00	0.02
193	300084	海默科技	8,900	55,625.00	0.02
194	301032	新柴股份	6,200	55,490.00	0.02
195	300823	建科机械	2,700	55,485.00	0.02
196	000622	恒立实业	14,300	55,484.00	0.02
197	301003	江苏博云	2,400	55,464.00	0.02
198	603326	我乐家居	7,100	55,451.00	0.02
199	300176	派生科技	9,000	55,440.00	0.02
200	688090	瑞松科技	1,500	55,395.00	0.02
201	603499	翔港科技	5,800	55,332.00	0.02
202	603320	迪贝电气	3,800	55,252.00	0.02
203	603926	铁流股份	5,400	55,242.00	0.02
204	300462	华铭智能	4,700	55,178.00	0.02
205	300956	英力股份	3,500	55,055.00	0.02

206	603036	如通股份	5,200	55,016.00	0.02
207	603356	华菱精工	3,900	54,990.00	0.02
208	300930	屹通新材	2,200	54,890.00	0.02
209	301178	天亿马	1,700	54,791.00	0.02
210	002671	龙泉股份	13,000	54,730.00	0.02
211	002687	乔治白	11,400	54,720.00	0.02
211	001234	泰慕士	2,400	54,720.00	0.02
213	688367	工大高科	3,095	54,719.60	0.02
214	002811	郑中设计	6,900	54,717.00	0.02
215	300707	威唐工业	3,500	54,705.00	0.02
216	300652	雷迪克	2,400	54,648.00	0.02
217	002862	实丰文化	2,900	54,636.00	0.02
218	605258	协和电子	2,100	54,558.00	0.02
219	000565	渝三峡 A	9,900	54,549.00	0.02
220	603321	梅轮电梯	7,000	54,530.00	0.02
221	300720	海川智能	4,300	54,395.00	0.02
222	603860	中公高科	1,900	54,302.00	0.02
223	603183	建研院	11,500	54,280.00	0.02
224	002883	中设股份	4,600	54,234.00	0.02
225	603089	正裕工业	6,100	54,229.00	0.02
226	300694	蠡湖股份	5,100	54,213.00	0.02
227	600272	开开实业	6,000	54,180.00	0.02
228	603580	艾艾精工	3,800	54,074.00	0.02
229	300808	久量股份	4,000	54,000.00	0.02
230	002420	毅昌科技	8,800	53,944.00	0.02
231	300535	达威股份	3,700	53,872.00	0.02
232	688038	中科通达	3,600	53,856.00	0.02
233	605003	众望布艺	2,800	53,844.00	0.02
234	002861	瀛通通讯	4,700	53,768.00	0.02
235	605255	天普股份	3,400	53,720.00	0.02
236	603810	丰山集团	3,900	53,703.00	0.02

237	300417	南华仪器	5,000	53,700.00	0.02
238	603958	哈森股份	7,000	53,690.00	0.02
239	300907	康平科技	2,500	53,675.00	0.02
240	300789	唐源电气	2,600	53,612.00	0.02
241	688528	秦川物联	5,000	53,550.00	0.02
241	688296	和达科技	3,000	53,550.00	0.02
243	600444	国机通用	3,900	53,547.00	0.02
244	000955	欣龙控股	12,400	53,444.00	0.02
245	603090	宏盛股份	2,400	53,400.00	0.02
246	300931	通用电梯	6,800	53,380.00	0.02
247	600099	林海股份	5,700	53,352.00	0.02
248	300920	润阳科技	3,100	53,351.00	0.02
249	603037	凯众股份	3,900	53,313.00	0.02
250	002209	达意隆	5,200	53,300.00	0.02
251	300126	锐奇股份	8,200	53,218.00	0.02
252	300588	熙菱信息	4,600	53,176.00	0.02
253	002691	冀凯股份	8,500	53,125.00	0.02
254	688485	九州一轨	3,463	53,122.42	0.02
255	603928	兴业股份	4,400	53,108.00	0.02
256	002767	先锋电子	3,800	53,086.00	0.02
257	300050	世纪鼎利	12,200	53,070.00	0.02
258	603023	威帝股份	13,000	53,040.00	0.02
259	603045	福达合金	3,500	52,990.00	0.02
260	603238	诺邦股份	4,200	52,962.00	0.02
261	002809	红墙股份	4,900	52,920.00	0.02
262	688685	迈信林	2,500	52,900.00	0.02
263	300948	冠中生态	3,500	52,885.00	0.02
264	301182	凯旺科技	2,300	52,831.00	0.02
265	300868	杰美特	2,900	52,780.00	0.02
266	000702	正虹科技	9,600	52,608.00	0.02
267	002830	名雕股份	4,100	52,521.00	0.02

