

# 泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金

## 2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 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 03 月 28 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。本年度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3月27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。

本年度报告财务资料经审计，普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自2023年1月1日起至2023年12月31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、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 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 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 审计报告	14
6.1 审计报告基本信息	14
6.2 审计报告的基本内容	15
§7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	19
7.3 净资产变动表	20
7.4 报表附注	22
§8 投资组合报告	54
8.1 期末基金资产组合情况	54
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	55
8.3 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	56
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	77
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	85
8.6 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	85
8.7 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	86
8.8 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	86
8.9 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	86

8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	86
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	86
8.12 投资组合报告附注 .....	86
§9 基金份额持有人信息 .....	87
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	87
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	87
9.3 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 .....	87
§10 开放式基金份额变动 .....	88
§11 重大事件揭示 .....	88
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	88
11.2 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 .....	88
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	88
11.4 基金投资策略的改变 .....	88
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	89
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	89
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	89
11.8 其他重大事件 .....	93
§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....	95
12.1 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 .....	95
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	96
§13 备查文件目录 .....	96
13.1 备查文件目录 .....	96
13.2 存放地点 .....	96
13.3 查阅方式 .....	96

## §2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

基金名称	泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	泓德泓信混合
基金主代码	002801
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年06月01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	304,635,503.75份
基金合同存续期	不定期

## 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，通过股票与债券等资产的合理配置，力争为投资者带来稳健的投资回报。
投资策略	本基金运用自上而下和自下而上相结合的方法进行大类资产配置，从宏观经济环境、国家政策导向、产业转型与变革等多个角度，积极挖掘新经济环境下的投资机遇，精选具有核心竞争优势和持续成长能力的优质上市公司。对于债券投资策略，本基金通过对宏观经济、货币政策、财政政策、资金流动性等影响市场利率的主要因素进行深入研究，结合新券发行情况，综合分析市场利率和信用利差的变动趋势，采取久期调整、收益率曲线配置和券种配置等积极投资策略，把握债券市场投资机会，以获取稳健的投资收益。同时，本基金将本着谨慎原则，从风险管理角度出发，适度参与股指期货、国债期货投资。
业绩比较基准	中证500指数收益率×90%+中国债券综合全价指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为混合型基金，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。
--	----------------

注：自2023年12月22日起，泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金的业绩比较基准由“沪深300指数收益率×50%+中证综合债券指数收益率×50%”，变更为“中证500指数收益率×90%+中国债券综合全价指数收益率×10%”。

## 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
	联系电话	010-59850177
	电子邮箱	lixiaochun@hongdefund.com
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	陈四清

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.hongdefund.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所	中国上海市浦东新区东育路588号前

	(特殊普通合伙)	滩中心42楼
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、基金净值表现及利润分配情况

#### 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	2023年	2022年	2021年
本期已实现收益	-33,427,569.50	-46,457,495.84	206,432,578.40
本期利润	-16,523,056.67	-73,570,759.28	32,909,177.82
加权平均基金份额本期利润	-0.1115	-0.5699	0.1755
本期加权平均净值利润率	-6.91%	-29.57%	7.74%
本期基金份额净值增长率	-7.12%	-22.55%	10.65%
3.1.2 期末数据和指标	2023年末	2022年末	2021年末
期末可供分配利润	110,397,736.40	79,138,764.31	198,885,780.09
期末可供分配基金份额利润	0.3624	0.8256	1.3572
期末基金资产净值	415,033,240.15	174,996,883.70	345,429,692.13
期末基金份额净值	1.3624	1.8256	2.3572
3.1.3 累计期末指标	2023年末	2022年末	2021年末
基金份额累计净值增长率	69.55%	82.56%	135.72%

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
过去三个月	-0.90%	0.82%	-3.04%	0.45%	2.14%	0.37%
过去六个月	-3.13%	0.79%	-4.60%	0.45%	1.47%	0.34%
过去一年	-7.12%	0.80%	-3.57%	0.43%	-3.55%	0.37%
过去三年	-20.41%	1.14%	-12.52%	0.56%	-7.89%	0.58%
过去五年	99.24%	1.18%	20.85%	0.60%	78.39%	0.58%
自基金合同生效起至今	69.55%	1.10%	24.35%	0.57%	45.20%	0.53%

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

根据《泓德基金管理有限公司关于修改泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金业绩比较基准的公告》，本基金自2023年12月22日起变更业绩比较基准。原业绩比较基准为：沪深300指数收益率×50%+中证综合债券指数收益率×50%。变更后的业绩比较基准为：中证500指数收益率×90%+中国债券综合全价指数收益率×10%。

基准指数的构建原则如下：

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

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

(3) 由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照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。

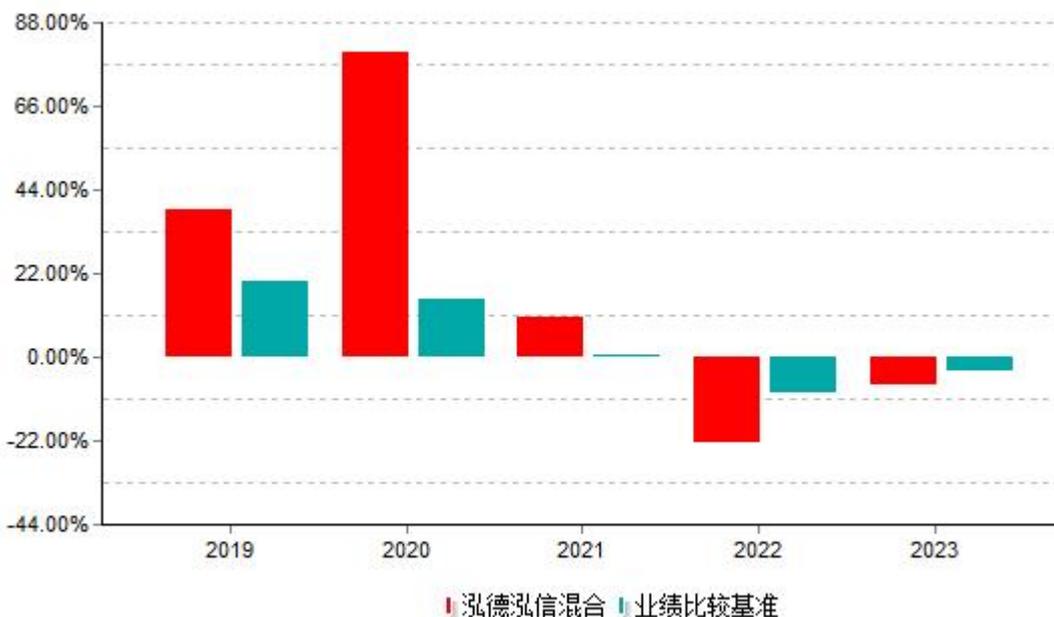
#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

泓德泓信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  
(2016年06月01日-2023年12月31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。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金	现金形式发	再投资形式	年度利润分	备注
----	--------	-------	-------	-------	----

	份额分红数	放总额	发放总额	配合计	
2023年	3.300	24,758,685.1 8	51,818,614.2 6	76,577,299.4 4	-
合计	3.300	24,758,685.1 8	51,818,614.2 6	76,577,299.4 4	-

注：1、本基金于2021年1月1日至2022年12月31日止会计期间未进行利润分配。

2、本基金于2023年1月1日至2023年12月31日止会计期间进行了一次利润分配，权益登记日和红利再投日为2023年10月31日，现金红利发放日为2023年11月2日。

## §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		
李子昂	本基金的基金经理	2023-10-26	-	10年	硕士研究生，具有基金从业资格，曾任本公司多资产投资部投资经理，北京隆慧投

					资有限公司投资管理部投资经理，华商基金管理有限公司量化投资部量化研究员，泰达宏利基金管理有限公司风险管理与基金评估部助理专员。
苏昌景	本基金的基金经理、量化投资部总监	2021-02-10	2023-10-26	15年	硕士研究生，具有基金从业资格，曾任本公司研究部研究员，国都证券股份有限公司研究所研究员、资产管理总部总经理助理、投资经理。

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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《泓德基金管理有限公司公平交易制度》。公司通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

##### 4.3.2 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。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，经济复苏相对较弱，地产销售、投资和新开工均大幅调整，我国经济面临转型压力，出口虽有所恢复，但对美欧等发达经济体回落显著，产业链重构趋势有所加强，新能源车出口成为较大亮点，此外，受居民可支配收入增速放缓和消费意愿下降等原因，消费增速出现回落。股票市场，A股整体表现乏善可陈，低波红利和AI主题是为数不多的亮点，小市值和微盘表现出较好超额收益，“哑铃型”配置结构获得较多青睐。二季度开始，我们使用机器学习的方法构建量化选股模型，挖掘更多量价特征和基本面因子中隐含的Alpha信息，并取得了较好效果。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末泓德泓信混合基金份额净值为1.3624元，本报告期内，基金份额净值增长率为-7.12%，同期业绩比较基准收益率为-3.57%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2024年初，A股市场再现较大波动，特别是中小市值风格出现较大回撤，也让市场认识到风格暴露带来的收益可能存在一定的不确定性，并重新审视风险敞口的设定。展望全年，影响A股市场的积极因素正在逐渐积累，经历了过去3年的下跌，A股的整体估值相对较低，而政策持续发力也使得宏观基本面向好改善，行业景气程度和企业盈利预期也有望得到改善。海外方面，美联储有望开启降息周期，外部压力也将得到缓解，市场风险偏好有望得到改善。随着风险的逐渐出清，我们依然看好量化投资的长期价值，也将不断迭代修改神经网络模型，力争实现更稳健的超额收益。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人继续完善内部控制体系和内部控制制度，健全管理制度和业务规章，依据国家相关法律法规、内部控制制度、内部管理制度和业务规章、基金合同以及基金招募说明书对本基金的投资、销售、运营等业务中的内部控制完善程度和执行情况进行持续的监察稽核，对监察稽核中发现的问题及时提示，督促改进并跟踪改进效果。

本报告期内，本基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

(1) 根据法律法规的要求，推动各业务单元更新、完善内部制度及业务流程。识别业务活动中的关键风险点，确定关键控制活动，持续完善内部控制措施。

(2) 对合同、协议等法律文件及实务运作中存在的法律风险进行识别及防范。

(3) 通过事前合规审核、持续优化合规监控系统、加强合规培训等方面，对业务活动中存在的合规风险进行识别及评估，完成各类合规管理工作。

(4) 按计划完成定期稽核工作，检查内容覆盖公司主要业务部门和业务环节，并对整改情况进行跟踪。

(5) 认真贯彻落实反洗钱各项法律法规，切实履行金融机构的反洗钱法定义务，将反洗钱工作贯穿于公司各项业务流程。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

#### 4.8 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，本基金的基金管理人于2023年10月27日发布《泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金分红公告》，收益分配基准日为2023年10月24日，每10份基金份额发放红利3.300元，分配的总金额为76,577,299.44元。

本基金截至2023年12月31日，期末可供分配利润为110,397,736.40元，其中：未分配利润已实现部分为122,816,213.06元，未分配利润未实现部分为-12,418,476.66元。

#### 4.9 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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对泓德基金管理有限公司编制和披露的本基金2023年年度报告中财务指标、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 审计报告

#### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2024)第23839号

## 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容 我们审计了泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"泓德泓信混合基金")的财务报表, 包括2023年12月31日的资产负债表, 2023年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。(二) 我们的意见 我们认为, 后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")、中国证券投资基金业协会(以下简称"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, 公允反映了泓德泓信混合基金2023年12月31日的财务状况以及2023年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的"注册会计师对财务报表审计的责任"部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信, 我们获取的审计证据是充分、适当的, 为发表审计意见提供了基础。按照中国注册会计师职业道德守则, 我们独立于泓德泓信混合基金, 并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>泓德泓信混合基金的基金管理人泓德基金管理有限公司(以下简称"基金管理人")管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表, 使其实现公允反映, 并设计、执行和维护必要的内部控制, 以使财务报表不存在由</p>

