

泓德泓业灵活配置混合型证券投资基金

2024 年中期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人:泓德基金管理有限公司

基金托管人:中国建设银行股份有限公司

送出日期:2024 年 08 月 29 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2024年1月1日起至2024年6月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	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	45
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 本基金投资股指期货的投资政策	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	46
§8 基金份额持有人信息	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	47

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	47
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	47
§9 开放式基金份额变动	48
§10 重大事件揭示	48
10.1 基金份额持有人大会决议	48
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	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	48
10.4 基金投资策略的改变	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	48
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	50
§11 影响投资者决策的其他重要信息	51
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	51
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	51
§12 备查文件目录	52
12.1 备查文件目录	52
12.2 存放地点	52
12.3 查阅方式	52

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泓德泓业灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	泓德泓业混合
基金主代码	001695
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年08月27日
基金管理人	泓德基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	86,230,723.10份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过科学的、谨慎的大类资产配置策略，和重点投资于具有较高安全边际证券的组合策略，力争实现绝对收益的目标。
投资策略	本基金通过研究宏观经济周期及调控政策规律，结合对股票、债券、货币等大类资产的市场变化趋势、风险收益对比、估值情况等进行的综合动态分析，主动进行本基金资产在股票、债券、货币等大类资产间的灵活配置。本基金股票投资策略主要采取自上而下和自下而上相结合的方法选择具有较高安全边际的股票进行投资，债券投资采取适当的久期策略、信用策略和时机策略，以及可转换债券投资策略相结合的方法。
业绩比较基准	一年期银行定期存款利率（税后）+3%
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于较高风险、较高收益的品种，其长期风险与收益特征低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称		泓德基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李晓春	王小飞
	联系电话	010-59850177	021-60637103
	电子邮箱	lixiaochun@hongdefund.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		4009-100-888	021-60637228
传真		010-59850195	021-60635778
注册地址		西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦1206室	北京市西城区金融大街25号
办公地址		北京市西城区德胜门外大街125号	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		100088	100033
法定代表人		王德晓	张金良

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2024年01月01日-2024年06月30日)
本期已实现收益	-57,202,863.78

本期利润	-60,053,922.39
加权平均基金份额本期利润	-0.3967
本期加权平均净值利润率	-29.74%
本期基金份额净值增长率	-20.67%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2024年06月30日)
期末可供分配利润	15,660,425.26
期末可供分配基金份额利润	0.1816
期末基金资产净值	101,891,148.36
期末基金份额净值	1.1816
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2024年06月30日)
基金份额累计净值增长率	64.63%

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	-10.42%	0.90%	0.37%	0.01%	-10.79%	0.89%
过去三个月	-11.57%	1.07%	1.12%	0.01%	-12.69%	1.06%
过去六个月	-20.67%	1.45%	2.24%	0.02%	-22.91%	1.43%
过去一年	-24.32%	1.26%	4.51%	0.01%	-28.83%	1.25%
过去三年	-42.80%	1.26%	13.51%	0.01%	-56.31%	1.25%
自基金合同	64.63%	1.06%	39.87%	0.01%	24.76%	1.05%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

注：本基金的业绩比较基准为：一年期银行定期存款利率（税后）+3%

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

泓德泓业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
(2015年08月27日-2024年06月30日)



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

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金基金管理人为泓德基金管理有限公司（以下简称“公司”或“泓德基金”），成立于2015年3月3日，是经中国证监会证监许可[2015]258号文批准设立的公募基金管理公司。公司注册资本为人民币1.43亿元，公司注册地拉萨市。

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金 经理（助理） 期限		证券 从业 年限	说明
		任职 日期	离任 日期		
操昭煦	本基金的基金经理	2021- 07-14	-	8年	硕士研究生，具有基金从业资格，资管行业从业经验12年，曾任职于交通银行。

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024年上半年A股市场波动较大，整体上仍处于下跌通道中。2月初市场在担忧宏观调控实际效果的悲观情绪下走出了加速下探的行情，随后的反弹持续性不强，在5月份观察到经济数据疲软后继续走入了下跌通道。整个上半年万得全A指数下跌8.01%，分板块看，上半年涨幅较大的是石油石化、煤炭、有色等有业绩支撑的上游周期板块和符合低风险偏好要求的银行、公用事业等行业。多数行业内部也是对于过去成长性较好的公司纷纷下修了成长预期，而对低估值、高股息率等安全边际较好的个股更加青睐。

