

# 宏利改革动力量化策略灵活配置混合型证 券投资基金 2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：宏利基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会及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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 29 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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
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	12
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
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>13</b>
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内容的真实、准确和完整发表意见	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	18
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>38</b>
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	49
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	49

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 .....	49
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 .....	50
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 .....	50
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	50
7.12 投资组合报告附注 .....	50
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>51</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	51
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 .....	52
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>52</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>52</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	52
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 .....	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	52
10.4 基金投资策略的改变 .....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	53
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 .....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	53
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>57</b>
11.1 影响投资者决策的其他重要信息 .....	57
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>57</b>
12.1 备查文件目录 .....	57
12.2 存放地点 .....	58
12.3 查阅方式 .....	58

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	宏利改革动力量化策略灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	宏利改革动力混合	
基金主代码	001017	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 2 月 13 日	
基金管理人	宏利基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	67,469,449.42 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	宏利改革动力混合 A	宏利改革动力混合 C
下属分级基金的交易代码	001017	003550
报告期末下属分级基金的份额总额	67,211,754.64 份	257,694.78 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采取大类资产配置策略，同时深入研究各项改革过程中带来的投资机会，采用量化投资方法，力争为基金份额持有人创造持久的、稳定的、较高的超额业绩基准收益。
投资策略	本基金以中国国有企业改革、金融改革、土地改革、企业兼并重组等产生的各类投资机遇为主线，通过量化投资方式精选个股。一方面，本基金在对国内外宏观经济发展趋势、相关政策深入研究的基础上，从“自上而下”的角度对大类资产进行优化配置，并优选收益行业；另一方面，本基金凭借多年来不断积累形成的量化选股框架，从国企改革因子、并购重组因子等方面出发，结合估值、成长、盈利质量、情绪等因子，以“自下而上”的视角精选出具有各项改革可能性、受益于改革的优质公司，力求在抵御各类风险的前提下获取超越平均水平的良好回报。
业绩比较基准	50%*沪深 300 指数收益率+50%*中证综合债指数收益率。
风险收益特征	本基金为混合型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。

### 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	宏利基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	徐娇
	联系电话	66577766
	电子邮箱	irm@manulifefund.com.cn
客户服务电话	400-698-8888	95566

传真	010-66577666	010-66594942
注册地址	北京市朝阳区针织路 23 号楼中国人寿金融中心 6 层 02-07 单元	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	北京市朝阳区针织路 23 号楼中国人寿金融中心 6 层 02-07 单元	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	100026	100818
法定代表人	高贵鑫	葛海蛟

## 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的管理人互联网网址	<a href="https://www.manulifefund.com.cn">https://www.manulifefund.com.cn</a>
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	宏利基金管理有限公司	北京市朝阳区针织路 23 号楼中国人寿金融中心 6 层 02-07 单元

## § 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(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)	
	宏利改革动力混合 A	宏利改革动力混合 C
本期已实现收益	-1,069,732.68	-5,553.24
本期利润	406,580.71	1,800.79
加权平均基金份额本期利润	0.0059	0.0066
本期加权平均净值利润率	0.36%	0.38%
本期基金份额净值增长率	0.32%	0.17%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
	期末可供分配利润	174,552.35
	期末可供分配基金份额利润	0.6774
	39,227,433.11	0.5836

期末基金资产净值	106,439,187.75	432,247.13
期末基金份额净值	1.5836	1.6774
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	87.41%	42.15%

注：1. 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；

2. 所述基金业绩指标不包括基金份额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；

3. 对期末可供分配利润，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。

## 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

宏利改革动力混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.70%	1.01%	0.85%	0.43%	-0.15%	0.58%
过去三个月	-2.76%	0.84%	-1.69%	0.41%	-1.07%	0.43%
过去六个月	0.32%	0.82%	1.08%	0.42%	-0.76%	0.40%
过去一年	-11.75%	0.98%	-5.21%	0.49%	-6.54%	0.49%
过去三年	-0.03%	1.34%	3.20%	0.60%	-3.23%	0.74%
自基金合同生效起至今	87.41%	1.59%	32.69%	0.70%	54.72%	0.89%

宏利改革动力混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.68%	1.01%	0.85%	0.43%	-0.17%	0.58%
过去三个月	-2.83%	0.84%	-1.69%	0.41%	-1.14%	0.43%
过去六个月	0.17%	0.82%	1.08%	0.42%	-0.91%	0.40%

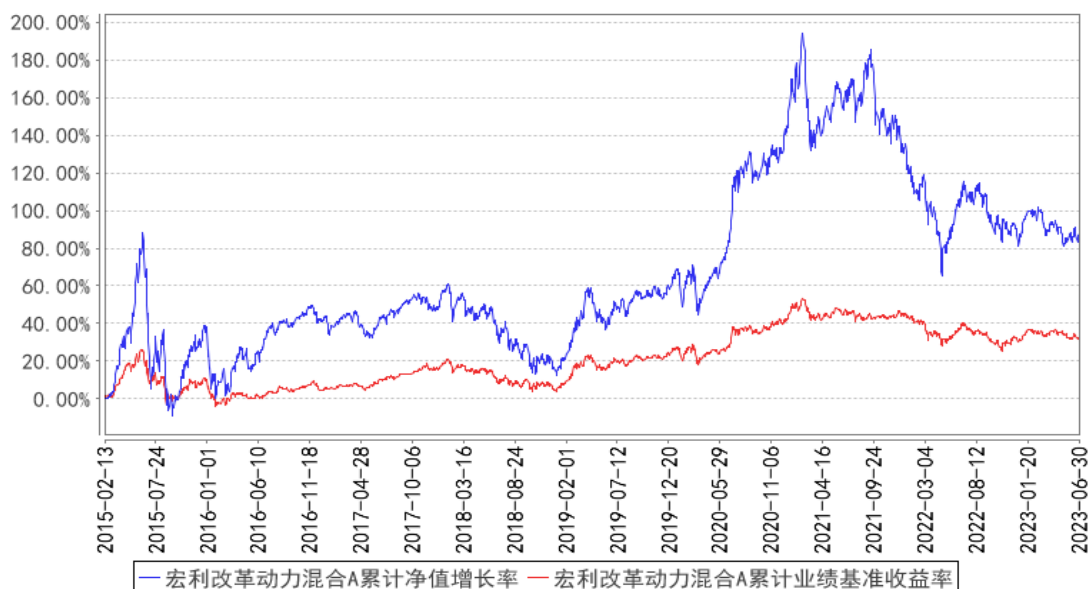
过去一年	-12.01%	0.98%	-5.21%	0.49%	-6.80%	0.49%
过去三年	-1.04%	1.34%	3.20%	0.60%	-4.24%	0.74%
自基金合同生效起至今	42.15%	1.29%	25.68%	0.59%	16.47%	0.70%

注：1、本基金的业绩比较基准：50%\*沪深 300 指数收益率+50%\*中证综合债指数收益率。

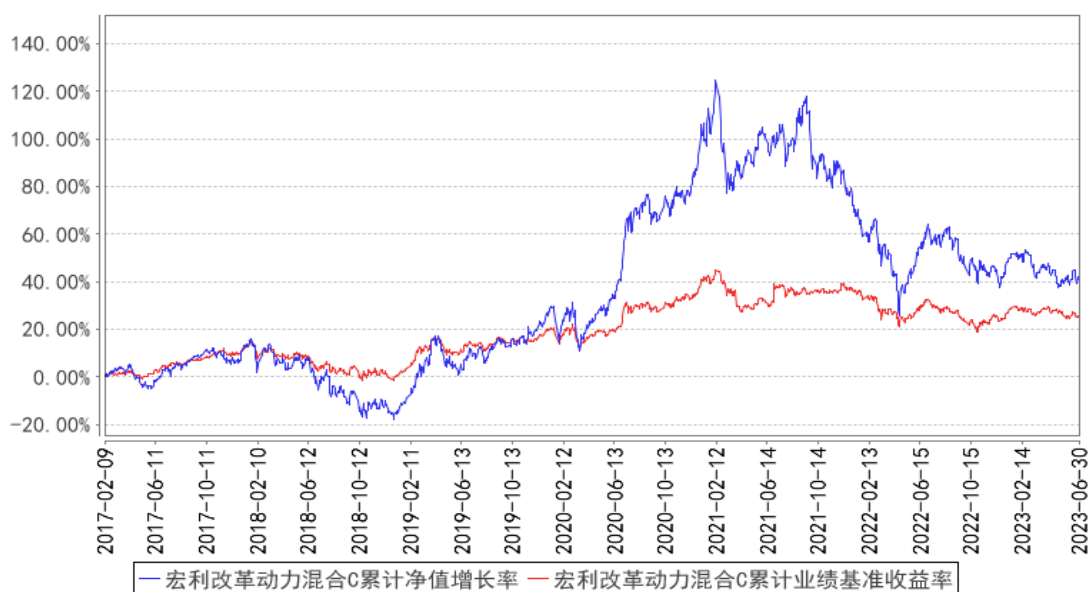
2、本基金 A 类份额成立于 2015 年 2 月 13 日，C 类份额成立于 2017 年 2 月 9 日。

