

# 宏利价值长青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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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	10
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	12
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	12
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	14
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>39</b>
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45
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	46

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 .....	46
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 .....	46
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 .....	46
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	46
7.12 投资组合报告附注 .....	46
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>47</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	48
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	48
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>48</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>49</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	49
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 .....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	49
10.4 基金投资策略的改变 .....	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	49
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	49
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>50</b>
11.1 影响投资者决策的其他重要信息 .....	50
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>51</b>
12.1 备查文件目录 .....	51
12.2 存放地点 .....	51
12.3 查阅方式 .....	51

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	宏利价值长青混合型证券投资基金	
基金简称	宏利价值长青混合	
基金主代码	009141	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 6 月 24 日	
基金管理人	宏利基金管理有限公司	
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	224,082,560.96 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	宏利价值长青混合 A	宏利价值长青混合 C
下属分级基金的交易代码	009141	009142
报告期末下属分级基金的份额总额	213,203,015.64 份	10,879,545.32 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金精选业绩稳定的优质企业进行长期投资，在严格控制风险的前提下，力求实现资产净值的长期稳健增值。
投资策略	以寻找持续的超额利润创造能力为核心，长线投资于稳健发展的卓越龙头企业。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+恒生指数收益率×20%+中债综合指数收益率×30%。
风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平低于股票型基金，高于货币市场基金与债券型基金。本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

### 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	招商银行股份有限公司
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	95555
传真	010-66577666	0755-83195201
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

邮政编码	100026	518040
法定代表人	高贵鑫	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	证券时报
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)	
	宏利价值长青混合 A	宏利价值长青混合 C
本期已实现收益	-11,471,194.27	-528,157.58
本期利润	16,073,501.68	821,345.94
加权平均基金份额本期利润	0.0731	0.0706
本期加权平均净值利润率	9.51%	9.26%
本期基金份额净值增长率	10.07%	9.91%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)	
	宏利价值长青混合 A	宏利价值长青混合 C
期末可供分配利润	-46,604,370.47	-2,454,488.30
期末可供分配基金份额利润	-0.2186	-0.2256
期末基金资产净值	166,598,645.17	8,425,057.02
期末基金份额净值	0.7814	0.7744
3.1.3 累计期末	报告期末(2023年6月30日)	

指标		
基金份额累计净值增长率	-21.86%	-22.56%

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. 期末可供分配利润等于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

宏利价值长青混合 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	2.64%	2.31%	1.40%	0.69%	1.24%	1.62%
过去三个月	0.37%	1.75%	-3.72%	0.61%	4.09%	1.14%
过去六个月	10.07%	1.53%	-0.72%	0.64%	10.79%	0.89%
过去一年	-7.60%	1.55%	-9.22%	0.78%	1.62%	0.77%
过去三年	-21.87%	1.54%	-6.23%	0.83%	-15.64%	0.71%
自基金合同生效起至今	-21.86%	1.54%	-6.03%	0.83%	-15.83%	0.71%