	<p>于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估泓德泓信混合基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算泓德泓信混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督泓德泓信混合基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：(一)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。(二)了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。(三)评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。(四)对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对泓德泓信混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提</p>

	请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致泓德泓信混合基金不能持续经营。(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	陈熹	俞伟敏
会计师事务所的地址	中国上海市浦东新区东育路588号前滩中心42楼	
审计报告日期	2024-03-25	

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2023年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	18,638,736.00	3,117,257.35
结算备付金		4,541,650.02	103,315.37
存出保证金		880,235.73	19,242.57
交易性金融资产	7.4.7.2	388,925,719.17	172,031,384.54
其中：股票投资		377,732,469.50	161,902,521.53
基金投资		-	-
债券投资		11,193,249.67	10,128,863.01
资产支持证券投资		-	-

贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		7,148,464.78	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,811.20	1,146.21
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		420,136,616.90	175,272,346.04
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年12月31日</b>	<b>上年度末 2022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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		4,152,371.87	-
应付赎回款		413.83	-
应付管理人报酬		272,925.72	135,151.22
应付托管费		51,173.60	25,340.86
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		3.47	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	626,488.26	114,970.26
负债合计		5,103,376.75	275,462.34
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	304,635,503.75	95,858,119.39
未分配利润	7.4.7.8	110,397,736.40	79,138,764.31

净资产合计		415,033,240.15	174,996,883.70
负债和净资产总计		420,136,616.90	175,272,346.04

注：报告截止日2023年12月31日，基金份额净值1.3624元，基金份额总额304,635,503.75份。

## 7.2 利润表

会计主体：泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年01月01日至2 023年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2 022年12月31日
一、营业总收入		-14,034,738.10	-70,970,867.43
1.利息收入		60,950.95	47,407.00
其中：存款利息收入	7.4.7.9	60,950.95	39,717.42
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	7,689.58
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-31,059,763.25	-44,034,746.26
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-33,867,105.52	-46,929,143.45
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	350,612.20	356,657.53
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.12	32,486.63	-
股利收益	7.4.7.13	2,424,243.44	2,537,739.66
其他投资收益		-	-

3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.14	16,904,512.83	-27,113,263.44
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	59,561.37	129,735.27
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>2,488,318.57</b>	<b>2,599,891.85</b>
1.管理人报酬		1,910,041.85	2,003,829.93
2.托管费		358,132.95	375,718.14
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		166.18	0.18
8.其他费用	7.4.7.16	219,977.59	220,343.60
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-16,523,056.67</b>	<b>-73,570,759.28</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-16,523,056.67</b>	<b>-73,570,759.28</b>
五、其他综合收益的税后净额		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-16,523,056.67</b>	<b>-73,570,759.28</b>

### 7.3 净资产变动表

会计主体：泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年12月31日

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年12月31日

	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	95,858,119.39	79,138,764.31	174,996,883.70
二、本期期初净资产	95,858,119.39	79,138,764.31	174,996,883.70
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	208,777,384.36	31,258,972.09	240,036,356.45
（一）、综合收益总额	-	-16,523,056.67	-16,523,056.67
（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）	208,777,384.36	124,359,328.20	333,136,712.56
其中：1.基金申购款	238,799,054.06	144,421,847.40	383,220,901.46
2.基金赎回款	-30,021,669.70	-20,062,519.20	-50,084,188.90
（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）	-	-76,577,299.44	-76,577,299.44
四、本期期末净资产	304,635,503.75	110,397,736.40	415,033,240.15
项目	上年度可比期间		
	2022年01月01日至2022年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	146,543,912.04	198,885,780.09	345,429,692.13
二、本期期初净资产	146,543,912.04	198,885,780.09	345,429,692.13
三、本期增减变动	-50,685,792.65	-119,747,015.78	-170,432,808.43

额（减少以“-”号填列）			
（一）、综合收益总额	-	-73,570,759.28	-73,570,759.28
（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）	-50,685,792.65	-46,176,256.50	-96,862,049.15
其中：1.基金申购款	18,049,711.74	16,929,719.11	34,979,430.85
2.基金赎回款	-68,735,504.39	-63,105,975.61	-131,841,480.00
（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	95,858,119.39	79,138,764.31	174,996,883.70

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

泓德泓信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[2016]967号《关于准予泓德泓信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《泓德泓信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，自基金合同生效之日起至18个月后对应日的前一个工作日（含该日）止的期间内采用封闭式运作方式，如不存在该对应日的，顺延至下一工作日，封闭期结束后转为开放式运作，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集

847,529,845.47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699号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2016年6月1日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为847,544,853.76份，其中认购资金利息折合15,008.29份基金份额。本基金的基金管理人为泓德基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括股票（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、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、短期融资券、超短期融资券、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、证券公司短期公司债券、中期票据、债券回购和银行存款、同业存单等固定收益类投资工具，股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。本基金的投资组合比例为：封闭期内股票资产占基金资产的比例范围为0%-100%；转为开放式运作后股票资产占基金资产的比例范围为0%-95%。本基金如果投资股指期货、国债期货，则在封闭期内，每个交易日日终扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应保持不低于交易保证金一倍的现金；转为开放式运作后，每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应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：中证500指数收益率×90%+中国债券综合全价指数收益率×10%。

本财务报表由本基金的基金管理人泓德基金管理有限公司于2024年3月25日批准报出。

#### 7.4.2 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》、《泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、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。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2023年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2023年12月31日的财务状况以及2023年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

#### (1) 金融资产

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

#### 债务工具

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

#### 以摊余成本计量：

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

#### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

#### 权益工具

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

## (2) 金融负债

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

## (3) 衍生金融工具

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

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产,以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

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

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

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

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

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

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

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

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

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率

(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

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

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

#### **7.4.4.10 费用的确认和计量**

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

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

#### **7.4.4.11 基金的收益分配政策**

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### **7.4.4.12 分部报告**

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 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。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
活期存款	18,638,736.00	3,117,257.35
等于：本金	18,636,590.55	3,116,769.15
加：应计利息	2,145.45	488.20
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	18,638,736.00	3,117,257.35

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日

		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		380,716,181.14	-	377,732,469.50	-2,983,711.64
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	765,400.00	438.20	933,178.63	167,340.43
	银行间市场	10,075,720.00	235,071.04	10,260,071.04	-50,720.00
	合计	10,841,120.00	235,509.24	11,193,249.67	116,620.43
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		391,557,301.14	235,509.24	388,925,719.17	-2,867,091.21
项目		上年度末 2022年12月31日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		181,782,005.57	-	161,902,521.53	-19,879,484.04
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	10,003,380.00	129,863.01	10,128,863.01	-4,380.00
	合计	10,003,380.00	129,863.01	10,128,863.01	-4,380.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		191,785,385.57	129,863.01	172,031,384.54	-19,883,864.04

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日		
	合同/名义金额	公允价值	备注

		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	6,636,420.00	-	-	-
--股指期货	6,636,420.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	6,636,420.00	-	-	-
项目	上年度末 2022年12月31日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

#### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2401	中证500股指期货2401合约	6.00	6,524,160.00	-112,260.00
合计				-112,260.00
减：可抵销 期货暂收款				-112,260.00
净额				-

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为0。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

**7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

**7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金本报告期末及上年度末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

**7.4.7.5 其他资产**

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

**7.4.7.6 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	446,488.26	54,970.26
其中：交易所市场	446,488.26	54,970.26
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	180,000.00	60,000.00
合计	626,488.26	114,970.26

**7.4.7.7 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	95,858,119.39	95,858,119.39
本期申购	238,799,054.06	238,799,054.06
本期赎回（以“-”号填列）	-30,021,669.70	-30,021,669.70
本期末	304,635,503.75	304,635,503.75

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

## 7.4.7.8 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	100,834,247.65	-21,695,483.34	79,138,764.31
本期期初	100,834,247.65	-21,695,483.34	79,138,764.31
本期利润	-33,427,569.50	16,904,512.83	-16,523,056.67
本期基金份额交易产生的变动数	131,986,834.35	-7,627,506.15	124,359,328.20
其中：基金申购款	153,655,767.12	-9,233,919.72	144,421,847.40
基金赎回款	-21,668,932.77	1,606,413.57	-20,062,519.20
本期已分配利润	-76,577,299.44	-	-76,577,299.44
本期末	122,816,213.06	-12,418,476.66	110,397,736.40

## 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
活期存款利息收入	36,692.36	36,794.80
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	23,507.54	2,578.02
其他	751.05	344.60
合计	60,950.95	39,717.42

## 7.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
卖出股票成交总额	1,895,124,532.63	320,264,275.01

减：卖出股票成本总额	1,926,203,149.79	366,401,363.74
减：交易费用	2,788,488.36	792,054.72
买卖股票差价收入	-33,867,105.52	-46,929,143.45

#### 7.4.7.11 债券投资收益

##### 7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
债券投资收益——利息收入	272,236.77	211,435.46
债券投资收益——买卖债券 (债转股及债券到期兑付) 差价收入	78,375.43	145,222.07
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	350,612.20	356,657.53

##### 7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月 31日
卖出债券(债转股 及债券到期兑付) 成交总额	10,523,406.19	11,090,470.12
减：卖出债券(债 转股及债券到期兑 付)成本总额	10,244,780.00	10,715,990.00
减：应计利息总额	200,062.81	229,082.19

减：交易费用	187.95	175.86
买卖债券差价收入	78,375.43	145,222.07

#### 7.4.7.12 衍生工具收益

##### 7.4.7.12.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间未进行权证投资。

##### 7.4.7.12.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
股指期货投资收益	32,486.63	-

#### 7.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023 年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022 年12月31日
股票投资产生的股利收益	2,424,243.44	2,537,739.66
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	2,424,243.44	2,537,739.66

#### 7.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年01月01日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12 月31日
1.交易性金融资产	17,016,772.83	-27,113,263.44
——股票投资	16,895,772.40	-27,086,873.44
——债券投资	121,000.43	-26,390.00

——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-112,260.00	-
——权证投资	-	-
——期货投资	-112,260.00	-
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	16,904,512.83	-27,113,263.44

#### 7.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
基金赎回费收入	44,623.01	129,032.09
基金转换费收入	14,938.36	703.18
合计	59,561.37	129,735.27

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。

#### 7.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00

证券出借违约金	-	-
汇划手续费	2,777.59	3,143.60
账户维护费	36,000.00	36,000.00
其他	1,200.00	1,200.00
合计	219,977.59	220,343.60

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 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。

##### 7.4.8.2 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。

#### 7.4.9 关联方关系

经公司股东会审议通过，泓德基金于2023年度发生股权变更。此次股权变更共涉及新增股东8名，分别为珠海市崇德企业管理咨询中心（有限合伙）、珠海市广业企业管理咨询中心（有限合伙）、温永鹏、李晓春、王克玉、秦毅、李娇、李操纲，泓德基业（西藏）企业管理有限公司合计转让其持有的泓德基金1,342.50万元股权给上述8名新增股东。此次股权变更不涉及公司注册资本金变动。以上股权变更已完成工商变更登记手续并向中国证监会派出机构备案。

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
王德晓	基金管理人的自然人股东
阳光资产管理股份有限公司	基金管理人股东
珠海市基业长青投资中心（有限合伙）	基金管理人股东
泓德基业（西藏）企业管理有限公司	基金管理人股东
南京民生租赁股份有限公司	基金管理人股东
江苏岛村实业发展有限公司	基金管理人股东
珠海市崇德企业管理咨询中心（有限合伙）(2023年12月28日后)	基金管理人股东

