

# 泓德裕祥债券型证券投资基金

## 2024 年中期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人:泓德基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

送出日期:2024 年 08 月 29 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2024年1月1日起至2024年6月30日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	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	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
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	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	57
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	58
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	58
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	58
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	58
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	59
7.12 投资组合报告附注	59
§8 基金份额持有人信息	61
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	61

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	62
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	62
§9 开放式基金份额变动 .....	62
§10 重大事件揭示 .....	63
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	63
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 .....	63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	63
10.4 基金投资策略的改变 .....	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	63
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	63
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	64
10.8 其他重大事件 .....	67
§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....	67
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	67
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	68
§12 备查文件目录 .....	68
12.1 备查文件目录 .....	68
12.2 存放地点 .....	68
12.3 查阅方式 .....	68

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	泓德裕祥债券型证券投资基金	
基金简称	泓德裕祥债券	
基金主代码	002742	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年01月13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	582,029,557.62份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	泓德裕祥债券A	泓德裕祥债券C
下属分级基金的交易代码	002742	002743
报告期末下属分级基金的份额总额	573,227,706.60份	8,801,851.02份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将在严格控制风险与保持资产流动性的基础上，力争为投资人获取超越业绩比较基准的投资回报。
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。本基金通过对国内外宏观经济状况、市场利率走势、市场资金供求情况，以及证券市场走势、信用风险情况、风险预算和有关法律法规等因素的综合分析，预测各类资产在长、中、短期收益率的变化情况，进而在各大类资产之间进行动态配置，确定资产的最优配置比例和相应的风险水平。固定收益投资将采取久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、个券选择策略等。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动

	性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。
业绩比较基准	中国债券综合全价指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为债券型基金，属证券投资基金中的较低风险品种，预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		泓德基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李晓春	郭明
	联系电话	010-59850177	010-66105799
	电子邮箱	lixiaochun@hongdefund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4009-100-888	95588
传真		010-59850195	010-66105798
注册地址		西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦1206室	北京市西城区复兴门内大街5号
办公地址		北京市西城区德胜门外大街125号	北京市西城区复兴门内大街5号
邮政编码		100088	100140
法定代表人		王德晓	廖林

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《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 (2024年01月01日-2024年06月30日)	
	泓德裕祥债券A	泓德裕祥债券C
本期已实现收益	-71,245,710.94	-1,042,413.28
本期利润	-26,696,555.64	-443,770.63
加权平均基金份额本期利润	-0.0416	-0.0469
本期加权平均净值利润率	-3.51%	-4.05%
本期基金份额净值增长率	-3.12%	-3.28%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2024年06月30日)	
期末可供分配利润	37,294,966.90	313,477.43
期末可供分配基金份额利润	0.0651	0.0356
期末基金资产净值	677,443,064.04	10,129,151.63
期末基金份额净值	1.1818	1.1508
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2024年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	37.83%	34.11%

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

## 泓德裕祥债券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	-2.09%	0.40%	0.25%	0.05%	-2.34%	0.35%
过去三个月	-0.40%	0.38%	0.75%	0.07%	-1.15%	0.31%
过去六个月	-3.12%	0.51%	2.31%	0.09%	-5.43%	0.42%
过去一年	-5.22%	0.42%	1.96%	0.09%	-7.18%	0.33%
过去三年	-7.31%	0.42%	2.00%	0.11%	-9.31%	0.31%
自基金合同 生效起至今	37.83%	0.38%	10.68%	0.12%	27.15%	0.26%

## 泓德裕祥债券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	-2.12%	0.39%	0.25%	0.05%	-2.37%	0.34%
过去三个月	-0.48%	0.38%	0.75%	0.07%	-1.23%	0.31%
过去六个月	-3.28%	0.51%	2.31%	0.09%	-5.59%	0.42%
过去一年	-5.56%	0.42%	1.96%	0.09%	-7.52%	0.33%
过去三年	-8.29%	0.42%	2.00%	0.11%	-10.29%	0.31%
自基金合同 生效起至今	34.11%	0.38%	10.68%	0.12%	23.43%	0.26%

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

本基金的业绩比较基准为：中国债券综合全价指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10%

基准指数的构建原则如下：

(1) 中国债券综合全价指数是由中债金融估值中心有限公司编制，样本债券涵盖的范围全面，具有广泛的市场代表性，涵盖主要交易市场（银行间市场、交易所市场等）、不同发行主体（政府、企业等）和期限（长期、中期、短期等），能够很好地反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势。中国债券综合全价指数各项指标值的时间序列更加完整，有利于更加深入地研究和分析市场。在综合考虑了指数的权威性和代表性、指数



的编制方法和本基金的投资范围和投资理念，本基金选择市场认同度较高的中国债券综合全价指数收益率作为债券投资部分的业绩比较基准。

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

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

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



泓德裕祥债券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  
(2017年01月13日-2024年06月30日)



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

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

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

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基	证券	说明
----	----	--------	----	----

		金经理（助理） 期限		从业 年限	
		任职 日期	离任 日期		
赵端端	本基金的基金经理	2019-01-15	-	10年	硕士研究生，具有基金从业资格，资管行业从业经验18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。
姚学康	本基金的基金经理	2021-12-31	-	10年	硕士研究生，具有基金从业资格，资管行业从业经验13年，曾任华夏久盈资产管理有限责任公司固定收益投资中心投资经理，安信证券研究中心宏观分析师。

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

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024年上半年，中国债市经历了整体收益率的大幅下行行情，资金环境改善与资产荒加剧是核心推动因素。期间受到降息预期变动、政府债券供给、地产政策、央行不断提示长债风险等多重因素的影响，小有波动，但不改收益率下行的大方向，利率不断创出历史新低。由于城投和地产两大主要融资部门同时出现收缩，债市经历的本轮资产荒程度比以往更为剧烈。市场缺乏高收益资产，权益类资产表现相对低迷，大量资金涌入债市避险，使得各类机构都大幅增加对债券类资产的配置。收益率低位水平下市场对于票息挖掘的诉求进一步抬升，在资金的追逐下利率绝对水平、期限利差、信用利差均压缩至历史低位。

权益市场方面，2024年上半年权益市场呈现先深V反弹，后震荡下行的走势。一月份权益市场延续2023年底的偏弱运行，市场经历了深度调整，小微盘在流动性踩踏下回撤幅度巨大；二月初开始，经济数据环比改善以及监管托底和国家队入场支持的预期逐步强化，在政策面的配合下股市表现出强劲修复。3月中开始，市场对年报预期偏弱，对于退市存在担忧，市场转为震荡回调。4月底政治局会议表述积极变化等因素提振股市，但随后弱现实下上涨未能持续，市场整体又有所下行。整个上半年，大小盘风格分化剧烈，上证50涨2.95%，沪深300涨0.89%，中证500下跌8.96%，中证1000下跌16.84%，中证2000下跌23.28%。

转债方面，2024年上半年，转债市场一波三折，虽然整体跑赢主要股指，但波动剧烈，呈现超跌后V型反弹，又再次回调的走势。开年至二月初，转债市场随权益市场深度回调，中证转债指数跌至2022年以来低点；后在正股行情修复以及流动性宽松带动资金回归的支撑下上涨；5月底，正股开始回调叠加信用评级风波，低价转债显著走弱。整

