

---

**泓德裕泰债券型证券投资基金**

**2021 年中期报告**

2021 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:2021 年 08 月 25 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2021年8月24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2021年1月1日起至2021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.....	9
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.....	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	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 中期财务会计报告(未经审计).....	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益(基金净值)变动表.....	17
6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告.....	42
7.1 期末基金资产组合情况.....	42
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.....	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	44
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	45
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	45
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.....	45
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.....	45
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	46
7.12 投资组合报告附注.....	46
§8 基金份额持有人信息.....	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	47

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	48
§9 开放式基金份额变动.....	48
§10 重大事件揭示.....	48
10.1 基金份额持有人大会决议.....	48
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	49
10.4 基金投资策略的改变.....	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	49
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	49
10.8 其他重大事件.....	53
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	53
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	53
§12 备查文件目录.....	53
12.1 备查文件目录.....	53
12.2 存放地点.....	53
12.3 查阅方式.....	53

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	泓德裕泰债券型证券投资基金	
基金简称	泓德裕泰债券	
基金主代码	002138	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年12月17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	2,466,520,353.95份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	泓德裕泰债券A	泓德裕泰债券C
下属分级基金的交易代码	002138	002139
报告期末下属分级基金的份额总额	2,438,277,261.38份	28,243,092.57份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在控制风险并保持资产流动性的基础上，力争为投资人实现超过业绩比较基准的投资收益。
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。本基金采取稳健的资产配置策略，通过自上而下的方法进行固定收益类与权益类投资工具的战略及战术资产配置，在控制基金资产净值下行风险的基础上，提高基金的收益水平。通过对国内外宏观经济走势、政策、市场利率及信用状况等影响证券市场走势的因素进行深入分析，根据本基金对风险的承受能力和对大类资产的预期收益、风险水平及相关关系，确定本基金在大类资产之间的长期战略资产配置，以使本基金具有相对明确、稳定的风险收益特征，降低基金的组合风险，控制基金资产净值的下行风险，追求相对稳定的收益。
业绩比较基准	中国债券综合全价指数收益率

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
	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	010-59322130	010-66105798
注册地址	西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦1206室	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址	北京市西城区德胜门外大街125号	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码	100088	100140
法定代表人	王德晓	陈四清

### 2.4 信息披露方式

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

### 2.5 其他相关资料

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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2021年01月01日-2021年06月30日)	
	泓德裕泰债券A	泓德裕泰债券C
本期已实现收益	149,590,700.94	1,751,287.32
本期利润	62,640,172.58	665,263.44
加权平均基金份额本期利润	0.0248	0.0218
本期加权平均净值利润率	2.12%	1.91%
本期基金份额净值增长率	2.17%	2.00%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2021年06月30日)	
期末可供分配利润	462,873,439.16	4,531,035.98
期末可供分配基金份额利润	0.1898	0.1604
期末基金资产净值	2,901,150,700.54	32,774,128.55
期末基金份额净值	1.1898	1.1604
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2021年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	29.38%	26.12%

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

泓德裕泰债券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 ④	①-③	②-④
过去一个月	0.63%	0.14%	-0.04%	0.03%	0.67%	0.11%
过去三个月	1.93%	0.14%	0.45%	0.03%	1.48%	0.11%
过去六个月	2.17%	0.14%	0.65%	0.04%	1.52%	0.10%
过去一年	-3.11%	0.24%	-0.20%	0.06%	-2.91%	0.18%
过去三年	15.41%	0.20%	4.53%	0.07%	10.88%	0.13%
自基金合同 生效起至今	29.38%	0.16%	2.27%	0.07%	27.11%	0.09%

## 泓德裕泰债券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	0.61%	0.14%	-0.04%	0.03%	0.65%	0.11%
过去三个月	1.84%	0.15%	0.45%	0.03%	1.39%	0.12%
过去六个月	2.00%	0.14%	0.65%	0.04%	1.35%	0.10%
过去一年	-3.38%	0.24%	-0.20%	0.06%	-3.18%	0.18%
过去三年	14.24%	0.20%	4.53%	0.07%	9.71%	0.13%
自基金合同 生效起至今	26.12%	0.16%	2.27%	0.07%	23.85%	0.09%

注：业绩比较基准：中国债券综合全价指数收益率

### 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



泓德裕泰债券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  
(2015年12月17日-2021年06月30日)



泓德裕泰债券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  
(2015年12月17日-2021年06月30日)