报告期内本组合维持了高仓位运行，在一季度降低了白酒行业和医药上游行业的配置，在二季度增加了一些医药行业内低估公司的配置和社服行业的配置，降低了医疗服务行业配置。今年上半年组合净值延续了较弱的趋势，主要原因是受到了行业配置的影响，本组合重点配置的医药和消费板块作为典型的“下游”行业，在当前经济形势下的确面临着行业内部和外部大环境的双重压力。这两个板块在2021年以前一直是受到市场追捧的热门行业，但最近3年迅速跌落到经常出现在跌幅榜前列，这个过程不断捶打、考验着对医药股和消费股的投资逻辑。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末泓德泓业混合基金份额净值为1.1816元，本报告期内，基金份额净值增长率为-20.67%，同期业绩比较基准收益率为2.24%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

4.5.1 对宏观经济和证券市场展望

2024年上半年我国宏观经济面临着较为严峻的外部形势和内部经济结构转型的真实压力，整体上是生产端情况相对较好而需求端偏弱的局面。在旧的增长动力出清、新质生产力仍未成长到有足够影响力的情况下，我们经历了转型期的阵痛；当前影响国内需求释放的因素不仅包括以房地产为代表的旧动力的调整，也包括了居民资产负债表收缩、对未来就业和收入信心不足。我们看到三中全会后，政策制定方对拉动内需的表述更强，也可以预期到下半年一系列相应的政策会陆续落地。但也要认识到打破下降螺旋、修复消费者信心会是一个漫长的过程，不会在短期内反转；同时，在新的时代会有新的增长中枢，达到新平衡后终端消费的模式也将较以前有较大的变化。

此外，外部形势的变化也是近年来讨论较多的话题。从中短期冲击程度较大的角度，国际金融环境、美联储本轮加息-降息的拐点，都是影响今年市场的重要因素；而从长期角度来说，世界各国贸易保护主义的兴起以及背后政治、意识形态的变化，将会是对未来我国企业影响更大的因素。我国一批最优秀的企业已经在过去10年加速了融入国际化的进程，未来如何更好的适应新的外部环境会是新的话题。

4.5.2 行业走势展望

我们在今年半年报中总结了医药行业这个关系到国计民生的行业未来的发展方向，以及依托在这些发展方向上的投资逻辑——其核心是：1) 极致的供给过剩催生的研发竞赛，让我国的创新药械企业迅速卷到了一个新高度，历史上第一次可以去触摸国际医药研发的前沿，也可以打开更广阔的外部市场；2) 国内市场仍存在零星的低国产化率、低渗透率的双低赛道，可以成就少数开创局面的明星企业；3) 医药制造业是永远在竞争中的，但医药服务业未来能诞生一批具有品牌和稳定壁垒的公司，他们也正在从过去的快速扩张发展模式中转型。

在本期中报中，我们将同样对消费板块在未来新形势下的发展方向和投资逻辑做一个总结：

1) 从消费升级走向高性价比消费，是必然趋势：

过去10年，消费行业在我国经济大发展的背景下受益于消费升级的大趋势，走出了一定程度上穿越经济周期的发展态势。在新时代里，我国经济从高速发展转向高质量发展，无论是当下几年的转型阵痛期还是未来更长时间的稳定发展期，消费升级的发展路径将让位于追求高性价比的发展路径，且这个过程的持续时间不会短于过去消费升级的时间。基于过去发展模式的消费企业在未来对利润率、价格带、营销方式、渠道方式等方面都需要进行根本性的调整。能胜出并在新时代生存得“不错”的企业无论是在制造业、零售业或终端服务业，都必然是在转型上先人一步，甚至是“发明”了适应新时代的商业模式的企业。从投资角度，我们会比企业的转型有更多、更灵活的选择，当前最好的选择应该是那些在消费降级上走得更快更彻底、生产运营成本控制得好的企业，或者在变化的人口年龄结构、城乡结构和快速变化的消费倾向中找到新方向的消费企业。