### 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

宏利改革动力混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



宏利改革动力混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金在建仓期结束时及截止报告期末各项投资比例已达到基金合同规定的比例要求。



## § 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

截至报告期末本公司股东及持股比例分别为：宏利投资管理（新加坡）私人有限公司：51%；宏利投资管理（香港）有限公司：49%。

宏利基金管理有限公司原名湘财合丰基金管理有限公司、湘财荷银基金管理有限公司、泰达荷银基金管理有限公司、泰达宏利基金管理有限公司，成立于 2002 年 6 月。截至目前，公司管理着包括宏利价值优化型系列基金、宏利行业精选混合型证券投资基金、宏利风险预算混合型证券投资基金、宏利货币市场基金、宏利效率优选混合型证券投资基金（LOF）、宏利首选企业股票型证券投资基金、宏利市值优选混合型证券投资基金、宏利集利债券型证券投资基金、宏利品质生活灵活配置混合型证券投资基金、宏利红利先锋混合型证券投资基金、宏利沪深 300 指数增强型证券投资基金、宏利领先中小盘混合型证券投资基金、宏利聚利债券型证券投资基金（LOF）、宏利中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）、宏利逆向策略混合型证券投资基金、宏利宏达混合型证券投资基金、宏利淘利债券型证券投资基金、宏利转型机遇股票型证券投资基金、宏利改革动力量化策略灵活配置混合型证券投资基金、宏利复兴伟业灵活配置混合型证券投资基金、宏利新起点灵活配置混合型证券投资基金、宏利蓝筹价值混合型证券投资基金、宏利创益灵活配置混合型证券投资基金、宏利活期友货币市场基金、宏利汇利债券型证券投资基金、宏利睿智稳健灵活配置混合型证券投资基金、宏利京元宝货币市场基金、宏利纯利债券型证券投资基金、宏利溢利债券型证券投资基金、宏利恒利债券型证券投资基金、宏利全能优选混合型基金中基金（FOF）、宏利交利 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、宏利金利 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、宏利绩优增长灵活配置混合型证券投资基金、宏利泽利 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、宏利泰和平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、宏利印度机会股票型证券投资基金（QDII）、宏利永利债券型证券投资基金、宏利消费行业量化精选混合型证券投资基金、宏利中证主要消费红利指数型证券投资基金、宏利泰和稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、宏利价值长青混合型证券投资基金、宏利乐盈 66 个月定期开放债券型证券投资基金、宏利高研发创新 6 个月持有期混合型证券投资基金、宏利波控回报 12 个月持有期混合型证券投资基金、宏利消费服务混合型证券投资基金、宏利新能源股票型证券投资基金、宏利中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金、宏利悠然养老目标日期 2025 一年持有期混合型基金中基金（FOF）、宏利新兴景气龙头混合型证券投资基金、宏利景气领航两年持有期混合型证券投资基金、宏利中短债债券型证券投资基金、宏利先进制造股票型证券投资基金、宏利景气智选 18 个月持有

期混合型证券投资基金、宏利昇利一年定期开放债券型发起式证券投资基金、宏利闽利一年定期开放债券型发起式证券投资基金、宏利悠享养老目标日期 2030 一年持有期混合型基金中基金（FOF）、宏利添盈两年定期开放债券型证券投资基金在内的六十只证券投资基金。

本公司采用团队投资方式，即通过整个投资团队全体人员的共同努力，力求实现基金财产的持续增值。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘欣	总经理助理兼基金经理	2015年2月13日	-	16年	清华大学理学硕士；2007年7月至2008年12月就职于工银瑞信基金管理有限公司；2008年12月至2011年7月就职于嘉实基金管理有限公司；2011年7月加盟宏利基金管理有限公司，曾担任产品与金融工程部高级研究员、金融工程部副总经理、金融工程部总经理、投资副总监，现担任公司总经理助理兼投资总监（权益）兼基金经理；具备16年基金从业经验，16年证券投资管理经验，具有基金从业资格。
李婷婷	本基金基金经理助理	2019年11月18日	-	6年	北京大学金融硕士；2017年7月至今任职于宏利基金管理有限公司，曾任策略投资部助理研究员、研究员，现任基金经理。具备6年基金从业经验，具有基金从业资格。
刘洋	策略投资部副总经理；基金经理助理	2017年4月21日	2023年1月13日	8年	北京大学理学硕士；2015年1月至2015年4月就职于九坤投资（北京）有限公司，2015年5月加入宏利基金管理有限公司，任职于金融工程部，先后担任助理研究员、研究员、基金经理助理、策略投资部总经理助理等职务，现担任策略投资部副总经理兼基金经理；具备8年证券投资管理经验，具有基金从业资格。

注：证券从业的含义遵从监管及行业协会相关规定。表中的任职日期和离任日期均指公司相关公告中披露的日期。

#### 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相关法律法规以及基金合同的约定，本基金运作整体合法合规，没有出现损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本基金管理人建立了公平交易制度和流程，并严格执行制度的规定。在投资管理活动中，本基金管理人公平对待不同投资组合，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和投资决策方面享有平等机会；严格执行投资管理职能和交易执行职能的隔离；在交易环节实行集中交易制度，并确保公平交易可操作、可评估、可稽核、可持续；交易部运用交易系统中设置的公平交易功能并按照时间优先、价格优先的原则严格执行所有指令；对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，交易部按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配，确保各投资组合享有公平的投资机会。风险管理部事后对本报告期的公平交易执行情况进行数量统计、分析。在本报告期内，未发现利益输送、不公平对待不同投资组合的情况。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金管理人建立了异常交易的监控与报告制度，对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控，风险管理部定期对各投资组合的交易行为进行分析评估，向公司风险控制委员会提交公募基金和特定客户资产组合的交易行为分析报告。本报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合的同日反向交易成交较少的单边交易量均不超过该证券当日成交量的 5%。在本报告期内也未发生因异常交易而受到监管机构的处罚情况。

### 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

2023 年上半年 A 股整体呈现震荡剧烈分化格局，股票平均涨幅在 0 上下。就风格而言，非机构重仓小盘股平均上涨幅度达到 20%，而机构重仓股中，消费、新能源等当期业绩较扎实的公司表现较差，受益于新产业趋势的 ChatGPT、AIGC 等概念股涨幅可观，尤其是光模块领域。在低估值领域，中特估等央企股票涨幅较好，而民营企业表现较落后。从整体风格看，市场延续 2022 年的机构占比降低的逻辑，当期业绩不是投资主线，中小盘中的交易 alpha 是主要收益来源。市场整体风险偏好较低。

本基金在操作中，采用量化与基本面结合的投资方法，均衡配置组合，力争获取长期稳健的相对市场的超额收益。本基金在投资策略上做进一步优化，基于股票的分域定价和 DCF 现金流折现模型，均衡配置下述几类长期具有超额收益短期形成风格互补的策略，即基于近端现金流的业绩超预期策略、基于中期现金流的景气成长策略、基于远端现金流假设的核心资产策略、基于风险溢价变化的低估值策略以及基于大样本统计的小盘统计套利策略，并重点关注通过改革释放潜力的公司。本报告期内，本基金增加了医药、计算机、食品饮料的配置，减少了煤炭、电力设备