上海捷朔信息技术有限公司	基金管理人股东
珠海市广业企业管理咨询中心（有限合伙）(2023年12月28日后)	基金管理人股东
温永鹏(2023年12月28日后)	基金管理人的自然人股东
李晓春(2023年12月28日后)	基金管理人的自然人股东
王克玉(2023年12月28日后)	基金管理人的自然人股东
秦毅(2023年12月28日后)	基金管理人的自然人股东
李娇(2023年12月28日后)	基金管理人的自然人股东
李操纲(2023年12月28日后)	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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 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。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至20 23年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至20 22年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,910,041.85	2,003,829.93
其中：应支付销售机构的客户维护费	25,129.58	33,106.36
应支付基金管理人的净管理费	1,884,912.27	1,970,723.57

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。

###### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023	上年度可比期间 2022年01月01日至2022
----	------------------------	-----------------------------

	年12月31日	年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	358,132.95	375,718.14

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0.15%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。

#### 7.4.10.3 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。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 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 2023年01月01日至 2023年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至 2022年12月31日
报告期初持有的基金份额	11,609,107.83	8,556,780.69
报告期间申购/买入总份额	23,743,979.85	3,052,327.14
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	35,353,087.68	11,609,107.83
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	11.61%	12.11%

注：1.期间申购/买入总份额为红利再投及基金转换（入）份额。

2.基金管理人在本年度及上年度可比期间投资本基金适用的申购/转换费率按照本基金招募说明书的规定执行。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023年12月31日		上年度末 2022年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份	持有的基金份额	持有的基金份

		额占基金总份 额的比例		额占基金总份 额的比例
泓德基业 (西藏)企 业管理有 限公司	30,809,733.01	10.11%	9,000,503.13	9.39%
自然人股 东	3,359,385.72	1.10%	997.51	0.00%

注：上年度末，自然人股东持有本基金份额占总份额的比例为0.001%。

#### 7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名 称	本期 2023年01月01日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31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	18,638,736.00	36,692.36	3,117,257.35	36,794.80

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。

#### 7.4.10.6 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。

#### 7.4.10.7 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。

#### 7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日	每10份基 金 份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形 式发放总 额	本期利润 分配合计	备注
1	2023-10- 31	2023-10- 31	3.300	24,758,68 5.18	51,818,614. 26	76,577,29 9.44	-
合			3.300	24,758,68	51,818,614.	76,577,29	-

计				5.18	26	9.44	
---	--	--	--	------	----	------	--

## 7.4.12 期末（2023年12月31日）本基金持有的流通受限证券

## 7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
301526	国际复材	2023-12-19	6个月以上	限售股	2.66	4.45	6,479	17,234.14	28,831.55	-
601096	宏盛华源	2023-12-15	6个月以上	限售股	1.70	4.06	3,266	5,552.20	13,259.96	-
301566	达利凯普	2023-12-22	6个月以上	限售股	8.90	22.14	576	5,126.40	12,752.64	-
301508	中机认检	2023-11-23	6个月以上	限售股	16.82	26.68	419	7,047.58	11,178.92	-
301413	安培龙	2023-12-11	6个月以上	限售股	33.25	58.19	164	5,453.00	9,543.16	-
301516	中远通	2023-12-01	6个月以上	限售股	6.87	15.51	604	4,149.48	9,368.04	-
301568	思泰克	2023-11-21	6个月以上	限售股	23.23	35.58	246	5,714.58	8,752.68	-
301459	丰茂股份	2023-12-06	6个月以上	限售股	31.90	39.84	208	6,635.20	8,286.72	-

301489	思泉新材	2023-10-16	6个月以上	限售股	41.66	64.11	128	5,332.48	8,206.08	-
301517	陕西华达	2023-10-09	6个月以上	限售股	26.87	43.69	185	4,970.95	8,082.65	-
301578	辰奕智能	2023-12-21	6个月以上	限售股	48.94	68.32	118	5,774.92	8,061.76	-
301559	中集环科	2023-09-26	6个月以上	限售股	24.22	18.24	414	10,027.08	7,551.36	-
301555	惠柏新材	2023-10-24	6个月以上	限售股	22.88	32.44	224	5,125.12	7,266.56	-
001378	德冠新材	2023-10-23	6个月以上	限售股	31.68	31.27	205	6,494.40	6,410.35	-
601083	锦江航运	2023-11-28	6个月以上	限售股	11.25	11.07	579	6,513.75	6,409.53	-
603004	鼎龙科技	2023-12-20	6个月以上	限售股	16.80	31.19	195	3,276.00	6,082.05	-
301500	飞南资源	2023-09-13	6个月以上	限售股	23.97	20.89	283	6,783.51	5,911.87	-
603107	上海汽配	2023-10-25	6个月以上	限售股	14.23	18.19	292	4,155.16	5,311.48	-
001306	夏厦精密	2023-11-09	6个月以上	限售股	53.63	75.36	64	3,432.32	4,823.04	-

0013 26	联域 股份	2023- 11-01	6个 月以 上	限售 股	41.18	48.64	99	4,07 6.82	4,81 5.36	-
3015 48	崇德 科技	2023- 09-11	6个 月以 上	限售 股	66.80	58.99	80	5,34 4.00	4,71 9.20	-
6032 96	华勤 技术	2023- 08-01	6个 月以 上	限售 股	80.80	77.75	60	4,84 8.00	4,66 5.00	-
0013 58	兴欣 新材	2023- 12-14	6个 月以 上	限售 股	41.00	44.16	87	3,56 7.00	3,84 1.92	-
0012 39	永达 股份	2023- 12-04	6个 月以 上	限售 股	12.05	19.92	189	2,27 7.45	3,76 4.88	-
6030 62	麦加 芯彩	2023- 10-31	6个 月以 上	限售 股	58.08	57.81	63	3,65 9.04	3,64 2.03	-
6032 31	索宝 蛋白	2023- 12-06	6个 月以 上	限售 股	21.29	21.53	161	3,42 7.69	3,46 6.33	-
6032 73	天元 智能	2023- 10-16	6个 月以 上	限售 股	9.50	18.97	178	1,69 1.00	3,37 6.66	-
6033 73	安邦 护卫	2023- 12-13	6个 月以 上	限售 股	19.10	34.75	88	1,68 0.80	3,05 8.00	-
6030 75	热威 股份	2023- 09-01	6个 月以 上	限售 股	23.10	23.31	126	2,91 0.60	2,93 7.06	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的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。

#### 7.4.12.2 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。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 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。

##### 7.4.12.3.2 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。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 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。

##### 7.4.13.2 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0.22%(上年度末：0%)。

### 7.4.13.3 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。

#### 7.4.13.3.1 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7.4.12。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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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：

## 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	18,638,736.00	-	-	-	18,638,736.00
结算备付金	4,541,650.02	-	-	-	4,541,650.02
存出保证金	97,336.53	-	-	782,899.20	880,235.73
交易性金融资产	10,260,071.04	-	933,178.63	377,732,469.50	388,925,719.17
应收清算款	-	-	-	7,148,464.78	7,148,464.78
应收申购款	-	-	-	1,811.20	1,811.20
资产总计	33,537,793.59	-	933,178.63	385,665,644.68	420,136,616.90
负债					
应付清算款	-	-	-	4,152,371.87	4,152,371.87
应付赎回款	-	-	-	413.83	413.83
应付管理人报酬	-	-	-	272,925.72	272,925.72
应付托管费	-	-	-	51,173.60	51,173.60
应交税费	-	-	-	3.47	3.47
其他负债	-	-	-	626,488.26	626,488.26
负债总计	-	-	-	5,103,376.75	5,103,376.75
利率敏感度缺口	33,537,793.59	-	933,178.63	380,562,267.93	415,033,240.15
上年度末 2022年12月31日					
资产					
货币资金	3,117,257.35	-	-	-	3,117,257.35
结算备付金	103,315.37	-	-	-	103,315.37
存出保证金	19,242.57	-	-	-	19,242.57
交易性金融资产	10,128,863.01	-	-	161,902,521.53	172,031,384.54
应收申购款	-	-	-	1,146.21	1,146.21
资产总计	13,368,678.30	-	-	161,903,667.74	175,272,346.04
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	135,151.22	135,151.22

应付托管费	-	-	-	25,340.86	25,340.86
其他负债	-	-	-	114,970.26	114,970.26
负债总计	-	-	-	275,462.34	275,462.34
利率敏感度缺口	13,368,678.30	-	-	161,628,205.40	174,996,883.70

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。

#### 7.4.13.4.1.2 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2.70%(上年度末：5.79%)，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)。

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日

	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	377,732,469.50	91.01	161,902,521.53	92.52
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	377,732,469.50	91.01	161,902,521.53	92.52

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资（附注7.4.7.3）。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为0。

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化5%，其他变量不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币元)	
		本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
	业绩比较基准上升5%	31,150,837.08	17,231,457.31
	业绩比较基准下降5%	-31,150,837.08	-17,231,457.31

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 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。

#### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 7.4.14.2.1 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 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	378,451,271.29	161,170,716.93
第二层次	10,260,071.04	10,128,863.01
第三层次	214,376.84	731,804.60
合计	388,925,719.17	172,031,384.54

##### 7.4.14.2.2 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的公允价值应属第二层次还是第三层次。

##### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

###### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	731,804.60	731,804.60
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	324,434.71	324,434.71
转出第三层次	-	899,227.41	899,227.41
当期利得或损失总额	-	57,364.94	57,364.94

其中：计入损益的利得或损失	-	57,364.94	57,364.94
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	214,376.84	214,376.84
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-58,207.83	-58,207.83
项目	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	4,697,227.73	4,697,227.73
当期购买	-	3,511,802.00	3,511,802.00
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	2,826,807.23	2,826,807.23
转出第三层次	-	9,295,124.51	9,295,124.51
当期利得或损失总额	-	-1,008,907.85	-1,008,907.85
其中：计入损益的利得或损失	-	-1,008,907.85	-1,008,907.85
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	731,804.60	731,804.60
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-15,052.86	-15,052.86

注：1、于2023年12月31日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。于2023年度，本基金从第三层次转出的交易性金

融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。

2、计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

#### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	214,376.84	平均价格亚式期权模型	股价的预期年化波动率	27.16%-219.88%	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	731,804.60	平均价格亚式期权模型	股价的预期年化波动率	18.91%-247.56%	负相关

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

#### 7.4.14.4 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。

#### 7.4.15 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。

## §8 投资组合报告

### 8.1 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	377,732,469.50	89.91

	其中：股票	377,732,469.50	89.91
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	11,193,249.67	2.66
	其中：债券	11,193,249.67	2.66
	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	23,180,386.02	5.52
8	其他各项资产	8,030,511.71	1.91
9	合计	420,136,616.90	100.00

## 8.2 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	3,754,897.00	0.90
B	采矿业	10,214,195.00	2.46
C	制造业	249,193,242.13	60.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,345,350.04	1.77
E	建筑业	6,077,920.00	1.46
F	批发和零售业	13,653,344.00	3.29
G	交通运输、仓储和邮政业	9,045,614.43	2.18
H	住宿和餐饮业	226,490.00	0.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	24,158,446.55	5.82
J	金融业	28,850,966.56	6.95
K	房地产业	7,523,619.00	1.81
L	租赁和商务服务业	1,009,029.40	0.24
M	科学研究和技术服务业	4,802,469.39	1.16
N	水利、环境和公共设施管理业	7,773,276.00	1.87

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,820,542.00	0.44
R	文化、体育和娱乐业	2,283,068.00	0.55
S	综合	-	-
	合计	377,732,469.50	91.01