268	688004	博汇科技	1,500	52,455.00	0.02
269	300889	爱克股份	3,500	52,395.00	0.02
270	688577	浙海德曼	1,100	52,338.00	0.02
271	300992	泰福泵业	2,600	52,312.00	0.02
272	603059	倍加洁	2,300	52,302.00	0.02
273	300980	祥源新材	2,600	52,286.00	0.02
274	600243	青海华鼎	11,800	52,274.00	0.02
275	301056	森赫股份	5,700	52,212.00	0.02
276	603316	诚邦股份	8,500	52,190.00	0.02
277	605287	德才股份	2,200	52,140.00	0.02
278	603389	亚振家居	9,800	52,136.00	0.02
279	002591	恒大高新	8,100	52,083.00	0.02
280	002898	赛隆药业	4,600	52,072.00	0.02
281	300564	筑博设计	3,900	52,026.00	0.02
282	300923	研奥股份	2,300	51,980.00	0.02
283	300405	科隆股份	9,500	51,965.00	0.02
284	300562	乐心医疗	5,300	51,940.00	0.02
285	300243	瑞丰高材	5,900	51,920.00	0.02
286	300865	大宏立	2,400	51,888.00	0.02
287	300743	天地数码	3,300	51,876.00	0.02
288	688251	井松智能	1,700	51,850.00	0.02
289	003003	天元股份	4,900	51,842.00	0.02
290	002998	优彩资源	7,300	51,830.00	0.02
291	000605	渤海股份	8,200	51,824.00	0.02
292	300899	上海凯鑫	2,100	51,807.00	0.02
293	301105	鸿铭股份	1,400	51,800.00	0.02
294	300635	中达安	3,800	51,794.00	0.02
295	300074	华平股份	12,000	51,720.00	0.02
296	003008	开普检测	1,800	51,714.00	0.02
297	603041	美思德	4,300	51,686.00	0.02
298	688616	西力科技	3,900	51,597.00	0.02

299	002295	精艺股份	7,500	51,525.00	0.02
300	603048	浙江黎明	3,200	51,520.00	0.02
301	300281	金明精机	9,600	51,456.00	0.02
302	003041	真爱美家	3,240	51,386.40	0.02
303	605318	法狮龙	3,700	51,282.00	0.02
303	603221	爱丽家居	6,600	51,282.00	0.02
305	688215	瑞晟智能	1,300	51,272.00	0.02
306	003018	金富科技	5,300	51,251.00	0.02
307	603637	镇海股份	6,200	51,150.00	0.02
308	000953	河化股份	9,700	51,119.00	0.02
309	300886	华业香料	2,200	51,106.00	0.02
310	300947	德必集团	3,500	51,065.00	0.02
311	600778	友好集团	7,500	51,000.00	0.02
311	300995	奇德新材	2,500	51,000.00	0.02
313	603937	丽岛新材	4,400	50,996.00	0.02
314	603161	科华控股	3,500	50,995.00	0.02
315	301288	清研环境	2,952	50,951.52	0.02
316	002963	豪尔赛	3,500	50,925.00	0.02
317	301024	霍普股份	2,000	50,900.00	0.02
318	603272	联翔股份	3,000	50,880.00	0.02
319	300218	安利股份	5,400	50,868.00	0.02
320	301067	显盈科技	2,340	50,801.40	0.02
321	605155	西大门	3,500	50,785.00	0.02
322	688092	爱科科技	1,700	50,779.00	0.02
323	600232	金鹰股份	9,300	50,778.00	0.02
324	688379	华光新材	2,500	50,775.00	0.02
325	300883	龙利得	8,200	50,758.00	0.02
326	300927	江天化学	3,100	50,747.00	0.02
327	002826	易明医药	4,600	50,646.00	0.02
328	301098	金埔园林	4,200	50,610.00	0.02
328	300936	中英科技	1,500	50,610.00	0.02