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

#### § 4 管理人报告

## 4.1 基金管理人及基金经理情况

### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至2021年6月30日，公司总资产管理规模为1398.04亿元，其中公募基金管理规模1153.88亿元，专户产品管理规模为244.16亿元。2021年上半年，公司新发行3只公募基金产品，均为混合型基金产品。自成立起至2021年6月30日，公司累计发行34只公募基金产品：其中混合型基金22只，具体包括泓德优选成长混合、泓德泓富混合、泓德远见回报混合、泓德泓业混合、泓德泓益量化混合、泓德泓信混合、泓德泓汇混合、泓德泓华混合、泓德优势领航混合、泓德致远混合、泓德臻远回报混合、泓德三年封闭丰泽混合、泓德研究优选混合、泓德量化精选混合、泓德丰润三年持有期混合、泓德睿泽混合、泓德睿享一年持有期混合、泓德瑞兴三年持有期混合、泓德卓远混合、泓德优质治理混合、泓德睿源三年持有期混合、泓德瑞嘉三年持有期混合；股票型基金1只，具体为泓德战略转型股票；债券型基金9只，具体包括泓德裕泰债券、泓德裕康债券、泓德裕荣纯债、泓德裕和纯债、泓德裕祥债券、泓德裕泽一年定开债券、泓德裕鑫一年定开债券、泓德裕丰中短债、泓德裕瑞三年定开债券；货币基金2只，具体为泓德泓利货币、泓德添利货币。同时，公司管理多只特定客户资产管理计划。

### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李倩	无	2015-12-29	2021-06-18	9年	硕士研究生，具有基金从业资格，资管行业从业经验12年，曾任中国农业银行股份有限公司金融市场部、资产管理部理财组合

					投资经理，中信建投证券股份有限公司资产管理部债券交易员、债券投资经理助理。
赵端端	泓德裕荣纯债债券、泓德裕鑫一年定开债券、泓德裕泽一年定开债券、泓德裕祥债券、泓德睿享一年持有期混合、泓德泓富混合、泓德裕泰债券基金经理	2021-06-18	-	7年	硕士研究生，具有基金从业资格，资管行业从业经验15年，曾任天安财产保险股份有限公司资产管理中心固定收益部资深投资经理，阳光资产管理股份有限公司固定收益投资事业部高级投资经理，嘉实基金管理有限公司机构业务部产品经理。

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021年上半年，利率走势整体先升后降。年初由于自去年11月份起央行实行的偏宽松政策使得十年国债收益率保持了3.1%左右的低位震荡。1月中旬至1月底，资金面超预期收紧，为13年“钱荒”以后的最紧状态，市场对货币政策的预期转向从紧，债市情绪转向。步入2月，跨月后流动性虽好转，但市场心有余悸，股市、商品和美债收益率齐涨，进一步加强了市场收益率上行的预期，长端利率开始调整，1个月时间十年国债收益率上行近20bp。3-5月份，央行进入佛系维持状态，资金面整体宽松偶有波动，通胀担忧四起叠加经济回弹，另外迟迟未到的利率债供给以及信用风险扰动市场，使得市场结构性的资金配置压力和谨慎情绪之间的矛盾一直存在，利率在纠结震荡中下行。6月，股市走强带动风险偏好上移，地方债供给压力逐步抬升，收益率缺乏进一步下行的动力，但又有央妈表态流动性充裕等因素，维稳诉求下加大月末逆回购投放量等因素使得利率上行同样乏力，利率整体处于震荡状态。与此同时，信用品种总体仍跟随利率品种运行，收益率整体下行。信用风险事件下，结构性的冲击局部市场，但整体来看信用利差压缩，中低等级压缩幅度更大，反映出结构性资产荒背景下，市场适度信用下沉以获取较高票息。

本产品成立于2015年12月17日，在报告期本产品合理控制组合久期，基于国内信用债市场的迅速发展与扩容，控制不同等级信用债券的持仓比例，通过分散化的投资策略平衡风险和收益，实现组合资产的增值。本基金的下阶段投资策略将精选信用债品种，在投资方向上以中高等级信用债为主，对主体信用风险进行研究、评价、跟踪和分析，在充分甄别信用风险的前提下分散投资，保证投资组合能够在具有较好流动性的基础上，为基金获得收益。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末泓德裕泰债券A基金份额净值为1.1898元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为2.17%，同期业绩比较基准收益率为0.65%；截至报告期末泓德裕泰债券C基金份额净值为1.1604元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为2.00%，同期业绩比较基准收益率为0.65%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从基本面、政策面以及情绪面出发，经济似乎已经出现增长趋缓迹象，也难以出现2月份那样资金收紧以及股、商品和美债利率齐涨等利空因素同时出现的场景，但是经济韧性仍在，下半年需关注出口、广义需求、制造业投资的韧性。上半年虽然紧信用，但紧信用力度相对中性，考虑到经济仍有上行动能的情况下，并不宜对经济过度悲观。