及新能源、有色金属的配置。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末宏利改革动力混合 A 的基金份额净值为 1.5836 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.32%，截至本报告期末宏利改革动力混合 C 的基金份额净值为 1.6774 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.17%，同期业绩比较基准收益率为 1.08%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，尽管年初以来市场呈现原地波动、结构分化特征，我们仍维持 A 股整体权益资产估值分位数较低，处于投资价值较高区域的判断，港股观点类似。而与上个季度不同的是，我们认为随着经济压力增加，正面催化剂将逐渐增加，有利于市场反弹。而在风格层面，要重点关注外资对市场的认可程度，能否在催化中完成重新向机构化转变的过程。如果北向资金能形成可观的正向流入，则市场风格可能重新向 2019、2020 转变，否则反弹将更类似与 2009、2013。无论任一情况发生，就整体而言，站在当前估值位置，应对市场更为乐观。在投资策略层面，我们将积极关注资金趋势变化引起的可能市场中后期风格变化，以及下半年从日历角度，市场风格在年底可能切向大盘价值。

基于基金合同与投资观点，将继续均衡配置各类具有长期超额收益的策略，并力争通过不断研究学习丰富策略体系。本基金在持仓上相对分散，以平衡组合风险。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。报告期内相关基金估值政策由托管银行进行复核。公司估值委员会主任由主管基金运营的副总经理担任，成员包括但不限于督察长、主管投研的副总经理或投资总监、权益投资部、研究部、策略投资部、固定收益部、合规风控部门、基金运营部的主要负责人；委员会秘书由基金运营部负责人担任。所有人员均具有丰富的专业工作经历，具备良好的专业经验和专业胜任能力。

基金经理参与估值委员会对相关停牌品种估值的讨论，发表相关意见和建议，但涉及停牌品种的基金经理不参与最终的投票表决。

本报告期内，本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供银行间同业市场交易的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

根据本基金基金合同及基金的实际运作情况，本基金于本报告期内未进行收益分配。

#### 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

本报告期内本基金未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的情形。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对宏利改革动力量化策略灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

#### 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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在本托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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：宏利改革动力量化策略灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	7,923,017.23	2,675,985.29
结算备付金		1,012,325.30	745,343.46
存出保证金		13,789.84	15,298.41

交易性金融资产	6.4.7.2	98,614,722.58	106,253,671.68
其中：股票投资		98,614,722.58	102,658,510.17
基金投资		-	-
债券投资		-	3,595,161.51
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	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	2,652,759.34
应收股利		-	-
应收申购款		2,221.74	3,017.65
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		107,566,076.69	112,346,075.83
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年6月30日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		174.65	53.16
应付管理人报酬		132,264.52	143,769.70
应付托管费		22,044.09	23,961.62
应付销售服务费		107.15	124.45
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	540,051.40	585,378.49
负债合计		694,641.81	753,287.42
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	67,469,449.42	70,674,847.33
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	39,401,985.46	40,917,941.08
净资产合计		106,871,434.88	111,592,788.41

负债和净资产总计		107,566,076.69	112,346,075.83
----------	--	----------------	----------------

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 67,469,449.42 份，其中宏利改革动力混合 A 基金份额总额 67,211,754.64 份，基金份额净值 1.5836 元；宏利改革动力混合 C 基金份额总额 257,694.78 份，基金份额净值 1.6774 元。

## 6.2 利润表

会计主体：宏利改革动力量化策略灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		1,496,098.92	-14,011,137.20
1. 利息收入		20,687.09	21,719.52
其中：存款利息收入	6.4.7.13	20,479.59	21,719.52
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		207.50	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-9,049.70	-21,527,711.16
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-1,086,461.97	-22,369,438.84
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	5,310.96	37,351.51
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	1,072,101.31	804,376.17
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	1,483,667.42	7,492,607.93
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	794.11	2,246.51

<b>减：二、营业总支出</b>		1,087,717.42	1,209,731.01
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	837,194.70	936,288.46
2. 托管费	6.4.10.2.2	139,532.46	156,048.05
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	699.67	1,381.15
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	757.83
其中：卖出回购金融资产支出		-	757.83
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	110,290.59	115,255.52
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		408,381.50	-15,220,868.21
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		408,381.50	-15,220,868.21
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		408,381.50	-15,220,868.21

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：宏利改革动力量化策略灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	70,674,847.33	-	40,917,941.08	111,592,788.41
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	70,674,847.33	-	40,917,941.08	111,592,788.41
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-3,205,397.91	-	-1,515,955.62	-4,721,353.53
（一）、综合收益总额	-	-	408,381.50	408,381.50
（二）、本期基金份额交易产生的	-3,205,397.91	-	-1,924,337.12	-5,129,735.03



基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)				
其中: 1. 基金申购款	565,344.68	-	359,328.76	924,673.44
2. 基金赎回款	-3,770,742.59	-	-2,283,665.88	-6,054,408.47
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	67,469,449.42	-	39,401,985.46	106,871,434.88
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	75,325,518.52	-	74,758,841.88	150,084,360.40
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	75,325,518.52	-	74,758,841.88	150,084,360.40
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-3,016,247.28	-	-17,281,691.60	-20,297,938.88
(一)、综合收益总额	-	-	-15,220,868.21	-15,220,868.21
(二)、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)	-3,016,247.28	-	-2,060,823.39	-5,077,070.67
其中: 1. 基金申购款	1,808,061.61	-	1,352,601.11	3,160,662.72
2. 基金赎回款	-4,824,308.89	-	-3,413,424.50	-8,237,733.39

（三）、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）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	72,309,271.24	-	57,477,150.28	129,786,421.52

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：

高贵鑫

王泉

石楠

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

宏利改革动力量化策略灵活配置混合型证券投资基金(原名为泰达宏利改革动力量化策略灵活配置混合型证券投资基金,以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]54号《关于准予泰达宏利改革动力量化策略灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》注册,由宏利基金管理有限公司(原泰达宏利基金管理有限公司,已于2023年4月20日办理完成工商变更登记)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利改革动力量化策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币1,931,209,798.06元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第133号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰达宏利改革动力量化策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2015年2月13日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,931,765,423.15份基金份额,其中认购资金利息折合555,625.09份基金份额。本基金的基金管理人为宏利基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)。

根据本基金的基金管理人2023年6月17日发布的《宏利基金管理有限公司关于旗下基金更名事宜的公告》,本基金自2023年6月20日起更名为宏利改革动力量化策略灵活配置混合型证券投资基金。

根据《关于泰达宏利改革动力量化策略灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利中证财富大

盘指数证券投资基金与泰达宏利同顺大数据量化优选灵活配置混合型证券投资基金修改基金合同及托管协议的公告》并报证监会备案，本基金于 2017 年 2 月 9 日起根据申购费用、销售服务费用收取方式的不同和销售渠道的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取申购费用，赎回时根据持有期限收取赎回费用的，称为 A 类基金份额；不收取申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费，赎回时根据持有期限收取赎回费用的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存，由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值。本基金的原有基金份额全部自动划归为该基金 A 类基金份额类别，A 类基金份额的各项业务规则与原基金合同相同。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《宏利改革动力量化策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、债券回购、资产支持证券、货币市场工具、权证、股指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的相关规定)。本基金投资的股票资产占基金资产的比例为 0%-95%，其余资产投资于债券、货币市场工具、股指期货、权证、资产支持证券等金融工具；其中投资于具有改革动力主题的证券不低于非现金基金资产的 80%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，股指期货的投资比例遵循国家相关法律法规。本基金的业绩比较基准为：50%X 沪深 300 指数收益率+50%X 中证综合债指数收益率。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《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》、《宏利改革动力量化策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年度上半年财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年度上半年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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无会计政策的变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无会计估计的变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无重大会计差错发生。

#### 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。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	7,923,017.23
等于：本金	7,922,308.61
加：应计利息	708.62
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	7,923,017.23

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	99,814,677.94	-	98,614,722.58	-1,199,955.36
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券   交易所市场	-	-	-	-

	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
	资产支持证券	-	-	-	-
	基金	-	-	-	-
	其他	-	-	-	-
	合计	99,814,677.94	-	98,614,722.58	-1,199,955.36

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末未持有期货合约。

#### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

### 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从买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

### 6.4.7.5 债权投资

#### 6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末未持有债权投资。

#### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末未计提债权投资减值准备。

### 6.4.7.6 其他债权投资

#### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末未持有其他债权投资。

#### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末未计提其他债权投资减值准备。

## 6.4.7.7 其他权益工具投资

## 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

## 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

## 6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

## 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6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	-
应付交易费用	441,791.25
其中：交易所市场	441,791.25
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	98,260.15
合计	540,051.40

