

# 泓德裕康债券型证券投资基金

## 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:中国工商银行股份有限公司

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。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2024年1月1日起至2024年6月30日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	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	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55
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	55
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	56
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	56
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	56
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	56
7.12 投资组合报告附注	56
§8 基金份额持有人信息	60
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	60

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 .....	61
§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 .....	67
§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	泓德裕康债券型证券投资基金	
基金简称	泓德裕康债券	
基金主代码	002738	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年07月15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	340,935,424.67份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	泓德裕康债券A	泓德裕康债券C
下属分级基金的交易代码	002738	002739
报告期末下属分级基金的份额总额	311,553,348.27份	29,382,076.40份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在保持基金资产流动性前提下，通过积极主动的资产管理和严格的风险控制，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金的主要投资策略包括：资产配置策略、固定收益投资策略、权益投资策略及国债期货投资策略，在严格控制风险的前提下，发掘和利用市场失衡提供的投资机会，实现组合资产的增值。其中，本基金将采用"自上而下"的分析方法，综合分析宏观经济周期与形势、货币政策、财政政策、利率走势、资金供求、流动性风险、信用风险等因素，分析比较各大类资产的收益风险特征，在基准配置比例的基础上，动态调整各大类资产的投资比例，控制投资组合的系统性风险。
业绩比较基准	中国债券综合全价指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为债券型基金，属证券投资基金中的较低

	风险品种，预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。
--	---------------------------------------

### 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		010-59850195	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5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5号
邮政编码		100088	100140
法定代表人		王德晓	廖林

### 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址	www.hongdefund.com
基金中期报告备置地点	北京市西城区德胜门外大街125号

### 2.5 其他相关资料

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

## §3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2024年01月01日-2024年06月30日)	
	泓德裕康债券A	泓德裕康债券C
本期已实现收益	-6,871,216.85	-469,203.32
本期利润	-5,543,051.23	-434,197.68
加权平均基金份额本期利润	-0.0140	-0.0137
本期加权平均净值利润率	-1.16%	-1.17%
本期基金份额净值增长率	-0.90%	-1.08%
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	19,074,130.88	863,776.81
期末可供分配基金份额利润	0.0612	0.0294
期末基金资产净值	373,760,227.00	34,256,461.38
期末基金份额净值	1.1997	1.1659
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	33.51%	29.93%

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

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

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

## 3.2 基金净值表现

## 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

泓德裕康债券A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差	①-③	②-④

				④		
过去一个月	-1.08%	0.31%	0.25%	0.05%	-1.33%	0.26%
过去三个月	-0.38%	0.25%	0.75%	0.07%	-1.13%	0.18%
过去六个月	-0.90%	0.30%	2.31%	0.09%	-3.21%	0.21%
过去一年	-2.16%	0.24%	1.96%	0.09%	-4.12%	0.15%
过去三年	-6.57%	0.24%	2.00%	0.11%	-8.57%	0.13%
自基金合同生效起至今	33.51%	0.25%	9.16%	0.12%	24.35%	0.13%

## 泓德裕康债券C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-1.11%	0.31%	0.25%	0.05%	-1.36%	0.26%
过去三个月	-0.47%	0.25%	0.75%	0.07%	-1.22%	0.18%
过去六个月	-1.08%	0.30%	2.31%	0.09%	-3.39%	0.21%
过去一年	-2.51%	0.24%	1.96%	0.09%	-4.47%	0.15%
过去三年	-7.55%	0.24%	2.00%	0.11%	-9.55%	0.13%
自基金合同生效起至今	29.93%	0.25%	9.16%	0.12%	20.77%	0.13%

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：中国债券综合全价指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10%

(1)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。中国债券综合全价指数各项指标值的时间序列更加完整，有利于更加深入地研究和分析市场。在综合考虑了指数的权威性和代表性、指数的编制方法和本基金的投资范围和投资理念，本基金选择市场认同度较高的中国债券综合全价指数收益率作为债券投资部分的业绩比较基准。

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



本基金选择沪深300指数收益率作为股票投资部分的业绩比较基准。

(3)由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中,需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求,基准指数每日按照90%、10%的比例采取再平衡,再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

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

泓德裕康债券A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2016年07月15日-2024年06月30日)



泓德裕康债券C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2016年07月15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		
刘星洋	本基金的基金经理	2021-12-31	-	3年	硕士研究生，具有基金从业资格，资管行业从业经验12年，曾任信银理财有限责任公司投资经理，中信银行股份有限公司资产管理业务中心投资经理，中信银行股份有限公司金融市场部投资经理、分析师。

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

分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

一季度，利好地产的政策依然无法扭转一手商品房销售弱势的局面，二手房交易量在3月有所回暖，但价格并未回暖。部分经济的高频指标也并未走强，春节后，电厂日耗低点略低于近两年，中型焦化企业、PTA、钢厂高炉开工率小幅回落，整车货运流量指数回升弱于季节性，水泥价格震荡，螺纹钢累库放缓，价格未出现季节性回升。但国内PMI指数与世界主要经济体的PMI共振与3月底站上50%，出口数据较好，春节出行人次创了新记录，规模以上工业利润同比增长10%，一些迹象显示一季度的经济有所恢复。

但国内的需求持续偏弱制约了经济复苏。从4月发表的数据来看，一季度的GDP同比增长5.3%，略超预期，但价格指数依然低迷，表明居民的获得感不强，需求偏弱。另一方面，30中大城市商品房销售数据和6月的经济、消费、金融等众多数据显示国内需求依然偏弱，国内的基建链条从年初到现在也处于历史同期较差的水平。尽管国内的房产政策持续的放松，5、6月二手房的交易量环比改善明显，但整个地产产业链的状态依然没有发生实质性的转变，居民的资产负债表依然处于收缩状态。第二季度的出口依然表现强劲，需求的结构上外需好于内需。

债券市场方面，回顾2024年一季度的行情，债券走强在预期之中，而利率降幅则在预期之外。1、2月的债券收益率受到降准、降息的影响下行较快。受到市场交易行为、出口数据较好的影响，3月的债券收益率下行动能明显减弱。30年国债收益率由季初的2.84%下行至2.46%，10年国债收益率由2.56%下行至2.29%。在30年国债的强势表现下，30Y-10Y的期限利差由30bps压降至18bps左右，利率债的期限结构曲线进一步趋平。二季度，虽经济基本面支持利率进一步下行，但长周期的利率债受到央行对长端利率表态的影响而短时间内大幅上行，但考虑到央行力保资金面“量足价稳”，政府债供给也明显缩量，大部分机构持续欠配，债券市场虽有短期的明显回调、调整，但很快重回利率下行的趋势。信用利差处于低位也说明国内的信用扩张是很低迷的，也一定程度反应出一种不再以信贷为驱动的经济转型。