通胀关注中上游向下游的传导，关注非食品及核心CPI。上半年政策阶段性转向紧信用，定调经济处于合意区间，财政支出力度、基建投资增速、政府债发行规模等均低于预期，且对地产及平台债务、违规融资及影子银行风险等更为关注。目前信用风险恐慌虽然边际缓解，但是融资分层仍在持续，市场对于弱区域和信用风险回避倾向仍存。在结构性资产荒背景下，资金的一致性可能会使得信用风险可控品种利差维持低位，而受信用风险影响的部分板块信用利差可能会进一步走扩，考验投资者择券能力和信用风险识别及判断能力。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及本基金合同约定，本基金管理人严格按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持投资品种进行估值。本基金管理人制订了证券投资基金估值政策与估值程序，设立基金估值小组，参考行业协会估值意见和独立第三方机构估值数据，确保基金估值的公平、合理。

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

基金经理参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

本基金截至2021年06月30日，期末可供分配利润为467,404,475.14元，其中：泓德裕泰债券A期末可供分配利润为462,873,439.16元（泓德裕泰债券A的未分配利润已实现部分为864,455,079.72元，未分配利润未实现部分为-401,581,640.56元），泓德裕泰

债券C期末可供分配利润为4,531,035.98元（泓德裕泰债券C的未分配利润已实现部分为9,078,157.79元，未分配利润未实现部分为-4,547,121.81元）。

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

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

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对泓德裕泰债券型证券投资基金的托管过程中，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，泓德裕泰债券型证券投资基金的管理人—泓德基金管理有限公司在泓德裕泰债券型证券投资基金的投资运作、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，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

#### 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泓德裕泰债券型证券投资基金2021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 中期财务会计报告(未经审计)

#### 6.1 资产负债表

会计主体：泓德裕泰债券型证券投资基金

报告截止日：2021年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	265,225.45	307,073.46
结算备付金		1,113,828.73	27,801,637.21
存出保证金		3,885.81	16,940.51
交易性金融资产	6.4.7.2	2,832,771,983.50	3,253,163,231.79

其中：股票投资		39,217,910.64	35,008,948.51
基金投资		-	-
债券投资		2,662,943,072.86	3,086,776,283.28
资产支持证券投资		130,611,000.00	131,378,000.00
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		4,978,371.01	32,499.76
应收利息	6.4.7.5	107,432,753.25	139,316,576.04
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,946,566,047.75	3,420,637,958.77
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年06月30日</b>	<b>上年度末 2020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		5,900,000.00	271,889,860.90
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		5,017,074.21	121,802.45
应付管理人报酬		968,008.09	1,063,439.06
应付托管费		314,602.63	345,617.71
应付销售服务费		9,508.65	13,185.12
应付交易费用	6.4.7.7	31,301.34	3,259.49
应交税费		296,089.45	597,510.77
应付利息		-	-47,660.76
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	104,634.29	218,000.00
负债合计		12,641,218.66	274,205,014.74
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	2,466,520,353.95	2,702,783,639.04
未分配利润	6.4.7.10	467,404,475.14	443,649,304.99
所有者权益合计		2,933,924,829.09	3,146,432,944.03
负债和所有者权益总计		2,946,566,047.75	3,420,637,958.77

注：报告截止日2021年06月30日，基金份额总额2,466,520,353.95份，其中A类基金份额总额为2,438,277,261.38份，基金份额净值为1.1898元；C类基金份额总额为28,243,092.57份，基金份额净值为1.1604元。

## 6.2 利润表

会计主体：泓德裕泰债券型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年01月01日至 2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至202 0年06月30日
<b>一、收入</b>		72,123,001.10	135,609,612.55
1. 利息收入		75,936,279.58	118,862,456.39
其中：存款利息收入	6.4.7.11	57,998.82	237,844.80
债券利息收入		71,856,312.33	114,499,638.09
资产支持证券利息收入		3,753,173.97	3,633,543.27
买入返售金融资产收入		268,794.46	491,430.23
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		84,222,617.15	100,824,422.66
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-2,014,302.89	-