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

## 宏利改革动力混合 A

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	70,386,309.52	70,386,309.52
本期申购	544,444.50	544,444.50
本期赎回（以“-”号填列）	-3,718,999.38	-3,718,999.38
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	67,211,754.64	67,211,754.64

## 宏利改革动力混合 C

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	288,537.81	288,537.81
本期申购	20,900.18	20,900.18

本期赎回（以“-”号填列）	-51,743.21	-51,743.21
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	257,694.78	257,694.78

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期末未有其他综合收益。

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

##### 宏利改革动力混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	57,944,824.46	-17,221,500.98	40,723,323.48
本期利润	-1,069,732.68	1,476,313.39	406,580.71
本期基金份额交易产生的变动数	-2,576,955.43	674,484.35	-1,902,471.08
其中：基金申购款	450,600.76	-106,326.97	344,273.79
基金赎回款	-3,027,556.19	780,811.32	-2,246,744.87
本期已分配利润	-	-	-
本期末	54,298,136.35	-15,070,703.24	39,227,433.11

##### 宏利改革动力混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	271,920.49	-77,302.89	194,617.60
本期利润	-5,553.24	7,354.03	1,800.79
本期基金份额交易产生的变动数	-28,373.24	6,507.20	-21,866.04
其中：基金申购款	19,622.61	-4,567.64	15,054.97
基金赎回款	-47,995.85	11,074.84	-36,921.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	237,994.01	-63,441.66	174,552.35

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	14,172.80
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	5,158.43
其他	1,148.36
合计	20,479.59



## 6.4.7.14 股票投资收益

## 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-1,086,461.97
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-1,086,461.97

## 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	462,134,318.05
减：卖出股票成本总额	461,831,317.30
减：交易费用	1,389,462.72
买卖股票差价收入	-1,086,461.97

## 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期未有股票投资收益-证券出借差价收入。

## 6.4.7.15 债券投资收益

## 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	4,729.71
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	581.25
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	5,310.96

## 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	3,600,382.67
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成	3,528,277.30

本总额	
减：应计利息总额	71,524.12
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	581.25

#### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期末有债券投资收益-赎回差价收入。

#### 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期末有债券投资收益-申购差价收入。

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期末有资产支持证券投资收益。

##### 6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期末有资产支持证券投资收益-买卖资产支持证券差价收入。

##### 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期末有资产支持证券投资收益-赎回差价收入。

##### 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期末有资产支持证券投资收益-申购差价收入。

#### 6.4.7.17 贵金属投资收益

##### 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期末有贵金属投资收益。

##### 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期末有贵金属投资收益-买卖贵金属差价收入。

##### 6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期末有贵金属投资收益-赎回差价收入。

##### 6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期末有贵金属投资收益-申购差价收入。

#### 6.4.7.18 衍生工具收益

##### 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期末有衍生工具收益-买卖权证差价收入。

##### 6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期末有衍生工具收益-其他投资收益。

**6.4.7.19 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,072,101.31
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	1,072,101.31

**6.4.7.20 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	1,483,667.42
股票投资	1,483,757.22
债券投资	-89.80
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	1,483,667.42

**6.4.7.21 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	756.66
基金转换费收入	37.45
合计	794.11

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

**6.4.7.22 信用减值损失**

本基金本报告期末未有信用减值损失。

**6.4.7.23 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	2,430.44
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	110,290.59

#### 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，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并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

本基金本报告期没有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
宏利基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司(中国银行)	基金托管人、基金代销机构

注：1. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2. 我公司已于 2023 年 4 月 22 日发布《关于公司法定名称变更的公告》，基金管理人名称由“泰达宏利基金管理有限公司”变更为“宏利基金管理有限公司”，该名称变更事项已于 2023 年 4 月完成工商变更登记手续。

#### 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

###### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

#### 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 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	837,194.70	936,288.46
其中：支付销售机构的客户维护费	387,729.21	406,113.15

注：支付基金管理人宏利基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%的年费率计提，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 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	139,532.46	156,048.05

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，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。

##### 6.4.10.2.3 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 2023年1月1日至2023年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	宏利改革动力混合 A	宏利改革动力混合 C	合计
宏利基金管理有限公司	-	6.64	6.64
中国银行股份有限公司	-	-	-
合计	-	6.64	6.64
获得销售服务费的各关联方 名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		

	宏利改革动力混合 A	宏利改革动力混合 C	合计
宏利基金管理有限公司	-	6.84	6.84
中国银行股份有限公司	-	-	-
合计	-	6.84	6.84

注：支付基金销售机构的销售服务费按 C 类基金基金份额前一日基金资产净值 0.30%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给宏利基金管理有限公司，再由宏利基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日 C 类基金基金份额销售服务费=C 类基金基金份额前一日基金资产净值×0.30%/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

本基金本报告期及上年度可比期间均无与关联方进行的银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本基金本报告期内及上年度可比期间未运用自有资金投资本基金。

##### 6.4.10.5.2 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

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	7,923,017.23	14,172.80	4,137,179.82	10,149.01

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按约定利率计息。

**6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

**6.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

**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（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券****6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601916	浙商银行	2023年6月27日	1个月内（含）	配股流通受限	2.02	2.64	11,700	23,634.00	30,888.00	-

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

**6.4.12.2 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余额。

**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余额。

**6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券**

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

**6.4.13 金融工具风险及管理**

本基金为混合型证券投资基金，属于较高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、货币市场工具、股指期货、权证、资产支持证券等。本基金在日常经营活动中面

临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。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。

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。

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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国银行，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 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有债券投资、资产支持证券投资和同业存单投资。（2022 年 12 月 31 日：本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券投资）。

#### 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 2023 年 6 月 30 日，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》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)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上述比例限制)。

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%。

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。

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。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### 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主要为银行存款、结算备付金、存出保证金等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年6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	7,923,017.23	-	-	-	7,923,017.23
结算备付金	1,012,325.30	-	-	-	1,012,325.30
存出保证金	13,789.84	-	-	-	13,789.84
交易性金融资产	-	-	-	98,614,722.58	98,614,722.58
应收申购款	-	-	-	2,221.74	2,221.74
资产总计	8,949,132.37	-	-	98,616,944.32	107,566,076.69
负债					
应付赎回款	-	-	-	174.65	174.65
应付管理人报酬	-	-	-	132,264.52	132,264.52
应付托管费	-	-	-	22,044.09	22,044.09

应付销售服务费	-	-	-	107.15	107.15
其他负债	-	-	-	540,051.40	540,051.40
负债总计	-	-	-	694,641.81	694,641.81
利率敏感度缺口	8,949,132.37	-	-	97,922,302.51	106,871,434.88
上年度末 2022 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	2,675,985.29	-	-	-	2,675,985.29
结算备付金	745,343.46	-	-	-	745,343.46
存出保证金	15,298.41	-	-	-	15,298.41
交易性金融资产	3,595,161.51	-	-	102,658,510.17	106,253,671.68
应收申购款	0.60	-	-	3,017.05	3,017.65
应收清算款	-	-	-	2,652,759.34	2,652,759.34
资产总计	7,031,789.27	-	-	105,314,286.56	112,346,075.83
负债					
应付赎回款	-	-	-	53.16	53.16
应付管理人报酬	-	-	-	143,769.70	143,769.70
应付托管费	-	-	-	23,961.62	23,961.62
应付销售服务费	-	-	-	124.45	124.45
其他负债	-	-	-	585,378.49	585,378.49
负债总计	-	-	-	753,287.42	753,287.42
利率敏感度缺口	7,031,789.27	-	-	104,560,999.14	111,592,788.41

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的到期日予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2022 年 12 月 31 日：本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金净资产的比例为 3.22%)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(2022 年 12 月 31 日：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，采用“自上而下”的策略，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。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产占比 0%-95%，其中投资于具有改革动力主题的证券不低于非现金基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。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，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	98,614,722.58	92.27	102,658,510.17	91.99
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
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	98,614,722.58	92.27	102,658,510.17	91.99

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数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（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	3,820,000.00	5,050,000.00

	沪深 300 指数下降 5%	-3,820,000.00	-5,050,000.00
--	-------------------	---------------	---------------

#### 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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	98,583,834.58	102,585,868.22
第二层次	30,888.00	3,595,161.51
第三层次	-	72,641.95
合计	98,614,722.58	106,253,671.68

###### 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事项发生的当年年初为确认各层次之间转换的时点。

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

###### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 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（2022 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