个转债市场呈现出明显的分层化走势。从整个上半年来看，中证转债指数跌0.07%，Wind可转债等权指数跌5.21%。

本产品成立于2017年1月13日，报告期内，本产品根据组合负债现金流的情况动态调整持仓结构。权益方面，结合宏观环境、产业趋势、行业景气度、个股财务情况、盈利能力、估值水平等，筛选出具备投资价值的股票，并在股票风格上择机进行选择，引入了量化多因子模型和人工智能选股模型等定量分析方法。可转债方面，风格上有选择地与股票组合的风格变动形成一定互补，并不断通过动态的持仓调整进行优化，兼顾组合的稳健性与进攻性。纯债方面，着眼于票息、久期及组合整体的流动性安排进行配置及交易，力争持续为组合贡献收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末泓德裕祥债券A基金份额净值为1.1818元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-3.12%，同期业绩比较基准收益率为2.31%；截至报告期末泓德裕祥债券C基金份额净值为1.1508元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-3.28%，同期业绩比较基准收益率为2.31%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2024年下半年，世界主要经济体货币政策将有所分化，美联储降息预期升温，欧洲央行开启降息周期，日本加息。此外，美国大选、地缘政治冲突等问题将会给全球经济带来不确定性。国内方面，经济总量数据平稳，经济内生动能或仍偏弱，在生产端好于需求端、外需好于内需的环境中，稳增长存在诉求，总量政策仍存在较大发力的可能，财政和货币政策或较上半年更为积极。

债市方面，在基本面偏弱的大环境下，资金面预计仍整体保持宽裕，市场较低的风险偏好或将延续，货币政策走在总量宽松支持实体经济的大方向上，债市不具备大幅调整的基础。然而随着整体收益率迭创新低，理财规模变动、供给冲击、政策扰动等也需关注，预计市场波动会有所加大，但调整空间有限。

权益市场方面，目前仍处于调整筑底阶段，但经历了长期的出清，市场也将在经济动能转换的高质量发展中逐步走出新趋势。随着资本市场生态的重塑，以及稳增长促改革的不断推进，2024年下半年A股市场有望视政策起效与上市公司盈利质量改善的进程迎来新行情的起点。

转债方面，年中以来转债市场的定价逻辑发生了显著变化。新“国九条”之后，转债市场的信用冲击逻辑发生了深刻变化，转债市场分层或将持续。但随着债市收益率进入历史新低阶段，资产荒背景下，转债的需求仍有支撑，估值本身的性价比也开始显现。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

本基金截至2024年06月30日,期末可供分配利润为37,608,444.33元,其中:泓德裕祥债券A期末可供分配利润为37,294,966.90元(泓德裕祥债券A的未分配利润已实现部分为37,294,966.90元,未分配利润未实现部分为66,920,390.54元),泓德裕祥债券C期末可供分配利润为313,477.43元(泓德裕祥债券C的未分配利润已实现部分为313,477.43元,未分配利润未实现部分为1,013,823.18元)。

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

本报告期内,本基金管理人无应说明的预警信息。

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

## 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对泓德基金管理有限公司编制和披露的本基金2024年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：泓德裕祥债券型证券投资基金

报告截止日：2024年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	396,482.87	242,017.05
结算备付金		10,133,310.45	6,774,086.87
存出保证金		78,028.45	19,135.37
交易性金融资产	6.4.7.2	681,026,667.92	973,082,715.18
其中：股票投资		86,727,557.19	168,157,384.88
基金投资		-	-
债券投资		594,299,110.73	804,925,330.30
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		2,236,290.39	-

应收股利		-	-
应收申购款		1,096.09	22,016.80
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		693,871,876.17	980,139,971.27
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年06月30日</b>	<b>上年度末 2023年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		3,000,000.00	70,092,043.99
应付清算款		-	31,824.01
应付赎回款		2,420,937.31	23,624.59
应付管理人报酬		342,748.56	469,283.81
应付托管费		74,262.18	101,678.15
应付销售服务费		2,960.80	4,480.72
应付投资顾问费		-	-
应交税费		15,296.63	16,586.35
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	443,455.02	238,894.28
负债合计		6,299,660.50	70,978,415.90
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	582,029,557.62	745,643,704.56
未分配利润	6.4.7.8	105,542,658.05	163,517,850.81
净资产合计		687,572,215.67	909,161,555.37
负债和净资产总计		693,871,876.17	980,139,971.27

注：报告截止日2024年06月30日，基金份额总额582,029,557.62份，其中A类基金份额总额为573,227,706.60份，基金份额净值为1.1818元；C类基金份额总额为8,801,851.02份，基金份额净值为1.1508元。



## 6.2 利润表

会计主体：泓德裕祥债券型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至202 3年06月30日
一、营业总收入		-23,406,107.25	21,250,219.45
1.利息收入		139,108.41	144,575.28
其中：存款利息收入	6.4.7.9	75,874.01	109,512.80
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		63,234.40	35,062.48
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-” 填列）		-68,694,403.42	-388,162.26
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-95,787,613.20	-23,255,775.93
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	25,936,092.32	20,862,947.01
资产支持证券投资 收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-	-
股利收益	6.4.7.13	1,157,117.46	2,004,666.66
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	6.4.7.14	45,147,797.95	21,363,936.55
4.汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	1,389.81	129,869.88
<b>减：二、营业总支出</b>		3,734,219.02	6,859,135.03
1.管理人报酬		2,306,245.64	4,454,885.84
2.托管费		499,686.55	965,225.27
3.销售服务费		18,998.68	102,323.26
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		782,218.69	1,185,363.43
其中：卖出回购金融资产支出		782,218.69	1,185,363.43
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		9,442.34	22,756.54
8.其他费用	6.4.7.16	117,627.12	128,580.69
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-27,140,326.27	14,391,084.42
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-27,140,326.27	14,391,084.42
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-27,140,326.27	14,391,084.42

### 6.3 净资产变动表

会计主体：泓德裕祥债券型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	745,643,704.56	163,517,850.81	909,161,555.37
二、本期期初净资产	745,643,704.56	163,517,850.81	909,161,555.37

产			
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-163,614,146.94	-57,975,192.76	-221,589,339.70
（一）、综合收益总额	-	-27,140,326.27	-27,140,326.27
（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）	-163,614,146.94	-30,834,866.49	-194,449,013.43
其中：1.基金申购款	688,304.62	117,664.66	805,969.28
2.基金赎回款	-164,302,451.56	-30,952,531.15	-195,254,982.71
（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	582,029,557.62	105,542,658.05	687,572,215.67
项目	上年度可比期间		
	2023年01月01日至2023年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,453,044,578.83	445,862,302.14	1,898,906,880.97
二、本期期初净资产	1,453,044,578.83	445,862,302.14	1,898,906,880.97
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-544,201,945.29	-162,590,770.11	-706,792,715.40
（一）、综合收益总额	-	14,391,084.42	14,391,084.42

(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)	-544,201,945.29	-176,981,854.53	-721,183,799.82
其中: 1.基金申购款	139,837,888.65	47,056,320.96	186,894,209.61
2.基金赎回款	-684,039,833.94	-224,038,175.49	-908,078,009.43
(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	908,842,633.54	283,271,532.03	1,192,114,165.57