基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13.1	86,236,920.04	100,824,422.66
资产支持证券投资 收益	6.4.7.13.2	0.00	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	-	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.16	-88,036,552.24	-84,368,931.24
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.17	656.61	291,664.74
<b>减：二、费用</b>		8,817,565.08	13,503,236.50
1. 管理人报酬		5,943,253.10	7,587,842.65
2. 托管费		1,931,557.30	2,466,048.89
3. 销售服务费		60,726.80	200,712.26
4. 交易费用	6.4.7.18	57,769.30	14,070.19
5. 利息支出		415,335.90	2,684,479.54
其中：卖出回购金融资产 支出		415,335.90	2,684,479.54
6. 税金及附加		278,242.97	408,739.08
7. 其他费用	6.4.7.19	130,679.71	141,343.89
<b>三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）</b>		63,305,436.02	122,106,376.05
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-” 号填列）</b>		63,305,436.02	122,106,376.05

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泓德裕泰债券型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	2,702,783,639.04	443,649,304.99	3,146,432,944.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	63,305,436.02	63,305,436.02
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-236,263,285.09	-39,550,265.87	-275,813,550.96
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-236,263,285.09	-39,550,265.87	-275,813,550.96
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	2,466,520,353.95	467,404,475.14	2,933,924,829.09
项目	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	2,908,533,232.92	543,435,071.65	3,451,968,304.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	122,106,376.05	122,106,376.05
三、本期基金份额交	240,022,115.09	48,411,583.36	288,433,698.45

易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)			
其中: 1. 基金申购款	1,024,980,050.43	215,266,553.08	1,240,246,603.51
2. 基金赎回款	-784,957,935.34	-166,854,969.72	-951,812,905.06
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	3,148,555,348.01	713,953,031.06	3,862,508,379.07

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

王德晓

王德晓

李娇

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

泓德裕泰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[2015]2575号《关于准予泓德裕泰债券型证券投资基金注册的批复》核准,由泓德基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《泓德裕泰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206,406,244.58元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第1419号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泓德裕泰债券型证券投资基金基金合同》于2015年12月17日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为206,414,184.84份,其中认购资金利息折合7,940.26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《泓德裕泰债券型证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购费、申购费和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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泓德裕泰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。本基金的投资组合中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。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泓德裕泰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2021年1月1日至2021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2021年6月30日的财务状况以及2021年1月1日至2021年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[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 and 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。

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

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
----	--------------------

活期存款	265,225.45
定期存款	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
合计	265,225.45

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	36,270,360.18	39,217,910.64	2,947,550.46	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	1,083,053,858.29	702,557,622.40	-380,496,235.89
	银行间市场	2,072,069,023.96	1,960,385,450.46	-111,683,573.50
	合计	3,155,122,882.25	2,662,943,072.86	-492,179,809.39
资产支持证券	128,934,000.00	130,611,000.00	1,677,000.00	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	3,320,327,242.43	2,832,771,983.50	-487,555,258.93	

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应收活期存款利息	612.59
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	450.45
应收债券利息	104,769,643.14
应收资产支持证券利息	2,662,045.54
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	1.53
合计	107,432,753.25

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
交易所市场应付交易费用	23,668.26
银行间市场应付交易费用	7,633.08
合计	31,301.34

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30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	-
预提费用	104,634.29
合计	104,634.29

#### 6.4.7.9 实收基金

##### 6.4.7.9.1 泓德裕泰债券A

金额单位：人民币元

项目 (泓德裕泰债券A)	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	2,664,061,242.13	2,664,061,242.13
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-225,783,980.75	-225,783,980.75
本期末	2,438,277,261.38	2,438,277,261.38

##### 6.4.7.9.2 泓德裕泰债券C

金额单位：人民币元

项目 (泓德裕泰债券C)	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	38,722,396.91	38,722,396.91
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-10,479,304.34	-10,479,304.34
本期末	28,243,092.57	28,243,092.57

注：赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

##### 6.4.7.10.1 泓德裕泰债券A

单位：人民币元

项目 (泓德裕泰债券A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计



上年度末	788,695,819.07	-350,378,152.27	438,317,666.80
本期利润	149,590,700.94	-86,950,528.36	62,640,172.58
本期基金份额交易产生的变动数	-73,831,440.29	35,747,040.07	-38,084,400.22
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-73,831,440.29	35,747,040.07	-38,084,400.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	864,455,079.72	-401,581,640.56	462,873,439.16