本基金本报告期内无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

## § 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	98,614,722.58	91.68
	其中：股票	98,614,722.58	91.68
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	8,935,342.53	8.31
8	其他各项资产	16,011.58	0.01
9	合计	107,566,076.69	100.00

### 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

金额单位：人民币元

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	63,735.00	0.06
B	采矿业	1,480,693.00	1.39
C	制造业	69,104,909.53	64.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	933,071.00	0.87
E	建筑业	334,447.40	0.31
F	批发和零售业	2,121,240.00	1.98
G	交通运输、仓储和邮政业	584,152.20	0.55
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,266,771.80	10.54

J	金融业	3,750,805.20	3.51
K	房地产业	84,120.00	0.08
L	租赁和商务服务业	1,522,546.45	1.42
M	科学研究和技术服务业	2,691,283.00	2.52
N	水利、环境和公共设施管理业	197,140.00	0.18
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,775,896.00	3.53
R	文化、体育和娱乐业	703,912.00	0.66
S	综合	-	-
	合计	98,614,722.58	92.27

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

### 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	603027	千禾味业	171,200	3,615,744.00	3.38
2	603309	维力医疗	138,500	2,142,595.00	2.00
3	688569	铁科轨道	49,927	2,100,428.89	1.97
4	301239	普瑞眼科	21,300	2,089,104.00	1.95
5	002478	常宝股份	269,900	2,010,755.00	1.88
6	688551	科威尔	29,776	1,952,710.08	1.83
7	002605	姚记科技	40,800	1,894,344.00	1.77
8	300624	万兴科技	15,300	1,792,395.00	1.68
9	600612	老凤祥	25,500	1,781,940.00	1.67
10	301103	何氏眼科	40,200	1,686,792.00	1.58
11	300866	安克创新	18,700	1,636,250.00	1.53
12	003011	海象新材	49,600	1,599,600.00	1.50
13	603040	新坐标	58,300	1,550,197.00	1.45
14	000568	泸州老窖	7,100	1,487,947.00	1.39
15	688410	山外山	27,800	1,459,500.00	1.37
16	603757	大元泵业	47,800	1,426,352.00	1.33
17	603215	比依股份	72,300	1,297,062.00	1.21
18	000661	长春高新	8,800	1,199,440.00	1.12
19	600519	贵州茅台	700	1,183,700.00	1.11
20	600197	伊力特	42,600	1,157,442.00	1.08
21	600129	太极集团	18,700	1,112,463.00	1.04
22	301257	普蕊斯	19,000	1,067,800.00	1.00
23	300533	冰川网络	21,000	1,049,160.00	0.98
24	688029	南微医学	12,855	1,048,453.80	0.98
25	688111	金山办公	2,170	1,024,717.40	0.96

26	300775	三角防务	29,000	979,620.00	0.92
27	000997	新大陆	51,300	969,570.00	0.91
28	002020	京新药业	74,200	951,244.00	0.89
29	603156	养元饮品	38,100	941,070.00	0.88
30	002011	盾安环境	66,700	922,461.00	0.86
31	603283	赛腾股份	20,700	921,150.00	0.86
32	688387	信科移动	106,800	891,780.00	0.83
33	688305	科德数控	8,800	882,288.00	0.83
34	600419	天润乳业	54,100	877,502.00	0.82
35	601965	中国汽研	42,300	873,495.00	0.82
36	300444	双杰电气	113,400	873,180.00	0.82
37	300638	广和通	36,520	828,273.60	0.78
38	300394	天孚通信	7,700	822,591.00	0.77
39	605266	健之佳	9,700	813,151.00	0.76
40	603129	春风动力	5,000	809,500.00	0.76
41	601138	工业富联	30,000	756,000.00	0.71
42	601318	中国平安	16,200	751,680.00	0.70
43	002959	小熊电器	8,700	726,450.00	0.68
44	002027	分众传媒	106,300	723,903.00	0.68
45	000977	浪潮信息	14,700	712,950.00	0.67
46	300181	佐力药业	57,900	706,959.00	0.66
47	300896	爱美客	1,580	703,021.00	0.66
48	002463	沪电股份	31,200	653,328.00	0.61
49	002643	万润股份	36,700	638,947.00	0.60
50	002867	周大生	35,900	638,302.00	0.60
51	300494	盛天网络	24,480	606,859.20	0.57
52	002419	天虹股份	95,700	559,845.00	0.52
53	601888	中国中免	4,500	497,385.00	0.47
54	688037	芯源微	2,768	473,189.60	0.44
55	603019	中科曙光	8,900	453,010.00	0.42
56	002517	恺英网络	28,600	450,164.00	0.42
57	300855	图南股份	12,720	449,270.40	0.42
58	603688	石英股份	3,900	443,976.00	0.42
59	000063	中兴通讯	9,400	428,076.00	0.40
60	600702	舍得酒业	3,400	421,430.00	0.39
61	002223	鱼跃医疗	11,700	421,083.00	0.39
62	603517	绝味食品	11,300	419,795.00	0.39
63	688472	阿特斯	22,036	404,580.96	0.38
64	300124	汇川技术	6,300	404,523.00	0.38
65	600036	招商银行	11,600	380,016.00	0.36
66	000552	甘肃能化	113,400	377,622.00	0.35
67	603259	药明康德	5,900	367,629.00	0.34
68	600690	海尔智家	15,500	363,940.00	0.34



69	688235	百济神州	3,251	354,716.61	0.33
70	688766	普冉股份	3,282	350,583.24	0.33
71	601728	中国电信	61,900	348,497.00	0.33
72	601658	邮储银行	68,600	335,454.00	0.31
73	688295	中复神鹰	9,002	330,193.36	0.31
74	300408	三环集团	11,100	325,785.00	0.30
75	600602	云赛智联	21,500	323,790.00	0.30
76	000338	潍柴动力	25,900	322,714.00	0.30
77	605300	佳禾食品	14,700	319,578.00	0.30
78	301004	嘉益股份	8,200	318,160.00	0.30
79	688297	中无人机	6,202	318,100.58	0.30
80	600660	福耀玻璃	8,700	311,895.00	0.29
81	000543	皖能电力	47,200	311,520.00	0.29
82	003006	百亚股份	17,700	305,856.00	0.29
83	300002	神州泰岳	21,700	303,800.00	0.28
84	601137	博威合金	19,500	303,420.00	0.28
85	601766	中国中车	42,300	274,950.00	0.26
86	002990	盛视科技	7,300	268,640.00	0.25
87	600011	华能国际	29,000	268,540.00	0.25
88	603466	风语筑	19,100	265,490.00	0.25
89	300791	仙乐健康	9,100	264,264.00	0.25
90	601958	金钼股份	23,700	264,255.00	0.25
91	601899	紫金矿业	23,200	263,784.00	0.25
92	002322	理工能科	25,200	262,080.00	0.25
93	300856	科思股份	3,300	259,941.00	0.24
94	601328	交通银行	44,100	255,780.00	0.24
95	603383	顶点软件	4,500	249,390.00	0.23
96	688390	固德威	1,480	246,952.80	0.23
97	300274	阳光电源	2,100	244,923.00	0.23
98	002612	朗姿股份	10,100	240,178.00	0.22
99	300314	戴维医疗	11,300	238,882.00	0.22
100	000921	海信家电	8,800	237,160.00	0.22
101	603486	科沃斯	3,000	233,310.00	0.22
102	603816	顾家家居	5,800	221,270.00	0.21
103	600312	平高电气	17,300	214,347.00	0.20
104	002293	罗莱生活	18,100	208,150.00	0.19
105	603639	海利尔	11,600	207,872.00	0.19
106	301039	中集车辆	15,700	207,711.00	0.19
107	002300	太阳电缆	23,400	205,686.00	0.19
108	002948	青岛银行	64,800	202,824.00	0.19
109	002460	赣锋锂业	3,300	201,168.00	0.19
110	002603	以岭药业	7,800	200,382.00	0.19
111	600863	内蒙华电	47,800	198,370.00	0.19