股票方面，A股在2024年一季度走出了V型曲线。股票市场的主要跌幅发生在1月下旬和2月初，1月的沪深300指数下跌6.29%，中证500指数下跌13.49%，恒生科技指数下跌20.15%。虽然上证指数和沪深300指数跌幅并不算大，但A股个股的1月平均跌幅高达21.31%。其主要原因可能是经济未明显好转，居民需求持续偏弱，市场长时间缺乏信心导致了多重悲观因素已被过度定价，盘面上已经出现恐慌性下跌。在国家加大救市力度的影响下，股市的流动性危机得以解除，2月沪深300指数上涨9.35%，中证500指数上涨13.83%，恒生科技指数上涨14.16%。主要指数在连续六个月下跌后，出现强势反弹。进入3月，虽然境外市场受到美国经济数据强劲、通胀略超预期、美元降息节点可能晚于预期的影响有所下跌，但A股以及港股更多展现出抗跌性，市场步入分化震荡和基本面观察期。二季度，在经济复苏受阻，居民资产负债表受到冲击的大环境下，再次压制了股票市场做多的情绪，整个二季度的股票市场的表现欠佳，流动性持续处于低位使得部分小市值股票表现承压，中小盘风格表现弱于大盘风格。红利风格虽然表现相对较好，但红利指数也从4月中旬的高点回落7%。

投资运作上，裕康保持了中性灵活的杠杆水平，债券整体久期位于行业平均数，个券选择上注重安全性和流动性，配置中长久期的利率债、二级资本债和高等级信用债，遵循分散化的策略，在行业、主体和个券上都尽量分散；股票方面在行业上均衡配置，个股选择上秉持长期价值投资的理念，精选个股。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末泓德裕康债券A基金份额净值为1.1997元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-0.90%，同期业绩比较基准收益率为2.31%；截至报告期末泓德裕康债券C基金份额净值为1.1659元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-1.08%，同期业绩比较基准收益率为2.31%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前，经济内生增长的动力弱，债券市场虽面临短期波动率上升带来的调整，但并无较大的风险。中短期来看，实体经济和居民需求需要央行进一步降息来提振，在未出现积极的总量财政政策前，可重点关注房价和商品房销售数据决定债券投资的久期。当前的信用利差处于历史极值分位数，说明信用风险补偿不足，投资价值低，但机构的欠配和市场风险偏好低使得信用利差中短期内依然会处于低位。相比之下，部分信用风险可控的高债券收益率的可转债具有较好的配置价值。股票方面，A股处于静态估值的底部，在多重悲观因素被定价的情况下，强有力的政策出台，居民资产负债表企稳，经济的价格信号重回温和扩张等因素可使得A股回升，尤其会带来内需相关行业困境反转的投资机会。参照日本的经验，优质的出海企业会带来投资机会，但也需警惕下半年美国总统大选带来的出口扰动。我们将继续做好大类资产配置，坚守长期价值投资理念，自下而上在长期更具确定性的赛道里寻找优质标的，摒除短期的扰动，均衡配置，为投资者创造价值。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

本基金截至2024年06月30日，期末可供分配利润为19,937,907.69元，其中：泓德裕康债券A期末可供分配利润为19,074,130.88元（泓德裕康债券A的未分配利润已实现部分为19,074,130.88元，未分配利润未实现部分为43,132,747.85元），泓德裕康债券C期末可供分配利润为863,776.81元（泓德裕康债券C的未分配利润已实现部分为863,776.81元，未分配利润未实现部分为4,010,608.17元）。

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

本报告期内，本基金管理人无应说明的预警信息。

### §5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，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遵规守信、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2024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：泓德裕康债券型证券投资基金

报告截止日：2024年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	299,189.90	245,779.08
结算备付金		3,421,784.31	1,247,525.03
存出保证金		54,369.04	42,749.55
交易性金融资产	6.4.7.2	481,895,761.56	683,289,570.65
其中：股票投资		46,876,215.94	102,749,458.65
基金投资		-	-
债券投资		435,019,545.62	580,540,112.00
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		28,602.97	999,869.98
应收股利		-	-
应收申购款		1,665.30	4,355.86
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		485,701,373.08	685,829,850.15
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年06月30日</b>	<b>上年度末 2023年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-

卖出回购金融资产款		76,904,278.05	39,321,757.11
应付清算款		119,559.73	-
应付赎回款		96,540.05	1,040,573.71
应付管理人报酬		206,648.89	330,842.43
应付托管费		44,773.91	71,682.49
应付销售服务费		9,934.30	12,217.95
应付投资顾问费		-	-
应交税费		9,138.49	29,530.21
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	293,811.28	518,879.28
负债合计		77,684,684.70	41,325,483.18
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	340,935,424.67	533,283,998.93
未分配利润	6.4.7.8	67,081,263.71	111,220,368.04
净资产合计		408,016,688.38	644,504,366.97
负债和净资产总计		485,701,373.08	685,829,850.15

注：报告截止日2024年06月30日，基金份额总额340,935,424.67份，其中A类基金份额总额为311,553,348.27份，基金份额净值为1.1997元；C类基金份额总额为29,382,076.40份，基金份额净值为1.1659元。

## 6.2 利润表

会计主体：泓德裕康债券型证券投资基金

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		-2,807,395.08	-12,657,687.05
1.利息收入		80,763.96	127,130.46
其中：存款利息收入	6.4.7.9	19,624.67	44,377.69



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		61,139.29	82,752.77
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-4,270,032.10	-19,870,483.68
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-13,732,719.95	-51,163,998.86
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	8,712,655.13	29,040,348.06
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	750,032.72	2,253,167.12
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	1,363,171.26	7,066,992.90
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	18,701.80	18,673.27
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>3,169,853.83</b>	<b>9,998,327.56</b>
1.管理人报酬		1,541,094.04	5,298,613.74
2.托管费		333,903.73	1,148,033.00
3.销售服务费		64,714.26	91,762.43
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		1,093,867.70	3,243,162.12
其中：卖出回购金融资产支出		1,093,867.70	3,243,162.12
6.信用减值损失		-	-

7.税金及附加		11,058.89	80,402.80
8.其他费用	6.4.7.16	125,215.21	136,353.47
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-5,977,248.91	-22,656,014.61
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-5,977,248.91	-22,656,014.61
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-5,977,248.91	-22,656,014.61

### 6.3 净资产变动表

会计主体：泓德裕康债券型证券投资基金

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	533,283,998.93	111,220,368.04	644,504,366.97
二、本期期初净资产	533,283,998.93	111,220,368.04	644,504,366.97
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-192,348,574.26	-44,139,104.33	-236,487,678.59
（一）、综合收益总额	-	-5,977,248.91	-5,977,248.91
（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）	-192,348,574.26	-38,161,855.42	-230,510,429.68

其中：1.基金申购款	477,885.82	94,575.59	572,461.41
2.基金赎回款	-192,826,460.08	-38,256,431.01	-231,082,891.09
(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	340,935,424.67	67,081,263.71	408,016,688.38
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	2,174,819,303.98	527,290,581.49	2,702,109,885.47
二、本期期初净资产	2,174,819,303.98	527,290,581.49	2,702,109,885.47
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,382,610,008.88	-349,339,230.17	-1,731,949,239.05
(一)、综合收益总额	-	-22,656,014.61	-22,656,014.61
(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）	-1,382,610,008.88	-326,683,215.56	-1,709,293,224.44
其中：1.基金申购款	49,907,288.95	12,243,656.69	62,150,945.64
2.基金赎回款	-1,432,517,297.83	-338,926,872.25	-1,771,444,170.08
(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	792,209,295.10	177,951,351.32	970,160,646.42