## 6.4.7.10.2 泓德裕泰债券C

单位：人民币元

项目 (泓德裕泰债券C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	10,310,861.23	-4,979,223.04	5,331,638.19
本期利润	1,751,287.32	-1,086,023.88	665,263.44
本期基金份额交易产生的变动数	-2,983,990.76	1,518,125.11	-1,465,865.65
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-2,983,990.76	1,518,125.11	-1,465,865.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,078,157.79	-4,547,121.81	4,531,035.98

## 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
活期存款利息收入	7,757.95
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	50,177.78
其他	63.09
合计	57,998.82

## 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
卖出股票成交总额	25,971,134.26
减：卖出股票成本总额	27,985,437.15
买卖股票差价收入	-2,014,302.89

## 6.4.7.13 债券投资收益

## 6.4.7.13.1 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,549,302,683.20
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,416,200,692.91
减：应收利息总额	46,865,070.25
买卖债券差价收入	86,236,920.04

## 6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
卖出资产支持证券成交总额	3,610,266.54
减：卖出资产支持证券成本总额	429,000.00
减：应收利息总额	3,181,266.54
资产支持证券投资收益	0.00

**6.4.7.14 衍生工具收益**

本基金本报告期内无衍生工具收益。

**6.4.7.15 股利收益**

本基金本报告期内无股利收益。

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
1. 交易性金融资产	-88,036,552.24
——股票投资	3,329,639.93
——债券投资	-91,028,192.17
——资产支持证券投资	-338,000.00
——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	-88,036,552.24

**6.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
基金赎回费收入	656.61
合计	656.61

注：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。

**6.4.7.18 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期

	2021年01月01日至2021年06月30日
交易所市场交易费用	52,280.80
银行间市场交易费用	5,488.50
合计	57,769.30

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
审计费用	45,126.92
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	11,945.42
账户维护费	13,500.00
其他	600.00
合计	130,679.71

#### 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
王德晓	基金管理人股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,943,253.10	7,587,842.65
其中：支付销售机构的客户维护费	20,176.46	63,891.45

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0.40%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×0.40%/当年天数。

###### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,931,557.30	2,466,048.89

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 2021年01月01日至2021年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泓德裕泰债券A	泓德裕泰债券C	合计
泓德基金	0.00	26,093.41	26,093.41
合计	0.00	26,093.41	26,093.41
获得销售	上年度可比期间		

服务费的各关联方名称	2020年01月01日至2020年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泓德裕泰债券A	泓德裕泰债券C	合计
泓德基金	0.00	119,541.46	119,541.46
合计	0.00	119,541.46	119,541.46

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

泓德裕泰债券A

份额单位：份

项目	本期 2021年01月01日至 2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至 2020年06月30日
报告期初持有的基金份额	47,542,886.76	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	47,542,886.76	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.93%	0.00%

泓德裕泰债券C

份额单位：份

项目	本期 2021年01月01日至 2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至 2020年06月30日
报告期初持有的基金份额	0.00	0.00

报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%

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

份额单位：份

泓德裕泰债券C

关联方名称	本期末 2021年06月30日		上年度末 2020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
王德晓	1,000.05	0.00%	1,000.05	0.00%

注：本报告期末王德晓持有本基金份额占总份额的比例为0.00004%（2020年12月31日：同）。

#### 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 2021年01月01日至2021年06月30日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020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	265,225.45	7,757.95	371,772.05	31,364.25

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（2021年06月30日）本基金持有的流通受限证券

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600157	永泰能源	2020-12-29	2021-09-29	债转股锁定	1.26	1.37	4,776,118	6,017,908.68	6,543,281.66	-
600157	永泰能源	2020-12-29	2021-12-29	债转股锁定	1.24	1.35	4,776,118	5,922,386.32	6,447,759.30	-
600157	永泰能源	2020-12-29	2022-03-29	债转股锁定	1.23	1.33	4,776,118	5,874,625.14	6,352,236.94	-
600157	永泰能源	2020-12-29	2022-06-29	债转股锁定	1.22	1.31	4,776,118	5,826,863.96	6,256,714.58	-
600157	永泰能源	2020-12-29	2022-09-29	债转股锁定	1.20	1.30	4,776,120	5,731,344.00	6,208,956.00	-
600157	永泰能源	2021-03-02	2021-09-29	债转股锁定	1.26	1.37	1,112,456	1,401,694.56	1,524,064.72	-
600157	永泰能源	2021-03-02	2021-12-29	债转股锁定	1.25	1.35	1,112,456	1,390,570.00	1,501,815.60	-
600157	永泰能源	2021-03-02	2022-03-29	债转股锁定	1.24	1.33	1,112,456	1,379,445.44	1,479,566.48	-
600157	永泰能源	2021-03-02	2022-06-29	债转股锁定	1.23	1.31	1,112,456	1,368,320.88	1,457,317.36	-
600157	永泰能源	2021-03-02	2022-06-29	债转股	1.22	1.30	1,112,456	1,358,320.88	1,447,317.36	-