112	002912	中新赛克	4,500	198,045.00	0.19
113	002563	森马服饰	31,100	193,442.00	0.18
114	600583	海油工程	33,000	193,050.00	0.18
115	300532	今天国际	9,200	189,152.00	0.18
116	300908	仲景食品	4,100	185,935.00	0.17
117	002852	道道全	13,900	179,727.00	0.17
118	601088	中国神华	5,800	178,350.00	0.17
119	000596	古井贡酒	700	173,166.00	0.16
120	688208	道通科技	5,679	172,130.49	0.16
121	603551	奥普家居	13,200	170,676.00	0.16
122	605599	菜百股份	12,900	170,409.00	0.16
123	300130	新国都	6,000	169,980.00	0.16
124	603871	嘉友国际	10,720	168,411.20	0.16
125	688357	建龙微纳	2,600	168,194.00	0.16
126	300768	迪普科技	10,100	167,357.00	0.16
127	000999	华润三九	2,700	163,782.00	0.15
128	300231	银信科技	18,300	163,053.00	0.15
129	002739	万达电影	13,000	163,020.00	0.15
130	300465	高伟达	16,400	162,852.00	0.15
131	688276	百克生物	2,600	162,760.00	0.15
132	002829	星网宇达	3,700	162,541.00	0.15
133	300308	中际旭创	1,100	162,195.00	0.15
134	000878	云南铜业	14,600	161,330.00	0.15
135	300622	博士眼镜	6,800	160,480.00	0.15
136	603768	常青股份	9,000	159,930.00	0.15
137	601288	农业银行	44,700	157,791.00	0.15
138	605167	利柏特	16,200	156,816.00	0.15
139	688152	麒麟信安	1,690	155,953.20	0.15
140	002335	科华数据	4,200	150,990.00	0.14
141	688188	柏楚电子	800	150,848.00	0.14
142	002782	可立克	9,800	149,842.00	0.14
143	002372	伟星新材	7,200	147,888.00	0.14
144	605066	天正电气	15,700	147,737.00	0.14
145	601528	瑞丰银行	30,400	147,440.00	0.14
146	002763	汇洁股份	16,600	147,076.00	0.14
147	600039	四川路桥	14,940	146,561.40	0.14
148	600901	江苏金租	35,140	145,128.20	0.14
149	603368	柳药集团	5,800	143,318.00	0.13
150	601398	工商银行	29,600	142,672.00	0.13
151	002345	潮宏基	18,100	142,266.00	0.13
152	300354	东华测试	3,100	138,570.00	0.13
153	601128	常熟银行	20,200	137,764.00	0.13
154	601601	中国太保	5,300	137,694.00	0.13

155	002115	三维通信	21,100	137,572.00	0.13
156	605168	三人行	1,595	137,074.30	0.13
157	601916	浙商银行	50,900	134,376.00	0.13
158	600919	江苏银行	18,100	133,035.00	0.12
159	600481	双良节能	9,500	132,810.00	0.12
160	601021	春秋航空	2,300	132,181.00	0.12
161	603367	辰欣药业	8,700	132,066.00	0.12
162	002327	富安娜	15,600	131,352.00	0.12
163	002568	百润股份	3,600	130,860.00	0.12
164	002991	甘源食品	1,700	130,390.00	0.12
165	603878	武进不锈	15,380	129,961.00	0.12
166	002955	鸿合科技	5,500	129,525.00	0.12
167	002947	恒铭达	6,200	129,208.00	0.12
168	603136	天目湖	4,900	126,420.00	0.12
169	002749	国光股份	11,000	124,630.00	0.12
170	603661	恒林股份	3,700	122,692.00	0.11
171	603303	得邦照明	8,800	121,528.00	0.11
172	300978	东箭科技	8,900	121,307.00	0.11
173	600585	海螺水泥	5,100	121,074.00	0.11
174	603808	歌力思	9,100	119,483.00	0.11
175	603366	日出东方	20,500	119,105.00	0.11
176	603238	诺邦股份	9,400	118,534.00	0.11
177	000777	中核科技	8,600	116,014.00	0.11
178	605009	豪悦护理	2,400	115,200.00	0.11
179	603289	泰瑞机器	10,200	114,444.00	0.11
180	603689	皖天然气	12,900	113,133.00	0.11
181	600229	城市传媒	13,200	112,464.00	0.11
182	300724	捷佳伟创	1,000	112,350.00	0.11
183	603508	思维列控	6,400	109,120.00	0.10
184	603619	中曼石油	6,100	103,212.00	0.10
185	300161	华中数控	1,900	101,688.00	0.10
186	003029	吉大正元	3,100	100,595.00	0.09
187	688626	翔宇医疗	2,210	100,577.10	0.09
188	300577	开润股份	6,100	99,369.00	0.09
189	002966	苏州银行	15,100	98,905.00	0.09
190	300129	泰胜风能	10,300	98,777.00	0.09
191	603993	洛阳钼业	18,400	98,072.00	0.09
192	300009	安科生物	9,400	94,000.00	0.09
193	002483	润邦股份	15,900	92,220.00	0.09
194	002970	锐明技术	2,900	91,321.00	0.09
195	601717	郑煤机	7,300	90,885.00	0.09
196	002392	北京利尔	25,100	90,862.00	0.09
197	601006	大秦铁路	12,200	90,646.00	0.08

198	688257	新锐股份	3,400	90,134.00	0.08
199	002839	张家港行	21,200	89,676.00	0.08
200	603071	物产环能	5,400	89,586.00	0.08
201	688793	倍轻松	1,600	86,240.00	0.08
202	603365	水星家纺	6,100	85,766.00	0.08
203	600488	津药药业	15,200	85,424.00	0.08
204	600261	阳光照明	23,400	85,410.00	0.08
205	000822	山东海化	12,500	85,125.00	0.08
206	601998	中信银行	14,200	84,916.00	0.08
207	603090	宏盛股份	3,800	84,550.00	0.08
208	000002	万科 A	6,000	84,120.00	0.08
209	603012	创力集团	13,600	83,912.00	0.08
210	688288	鸿泉物联	3,300	83,886.00	0.08
211	002489	浙江永强	20,300	82,215.00	0.08
212	002283	天润工业	12,600	80,892.00	0.08
213	688315	诺禾致源	3,000	79,650.00	0.07
214	601939	建设银行	12,600	78,876.00	0.07
215	002170	芭田股份	11,400	78,318.00	0.07
216	002056	横店东磁	4,300	78,303.00	0.07
217	002929	润建股份	1,800	78,138.00	0.07
218	002233	塔牌集团	10,100	77,972.00	0.07
219	600016	民生银行	20,700	77,625.00	0.07
220	002429	兆驰股份	14,100	77,550.00	0.07
221	002641	公元股份	13,700	77,268.00	0.07
222	000938	紫光股份	2,400	76,440.00	0.07
223	688187	时代电气	1,799	75,306.14	0.07
224	002060	粤水电	11,200	73,696.00	0.07
225	603345	安井食品	500	73,400.00	0.07
226	601975	招商南油	25,600	73,216.00	0.07
227	688428	诺诚健华	6,249	72,175.95	0.07
228	300012	华测检测	3,700	72,150.00	0.07
229	002724	海洋王	8,300	72,044.00	0.07
230	002518	科士达	1,800	72,018.00	0.07
231	003002	壶化股份	4,500	71,190.00	0.07
232	002033	丽江股份	6,500	70,720.00	0.07
233	002448	中原内配	10,100	70,700.00	0.07
234	002588	史丹利	11,500	69,920.00	0.07
235	002415	海康威视	2,100	69,531.00	0.07
236	601577	长沙银行	8,900	69,064.00	0.06
237	603889	新澳股份	9,140	68,641.40	0.06
238	002847	盐津铺子	800	68,040.00	0.06
238	603565	中谷物流	6,300	68,040.00	0.06
240	600161	天坛生物	2,400	65,160.00	0.06