宏利价值长青混合 C

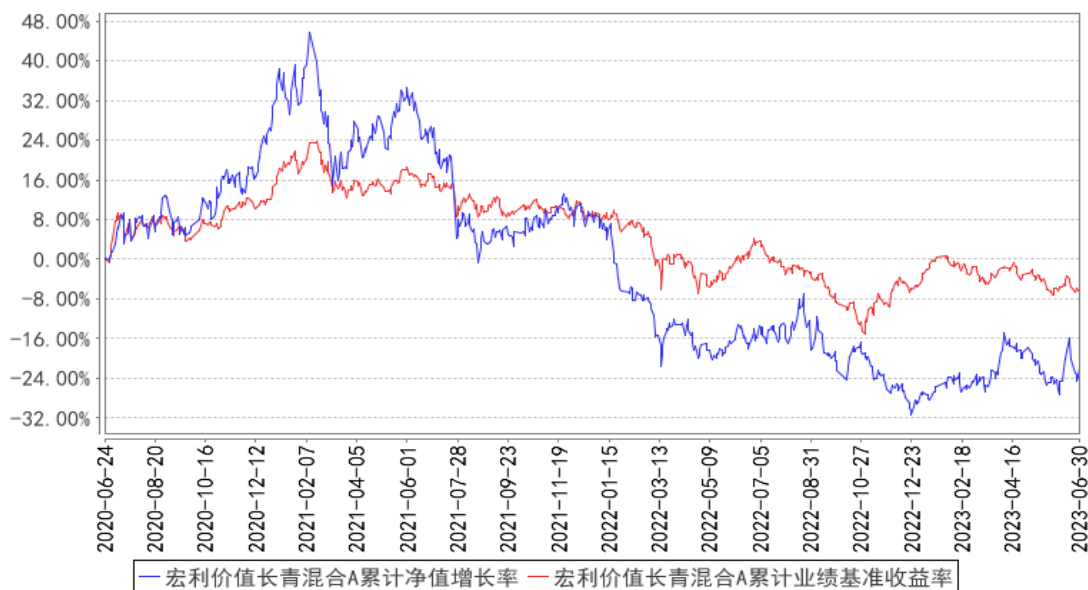
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.62%	2.31%	1.40%	0.69%	1.22%	1.62%
过去三个月	0.30%	1.75%	-3.72%	0.61%	4.02%	1.14%
过去六个月	9.91%	1.53%	-0.72%	0.64%	10.63%	0.89%
过去一年	-7.88%	1.55%	-9.22%	0.78%	1.34%	0.77%
过去三年	-22.56%	1.54%	-6.23%	0.83%	-16.33%	0.71%

					%	
自基金合同生效起 至今	-22.56%	1.54%	-6.03%	0.83%	-16.53%	0.71%

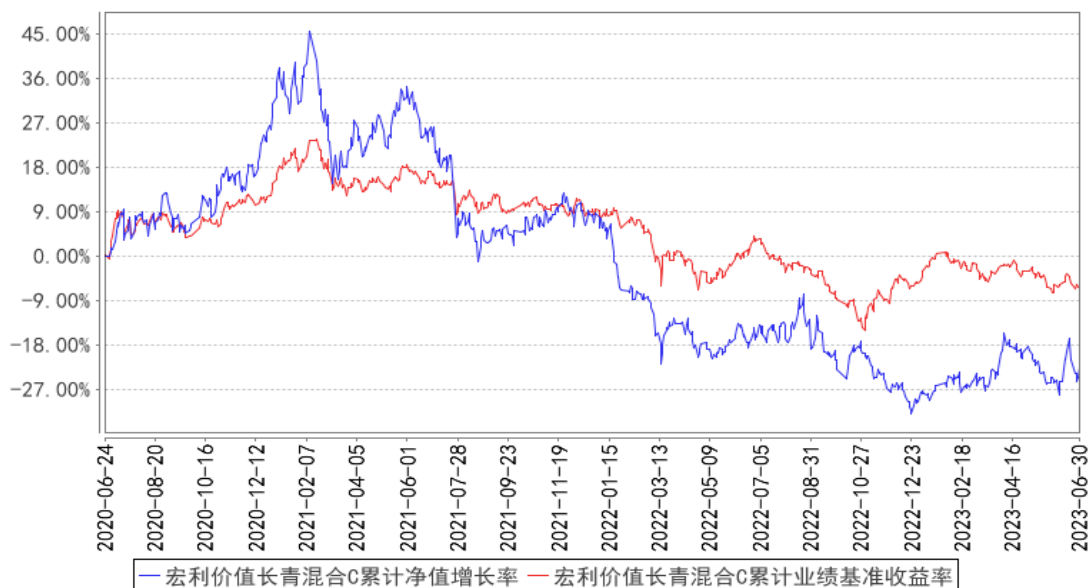
注：本基金的业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×50%+恒生指数收益率×20%+中债综合指数收益率×30%。