57	能源	-03-02	-09-29	股锁 定			460	7, 20 1. 20	6, 19 8. 00	
----	----	--------	--------	---------	--	--	-----	----------------	----------------	--

注：根据永泰能源股份有限公司（以下简称“永泰能源”）于2020年12月16日发布的《永泰能源股份有限公司重整计划》，作为永泰能源所发行债券的债券持有人，本基金所持有的部分永泰能源债权获永泰能源资本公积金转增股票以股抵债，本基金自本次受让转增股票之日起六个月内不减持其所持有的本次转增的永泰能源股票；自受让转增股票之日起六个月后每个季度减持其所持有的本次转增的永泰能源股票的比例不超过六分之一（每个季度可减持但未减持的本次转增的股票，可累计至以后任意季度减持）。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限证券

于2021年06月30日，本基金持有的流通受限的债券期末估值总额（含应收利息）为371,220,266.46元。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2021年06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5,900,000.000元，于2021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

信用风险是指基金所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下降，或者债券回购交易到期时交易对手方不能履行付款或结算义务等，造成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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
A-1	20,058,000.00	19,888,000.00
A-1以下	1,695,000.00	1,695,000.00
未评级	603,793,000.00	9,454,000.00
合计	625,546,000.00	31,037,000.00

注：于2021年06月30日，未评级部分为超短期融资券(2020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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
A-1	-	-

A-1以下	-	-
未评级	-	29,521,000.00
合计	-	29,521,000.00

#### 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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	830,197,917.60	751,493,164.52
AAA以下	1,036,570,155.26	2,104,011,118.76
未评级	170,629,000.00	170,714,000.00
合计	2,037,397,072.86	3,026,218,283.28

注：于2021年06月30日，未评级部分为政策性金融债（2020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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	130,611,000.00	131,378,000.00
AAA以下	-	-
未评级	-	-
合计	130,611,000.00	131,378,000.00

#### 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(所有者权益)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。于本报告期期末，本基金持有流通受限的股票、资产支持证券和因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等流动性受限资产，其市值合计为基金资产净值的17.86%。

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 2021年 06月30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	265,225.45	-	-	-	265,225.45
结算备付金	1,112,328.73	-	-	1,500.00	1,113,828.73
存出保证金	3,885.81	-	-	-	3,885.81
交易性金融资产	1,746,794,543.20	661,843,066.20	130,611,000.00	293,523,374.10	2,832,771,983.50
应收证券清算款	-	-	-	4,978,371.01	4,978,371.01
应收利息	-	-	-	107,432,753.25	107,432,753.25
资产总计	1,748,175,983.19	661,843,066.20	130,611,000.00	405,935,998.36	2,946,566,047.75
负债					
卖出回	5,900,000.00	-	-	-	5,900,000.00

购金融资产款					
应付赎回款	-	-	-	5,017,074.21	5,017,074.21
应付管理人报酬	-	-	-	968,008.09	968,008.09
应付托管费	-	-	-	314,602.63	314,602.63
应付销售服务费	-	-	-	9,508.65	9,508.65
应付交易费用	-	-	-	31,301.34	31,301.34
应交税费	-	-	-	296,089.45	296,089.45
其他负债	-	-	-	104,634.29	104,634.29
负债总计	5,900,000.00	-	-	6,741,218.66	12,641,218.66
利率敏感度缺口	1,742,275,983.19	661,843,066.20	130,611,000.00	399,194,779.70	2,933,924,829.09
上年度末 2020年 12月31 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	307,073.46	-	-	-	307,073.46
结算备付金	27,800,137.21	-	-	1,500.00	27,801,637.21
存出保证金	16,940.51	-	-	-	16,940.51
交易性金融资产	1,972,547,095.22	891,087,967.80	133,073,000.00	256,455,168.77	3,253,163,231.79
应收证券清算款	-	-	-	32,499.76	32,499.76
应收利息	-	-	-	139,316,576.04	139,316,576.04
资产总计	2,000,671,246.	891,087,967.8	133,073,000.0	395,805,744.5	3,420,637,958.

