

泓德瑞兴三年持有期混合型证券投资基金

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:招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。

基金托管人招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	7
§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	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§6 中期财务会计报告(未经审计)	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	16
6.4 报表附注	17
§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	44
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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
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	53
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	53
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	53
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	53
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
7.12 投资组合报告附注	54
§8 基金份额持有人信息	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55

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	55
§9 开放式基金份额变动	56
§10 重大事件揭示	56
10.1 基金份额持有人大会决议	56
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	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4 基金投资策略的改变	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
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	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	56
10.8 其他重大事件	59
§11 影响投资者决策的其他重要信息	61
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	61
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	61
§12 备查文件目录	61
12.1 备查文件目录	61
12.2 存放地点	61
12.3 查阅方式	61

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泓德瑞兴三年持有期混合型证券投资基金
基金简称	泓德瑞兴三年持有期混合
基金主代码	009264
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年07月14日
基金管理人	泓德基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	7,328,558,231.87份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下,通过合理的资产配置,综合运用多种投资策略,力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>本基金采取“自上而下”的方式进行大类资产配置,根据对宏观经济、市场面、政策面等因素进行定量与定性相结合的分析研究,动态调整基金资产在股票、债券、货币市场工具等类别资产间的分配比例,控制市场风险,提高配置效率。</p> <p>在股票投资方面,本基金在深入研究的基础上优选行业和个股,对处于稳定的中长期发展趋势和预期进入稳定的中长期发展趋势的行业作为重点行业资产进行配置;通过定性分析和定量分析相结合的办法,对上市公司的增长前景进行分析,挑选具备较大竞争优势和长期投资价值的上市公司;在对A、H股溢价水平进行重点分析和趋势预测的前提下,本基金将优选香港市场与国内A股在部分行业形成有效互补的行业和上市公司。</p> <p>本基金通过对国内外宏观经济态势、利率走势、收益率曲线变化趋势和信用风险变化等因素进行综合分析,构建和调整固定收益证券投资组合,主要采取久期配置策略、个券选择策略、可转换债券投资策略、证券公司短期</p>

	<p>公司债券投资策略、资产支持证券投资策略。</p> <p>本基金本着谨慎原则，从风险管理角度出发，适度参与股指期货、国债期货投资。</p>
业绩比较基准	$\text{中证800指数收益率} \times 70\% + \text{中证港股通综合指数收益率} \times 10\% + \text{中国债券综合全价指数收益率} \times 20\%$
风险收益特征	<p>本基金为混合型基金，其长期预期风险与预期收益特征低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。</p> <p>本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港证券市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、投资于香港证券市场的风险、以及通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险等特有风险。</p>

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	招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	95555
传真	010-59322130	0755-83195201
注册地址	西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦1206室	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址	北京市西城区德胜门外大街125号	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码	100088	518040
法定代表人	王德晓	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文	www.hongdefund.com

的管理人互联网网址	
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)
本期已实现收益	683,492,981.71
本期利润	532,133,474.52
加权平均基金份额本期利润	0.0749
本期加权平均净值利润率	5.93%
本期基金份额净值增长率	7.10%
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	973,365,764.85
期末可供分配基金份额利润	0.1328
期末基金资产净值	9,501,709,058.87
期末基金份额净值	1.2965
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	29.65%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	0.19%	0.74%	-0.95%	0.59%	1.14%	0.15%
过去三个月	7.43%	0.87%	3.46%	0.68%	3.97%	0.19%
过去六个月	7.10%	1.22%	2.06%	0.94%	5.04%	0.28%
自基金合同 生效起至今	29.65%	1.13%	5.20%	0.94%	24.45%	0.19%

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：中证800指数收益率×70%+中证港股通综合指数收益率×10%+中国债券综合全价指数收益率×20%

基准指数的构建原则如下：

（1）中证800指数是由中证指数有限公司编制的，其成份股是由沪深300指数和中证500指数成份股一起构成，中证800指数综合反映沪深股票市场内大中小市值公司的整体状况，较好地反映了A股市场的总体趋势。

（2）中证港股通综合指数是由中证指数有限公司编制，选取符合港股通资格的普通股作为样本股，采用自由流通市值加权计算，是反映港股通范围内上市公司的整体状况和走势的具有代表性的一种股价指数。

（3）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。

（4）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70%、10%、20%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

泓德瑞兴三年持有期混合型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2020年07月14日-2021年06月30日)



注：1、本基金的基金合同于2020年07月14日生效，截至2021年06月30日止，本基金成立未满1年。
2、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		
王克玉	投研总监，泓德优选成长混合、泓德优势领航混合、泓德研究优选混合、泓德瑞兴三年持有期混合、泓德瑞嘉三年持有期混合基金经理	2020-07-14	-	18年	硕士研究生，具有基金从业资格，曾任长盛基金管理有限公司基金经理、权益投资部副总监，国都证券有限公司分析师，天相投资顾问有限公司分析师，元大京华证券上海代表处研究员。
操昭煦	本基金基金经理	2021-01-04	-	5年	硕士研究生，具有基金从业资格，资管行业从业经验9年，曾任职于交通银行从事研究工作。

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

在经过连续三个季度的上涨之后，A股市场从2021年年初就体现初大幅震荡的特征。受到国际疫情控制和经济复苏的不确定性的影响，金融市场的流动性和企业盈利预期产生了很大的波动；另外在连续两年大幅上涨之后，赚钱效应带动之下市场的关注度持续提高，也推动市场的短期波动更加剧烈。