328	002981	朝阳科技	2,100	50,610.00	0.02
331	600561	江西长运	9,600	50,592.00	0.02
332	300169	天晟新材	12,100	50,578.00	0.02
333	000590	启迪药业	5,800	50,576.00	0.02
334	688069	德林海	2,380	50,551.20	0.02
335	603813	原尚股份	3,500	50,505.00	0.02
336	300640	德艺文创	8,400	50,484.00	0.02
337	300069	金利华电	3,700	50,468.00	0.02
338	001211	双枪科技	2,300	50,439.00	0.02
339	300321	同大股份	3,100	50,437.00	0.02
340	600235	民丰特纸	9,300	50,406.00	0.02
341	600793	宜宾纸业	4,100	50,389.00	0.02
342	300637	扬帆新材	7,000	50,260.00	0.02
343	000985	大庆华科	3,100	50,220.00	0.02
344	300329	海伦钢琴	7,100	50,197.00	0.02
345	001202	炬申股份	3,400	50,184.00	0.02
346	301081	严牌股份	5,040	50,148.00	0.02
347	600539	狮头股份	7,500	50,100.00	0.02
348	688681	科汇股份	3,100	50,096.00	0.02
349	600847	万里股份	4,100	50,061.00	0.02
350	300621	维业股份	5,000	50,050.00	0.02
351	002718	友邦吊顶	3,300	50,028.00	0.02
352	002494	华斯股份	10,800	50,004.00	0.02
353	300554	三超新材	2,400	49,992.00	0.02
354	603079	圣达生物	3,900	49,959.00	0.02
355	605303	园林股份	4,500	49,950.00	0.02
356	600889	南京化纤	10,600	49,926.00	0.02
357	600768	宁波富邦	4,600	49,910.00	0.02
358	688466	金科环境	2,500	49,900.00	0.02
359	603022	新通联	5,300	49,873.00	0.02
360	301228	实朴检测	3,200	49,856.00	0.02

361	300106	西部牧业	6,200	49,786.00	0.02
362	300333	兆日科技	7,500	49,725.00	0.02
363	600455	博通股份	2,200	49,698.00	0.02
364	002442	龙星化工	10,100	49,692.00	0.02
365	300242	佳云科技	14,400	49,680.00	0.02
366	603080	新疆火炬	3,500	49,665.00	0.02
367	603536	惠发食品	7,700	49,588.00	0.02
368	002278	神开股份	9,300	49,569.00	0.02
369	300658	延江股份	7,560	49,518.00	0.02
370	300703	创源股份	5,200	49,504.00	0.02
371	688669	聚石化学	2,730	49,494.90	0.02
372	000632	三木集团	11,700	49,491.00	0.02
373	300419	浩丰科技	7,900	49,454.00	0.02
374	002105	信隆健康	8,300	49,385.00	0.02
375	603726	朗迪集团	3,900	49,374.00	0.02
376	300819	聚杰微纤	3,600	49,356.00	0.02
377	600356	恒丰纸业	6,300	49,329.00	0.02
378	600128	弘业股份	6,000	49,320.00	0.02
378	301040	中环海陆	2,400	49,320.00	0.02
380	300854	中兰环保	3,100	49,290.00	0.02
381	600493	凤竹纺织	8,800	49,280.00	0.02
382	002144	宏达高科	4,400	49,236.00	0.02
383	605081	太和水	3,300	49,137.00	0.02
384	688163	赛伦生物	2,300	49,105.00	0.02
385	603696	安记食品	5,200	49,088.00	0.02
386	300955	嘉亨家化	2,300	48,990.00	0.02
387	300385	雪浪环境	8,000	48,960.00	0.02
387	002682	龙洲股份	12,000	48,960.00	0.02
389	688109	品茗科技	1,885	48,821.50	0.02
390	600149	廊坊发展	8,700	48,807.00	0.02
391	600051	宁波联合	6,700	48,776.00	0.02