2) 消费品出海也是一个寻找新增量的重要方向：

消费品或服务的出海，需要借助国家文化影响力的大势，需要较高的性价比的产品和全球化管理的经验，这每一条对我国的消费企业都是巨大的挑战。从现阶段看，我们更看好有性价比、更偏制造业的实物消费品出海，如家电、汽车和上中游零部件制造业企业。消费品出海面临的另一个挑战是外部各国贸易保护主义的兴起，因此要求出海企业有更合理的在全球布置产值的能力，这对绝大多数我国出海企业来说都是全新的挑战，还需要较长的时间交学费。尽管困难重重，我们依然认为投资消费品出海是未来的一个重要方向，这个过程中对研究和投资都提出了更高的要求。

3) 消费板块在未来如何体现商业模式的优势：

过去我们一直认为消费板块的公司是比较容易建立长期壁垒的，这些壁垒来自于企业长期与消费者接触互动中，保持卓越的对消费需求的理解能力。但是在最近一年消费品价格带下移的过程中，我们看到很多过去认为刚需性强的消费品公司，其需求稳定性并不如想象中的强。这个理论与现实的矛盾，体现了新时代新经营环境的切换过程的确是一个试金石，过去宽松升级发展的大潮褪去后，才能看清谁在裸泳。参考国内过去的历史和海外成熟市场的经验，消费品公司的强壁垒是确实存在的，但这些壁垒也是需要建立在长期维度的，且需要不断经历经营大环境、经济周期的考验。我们投资消费品公司也是需要从更长时间维度去考察企业的经营，从更深层的战略能力和管理能力角度去判断企业的真实壁垒是否存在，这是我们投资消费品公司的核心因素。

整体来说，我们认为对于医药和消费两个板块都需要在新时代背景下重新进行审视，尽管这两个板块都已经下跌了3年，如果简单以历史估值分位数为参考，他们的确都处于底部；但如果从这两个下游行业面临的新发展环境来看，短期内的供给过剩、价格收缩和长期的增长中枢下移，都需要我们重新审视它们在新时代的合理估值区间。我们相信，在估值与增长达到新平衡后，这两个板块仍然会是长期牛股辈出的行业，医药行业有创新的驱动、有更加深入融入国际化的动力，消费行业有能够形成高壁垒、需求相对稳定、股东回报较好的优秀公司。我们当下的工作也是用更积极的态度，去寻找这两个板块的长期胜者。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

本基金截至2024年06月30日，期末可供分配利润为15,660,425.26元，其中：未分配利润已实现部分为147,959,538.94元，未分配利润未实现部分为-132,299,113.68元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金管理人无应说明的预警信息。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

本托管人复核审查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。

§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：泓德泓业灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2024年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日

资产：			
货币资金	6.4.7.1	5,381,163.79	7,515,921.65
结算备付金		89,988.06	124,577.39
存出保证金		56,587.32	107,221.27
交易性金融资产	6.4.7.2	96,640,825.51	377,381,367.01
其中：股票投资		86,573,235.35	346,493,932.58
基金投资		-	-
债券投资		10,067,590.16	30,887,434.43
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		4,434.84	18,525.89
应收股利		-	-
应收申购款		557.44	1,415.89
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		102,173,556.96	385,149,029.10
负债和净资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		4.40	428,792.32
应付赎回款		38,091.21	12,110.00
应付管理人报酬		72,461.03	260,978.42
应付托管费		13,586.45	48,933.45

应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	158,265.51	465,359.65
负债合计		282,408.60	1,216,173.84
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	86,230,723.10	257,760,504.45
未分配利润	6.4.7.8	15,660,425.26	126,172,350.81
净资产合计		101,891,148.36	383,932,855.26
负债和净资产总计		102,173,556.96	385,149,029.10

注：报告截止日2024年06月30日，基金份额净值1.1816元，基金份额总额86,230,723.10份。

6.2 利润表

会计主体：泓德泓业灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至202 3年06月30日
一、营业总收入		-59,004,038.91	-32,130,143.09
1.利息收入		23,840.02	39,866.51
其中：存款利息收入	6.4.7.9	23,840.02	39,866.51
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”		-56,226,600.66	-5,089,670.22