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

王德晓

李娇

王玲

-----  
基金管理人负责人

-----  
主管会计工作负责人

-----  
会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

泓德裕祥债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]841号《关于准予泓德裕祥债券型证券投资基金注册的批复》准予注册,由泓德基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《泓德裕祥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208,922,540.66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(2017)第039号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泓德裕祥债券型证券投资基金基金合同》于2017年1月13日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为208,930,733.38份,其中认购资金利息折合8,192.72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《泓德裕祥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、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。收取认（申）购费和赎回费，不收取销售服务费的，称为A类基金份额；收取销售服务费和赎回费，不收取认（申）购费的，称为C类基金份额。本基金A类基金份额、C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为：计算日某类基金份额净值=计算日该类基金份额的基金资产净值/计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泓德裕祥债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、短期融资券、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转换债券）、可交换债券、资产支持证券、中小企业私募债、债券回购和银行存款、大额存单等固定收益类投资工具，股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证等权益类品种，国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。本基金的投资组合比例为：债券资产占基金资产的比例不低于80%，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中国债券综合全价指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泓德裕祥债券型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 6.4.6 税项

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

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

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

持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

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

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

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
活期存款	396,482.87
等于：本金	396,451.51
加：应计利息	31.36
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	396,482.87

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	89,182,759.10	-	86,727,557.19	-2,455,201.91	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	517,847,931.63	2,766,035.56	491,558,394.88	-29,055,572.31
	银行间市场	99,981,751.38	1,015,715.85	102,740,715.85	1,743,248.62
	合计	617,829,683.01	3,781,751.41	594,299,110.73	-27,312,323.69
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	707,012,442.11	3,781,751.41	681,026,667.92	-29,767,525.60	

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1.48



应付证券出借违约金	-
应付交易费用	347,978.16
其中：交易所市场	347,357.66
银行间市场	620.50
应付利息	-
预提费用	95,475.38
合计	443,455.02

### 6.4.7.7 实收基金

#### 6.4.7.7.1 泓德裕祥债券A

金额单位：人民币元

项目 (泓德裕祥债券A)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	733,848,988.57	733,848,988.57
本期申购	531,160.19	531,160.19
本期赎回（以“-”号填列）	-161,152,442.16	-161,152,442.16
本期末	573,227,706.60	573,227,706.60

#### 6.4.7.7.2 泓德裕祥债券C

金额单位：人民币元

项目 (泓德裕祥债券C)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	11,794,715.99	11,794,715.99
本期申购	157,144.43	157,144.43
本期赎回（以“-”号填列）	-3,150,009.40	-3,150,009.40
本期末	8,801,851.02	8,801,851.02

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

### 6.4.7.8 未分配利润

#### 6.4.7.8.1 泓德裕祥债券A

单位：人民币元

项目 (泓德裕祥债券A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	121,748,488.96	39,530,262.24	161,278,751.20
本期期初	121,748,488.96	39,530,262.24	161,278,751.20
本期利润	-71,245,710.94	44,549,155.30	-26,696,555.64
本期基金份额交易产生的变动数	-13,207,811.12	-17,159,027.00	-30,366,838.12
其中：基金申购款	35,991.59	58,321.64	94,313.23
基金赎回款	-13,243,802.71	-17,217,348.64	-30,461,151.35
本期已分配利润	-	-	-
本期末	37,294,966.90	66,920,390.54	104,215,357.44

## 6.4.7.8.2 泓德裕祥债券C

单位：人民币元

项目 (泓德裕祥债券C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,604,071.89	635,027.72	2,239,099.61
本期期初	1,604,071.89	635,027.72	2,239,099.61
本期利润	-1,042,413.28	598,642.65	-443,770.63
本期基金份额交易产生的变动数	-248,181.18	-219,847.19	-468,028.37
其中：基金申购款	4,488.65	18,862.78	23,351.43
基金赎回款	-252,669.83	-238,709.97	-491,379.80
本期已分配利润	-	-	-
本期末	313,477.43	1,013,823.18	1,327,300.61

## 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
活期存款利息收入	2,216.26

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	73,241.28
其他	416.47
合计	75,874.01

#### 6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
卖出股票成交总额	632,487,757.68
减：卖出股票成本总额	726,976,652.11
减：交易费用	1,298,718.77
买卖股票差价收入	-95,787,613.20

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
债券投资收益——利息收入	6,596,066.02
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	19,340,026.30
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	25,936,092.32

##### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
卖出债券（债转股）	382,460,072.36

及债券到期兑付) 成交总额	
减：卖出债券（债 转股及债券到期兑 付）成本总额	358,821,543.32
减：应计利息总额	4,282,385.87
减：交易费用	16,116.87
买卖债券差价收入	19,340,026.30

#### 6.4.7.12 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
股票投资产生的股利收益	1,157,117.46
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,157,117.46

#### 6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
1.交易性金融资产	45,147,797.95
——股票投资	50,014,353.61
——债券投资	-4,866,555.66
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-

——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	45,147,797.95

#### 6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
基金赎回费收入	1,388.79
基金转换费收入	1.02
合计	1,389.81

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

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

#### 6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
审计费用	35,803.04
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
汇划手续费	3,551.74
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	117,627.12

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至20 24年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至20 23年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,306,245.64	4,454,885.84
其中：应支付销售机构的客户维护费	69,103.05	105,671.95
应支付基金管理人的净管理费	2,237,142.59	4,349,213.89

注：支付基金管理人泓德基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.60%的年费率每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.60%/当年天数。

## 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024 年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	499,686.55	965,225.27

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值0.13%的年费率每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.13%/当年天数。

## 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售 服务费的 各关联方 名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泓德裕祥债券A	泓德裕祥债券C	合计
泓德基金	0.00	282.44	282.44
中国工商银行	0.00	2,469.53	2,469.53
合计	0.00	2,751.97	2,751.97
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泓德裕祥债券A	泓德裕祥债券C	合计
泓德基金	0.00	19,057.36	19,057.36
中国工商银行	0.00	3,181.23	3,181.23
合计	0.00	22,238.59	22,238.59

注：支付销售机构的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

泓德裕祥债券A

份额单位：份

项目	本期 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至 2023年06月30日
报告期初持有的基金份额	-	11,838,581.01
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	11,838,581.01
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	1.30%

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

泓德裕祥债券A

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024年06月30日		上年度末 2023年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
自然人股东	113.99	0.00%	113.99	0.00%



注：本报告期末，自然人股东持有本基金份额占总份额的比例为0.00002%（上年度末：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 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	396,482.87	2,216.26	344,630.62	8,925.09

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2024年06月30日）本基金持有的流通受限证券

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

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于2024年6月30日，本基金持有27,000股ST富通（股票代码“000836”）成本总额为人民币53,524.06元。根据相关公告，该股票自2024年6月18日起停牌，于2024年8月12日被终止上市。

基金管理人于2024年6月22日发布《泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金所持股票估值方法调整的提示性公告》，经与相关托管人协商一致，自2024年6月21日起，对“ST富通”（股票代码：“000836”）按照0元进行估值，详见基金管理人在规定媒介披露的相关公告。