392	300929	华骐环保	4,300	48,719.00	0.02
393	600678	四川金顶	9,100	48,594.00	0.02
394	600538	国发股份	11,500	48,530.00	0.02
395	603506	南都物业	4,100	48,503.00	0.02
396	002856	美芝股份	4,900	48,461.00	0.02
397	603226	菲林格尔	9,500	48,450.00	0.02
398	002775	文科园林	12,900	48,375.00	0.02
399	600193	创兴资源	9,200	48,300.00	0.02
400	301057	汇隆新材	2,800	48,272.00	0.02
401	688217	睿昂基因	1,200	48,180.00	0.02
401	002058	威尔泰	4,400	48,180.00	0.02
403	301075	多瑞医药	2,000	48,100.00	0.02
404	600692	亚通股份	8,600	47,988.00	0.02
405	301027	华蓝集团	3,900	47,931.00	0.02
406	002492	恒基达鑫	8,300	47,725.00	0.02
407	600097	开创国际	5,000	47,650.00	0.02
408	000619	海螺新材	7,800	47,580.00	0.02
409	688350	富淼科技	2,800	47,572.00	0.02
410	600234	科新发展	7,900	47,479.00	0.02
411	300949	奥雅股份	1,300	47,450.00	0.02
412	600281	华阳新材	11,700	47,385.00	0.02
413	603903	中持股份	5,300	47,382.00	0.02
414	000573	粤宏远 A	13,900	47,260.00	0.02
415	300521	爱司凯	3,700	47,249.00	0.02
416	603214	爱婴室	2,900	47,183.00	0.02
417	301273	瑞晨环保	1,500	47,040.00	0.02
418	600802	福建水泥	9,500	46,835.00	0.02
419	688679	通源环境	3,200	46,624.00	0.02
420	688597	煜邦电力	4,600	46,460.00	0.02
421	000890	法尔胜	11,500	46,000.00	0.02
422	688607	康众医疗	2,400	45,888.00	0.02

423	603955	大千生态	3,000	45,600.00	0.02
424	600697	欧亚集团	3,700	45,547.00	0.02
425	603021	山东华鹏	8,900	45,479.00	0.02
426	301259	艾布鲁	3,380	45,461.00	0.02
427	300162	雷曼光电	6,200	43,524.00	0.02
428	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.01
429	301317	鑫磊股份	598	15,649.66	0.01
430	301358	湖南裕能	355	15,225.95	0.01
431	301260	格力博	458	10,822.54	0.00
432	301246	宏源药业	304	9,335.84	0.00
433	001287	中电港	386	8,113.72	0.00
434	301386	未来电器	282	6,708.78	0.00
435	301439	泓淋电力	393	6,641.70	0.00
436	603135	中重科技	285	5,098.65	0.00
437	301345	涛涛车业	100	4,664.00	0.00
438	601065	江盐集团	328	3,883.52	0.00
439	601133	柏诚股份	280	3,432.80	0.00
440	001328	登康口腔	121	3,084.29	0.00
441	001282	三联锻造	93	3,071.79	0.00
442	001360	南矿集团	166	2,468.42	0.00
443	603125	常青科技	95	2,330.35	0.00
444	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
445	001367	海森药业	53	2,092.44	0.00
446	603172	万丰股份	122	1,967.86	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	300143	盈康生命	7,217,673.00	2.83