在经过一季度大盘成长股的快速上涨和春节之后的急速下跌之后，市场在二季度经过短暂休整之后，高景气细分行业中的个股大幅上涨，特别是新能源、半导体等细分领域的公司短期内涨幅巨大。而相对应的部分业绩预期稳定或所有下调的公司则在流动性压力之下表现低迷。

组合在年初按照个股精选、行业均衡的目标进行调整，主要是为了适应今年经济复苏的经济环境，同时也是为了在更多的细分领域挖掘有竞争力的公司，为组合长期收益做好准备。考虑到整体市场估值等方面还处于比较合理的状况，组合的仓位在期间保持在中高水平上。但组合净值在二季度表现一般，在结构性的极致行情中表现相对落后，二季度的组合优化效果较差。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末泓德瑞兴三年持有期混合基金份额净值为1.2965元，本报告期内，基金份额净值增长率为7.10%，同期业绩比较基准收益率为2.06%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

4.5.1 对宏观经济和证券市场展望

疫情的反复还在对经济活动造成持续的影响，但是影响幅度已经远远小于去年。在“双循环”发展思路的指引下，国内经济体系运行中的短板等在持续补齐，这种情况下经济运行受到外部冲击的抗风险能力持续提高。另外通过持续的产业升级，具备全球竞争力的企业越来越多，使得我们有能力面对外部环境的不确定性。

对资本市场而言，通过持续的制度建设，市场体系中的投资者、上市公司等在持续的优胜劣汰，形成非常良好的运行机制。越来越多具备长期发展竞争力的企业上市，这将是我们的长期收益率的主要来源。

4.5.2 本基金下阶段投资策略

目前市场整体估值水平已经从19年初绝对低估涨到目前整体比较合理的状态，但市场内部结构分化显著，这是经济增速放缓、产业结构分化的必然结果。从我们投资者角度而言，既要看到高景气行业中的公司竞争力优势，也要关注其行业周期波动的风险；而对于相对低估的行业，如果回避其估值陷阱的风险，则有机会为我们贡献稳健而丰厚的回报。

基于我们对产业的分析，我们后期会重点关注中国的制造业和科技产业的产业升级的机会，对研发投入效率高、竞争格局良好、具备优秀的管理团队的公司会更长期的关注，而合理的估值仍然是我们投资中需要遵守的原则。

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6月30日，期末可供分配利润为973,365,764.85元，其中：未分配利润已实现部分为973,365,764.85元，未分配利润未实现部分为1,199,785,062.15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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 中期财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：泓德瑞兴三年持有期混合型证券投资基金

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
资 产:			
银行存款	6.4.7.1	282,697,442.79	238,851,793.77
结算备付金		1,624,422.85	3,069,272.10
存出保证金		901,462.58	1,470,383.95
交易性金融资产	6.4.7.2	9,234,536,731.87	7,141,685,994.24
其中：股票投资		8,783,943,885.24	6,844,359,994.24
基金投资		-	-
债券投资		450,592,846.63	297,326,000.00
资产支持证券投资		-	-
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		268,692.63	9,830,252.38
应收利息	6.4.7.5	6,508,689.25	4,307,244.53
应收股利		3,654,467.73	484,800.00
应收申购款		718,959.45	2,494,894.97
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		9,530,910,869.15	7,402,194,635.94
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		14,023,820.14	5,083,111.27
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		11,539,461.89	8,832,812.99
应付托管费		1,923,243.66	1,472,135.49
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,596,256.53	973,243.52
应交税费		13.32	5.70
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	119,014.74	156,000.00
负债合计		29,201,810.28	16,517,308.97
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	7,328,558,231.87	6,101,539,086.48
未分配利润	6.4.7.10	2,173,150,827.00	1,284,138,240.49
所有者权益合计		9,501,709,058.87	7,385,677,326.97
负债和所有者权益总计		9,530,910,869.15	7,402,194,635.94

注：1. 报告截止日2021年06月30日，基金份额净值1.2965元，基金份额总额7,328,558,231.87份。
2. 本基金合同于2020年07月14日生效，上年度财务报表的实际编制期间为2020年07月14日至2020年12月31日。

6.2 利润表

会计主体：泓德瑞兴三年持有期混合型证券投资基金

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0 6月30日
一、收入		619,660,282.67
1. 利息收入		6,210,484.61
其中：存款利息收入	6.4.7.11	742,808.99
债券利息收入		5,153,563.57
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		314,112.05

证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		764,809,305.25
其中：股票投资收益	6.4.7.12	716,977,986.55
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	3,453,284.06
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	44,378,034.64
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-151,359,507.19
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	-
减：二、费用		87,526,808.15
1. 管理人报酬		66,883,924.67
2. 托管费		11,147,320.82
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.18	9,342,771.44
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		14.29
7. 其他费用	6.4.7.19	152,776.93
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		532,133,474.52
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		532,133,474.52

注：本基金合同于2020年07月14日生效，无上年度可比期间。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泓德瑞兴三年持有期混合型证券投资基金

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)	6,101,539,086.48	1,284,138,240.49	7,385,677,326.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	532,133,474.52	532,133,474.52
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)	1,227,019,145.39	356,879,111.99	1,583,898,257.38
其中：1. 基金申购款	1,227,019,145.39	356,879,111.99	1,583,898,257.38
2. 基金赎回款	-	-	-
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)	7,328,558,231.87	2,173,150,827.00	9,501,709,058.87