### 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2024年6月30日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额3,000,000.00元，于2024年7月1日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

#### 6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项

清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

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

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	50,544,890.71	-
合计	50,544,890.71	-

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

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级的资产支持证券。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级的同业存单。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	283,622,034.29	522,454,366.01
AAA以下	207,936,360.59	159,353,466.37
未评级	52,195,825.14	123,117,497.92
合计	543,754,220.02	804,925,330.30

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

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级的资产支持证券。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级的同业存单。

### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

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

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。于本报告期末，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。于本报告期末，本基金确认的净赎回申请未超过7个工作日可变现资产的可变现价值。

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

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年 06月30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	396,482.87	-	-	-	396,482.87
结算备付金	10,133,310.45	-	-	-	10,133,310.45
存出保证金	78,028.45	-	-	-	78,028.45
交易性金融资产	74,192,283.68	510,291,629.44	9,815,197.61	86,727,557.19	681,026,667.92
应收清算款	-	-	-	2,236,290.39	2,236,290.39
应收申购款	-	-	-	1,096.09	1,096.09
资产总计	84,800,105.45	510,291,629.44	9,815,197.61	88,964,943.67	693,871,876.17
负债					
卖出回购金融资产款	3,000,000.00	-	-	-	3,000,000.00
应付赎回款	-	-	-	2,420,937.31	2,420,937.31
应付管理人报酬	-	-	-	342,748.56	342,748.56
应付托管费	-	-	-	74,262.18	74,262.18
应付销售服务费	-	-	-	2,960.80	2,960.80
应交税费	-	-	-	15,296.63	15,296.63

其他负债	-	-	-	443,455.02	443,455.02
负债总计	3,000,000.00	-	-	3,299,660.50	6,299,660.50
利率敏感度缺口	81,800,105.45	510,291,629.44	9,815,197.61	85,665,283.17	687,572,215.67
上年度末 2023年 12月31 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	242,017.05	-	-	-	242,017.05
结算备付金	6,774,086.87	-	-	-	6,774,086.87
存出保证金	19,135.37	-	-	-	19,135.37
交易性金融资产	92,530,639.35	712,394,690.95	-	168,157,384.88	973,082,715.18
应收申购款	-	-	-	22,016.80	22,016.80
资产总计	99,565,878.64	712,394,690.95	-	168,179,401.68	980,139,971.27
负债					
卖出回购金融资产款	70,092,043.99	-	-	-	70,092,043.99
应付清算款	-	-	-	31,824.01	31,824.01
应付赎回款	-	-	-	23,624.59	23,624.59
应付管理人报	-	-	-	469,283.81	469,283.81

酬					
应付托管费	-	-	-	101,678.15	101,678.15
应付销售服务费	-	-	-	4,480.72	4,480.72
应交税费	-	-	-	16,586.35	16,586.35
其他负债	-	-	-	238,894.28	238,894.28
负债总计	70,092,043.99	-	-	886,371.91	70,978,415.90
利率敏感度缺口	29,473,834.65	712,394,690.95	-	167,293,029.77	909,161,555.37

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
	市场利率下降25个基点	3,804,582.51	5,009,756.66
市场利率上升25个基点	-3,766,156.98	-4,958,747.41	

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上



市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

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

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	86,727,557.19	12.61	168,157,384.88	18.50
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	86,727,557.19	12.61	168,157,384.88	18.50

#### 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12.61%（上年度末：18.50%），因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年度末：同）。

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	558,115,946.59	808,997,969.43
第二层次	122,910,721.33	164,084,745.75
第三层次	-	-
合计	681,026,667.92	973,082,715.18

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

###### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

**6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明**

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

**6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

**§7 投资组合报告****7.1 期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	86,727,557.19	12.50
	其中：股票	86,727,557.19	12.50
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	594,299,110.73	85.65
	其中：债券	594,299,110.73	85.65
	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	10,529,793.32	1.52
8	其他各项资产	2,315,414.93	0.33
9	合计	693,871,876.17	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	800,714.00	0.12
B	采矿业	6,790,991.00	0.99

C	制造业	45,101,730.24	6.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,932,223.00	0.57
E	建筑业	1,414,732.00	0.21
F	批发和零售业	455,755.00	0.07
G	交通运输、仓储和邮政业	2,738,065.00	0.40
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,985,967.25	0.43
J	金融业	19,869,132.70	2.89
K	房地产业	549,921.00	0.08
L	租赁和商务服务业	1,008,221.00	0.15
M	科学研究和技术服务业	265,840.00	0.04
N	水利、环境和公共设施管理业	199,569.00	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	71,604.00	0.01
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	75,518.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	299,940.00	0.04
S	综合	167,634.00	0.02
	合计	86,727,557.19	12.61

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	3,100	4,548,909.00	0.66
2	601318	中国平安	58,000	2,398,880.00	0.35
3	300750	宁德时代	13,100	2,358,393.00	0.34
4	000333	美的集团	26,600	1,715,700.00	0.25
5	600036	招商银行	45,800	1,565,902.00	0.23
6	601166	兴业银行	83,600	1,473,032.00	0.21
7	600900	长江电力	50,400	1,457,568.00	0.21

8	601288	农业银行	313,800	1,368,168.00	0.20
9	601328	交通银行	178,900	1,336,383.00	0.19
10	000651	格力电器	32,000	1,255,040.00	0.18
11	000725	京东方 A	276,000	1,128,840.00	0.16
12	600887	伊利股份	41,200	1,064,608.00	0.15
13	601899	紫金矿业	55,900	982,163.00	0.14
14	600030	中信证券	48,900	891,447.00	0.13
15	002475	立讯精密	21,900	860,889.00	0.13
16	601138	工业富联	30,800	843,920.00	0.12
17	000338	潍柴动力	51,500	836,360.00	0.12
18	000858	五粮液	6,500	832,260.00	0.12
19	601919	中远海控	52,200	808,578.00	0.12
20	002594	比亚迪	3,200	800,800.00	0.12
21	600690	海尔智家	27,700	786,126.00	0.11
22	603993	洛阳钼业	90,300	767,550.00	0.11
23	300760	迈瑞医疗	2,600	756,366.00	0.11
24	000100	TCL科技	172,400	744,768.00	0.11
25	600941	中国移动	6,700	720,250.00	0.10
26	601211	国泰君安	51,700	700,535.00	0.10
27	601169	北京银行	119,000	694,960.00	0.10
28	601088	中国神华	15,400	683,298.00	0.10
29	300498	温氏股份	32,700	648,114.00	0.09
30	601857	中国石油	62,100	640,872.00	0.09
31	600015	华夏银行	99,700	638,080.00	0.09
32	600926	杭州银行	48,600	634,230.00	0.09
33	600019	宝钢股份	93,700	623,105.00	0.09
34	601939	建设银行	84,200	623,080.00	0.09
35	601728	中国电信	100,300	616,845.00	0.09
36	601668	中国建筑	115,200	611,712.00	0.09
37	002027	分众传媒	100,700	610,242.00	0.09
38	603501	韦尔股份	6,100	606,157.00	0.09