### 8.3 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	002594	比亚迪	15,900	3,148,200.00	0.76
2	603176	汇通集团	488,100	3,016,458.00	0.73
3	600519	贵州茅台	1,700	2,934,200.00	0.71
4	301236	软通动力	62,000	2,864,400.00	0.69
5	300760	迈瑞医疗	9,800	2,847,880.00	0.69
6	603527	众源新材	261,400	2,825,734.00	0.68
7	002371	北方华创	11,400	2,801,094.00	0.67
8	002475	立讯精密	80,800	2,783,560.00	0.67
9	300308	中际旭创	24,500	2,766,295.00	0.67
10	300512	中亚股份	328,600	2,763,526.00	0.67
11	002082	万邦德	431,800	2,763,520.00	0.67
12	002350	北京科锐	408,200	2,755,350.00	0.66
13	300624	万兴科技	28,900	2,733,940.00	0.66
14	000977	浪潮信息	81,900	2,719,080.00	0.66
15	601899	紫金矿业	216,500	2,697,590.00	0.65
16	600030	中信证券	132,300	2,694,951.00	0.65
17	601881	中国银河	223,600	2,694,380.00	0.65
18	300750	宁德时代	16,500	2,693,790.00	0.65
19	002111	威海广泰	297,300	2,693,538.00	0.65

20	300067	安诺其	865,400	2,691,394.00	0.65
21	300502	新易盛	54,400	2,683,008.00	0.65
22	300059	东方财富	190,964	2,681,134.56	0.65
23	301205	联特科技	25,500	2,671,125.00	0.64
24	600279	重庆港	600,200	2,670,890.00	0.64
25	688041	海光信息	37,400	2,654,652.00	0.64
26	600900	长江电力	113,300	2,644,422.00	0.64
27	600828	茂业商业	724,400	2,644,060.00	0.64
28	000545	金浦钛业	872,500	2,643,675.00	0.64
29	601288	农业银行	724,400	2,636,816.00	0.64
30	603980	吉华集团	562,900	2,628,743.00	0.63
31	688055	龙腾光电	536,600	2,618,608.00	0.63
32	300315	掌趣科技	502,100	2,585,815.00	0.62
33	300187	永清环保	478,000	2,571,640.00	0.62
34	601995	中金公司	66,600	2,534,130.00	0.61
35	300942	易瑞生物	215,143	2,515,021.67	0.61
36	601988	中国银行	610,300	2,435,097.00	0.59
37	000568	泸州老窖	13,200	2,368,344.00	0.57
38	002230	科大讯飞	50,900	2,360,742.00	0.57
39	002996	顺博合金	215,800	2,356,536.00	0.57
40	300394	天孚通信	25,700	2,352,064.00	0.57
41	000858	五粮液	14,800	2,076,588.00	0.50
42	603676	卫信康	185,400	1,933,722.00	0.47
43	002724	海洋王	228,400	1,877,448.00	0.45
44	300527	中船应急	234,200	1,784,604.00	0.43
45	300875	捷强装备	60,100	1,754,319.00	0.42
46	002578	闽发铝业	354,500	1,588,160.00	0.38
47	300839	博汇股份	153,900	1,574,397.00	0.38
48	603086	先达股份	266,100	1,564,668.00	0.38
49	300453	三鑫医疗	204,300	1,558,809.00	0.38
50	301126	达嘉维康	119,500	1,557,085.00	0.38

51	000698	沈阳化工	368,100	1,553,382.00	0.37
52	601901	方正证券	190,300	1,533,818.00	0.37
53	600370	三房巷	633,200	1,532,344.00	0.37
54	300715	凯伦股份	130,400	1,520,464.00	0.37
55	601099	太平洋	407,200	1,506,640.00	0.36
56	600080	金花股份	201,800	1,503,410.00	0.36
57	601003	柳钢股份	474,200	1,503,214.00	0.36
58	603122	合富中国	185,300	1,491,665.00	0.36
59	300774	倍杰特	144,900	1,491,021.00	0.36
60	001313	粤海饲料	170,600	1,470,572.00	0.35
61	603213	镇洋发展	132,900	1,433,991.00	0.35
62	300412	迦南科技	250,100	1,423,069.00	0.34
63	603963	大理药业	119,100	1,414,908.00	0.34
64	300214	日科化学	215,700	1,402,050.00	0.34
65	002798	帝欧家居	211,600	1,385,980.00	0.33
66	002346	柘中股份	124,200	1,384,830.00	0.33
67	600067	冠城大通	548,500	1,376,735.00	0.33
68	603680	今创集团	144,939	1,369,673.55	0.33
69	000576	甘化科工	146,700	1,364,310.00	0.33
70	000504	南华生物	117,200	1,359,520.00	0.33
71	600076	康欣新材	512,700	1,358,655.00	0.33
72	300967	晓鸣股份	94,400	1,348,032.00	0.32
73	600231	凌钢股份	625,800	1,345,470.00	0.32
74	600150	中国船舶	45,500	1,339,520.00	0.32
75	000725	京东方 A	343,300	1,338,870.00	0.32
76	603259	药明康德	18,400	1,338,784.00	0.32
77	603819	神力股份	93,500	1,337,985.00	0.32
78	601006	大秦铁路	184,600	1,330,966.00	0.32
79	002365	永安药业	135,900	1,329,102.00	0.32
80	603811	诚意药业	128,126	1,328,666.62	0.32
81	002714	牧原股份	32,100	1,321,878.00	0.32

82	600722	金牛化工	264,400	1,319,356.00	0.32
83	603501	韦尔股份	12,300	1,312,533.00	0.32
84	603986	兆易创新	14,200	1,311,938.00	0.32
85	002627	三峡旅游	245,000	1,308,300.00	0.32
86	000625	长安汽车	77,670	1,307,186.10	0.31
87	003025	思进智能	96,500	1,303,715.00	0.31
88	301011	华立科技	55,330	1,294,722.00	0.31
89	600207	安彩高科	271,100	1,293,147.00	0.31
90	000762	西藏矿业	44,000	1,258,400.00	0.30
91	300305	裕兴股份	123,400	1,219,192.00	0.29
92	601555	东吴证券	163,900	1,198,109.00	0.29
93	601318	中国平安	29,700	1,196,910.00	0.29
94	600800	渤海化学	316,300	1,167,147.00	0.28
95	003042	中农联合	62,800	1,166,824.00	0.28
96	300800	力合科技	85,300	1,166,051.00	0.28
97	002227	奥特迅	87,100	1,164,527.00	0.28
98	000751	锌业股份	353,200	1,147,900.00	0.28
99	002054	德美化工	168,000	1,142,400.00	0.28
100	002379	宏创控股	247,100	1,121,834.00	0.27
101	000626	远大控股	150,500	1,098,650.00	0.26
102	603797	联泰环保	195,700	1,080,264.00	0.26
103	002879	长缆科技	66,600	1,066,932.00	0.26
104	000042	中洲控股	181,200	1,040,088.00	0.25
105	002016	世荣兆业	164,100	1,032,189.00	0.25
106	002524	光正眼科	159,700	1,030,065.00	0.25
107	301176	逸豪新材	60,800	1,019,616.00	0.25
108	605006	山东玻纤	140,700	970,830.00	0.23
109	300424	航新科技	73,200	958,920.00	0.23
110	300721	怡达股份	62,900	939,097.00	0.23
111	300422	博世科	156,500	937,435.00	0.23
112	002602	世纪华通	178,200	919,512.00	0.22

113	300866	安克创新	10,200	903,720.00	0.22
114	000589	贵州轮胎	145,900	892,908.00	0.22
115	601717	郑煤机	70,400	890,560.00	0.21
116	000798	中水渔业	99,800	887,222.00	0.21
117	600066	宇通客车	66,800	885,100.00	0.21
118	688271	联影医疗	6,448	883,440.48	0.21
119	300856	科思股份	14,100	877,443.00	0.21
120	600153	建发股份	91,100	877,293.00	0.21
121	000921	海信家电	42,700	871,080.00	0.21
122	000338	潍柴动力	63,600	868,140.00	0.21
123	001267	汇绿生态	165,100	863,473.00	0.21
124	301048	金鹰重工	81,600	860,064.00	0.21
125	688169	石头科技	3,000	848,850.00	0.20
126	000932	华菱钢铁	163,900	844,085.00	0.20
127	600582	天地科技	150,300	817,632.00	0.20
128	688981	中芯国际	15,000	795,300.00	0.19
129	600281	华阳新材	168,300	780,912.00	0.19
130	000975	银泰黄金	51,600	774,000.00	0.19
131	002265	建设工业	64,500	732,720.00	0.18
132	300155	安居宝	119,200	705,664.00	0.17
133	605162	新中港	75,300	692,007.00	0.17
134	688660	电气风电	130,800	672,312.00	0.16
135	688036	传音控股	4,800	664,320.00	0.16
136	300532	今天国际	40,300	661,726.00	0.16
137	600096	云天化	42,100	656,760.00	0.16
138	000627	天茂集团	229,000	650,360.00	0.16
139	002035	华帝股份	103,700	643,977.00	0.16
140	002734	利民股份	80,500	641,585.00	0.15
141	000933	神火股份	38,100	640,080.00	0.15
142	600019	宝钢股份	103,500	613,755.00	0.15
143	601088	中国神华	18,900	592,515.00	0.14

144	601225	陕西煤业	27,900	582,831.00	0.14
145	300246	宝莱特	53,100	546,930.00	0.13
146	601788	光大证券	33,700	519,654.00	0.13
147	600909	华安证券	104,400	509,472.00	0.12
148	603612	索通发展	31,800	489,402.00	0.12
149	300679	电连技术	11,700	485,550.00	0.12
150	603171	税友股份	13,700	484,706.00	0.12
151	688556	高测股份	12,412	483,943.88	0.12
152	300323	华灿光电	66,000	483,120.00	0.12
153	603927	中科软	15,800	473,684.00	0.11
154	600845	宝信软件	9,700	473,360.00	0.11
155	688083	中望软件	4,735	471,321.90	0.11
156	600050	中国联通	107,500	470,850.00	0.11
157	300217	东方电热	87,400	470,212.00	0.11
158	601058	赛轮轮胎	40,000	470,000.00	0.11
159	002612	朗姿股份	24,400	469,212.00	0.11
160	601390	中国中铁	82,600	469,168.00	0.11
161	002891	中宠股份	17,800	469,030.00	0.11
162	601377	兴业证券	79,900	469,013.00	0.11
163	603197	保隆科技	8,300	468,120.00	0.11
164	601857	中国石油	66,300	468,078.00	0.11
165	603298	杭叉集团	18,800	467,744.00	0.11
166	603063	禾望电气	18,700	467,500.00	0.11
167	688639	华恒生物	3,713	467,466.70	0.11
168	600660	福耀玻璃	12,500	467,375.00	0.11
169	600036	招商银行	16,700	464,594.00	0.11
170	600612	老凤祥	6,700	462,300.00	0.11
171	601633	长城汽车	18,300	461,526.00	0.11
172	600809	山西汾酒	2,000	461,460.00	0.11
173	601918	新集能源	87,400	460,598.00	0.11
174	688697	纽威数控	24,400	459,452.00	0.11

175	300671	富满微	14,200	459,086.00	0.11
176	000089	深圳机场	71,300	458,459.00	0.11
177	688699	明微电子	11,331	457,205.85	0.11
178	300389	艾比森	26,200	454,308.00	0.11
179	600048	保利发展	45,800	453,420.00	0.11
180	603859	能科科技	12,000	452,760.00	0.11
181	002517	恺英网络	40,400	451,268.00	0.11
182	300782	卓胜微	3,200	451,200.00	0.11
183	603301	振德医疗	18,400	450,800.00	0.11
184	688127	蓝特光学	19,000	442,510.00	0.11
185	000596	古井贡酒	1,900	442,320.00	0.11
186	300241	瑞丰光电	78,500	441,955.00	0.11
187	603897	长城科技	21,400	438,272.00	0.11
188	600219	南山铝业	148,100	435,414.00	0.10
189	000156	华数传媒	58,900	434,093.00	0.10
190	600060	海信视像	20,700	432,630.00	0.10
191	002180	纳思达	19,100	432,233.00	0.10
192	601668	中国建筑	89,800	431,938.00	0.10
193	300902	国安达	12,200	430,050.00	0.10
194	002955	鸿合科技	13,300	429,723.00	0.10
195	688687	凯因科技	12,318	429,405.48	0.10
196	300882	万胜智能	17,600	428,736.00	0.10
197	000630	铜陵有色	130,500	428,040.00	0.10
198	002947	恒铭达	13,300	427,994.00	0.10
199	601500	通用股份	103,300	427,662.00	0.10
200	300128	锦富技术	92,500	426,425.00	0.10
201	002519	银河电子	69,000	425,730.00	0.10
202	002130	沃尔核材	56,200	424,310.00	0.10
203	002756	永兴材料	8,100	422,901.00	0.10
204	300286	安科瑞	16,300	422,659.00	0.10
205	300985	致远新能	11,200	422,352.00	0.10