241	600926	杭州银行	5,500	64,625.00	0.06
242	002234	民和股份	3,500	63,735.00	0.06
243	601211	国泰君安	4,500	62,955.00	0.06
244	600329	达仁堂	1,400	62,846.00	0.06
245	601336	新华保险	1,700	62,509.00	0.06
246	605259	绿田机械	1,600	62,112.00	0.06
247	603067	振华股份	5,000	60,750.00	0.06
248	603939	益丰药房	1,620	59,940.00	0.06
249	603279	景津装备	1,900	59,584.00	0.06
250	300726	宏达电子	1,300	58,136.00	0.05
251	603399	吉翔股份	4,900	56,693.00	0.05
252	603859	能科科技	1,100	56,243.00	0.05
253	601928	凤凰传媒	4,700	53,580.00	0.05
254	002956	西麦食品	3,400	53,142.00	0.05
255	002536	飞龙股份	3,500	52,500.00	0.05
256	300631	久吾高科	1,500	52,470.00	0.05
257	002609	捷顺科技	4,400	51,304.00	0.05
258	000913	钱江摩托	2,800	51,044.00	0.05
259	603605	珀莱雅	440	49,456.00	0.05
260	002737	葵花药业	2,000	48,680.00	0.05
261	300773	拉卡拉	2,700	47,088.00	0.04
262	002397	梦洁股份	13,500	46,845.00	0.04
263	002942	新农股份	2,500	45,375.00	0.04
264	300787	海能实业	2,300	45,310.00	0.04
265	002885	京泉华	1,900	41,496.00	0.04
266	300352	北信源	8,200	41,328.00	0.04
267	301061	匠心家居	1,100	40,645.00	0.04
268	002919	名臣健康	900	40,590.00	0.04
269	688063	派能科技	200	39,650.00	0.04
270	603209	兴通股份	1,800	38,178.00	0.04
271	603313	梦百合	3,800	38,114.00	0.04
272	603556	海兴电力	1,500	37,860.00	0.04
273	688516	奥特维	200	37,680.00	0.04
274	603758	秦安股份	3,500	37,240.00	0.03
275	603327	福蓉科技	3,100	36,828.00	0.03
276	601686	友发集团	5,200	35,568.00	0.03
277	603032	德新科技	1,020	35,230.80	0.03
278	300304	云意电气	6,300	34,902.00	0.03
279	002803	吉宏股份	1,700	34,782.00	0.03
280	300973	立高食品	500	34,210.00	0.03
281	600218	全柴动力	3,800	34,048.00	0.03
282	603339	四方科技	2,100	33,411.00	0.03
283	601028	玉龙股份	3,100	33,325.00	0.03

284	603949	雪龙集团	2,100	33,138.00	0.03
285	600828	茂业商业	8,800	32,560.00	0.03
286	300796	贝斯美	2,700	32,481.00	0.03
287	603306	华懋科技	1,100	31,922.00	0.03
288	002371	北方华创	100	31,765.00	0.03
289	601068	中铝国际	5,800	31,088.00	0.03
290	603515	欧普照明	1,500	30,450.00	0.03
291	600436	片仔癀	100	28,636.00	0.03
292	603600	永艺股份	3,000	28,530.00	0.03
293	002238	天威视讯	4,100	28,413.00	0.03
294	603719	良品铺子	1,100	27,511.00	0.03
295	603321	梅轮电梯	3,500	27,265.00	0.03
296	603096	新经典	1,300	26,468.00	0.02
297	300659	中孚信息	1,300	26,416.00	0.02
298	603115	海星股份	1,600	24,592.00	0.02
299	300982	苏文电能	400	24,224.00	0.02
300	600580	卧龙电驱	1,600	23,376.00	0.02
301	301155	海力风电	300	23,124.00	0.02
302	603103	横店影视	1,300	21,892.00	0.02
303	002534	西子洁能	1,300	21,840.00	0.02
304	600986	浙文互联	3,300	21,120.00	0.02
305	600551	时代出版	1,900	20,995.00	0.02
306	603230	内蒙新华	1,600	20,640.00	0.02
307	600512	腾达建设	7,500	20,100.00	0.02
308	605577	龙版传媒	1,700	19,363.00	0.02
309	002062	宏润建设	3,400	18,394.00	0.02
310	002249	大洋电机	3,200	18,240.00	0.02
311	603507	振江股份	500	18,130.00	0.02
312	605090	九丰能源	800	17,864.00	0.02
313	600694	大商股份	1,000	17,730.00	0.02
314	301033	迈普医学	400	17,584.00	0.02
315	603018	华设集团	2,000	17,500.00	0.02
316	603300	华铁应急	3,200	17,440.00	0.02
317	603886	元祖股份	900	16,506.00	0.02
318	600831	广电网络	2,600	15,600.00	0.01
319	300718	长盛轴承	700	15,575.00	0.01
320	002152	广电运通	1,300	15,236.00	0.01
321	002048	宁波华翔	1,100	14,740.00	0.01
322	601908	京运通	2,300	13,915.00	0.01
323	603778	乾景园林	2,500	13,500.00	0.01
324	000951	中国重汽	800	13,480.00	0.01
325	000739	普洛药业	700	12,418.00	0.01
326	301116	益客食品	800	12,320.00	0.01

327	600635	大众公用	3,700	12,284.00	0.01
328	688136	科兴制药	642	11,973.30	0.01
329	600026	中远海能	900	11,376.00	0.01
330	600297	广汇汽车	5,000	10,400.00	0.01
331	000407	胜利股份	2,700	9,855.00	0.01
332	688599	天合光能	201	8,564.61	0.01
333	000534	万泽股份	400	6,708.00	0.01
334	603170	宝立食品	300	6,378.00	0.01
335	688006	杭可科技	200	6,094.00	0.01
336	600211	西藏药业	100	5,940.00	0.01
337	300633	开立医疗	100	5,450.00	0.01
338	300109	新开源	200	4,974.00	0.00
339	000680	山推股份	800	4,504.00	0.00
340	688226	威腾电气	201	4,385.82	0.00
341	000528	柳工	500	3,950.00	0.00
342	301102	兆讯传媒	145	3,896.15	0.00
343	002081	金螳螂	800	3,608.00	0.00
344	002183	怡亚通	700	3,570.00	0.00
345	002375	亚厦股份	700	3,276.00	0.00
346	603883	老百姓	100	2,985.00	0.00
347	002422	科伦药业	100	2,968.00	0.00
348	603116	红蜻蜓	400	2,536.00	0.00
349	600547	山东黄金	100	2,348.00	0.00
349	603919	金徽酒	100	2,348.00	0.00
351	601816	京沪高铁	400	2,104.00	0.00
352	600415	小商品城	200	1,706.00	0.00
353	600674	川投能源	100	1,505.00	0.00
354	002367	康力电梯	100	913.00	0.00
355	600742	一汽富维	100	819.00	0.00
356	600480	凌云股份	100	786.00	0.00

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	603027	千禾味业	7,262,151.12	6.51
2	300129	泰胜风能	5,346,317.00	4.79
3	002833	弘亚数控	5,335,733.80	4.78
4	605266	健之佳	4,104,571.00	3.68
5	301239	普瑞眼科	3,624,321.39	3.25
6	300274	阳光电源	3,605,020.00	3.23
7	300624	万兴科技	3,558,276.00	3.19
8	603757	大元泵业	3,479,619.00	3.12

9	000921	海信家电	3,243,388.75	2.91
10	002206	海利得	3,031,692.00	2.72
11	002777	久远银海	2,917,304.00	2.61
12	688551	科威尔	2,828,372.80	2.53
13	000001	平安银行	2,770,091.00	2.48
14	300481	濮阳惠成	2,745,232.00	2.46
15	603966	法兰泰克	2,732,383.00	2.45
16	603778	乾景园林	2,721,520.00	2.44
17	600129	太极集团	2,702,738.00	2.42
18	601965	中国汽研	2,694,150.00	2.41
19	300394	天孚通信	2,677,315.00	2.40
20	603309	维力医疗	2,656,880.78	2.38
21	600123	兰花科创	2,619,901.84	2.35
22	000568	泸州老窖	2,523,869.00	2.26
23	000933	神火股份	2,516,551.00	2.26
24	600761	安徽合力	2,515,915.85	2.25
25	601838	成都银行	2,476,976.00	2.22
26	002129	TCL 中环	2,470,823.00	2.21
27	600546	山煤国际	2,446,807.00	2.19
28	688111	金山办公	2,428,028.29	2.18
29	688410	山外山	2,418,130.47	2.17
30	600348	华阳股份	2,287,001.00	2.05
31	600612	老凤祥	2,277,010.00	2.04
32	002300	太阳电缆	2,276,017.00	2.04
33	600036	招商银行	2,264,777.00	2.03
34	688556	高测股份	2,260,336.64	2.03
35	603878	武进不锈	2,250,647.00	2.02
36	688331	荣昌生物	2,242,463.13	2.01