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

泓德裕康债券型证券投资基金（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[2016]796号《关于准予泓德裕康债券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《泓德裕康债券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207,107,248.47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（2016）第937号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泓德裕康债券型证券投资基金基金合同》于2016年07月15日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为207,127,733.67份，其中认购资金利息折合20,485.20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《泓德裕康债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。收取认(申)购费和赎回费，不收取销售服务费的，称为A类基金份额；收取销售服务费和赎回费，不收取认(申)购费的，称为C类基金份额。本基金A类基金份额、C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为：计算日某类基金份额净值=计算日该类基金份额的基金资产净值/计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资人可自行选择认/申购的基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泓德裕康债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、短期融资券、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转换债券）、可交换债券、资产支持证券、中小企业私募债、债券回购和银行存款、大额存单等固定收益类投

资工具，股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证等权益类品种，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：债券资产占基金资产的比例不低于80%，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于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：中国债券综合全价指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泓德裕康债券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	299,189.90
等于：本金	299,147.46
加：应计利息	42.44
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	299,189.90

#### 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	48,931,426.20	-	46,876,215.94	-2,055,210.26	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	142,911,569.41	904,918.07	143,227,834.50	-588,652.98
	银行间市场	284,117,493.71	5,059,711.12	291,791,711.12	2,614,506.29
	合计	427,029,063.12	5,964,629.19	435,019,545.62	2,025,853.31
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	

其他	-	-	-	-
合计	475,960,489.32	5,964,629.19	481,895,761.56	-29,356.95

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	0.19
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	199,335.71
其中：交易所市场	189,773.28
银行间市场	9,562.43
应付利息	-
预提费用	94,475.38
合计	293,811.28

#### 6.4.7.7 实收基金

##### 6.4.7.7.1 泓德裕康债券A

金额单位：人民币元



项目 (泓德裕康债券A)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	498,476,780.60	498,476,780.60
本期申购	426,365.50	426,365.50
本期赎回(以“-”号填列)	-187,349,797.83	-187,349,797.83
本期末	311,553,348.27	311,553,348.27

#### 6.4.7.7.2 泓德裕康债券C

金额单位：人民币元

项目 (泓德裕康债券C)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	34,807,218.33	34,807,218.33
本期申购	51,520.32	51,520.32
本期赎回(以“-”号填列)	-5,476,662.25	-5,476,662.25
本期末	29,382,076.40	29,382,076.40

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.8 未分配利润

##### 6.4.7.8.1 泓德裕康债券A

单位：人民币元

项目 (泓德裕康债券A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	35,982,630.90	69,020,825.49	105,003,456.39
本期期初	35,982,630.90	69,020,825.49	105,003,456.39
本期利润	-6,871,216.85	1,328,165.62	-5,543,051.23
本期基金份额交易产生的变动数	-10,037,283.17	-27,216,243.26	-37,253,526.43
其中：基金申购款	25,181.32	60,796.49	85,977.81
基金赎回款	-10,062,464.49	-27,277,039.75	-37,339,504.24
本期已分配利润	-	-	-

本期末	19,074,130.88	43,132,747.85	62,206,878.73
-----	---------------	---------------	---------------

#### 6.4.7.8.2 泓德裕康债券C

单位：人民币元

项目 (泓德裕康债券C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,465,813.81	4,751,097.84	6,216,911.65
本期期初	1,465,813.81	4,751,097.84	6,216,911.65
本期利润	-469,203.32	35,005.64	-434,197.68
本期基金份额交易产生的变动数	-132,833.68	-775,495.31	-908,328.99
其中：基金申购款	1,104.73	7,493.05	8,597.78
基金赎回款	-133,938.41	-782,988.36	-916,926.77
本期已分配利润	-	-	-
本期末	863,776.81	4,010,608.17	4,874,384.98

#### 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	7,608.99
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	11,649.82
其他	365.86
合计	19,624.67

#### 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	303,767,999.61

减：卖出股票成本总额	316,897,623.37
减：交易费用	603,096.19
买卖股票差价收入	-13,732,719.95

#### 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	6,933,416.21
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,779,238.92
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	8,712,655.13

##### 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	648,755,918.41
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	639,808,735.58
减：应计利息总额	7,138,871.29
减：交易费用	29,072.62
买卖债券差价收入	1,779,238.92

#### 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	750,032.72
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	750,032.72

## 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	1,363,171.26
——股票投资	817,780.06
——债券投资	545,391.20
——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	1,363,171.26

## 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	18,668.33

基金转换费收入	33.47
合计	18,701.80

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	35,803.04
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
汇划手续费	11,139.83
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	125,215.21

#### 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 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	1,541,094.04	5,298,613.74
其中：应支付销售机构的客户维护费	370,741.12	578,301.88
应支付基金管理人的净管理费	1,170,352.92	4,720,311.86

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0.60%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×0.60%/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	333,903.73	1,148,033.00

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0.13%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×0.13%/当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泓德裕康债券A	泓德裕康债券C	合计
泓德基金	0.00	111.18	111.18
中国工商银行	0.00	442.72	442.72
合计	0.00	553.90	553.90
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泓德裕康债券A	泓德裕康债券C	合计
泓德基金	0.00	118.90	118.90
中国工商银行	0.00	523.17	523.17
合计	0.00	642.07	642.07

注：支付基金销售机构的C类基金份额销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值0.35%的年费率每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付给泓德基金，再由泓德基金计算并支付给各基金销售机构。A类基金份额不收取销售服务费。其计算公式为：  
日销售服务费=前一日C类基金份额基金资产净值×0.35%/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**

泓德裕康债券A

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	-	5,034,609.78
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	5,034,609.78
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

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

泓德裕康债券C

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	2,118.84	0.00%	2,118.84	0.00%

注：本报告期末，自然人股东持有本基金份额占总份额的比例为0.0006%（上年度末：0.0004%）。

**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



中国工商银行	299,189.90	7,608.99	382,859.82	25,130.43
--------	------------	----------	------------	-----------

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（2024年06月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2024年6月30日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额73,224,278.05元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
2028024	20中信银行二级	2024-07-03	105.42	200,000	21,084,760.65
2028025	20浦发银行二级01	2024-07-03	105.50	100,000	10,549,685.25
2028033	20建设银行二级	2024-07-03	105.92	100,000	10,592,147.54
2028034	20浦发银行二	2024-07-03	106.01	200,000	21,201,600.00

	级03				
2128025	21建设银行二级01	2024-07-03	105.89	71,000	7,518,073.61
2128042	21兴业银行二级02	2024-07-03	105.66	100,000	10,566,285.25
合计				771,000	81,512,552.30

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2024年6月30日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额3,680,000.00元，于2024年7月1日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

#### 6.4.13.2 信用风险

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

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

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

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	20,368,628.42	20,203,062.84
合计	20,368,628.42	20,203,062.84