填列)			
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-57,210,685.56	-9,334,923.59
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-81,203.21	201,984.65
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	1,065,288.11	4,043,268.72
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	-2,851,058.61	-27,212,067.85
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	49,780.34	131,728.47
减：二、营业总支出		1,049,883.48	1,233,328.41
1.管理人报酬		799,196.43	950,613.65
2.托管费		149,849.27	178,240.07
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		-	-
8.其他费用	6.4.7.16	100,837.78	104,474.69
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		-60,053,922.39	-33,363,471.50
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”		-60,053,922.39	-33,363,471.50

号填列)			
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-60,053,922.39	-33,363,471.50

6.3 净资产变动表

会计主体：泓德泓业灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	257,760,504.45	126,172,350.81	383,932,855.26
二、本期期初净资产	257,760,504.45	126,172,350.81	383,932,855.26
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-171,529,781.35	-110,511,925.55	-282,041,706.90
（一）、综合收益总额	-	-60,053,922.39	-60,053,922.39
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-171,529,781.35	-50,458,003.16	-221,987,784.51
其中：1.基金申购款	515,960.53	182,768.02	698,728.55
2.基金赎回款	-172,045,741.88	-50,640,771.18	-222,686,513.06
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少	-	-	-

以“-”号填列)			
四、本期期末净资产	86,230,723.10	15,660,425.26	101,891,148.36
项目	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	71,734,511.20	84,623,213.12	156,357,724.32
二、本期期初净资产	71,734,511.20	84,623,213.12	156,357,724.32
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	244,867,180.27	93,093,293.35	337,960,473.62
（一）、综合收益总额	-	-33,363,471.50	-33,363,471.50
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	244,867,180.27	252,369,494.87	497,236,675.14
其中：1.基金申购款	270,098,502.44	278,792,394.12	548,890,896.56
2.基金赎回款	-25,231,322.17	-26,422,899.25	-51,654,221.42
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-125,912,730.02	-125,912,730.02
四、本期期末净资产	316,601,691.47	177,716,506.47	494,318,197.94

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

泓德泓业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[2015]1158号《关于准予泓德泓业灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》准予注册,由泓德基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《泓德泓业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811,007,625.49元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第1051号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泓德泓业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2015年8月27日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为811,010,666.55份,其中认购资金利息折合3,041.06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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泓德泓业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资目标为通过科学的、谨慎的大类资产配置策略和重点投资于具有较高安全边际证券的组合策略,力争实现绝对收益的目标。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市交易的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会准予投资的股票)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、可转换债券等)、银行存款(包括通知存款、定期存款、协议存款等)、权证、货币市场工具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:股票投资比例为基金资产的0%-95%;保持现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:一年期银行定期存款利率(税后)+3%。

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》、《泓德泓业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2024年1月1日至2024年6月30日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2024年6月30日的财务状况以及2024年1月1日至2024年6月30日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

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

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价

计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

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

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
活期存款	5,381,163.79
等于：本金	5,380,531.77
加：应计利息	632.02
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	5,381,163.79

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	114,746,146.43	-	86,573,235.35	-28,172,911.08
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	9,991,340.00	60,590.16	10,067,590.16
	合计	9,991,340.00	60,590.16	10,067,590.16
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	124,737,486.43	60,590.16	96,640,825.51	-28,157,251.08

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	7.19
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	68,750.72
其中：交易所市场	68,575.72
银行间市场	175.00
应付利息	-
预提费用	89,507.60
合计	158,265.51

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	257,760,504.45	257,760,504.45
本期申购	515,960.53	515,960.53
本期赎回（以“-”号填列）	-172,045,741.88	-172,045,741.88
本期末	86,230,723.10	86,230,723.10

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
上年度末	538,887,062.58	-412,714,711.77	126,172,350.81
本期期初	538,887,062.58	-412,714,711.77	126,172,350.81

本期利润	-57,202,863.78	-2,851,058.61	-60,053,922.39
本期基金份额交易产生的变动数	-333,724,659.86	283,266,656.70	-50,458,003.16
其中：基金申购款	953,666.44	-770,898.42	182,768.02
基金赎回款	-334,678,326.30	284,037,555.12	-50,640,771.18
本期已分配利润	-	-	-
本期末	147,959,538.94	-132,299,113.68	15,660,425.26