### 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

宏利价值长青混合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



宏利价值长青混合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		
吴华	资深基金经理	2020年6月24日	-	19年	北京大学金融学硕士；2004年6月至2006年3月就职于易方达基金管理有限公司，担任宏观策略分析员；2006年4月至2011年4月就职于中国国际金融有限公司，先后就职于研究部、资产管理部，担任经理、副总经理等职位；2011年5月加入宏利基金管理有限公司，现任资深基金经理；具备19年证券从业经验，19年证券投资基金管理经验，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，风险管理部对可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，对异常交易发生前后不同投资组合买卖该异常交易证券的情况进行分析，定期对各投资组合的交易行为进行整体分析评估，定期向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。如发现疑似异常交易情况，相关投资组合经理对该交易情况进行合理性解释。监察稽核部定期对异常交易制度的执行和控制工作进行稽核。

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处罚的情况。

## 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

报告期内本基金的操作思路：一个中心，两个基本点——以业绩高增长的预期为中心，把握好股票的买点和卖点。上半年本基金也是按该思路展开运作。

从长期的角度来看，基金经理依然认为人工智能为代表的科技浪潮是未来最重要的宏观主线。但由于该类股票今年年初以来涨幅较大，其交易可能已经较为拥挤，因此在短期内可能需要时间来消化获利盘。

进入下半年，本基金会砥砺前行，一方面要将短期和中长期的因素有机地结合起来，另一方面要努力适应变化的市场环境和经济环境，不断完善投资方法。争取在 2023 年下半年更好地为基金持有人服务。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末宏利价值长青混合 A 的基金份额净值为 0.7814 元，本报告期基金份额净值增长率为 10.07%，截至本报告期末宏利价值长青混合 C 的基金份额净值为 0.7744 元，本报告期基金份额净值增长率为 9.91%，同期业绩比较基准收益率为-0.72%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来整体市场可能会震荡。但内部结构会有明显的分化。从长期成长空间来看，基金经理依然看好对算力和 AIGC 等 TMT 方向。但从边际景气度的变化和交易拥挤的角度出发，基金经理看好两个方向：第一是光伏、风电和电网设备等新能源板块，第二是家居消费建材等相关板块。

进入下半年以来，全球有两个新发生的重大事件可能会对行业景气 and 基本面造成持久的影响。一是全球平均气温持续创历史新高。二是美国 CPI 数据超预期地回落到 3%。前者会导致各国会更加重视碳减排和新能源，进而导致光伏、风电和核能建设进一步加快。后者会导致美国利率见顶

并在不久后下降，这会进一步加快光伏、风电和核能项目的收益率，并刺激这些项目的增长。而随着新能源装机不断增长，电网设备的需求也在与日俱增。国内经济来看，下半年稳定经济的措施逐渐增多，着力的重点是刺激消费和稳定房地产。而家居消费建材则是在这两个方向都受益。这些措施可能会在 3、4 季度不断出台。最后，这两个方向的股票今年以来股价大部分都处于低位，前期较大的跌幅表明大部分资金已经将这些股票卖出，交易拥挤度很低。加之这些行业中有较多业绩较好，很有竞争力的可以跨越周期的标的。所以，它们的长期价值会为这些公司奠定较好的价值底部。整体下跌的空间有限。随着 3、4 季度这两个行业的催化剂的不断出现，市场有可能会更加关注这些公司的内在价值。

#### 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

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合规守信、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的真实、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 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：宏利价值长青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	1,443,600.97	8,445,387.76
结算备付金		1,918,410.06	287,264.34
存出保证金		110,471.98	111,186.57
交易性金融资产	6.4.7.2	171,827,957.97	162,209,273.95
其中：股票投资		162,850,684.98	149,972,711.83
基金投资		-	-
债券投资		8,977,272.99	12,236,562.12
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		5,315,367.20	-
应收股利		8,003.55	50.97
应收申购款		19,797.12	9,387.78
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		180,643,608.85	171,062,551.37
<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		4,171,083.56	0.13
应付赎回款		35,544.23	96,552.94
应付管理人报酬		215,432.15	221,747.94
应付托管费		35,905.37	36,957.99
应付销售服务费		2,105.44	2,173.14
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	1,159,835.91	468,303.22
负债合计		5,619,906.66	825,735.36
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	224,082,560.96	239,904,341.55
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-49,058,858.77	-69,667,525.54
净资产合计		175,023,702.19	170,236,816.01
负债和净资产总计		180,643,608.85	171,062,551.37