39	601658	邮储银行	118,600	601,302.00	0.09
40	600660	福耀玻璃	12,500	598,750.00	0.09
41	600919	江苏银行	79,700	592,171.00	0.09
42	600795	国电电力	98,300	588,817.00	0.09
43	601009	南京银行	56,000	581,840.00	0.08
44	601601	中国太保	20,300	565,558.00	0.08
45	601225	陕西煤业	21,500	554,055.00	0.08
46	600346	恒力石化	39,500	551,025.00	0.08
47	600999	招商证券	37,800	525,798.00	0.08
48	600276	恒瑞医药	13,300	511,518.00	0.07
49	601688	华泰证券	40,600	503,034.00	0.07
50	600938	中国海油	14,700	485,100.00	0.07
51	600018	上港集团	83,500	482,630.00	0.07
52	601633	长城汽车	18,300	462,990.00	0.07
53	601985	中国核电	41,800	445,588.00	0.06
54	600048	保利发展	50,500	442,380.00	0.06
55	601336	新华保险	14,700	441,441.00	0.06
56	600309	万华化学	4,900	396,214.00	0.06
57	000596	古井贡酒	1,800	379,926.00	0.06
58	600050	中国联通	77,600	364,720.00	0.05
59	300122	智飞生物	12,900	361,587.00	0.05
60	688036	传音控股	4,652	356,064.08	0.05
61	002938	鹏鼎控股	8,900	353,864.00	0.05
62	600016	民生银行	92,000	348,680.00	0.05
63	601988	中国银行	74,300	343,266.00	0.05
64	601766	中国中车	45,200	339,452.00	0.05
65	300059	东方财富	32,100	338,976.00	0.05
66	600837	海通证券	38,500	329,560.00	0.05
67	600028	中国石化	51,900	328,008.00	0.05
68	002736	国信证券	37,500	325,875.00	0.05
69	600436	片仔癀	1,500	310,755.00	0.05

70	601600	中国铝业	40,600	309,778.00	0.05
71	600183	生益科技	14,500	305,370.00	0.04
72	000999	华润三九	7,060	300,614.80	0.04
73	002241	歌尔股份	14,900	290,699.00	0.04
74	600188	兖矿能源	12,600	286,398.00	0.04
75	688008	澜起科技	5,000	285,800.00	0.04
76	000975	银泰黄金	17,300	281,817.00	0.04
77	605499	东鹏饮料	1,300	280,475.00	0.04
78	600219	南山铝业	72,100	274,701.00	0.04
79	600011	华能国际	28,500	274,170.00	0.04
80	600547	山东黄金	9,800	268,324.00	0.04
81	601816	京沪高铁	49,300	264,741.00	0.04
82	600489	中金黄金	17,700	261,960.00	0.04
83	603096	新经典	15,300	258,570.00	0.04
84	003816	中国广核	55,600	257,428.00	0.04
85	601186	中国铁建	30,000	257,100.00	0.04
86	000166	申万宏源	58,900	253,859.00	0.04
87	002142	宁波银行	11,500	253,690.00	0.04
88	600115	中国东航	62,300	249,823.00	0.04
89	000157	中联重科	32,300	248,064.00	0.04
90	600025	华能水电	22,500	242,550.00	0.04
91	002493	荣盛石化	24,900	240,534.00	0.03
92	002415	海康威视	7,700	238,007.00	0.03
93	600039	四川路桥	29,800	235,122.00	0.03
94	002001	新和成	12,200	234,240.00	0.03
95	300308	中际旭创	1,660	228,880.80	0.03
96	601128	常熟银行	29,910	226,418.70	0.03
97	000786	北新建材	7,500	222,450.00	0.03
98	601998	中信银行	32,500	217,750.00	0.03
99	600989	宝丰能源	12,500	216,625.00	0.03
100	000708	中信特钢	15,800	214,406.00	0.03

101	600803	新奥股份	10,300	214,240.00	0.03
102	601319	中国人保	41,100	211,665.00	0.03
103	002128	电投能源	10,000	211,000.00	0.03
104	600845	宝信软件	6,600	210,738.00	0.03
105	600161	天坛生物	8,620	210,328.00	0.03
106	600985	淮北矿业	12,500	209,250.00	0.03
107	601066	中信建投	10,800	207,792.00	0.03
108	300999	金龙鱼	7,500	205,125.00	0.03
109	600875	东方电气	11,100	204,795.00	0.03
110	600600	青岛啤酒	2,800	203,756.00	0.03
111	002688	金河生物	56,100	203,643.00	0.03
112	601717	郑煤机	13,600	201,280.00	0.03
113	601808	中海油服	11,700	201,240.00	0.03
114	000568	泸州老窖	1,400	200,886.00	0.03
115	600760	中航沈飞	5,000	200,500.00	0.03
116	603228	景旺电子	6,300	200,340.00	0.03
117	300628	亿联网络	5,400	198,558.00	0.03
118	000877	天山股份	36,500	197,100.00	0.03
119	601865	福莱特	9,800	196,980.00	0.03
120	601006	大秦铁路	27,500	196,900.00	0.03
121	002311	海大集团	4,000	188,200.00	0.03
122	600588	用友网络	18,500	185,000.00	0.03
123	600089	特变电工	13,300	184,471.00	0.03
124	002064	华峰化学	24,500	175,665.00	0.03
125	601218	吉鑫科技	62,600	174,654.00	0.03
126	300605	恒锋信息	19,200	173,952.00	0.03
127	601616	广电电气	59,700	173,727.00	0.03
128	002422	科伦药业	5,700	172,881.00	0.03
129	600517	国网英大	39,900	172,767.00	0.03
130	300837	浙矿股份	8,300	172,308.00	0.03
131	601058	赛轮轮胎	12,300	172,200.00	0.03



132	688077	大地熊	10,866	172,008.78	0.03
133	002788	鹭燕医药	21,800	171,784.00	0.02
134	600707	彩虹股份	25,200	171,612.00	0.02
135	001207	联科科技	11,800	171,336.00	0.02
136	001872	招商港口	8,900	171,325.00	0.02
137	002282	博深股份	26,800	171,252.00	0.02
138	603681	永冠新材	13,400	170,850.00	0.02
139	002661	克明食品	22,800	170,316.00	0.02
140	600066	宇通客车	6,600	170,280.00	0.02
141	002636	金安国纪	26,800	170,180.00	0.02
142	002286	保龄宝	30,800	169,708.00	0.02
143	300124	汇川技术	3,300	169,290.00	0.02
144	000830	鲁西化工	14,600	169,214.00	0.02
145	603385	惠达卫浴	30,800	169,092.00	0.02
146	300140	节能环保	28,300	168,951.00	0.02
147	601598	中国外运	30,000	168,900.00	0.02
148	601168	西部矿业	9,400	168,730.00	0.02
149	002969	嘉美包装	59,200	168,720.00	0.02
150	301301	川宁生物	13,200	168,696.00	0.02
151	002463	沪电股份	4,600	167,900.00	0.02
152	002852	道道全	23,300	167,760.00	0.02
153	000532	华金资本	13,900	167,634.00	0.02
154	600262	北方股份	10,200	167,586.00	0.02
155	002054	德美化工	34,100	167,431.00	0.02
156	600096	云天化	8,600	167,012.00	0.02
157	002215	诺普信	22,400	166,880.00	0.02
158	603897	长城科技	9,500	166,725.00	0.02
159	603909	建发合诚	20,000	166,400.00	0.02
160	002557	洽洽食品	5,900	166,321.00	0.02
161	603819	神力股份	15,700	164,850.00	0.02
162	688355	明志科技	12,280	164,797.60	0.02