注：本基金合同于2020年07月14日生效，无上年度可比期间。

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

泓德瑞兴三年持有期混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2020]381号《关于准予泓德瑞兴三年持有期混合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《泓德瑞兴三年持有期混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，对于每份基金份额，锁定期从起始日开始，至起始日次三年的年度对日的前一日止。在锁定期内，基金份额持有人不能提出赎回申请，锁定期届满后的下一个工作日起可以提出赎回申请。对于每份认购份额，起始日指基金合同生效日；对于每份申购份额，起始日指该基金份额申购申请确认日。年度对日指某一日期在后续日历年中的对应日期，若该对应日为非工作日或该日历年实际不存在对应日期的，则顺延至下一工作日。存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集5,942,070,680.87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(2020)第0573号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泓德瑞兴三年持有期混合型证券投资基金基金合同》于2020年7月14日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为5,942,070,680.87份，其中认购资金利息折合0.00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，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泓德瑞兴三年持有期混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资目标为在严格控制风险的前提下，通过合理的资产配置，综合运用多种投资策略，力争实现基金资产的长期稳健增值。本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、港股通机制下允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债、可转换债券、可交换债券、证券公司短期公司债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资于其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为60%-95%，其中投资于港股通标的股票占股票资产的比例不超过50%。每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证800指数收益率×70%+中证港股通综合指数收益率×10%+中国债券综合全价指数收益率×20%。

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》、《泓德瑞兴三年持有期混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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,以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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	282,697,442.79
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	282,697,442.79

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		7,875,420,210.47	8,783,943,885.24	908,523,674.77
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	14,394,700.00	14,395,846.63	1,146.63
	银行间市场	435,817,415.00	436,197,000.00	379,585.00
	合计	450,212,115.00	450,592,846.63	380,731.63
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		8,325,632,325.47	9,234,536,731.87	908,904,406.40

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	29,553.36
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	8,831.13
应收债券利息	6,469,625.36

应收资产支持证券利息	—
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	679.40
合计	6,508,689.25

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	1,595,056.53
银行间市场应付交易费用	1,200.00
合计	1,596,256.53

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	119,014.74
合计	119,014.74

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
----	-------------------------------

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	6,101,539,086.48	6,101,539,086.48
本期申购	1,227,019,145.39	1,227,019,145.39
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	7,328,558,231.87	7,328,558,231.87

注：申购含转换入份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	208,617,465.58	1,075,520,774.91	1,284,138,240.49
本期利润	683,492,981.71	-151,359,507.19	532,133,474.52
本期基金份额交易产生的变动数	81,255,317.56	275,623,794.43	356,879,111.99
其中：基金申购款	81,255,317.56	275,623,794.43	356,879,111.99
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	973,365,764.85	1,199,785,062.15	2,173,150,827.00

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	604,526.49
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	114,860.27
其他	23,422.23
合计	742,808.99

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	2,812,706,843.09
减：卖出股票成本总额	2,095,728,856.54
买卖股票差价收入	716,977,986.55

6.4.7.13 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	164,657,750.32
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	156,777,450.00
减：应收利息总额	4,427,016.26
买卖债券差价收入	3,453,284.06

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

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
股票投资产生的股利收益	44,378,034.64
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	44,378,034.64

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	-151,359,507.19

——股票投资	-152,164,503.82
——债券投资	804,996.63
——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	-151,359,507.19

6.4.7.17 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

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	9,340,871.44
银行间市场交易费用	1,900.00
合计	9,342,771.44

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	59,507.37
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	21,162.19
账户维护费	12,000.00

开户费	400.00
其他	200.00
合计	152,776.93

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
招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）	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
当期发生的基金应支付的管理费	66,883,924.67
其中：支付销售机构的客户维护费	30,426,437.12

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1.50%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 × 1.50% / 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
当期发生的基金应支付的托管费	11,147,320.82

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%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×0.25%/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

本基金的管理人于本报告期内未运用固有资金投资本基金。

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

本报告期末及上年度末除管理人之外的其他关联方未投资本基金。

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	
	期末余额	当期利息收入
招商银行	282,697,442.79	604,526.49

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，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	证券	成功	可流	流通	认购	期末	数量	期末	期末	备注

代码	名称	认购 日	通日	受限 类型	价格	估值 单价	(单 位: 股)	成本 总额	估值 总额	
0003 38	潍柴 动力	2021 -05- 27	2021 -12- 01	限售 股	16.4 0	16.7 5	15,40 6,427	252, 665, 402. 80	258, 057, 652. 25	-
3006 28	亿联 网络	2021 -01- 21	2021 -07- 21	限售 股	76.4 2	81.4 4	588,80 0	44,9 96,0 96.0 0	47,9 51,8 72.0 0	-
6038 66	桃李 面包	2021 -01- 28	2021 -07- 28	限售 股	53.4 0	30.7 5	1,260, 000	48,0 60,0 00.0 0	38,7 45,0 00.0 0	备注6 (1)
6009 05	三峡 能源	2021 -06- 02	2021 -12- 10	限售 股	2.65	5.67	907,76 3	2,40 5,57 1.95	5,14 7,01 6.21	-
6881 31	皓元 医药	2021 -06- 01	2021 -12- 08	限售 股	64.9 9	247. 10	1,955	127, 055. 45	483, 080. 50	-
6886 87	凯因 科技	2021 -01- 29	2021 -08- 09	限售 股	18.9 8	27.9 8	5,354	101, 618. 92	149, 804. 92	-
3009 19	中伟 股份	2020 -12- 15	2021 -07- 02	限售 股	24.6 0	163. 00	610	15,0 06.0 0	99,4 30.0 0	-
6886 28	优利 德	2021 -01- 22	2021 -08- 02	限售 股	19.1 1	32.6 2	2,789	53,2 97.7 9	90,9 77.1 8	-
6886 07	康众 医疗	2021 -01- 25	2021 -08- 02	限售 股	23.2 1	44.5 0	1,890	43,8 66.9 0	84,1 05.0 0	-
6884	利元	2021	2021	新股	38.8	38.8	2,149	83,4	83,4	-