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 224,082,560.96 份，其中宏利价值长青混合 A 基金份额总额 213,203,015.64 份，基金份额净值 0.7814 元；宏利价值长青混合 C 基金份额总额 10,879,545.32 份，基金份额净值 0.7744 元。

## 6.2 利润表

会计主体：宏利价值长青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>		18,557,544.18	-62,557,390.34
1. 利息收入		21,922.30	118,154.02
其中：存款利息收入	6.4.7.13	21,922.30	71,360.32
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		-	46,793.70
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-10,373,472.46	-58,217,123.16
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-10,883,358.13	-62,852,637.16
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	117,063.16	212,743.60
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	392,822.51	4,422,770.40
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	28,894,199.47	-4,468,003.92
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	14,894.87	9,582.72
<b>减：二、营业总支出</b>		1,662,696.56	2,146,122.52
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,325,262.86	1,727,442.02
2. 托管费	6.4.10.2.2	220,877.19	287,906.97
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	13,227.77	15,516.94
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	331.02
其中：卖出回购金融资产支出		-	331.02
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	0.25
8. 其他费用	6.4.7.23	103,328.74	114,925.32
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		16,894,847.62	-64,703,512.86
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		16,894,847.62	-64,703,512.86
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		16,894,847.62	-64,703,512.86

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：宏利价值长青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）	239,904,341.55	-	-69,667,525.54	170,236,816.01
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）	239,904,341.55	-	-69,667,525.54	170,236,816.01
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-15,821,780.59	-	20,608,666.77	4,786,886.18
（一）、综合收益总额	-	-	16,894,847.62	16,894,847.62
（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）	-15,821,780.59	-	3,713,819.15	-12,107,961.44
其中：1. 基金申购款	7,156,579.29	-	-1,535,321.99	5,621,257.30
2. 基金赎回款	-22,978,359.88	-	5,249,141.14	-17,729,218.74
（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)	224,082,560.96	-	-49,058,858.77	175,023,702.19
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)	266,588,563.39	-	24,389,118.55	290,977,681.94
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)	266,588,563.39	-	24,389,118.55	290,977,681.94
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-7,689,177.47	-	-64,390,846.71	-72,080,024.18
(一)、综合收益总额	-	-	-64,703,512.86	-64,703,512.86
(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)	-7,689,177.47	-	312,666.15	-7,376,511.32
其中：1. 基金申购款	16,260,987.70	-	-2,113,503.66	14,147,484.04
2. 基金赎回款	-23,950,165.17	-	2,426,169.81	-21,523,995.36
(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)	258,899,385.92	-	-40,001,728.16	218,897,657.76

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

宏利价值长青混合型证券投资基金(原名为泰达宏利价值长青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[2019]2155号《关于准予泰达宏利价值长青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《泰达宏利价值长青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1,278,351,129.93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0357号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰达宏利价值长青混合型证券投资基金基金合同》于2020年6月24日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,278,718,247.15份基金份额,其中认购资金利息折合367,117.22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,基金托管人为招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)。

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日起更名为宏利价值长青混合型证券投资基金。

根据《宏利价值长青混合型证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用的基金份额,称为A类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费的、不收取认购/申购费用的基金份额,称为C类基金份额。本基金A类、C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金A类基金份额和C类基金份额分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《宏利价值长青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,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、港股通标的股票、债券(包括国债、地方政府债、政府支持债券、政府支持机构债券、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券(含分离交易可转债的纯债部分)、可交换债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、债券回购、资产支持证券、货币市场工具、银行存款(包括定期存款、协议存款、通知存款等)、同业存单、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)。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%；投资于港股通标的股票比例占股票投资比例的 0-50%；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，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；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沪深 300 指数收益率×50%+恒生指数收益率×20%+中债综合指数收益率×30%。

#### 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》、《宏利价值长青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

本基金本报告期末发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 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]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。