注：于2024年6月30日，未评级部分为政策性金融债（2023年12月31日，同）。债券信用评级取自第三方评级机构。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级的资产支持证券。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级的同业存单。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	222,463,484.82	354,359,285.03
AAA以下	88,606,965.40	220,964.58
未评级	103,580,466.98	205,756,799.55

合计	414,650,917.20	560,337,049.16
----	----------------	----------------

注：于2024年6月30日，未评级部分为政策性金融债和中期票据(2023年12月31日，同)。债券信用评级取自第三方评级机构。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级的资产支持证券。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级的同业存单。

### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

于本报告期期末，除附注6.4.12.3中列示的卖出回购金融资产款余额将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本基金持有的利率敏感性资产如下表所示：

## 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年 06月30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	299,189.90	-	-	-	299,189.90
结算备付金	3,421,784.31	-	-	-	3,421,784.31
存出保证金	54,369.04	-	-	-	54,369.04
交易性金融资产	95,231,113.23	261,491,359.33	78,297,073.06	46,876,215.94	481,895,761.56
应收清算款	-	-	-	28,602.97	28,602.97
应收申购款	-	-	-	1,665.30	1,665.30
资产总计	99,006,456.48	261,491,359.33	78,297,073.06	46,906,484.21	485,701,373.08
负债					
卖出回购金融资产款	76,904,278.05	-	-	-	76,904,278.05
应付清算款	-	-	-	119,559.73	119,559.73
应付赎回款	-	-	-	96,540.05	96,540.05
应付管理人报酬	-	-	-	206,648.89	206,648.89
应付托管费	-	-	-	44,773.91	44,773.91
应付销售	-	-	-	9,934.30	9,934.30

售服务费					
应交税费	-	-	-	9,138.49	9,138.49
其他负债	-	-	-	293,811.28	293,811.28
负债总计	76,904,278.05	-	-	780,406.65	77,684,684.70
利率敏感度缺口	22,102,178.43	261,491,359.33	78,297,073.06	46,126,077.56	408,016,688.38
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	245,779.08	-	-	-	245,779.08
结算备付金	1,247,525.03	-	-	-	1,247,525.03
存出保证金	42,749.55	-	-	-	42,749.55
交易性金融资产	223,743,168.67	293,866,241.71	62,930,701.62	102,749,458.65	683,289,570.65
应收清算款	-	-	-	999,869.98	999,869.98
应收申购款	-	-	-	4,355.86	4,355.86
资产总计	225,279,222.33	293,866,241.71	62,930,701.62	103,753,684.49	685,829,850.15
负债					
卖出回购金融资产款	39,321,757.11	-	-	-	39,321,757.11

应付赎回款	-	-	-	1,040,573.71	1,040,573.71
应付管理人报酬	-	-	-	330,842.43	330,842.43
应付托管费	-	-	-	71,682.49	71,682.49
应付销售服务费	-	-	-	12,217.95	12,217.95
应交税费	-	-	-	29,530.21	29,530.21
其他负债	-	-	-	518,879.28	518,879.28
负债总计	39,321,757.11	-	-	2,003,726.07	41,325,483.18
利率敏感度缺口	185,957,465.22	293,866,241.71	62,930,701.62	101,749,958.42	644,504,366.97

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
	市场利率下降25个基点	3,033,514.58	2,849,429.13
	市场利率上升25个基点	-2,986,532.31	-2,813,139.03

#### 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	46,876,215.94	11.49	102,749,458.65	15.94
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	46,876,215.94	11.49	102,749,458.65	15.94

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于本报告期期末，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为11.49%（上年度末：15.94%），因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年度末：同）。

### 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	159,322,707.97	108,931,073.69
第二层次	322,573,053.59	574,358,496.96
第三层次	-	-
合计	481,895,761.56	683,289,570.65

##### 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	46,876,215.94	9.65
	其中：股票	46,876,215.94	9.65
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	435,019,545.62	89.57
	其中：债券	435,019,545.62	89.57
	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	3,720,974.21	0.77
8	其他各项资产	84,637.31	0.02
9	合计	485,701,373.08	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	100,406.00	0.02

B	采矿业	2,606,098.00	0.64
C	制造业	31,958,783.74	7.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,873,314.00	0.46
E	建筑业	946,854.00	0.23
F	批发和零售业	2,622,799.20	0.64
G	交通运输、仓储和邮政业	1,043,618.00	0.26
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,910,374.00	0.47
J	金融业	718,435.20	0.18
K	房地产业	604,115.00	0.15
L	租赁和商务服务业	423,216.00	0.10
M	科学研究和技术服务业	422,130.00	0.10
N	水利、环境和公共设施管理业	379,788.00	0.09
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	267,084.00	0.07
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	999,200.80	0.24
S	综合	-	-
	合计	46,876,215.94	11.49

### 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	000543	皖能电力	32,600	288,510.00	0.07
2	002139	拓邦股份	25,200	267,624.00	0.07
3	688127	蓝特光学	14,200	261,138.00	0.06
4	002233	塔牌集团	35,500	259,505.00	0.06
5	300406	九强生物	15,900	244,542.00	0.06
6	601019	山东出版	20,600	243,492.00	0.06

7	600064	南京高科	40,100	243,407.00	0.06
8	000650	仁和药业	40,600	239,540.00	0.06
9	601298	青岛港	25,000	239,000.00	0.06
10	002215	诺普信	32,000	238,400.00	0.06
11	000034	神州数码	10,400	238,056.00	0.06
12	603993	洛阳钼业	27,800	236,300.00	0.06
13	002913	奥士康	8,800	235,928.00	0.06
14	603298	杭叉集团	12,000	235,680.00	0.06
15	603328	依顿电子	29,900	235,014.00	0.06
16	603368	柳药集团	13,300	232,750.00	0.06
17	300760	迈瑞医疗	800	232,728.00	0.06
18	000915	华特达因	7,700	232,232.00	0.06
19	600795	国电电力	38,700	231,813.00	0.06
20	002727	一心堂	15,300	230,877.00	0.06
21	600557	康缘药业	14,600	229,220.00	0.06
22	300226	上海钢联	13,500	228,690.00	0.06
23	600458	时代新材	22,600	228,260.00	0.06
24	688159	有方科技	6,000	227,160.00	0.06
25	688586	江航装备	24,400	226,920.00	0.06
26	603380	易德龙	11,300	226,904.00	0.06
27	600489	中金黄金	15,300	226,440.00	0.06
28	002540	亚太科技	42,700	225,883.00	0.06
29	601890	亚星锚链	31,800	224,190.00	0.05
30	000338	潍柴动力	13,800	224,112.00	0.05
31	000550	江铃汽车	10,300	223,613.00	0.05
32	300130	新国都	13,400	222,976.00	0.05
33	688510	航亚科技	12,100	222,761.00	0.05
34	601058	赛轮轮胎	15,800	221,200.00	0.05
35	601668	中国建筑	41,600	220,896.00	0.05
36	300445	康斯特	13,700	220,570.00	0.05
37	002475	立讯精密	5,600	220,136.00	0.05