163	688678	福立旺	15,200	164,616.00	0.02
164	688132	邦彦技术	9,439	163,766.65	0.02
165	300080	易成新能	56,500	162,720.00	0.02
166	688728	格科微	13,400	162,274.00	0.02
167	688767	博拓生物	6,452	161,751.64	0.02
168	600566	济川药业	5,100	161,721.00	0.02
169	300737	科顺股份	37,400	160,820.00	0.02
170	002371	北方华创	500	159,945.00	0.02
171	600968	海油发展	38,800	159,856.00	0.02
172	600406	国电南瑞	6,400	159,744.00	0.02
173	002340	格林美	24,900	158,613.00	0.02
174	000153	丰原药业	29,000	156,020.00	0.02
175	300433	蓝思科技	8,400	153,300.00	0.02
176	603806	福斯特	10,400	152,880.00	0.02
177	002714	牧原股份	3,500	152,600.00	0.02
178	000039	中集集团	16,100	149,086.00	0.02
179	601989	中国重工	30,100	148,393.00	0.02
180	600642	申能股份	16,700	147,461.00	0.02
181	601818	光大银行	46,100	146,137.00	0.02
182	000630	铜陵有色	40,300	145,483.00	0.02
183	601888	中国中免	2,300	143,727.00	0.02
184	600893	航发动力	3,900	142,545.00	0.02
185	300651	金陵体育	11,600	140,592.00	0.02
186	300986	志特新材	19,600	132,692.00	0.02
187	000785	居然之家	53,800	130,734.00	0.02
188	000538	云南白药	2,500	127,875.00	0.02
189	600674	川投能源	6,600	123,750.00	0.02
190	002252	上海莱士	15,500	121,210.00	0.02
191	003019	宸展光电	4,760	120,570.80	0.02
192	002648	卫星化学	6,700	120,466.00	0.02
193	600426	华鲁恒升	4,500	119,880.00	0.02

194	600029	南方航空	20,100	118,389.00	0.02
195	688188	柏楚电子	640	118,112.00	0.02
196	600233	圆通速递	7,300	114,245.00	0.02
197	000776	广发证券	9,200	111,964.00	0.02
198	000301	东方盛虹	14,000	111,580.00	0.02
199	600332	白云山	3,800	111,454.00	0.02
200	601898	中煤能源	8,500	106,080.00	0.02
201	000876	新希望	11,600	106,024.00	0.02
202	002916	深南电路	1,000	105,770.00	0.02
203	601877	正泰电器	5,500	104,830.00	0.02
204	688223	晶科能源	14,600	103,660.00	0.02
205	603458	勘设股份	17,600	99,440.00	0.01
206	001266	宏英智能	4,300	93,396.00	0.01
207	603659	璞泰来	6,600	93,258.00	0.01
208	002384	东山精密	4,500	93,150.00	0.01
209	688090	瑞松科技	3,311	90,390.30	0.01
210	601298	青岛港	9,400	89,864.00	0.01
211	603032	德新科技	7,800	89,154.00	0.01
212	300614	百川畅银	9,800	89,082.00	0.01
213	300440	运达科技	16,900	88,725.00	0.01
214	603707	健友股份	7,400	87,912.00	0.01
215	300412	迦南科技	30,500	87,840.00	0.01
216	688079	美迪凯	11,800	87,556.00	0.01
217	600820	隧道股份	13,400	87,502.00	0.01
218	603529	爱玛科技	3,200	87,456.00	0.01
219	688659	元琛科技	14,400	86,400.00	0.01
220	300153	科泰电源	14,400	85,680.00	0.01
221	688660	电气风电	29,400	84,672.00	0.01
221	600663	陆家嘴	9,600	84,672.00	0.01
223	002412	汉森制药	16,300	84,271.00	0.01
224	600694	大商股份	5,000	84,050.00	0.01

225	600415	小商品城	11,300	83,846.00	0.01
226	603429	集友股份	20,200	83,830.00	0.01
227	600031	三一重工	5,000	82,500.00	0.01
228	300649	杭州园林	7,900	82,397.00	0.01
229	301222	浙江恒威	3,300	81,708.00	0.01
230	688273	麦澜德	4,115	81,477.00	0.01
231	000915	华特达因	2,700	81,432.00	0.01
232	000035	中国天楹	17,800	80,634.00	0.01
233	603110	东方材料	7,200	80,136.00	0.01
234	600988	赤峰黄金	4,900	80,066.00	0.01
235	002531	天顺风能	8,900	79,566.00	0.01
236	688109	品茗科技	2,907	79,506.45	0.01
237	688276	百克生物	2,800	79,436.00	0.01
238	605016	百龙创园	3,870	78,831.90	0.01
239	301116	益客食品	8,800	78,584.00	0.01
240	000553	安道麦A	17,100	77,634.00	0.01
241	600150	中国船舶	1,900	77,349.00	0.01
242	601825	沪农商行	11,500	77,280.00	0.01
243	603699	纽威股份	4,500	77,040.00	0.01
244	603176	汇通集团	20,500	76,465.00	0.01
245	600256	广汇能源	11,400	76,380.00	0.01
246	002100	天康生物	11,000	76,230.00	0.01
247	603737	三棵树	2,100	76,167.00	0.01
248	300832	新产业	1,100	74,184.00	0.01
249	601872	招商轮船	8,600	72,670.00	0.01
250	603688	石英股份	2,450	72,544.50	0.01
251	301358	湖南裕能	2,300	72,358.00	0.01
252	688296	和达科技	7,400	71,928.00	0.01
253	300736	百邦科技	5,100	71,604.00	0.01
254	600886	国投电力	3,800	69,312.00	0.01
255	300211	亿通科技	13,100	69,299.00	0.01

256	688616	西力科技	6,065	68,777.10	0.01
257	600104	上汽集团	4,900	67,914.00	0.01
258	603016	新宏泰	4,300	66,478.00	0.01
259	600956	新天绿能	8,100	66,177.00	0.01
260	600809	山西汾酒	300	63,264.00	0.01
261	300018	中元股份	13,000	59,800.00	0.01
262	688092	爱科科技	2,800	59,780.00	0.01
263	301015	百洋医药	2,500	58,825.00	0.01
264	000408	藏格矿业	2,400	57,768.00	0.01
265	002466	天齐锂业	1,900	56,829.00	0.01
266	688041	海光信息	800	56,256.00	0.01
267	603966	法兰泰克	7,900	54,273.00	0.01
268	601628	中国人寿	1,700	52,785.00	0.01
269	002567	唐人神	9,700	51,992.00	0.01
270	601916	浙商银行	18,500	51,060.00	0.01
271	688187	时代电气	1,000	49,380.00	0.01
272	002106	莱宝高科	4,400	47,960.00	0.01
273	603882	金域医学	1,700	46,223.00	0.01
274	002660	茂硕电源	6,100	45,262.00	0.01
275	603393	新天然气	1,300	45,162.00	0.01
276	600312	平高电气	2,300	44,735.00	0.01
277	002469	三维化学	7,800	44,460.00	0.01
278	300639	凯普生物	9,500	43,700.00	0.01
279	301227	森鹰窗业	2,300	43,263.00	0.01
280	600537	亿晶光电	17,100	43,092.00	0.01
281	002240	盛新锂能	3,200	42,944.00	0.01
282	601567	三星医疗	1,200	42,000.00	0.01
283	300743	天地数码	3,100	41,974.00	0.01
284	002003	伟星股份	3,300	41,415.00	0.01
285	601019	山东出版	3,500	41,370.00	0.01
286	600180	瑞茂通	10,700	40,767.00	0.01