(4) 对基金通过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。

(5) 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。

(6) 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	1,443,600.97
等于：本金	1,443,385.24
加：应计利息	215.73
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	1,443,600.97

##### 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	152,743,773.11	-	162,850,684.98	10,106,911.87	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	8,831,506.00	156,152.99	8,977,272.99	-10,386.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	8,831,506.00	156,152.99	8,977,272.99	-10,386.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	161,575,279.11	156,152.99	171,827,957.97	10,096,525.87	

### 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	0.11
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,066,075.65
其中：交易所市场	1,066,075.65
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	93,760.15
合计	1,159,835.91

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

## 宏利价值长青混合 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	227,960,801.69	227,960,801.69
本期申购	3,335,606.72	3,335,606.72
本期赎回（以“-”号填列）	-18,093,392.77	-18,093,392.77
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	213,203,015.64	213,203,015.64

## 宏利价值长青混合 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	11,943,539.86	11,943,539.86
本期申购	3,820,972.57	3,820,972.57
本期赎回（以“-”号填列）	-4,884,967.11	-4,884,967.11
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	10,879,545.32	10,879,545.32

注：若本基金有分红及转换业务，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

宏利价值长青混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-3,077,044.83	-63,061,782.64	-66,138,827.47
本期利润	-11,471,194.27	27,544,695.95	16,073,501.68
本期基金份额交易产生的变动数	343,906.91	3,117,048.41	3,460,955.32
其中：基金申购款	-100,946.15	-649,301.68	-750,247.83
基金赎回款	444,853.06	3,766,350.09	4,211,203.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-14,204,332.19	-32,400,038.28	-46,604,370.47

宏利价值长青混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-240,273.73	-3,288,424.34	-3,528,698.07
本期利润	-528,157.58	1,349,503.52	821,345.94
本期基金份额交易产生的变动数	-35,888.75	288,752.58	252,863.83
其中：基金申购款	-151,856.49	-633,217.67	-785,074.16
基金赎回款	115,967.74	921,970.25	1,037,937.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-804,320.06	-1,650,168.24	-2,454,488.30

#### 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	13,871.64
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	7,284.66
其他	766.00
合计	21,922.30

#### 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	-10,883,358.13
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	-10,883,358.13

#### 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	786,902,146.28
减：卖出股票成本总额	795,416,613.10
减：交易费用	2,368,891.31
买卖股票差价收入	-10,883,358.13

#### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期末有股票投资收益-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	113,117.10
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	3,946.06
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	117,063.16

##### 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	3,363,796.65
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,292,227.88
减：应计利息总额	67,621.23
减：交易费用	1.48
买卖债券差价收入	3,946.06

##### 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	392,822.51
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	392,822.51

#### 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	28,894,199.47
股票投资	28,906,756.59
债券投资	-12,557.12
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	28,894,199.47

#### 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	14,824.50
基金转换费收入	70.37
合计	14,894.87

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	5,052.94
账户维护费	9,000.00

其他	15.65
合计	103,328.74

#### 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、基金销售机构、注册登记机构
招商银行股份有限公司(招商银行)	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	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	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	1,325,262.86	1,727,442.02
其中：支付销售机构的客户维护费	637,739.35	784,933.86

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	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	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	220,877.19	287,906.97

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		
	宏利价值长青混合 A	宏利价值长青混合 C	合计
宏利基金管理有限公司	-	0.82	0.82
招商银行	-	6,782.13	6,782.13
合计	-	6,782.95	6,782.95
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		
	宏利价值长青混合 A	宏利价值长青混合 C	合计
宏利基金管理有限公司	-	0.29	0.29
招商银行	-	8,295.00	8,295.00
合计	-	8,295.29	8,295.29

注：支付基金销售机构的销售服务费按 C 类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 类基金份额销售服务费 = 前一日 C 类基金份额基金资产净值 × 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银行间同业市场债券(含回购)的交易。

#### 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的情况。

##### 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
招商银行	1,443,600.97	13,871.64	8,482,480.49	55,913.45

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，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无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 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其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 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