206	300043	星辉娱乐	113,800	422,198.00	0.10
207	300708	聚灿光电	37,400	421,872.00	0.10
208	601138	工业富联	27,900	421,848.00	0.10
209	605066	天正电气	45,900	421,362.00	0.10
210	603328	依顿电子	51,700	421,355.00	0.10
211	300709	精研科技	13,500	421,065.00	0.10
212	603929	亚翔集成	17,600	420,992.00	0.10
213	002128	电投能源	29,500	420,965.00	0.10
214	601388	怡球资源	160,500	420,510.00	0.10
215	300681	英搏尔	21,800	420,086.00	0.10
216	688182	灿勤科技	23,600	419,608.00	0.10
217	603002	宏昌电子	66,800	419,504.00	0.10
218	603886	元祖股份	23,000	419,290.00	0.10
219	002491	通鼎互联	80,000	419,200.00	0.10
220	000902	新洋丰	36,800	419,152.00	0.10
221	003000	劲仔食品	34,300	419,146.00	0.10
222	688278	特宝生物	8,000	418,800.00	0.10
223	605166	聚合顺	42,200	418,624.00	0.10
224	603187	海容冷链	27,600	418,416.00	0.10
225	603277	银都股份	15,600	418,392.00	0.10
226	603050	科林电气	23,300	418,235.00	0.10
227	301004	嘉益股份	9,200	418,140.00	0.10
228	002045	国光电器	25,100	417,915.00	0.10
229	603335	迪生力	62,200	417,362.00	0.10
230	301026	浩通科技	13,700	417,165.00	0.10
231	601798	蓝科高新	54,800	417,028.00	0.10
232	603688	石英股份	4,800	417,024.00	0.10
233	300277	海联讯	48,200	416,930.00	0.10
234	603920	世运电路	22,800	416,784.00	0.10
235	002014	永新股份	49,900	416,665.00	0.10
236	300444	双杰电气	61,800	416,532.00	0.10

237	300622	博士眼镜	21,000	416,430.00	0.10
238	300441	鲍斯股份	60,400	416,156.00	0.10
239	000888	峨眉山 A	46,600	416,138.00	0.10
240	300696	爱乐达	23,900	416,099.00	0.10
241	603866	桃李面包	54,300	415,938.00	0.10
242	688319	欧林生物	26,324	415,919.20	0.10
243	688510	航亚科技	23,600	415,832.00	0.10
244	000612	焦作万方	72,300	415,725.00	0.10
245	002588	史丹利	65,100	415,338.00	0.10
246	603556	海兴电力	14,300	415,129.00	0.10
247	600390	五矿资本	88,700	415,116.00	0.10
248	603228	景旺电子	18,400	415,104.00	0.10
249	688589	力合微	10,400	415,064.00	0.10
250	688100	威胜信息	14,352	415,059.84	0.10
251	603067	振华股份	40,700	414,733.00	0.10
252	300645	正元智慧	22,800	414,732.00	0.10
253	300547	川环科技	24,600	414,510.00	0.10
254	603338	浙江鼎力	8,100	414,477.00	0.10
255	002991	甘源食品	5,800	414,468.00	0.10
256	603876	鼎胜新材	33,060	414,241.80	0.10
257	603758	秦安股份	36,200	414,128.00	0.10
258	603787	新日股份	33,100	414,081.00	0.10
259	002641	公元股份	82,300	413,969.00	0.10
260	601168	西部矿业	29,000	413,830.00	0.10
261	002361	神剑股份	105,300	413,829.00	0.10
262	002224	三力士	81,300	413,817.00	0.10
263	002913	奥士康	13,500	413,775.00	0.10
264	000997	新大陆	21,100	413,771.00	0.10
265	002206	海利得	82,400	413,648.00	0.10
266	605188	国光连锁	48,600	413,586.00	0.10
267	000737	北方铜业	71,300	413,540.00	0.10

268	605116	奥锐特	16,000	413,120.00	0.10
269	603699	纽威股份	29,800	413,028.00	0.10
270	300638	广和通	21,700	412,951.00	0.10
271	002757	南兴股份	26,400	412,896.00	0.10
272	002043	兔宝宝	46,600	412,876.00	0.10
273	603208	江山欧派	13,900	412,691.00	0.10
274	002469	三维化学	68,100	412,686.00	0.10
275	603611	诺力股份	21,800	412,674.00	0.10
276	002091	江苏国泰	52,700	412,641.00	0.10
277	300080	易成新能	85,200	412,368.00	0.10
278	002550	千红制药	70,100	412,188.00	0.10
279	600230	沧州大化	30,600	412,182.00	0.10
280	603757	大元泵业	17,000	412,080.00	0.10
281	002623	亚玛顿	15,400	411,950.00	0.10
282	002986	宇新股份	26,400	411,840.00	0.10
283	002753	永东股份	49,900	411,675.00	0.10
284	688223	晶科能源	46,400	411,104.00	0.10
285	603989	艾华集团	19,100	411,032.00	0.10
285	300448	浩云科技	76,400	411,032.00	0.10
287	000019	深粮控股	54,500	410,930.00	0.10
288	600794	保税科技	100,700	410,856.00	0.10
289	603230	内蒙新华	26,500	410,750.00	0.10
290	605007	五洲特纸	27,900	410,409.00	0.10
291	300355	蒙草生态	109,400	410,250.00	0.10
292	600510	黑牡丹	72,600	410,190.00	0.10
293	300729	乐歌股份	22,900	410,139.00	0.10
294	603057	紫燕食品	19,000	410,020.00	0.10
295	002274	华昌化工	54,300	409,965.00	0.10
296	002158	汉钟精机	18,400	409,584.00	0.10
297	601319	中国人保	84,600	409,464.00	0.10
298	002773	康弘药业	22,200	409,368.00	0.10

299	601163	三角轮胎	28,400	409,244.00	0.10
300	002746	仙坛股份	58,100	409,024.00	0.10
301	300636	同和药业	38,800	408,952.00	0.10
302	000543	皖能电力	65,300	408,778.00	0.10
303	600694	大商股份	24,200	408,738.00	0.10
304	600737	中粮糖业	49,600	408,704.00	0.10
305	000598	兴蓉环境	71,800	408,542.00	0.10
306	002233	塔牌集团	57,700	408,516.00	0.10
307	603689	皖天然气	47,000	408,430.00	0.10
308	002555	三七互娱	21,700	408,177.00	0.10
309	000631	顺发恒业	122,900	408,028.00	0.10
310	600461	洪城环境	44,600	407,644.00	0.10
311	603871	嘉友国际	25,700	407,602.00	0.10
312	601952	苏垦农发	39,800	407,552.00	0.10
313	603590	康辰药业	10,700	407,456.00	0.10
314	601688	华泰证券	29,200	407,340.00	0.10
315	002393	力生制药	15,600	407,160.00	0.10
316	002658	雪迪龙	50,700	407,121.00	0.10
317	600479	千金药业	37,800	407,106.00	0.10
318	603558	健盛集团	42,000	406,980.00	0.10
319	600866	星湖科技	87,300	406,818.00	0.10
320	603167	渤海轮渡	45,800	406,704.00	0.10
321	603283	赛腾股份	5,600	406,336.00	0.10
322	601211	国泰君安	27,300	406,224.00	0.10
323	002818	富森美	32,600	406,196.00	0.10
324	300770	新媒股份	10,500	406,140.00	0.10
325	600757	长江传媒	54,500	406,025.00	0.10
326	002978	安宁股份	12,800	405,248.00	0.10
327	600739	辽宁成大	34,400	405,232.00	0.10
328	002572	索菲亚	25,400	405,130.00	0.10
329	300073	当升科技	10,600	404,920.00	0.10

330	605008	长鸿高科	25,500	404,685.00	0.10
331	601878	浙商证券	38,800	404,684.00	0.10
332	603992	松霖科技	22,300	404,522.00	0.10
333	601028	玉龙股份	37,700	403,767.00	0.10
334	002443	金洲管道	58,900	403,465.00	0.10
335	603368	柳药集团	21,300	402,996.00	0.10
336	600094	大名城	134,200	402,600.00	0.10
337	600269	赣粤高速	97,900	402,369.00	0.10
338	601686	友发集团	65,400	402,210.00	0.10
339	600873	梅花生物	42,100	402,055.00	0.10
340	600623	华谊集团	62,400	401,856.00	0.10
341	002697	红旗连锁	80,500	400,890.00	0.10
342	605158	华达新材	52,600	399,760.00	0.10
343	600368	五洲交通	101,000	398,950.00	0.10
344	600984	建设机械	106,100	397,875.00	0.10
345	002199	东晶电子	42,300	396,774.00	0.10
346	002701	奥瑞金	95,700	396,198.00	0.10
347	603879	永悦科技	61,600	393,624.00	0.09
348	600109	国金证券	43,300	393,164.00	0.09
349	600831	广电网络	74,500	390,380.00	0.09
350	600768	宁波富邦	32,700	387,495.00	0.09
351	600383	金地集团	88,200	384,552.00	0.09
351	002842	翔鹭钨业	44,100	384,552.00	0.09
353	601567	三星医疗	18,700	383,350.00	0.09
354	002105	信隆健康	59,000	382,320.00	0.09
355	300082	奥克股份	54,400	379,168.00	0.09
356	300931	通用电梯	44,900	378,956.00	0.09
357	301060	兰卫医学	28,500	378,765.00	0.09
358	300385	雪浪环境	56,200	377,664.00	0.09
359	002793	罗欣药业	68,500	367,160.00	0.09
360	000953	河化股份	67,100	367,037.00	0.09

361	000757	浩物股份	76,400	366,720.00	0.09
362	000761	本钢板材	102,400	365,568.00	0.09
363	600817	宇通重工	37,100	356,160.00	0.09
364	301526	国际复材	64,782	351,247.14	0.08
365	603033	三维股份	22,100	349,401.00	0.08
366	600918	中泰证券	48,700	334,082.00	0.08
367	601162	天风证券	108,000	333,720.00	0.08
368	300887	谱尼测试	28,000	330,680.00	0.08
369	600758	辽宁能源	90,700	328,334.00	0.08
370	300509	新美星	45,300	327,519.00	0.08
371	600061	国投资本	48,100	324,194.00	0.08
372	300641	正丹股份	54,200	305,688.00	0.07
373	300922	天秦装备	17,300	295,311.00	0.07
374	601086	国芳集团	54,500	286,670.00	0.07
375	600774	汉商集团	28,900	284,954.00	0.07
376	000422	湖北宜化	26,200	274,052.00	0.07
377	000783	长江证券	50,600	272,228.00	0.07
378	000100	TCL科技	59,200	254,560.00	0.06
379	688029	南微医学	2,600	251,680.00	0.06
380	600228	返利科技	32,200	251,160.00	0.06
381	002449	国星光电	26,400	250,008.00	0.06
382	603185	弘元绿能	7,500	249,600.00	0.06
383	600438	通威股份	9,900	247,797.00	0.06
384	688686	奥普特	2,200	246,400.00	0.06
385	002600	领益智造	36,300	245,388.00	0.06
386	600938	中国海油	11,700	245,349.00	0.06
387	300274	阳光电源	2,800	245,252.00	0.06
388	688707	振华新材	11,920	244,360.00	0.06
389	603100	川仪股份	8,800	243,936.00	0.06
390	601669	中国电建	49,600	242,544.00	0.06
391	002223	鱼跃医疗	7,000	242,060.00	0.06