38	600023	浙能电力	30,800	218,988.00	0.05
39	600362	江西铜业	9,200	217,856.00	0.05
40	002300	太阳电缆	41,200	217,536.00	0.05
41	688678	福立旺	20,070	217,358.10	0.05
42	300566	激智科技	15,500	216,845.00	0.05
43	300783	三只松鼠	9,900	216,513.00	0.05
44	688389	普门科技	13,300	216,258.00	0.05
45	601728	中国电信	35,100	215,865.00	0.05
46	600989	宝丰能源	12,400	214,892.00	0.05
47	603187	海容冷链	18,400	214,544.00	0.05
48	000708	中信特钢	15,800	214,406.00	0.05
49	000895	双汇发展	9,000	213,930.00	0.05
50	000823	超声电子	25,100	213,601.00	0.05
51	601001	晋控煤业	12,900	213,108.00	0.05
52	688036	传音控股	2,782	212,934.28	0.05
53	000921	海信家电	6,600	212,784.00	0.05
54	688571	杭华股份	40,200	212,658.00	0.05
55	000596	古井贡酒	1,000	211,070.00	0.05
56	603156	养元饮品	9,900	210,573.00	0.05
57	688210	统联精密	9,500	210,425.00	0.05
58	601717	郑煤机	14,200	210,160.00	0.05
59	603558	健盛集团	21,100	209,945.00	0.05
60	001965	招商公路	17,700	209,922.00	0.05
61	600039	四川路桥	26,600	209,874.00	0.05
62	002128	电投能源	9,900	208,890.00	0.05
63	600967	内蒙一机	29,000	208,800.00	0.05
64	002664	信质集团	17,500	208,250.00	0.05
65	301015	百洋医药	8,800	207,064.00	0.05
66	000027	深圳能源	28,300	206,590.00	0.05
67	002422	科伦药业	6,800	206,244.00	0.05
68	601006	大秦铁路	28,800	206,208.00	0.05

69	688253	英诺特	5,400	205,794.00	0.05
70	600018	上港集团	35,600	205,768.00	0.05
71	603948	建业股份	12,600	205,128.00	0.05
71	600426	华鲁恒升	7,700	205,128.00	0.05
73	600648	外高桥	23,100	204,666.00	0.05
74	000933	神火股份	10,100	204,323.00	0.05
75	600941	中国移动	1,900	204,250.00	0.05
76	601952	苏垦农发	22,600	203,852.00	0.05
77	003000	劲仔食品	16,900	203,645.00	0.05
78	300797	钢研纳克	21,900	202,794.00	0.05
79	002757	南兴股份	16,800	202,440.00	0.05
80	002998	优彩资源	35,700	202,419.00	0.05
81	300122	智飞生物	7,200	201,816.00	0.05
82	002106	莱宝高科	18,500	201,650.00	0.05
83	300115	长盈精密	16,800	201,432.00	0.05
84	605066	天正电气	36,100	201,077.00	0.05
85	300441	鲍斯股份	33,900	201,027.00	0.05
86	002064	华峰化学	28,000	200,760.00	0.05
87	601633	长城汽车	7,900	199,870.00	0.05
88	600582	天地科技	29,000	199,810.00	0.05
89	002001	新和成	10,400	199,680.00	0.05
90	301195	北路智控	6,700	199,258.00	0.05
91	603031	安孚科技	8,800	198,704.00	0.05
92	002601	龙佰集团	10,700	198,699.00	0.05
93	603369	今世缘	4,300	198,660.00	0.05
93	600398	海澜之家	21,500	198,660.00	0.05
93	600066	宇通客车	7,700	198,660.00	0.05
96	688307	中润光学	9,600	198,624.00	0.05
97	002788	鹭燕医药	25,200	198,576.00	0.05
98	601225	陕西煤业	7,700	198,429.00	0.05
99	688601	力芯微	4,539	198,308.91	0.05

100	002891	中宠股份	9,500	198,265.00	0.05
101	002937	兴瑞科技	8,500	198,135.00	0.05
102	300750	宁德时代	1,100	198,033.00	0.05
103	601319	中国人保	38,400	197,760.00	0.05
104	002973	侨银股份	22,100	197,574.00	0.05
105	002845	同兴达	14,900	196,978.00	0.05
106	300560	中富通	18,200	196,924.00	0.05
107	603989	艾华集团	14,000	196,840.00	0.05
108	002558	巨人网络	20,800	196,352.00	0.05
109	601877	正泰电器	10,300	196,318.00	0.05
110	688590	新致软件	15,200	196,080.00	0.05
110	601857	中国石油	19,000	196,080.00	0.05
112	600028	中国石化	31,000	195,920.00	0.05
113	600690	海尔智家	6,900	195,822.00	0.05
114	000786	北新建材	6,600	195,756.00	0.05
115	002736	国信证券	22,500	195,525.00	0.05
116	603676	卫信康	24,400	195,444.00	0.05
117	600741	华域汽车	11,900	194,922.00	0.05
118	002415	海康威视	6,300	194,733.00	0.05
119	002027	分众传媒	32,100	194,526.00	0.05
120	600346	恒力石化	13,900	193,905.00	0.05
121	601168	西部矿业	10,800	193,860.00	0.05
122	000333	美的集团	3,000	193,500.00	0.05
123	002255	海陆重工	39,500	193,155.00	0.05
124	603897	长城科技	11,000	193,050.00	0.05
125	002533	金杯电工	19,400	193,030.00	0.05
126	003036	泰坦股份	24,100	192,559.00	0.05
127	600642	申能股份	21,800	192,494.00	0.05
128	000999	华润三九	4,520	192,461.60	0.05
129	600829	人民同泰	34,300	192,423.00	0.05
130	600027	华电国际	27,700	192,238.00	0.05



131	300193	佳士科技	25,900	192,178.00	0.05
132	600998	九州通	39,290	191,735.20	0.05
133	601899	紫金矿业	10,900	191,513.00	0.05
134	600873	梅花生物	19,100	191,382.00	0.05
135	600887	伊利股份	7,400	191,216.00	0.05
136	003019	宸展光电	7,535	190,861.55	0.05
137	600019	宝钢股份	28,700	190,855.00	0.05
138	002449	国星光电	26,800	190,816.00	0.05
139	601600	中国铝业	25,000	190,750.00	0.05
140	600332	白云山	6,500	190,645.00	0.05
141	000883	湖北能源	31,700	190,517.00	0.05
142	000807	云铝股份	14,100	190,491.00	0.05
143	002919	名臣健康	16,400	190,404.00	0.05
144	601390	中国中铁	29,200	190,384.00	0.05
145	002469	三维化学	33,400	190,380.00	0.05
146	001207	联科科技	13,100	190,212.00	0.05
147	600551	时代出版	26,860	190,168.80	0.05
148	603758	秦安股份	25,000	190,000.00	0.05
149	600694	大商股份	11,300	189,953.00	0.05
150	002532	天山铝业	23,400	189,774.00	0.05
151	002078	太阳纸业	13,600	189,720.00	0.05
152	601898	中煤能源	15,200	189,696.00	0.05
153	605077	华康股份	12,430	189,557.50	0.05
154	000045	深纺织 A	23,600	189,272.00	0.05
155	002367	康力电梯	32,800	189,256.00	0.05
156	601865	福莱特	9,400	188,940.00	0.05
157	600737	中粮糖业	19,700	188,923.00	0.05
158	603408	建霖家居	14,300	188,617.00	0.05
159	002017	东信和平	22,600	188,258.00	0.05
160	002519	银河电子	38,200	187,562.00	0.05
161	603508	思维列控	10,000	187,500.00	0.05