本基金本报告期末未有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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，预期收益及风险水平低于股票型基金，高于货币市场基金与债券型基金。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、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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行招商银行，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，本基金未持有除国债、央行票据、政策性金融债和同业存单以外的债券投资、资产支持证券投资。(2022 年 12 月 31 日：本基金持有除国债、央行票据、政策性金融债和同业存单以外的债券、资产支持证券投资占基金资产净值的比例为 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》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期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

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 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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未来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	1,443,600.97	-	-	-	1,443,600.97
结算备付金	1,918,410.06	-	-	-	1,918,410.06
存出保证金	110,471.98	-	-	-	110,471.98
交易性金融资产	8,977,272.99	-	-	162,850,684.98	171,827,957.97
应收股利	-	-	-	8,003.55	8,003.55
应收申购款	-	-	-	19,797.12	19,797.12
应收清算款	-	-	-	5,315,367.20	5,315,367.20
资产总计	12,449,756.00	-	-	168,193,852.85	180,643,608.85
负债					
应付赎回款	-	-	-	35,544.23	35,544.23
应付管理人报酬	-	-	-	215,432.15	215,432.15
应付托管费	-	-	-	35,905.37	35,905.37
应付清算款	-	-	-	4,171,083.56	4,171,083.56
应付销售服务费	-	-	-	2,105.44	2,105.44
其他负债	-	-	-	1,159,835.91	1,159,835.91
负债总计	-	-	-	5,619,906.66	5,619,906.66
利率敏感度缺口	12,449,756.00	-	-	-162,573,946.19	175,023,702.19
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	8,445,387.76	-	-	-	8,445,387.76
结算备付金	287,264.34	-	-	-	287,264.34
存出保证金	111,186.57	-	-	-	111,186.57
交易性金融资产	12,199,362.05	-	37,200.07	149,972,711.83	162,209,273.95
应收股利	-	-	-	50.97	50.97
应收申购款	-	-	-	9,387.78	9,387.78

资产总计	21,043,200.72	-	37,200.07	149,982,150.58	171,062,551.37
负债					
应付赎回款	-	-	-	96,552.94	96,552.94
应付管理人报酬	-	-	-	221,747.94	221,747.94
应付托管费	-	-	-	36,957.99	36,957.99
应付清算款	-	-	-	0.13	0.13
应付销售服务费	-	-	-	2,173.14	2,173.14
其他负债	-	-	-	468,303.22	468,303.22
负债总计	-	-	-	825,735.36	825,735.36
利率敏感度缺口	21,043,200.72	-	37,200.07	149,156,415.22	170,236,816.01

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，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金净资产的比例为 5.13%（2022 年 12 月 31 日：7.19%），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 2023 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	120,629.83	-	120,629.83
资产合计	-	120,629.83	-	120,629.83
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	-	120,629.83	-	120,629.83
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			

	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	607,068.92	-	607,068.92
资产合计	-	607,068.92	-	607,068.92
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	-	607,068.92	-	607,068.92

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	所有外币相对人民币升值5%	10,000.00	30,000.00
	所有外币相对人民币贬值5%	-10,000.00	-30,000.00

#### 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基金资产的

比例为 60%-95%，投资于港股通标的股票比例占股票投资比例的 0-50%；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。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	162,850,684.98	93.04	149,972,711.83	88.10
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	162,850,684.98	93.04	149,972,711.83	88.10

#### 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%	7,420,000.00	4,670,000.00
	沪深 300 指数下降 5%	-7,420,000.00	-4,670,000.00

## 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	162,850,684.98	149,743,511.90
第二层次	8,977,272.99	12,465,762.05
第三层次	-	-
合计	171,827,957.97	162,209,273.95

#### 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的转换时点。

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、债券和基金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

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	162,850,684.98	90.15
	其中：股票	162,850,684.98	90.15
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	8,977,272.99	4.97
	其中：债券	8,977,272.99	4.97
	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	3,362,011.03	1.86
8	其他各项资产	5,453,639.85	3.02
9	合计	180,643,608.85	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	-	-
B	采矿业	71,808.00	0.04
C	制造业	157,450,931.43	89.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	10,006.54	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,831,768.40	2.19
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-