99	亨	-06- 23	-07- 01	未上 市	5	5		88.6 5	88.6 5	
3009 79	华利 集团	2021 -04- 15	2021 -10- 26	限售 股	33.2 2	87.5 0	925	30,7 28.5 0	80,9 37.5 0	-
6883 28	深科 达	2021 -03- 01	2021 -09- 09	限售 股	16.4 9	37.7 9	1,499	24,7 18.5 1	56,6 47.2 1	-
6880 87	英科 再生	2021 -06- 30	2021 -07- 09	新股 未上 市	21.9 6	21.9 6	2,469	54,2 19.2 4	54,2 19.2 4	-
6881 95	腾景 科技	2021 -03- 18	2021 -09- 27	限售 股	13.6 0	19.8 7	2,693	36,6 24.8 0	53,5 09.9 1	-
6886 55	迅捷 兴	2021 -04- 28	2021 -11- 11	限售 股	7.59	15.7 7	3,083	23,3 99.9 7	48,6 18.9 1	-
3010 17	漱玉 平民	2021 -06- 23	2021 -07- 05	新股 未上 市	8.86	8.86	4,995	44,2 55.7 0	44,2 55.7 0	-
3009 73	立高 食品	2021 -04- 08	2021 -10- 15	限售 股	28.2 8	115. 71	360	10,1 80.8 0	41,6 55.6 0	-
3010 21	英诺 激光	2021 -06- 28	2021 -07- 06	新股 未上 市	9.46	9.46	2,609	24,6 81.1 4	24,6 81.1 4	-
3009 53	震裕 科技	2021 -03- 11	2021 -09- 22	限售 股	28.7 7	99.8 5	240	6,90 4.80	23,9 64.0 0	-
3010 09	可靠 股份	2021 -06- 08	2021 -12- 17	限售 股	12.5 4	27.8 9	801	10,0 44.5 4	22,3 39.8 9	-
3009	创识	2021	2021	限售	21.3	49.9	399	8,50	19,9	-

41	科技	-02-02	-08-09	股	1	4		2.69	26.06	
301015	百洋医药	2021-06-22	2021-12-30	限售股	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
688226	威腾电气	2021-06-28	2021-07-07	新股未上市	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
300982	苏文电能	2021-04-19	2021-10-27	限售股	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300940	南极光	2021-01-27	2021-08-03	限售股	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300614	百川畅银	2021-05-18	2021-11-25	限售股	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300937	药易购	2021-01-20	2021-07-27	限售股	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
301013	利和兴	2021-06-21	2021-12-29	限售股	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-
300942	易瑞生物	2021-02-02	2021-08-09	限售股	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300933	中辰股份	2021-01-15	2021-07-22	限售股	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
301002	崧盛股份	2021-05-27	2021-12-07	限售股	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
6052	德才	2021	2021	新股	31.5	31.5	349	11,0	11,0	-

87	股份	-06-28	-07-06	未上市	6	6		14.44	14.44	
300955	嘉亨家化	2021-03-16	2021-09-24	限售股	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300996	普联软件	2021-05-26	2021-12-03	限售股	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300956	英力股份	2021-03-16	2021-09-27	限售股	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
300962	中金辐照	2021-03-29	2021-10-11	限售股	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300952	恒辉安防	2021-03-03	2021-09-13	限售股	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
301016	雷尔伟	2021-06-23	2021-12-30	限售股	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
300966	共同药业	2021-03-31	2021-10-11	限售股	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300945	曼卡龙	2021-02-03	2021-08-10	限售股	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021-02-18	2021-08-25	限售股	13.00	27.42	324	2,808.00	8,884.08	备注6(2)
300931	通用电梯	2021-01-13	2021-07-21	限售股	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
3009	深水	2021	2021	限售	8.48	22.0	394	3,34	8,69	-

61	海纳	-03-23	-09-30	股		7		1.12	5.58	
300950	德固特	2021-02-24	2021-09-03	限售股	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
605162	新中港	2021-06-29	2021-07-07	新股未上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
300958	建工修复	2021-03-18	2021-09-29	限售股	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300986	志特新材	2021-04-21	2021-11-01	限售股	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网传媒	2021-04-28	2021-11-11	限售股	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300978	东箭科技	2021-04-15	2021-10-26	限售股	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-07-12	限售股	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300993	玉马遮阳	2021-05-17	2021-11-24	限售股	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300930	屹通新材	2021-01-13	2021-07-21	限售股	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300985	致远新能	2021-04-21	2021-10-29	限售股	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-
3009	博亚	2021	2021	限售	18.2	28.2	245	4,46	6,93	-

71	精工	-04-07	-10-15	股	4	9		8.80	1.05	
301004	嘉益股份	2021-06-18	2021-12-27	限售股	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-
300991	创益通	2021-05-12	2021-11-22	限售股	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300927	江天化学	2020-12-29	2021-07-07	限售股	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300975	商络电子	2021-04-14	2021-10-21	限售股	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300963	中洲特材	2021-03-30	2021-10-11	限售股	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
301011	华立科技	2021-06-09	2021-12-17	限售股	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
300943	春晖智控	2021-02-03	2021-08-10	限售股	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300967	晓鸣股份	2021-04-02	2021-10-13	限售股	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300972	万辰生物	2021-04-08	2021-10-19	限售股	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300929	华骐环保	2021-01-12	2021-07-21	限售股	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
3009	通业	2021	2021	限售	12.0	23.0	234	2,82	5,39	-