162	300543	朗科智能	23,400	187,200.00	0.05
163	600866	星湖科技	33,900	187,128.00	0.05
164	002955	鸿合科技	8,000	187,040.00	0.05
165	600351	亚宝药业	33,300	186,813.00	0.05
166	600096	云天化	9,600	186,432.00	0.05
167	688685	迈信林	7,620	186,309.00	0.05
168	603819	神力股份	17,700	185,850.00	0.05
169	603611	诺力股份	10,900	185,736.00	0.05
170	300453	三鑫医疗	29,000	185,310.00	0.05
171	300213	佳讯飞鸿	32,500	185,250.00	0.05
172	688352	颀中科技	16,200	184,842.00	0.05
173	603629	利通电子	10,000	184,600.00	0.05
174	000589	贵州轮胎	36,400	184,548.00	0.05
175	002376	新北洋	34,200	184,338.00	0.05
176	000975	银泰黄金	11,300	184,077.00	0.05
177	601636	旗滨集团	28,500	183,825.00	0.05
178	002752	昇兴股份	36,300	183,678.00	0.05
179	000157	中联重科	23,900	183,552.00	0.04
180	300179	四方达	27,700	183,097.00	0.04
181	601512	中新集团	24,000	182,880.00	0.04
182	600985	淮北矿业	10,900	182,466.00	0.04
183	603173	福斯达	8,400	182,364.00	0.04
184	603230	内蒙新华	15,800	182,332.00	0.04
185	688566	吉贝尔	8,100	182,250.00	0.04
186	603315	福鞍股份	19,100	182,214.00	0.04
187	300390	天华新能	10,600	182,108.00	0.04
188	603966	法兰泰克	26,500	182,055.00	0.04
189	300251	光线传媒	21,600	181,656.00	0.04
190	600566	济川药业	5,700	180,747.00	0.04
191	603878	武进不锈	27,600	180,504.00	0.04
192	603322	超讯通信	6,800	180,268.00	0.04

193	002705	新宝股份	12,800	180,096.00	0.04
194	002441	众业达	23,700	179,646.00	0.04
195	600757	长江传媒	22,100	178,126.00	0.04
196	000997	新大陆	12,800	178,048.00	0.04
197	600048	保利发展	20,300	177,828.00	0.04
198	000600	建投能源	28,100	177,030.00	0.04
199	002801	微光股份	9,300	176,328.00	0.04
200	688292	浩瀚深度	11,400	176,244.00	0.04
201	688002	睿创微纳	6,300	176,211.00	0.04
202	600184	光电股份	20,600	175,306.00	0.04
203	603233	大参林	12,200	174,460.00	0.04
204	688550	瑞联新材	7,500	173,925.00	0.04
205	300840	酷特智能	18,700	172,975.00	0.04
206	300724	捷佳伟创	3,200	172,832.00	0.04
207	688516	奥特维	4,100	171,421.00	0.04
208	601336	新华保险	5,600	168,168.00	0.04
209	605266	健之佳	6,400	166,080.00	0.04
210	002825	纳尔股份	26,600	165,718.00	0.04
211	600276	恒瑞医药	4,300	165,378.00	0.04
212	600104	上汽集团	11,700	162,162.00	0.04
213	600888	新疆众和	22,700	160,489.00	0.04
214	603060	国检集团	27,300	159,432.00	0.04
215	600201	生物股份	21,500	155,015.00	0.04
216	300231	银信科技	20,300	149,205.00	0.04
217	605098	行动教育	3,400	144,908.00	0.04
218	600987	航民股份	20,100	141,906.00	0.03
219	002615	哈尔斯	21,700	134,540.00	0.03
220	300694	蠡湖股份	15,300	130,203.00	0.03
221	600809	山西汾酒	600	126,528.00	0.03
222	000655	金岭矿业	22,300	123,319.00	0.03
223	600455	博通股份	8,300	122,176.00	0.03

224	688439	振华风光	1,764	117,217.80	0.03
225	002580	圣阳股份	18,900	116,235.00	0.03
226	002947	恒铭达	3,300	116,160.00	0.03
227	600820	隧道股份	16,300	106,439.00	0.03
228	601038	一拖股份	6,700	105,927.00	0.03
229	002648	卫星化学	5,800	104,284.00	0.03
230	600097	开创国际	12,200	100,406.00	0.02
231	600025	华能水电	9,300	100,254.00	0.02
232	002111	威海广泰	9,500	98,990.00	0.02
233	601816	京沪高铁	15,700	84,309.00	0.02
234	002478	常宝股份	16,700	83,166.00	0.02
235	000651	格力电器	2,100	82,362.00	0.02
236	600273	嘉化能源	11,400	81,396.00	0.02
237	300628	亿联网络	2,200	80,894.00	0.02
238	603815	交建股份	13,600	77,792.00	0.02
239	600803	新奥股份	3,600	74,880.00	0.02
240	300140	节能环境	12,300	73,431.00	0.02
241	601886	江河集团	14,900	72,712.00	0.02
242	601598	中国外运	12,300	69,249.00	0.02
243	601669	中国电建	12,300	68,757.00	0.02
244	600938	中国海油	2,000	66,000.00	0.02
245	600901	江苏金租	12,700	64,135.00	0.02
246	603909	建发合诚	7,200	59,904.00	0.01
247	002056	横店东磁	4,600	57,362.00	0.01
248	301355	南王科技	5,900	56,581.00	0.01
249	000012	南玻A	9,900	49,896.00	0.01
250	600999	招商证券	3,400	47,294.00	0.01
251	000567	海德股份	8,120	45,553.20	0.01
252	603915	国茂股份	4,300	44,247.00	0.01
253	000811	冰轮环境	4,100	39,565.00	0.01
254	300573	兴齐眼药	240	39,360.00	0.01

255	603013	亚普股份	2,900	39,063.00	0.01
256	002152	广电运通	3,600	37,656.00	0.01
257	000661	长春高新	400	36,708.00	0.01
258	601567	三星医疗	1,000	35,000.00	0.01
259	605158	华达新材	5,300	34,079.00	0.01
260	600229	城市传媒	3,400	23,426.00	0.01
261	002993	奥海科技	600	22,320.00	0.01
262	601872	招商轮船	2,200	18,590.00	0.00
263	300218	安利股份	1,200	18,096.00	0.00
264	300349	金卡智能	1,500	17,880.00	0.00
265	605050	福然德	1,200	10,572.00	0.00
266	002296	辉煌科技	1,000	10,310.00	0.00
267	600983	惠而浦	1,200	8,940.00	0.00
268	603926	铁流股份	600	4,980.00	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	000157	中联重科	1,950,834.00	0.30
2	000596	古井贡酒	1,945,697.00	0.30
3	603369	今世缘	1,929,264.00	0.30
4	600276	恒瑞医药	1,785,670.00	0.28
5	000338	潍柴动力	1,707,588.00	0.26
6	600406	国电南瑞	1,529,283.00	0.24
7	300896	爱美客	1,513,372.00	0.23
8	601799	星宇股份	1,510,547.00	0.23
9	300433	蓝思科技	1,509,457.00	0.23
10	300015	爱尔眼科	1,501,956.00	0.23