注：“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。

#### 7.4.2 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	002833	弘亚数控	5,893,593.36	5.28
2	300274	阳光电源	5,444,869.00	4.88
3	300129	泰胜风能	5,352,388.00	4.80
4	600546	山煤国际	4,760,487.00	4.27
5	000983	山西焦煤	4,273,959.00	3.83
6	605266	健之佳	4,110,009.00	3.68
7	600348	华阳股份	3,639,908.00	3.26
8	603027	千禾味业	3,466,614.80	3.11



9	000921	海信家电	3,393,073.60	3.04
10	000568	泸州老窖	3,390,530.00	3.04
11	300394	天孚通信	3,101,259.00	2.78
12	600690	海尔智家	2,979,881.00	2.67
13	600188	兖矿能源	2,966,810.00	2.66
14	600036	招商银行	2,874,935.00	2.58
15	002206	海利得	2,856,543.00	2.56
16	601899	紫金矿业	2,760,933.00	2.47
17	002335	科华数据	2,722,197.25	2.44
18	002129	TCL 中环	2,673,021.00	2.40
19	000933	神火股份	2,658,259.00	2.38
20	002555	三七互娱	2,639,663.00	2.37
21	000001	平安银行	2,609,132.00	2.34
22	300896	爱美客	2,590,513.00	2.32
23	600309	万华化学	2,564,075.00	2.30
24	002777	久远银海	2,548,487.00	2.28
25	600761	安徽合力	2,547,968.00	2.28
26	603778	乾景园林	2,514,736.00	2.25
27	300481	濮阳惠成	2,483,874.07	2.23
28	603966	法兰泰克	2,438,991.12	2.19
29	601838	成都银行	2,430,165.00	2.18
30	600123	兰花科创	2,421,895.00	2.17
31	301267	华夏眼科	2,405,557.36	2.16
32	688556	高测股份	2,334,668.17	2.09
33	603444	吉比特	2,310,741.00	2.07

注：“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。

#### 7.4.3 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	456,303,772.49
卖出股票收入（成交）总额	462,134,318.05

注：“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

本基金本报告期末未持有债券投资。

#### 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

本基金本报告期末未持有债券投资。

#### 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

本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的，将利用股指期货剥离多头股票资产部分的系统性风险或建立适当的股指期货多头头寸对冲市场向上风险。基金经理根据市场的变化、现货市场与期货市场的相关性等因素，计算需要用到的期货合约数量，对这个数量进行动态跟踪与测算，并进行适时灵活调整。同时，综合考虑各个月份期货合约之间的定价关系、套利机会、流动性以及保证金要求等因素，在各个月份期货合约之间进行动态配置，通过空头部分的优化创造额外收益。

本基金投资于股指期货，剥离系统性风险，大幅降低净值波动率，符合既定的投资政策和投资目标。

## 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

本基金本报告期末投资于国债期货。该策略符合基金合同的规定。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期没有投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

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

基金投资前十名证券的发行主体未有被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票均未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	13,789.84
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,221.74

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,011.58

#### 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

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

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
宏利改革动力混合 A	3,418	19,664.06	-	-	67,211,754.64	100.00
宏利改革动力混合 C	514	501.35	-	-	257,694.78	100.00
合计	3,932	17,159.07	-	-	67,469,449.42	100.00

注：分级基金机构/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	宏利改革动力混合 A	350,918.98	0.5221
	宏利改革动力混合 C	0.00	0.0000
	合计	350,918.98	0.5201

## 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	宏利改革动力混合 A	-
	宏利改革动力混合 C	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	宏利改革动力混合 A	10~50
	宏利改革动力混合 C	-
	合计	10~50

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	宏利改革动力混合 A	宏利改革动力混合 C
基金合同生效日 (2015年2月13日) 基金份额总额	1,931,765,423.15	-
本报告期期初基金份额总额	70,386,309.52	288,537.81
本报告期基金总申购份额	544,444.50	20,900.18
减：本报告期基金总赎回份额	3,718,999.38	51,743.21
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	67,211,754.64	257,694.78

## § 10 重大事件揭示

## 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金没有召开份额持有人大会。

## 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、本报告期内基金管理人未发生重大人事变动。
- 2、本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

## 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管理人、基金财产、本基金托管人、基金托管业务的诉讼事项。

#### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金无投资策略的变化。

#### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金未更换会计师事务所。

#### 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，基金管理人及其相关高级管理人员未受到稽查或处罚。

##### 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，本基金托管人的托管业务部门及其相关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 (%)	
华西证券	1	150,776,575.16	16.42	140,420.83	16.42	-
财通证券	1	130,903,633.55	14.26	121,911.21	14.26	-
华安证券	1	94,844,389.31	10.33	88,324.12	10.33	-
太平洋	2	84,191,352.27	9.17	78,408.56	9.17	-
长江证券	1	71,391,381.01	7.78	66,494.46	7.78	-
开源证券	1	61,495,635.39	6.70	57,272.00	6.70	-
东亚前海	1	60,934,677.05	6.64	56,749.05	6.64	-
西南证券	2	50,686,310.95	5.52	47,205.21	5.52	-
德邦证券	1	45,714,116.84	4.98	42,573.11	4.98	-
银河证券	2	34,367,419.12	3.74	32,005.72	3.74	-
国信证券	1	28,937,410.97	3.15	26,950.03	3.15	-

财信证券	2	27,298,611.6 3	2.97	25,424.71	2.97	-
国盛证券	2	20,442,432.6 4	2.23	19,038.74	2.23	-
中金公司	1	19,434,589.4 9	2.12	18,100.04	2.12	-
华泰证券	2	13,090,765.3 2	1.43	12,192.09	1.43	-
天风证券	1	12,702,356.0 0	1.38	11,829.53	1.38	-
中信建投	3	10,854,385.9 6	1.18	10,108.35	1.18	-
广发证券	1	10,430.00	0.00	9.72	0.00	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方财富	1	-	-	-	-	-
东方证券	3	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
新时代证 券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-

注：（一）本基金本报告期撤销平安证券，新增民生证券交易单元。

## (二) 交易单元选择的标准和程序

基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其交易单元作为基金的专用交易单元，选择的标准是：

- (1) 经营规范，有较完备的内控制度；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合证券交易的需要；
- (3) 能为基金管理人提供高质量的研究咨询服务。

## 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	
	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 (%)
华西证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
太平洋	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	2,518,000.00	100.00	-	-
开源证券	2,828,858.55	100.00	-	-	-	-
东亚前海	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
财信证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

华泰证 券	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
中信建 投	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-
安信证 券	-	-	-	-	-	-
渤海证 券	-	-	-	-	-	-
财达证 券	-	-	-	-	-	-
东北证 券	-	-	-	-	-	-
东方财 富	-	-	-	-	-	-
东方证 券	-	-	-	-	-	-
东吴证 券	-	-	-	-	-	-
方正证 券	-	-	-	-	-	-
光大证 券	-	-	-	-	-	-
国海证 券	-	-	-	-	-	-
国金证 券	-	-	-	-	-	-
国联证 券	-	-	-	-	-	-
国泰君 安	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
江海证 券	-	-	-	-	-	-
民生证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-



西部证 券	-	-	-	-	-	-
湘财证 券	-	-	-	-	-	-
新时代 证券	-	-	-	-	-	-
信达证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
浙商证 券	-	-	-	-	-	-
中山证 券	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-
中银国 际	-	-	-	-	-	-

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 影响投资者决策的其他重要信息

我公司已于 2023 年 4 月 22 日发布《关于公司法定名称变更的公告》，基金管理人名称由“泰达宏利基金管理有限公司”变更为“宏利基金管理有限公司”，该名称变更事项已于 2023 年 4 月完成工商变更登记手续。经基金托管人同意，并报中国证监会备案，我公司已于 2023 年 6 月 17 日发布《宏利基金管理有限公司关于旗下基金更名事宜的公告》，本基金名称改为宏利改革动力量化策略灵活配置混合型证券投资基金。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准本基金设立的文件；
- 2、基金合同；
- 3、托管协议；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、基金托管人业务资格批件和营业执照；

6、中国证监会要求的其他文件。

## 12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

## 12.3 查阅方式

投资人可登录中国证监会基金电子披露网站 (<http://eid.csrc.gov.cn/fund>) 或者基金管理人互联网网站 (<https://www.manulifefund.com.cn>) 查阅。

投资者对本报告书如有疑问, 可咨询本基金管理人宏利基金管理有限公司: 客户服务中心电话: 400-698-8888 或 010-66555662。

宏利基金管理有限公司

2023 年 8 月 31 日