60	科技	-03-22	-09-29	股	8	6		6.72	6.04	
301017	漱玉平民	2021-06-23	2022-01-05	新股未上市且限售	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30	-
300995	奇德新材	2021-05-17	2021-11-26	限售股	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
301007	德迈仕	2021-06-04	2021-12-16	限售股	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
300998	宁波方正	2021-05-25	2021-12-02	限售股	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301012	扬电科技	2021-06-15	2021-12-22	限售股	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
300992	泰福泵业	2021-05-17	2021-11-25	限售股	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
301010	晶雪节能	2021-06-09	2021-12-20	限售股	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	新股未上市且限售	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
1136	伯特	2021	2021	新债	100.	100.	143,91	14,3	14,3	-

26	转债	-06- 30	-07- 21	未上 市	00	00	0	91,0 00.0 0	91,0 00.0 0	
----	----	------------	------------	---------	----	----	---	-------------------	-------------------	--

注：1、根据中国证监会《上市公司证券发行管理办法》、《创业板上市公司证券发行管理暂行办法》以及《上市公司非公开发行股票实施细则》、《关于修改〈上市公司证券发行管理办法〉的决定》、《关于修改〈创业板上市公司证券发行管理暂行办法〉的决定》以及《关于修改〈上市公司非公开发行股票实施细则〉的决定》，本基金所认购的2020年2月14日(含)后发行完毕的非公开发行股票，自发行结束之日起6个月内不得转让。

2、根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后6个月内，不得转让所受让的股份。

3、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后6个月内不得转让。

4、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于6个月的限售期。

5、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6、上述流通受限股票持有期间分红情况如下：

(1) 该股票于2021年5月11日实施权益分派方案：每股派1.00元人民币现金（含税）；同时，以资本公积向全体股东每股转增0.40股。

(2) 该股票于2021年6月4日实施权益分派方案：每10股派0.80元人民币现金（含税）；同时，以资本公积向全体股东每10股转增5股。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险

限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

于本报告期期末，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为0.15%(上年度末：0.02%)。

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。

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司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，本基金主动投资于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。

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	282,697,442.79	-	-	-	282,697,442.79
结算备付金	1,624,422.85	-	-	-	1,624,422.85
存出保证金	901,462.58	-	-	-	901,462.58
交易性金融资产	436,197,000.00	-	14,395,846.63	8,783,943,885.24	9,234,536,731.87
应收证券清算款	-	-	-	268,692.63	268,692.63
应收利息	-	-	-	6,508,689.25	6,508,689.25
应收股利	-	-	-	3,654,467.73	3,654,467.73
应收申购款	-	-	-	718,959.45	718,959.45
资产总计	721,420,328.22	-	14,395,846.63	8,795,094,694.30	9,530,910,869.15
负债					
应付证券清算款	-	-	-	14,023,820.14	14,023,820.14
应付管理人报	-	-	-	11,539,461.89	11,539,461.89

酬					
应付托管费	-	-	-	1,923,243.66	1,923,243.66
应付交易费用	-	-	-	1,596,256.53	1,596,256.53
应交税费	-	-	-	13.32	13.32
其他负债	-	-	-	119,014.74	119,014.74
负债总计	-	-	-	29,201,810.28	29,201,810.28
利率敏感度缺口	721,420,328.22	-	14,395,846.63	8,765,892,884.02	9,501,709,058.87
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	238,851,793.77	-	-	-	238,851,793.77
结算备付金	3,069,272.10	-	-	-	3,069,272.10
存出保证金	1,470,383.95	-	-	-	1,470,383.95
交易性金融资产	295,631,000.00	-	1,695,000.00	6,844,359,994.24	7,141,685,994.24
应收证券清算款	-	-	-	9,830,252.38	9,830,252.38
应收利息	-	-	-	4,307,244.53	4,307,244.53
应收股利	-	-	-	484,800.00	484,800.00
应收申购款	-	-	-	2,494,894.97	2,494,894.97
资产总计	539,022,449.82	-	1,695,000.00	6,861,477,186.12	7,402,194,635.94
负债					
应付证券清算款	-	-	-	5,083,111.27	5,083,111.27
应付管	-	-	-	8,832,812.99	8,832,812.99

理人报酬					
应付托管费	-	-	-	1,472,135.49	1,472,135.49
应付交易费用	-	-	-	973,243.52	973,243.52
应交税费	-	-	-	5.70	5.70
其他负债	-	-	-	156,000.00	156,000.00
负债总计	-	-	-	16,517,308.97	16,517,308.97
利率敏感度缺口	539,022,449.82	-	1,695,000.00	6,844,959,877.15	7,385,677,326.97

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期期末，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 4.74%(上年度末：4.03%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(上年度末：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	2,046,693,310.82	-	2,046,693,310.82
应收股利	-	3,654,467.73	-	3,654,467.73
资产合计	-	2,050,347,778.55	-	2,050,347,778.55

以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	2,050,347.77 8.55	-	2,050,347.77 8.55
项目	上年度末 2020年12月31日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	1,358,935,625.74	-	1,358,935,625.74
应收股利	-	484,800.00	-	484,800.00
资产合计	-	1,359,420,425.74	-	1,359,420,425.74
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	1,359,420,425.74	-	1,359,420,425.74

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除外汇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
	港币相对人民币升值5%	102,517,388.93	67,971,021.29
	港币相对人民币贬值5%	-102,517,388.93	-67,971,021.29

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	8,783,943,885.24	92.45	6,844,359,994.24	92.67
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	8,783,943,885.24	92.45	6,844,359,994.24	92.67

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金成立尚未满一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