392	600436	片仔癀	1,000	241,990.00	0.06
393	002212	天融信	24,700	241,566.00	0.06
394	600105	永鼎股份	43,500	240,990.00	0.06
395	000050	深天马 A	22,600	240,690.00	0.06
396	600583	海油工程	40,500	240,570.00	0.06
397	688037	芯源微	1,800	240,498.00	0.06
398	603333	尚纬股份	42,100	240,391.00	0.06
399	000333	美的集团	4,400	240,372.00	0.06
400	002497	雅化集团	18,300	239,547.00	0.06
401	002422	科伦药业	8,200	238,210.00	0.06
402	002138	顺络电子	8,800	237,688.00	0.06
403	600707	彩虹股份	35,200	237,600.00	0.06
404	603383	顶点软件	4,800	236,640.00	0.06
405	603899	晨光股份	6,300	236,565.00	0.06
406	000002	万科 A	22,500	235,350.00	0.06
407	000157	中联重科	36,000	235,080.00	0.06
408	000811	冰轮环境	17,300	234,761.00	0.06
409	605376	博迁新材	8,300	234,060.00	0.06
410	600486	扬农化工	3,700	233,544.00	0.06
411	600312	平高电气	18,400	233,496.00	0.06
412	688578	艾力斯	5,600	233,296.00	0.06
413	688617	惠泰医疗	600	233,100.00	0.06
414	600132	重庆啤酒	3,500	232,575.00	0.06
415	002821	凯莱英	2,000	232,200.00	0.06
416	000039	中集集团	30,300	231,795.00	0.06
417	603985	恒润股份	9,300	231,105.00	0.06
418	301302	华如科技	9,200	231,012.00	0.06
419	600971	恒源煤电	20,700	230,805.00	0.06
420	600933	爱柯迪	10,500	230,370.00	0.06
421	603881	数据港	11,600	229,912.00	0.06
422	688088	虹软科技	5,600	229,824.00	0.06

423	601126	四方股份	16,200	229,392.00	0.06
424	688275	万润新能	3,718	229,289.06	0.06
425	002745	木林森	26,400	228,624.00	0.06
426	603893	瑞芯微	3,600	228,240.00	0.05
427	600926	杭州银行	22,800	228,228.00	0.05
428	601155	新城控股	20,000	228,200.00	0.05
429	002319	乐通股份	16,500	228,030.00	0.05
430	002690	美亚光电	11,600	227,824.00	0.05
431	601898	中煤能源	23,500	227,715.00	0.05
432	601186	中国铁建	29,900	227,539.00	0.05
433	002142	宁波银行	11,300	227,243.00	0.05
434	002649	博彦科技	18,500	226,995.00	0.05
435	000423	东阿阿胶	4,600	226,872.00	0.05
436	600258	首旅酒店	14,500	226,490.00	0.05
437	600361	创新新材	45,200	226,452.00	0.05
438	000538	云南白药	4,600	226,090.00	0.05
439	601021	春秋航空	4,500	225,900.00	0.05
440	688489	三未信安	4,800	225,696.00	0.05
441	601666	平煤股份	19,500	225,420.00	0.05
442	603289	泰瑞机器	20,400	225,216.00	0.05
443	000069	华侨城 A	72,200	224,542.00	0.05
444	600745	闻泰科技	5,300	224,243.00	0.05
445	688105	诺唯赞	7,000	224,140.00	0.05
446	301285	鸿日达	14,000	223,720.00	0.05
447	002283	天润工业	38,200	223,470.00	0.05
448	688008	澜起科技	3,800	223,288.00	0.05
449	002868	绿康生化	10,500	223,230.00	0.05
450	002444	巨星科技	9,900	222,948.00	0.05
451	600985	淮北矿业	13,400	222,842.00	0.05
452	301180	万祥科技	12,300	222,507.00	0.05
453	300486	东杰智能	32,100	221,811.00	0.05

454	301361	众智科技	9,300	221,712.00	0.05
455	301306	西测测试	5,600	221,704.00	0.05
456	300879	大叶股份	12,800	221,696.00	0.05
457	300870	欧陆通	5,000	221,350.00	0.05
458	000045	深纺织 A	18,700	220,660.00	0.05
459	603218	日月股份	17,800	220,186.00	0.05
460	301123	奕东电子	9,369	219,796.74	0.05
461	002213	大为股份	15,600	219,492.00	0.05
462	600063	皖维高新	51,000	219,300.00	0.05
463	601699	潞安环能	10,000	219,100.00	0.05
464	300631	久吾高科	7,500	218,775.00	0.05
465	300206	理邦仪器	21,400	218,494.00	0.05
466	688777	中控技术	4,800	217,680.00	0.05
467	000029	深深房 A	18,500	217,560.00	0.05
468	002631	德尔未来	35,600	217,516.00	0.05
469	603983	丸美股份	8,600	217,322.00	0.05
470	002420	毅昌科技	34,800	217,152.00	0.05
471	300031	宝通科技	11,700	216,918.00	0.05
472	002027	分众传媒	34,200	216,144.00	0.05
473	300551	古鳌科技	12,400	215,760.00	0.05
474	301296	新巨丰	20,900	215,270.00	0.05
475	601012	隆基绿能	9,400	215,260.00	0.05
476	603508	思维列控	13,700	215,090.00	0.05
477	600741	华域汽车	13,200	214,896.00	0.05
478	002676	顺威股份	45,300	214,722.00	0.05
479	300329	海伦钢琴	28,800	214,560.00	0.05
480	002644	佛慈制药	22,000	214,500.00	0.05
481	300111	向日葵	70,500	214,320.00	0.05
482	000795	英洛华	34,400	214,312.00	0.05
483	600959	江苏有线	68,200	214,148.00	0.05
484	600662	外服控股	44,400	213,120.00	0.05

485	300404	博济医药	23,800	213,010.00	0.05
486	300016	北陆药业	29,900	212,888.00	0.05
487	002434	万里扬	28,500	212,325.00	0.05
488	300626	华瑞股份	19,500	211,575.00	0.05
489	002478	常宝股份	38,800	211,460.00	0.05
490	000915	华特达因	7,300	211,408.00	0.05
491	300132	青松股份	40,400	210,888.00	0.05
492	600376	首开股份	69,100	210,064.00	0.05
493	600780	通宝能源	25,600	209,920.00	0.05
494	300593	新雷能	14,200	209,734.00	0.05
495	300117	嘉寓股份	72,300	209,670.00	0.05
496	300317	珈伟新能	41,100	209,199.00	0.05
497	688292	浩瀚深度	7,600	209,152.00	0.05
498	605366	宏柏新材	25,200	208,404.00	0.05
499	002083	孚日股份	41,300	208,152.00	0.05
500	300147	香雪制药	40,200	207,030.00	0.05
501	000790	华神科技	40,900	206,954.00	0.05
502	603798	康普顿	21,400	206,938.00	0.05
503	603182	嘉华股份	14,000	206,780.00	0.05
504	301239	普瑞眼科	2,400	206,400.00	0.05
505	000509	华塑控股	51,200	205,312.00	0.05
506	603369	今世缘	4,200	204,750.00	0.05
507	603177	德创环保	17,300	204,486.00	0.05
508	605180	华生科技	14,600	204,400.00	0.05
509	688371	菲沃泰	11,600	204,276.00	0.05
510	600791	京能置业	41,900	203,634.00	0.05
511	300464	星徽股份	33,800	203,476.00	0.05
512	300150	世纪瑞尔	41,900	203,215.00	0.05
513	603585	苏利股份	14,200	203,202.00	0.05
514	300539	横河精密	16,300	202,283.00	0.05
515	605580	恒盛能源	17,400	202,188.00	0.05

516	600369	西南证券	49,400	202,046.00	0.05
517	002688	金河生物	42,000	202,020.00	0.05
518	300830	金现代	25,000	201,750.00	0.05
519	300487	蓝晓科技	3,800	201,628.00	0.05
520	600880	博瑞传播	40,200	201,402.00	0.05
521	603186	华正新材	5,800	201,260.00	0.05
522	300279	和晶科技	31,100	201,217.00	0.05
523	600857	宁波中百	21,300	200,859.00	0.05
524	300426	唐德影视	18,200	200,746.00	0.05
525	300239	东宝生物	32,200	200,606.00	0.05
526	601279	英利汽车	34,400	200,552.00	0.05
527	600578	京能电力	67,700	200,392.00	0.05
528	603813	原尚股份	12,400	200,260.00	0.05
529	600184	光电股份	17,500	200,025.00	0.05
530	300950	德固特	12,400	200,012.00	0.05
531	000603	盛达资源	18,100	200,005.00	0.05
532	002575	群兴玩具	35,400	199,656.00	0.05
533	688280	精进电动	26,000	199,420.00	0.05
534	600865	百大集团	24,400	199,104.00	0.05
535	300697	电工合金	15,400	198,968.00	0.05
536	301228	实朴检测	12,000	198,960.00	0.05
537	603345	安井食品	1,900	198,759.00	0.05
538	000608	阳光股份	69,000	198,720.00	0.05
539	301193	家联科技	11,700	198,666.00	0.05
540	600833	第一医药	16,500	198,330.00	0.05
541	000863	三湘印象	50,200	198,290.00	0.05
542	300908	仲景食品	4,800	198,096.00	0.05
543	300399	天利科技	14,300	197,912.00	0.05
544	600097	开创国际	18,500	197,765.00	0.05
545	603336	宏辉果蔬	38,700	197,757.00	0.05
546	605338	巴比食品	9,200	197,616.00	0.05

547	688538	和辉光电	81,200	197,316.00	0.05
548	603398	沐邦高科	11,000	197,010.00	0.05
549	603567	珍宝岛	16,200	196,992.00	0.05
550	301258	富士莱	6,100	196,908.00	0.05
551	601339	百隆东方	40,400	196,748.00	0.05
552	603843	正平股份	56,200	196,138.00	0.05
553	600724	宁波富达	49,400	196,118.00	0.05
554	601528	瑞丰银行	39,600	196,020.00	0.05
555	605136	丽人丽妆	19,600	194,236.00	0.05
556	601000	唐山港	55,400	193,900.00	0.05
557	603588	高能环境	29,400	192,276.00	0.05
558	601963	重庆银行	27,600	192,096.00	0.05
559	600675	中华企业	60,500	190,575.00	0.05
560	000607	华媒控股	41,000	187,780.00	0.05
561	003029	吉大正元	9,500	187,245.00	0.05
562	600389	江山股份	10,600	184,440.00	0.04
563	002712	思美传媒	32,100	182,328.00	0.04
564	600569	安阳钢铁	85,300	181,689.00	0.04
565	301162	国能日新	3,500	181,580.00	0.04
566	603580	艾艾精工	12,100	180,169.00	0.04
567	301273	瑞晨环保	6,500	179,335.00	0.04
568	300701	森霸传感	15,600	179,088.00	0.04
569	688111	金山办公	564	178,336.80	0.04
570	300901	中胤时尚	17,400	178,176.00	0.04
571	301213	观想科技	4,400	178,024.00	0.04
572	601096	宏盛华源	32,659	177,860.76	0.04
573	603076	乐惠国际	6,600	176,880.00	0.04
574	002114	罗平锌电	23,500	175,780.00	0.04
575	300991	创益通	10,100	175,538.00	0.04
576	300871	回盛生物	12,100	174,966.00	0.04
577	300930	屹通新材	7,300	174,616.00	0.04