2	688318	财富趋势	5,056,804.52	1.98
3	603613	国联股份	4,876,184.00	1.91
4	000683	远兴能源	4,789,177.00	1.88
5	601111	中国国航	4,741,197.00	1.86
6	300767	震安科技	4,443,111.11	1.74
7	688002	睿创微纳	4,356,979.41	1.71
8	600989	宝丰能源	4,336,549.00	1.70
9	688711	宏微科技	4,284,007.68	1.68
10	002831	裕同科技	4,248,743.00	1.67
11	603712	七一二	4,216,630.00	1.65
12	688258	卓易信息	4,180,100.32	1.64
13	688408	中信博	4,126,630.83	1.62
14	605589	圣泉集团	4,108,954.00	1.61
15	002746	仙坛股份	4,085,899.00	1.60
16	603885	吉祥航空	3,951,847.00	1.55
17	688259	创耀科技	3,875,626.78	1.52
18	600029	南方航空	3,871,181.00	1.52
19	300725	药石科技	3,855,331.00	1.51
20	688707	振华新材	3,846,308.52	1.51

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	688318	财富趋势	9,876,120.08	3.87
2	300725	药石科技	8,052,423.00	3.16
3	688596	正帆科技	5,574,849.35	2.19
4	600160	巨化股份	5,352,300.00	2.10
5	688066	航天宏图	5,265,982.90	2.07
6	600989	宝丰能源	5,261,648.00	2.06
7	603613	国联股份	5,179,172.00	2.03

8	002468	申通快递	4,948,965.00	1.94
9	600027	华电国际	4,836,667.00	1.90
10	300183	东软载波	4,825,561.00	1.89
11	600373	中文传媒	4,643,572.00	1.82
12	600233	圆通速递	4,605,644.00	1.81
13	688613	奥精医疗	4,570,208.80	1.79
14	002493	荣盛石化	4,563,852.00	1.79
15	000623	吉林敖东	4,492,933.00	1.76
16	688023	安恒信息	4,462,347.62	1.75
17	600004	白云机场	4,437,056.00	1.74
18	600438	通威股份	4,374,332.00	1.72
19	603712	七一二	4,341,002.00	1.70
20	002729	好利科技	4,303,068.62	1.69

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	563,718,585.03
卖出股票收入（成交）总额	575,706,059.66

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,153,213.11	4.06
	其中：政策性金融债	10,153,213.11	4.06
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)	307,095.01	0.12
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,460,308.12	4.18

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	210303	21进出03	100,000	10,153,213.11	4.06
2	132026	G三峡EB2	2,650	293,292.92	0.12
3	123198	金埔转债	138	13,802.09	0.01

注：本基金本报告期末仅持有三只债券。

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中信证券（证券代码：600030）、睿创微纳（证券代码：688002）外，其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2023年04月11日，中信证券（证券代码：600030）发行人中信证券股份有限公司因未按照《保荐人尽职调查工作准则》等执业规范的要求，对发行人境外存货、境外销售、内部控制等异常情形保持充分关注并进行审慎核查，发表的核查意见不准确被深圳证券交易所书面警示。

2023年04月04日，中信证券（证券代码：600030）发行人中信证券股份有限公司因对关联方及关联交易现场检查不到位、未保持应有的职业审慎并开展审慎核查、未能督导发行人有效防止关联方违规占用发行人资金被中国证券监督管理委员会西藏监管局采取出具警示函的行政监督管理措施。

2023年02月06日，中信证券（证券代码：600030）发行人中信证券股份有限公司因未按规定履行客户身份识别义务、未按规定保存客户身份资料和交易记录、未按规定报送大额交易报告或者可疑交易报告被中国人民银行罚款1376万元。

2022年09月24日，中信证券（证券代码：600030）发行人中信证券股份有限公司因内部制度不完善被中国证券监督管理委员会深圳监管局整改通知。

2022年10月10日，睿创微纳（证券代码：688002）发行人烟台睿创微纳技术股份有限公司因对限制性股票激励计划的会计处理出现差错，导致公司2021年、2022年多期定期报告相关财务信息披露不准确被上海证券交易所通报批评。