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6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一层次的余额为8,432,147,263.37元，属于第二层次的余额为802,389,468.50元，无属于第三层次的余额(2020年12月31日：第一层次6,660,708,600.46元，第二层次480,977,393.78元，无第三层次)。

(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

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2021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(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	8,783,943,885.24	92.16

	其中：股票	8,783,943,885.24	92.16
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	450,592,846.63	4.73
	其中：债券	450,592,846.63	4.73
	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	284,321,865.64	2.98
8	其他各项资产	12,052,271.64	0.13
9	合计	9,530,910,869.15	100.00

注：本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币2,046,693,310.82元，占期末净值比例21.54%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	11,290.28	0.00
B	采矿业	177,483,408.24	1.87
C	制造业	4,518,284,560.47	47.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,160,036.60	0.05
E	建筑业	25,371.37	0.00
F	批发和零售业	146,619.48	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	286,560,007.60	3.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	192,032,080.52	2.02
J	金融业	826,047,768.77	8.69
K	房地产业	611,485,634.40	6.44
L	租赁和商务服务业	-	-

M	科学研究和技术服务业	66,440,354.40	0.70
N	水利、环境和公共设施管理业	44,438.33	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	53,501,978.96	0.56
R	文化、体育和娱乐业	27,025.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	6,737,250,574.42	70.91

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例(%)
非日常生活消费品	361,320.00	0.00
日常消费品	79,531,210.00	0.84
医疗保健	100,797,770.00	1.06
信息技术	1,115,945,699.82	11.74
电信服务	408,326,979.00	4.30
地产业	341,730,332.00	3.60
合计	2,046,693,310.82	21.54

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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	000002	万科A	17,073,104	406,510,606.24	4.28
1	02202	万科企业	8,960,600	181,183,332.00	1.91
2	01810	小米集团-W	21,670,400	486,933,888.00	5.12
3	300750	宁德时代	856,990	458,318,252.00	4.82
4	000338	潍柴动力	25,475,863	437,998,473.57	4.61
5	02382	舜宇光学科技	2,059,578	420,545,231.82	4.43
6	00700	腾讯控股	840,300	408,326,979.00	4.30
7	002142	宁波银行	8,784,113	342,316,883.61	3.60
8	600309	万华化学	3,075,198	334,643,046.36	3.52

9	601636	旗滨集团	16,270,797	301,985,992.32	3.18
10	601021	春秋航空	5,036,204	286,560,007.60	3.02
11	000725	京东方 A	39,681,700	247,613,808.00	2.61
12	601233	桐昆股份	10,105,894	243,450,986.46	2.56
13	000001	平安银行	10,660,280	241,135,533.60	2.54
14	603596	伯特利	6,503,066	232,484,609.50	2.45
15	603345	安井食品	861,574	218,857,027.48	2.30
16	603228	景旺电子	8,054,787	211,035,419.40	2.22
17	00268	金蝶国际	9,506,000	208,466,580.00	2.19
18	600048	保利地产	17,024,504	204,975,028.16	2.16
19	601318	中国平安	3,041,627	195,515,783.56	2.06
20	002600	领益智造	20,900,503	192,075,622.57	2.02
21	300003	乐普医疗	5,799,991	186,295,710.92	1.96
22	601966	玲珑轮胎	4,195,948	183,530,765.52	1.93
23	300628	亿联网络	2,076,895	172,654,233.00	1.82
24	00960	龙湖集团	4,435,000	160,547,000.00	1.69
25	300558	贝达药业	1,294,817	140,150,992.08	1.48
26	601899	紫金矿业	12,919,900	125,193,831.00	1.32
27	300188	美亚柏科	6,862,900	119,414,460.00	1.26
28	688157	松井股份	857,103	106,846,459.98	1.12
29	603160	汇顶科技	785,456	101,818,661.28	1.07
30	688029	南微医学	305,646	95,266,801.74	1.00
31	603866	桃李面包	2,302,677	71,276,522.40	0.75
32	603259	药明康德	421,210	65,957,273.90	0.69
33	002609	捷顺科技	6,472,116	64,785,881.16	0.68
34	01801	信达生物	856,500	64,528,710.00	0.68
35	600779	水井坊	494,900	62,530,615.00	0.66
36	002353	杰瑞股份	1,343,336	60,047,119.20	0.63
37	002831	裕同科技	1,943,246	57,694,973.74	0.61
38	600487	亨通光电	4,879,147	55,622,275.80	0.59
39	603882	金域医学	333,648	53,306,940.96	0.56

40	601012	隆基股份	587,160	52,163,294.40	0.55
41	603515	欧普照明	1,959,600	50,302,932.00	0.53
42	601658	邮储银行	9,378,400	47,079,568.00	0.50
43	06186	中国飞鹤	3,002,000	41,877,900.00	0.44
44	603727	博迈科	2,238,942	40,793,523.24	0.43
45	00291	华润啤酒	648,000	37,609,920.00	0.40
46	02269	药明生物	305,500	36,171,200.00	0.38
47	603290	斯达半导	98,000	31,360,000.00	0.33
48	002938	鹏鼎控股	811,300	29,109,444.00	0.31
49	600176	中国巨石	1,738,036	26,956,938.36	0.28
50	601100	恒立液压	300,000	25,776,000.00	0.27
51	300470	中密控股	577,207	22,303,278.48	0.23
52	600582	天地科技	5,046,033	19,679,528.70	0.21
53	603659	璞泰来	116,553	15,921,139.80	0.17
54	300760	迈瑞医疗	32,200	15,457,610.00	0.16
55	603338	浙江鼎力	227,784	13,368,642.96	0.14
56	000983	山西焦煤	1,383,400	11,496,054.00	0.12
57	688050	爱博医疗	30,372	11,473,934.16	0.12
58	002920	德赛西威	95,500	10,512,640.00	0.11
59	688299	长阳科技	347,399	9,372,825.02	0.10
60	300768	迪普科技	196,382	7,586,236.66	0.08
61	002812	恩捷股份	23,867	5,587,264.70	0.06
62	600905	三峡能源	907,763	5,147,016.21	0.05
63	002475	立讯精密	18,300	841,800.00	0.01
64	600276	恒瑞医药	8,760	595,417.20	0.01
65	600809	山西汾酒	1,100	492,800.00	0.01
66	300124	汇川技术	6,600	490,116.00	0.01
67	688131	皓元医药	1,955	483,080.50	0.01
68	603288	海天味业	3,250	419,087.50	0.00
69	002138	顺络电子	9,600	372,192.00	0.00
70	03690	美团-W	1,100	293,260.00	0.00