287	002678	珠江钢琴	11,200	40,544.00	0.01
288	002028	思源电气	600	40,140.00	0.01
289	603618	杭电股份	9,100	39,858.00	0.01
290	688328	深科达	2,800	39,844.00	0.01
291	603329	上海雅仕	3,600	39,672.00	0.01
292	600348	华阳股份	3,900	38,844.00	0.01
293	301236	软通动力	1,100	38,731.00	0.01
294	603786	科博达	600	38,490.00	0.01
295	300849	锦盛新材	3,000	38,190.00	0.01
296	000409	云鼎科技	4,700	37,929.00	0.01
297	300694	蠡湖股份	4,400	37,444.00	0.01
298	300321	同大股份	2,000	37,260.00	0.01
299	002795	永和智控	10,000	37,200.00	0.01
300	603368	柳药集团	2,100	36,750.00	0.01
301	300830	金现代	5,900	35,872.00	0.01
302	000050	深天马A	4,800	34,944.00	0.01
303	601838	成都银行	2,300	34,937.00	0.01
304	600386	北巴传媒	12,200	34,038.00	0.00
305	300275	梅安森	3,300	32,901.00	0.00
306	002563	森马服饰	5,300	30,793.00	0.00
307	002050	三花智控	1,600	30,528.00	0.00
308	002266	浙富控股	10,700	29,853.00	0.00
309	601061	中信金属	4,300	29,541.00	0.00
310	002524	光正眼科	9,300	29,295.00	0.00
311	688012	中微公司	200	28,252.00	0.00
312	002946	新乳业	3,200	28,032.00	0.00
313	688171	纬德信息	1,800	27,144.00	0.00
314	002105	信隆健康	6,600	27,060.00	0.00
315	002375	亚厦股份	8,200	26,650.00	0.00
316	000921	海信家电	800	25,792.00	0.00
317	603863	松炆资源	1,300	24,856.00	0.00

318	002830	名雕股份	2,500	24,600.00	0.00
319	603937	丽岛新材	3,100	24,056.00	0.00
320	603198	迎驾贡酒	400	23,000.00	0.00
321	000002	万科A	3,300	22,869.00	0.00
322	688257	新锐股份	1,437	22,029.21	0.00
323	002322	理工能科	1,300	20,826.00	0.00
324	002825	纳尔股份	3,200	19,936.00	0.00
325	003003	天元股份	2,400	19,128.00	0.00
326	600584	长电科技	600	19,026.00	0.00
327	002329	皇氏集团	6,900	18,699.00	0.00
328	301062	上海艾录	1,800	18,378.00	0.00
329	603040	新坐标	900	17,937.00	0.00
330	300896	爱美客	100	17,210.00	0.00
331	601377	兴业证券	3,300	16,698.00	0.00
332	300573	兴齐眼药	100	16,400.00	0.00
333	003011	海象新材	1,200	16,092.00	0.00
334	300329	海伦钢琴	4,100	15,457.00	0.00
335	002179	中航光电	400	15,220.00	0.00
336	300808	久量股份	900	14,661.00	0.00
337	688375	国博电子	200	14,128.00	0.00
338	601117	中国化学	1,600	13,184.00	0.00
339	300298	三诺生物	500	12,670.00	0.00
340	002948	青岛银行	3,600	12,132.00	0.00
341	002550	千红制药	2,100	11,319.00	0.00
342	688789	宏华数科	100	10,780.00	0.00
343	300274	阳光电源	100	6,203.00	0.00
344	688519	南亚新材	144	3,682.08	0.00
345	688060	云涌科技	95	3,043.80	0.00
346	000836	ST富通	27,000	-	0.00

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

## 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	7,467,547.00	0.82
2	300750	宁德时代	3,803,864.00	0.42
3	601318	中国平安	2,685,837.00	0.30
4	000333	美的集团	2,364,587.00	0.26
5	600036	招商银行	2,291,518.00	0.25
6	600900	长江电力	2,185,639.00	0.24
7	000651	格力电器	2,138,406.00	0.24
8	601288	农业银行	1,914,309.00	0.21
9	601328	交通银行	1,775,376.00	0.20
10	601939	建设银行	1,766,497.00	0.19
11	000725	京东方A	1,725,962.00	0.19
12	002594	比亚迪	1,699,802.00	0.19
13	601857	中国石油	1,686,718.00	0.19
14	000858	五粮液	1,653,155.00	0.18
15	601166	兴业银行	1,579,098.00	0.17
16	300259	新天科技	1,478,579.00	0.16
17	600887	伊利股份	1,471,895.00	0.16
18	601225	陕西煤业	1,468,675.00	0.16
19	300440	运达科技	1,443,079.00	0.16
20	300306	远方信息	1,436,572.00	0.16

## 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	600519	贵州茅台	9,944,599.00	1.09



2	600048	保利发展	7,625,934.00	0.84
3	603259	药明康德	7,524,235.60	0.83
4	300760	迈瑞医疗	7,263,046.00	0.80
5	002311	海大集团	7,040,309.00	0.77
6	688029	南微医学	7,036,393.68	0.77
7	601966	玲珑轮胎	7,028,805.00	0.77
8	600309	万华化学	6,890,661.30	0.76
9	002142	宁波银行	6,637,815.60	0.73
10	300750	宁德时代	6,576,288.40	0.72
11	605499	东鹏饮料	5,937,529.00	0.65
12	300059	东方财富	5,878,224.60	0.65
13	601899	紫金矿业	5,671,886.00	0.62
14	601100	恒立液压	5,123,045.80	0.56
15	300124	汇川技术	4,412,550.50	0.49
16	603596	伯特利	4,301,568.00	0.47
17	603517	绝味食品	3,856,676.00	0.42
18	688777	中控技术	3,806,542.14	0.42
19	002597	金禾实业	3,312,577.00	0.36
20	600486	扬农化工	3,227,882.00	0.36

#### 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	595,532,470.81
卖出股票收入（成交）总额	632,487,757.68

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	50,544,890.71	7.35
	其中：政策性金融债	50,544,890.71	7.35
4	企业债券	20,170,005.48	2.93
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	52,195,825.14	7.59
7	可转债(可交换债)	471,388,389.40	68.56
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	594,299,110.73	86.43

#### 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	113042	上银转债	605,000	68,772,471.64	10.00
2	110059	浦发转债	615,000	67,819,352.46	9.86
3	240301	24进出01	500,000	50,544,890.71	7.35
4	123107	温氏转债	382,400	48,258,513.32	7.02
5	113641	华友转债	377,480	38,301,768.33	5.57