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
活期存款利息收入	22,400.99
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	1,007.01
其他	432.02
合计	23,840.02

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
卖出股票成交总额	290,577,125.28
减：卖出股票成本总额	347,338,532.65
减：交易费用	449,278.19
买卖股票差价收入	-57,210,685.56

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2024年01月01日至2024年06月30日
债券投资收益——利息收入	224,991.79
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-306,195.00
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	-81,203.21

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	31,008,560.65
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	30,339,870.00
减：应计利息总额	974,360.65
减：交易费用	525.00
买卖债券差价收入	-306,195.00

6.4.7.12 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
股票投资产生的股利收益	1,065,288.11
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-

合计	1,065,288.11
----	--------------

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
1.交易性金融资产	-2,851,058.61
——股票投资	-3,104,588.61
——债券投资	253,530.00
——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	-2,851,058.61

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
基金赎回费收入	48,574.25
基金转换费收入	1,206.09
合计	49,780.34

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。

6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
审计费用	29,835.26
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
汇划手续费	2,030.18
账户维护费	9,000.00
其他	300.00
合计	100,837.78

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

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

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

本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
泓德基金管理有限公司（以下简称“泓德基金”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）	基金托管人
泓德基业(西藏)企业管理有限公司	基金管理人股东
李娇	基金管理人的自然人股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至20 24年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至20 23年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	799,196.43	950,613.65
其中：应支付销售机构的客户维护费	8,695.90	17,380.59
应支付基金管理人的净管理费	790,500.53	933,233.06

注：支付基金管理人泓德基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.80%的年费率每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.80%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024 年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	149,849.27	178,240.07

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值0.15%的年费率每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

6.4.10.3 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

份额单位：份

项目	本期 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至 2023年06月30日
报告期初持有的基金份额	30,446,131.40	15,504,642.55
报告期间申购/买入总份额	0.00	14,941,488.85
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	19,000,000.00	0.00
报告期末持有的基金份额	11,446,131.40	30,446,131.40
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	13.27%	9.62%

注：1.上年度可比期间申购/买入总份额为基金转换（入）份额。
2.期间赎回/卖出总份额含基金转换（出）份额。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024年06月30日		上年度末 2023年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
自然人股东	125,174.82	0.15%	1,201,801.50	0.47%
泓德基业（西藏）企业管理有限公司	0.00	0.00%	4,631,513.13	1.80%

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日

	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	5,381,163.79	22,400.99	55,366,152.62	35,248.74

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2024年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
301589	诺瓦星云	2024-02-01	6个月以上	限售股	126.89	188.01	817	57,608.06	153,604.17	备注2（1）
301536	星宸科技	2024-03-20	6个月以上	限售股	16.16	32.27	431	6,964.96	13,908.37	-
301538	骏鼎达	2024-03-13	6个月以上	限售股	55.82	91.24	150	5,972.74	13,686.00	备注2（2）
688709	成都华微	2024-01-31	6个月以上	限售股	15.69	18.79	676	10,606.44	12,702.04	-

301566	达利凯普	2023-12-22	6个月以上	限售股	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-
301591	肯特股份	2024-02-20	6个月以上	限售股	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-
688691	灿芯股份	2024-04-02	6个月以上	限售股	19.86	42.51	178	3,535.08	7,566.78	-
601033	永兴股份	2024-01-11	6个月以上	限售股	16.20	15.96	472	7,646.40	7,533.12	-
688584	上海合晶	2024-02-01	6个月以上	限售股	22.66	15.89	473	10,718.18	7,515.97	-
301539	宏鑫科技	2024-04-03	6个月以上	限售股	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-
001389	广合科技	2024-03-26	6个月以上	限售股	17.43	34.56	200	3,486.00	6,912.00	-
301587	中瑞股份	2024-03-27	6个月以上	限售股	21.73	25.26	272	5,910.56	6,870.72	-
688695	中创股份	2024-03-06	6个月以上	限售股	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
688530	欧莱新材	2024-04-29	6个月以上	限售股	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
301588	美新科技	2024-03-06	6个月以上	限售股	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-