	40	0	0	7	77
负债					
卖出回购金融资产款	271,889,860.90	-	-	-	271,889,860.90
应付赎回款	-	-	-	121,802.45	121,802.45
应付管理人报酬	-	-	-	1,063,439.06	1,063,439.06
应付托管费	-	-	-	345,617.71	345,617.71
应付销售服务费	-	-	-	13,185.12	13,185.12
应付交易费用	-	-	-	3,259.49	3,259.49
应交税费	-	-	-	597,510.77	597,510.77
应付利息	-	-	-	-47,660.76	-47,660.76
其他负债	-	-	-	218,000.00	218,000.00
负债总计	271,889,860.90	-	-	2,315,153.84	274,205,014.74
利率敏感度缺口	1,728,781,385.50	891,087,967.80	133,073,000.00	393,490,590.73	3,146,432,944.03

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
	市场利率下降25个基点	4,256,741.48	7,013,225.50
	市场利率上升25个基点	-4,233,192.44	-6,964,253.86

#### 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或债券，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 2021年06月30日		上年度末 2020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	39,217,910.64	1.34	35,008,948.51	1.11
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	39,217,910.64	1.34	35,008,948.51	1.11
----	---------------	------	---------------	------

#### 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1.34%（上年度末：1.11%），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 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于2021年06月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为2,478,647,935.74元，属于第三层次的余额为354,124,047.76元，无属于第一层次的余额（2020年12月31日：第二层次2,891,502,375.43元，第三层次361,660,856.36元，无第一层次）。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

于2021年06月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中归属于第三层次的余额为354,124,047.76元。2021上半年度，本基金结算第三层次的金额为-38,905,602.74元，转入第三层次的金额为18,165,014.10元，无购买、出售、转出第三层次的金额，计入损益的利得为13,203,780.04元。本基金于2021年06月30日仍持有的第三层次的金融资产，从年初起算计入2021上半年度公允价值变动损益的金额为-39,859,591.82元。（于2020年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中归属于第三层次的余额为361,660,856.36元。2020年度，本基

金结算第三层次的金额为-37,691,037.98元，转入第三层次的金额为208,624,961.80元，无购买、出售、转出第三层次的金额，计入损益的利得为-45,117,682.12元。本基金于2020年12月31日仍持有的第三层次的金融资产，从年初起算计入2020年度公允价值变动损益的金额为-274,268,431.39元。)

于2021年06月30日，使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的债券投资公允价值为354,124,047.76元。其中，对于使用的估值技术为清算价格法的债券投资，不可观察输入值为净资产回收率，其取值范围为0-1，不可观察输入值与公允价值之间的关系为正相关；对于使用的估值技术为现金流贴现法的债券投资，不可观察输入值为折现率，其取值范围为26%-28%，不可观察输入值与公允价值之间的关系为负相关。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2021年06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(2020年12月31日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	39,217,910.64	1.33
	其中：股票	39,217,910.64	1.33
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,793,554,072.86	94.81
	其中：债券	2,662,943,072.86	90.37
	资产支持证券	130,611,000.00	4.43
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	1,379,054.18	0.05
8	其他各项资产	112,415,010.07	3.82
9	合计	2,946,566,047.75	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	39,217,910.64	1.34
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	39,217,910.64	1.34

## 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	600157	永泰能源	29,442,876	39,217,910.64	1.34

#### 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	603555	ST贵人	20,521,333.25	0.65
2	600157	永泰能源	8,343,426.10	0.27

注：本基金本报告期内仅买入两只股票。

##### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	603555	ST贵人	17,434,614.82	0.55
2	600157	永泰能源	8,536,519.44	0.27

注：本基金本报告期内仅卖出两只股票。

##### 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	28,864,759.35
卖出股票收入（成交）总额	25,971,134.26

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	170,629,000.00	5.82
	其中：政策性金融债	170,629,000.00	5.82

4	企业债券	757,414,622.40	25.82
5	企业短期融资券	625,546,000.00	21.32
6	中期票据	1,109,353,450.46	37.81
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,662,943,072.86	90.76

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	190202	19国开02	1,700,000	170,629,000.00	5.82
2	101900868	19陕延油MTN005	1,300,000	131,820,000.00	4.49
3	012100902	21华侨城SCP001	1,000,000	100,300,000.00	3.42
4	012100867	21陕交建SCP003	1,000,000	100,200,000.00	3.42
5	143218	17清控01	1,415,310	96,750,591.60	3.30