2022年08月03日，睿创微纳（证券代码：688002）发行人烟台睿创微纳技术股份有限公司因股份支付费用披露不准确、购买理财产品情况披露不准确被中国证券监督管理委员会山东监管局采取责令改正的行政监管措施。

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	60,484.46
2	应收清算款	1,362,898.45

3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	12,109.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,435,492.03

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	132026	G三峡EB2	293,292.92	0.12

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
19,490	9,047.61	52,895,657.18	30.00%	123,442,344.23	70.00%

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	790,608.86	0.4483%

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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2019年09月06日)基金份额总额	629,793,546.24
本报告期期初基金份额总额	183,581,214.45
本报告期基金总申购份额	8,199,783.26
减：本报告期基金总赎回份额	15,442,996.30
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	176,338,001.41

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§10 重大事件揭示**10.1 基金份额持有人大会决议**

本报告期，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动**（1）基金管理人的重大人事变动**

2023年2月21日，本基金管理人发布《泓德基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，邬传雁离任公司副总经理；2023年5月18日，本基金管理人发布《泓德基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，温永鹏转任公司董事长，不再担任副总经理职务，胡康宁离任董事长。

（2）基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金基金管理人、基金财产以及基金托管人基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

自本基金基金合同生效日起普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务至今，本报告期内会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期未发生公司及其高级管理人员被中国证监会、基金业协会、证券交易所施以重大处罚或公开谴责，以及被财政、外汇和审计等部门施以重大处罚的情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
广发证券	2	359,624,809.61	31.61%	259,400.42	31.61%	-
中泰证券	2	233,489,797.00	20.52%	168,415.84	20.52%	-
长城证券	2	204,800,364.60	18.00%	147,723.93	18.00%	-
中信建投证券	4	170,690,558.30	15.00%	123,118.11	15.00%	-
安信	4	59,912,102.70	5.27%	43,216.45	5.27%	-

证券						
渤海证券	1	50,355,269.92	4.43%	36,320.48	4.43%	-
中信证券	2	48,889,507.18	4.30%	35,263.55	4.30%	-
海通证券	1	9,911,302.37	0.87%	7,148.87	0.87%	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
西藏东方	2	-	-	-	-	-

财富证券							
信达证券	2	-	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-	-
中国中金财富证券	2	-	-	-	-	-	-
首创证券	3	-	-	-	-	-	-

注：1、本公司选择证券经营机构的标准

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

2、本公司租用券商交易单元的程序

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构；
- (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

3、本基金租用证券公司交易单元均为共用交易单元。

4、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

- (1) 本基金报告期内新增租用交易单元：华金证券
- (2) 本基金报告期内停止租用交易单元：无

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	208,985.96	100.00%	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	12,500,000.00	100.00%	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

渤海证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中国中金财富 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	泓德基金管理有限公司关于调整旗下基金在中国工商银行股份有限公司最低申购及定投金额起点的公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2023-01-13
2	泓德基金管理有限公司高级管理人员变更公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2023-02-21
3	泓德基金管理有限公司关于旗下基金参与部分销售机构基金转换费率优惠活动的公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2023-02-24
4	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金参与湘财证券股份有限公司费率优惠活动的公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2023-02-28

5	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东莞证券股份有限公司为销售机构的公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-29
6	泓德基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2023-05-18
7	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华西证券股份有限公司为销售机构的公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2023-05-26

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2023/01/01-2023/06/30	48,980,365.20	0.00	0.00	48,980,365.20	27.78%
产品特有风险							
<p>本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20%的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。</p> <p>在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p>							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准泓德量化精选混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《泓德量化精选混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《泓德量化精选混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《泓德量化精选混合型证券投资基金托管协议》；

- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在规定报刊上披露的各项公告。

12.2 存放地点

地点为管理人地址：北京市西城区德胜门外大街125号

12.3 查阅方式

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

泓德基金管理有限公司
二〇二三年八月三十日