603341	龙旗科技	2024-02-23	6个月以上	限售股	26.00	37.49	142	3,692.00	5,323.58	-
301502	华阳智能	2024-01-26	6个月以上	限售股	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-
001359	平安电工	2024-03-19	6个月以上	限售股	17.39	20.60	164	2,851.96	3,378.40	-
603344	星德胜	2024-03-13	6个月以上	限售股	19.18	22.66	148	2,838.64	3,353.68	-
603312	西典新能	2024-01-04	6个月以上	限售股	29.02	25.36	130	3,772.60	3,296.80	-
603082	北自科技	2024-01-23	6个月以上	限售股	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-
001379	腾达科技	2024-01-11	6个月以上	限售股	16.98	13.48	213	3,616.74	2,871.24	-
603375	盛景微	2024-01-17	6个月以上	限售股	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	-
001387	雪祺电气	2024-01-04	6个月以上	限售股	15.38	15.25	173	2,045.54	2,638.25	备注2 (3)

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

2、上述流通受限股票持有期间分红情况如下：

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

(2) 该股票于2024年5月22日实施权益分派方案：每10股派发现金股利7.00元（含税），

同时，以资本公积向全体股东每10股转增4股。

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，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%(上年度末：0%)。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流

通股票的30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年06月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	5,381,163.79	-	-	-	5,381,163.79
结算备付金	89,988.06	-	-	-	89,988.06
存出保证金	56,587.32	-	-	-	56,587.32
交易性金融资产	10,067,590.16	-	-	86,573,235.35	96,640,825.51
应收清算款	-	-	-	4,434.84	4,434.84
应收申购款	-	-	-	557.44	557.44
资产总计	15,595,329.33	-	-	86,578,227.63	102,173,556.96
负债					
应付清算款	-	-	-	4.40	4.40
应付赎回款	-	-	-	38,091.21	38,091.21
应付管理人报酬	-	-	-	72,461.03	72,461.03
应付托管费	-	-	-	13,586.45	13,586.45
其他负债	-	-	-	158,265.51	158,265.51
负债总计	-	-	-	282,408.60	282,408.60
利率敏感度缺口	15,595,329.33	-	-	86,295,819.03	101,891,148.36
上年度末 2023年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	7,515,921.65	-	-	-	7,515,921.65
结算备付金	124,577.39	-	-	-	124,577.39
存出保证金	107,221.27	-	-	-	107,221.27
交易性金融资产	30,887,434.43	-	-	346,493,932.58	377,381,367.01
应收清算款	-	-	-	18,525.89	18,525.89
应收申购款	-	-	-	1,415.89	1,415.89
资产总计	38,635,154.74	-	-	346,513,874.36	385,149,029.10
负债					
应付清算款	-	-	-	428,792.32	428,792.32

应付赎回款	-	-	-	12,110.00	12,110.00
应付管理人报酬	-	-	-	260,978.42	260,978.42
应付托管费	-	-	-	48,933.45	48,933.45
其他负债	-	-	-	465,359.65	465,359.65
负债总计	-	-	-	1,216,173.84	1,216,173.84
利率敏感度缺口	38,635,154.74	-	-	345,297,700.52	383,932,855.26

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9.88%(上年度末：8.05%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(上年度末：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	86,573,235.35	84.97	346,493,932.58	90.25
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	86,573,235.35	84.97	346,493,932.58	90.25

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定沪深300指数变化5%，其他变量不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币元)	
		本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
	沪深300指数上升5%	6,316,606.94	14,477,792.01
	沪深300指数下降5%	-6,316,606.94	-14,477,792.01

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	86,269,001.15	346,255,197.47
第二层次	10,067,590.16	30,887,434.43
第三层次	304,234.20	238,735.11
合计	96,640,825.51	377,381,367.01

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2024年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2023年12月31日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	86,573,235.35	84.73
	其中：股票	86,573,235.35	84.73
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	10,067,590.16	9.85
	其中：债券	10,067,590.16	9.85
	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	5,471,151.85	5.35
8	其他各项资产	61,579.60	0.06
9	合计	102,173,556.96	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	65,982,950.15	64.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	10,062,217.00	9.88
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,435.08	0.01
J	金融业	-	-

K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	5,851,700.00	5.74
N	水利、环境和公共设施管理业	7,533.12	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,655,400.00	4.57
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	86,573,235.35	84.97