### 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	159463	19万达优	1,300,000	130,611,000.00	4.45

### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

**7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金本报告期末未投资股指期货。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****7.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末未投资国债期货。

**7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未投资国债期货。

**7.11.3 本期国债期货投资评价**

本基金本报告期末未投资国债期货。

**7.12 投资组合报告附注**

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

7.12.2 基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

**7.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,885.81
2	应收证券清算款	4,978,371.01
3	应收股利	-
4	应收利息	107,432,753.25
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	112,415,010.07

**7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

**7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

金额单位：人民币元

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

				例 (%)	
1	600157	永泰能源	39,217,910.64	1.34	债转股锁定

### 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
泓德裕泰债券A	411	5,932,548.08	2,437,331,761.75	99.96%	945,499.63	0.04%
泓德裕泰债券C	5,056	5,586.05	12,388,497.55	43.86%	15,854,595.02	56.14%
合计	5,457	451,992.00	2,449,720,259.30	99.32%	16,800,094.65	0.68%

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	泓德裕泰债券A	0.00	0.0000%
	泓德裕泰债券C	6,110.45	0.0216%
	合计	6,110.45	0.0002%

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	泓德裕泰债券A	0
	泓德裕泰债券C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	泓德裕泰债券A	0
	泓德裕泰债券C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	泓德裕泰债券A	泓德裕泰债券C
基金合同生效日(2015年12月17日)基金份额总额	206,011,835.39	402,349.45
本报告期期初基金份额总额	2,664,061,242.13	38,722,396.91
本报告期基金总申购份额	-	-
减：本报告期基金总赎回份额	225,783,980.75	10,479,304.34
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	2,438,277,261.38	28,243,092.57

注：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

中国工商银行股份有限公司根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。



### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

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

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信建投证券	4	25,971,134.26	100.00%	23,668.26	100.00%	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-

东北 证券	2	-	-	-	-	-
光大 证券	2	-	-	-	-	-
国金 证券	2	-	-	-	-	-
国盛 证券	2	-	-	-	-	-
国信 证券	2	-	-	-	-	-
华安 证券	2	-	-	-	-	-
华泰 证券	2	-	-	-	-	-
华西 证券	2	-	-	-	-	-
民生 证券	2	-	-	-	-	-
平安 证券	2	-	-	-	-	-
申万 宏源 证券	2	-	-	-	-	-
太平 洋证 券	2	-	-	-	-	-
西藏 东方 财富 证券	2	-	-	-	-	-
信达 证券	2	-	-	-	-	-
招商	2	-	-	-	-	-

证券						
中国 中金 财富 证券	2	-	-	-	-	-
中泰 证券	2	-	-	-	-	-
首创 证券	1	-	-	-	-	-
安信 证券	4	-	-	-	-	-

注：1、本公司选择证券经营机构的标准

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

(2) 资质雄厚，信誉良好。

(3) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。

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

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

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

2、本公司租用券商交易单元的程序

(1) 研究机构提出服务意向，并提供相关研究报告；

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

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

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

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

(6) 交易单元租用协议期限为一年，到期后若双方没有异议可自动延期一年。

3、本基金租用证券公司交易单元均为共用交易单元。

4、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

(1) 本基金报告期内新增租用交易单元：安信证券、华安证券、招商证券

(2) 本基金报告期内停止租用交易单元：无

## 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例	成交金额	占当期 债券回 购成交 总额的 比例	成交金 额	占当期 权证成 交总额 的比例	成交金 额	占当期 基金成 交总额 的比例
中信建投证 券	67,864,7 37.50	100.0 0%	3,144,000, 000.00	100.0 0%	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西藏东方财 富证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中国中金财 富证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-

首创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	泓德基金管理有限公司关于基金经理因休产假暂停履行职务的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-21
2	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加侧袋机制并相应修改法律文件的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-30
3	泓德基金管理有限公司关于泓德裕泰债券型证券投资基金变更基金经理的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2021-06-19

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期间无单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准泓德裕泰债券型证券投资基金设立的文件；
- 2、《泓德裕泰债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《泓德裕泰债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《泓德裕泰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指定报刊上披露的各项公告。

### 12.2 存放地点

地点为管理人地址：北京市西城区德胜门外大街125号

### 12.3 查阅方式

- 1、投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件

2、投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人泓德基金管理有限公司，客户服务电话：4009-100-888

3、投资者可访问本基金管理人公司网站，网址：[www.hongdefund.com](http://www.hongdefund.com)

泓德基金管理有限公司  
二〇二一年八月二十五日