71	300782	卓胜微	540	290,250.00	0.00
72	601799	星宇股份	1,100	248,292.00	0.00
73	300122	智飞生物	1,300	242,749.00	0.00
74	603517	绝味食品	2,800	236,012.00	0.00
75	600132	重庆啤酒	1,100	217,745.00	0.00
76	600519	贵州茅台	100	205,670.00	0.00
77	002624	完美世界	7,500	179,325.00	0.00
78	688687	凯因科技	5,354	149,804.92	0.00
79	603501	韦尔股份	400	128,800.00	0.00
80	000858	五 粮 液	400	119,156.00	0.00
81	002511	中顺洁柔	4,000	110,200.00	0.00
82	002050	三花智控	4,400	105,512.00	0.00
83	002078	太阳纸业	7,700	102,795.00	0.00
84	002841	视源股份	800	99,432.00	0.00
85	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.00
86	002044	美年健康	10,800	98,388.00	0.00
87	01951	锦欣生殖	6,000	97,860.00	0.00
88	300347	泰格医药	500	96,650.00	0.00
89	688628	优利德	2,789	90,977.18	0.00
90	300408	三环集团	2,000	84,840.00	0.00
91	688607	康众医疗	1,890	84,105.00	0.00
92	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.00
93	300979	华利集团	925	80,937.50	0.00
94	06862	海底捞	2,000	68,060.00	0.00
95	688557	兰剑智能	1,812	60,973.80	0.00
96	688328	深科达	1,499	56,647.21	0.00
97	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
98	688195	腾景科技	2,693	53,509.91	0.00
99	603939	益丰药房	910	51,041.90	0.00
100	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.00
101	688655	迅捷兴	3,083	48,618.91	0.00

102	01579	颐海国际	1,000	43,390.00	0.00
103	300894	火星人	628	42,704.00	0.00
104	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
105	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
106	300251	光线传媒	2,500	27,025.00	0.00
107	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
108	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
109	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
110	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
111	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
112	300908	仲景食品	285	16,983.15	0.00
113	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00
114	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
115	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
116	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
117	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
118	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
119	301013	利和兴	471	12,768.81	0.00
120	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
121	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
122	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
123	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
124	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
125	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
126	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
127	300922	天秦装备	287	9,996.21	0.00
128	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
129	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
130	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
131	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
132	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00

133	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
134	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
135	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
136	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
137	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
138	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
139	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
140	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
141	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
142	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
143	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
144	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
145	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
146	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
147	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
148	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
149	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
150	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
151	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
152	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
153	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
154	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
155	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
156	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
157	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
158	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
159	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
160	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
161	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
162	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
163	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00

164	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
165	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00

注：对于同时在A+H股上市的股票，合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

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	000338	潍柴动力	399,453,654.45	5.41
2	01810	小米集团－W	272,814,585.88	3.69
3	002600	领益智造	252,537,701.45	3.42
4	02202	万科企业	213,117,135.42	2.89
5	601318	中国平安	185,832,506.32	2.52
6	00700	腾讯控股	173,202,994.46	2.35
7	601636	旗滨集团	150,757,678.82	2.04
8	300628	亿联网络	141,962,631.37	1.92
9	600048	保利地产	139,255,655.25	1.89
10	600309	万华化学	136,207,236.72	1.84
11	000001	平安银行	125,528,601.08	1.70
12	603596	伯特利	118,276,747.36	1.60
13	00960	龙湖集团	107,907,802.49	1.46
14	601966	玲珑轮胎	103,448,331.50	1.40
15	603160	汇顶科技	96,834,505.45	1.31
16	00268	金蝶国际	81,800,953.02	1.11
17	300188	美亚柏科	81,373,283.90	1.10
18	603345	安井食品	79,065,169.45	1.07
19	02382	舜宇光学科技	77,810,567.35	1.05
20	000725	京东方A	77,269,165.00	1.05

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	300750	宁德时代	306,132,132.17	4.14
2	600779	水井坊	288,384,442.64	3.90
3	02382	舜宇光学科技	216,378,299.32	2.93
4	600309	万华化学	198,346,164.27	2.69
5	603259	药明康德	183,643,608.26	2.49
6	601318	中国平安	176,376,949.70	2.39
7	603659	璞泰来	149,963,779.67	2.03
8	02269	药明生物	147,614,193.66	2.00
9	603866	桃李面包	145,063,457.61	1.96
10	000001	平安银行	119,650,400.44	1.62
11	000338	潍柴动力	117,191,411.79	1.59
12	600741	华域汽车	83,348,040.64	1.13
13	601899	紫金矿业	73,314,363.39	0.99
14	601233	桐昆股份	52,523,421.00	0.71
15	300558	贝达药业	50,376,871.00	0.68
16	688029	南微医学	45,310,768.28	0.61
17	300760	迈瑞医疗	43,888,108.59	0.59
18	600438	通威股份	42,510,558.72	0.58
19	603345	安井食品	41,279,330.72	0.56
20	002812	恩捷股份	34,384,660.07	0.47