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	600519	贵州茅台	4,300	6,309,777.00	6.19
2	300896	爱美客	28,480	4,901,408.00	4.81
3	603345	安井食品	60,000	4,458,600.00	4.38
4	605499	东鹏饮料	20,000	4,315,000.00	4.23
5	000568	泸州老窖	24,000	3,443,760.00	3.38
6	688235	百济神州	28,800	3,336,192.00	3.27
7	000963	华东医药	118,500	3,295,485.00	3.23
8	688389	普门科技	195,000	3,170,700.00	3.11
9	002867	周大生	240,000	3,134,400.00	3.08
10	600566	济川药业	97,000	3,075,870.00	3.02
11	002044	美年健康	800,000	3,024,000.00	2.97
12	300558	贝达药业	86,000	2,799,300.00	2.75
13	600276	恒瑞医药	70,000	2,692,200.00	2.64
14	002223	鱼跃医疗	70,000	2,632,000.00	2.58
15	605338	巴比食品	180,000	2,385,000.00	2.34

16	300833	浩洋股份	51,000	2,366,400.00	2.32
17	300049	福瑞股份	45,400	2,285,436.00	2.24
18	300298	三诺生物	90,000	2,280,600.00	2.24
19	688046	药康生物	220,000	2,248,400.00	2.21
20	600529	山东药玻	86,000	2,179,240.00	2.14
21	300759	康龙化成	117,000	2,173,860.00	2.13
22	000596	古井贡酒	10,200	2,152,914.00	2.11
23	002821	凯莱英	30,000	1,974,000.00	1.94
24	688116	天奈科技	80,000	1,846,400.00	1.81
25	603939	益丰药房	75,040	1,842,232.00	1.81
26	603883	老百姓	97,500	1,790,100.00	1.76
27	603882	金域医学	60,000	1,631,400.00	1.60
28	000513	丽珠集团	39,000	1,451,190.00	1.42
29	688073	毕得医药	48,000	1,429,440.00	1.40
30	002810	山东赫达	120,000	1,413,600.00	1.39
31	600809	山西汾酒	5,700	1,202,016.00	1.18
32	300122	智飞生物	36,000	1,009,080.00	0.99
33	301367	怡和嘉业	16,000	995,200.00	0.98
34	688212	澳华内镜	24,000	960,240.00	0.94
35	301589	诺瓦星云	817	153,604.17	0.15
36	688530	欧莱新材	3,437	69,099.55	0.07
37	301536	星宸科技	431	13,908.37	0.01
38	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.01
39	688709	成都华微	676	12,702.04	0.01
40	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.01
41	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.01
42	688691	灿芯股份	178	7,566.78	0.01
43	601033	永兴股份	472	7,533.12	0.01
44	688584	上海合晶	473	7,515.97	0.01
45	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.01
46	001389	广合科技	200	6,912.00	0.01

47	301587	中瑞股份	272	6,870.72	0.01
48	688695	中创股份	186	5,868.30	0.01
49	301588	美新科技	257	5,461.25	0.01
50	603341	龙旗科技	142	5,323.58	0.01
51	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.01
52	001359	平安电工	164	3,378.40	0.00
53	603344	星德胜	148	3,353.68	0.00
54	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
55	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
56	001379	腾达科技	213	2,871.24	0.00
57	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00
58	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600887	伊利股份	7,327,593.00	1.91
2	002867	周大生	6,657,494.00	1.73
3	300833	浩洋股份	6,165,047.00	1.61
4	002044	美年健康	5,776,377.00	1.50
5	688506	百利天恒	5,453,972.74	1.42
6	688046	药康生物	4,212,374.28	1.10
7	688331	荣昌生物	4,200,373.65	1.09
8	603939	益丰药房	3,818,817.00	0.99
9	002810	山东赫达	3,803,915.00	0.99
10	002223	鱼跃医疗	3,555,016.00	0.93
11	300677	英科医疗	3,500,557.40	0.91
12	600566	济川药业	3,377,883.00	0.88

13	301080	百普赛斯	2,547,098.50	0.66
14	300759	康龙化成	2,493,592.00	0.65
15	688073	毕得医药	2,421,648.31	0.63
16	600529	山东药玻	2,355,583.00	0.61
17	603883	老百姓	2,351,456.00	0.61
18	300015	爱尔眼科	2,267,618.00	0.59
19	000568	泸州老窖	2,157,777.00	0.56
20	688116	天奈科技	1,999,329.50	0.52