578	002867	周大生	11,500	174,570.00	0.04
579	002887	绿茵生态	20,100	174,468.00	0.04
580	300417	南华仪器	13,900	174,445.00	0.04
581	600793	宜宾纸业	15,000	174,300.00	0.04
582	001202	炬申股份	9,900	173,943.00	0.04
583	300126	锐奇股份	24,300	173,745.00	0.04
584	301012	扬电科技	8,600	173,720.00	0.04
585	000565	渝三峡 A	27,500	173,525.00	0.04
586	301182	凯旺科技	7,400	173,012.00	0.04
587	002492	恒基达鑫	28,700	171,913.00	0.04
588	300190	维尔利	41,100	171,798.00	0.04
589	000605	渤海股份	26,700	171,147.00	0.04
590	000590	启迪药业	19,000	170,240.00	0.04
591	600802	福建水泥	32,500	168,350.00	0.04
592	601888	中国中免	2,000	167,380.00	0.04
593	600573	惠泉啤酒	16,000	166,080.00	0.04
594	301161	唯万密封	8,200	165,804.00	0.04
595	002672	东江环保	31,900	163,647.00	0.04
596	301566	达利凯普	5,755	162,891.85	0.04
597	600576	祥源文旅	21,800	162,192.00	0.04
598	300219	鸿利智汇	19,200	161,664.00	0.04
599	002853	皮阿诺	12,500	161,125.00	0.04
600	000717	中南股份	63,100	160,274.00	0.04
601	300497	富祥药业	17,000	159,120.00	0.04
602	002919	名臣健康	6,100	156,404.00	0.04
603	002608	江苏国信	23,500	154,395.00	0.04
604	002552	宝鼎科技	10,800	154,332.00	0.04
605	300477	合纵科技	40,900	153,375.00	0.04
606	002728	特一药业	8,500	152,320.00	0.04
607	300365	恒华科技	22,400	151,424.00	0.04
608	600829	人民同泰	19,000	148,580.00	0.04

609	300334	津膜科技	19,000	147,060.00	0.04
610	600714	金瑞矿业	15,100	144,960.00	0.03
611	001330	博纳影业	20,000	144,000.00	0.03
612	688509	正元地信	29,800	143,934.00	0.03
613	002839	张家港行	36,500	141,620.00	0.03
614	301508	中机认检	4,186	140,801.39	0.03
615	300292	吴通控股	37,200	138,384.00	0.03
616	300413	芒果超媒	5,400	136,080.00	0.03
617	002440	闰土股份	22,100	134,810.00	0.03
618	002425	凯撒文化	29,600	132,312.00	0.03
619	002078	太阳纸业	10,700	130,219.00	0.03
620	000776	广发证券	9,000	128,610.00	0.03
621	600167	联美控股	22,300	126,441.00	0.03
622	301516	中远通	6,033	124,517.13	0.03
623	603160	汇顶科技	1,800	124,380.00	0.03
624	002483	润邦股份	23,800	124,236.00	0.03
625	603903	中持股份	12,500	123,500.00	0.03
626	300040	九洲集团	21,900	122,640.00	0.03
627	600301	华锡有色	9,500	119,510.00	0.03
628	301413	安培龙	1,633	118,542.96	0.03
629	300674	宇信科技	7,100	115,588.00	0.03
630	300518	新讯达	6,600	112,728.00	0.03
631	300515	三德科技	9,700	111,938.00	0.03
632	300822	贝仕达克	7,300	110,084.00	0.03
633	300033	同花顺	700	109,809.00	0.03
634	301568	思泰克	2,456	109,572.88	0.03
635	300687	赛意信息	5,000	108,900.00	0.03
636	000720	新能泰山	26,300	108,882.00	0.03
637	002176	江特电机	8,000	108,000.00	0.03
638	603390	通达电气	10,200	102,510.00	0.02
639	301459	丰茂股份	2,077	95,083.08	0.02

640	301555	惠柏新材	2,235	91,587.79	0.02
641	301578	辰奕智能	1,175	89,662.16	0.02
642	001378	德冠新材	2,044	77,818.72	0.02
643	601083	锦江航运	5,789	71,482.43	0.02
644	603004	鼎龙科技	1,948	69,190.05	0.02
645	603107	上海汽配	2,920	66,438.76	0.02
646	001306	夏厦精密	631	56,221.59	0.01
647	001326	联域股份	986	53,715.67	0.01
648	603296	华勤技术	592	47,166.48	0.01
649	001239	永达股份	1,887	44,228.22	0.01
650	001358	兴欣新材	867	41,281.92	0.01
651	603062	麦加芯彩	629	38,983.07	0.01
652	603231	索宝蛋白	1,610	37,546.81	0.01
653	603373	安邦护卫	876	36,981.40	0.01
654	001376	百通能源	804	17,897.04	0.00
655	688503	聚和材料	159	8,522.40	0.00
656	301489	思泉新材	128	8,206.08	0.00
657	301517	陕西华达	185	8,082.65	0.00
658	301559	中集环科	414	7,551.36	0.00
659	301500	飞南资源	283	5,911.87	0.00
660	688061	灿瑞科技	142	5,680.00	0.00
661	301548	崇德科技	80	4,719.20	0.00
662	688772	珠海冠宇	196	4,313.96	0.00
663	603273	天元智能	178	3,376.66	0.00
664	603075	热威股份	126	2,937.06	0.00
665	688606	奥泰生物	33	2,263.80	0.00
666	603172	万丰股份	112	1,974.56	0.00
667	001282	三联锻造	53	1,917.01	0.00
668	001324	长青科技	68	1,650.36	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

## 8.4.1 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	000858	五粮液	10,647,300.00	6.08
2	002371	北方华创	10,195,395.96	5.83
3	002594	比亚迪	10,044,893.00	5.74
4	601012	隆基绿能	9,782,381.80	5.59
5	603527	众源新材	8,780,534.00	5.02
6	300394	天孚通信	8,623,650.00	4.93
7	000977	浪潮信息	8,488,128.61	4.85
8	002475	立讯精密	8,444,441.00	4.83
9	603213	镇洋发展	8,138,250.00	4.65
10	601899	紫金矿业	7,743,693.00	4.43
11	300760	迈瑞医疗	7,208,760.00	4.12
12	603680	今创集团	7,152,362.05	4.09
13	601688	华泰证券	6,504,511.00	3.72
14	601138	工业富联	6,460,246.00	3.69
15	688981	中芯国际	6,442,147.06	3.68
16	000625	长安汽车	6,435,416.29	3.68
17	603176	汇通集团	6,428,556.00	3.67
18	605577	龙版传媒	6,320,405.00	3.61
19	300274	阳光电源	6,227,406.00	3.56
20	600150	中国船舶	6,175,043.00	3.53
21	002230	科大讯飞	6,079,958.00	3.47
22	603259	药明康德	6,066,213.00	3.47
23	601512	中新集团	6,049,146.00	3.46
24	600276	恒瑞医药	6,027,194.00	3.44
25	002996	顺博合金	5,995,045.00	3.43
26	002241	歌尔股份	5,987,756.00	3.42

27	301017	漱玉平民	5,968,264.00	3.41
28	300750	宁德时代	5,953,813.00	3.40
29	301176	逸豪新材	5,931,188.00	3.39
30	300697	电工合金	5,837,992.00	3.34
31	688055	龙腾光电	5,724,251.96	3.27
32	600895	张江高科	5,705,628.00	3.26
33	688012	中微公司	5,692,360.38	3.25
34	603676	卫信康	5,676,894.00	3.24
35	605158	华达新材	5,673,026.30	3.24
36	002724	海洋王	5,624,810.00	3.21
37	603132	金徽股份	5,577,962.00	3.19
38	601099	太平洋	5,483,978.00	3.13
39	601698	中国卫通	5,452,119.00	3.12
40	600919	江苏银行	5,446,947.00	3.11
41	002111	威海广泰	5,424,161.00	3.10
42	603103	横店影视	5,362,230.00	3.06
43	000063	中兴通讯	5,362,140.00	3.06
44	605118	力鼎光电	5,348,294.70	3.06
45	600036	招商银行	5,341,004.00	3.05
46	605198	安德利	5,291,784.00	3.02
47	301236	软通动力	5,272,091.64	3.01
48	300308	中际旭创	5,152,191.00	2.94
49	300942	易瑞生物	5,145,660.27	2.94
50	605050	福然德	5,131,465.00	2.93
51	000988	华工科技	5,096,594.00	2.91
52	600519	贵州茅台	5,053,619.00	2.89
53	601288	农业银行	5,014,971.00	2.87
54	603053	成都燃气	4,999,014.31	2.86
55	002900	哈三联	4,988,610.00	2.85
56	600030	中信证券	4,985,316.45	2.85
57	603000	人民网	4,950,406.00	2.83

58	601601	中国太保	4,901,471.00	2.80
59	000576	甘化科工	4,892,689.29	2.80
60	000568	泸州老窖	4,874,983.00	2.79
61	000725	京东方 A	4,850,888.00	2.77
62	601686	友发集团	4,779,145.00	2.73
63	001313	粤海饲料	4,756,952.00	2.72
64	603585	苏利股份	4,725,307.00	2.70
65	603378	亚士创能	4,671,006.00	2.67
66	600828	茂业商业	4,661,001.90	2.66
67	002950	奥美医疗	4,632,863.00	2.65
68	603948	建业股份	4,630,816.00	2.65
69	603151	邦基科技	4,627,571.00	2.64
70	601318	中国平安	4,616,283.00	2.64
71	002096	易普力	4,541,361.00	2.60
72	300199	翰宇药业	4,490,158.00	2.57
73	600865	百大集团	4,474,986.00	2.56
74	605116	奥锐特	4,422,318.32	2.53
75	300805	电声股份	4,414,680.00	2.52
76	603861	白云电器	4,401,006.00	2.51
77	300512	中亚股份	4,368,993.00	2.50
78	601888	中国中免	4,321,962.00	2.47
79	603501	韦尔股份	4,303,311.00	2.46
80	000100	TCL科技	4,281,327.00	2.45
81	605188	国光连锁	4,123,238.00	2.36
82	300774	倍杰特	4,087,196.00	2.34
83	003002	壶化股份	4,078,614.00	2.33
84	002578	闽发铝业	4,047,700.00	2.31
85	603819	神力股份	3,988,950.00	2.28
86	001217	华尔泰	3,952,455.00	2.26
87	301283	聚胶股份	3,931,299.00	2.25
88	002973	侨银股份	3,927,803.00	2.24

89	002082	万邦德	3,912,823.00	2.24
90	301205	联特科技	3,912,094.25	2.24
91	601988	中国银行	3,890,669.00	2.22
92	300813	泰林生物	3,868,138.30	2.21
93	300968	格林精密	3,826,888.00	2.19
94	300624	万兴科技	3,817,226.00	2.18
95	003013	地铁设计	3,804,354.00	2.17
96	300502	新易盛	3,800,409.00	2.17
97	603261	立航科技	3,783,530.00	2.16
98	301111	粤万年青	3,711,158.00	2.12
99	601225	陕西煤业	3,708,334.00	2.12
100	601881	中国银河	3,688,901.00	2.11
101	603386	骏亚科技	3,675,446.00	2.10
102	600570	恒生电子	3,632,582.00	2.08
103	001331	胜通能源	3,618,770.00	2.07
104	600900	长江电力	3,613,055.00	2.06
105	301286	侨源股份	3,604,381.00	2.06
106	603689	皖天然气	3,578,744.00	2.05
107	002129	TCL中环	3,565,496.00	2.04
108	000504	南华生物	3,564,744.00	2.04
109	301389	隆扬电子	3,513,641.00	2.01

#### 8.4.2 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	601012	隆基绿能	15,908,230.90	9.09
2	603259	药明康德	12,473,546.00	7.13
3	300760	迈瑞医疗	9,918,763.46	5.67
4	002475	立讯精密	9,040,444.99	5.17