11	603589	口子窖	1,501,892.00	0.23
12	300014	亿纬锂能	1,501,586.00	0.23
13	002271	东方雨虹	1,501,292.00	0.23
14	002138	顺络电子	1,500,565.00	0.23
15	002299	圣农发展	1,500,004.00	0.23
16	002007	华兰生物	1,499,190.00	0.23
17	603899	晨光股份	1,498,723.98	0.23
18	002050	三花智控	1,496,693.00	0.23
19	002304	洋河股份	1,496,678.00	0.23
20	002373	千方科技	1,495,569.00	0.23

#### 7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值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	000338	潍柴动力	2,023,880.00	0.31
2	600406	国电南瑞	1,939,914.00	0.30
3	000157	中联重科	1,927,750.98	0.30
4	300433	蓝思科技	1,862,161.00	0.29
5	000596	古井贡酒	1,858,954.00	0.29
6	603369	今世缘	1,761,277.00	0.27
7	002594	比亚迪	1,684,566.00	0.26
8	002299	圣农发展	1,581,147.00	0.25
9	002371	北方华创	1,549,350.00	0.24
10	600276	恒瑞医药	1,540,452.00	0.24
11	603899	晨光股份	1,516,130.70	0.24
12	601799	星宇股份	1,454,399.00	0.23
13	002007	华兰生物	1,438,363.00	0.22
14	300014	亿纬锂能	1,435,191.00	0.22
15	002304	洋河股份	1,428,138.00	0.22

16	002373	千方科技	1,421,535.00	0.22
17	002262	恩华药业	1,395,412.00	0.22
18	688111	金山办公	1,394,071.43	0.22
19	002138	顺络电子	1,379,687.00	0.21
20	603589	口子窖	1,377,722.00	0.21

#### 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	260,206,600.60
卖出股票收入（成交）总额	303,767,999.61

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	270,852,906.33	66.38
	其中：政策性金融债	103,175,095.40	25.29
4	企业债券	20,539,095.89	5.03
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	31,181,051.37	7.64
7	可转债(可交换债)	112,446,492.03	27.56
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	435,019,545.62	106.62

#### 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	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产
---	------	------	-------	------	-------

号					净值比例(%)
1	240205	24国开05	500,000	51,968,756.83	12.74
2	2028024	20中信银行二级	300,000	31,627,140.98	7.75
3	2028013	20农业银行二级 01	300,000	30,417,147.95	7.45
4	2028034	20浦发银行二级 03	200,000	21,201,600.00	5.20
5	2128036	21平安银行二级	200,000	21,177,855.74	5.19

**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20中信银行二级（证券代码：2028024）、20农业银行二级01（证券代码：2028013）、21平安银行二级（证券代码：2128036）、23邮储永续债01（证券代码：242380019）、20建设银行二级（证券代码：2028033）、21建设银行二级01（证券代码：2128025）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12月29日，20中信银行二级（证券代码：2028024）发行人中信银行股份有限公司因部分重要信息系统应认定未认定、相关系统未建灾备或灾难恢复能力不符合监管要求、同城数据中心长期存在基础设施风险隐患未得到整改、对外包数据中心的准入前尽职调查和日常管理不符合监管要求、部分数据中心存在风险隐患等被国家金融监督管理总局罚款400万元。

2023年11月16日，20中信银行二级（证券代码：2028024）发行人中信银行股份有限公司因违反高管准入管理相关规定、关联贷款管理不合规、绩效考核不符合规定、重大关联交易信息披露不充分等被国家金融监督管理总局罚没合计22475.18万元。

2023年11月16日，20农业银行二级01（证券代码：2028013）发行人中国农业银行股份有限公司因流动资金贷款被用于固定资产投资、贷款受托支付问题整改不到位、贷款风险分类不准确、个别精准扶贫贷款被挪用等被国家金融监督管理总局处罚款合计5709738元。

2023年08月15日，20农业银行二级01（证券代码：2028013）发行人中国农业银行股份有限公司因农户贷款发放后流入房地产企业、农村个人生产经营贷款贷后管理不到位、农户小额贷款发放后转为定期存款、违规向房地产开发企业提供融资等被国家金融监督管理总局没收违法所得并处罚款合计4420.18万元。

2023年12月19日，21平安银行二级（证券代码：2128036）发行人平安银行股份有限公司因利用赠送基金份额形式开展基金销售业务被中国证券监督管理委员会深圳监管局出具警示函。

2024年05月14日，21平安银行二级（证券代码：2128036）发行人平安银行股份有限公司因个别高管人员未经任职资格核准实际履职、同一股东实质提名董事超比例、部分岗位绩效薪酬延期支付比例低于监管要求、未按监管规定审查审批重大关联交易等被国家金融监督管理总局没收违法所得并处罚款6073.98万元。

2023年12月12日，21平安银行二级（证券代码：2128036）发行人平安银行股份有限公司因考评机制不当、贷款业务操作不规范、小微企业划型不准确被国家金融监督管理总局深圳监管局罚款170万元。

2023年09月13日，21平安银行二级（证券代码：2128036）发行人平安银行股份有限公司因销售误导被国家金融监督管理总局常州监管分局处罚款8万元。

2023年07月07日，21平安银行二级（证券代码：2128036）发行人平安银行股份有限公司因违反账户管理规定、其他危及支付机构稳健运行、损害客户合法权益或危害支付服务市场的违法违规行为、违反反假货币业务管理规定、占压财政存款或资金等被中国人民银行警告、没收违法所得1848.67元、罚款3492.5万元。

2023年07月07日，23邮储永续债01（证券代码：242380019）发行人中国邮政储蓄银行股份有限公司因违反反假货币业务管理规定、占压财政存款或者资金、违反国库科目设置和使用规定等被中国人民银行警告、罚款3186万元。

2023年12月27日，20建设银行二级（证券代码：2028033）发行人中国建设银行股份有限公司因并表管理内部审计存在不足、母行对境外机构案件管理不到位、未及时报告境外子行高级管理人员任职情况、监管检查发现问题整改不力被国家金融监督管理总局罚款170万元。

2023年11月22日，20建设银行二级（证券代码：2028033）发行人中国建设银行股份有限公司因单个网点在同一会计年度内与超过3家保险公司开展保险业务合作、违规通过储蓄柜台销售投资连结型保险产品、代销利益不确定的保险产品未按规定提供完整合同材料等被国家金融监督管理总局处罚款合计2041.88万元。