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内本基金投资的前十名证券除上银转债（证券代码：113042）外，其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2023年12月28日，上银转债（证券代码：113042）发行人上海银行股份有限公司因未按规定提供报表、未根据标的项目的实际进度和资金需求发放贷款导致贷款资金被挪用、个人贷款贷前调查严重违反审慎经营规则、个人消费贷款违规流入股市被国家金融监督管理总局上海监管局罚款15万元。

2023年11月15日，上银转债（证券代码：113042）发行人上海银行股份有限公司因不良贷款余额数据报送存在偏差、漏报贸易融资业务余额EAST数据、漏报核销贷款本金EAST数据、漏报质或抵押物价值EAST数据等被国家金融监督管理总局上海监管局责令改正并处罚款共计690万元。

2023年11月15日，上银转债（证券代码：113042）发行人上海银行股份有限公司因封闭式产品投资非标准化资产终止日晚于产品到期日、理财产品老产品投资新资产的到期日晚于2020年、将无法持有至到期的资产以摊余成本计量、未按规定披露理财产品的杠杆水平等被国家金融监督管理总局上海监管局责令改正并处罚款共计690万元。

在上述公告公布后，本基金管理人对上述公司进行了进一步了解和他分析，认为上述处罚不会对投资价值构成实质性负面影响，因此本基金管理人对上述公司的投资判断未发生改变。本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合本基金管理人投资管理制度的规定。

7.12.2 基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	78,028.45

2	应收清算款	2,236,290.39
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,096.09
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,315,414.93

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113042	上银转债	68,772,471.64	10.00
2	110059	浦发转债	67,819,352.46	9.86
3	123107	温氏转债	48,258,513.32	7.02
4	113641	华友转债	38,301,768.33	5.57
5	127045	牧原转债	37,017,188.99	5.38
6	127056	中特转债	31,655,040.37	4.60
7	110073	国投转债	30,109,029.35	4.38
8	118022	锂科转债	20,337,684.93	2.96
9	127031	洋丰转债	20,250,394.52	2.95
10	118031	天23转债	18,844,157.71	2.74
11	123090	三诺转债	14,408,730.86	2.10
12	113048	晶科转债	13,383,114.93	1.95
13	118005	天奈转债	12,495,205.83	1.82
14	128124	科华转债	7,878,151.60	1.15
15	113044	大秦转债	6,013,254.79	0.87
16	127067	恒逸转2	5,643,808.06	0.82
17	123154	火星转债	4,248,465.75	0.62
18	127039	北港转债	3,837,242.09	0.56

19	113024	核建转债	3,477,387.49	0.51
20	113631	皖天转债	2,531,780.82	0.37
21	113052	兴业转债	1,515,047.40	0.22
22	113053	隆22转债	1,432,645.01	0.21
23	127044	蒙娜转债	1,261,684.03	0.18
24	113633	科沃转债	1,138,988.88	0.17
25	127018	本钢转债	562,044.89	0.08
26	110084	贵燃转债	169,838.40	0.02
27	113542	好客转债	115,145.36	0.02
28	127022	恒逸转债	95,053.98	0.01

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能存在尾差。

### §8 基金份额持有人信息

#### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	人均持有的基金份额	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
泓德裕祥债券A	11,054	51,857.04	542,014,290.13	94.55%	31,213,416.47	5.45%
泓德裕祥债券C	627	14,038.04	0.00	0.00%	8,801,851.02	100.00%

合计	11,615	50,110.16	542,014,290.13	93.12%	40,015,267.49	6.88%
----	--------	-----------	----------------	--------	---------------	-------

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	泓德裕祥债券A	17,461.52	0.00%
	泓德裕祥债券C	762.46	0.01%
	合计	18,223.98	0.00%

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

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

	泓德裕祥债券A	泓德裕祥债券C
--	---------	---------

基金合同生效日(2017年01月13日)基金份额总额	207,263,080.88	1,667,652.50
本报告期期初基金份额总额	733,848,988.57	11,794,715.99
本报告期基金总申购份额	531,160.19	157,144.43
减：本报告期基金总赎回份额	161,152,442.16	3,150,009.40
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	573,227,706.60	8,801,851.02

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 基金管理人的重大人事变动

本报告期基金管理人无重大人事变动。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东北证券	2	1,092,550,095.07	88.97%	804,002.85	88.97%	-
华泰证券	2	52,160,967.02	4.25%	38,383.51	4.25%	-
长城证券	2	46,237,854.91	3.77%	34,026.51	3.77%	-
渤海证券	1	19,467,331.99	1.59%	14,325.57	1.59%	-
开源证券	2	17,603,979.50	1.43%	12,954.96	1.43%	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	2	-	-	-	-	-



证券						
光大 证券	2	-	-	-	-	-
广发 证券	2	-	-	-	-	-
国金 证券	2	-	-	-	-	-
国盛 证券	2	-	-	-	-	-
国信 证券	2	-	-	-	-	-
华金 证券	2	-	-	-	-	-
华西 证券	2	-	-	-	-	-
民生 证券	2	-	-	-	-	-
平安 证券	2	-	-	-	-	-
申万 宏源 证券	2	-	-	-	-	-
东方 财富 证券	2	-	-	-	-	-
信达 证券	2	-	-	-	-	-
招商 证券	2	-	-	-	-	-
中国 中金 财富 证券	2	-	-	-	-	-

中信 证券	2	-	-	-	-	-
甬兴 证券	2	-	-	-	-	-
首创 证券	2	-	-	-	-	-
国投 证券	2	-	-	-	-	-
中信 建投 证券	4	-	-	-	-	-

注：1、基金专用交易单元的选择标准如下：

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

2、基金专用交易单元的选择程序如下：

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

3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

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

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例	成交金额	占当期 债券回 购成交 总额的 比例	成交金 额	占当期 权证成 交总额 的比例	成交金 额	占当期 基金成 交总额 的比例
东北证券	283,939,66 6.63	71.69%	6,768,936,00 0.00	74.01%	-	-	-	-
华泰证券	72,985,634. 16	18.43%	1,372,400,00 0.00	15.01%	-	-	-	-
长城证券	20,241,343. 20	5.11%	897,500,000. 00	9.81%	-	-	-	-

渤海证券	9,567,634.26	2.42%	51,900,000.00	0.57%	-	-	-	-
开源证券	9,315,717.86	2.35%	54,900,000.00	0.60%	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中国中金财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
甬兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金所持股票估值方法调整的提示性公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2024-06-22

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
---	----------------	------------

资 者 类 别	序 号	持有基金份额 比例达到或者 超过20%的时 间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机 构	1	2024/01/01-20 24/06/30	293,351,818.59	0.00	0.00	293,351,818.59	50.40%
产品特有风险							
<p>本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额20%的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。</p> <p>在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p>							

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准泓德裕祥债券型证券投资基金设立的文件；
- 2、《泓德裕祥债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《泓德裕祥债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《泓德裕祥债券型证券投资基金托管协议》；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在规定报刊上披露的各项公告。

### 12.2 存放地点

地点为管理人地址：北京市西城区德胜门外大街125号

### 12.3 查阅方式

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

泓德基金管理有限公司  
二〇二四年八月二十九日