5	000002	万科A	8,927,542.00	5.10
6	600048	保利发展	8,633,795.00	4.93
7	000858	五粮液	8,361,180.00	4.78
8	600570	恒生电子	8,053,648.00	4.60
9	002311	海大集团	7,802,987.89	4.46
10	600309	万华化学	7,708,809.00	4.41
11	002371	北方华创	7,569,404.00	4.33
12	605499	东鹏饮料	7,177,974.00	4.10
13	300122	智飞生物	7,159,167.50	4.09
14	300750	宁德时代	7,128,387.00	4.07
15	605577	龙版传媒	7,096,198.00	4.06
16	300059	东方财富	6,822,254.00	3.90
17	300394	天孚通信	6,775,185.00	3.87
18	603213	镇洋发展	6,648,365.00	3.80
19	600519	贵州茅台	6,623,409.00	3.78
20	688029	南微医学	6,599,992.42	3.77
21	002594	比亚迪	6,569,478.00	3.75
22	603345	安井食品	6,554,113.00	3.75
23	300697	电工合金	6,443,352.00	3.68
24	600276	恒瑞医药	6,094,045.00	3.48
25	601688	华泰证券	6,079,411.00	3.47
26	600895	张江高科	5,977,376.00	3.42
27	601138	工业富联	5,964,773.00	3.41
28	002241	歌尔股份	5,961,256.00	3.41
29	688012	中微公司	5,931,332.58	3.39
30	301017	漱玉平民	5,921,664.00	3.38
31	603527	众源新材	5,855,957.52	3.35
32	601512	中新集团	5,766,711.00	3.30
33	603132	金徽股份	5,752,494.99	3.29
34	603680	今创集团	5,713,088.00	3.26
35	601100	恒立液压	5,710,072.00	3.26

36	688981	中芯国际	5,656,059.12	3.23
37	300274	阳光电源	5,626,926.00	3.22
38	002142	宁波银行	5,625,249.68	3.21
39	000625	长安汽车	5,492,710.00	3.14
40	605118	力鼎光电	5,467,645.00	3.12
41	603103	横店影视	5,431,843.00	3.10
42	000977	浪潮信息	5,419,463.28	3.10
43	605158	华达新材	5,415,494.00	3.09
44	605198	安德利	5,343,397.00	3.05
45	600919	江苏银行	5,329,597.00	3.05
46	301176	逸豪新材	5,217,304.89	2.98
47	000063	中兴通讯	5,200,655.00	2.97
48	601698	中国卫通	5,177,512.00	2.96
49	002900	哈三联	5,120,424.00	2.93
50	601899	紫金矿业	5,084,109.78	2.91
51	600809	山西汾酒	5,071,783.00	2.90
52	605050	福然德	5,063,684.00	2.89
53	603000	人民网	5,055,210.80	2.89
54	600779	水井坊	5,040,879.00	2.88
55	603053	成都燃气	4,986,920.00	2.85
56	601966	玲珑轮胎	4,939,119.00	2.82
57	603378	亚士创能	4,934,693.00	2.82
58	600150	中国船舶	4,840,460.70	2.77
59	603948	建业股份	4,836,019.00	2.76
60	601601	中国太保	4,792,471.00	2.74
61	000988	华工科技	4,732,206.84	2.70
62	600036	招商银行	4,703,343.00	2.69
63	300124	汇川技术	4,665,752.00	2.67
64	603596	伯特利	4,630,451.00	2.65
65	300805	电声股份	4,623,859.00	2.64
66	002950	奥美医疗	4,551,942.50	2.60

67	301111	粤万年青	4,442,410.00	2.54
68	603585	苏利股份	4,388,418.00	2.51
69	603151	邦基科技	4,367,885.85	2.50
70	603861	白云电器	4,320,202.00	2.47
71	001217	华尔泰	4,246,879.00	2.43
72	600865	百大集团	4,177,082.00	2.39
73	000100	TCL科技	4,162,755.00	2.38
74	002096	易普力	4,143,552.00	2.37
75	300199	翰宇药业	4,134,298.00	2.36
76	601686	友发集团	4,128,311.00	2.36
77	601021	春秋航空	4,021,591.20	2.30
78	605116	奥锐特	3,970,090.24	2.27
79	002973	侨银股份	3,947,982.00	2.26
80	300968	格林精密	3,947,247.00	2.26
81	603517	绝味食品	3,881,021.00	2.22
82	300813	泰林生物	3,865,214.30	2.21
83	603386	骏亚科技	3,810,449.00	2.18
84	001331	胜通能源	3,794,391.60	2.17
85	002714	牧原股份	3,765,844.00	2.15
86	003002	壶化股份	3,755,639.00	2.15
87	301283	聚胶股份	3,729,746.47	2.13
88	605188	国光连锁	3,714,253.00	2.12
89	301389	隆扬电子	3,692,543.00	2.11
90	603261	立航科技	3,666,630.00	2.10
91	003013	地铁设计	3,657,750.00	2.09
92	301286	侨源股份	3,649,362.00	2.09
93	600007	中国国贸	3,633,749.00	2.08
94	601099	太平洋	3,596,604.00	2.06
95	002230	科大讯飞	3,595,545.00	2.05
96	601888	中国中免	3,570,223.00	2.04
97	301236	软通动力	3,525,806.50	2.01

98	000725	京东方 A	3,519,583.00	2.01
----	--------	-------	--------------	------

#### 8.4.3 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	2,125,137,325.36
卖出股票收入（成交）总额	1,895,124,532.63

注：本项中8.4.1、8.4.2、8.4.3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。

#### 8.5 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	10,260,071.04	2.47
	其中：政策性金融债	10,260,071.04	2.47
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)	933,178.63	0.22
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	11,193,249.67	2.70

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	210303	21进出03	100,000	10,260,071.04	2.47
2	127095	广泰转债	4,122	499,763.14	0.12
3	113068	金铜转债	1,420	170,810.13	0.04

4	113672	福蓉转债	580	80,643.09	0.02
5	113671	武进转债	490	60,884.98	0.01

### 8.7 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。

### 8.8 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。

### 8.9 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。

### 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

报告期内，本基金以套期保值为目的，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以降低大额申购时现金资产对组合仓位波动的影响。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 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。

#### 8.11.2 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。

### 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

#### 8.12.3 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	880,235.73
2	应收清算款	7,148,464.78
3	应收股利	-

4	应收利息	-
5	应收申购款	1,811.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,030,511.71

#### 8.12.4 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。

#### 8.12.5 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。

#### 8.12.6 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。

### §9 基金份额持有人信息

#### 9.1 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
631	482,782.10	283,117,686.36	92.94%	21,517,817.39	7.06%

#### 9.2 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	4,421,946.97	1.45%

#### 9.3 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、基金投资和研发部	>100

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 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2016年06月01日)基金份额总额	847,544,853.76
本报告期期初基金份额总额	95,858,119.39
本报告期基金总申购份额	238,799,054.06
减：本报告期基金总赎回份额	30,021,669.70
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	304,635,503.75

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

## §11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### (1) 基金管理人的重大人事变动

2023年2月21日，本基金管理人发布《泓德基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，邬传雁先生离任副总经理。

2023年5月18日，本基金管理人发布《泓德基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，胡康宁先生离任董事长，温永鹏先生离任副总经理，任职董事长。

#### (2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 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。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

## 11.5 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。本报告期应支付给该会计师事务所的报酬60,000.00元，已连续为本基金提供审计服务8年。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 11.6.1 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。

### 11.6.2 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。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华金证券	2	3,244,229,161.64	80.74%	588,351.78	51.31%	-
中泰证券	2	316,868,602.57	7.89%	228,793.48	19.95%	-
中信建投证券	4	229,323,987.22	5.71%	165,412.71	14.42%	-
长城证券	2	132,976,529.77	3.31%	95,917.72	8.36%	-
光大证券	2	59,878,302.77	1.49%	43,190.03	3.77%	-
中信	2	34,800,221.76	0.87%	25,099.41	2.19%	-

证券							
渤海 证券	1	-	-	-	-	-	-
长江 证券	1	-	-	-	-	-	-
海通 证券	1	-	-	-	-	-	-
西部 证券	1	-	-	-	-	-	-
东北 证券	2	-	-	-	-	-	-
广发 证券	2	-	-	-	-	-	-
国金 证券	2	-	-	-	-	-	-
国盛 证券	2	-	-	-	-	-	-
国信 证券	2	-	-	-	-	-	-
华安 证券	2	-	-	-	-	-	-
华泰 证券	2	-	-	-	-	-	-
华西 证券	2	-	-	-	-	-	-
开源 证券	2	-	-	-	-	-	-
民生 证券	2	-	-	-	-	-	-
平安 证券	2	-	-	-	-	-	-
申万	2	-	-	-	-	-	-

宏源 证券						
太平 洋证 券	2	-	-	-	-	-
西藏 东方 财富 证券	2	-	-	-	-	-
信达 证券	2	-	-	-	-	-
第一 创业 证券	2	-	-	-	-	-
招商 证券	2	-	-	-	-	-
中国 中金 财富 证券	2	-	-	-	-	-
首创 证券	3	-	-	-	-	-
国投 证券	4	-	-	-	-	-

注：1、本公司选择证券经营机构的标准

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

2、本公司租用券商交易单元的程序

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

3、本基金租用证券公司交易单元均为共用交易单元。

## 4、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

- (1) 本基金报告期内新增租用交易单元：华金证券、开源证券、第一创业证券。  
 (2) 本基金报告期内停止租用交易单元：无。

## 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
华金证券	323,406.19	100.00%	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-

中国中金财富 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-	-	-

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	泓德基金管理有限公司关于调整旗下基金在中国工商银行股份有限公司最低申购及定投金额起点的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2023-01-13
2	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加海通证券股份有限公司为销售机构的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2023-02-17
3	泓德基金管理有限公司高级管理人员变更公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2023-02-21
4	泓德基金管理有限公司关于旗下基金参与部分销售机构基金转换费率优惠活动的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2023-02-24
5	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加平安银行股份有限公司为销售机构的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2023-02-25
6	泓德基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在销售机构申购起点金额的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-02
7	泓德基金管理有限公司关于泓德泓信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、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-11
8	泓德基金管理有限公司关于	公司官网、上海证券报、中	2023-03-29

	旗下部分基金增加东莞证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站	
9	泓德基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2023-05-18
10	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华西证券股份有限公司为销售机构的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2023-05-26
11	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加开源证券股份有限公司为销售机构的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2023-06-13
12	泓德基金管理有限公司关于泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金新增部分销售机构的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2023-06-21
13	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加渤海证券股份有限公司为销售机构的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2023-07-01
14	泓德基金管理有限公司关于泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金增加华泰证券股份有限公司为销售机构的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2023-07-15
15	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加德邦证券股份有限公司为销售机构的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2023-07-21
16	泓德基金管理有限公司关于泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金增加中银国际证券股份有限公司为销售机构	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2023-08-11

	的公告		
17	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中航证券有限公司为销售机构的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2023-09-22
18	泓德基金管理有限公司关于泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金暂停大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2023-10-10
19	泓德基金管理有限公司关于泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金的基金经理变更公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2023-10-26
20	泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金分红公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2023-10-27
21	泓德基金管理有限公司关于泓德泓信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、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2023-11-09
22	泓德基金管理有限公司关于调整旗下基金在蚂蚁(杭州)基金销售有限公司最低申购及定投金额起点的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2023-12-18
23	泓德基金管理有限公司关于修改泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金业绩比较基准的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2023-12-22

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
-------	----------------	------------

	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2023/01/01-2023/07/20	23,916,118.00	5,874,446.55	0.00	29,790,564.55	9.78%
	2	2023/07/18-2023/07/20	9,000,503.13	30,809,733.01	9,000,503.13	30,809,733.01	10.11%
	3	2023/09/27-2023/12/07	0.00	58,926,929.88	0.00	58,926,929.88	19.34%
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>							

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《泓德泓信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。

### 13.2 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

### 13.3 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  
二〇二四年三月二十八日