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	300896	爱美客	15,613,227.40	4.07
2	605499	东鹏饮料	15,185,471.00	3.96
3	603259	药明康德	15,094,181.56	3.93
4	600519	贵州茅台	13,356,148.60	3.48
5	688366	昊海生科	11,084,285.73	2.89
6	301080	百普赛斯	10,207,900.00	2.66
7	688029	南微医学	10,071,259.94	2.62
8	688212	澳华内镜	9,856,922.08	2.57
9	300049	福瑞股份	9,508,228.00	2.48
10	603345	安井食品	9,293,519.52	2.42
11	688046	药康生物	8,629,113.03	2.25
12	600763	通策医疗	7,780,997.10	2.03
13	600887	伊利股份	7,639,804.00	1.99
14	002044	美年健康	7,522,115.00	1.96
15	300298	三诺生物	7,262,433.00	1.89
16	688235	百济神州	7,158,916.53	1.86
17	688506	百利天恒	6,794,129.13	1.77

18	600276	恒瑞医药	6,566,669.00	1.71
19	600566	济川药业	6,328,171.00	1.65
20	603882	金城医学	6,133,897.00	1.60

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	90,522,424.03
卖出股票收入（成交）总额	290,577,125.28

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	10,067,590.16	9.88
	其中：政策性金融债	10,067,590.16	9.88
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	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,067,590.16	9.88

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	240401	24农发01	100,000	10,067,590.16	9.88

注：本基金本报告期末仅持有一只债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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	56,587.32
2	应收清算款	4,434.84
3	应收股利	-
4	应收利息	-

5	应收申购款	557.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	61,579.60

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
913	94,447.67	79,237,233.02	91.89%	6,993,490.08	8.11%

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	757,786.50	0.88%

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、基金投资和研部	10~50

门负责人持有本开放式基金	
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(2015年08月27日)基金份额总额	811,010,666.55
本报告期期初基金份额总额	257,760,504.45
本报告期基金总申购份额	515,960.53
减：本报告期基金总赎回份额	172,045,741.88
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	86,230,723.10

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 基金管理人的重大人事变动

本报告期基金管理人无重大人事变动。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东吴证券	2	178,852,186.85	47.07%	131,618.84	47.07%	-
国联证券	2	109,352,430.86	28.78%	80,472.41	28.78%	-
长江证券	1	84,294,103.37	22.18%	62,033.14	22.18%	-
国信证券	1	7,468,992.30	1.97%	5,496.35	1.97%	-
国泰君安证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	-

兴业 证券	2	-	-	-	-	-
中信 建投 证券	2	-	-	-	-	-

注：1、基金专用交易单元的选择标准如下：

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

2、基金专用交易单元的选择程序如下：

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

3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

- (1) 本基金报告期内新增租用交易单元：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
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
----	------	--------	--------

1	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海大智慧基金销售有限公司为销售机构的公告	公司官网、证券日报、中国证监会基金电子披露网站	2024-01-11
2	泓德基金管理有限公司关于泓德泓业灵活配置混合型证券投资基金恢复大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	公司官网、证券日报、中国证监会基金电子披露网站	2024-01-24
3	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加招商证券股份有限公司为销售机构的公告	公司官网、证券日报、中国证监会基金电子披露网站	2024-05-29

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2024/03/26-2024/06/30	24,637,331.23	0.00	0.00	24,637,331.23	28.57%
	2	2024/03/26-2024/06/30	24,675,710.63	0.00	0.00	24,675,710.63	28.62%
	3	2024/01/01-2024/02/07,2024/03/26-2024/04/22	98,057,534.85	0.00	98,057,534.85	0.00	0.00%
	4	2024/02/07-2024/03/25	48,276,045.19	0.00	48,276,045.19	0.00	0.00%
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泓业灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《泓德泓业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《泓德泓业灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《泓德泓业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规定报刊上披露的各项公告。

12.2 存放地点

地点为管理人地址：北京市西城区德胜门外大街125号

12.3 查阅方式

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

泓德基金管理有限公司
二〇二四年八月二十九日