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	4,187,477,251.36
卖出股票收入（成交）总额	2,812,706,843.09

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	436,197,000.00	4.59
	其中：政策性金融债	436,197,000.00	4.59
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	14,395,846.63	0.15
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	450,592,846.63	4.74

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	200409	20农发09	1,000,000	100,190,000.00	1.05
2	200309	20进出09	1,000,000	100,040,000.00	1.05
3	190403	19农发03	500,000	50,225,000.00	0.53
4	150412	15农发12	400,000	40,556,000.00	0.43
5	190306	19进出06	300,000	30,210,000.00	0.32

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 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 报告期内本基金投资的前十名证券除腾讯控股（证券代码：00700）、宁波银行（证券代码：002142）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。2021年6月10日，宁波银行发行人宁波银行股份有限公司因代理销售保险不规范被中国银行保险监督管理委员会宁波监管局罚款人民币25万元，并责令该行对相关直接责任人员给予纪律处分。2020年10月16日，宁波银行发行人宁波银行股份有限公司因授信业务未履行关系人回避制度、贷后管理不到位被中国银行保险监督管理委员会宁波监管局罚款人民币30万元，并责令该行对贷后管理不到位直接责任人员给予纪律处分。2021年3月12日，腾讯控股发行人腾讯控股有限公司因存在下列情况被国家市场监督管理总局给予腾讯50万元人民币罚款的行政处罚。（一）构成未依法申报违法实施的经营者集中。（二）不具有排除、限制竞争的效果。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视为，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。

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	901,462.58
2	应收证券清算款	268,692.63
3	应收股利	3,654,467.73
4	应收利息	6,508,689.25
5	应收申购款	718,959.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	12,052,271.64

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	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000338	潍柴动力	258,057,652.25	2.72	非公开发行股票

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
71,172	102,969.68	3,439,796.25	0.05%	7,325,118,435.62	99.95%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	10,394,978.37	0.1418%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	>100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2020年07月14日)基金份额总额	5,942,070,680.87
本报告期期初基金份额总额	6,101,539,086.48
本报告期基金总申购份额	1,227,019,145.39
减：本报告期基金总赎回份额	—
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	7,328,558,231.87

注：总申购份额含转换入份额。

§ 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

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	
中信证券	2	2,652,771,772.64	39.39%	1,874,585.70	39.37%	—
中信建投 证券	2	2,891,522,293.31	42.94%	2,042,403.54	42.90%	—
长城证券	1	159,301,516.64	2.37%	113,311.55	2.38%	—
长江证券	1	319,233,920.12	4.74%	227,068.81	4.77%	—
广发证券	2	71,442,458.59	1.06%	50,816.26	1.07%	—
海通证券	2	639,594,819.60	9.50%	452,806.48	9.51%	—
华安证券	1	—	—	—	—	—
东方证券	2	—	—	—	—	—
东兴证券	2	—	—	—	—	—
东亚前海 证券	2	—	—	—	—	—
方正证券	2	—	—	—	—	—
开源证券	2	—	—	—	—	—
太平洋证 券	2	—	—	—	—	—
信达证券	2	—	—	—	—	—
中国中金 财富证券	2	—	—	—	—	—
中泰证券	2	—	—	—	—	—

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

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：海通证券、华安证券、方正证券、东亚前海证券、长城证
券、中国中金财富证券、东方证券、开源证券

(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
中信证券	5,722,060.32	28.28%	-	-	-	-	-	-
中信建投 证券	1,746,839.30	8.63%	-	-	-	-	-	-
长城证券	12,765,850.70	63.09%	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东亚前海	-	-	-	-	-	-	-	-

证券								
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中国中金财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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泓德瑞兴三年持有期混合型证券投资基金基金经理变更公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2021-01-04
2	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加交通银行股份有限公司为销售机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2021-01-13
3	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加光大证券股份有限公司为销售机构及参与其费率优惠的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2021-01-16
4	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加北京恒天明泽基金销售有限公司为销售机构及开通定投和转换业务的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2021-01-19
5	泓德基金管理有限公司关于泓德瑞兴三年持有期混合型证券投资基金暂停大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2021-01-22
6	泓德基金管理有限公司关于旗	公司官网、中国证券报、	2021-02-06

	下部分基金增加中国人寿保险股份有限公司为销售机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠的公告	中国证监会基金电子披露网站	
7	泓德基金管理有限公司关于泓德瑞兴三年持有期混合型证券投资基金恢复大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-03
8	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加北京汇成基金销售有限公司为销售机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-31
9	泓德基金管理有限公司关于旗下基金参与北京汇成基金销售有限公司基金转换费率优惠的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-01
10	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加财通证券股份有限公司为销售机构的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-29
11	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中泰证券股份有限公司为销售机构的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-30
12	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、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-30
13	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中信建投期货有限公司为销售机构的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2021-05-20
14	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加第一创业证券股份有限公司为销售机构的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2021-05-28
15	泓德基金管理有限公司关于旗	公司官网、中国证券报、	2021-05-29

	下部分基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会基金电子披露网站	
--	-------------------	---------------	--

§ 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瑞兴三年持有期混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《泓德瑞兴三年持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《泓德瑞兴三年持有期混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《泓德瑞兴三年持有期混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在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

泓德基金管理有限公司
二〇二一年八月二十五日