2023年12月27日，21建设银行二级01（证券代码：2128025）发行人中国建设银行股份有限公司因并表管理内部审计存在不足、母行对境外机构案件管理不到位、未及时报告境外子行高级管理人员任职情况、监管检查发现问题整改不力被国家金融监督管理总局罚款170万元。

2023年11月22日，21建设银行二级01（证券代码：2128025）发行人中国建设银行股份有限公司因单个网点在同一会计年度内与超过3家保险公司开展保险业务合作、违规通过储蓄柜台销售投资连结型保险产品、代销利益不确定的保险产品未按规定提供完整合同材料等被国家金融监督管理总局处罚款合计2041.88万元。

在上述公告公布后，本基金管理人对上述公司进行了进一步了解和分析，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	54,369.04
2	应收清算款	28,602.97
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,665.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	84,637.31
---	----	-----------

#### 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	5,650,779.51	1.38
2	113669	景23转债	3,969,793.15	0.97
3	123221	力诺转债	3,866,638.90	0.95
4	123219	宇瞳转债	3,786,691.23	0.93
5	113069	博23转债	3,783,767.67	0.93
6	128066	亚泰转债	3,282,394.52	0.80
7	123203	明电转02	3,252,467.12	0.80
8	123135	泰林转债	3,215,664.38	0.79
9	123170	南电转债	3,200,050.00	0.78
10	123107	温氏转债	3,154,976.03	0.77
11	123191	智尚转债	3,034,797.26	0.74
12	113045	环旭转债	2,969,726.71	0.73
13	128132	交建转债	2,911,003.42	0.71
14	123035	利德转债	2,875,086.30	0.70
15	113042	上银转债	2,841,837.67	0.70
16	123120	隆华转债	2,783,160.96	0.68
17	110067	华安转债	2,772,873.29	0.68
18	128109	楚江转债	2,770,663.01	0.68
19	111010	立昂转债	2,766,773.97	0.68
20	113058	友发转债	2,750,345.89	0.67
21	128081	海亮转债	2,712,645.89	0.66
22	113056	重银转债	2,711,479.45	0.66
23	123209	聚隆转债	2,630,671.23	0.64
24	123222	博俊转债	2,617,995.07	0.64
25	113648	巨星转债	2,603,936.99	0.64

26	127095	广泰转债	2,595,044.38	0.64
27	123188	水羊转债	2,586,114.52	0.63
28	123226	中富转债	2,585,461.92	0.63
29	123205	大叶转债	2,578,059.73	0.63
30	113667	春23转债	2,516,923.29	0.62
31	123177	测绘转债	2,484,121.64	0.61
32	127069	小熊转债	2,421,695.34	0.59
33	110082	宏发转债	2,234,383.56	0.55
34	113052	兴业转债	2,164,353.42	0.53
35	127015	希望转债	2,123,154.52	0.52
36	127049	希望转2	2,070,051.51	0.51
37	123078	飞凯转债	2,057,259.88	0.50
38	123161	强联转债	1,966,964.38	0.48
39	113053	隆22转债	350,021.23	0.09
40	128108	蓝帆转债	182,188.27	0.04
41	113661	福22转债	139,325.46	0.03
42	123234	中能转债	50,049.63	0.01
43	118036	力合转债	15,751.86	0.00
44	113037	紫银转债	13,176.38	0.00
45	110064	建工转债	11,158.36	0.00
46	113542	好客转债	10,862.77	0.00
47	110086	精工转债	8,913.34	0.00

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能存在尾差。

### §8 基金份额持有人信息

#### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
泓德裕康债券A	5,189	60,041.12	172,983,022.05	55.52%	138,570,326.22	44.48%
泓德裕康债券C	4,574	6,423.72	0.00	0.00%	29,382,076.40	100.00%
合计	9,705	35,129.87	172,983,022.05	50.74%	167,952,402.62	49.26%

注：机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	泓德裕康债券A	51,364.38	0.02%
	泓德裕康债券C	8,727.06	0.03%
	合计	60,091.44	0.02%

注：从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区
----	------	--------------

		间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	泓德裕康债券A	0~10
	泓德裕康债券C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	泓德裕康债券A	0~10
	泓德裕康债券C	0
	合计	0~10

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

	泓德裕康债券A	泓德裕康债券C
基金合同生效日(2016年07月15日)基金份额总额	206,660,871.06	466,862.61
本报告期期初基金份额总额	498,476,780.60	34,807,218.33
本报告期基金总申购份额	426,365.50	51,520.32
减：本报告期基金总赎回份额	187,349,797.83	5,476,662.25
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	311,553,348.27	29,382,076.40

注：总申购份额含转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### (1) 基金管理人的重大人事变动

本报告期基金管理人无重大人事变动。

#### (2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

#### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

#### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

#### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

##### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

##### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内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	
东北证券	2	434,944,525.72	77.12%	320,069.56	77.12%	-
华泰证券	2	56,559,394.19	10.03%	41,621.10	10.03%	-
长城证券	2	23,829,572.90	4.23%	17,534.86	4.23%	-
渤海	1	33,242,339.27	5.89%	24,463.06	5.89%	-

证券						
开源 证券	2	15,398,768.13	2.73%	11,332.13	2.73%	-
长江 证券	1	-	-	-	-	-
海通 证券	1	-	-	-	-	-
西部 证券	1	-	-	-	-	-
第一 创业 证券	2	-	-	-	-	-
光大 证券	2	-	-	-	-	-
广发 证券	2	-	-	-	-	-
国金 证券	2	-	-	-	-	-
国盛 证券	2	-	-	-	-	-
国信 证券	2	-	-	-	-	-
华金 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	-	-	-	-	-



东方财富证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中国中金财富证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
甬兴证券	2	-	-	-	-	-
首创证券	2	-	-	-	-	-
国投证券	2	-	-	-	-	-
中信建投证券	4	-	-	-	-	-

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：甬兴证券。
- (2) 本基金报告期内停止租用交易单元：中泰证券、太平洋证券、华安证券、国投证券、首创证券。

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
东北证券	127,729,676.29	20.13%	615,400,000.00	51.34%	-	-	-	-
华泰证券	155,729,660.90	24.55%	327,900,000.00	27.36%	-	-	-	-
长城证券	172,368,450.10	27.17%	141,310,000.00	11.79%	-	-	-	-
渤海证券	102,880,149.33	16.22%	100,400,000.00	8.38%	-	-	-	-
开源证券	75,710,219.59	11.93%	13,600,000.00	1.13%	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中国中金财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
甬兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2024-01-11

## §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	2024/02/21-2024/05/14	94,661,875.79	0.00	29,944,703.76	64,717,172.03	18.98%
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裕康债券型证券投资基金设立的文件；
- 2、《泓德裕康债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《泓德裕康债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《泓德裕康债券型证券投资基金托管协议》；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；

7、报告期内基金管理人在规定报刊上披露的各项公告。

## 12.2 存放地点

地点为管理人地址：北京市西城区德胜门外大街125号

## 12.3 查阅方式

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

泓德基金管理有限公司  
二〇二四年八月二十九日