N	水利、环境和公共设施管理业	1,365,540.78	0.78
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	162,730,055.15	92.98

### 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（%）
地产建筑业	-	-
医疗保健	-	-
电信服务	-	-
消费者常用品	-	-
信息技术	-	-
金融	-	-
公用事业	-	-
基础材料	-	-
工业	105,791.67	0.06
能源	10,037.04	0.01
消费者非必需品	4,801.12	0.00
合计	120,629.83	0.07

### 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	601138	工业富联	598,100	15,072,120.00	8.61
2	603019	中科曙光	286,500	14,582,850.00	8.33
3	000063	中兴通讯	305,300	13,903,362.00	7.94
4	000938	紫光股份	359,600	11,453,260.00	6.54
5	688048	长光华芯	105,366	9,959,194.32	5.69
6	600487	亨通光电	661,700	9,700,522.00	5.54
7	002371	北方华创	29,200	9,275,380.00	5.30
8	300567	精测电子	83,700	7,964,055.00	4.55
9	688072	拓荆科技	18,653	7,945,618.41	4.54
10	688037	芯源微	45,238	7,733,436.10	4.42
11	688498	源杰科技	22,939	6,537,615.00	3.74
12	600312	平高电气	398,400	4,936,176.00	2.82
13	300548	博创科技	133,900	4,612,855.00	2.64
14	300252	金信诺	329,100	3,699,084.00	2.11
15	688361	中科飞测	40,192	3,336,337.92	1.91
16	000988	华工科技	77,300	2,938,173.00	1.68
17	300474	景嘉微	32,200	2,897,678.00	1.66
18	688041	海光信息	39,724	2,711,957.48	1.55



19	002463	沪电股份	128,100	2,682,414.00	1.53
20	688120	华海清科	10,034	2,529,069.70	1.44
21	688099	晶晨股份	28,066	2,366,525.12	1.35
22	688372	伟测科技	11,575	1,772,711.25	1.01
23	603986	兆易创新	15,700	1,668,125.00	0.95
24	002396	星网锐捷	70,000	1,581,300.00	0.90
25	300456	赛微电子	63,700	1,559,376.00	0.89
26	603893	瑞芯微	20,400	1,486,140.00	0.85
27	002549	凯美特气	118,200	1,359,300.00	0.78
28	301191	菲菱科思	13,100	1,354,802.00	0.77
29	300499	高澜股份	76,000	1,339,120.00	0.77
30	002139	拓邦股份	64,300	839,115.00	0.48
31	002315	焦点科技	19,100	764,000.00	0.44
32	300458	全志科技	26,300	716,675.00	0.41
33	688521	芯原股份	9,585	689,353.20	0.39
34	603728	鸣志电器	2,300	184,690.00	0.11
35	300580	贝斯特	6,800	165,172.00	0.09
36	00564	郑煤机	16,800	105,791.67	0.06
37	300014	亿纬锂能	1,400	84,700.00	0.05
38	002487	大金重工	2,600	80,184.00	0.05
39	600188	兖矿能源	2,400	71,808.00	0.04
40	300702	天宇股份	1,400	33,978.00	0.02
41	002732	燕塘乳业	1,200	25,944.00	0.01
42	300973	立高食品	360	24,631.20	0.01
43	301117	佳缘科技	184	11,890.08	0.01
44	00883	中国海洋石油	972	10,037.04	0.01
45	301122	采纳股份	211	7,515.82	0.00
46	301135	瑞德智能	237	6,498.54	0.00
47	301109	军信股份	378	6,240.78	0.00
48	000333	美的集团	100	5,892.00	0.00
49	301177	迪阿股份	152	5,841.36	0.00
50	301201	诚达药业	141	5,809.20	0.00
51	301190	善水科技	284	5,336.36	0.00
52	301207	华兰疫苗	157	5,221.82	0.00
53	301055	张小泉	355	5,051.65	0.00
54	301206	三元生物	144	5,038.56	0.00
55	002032	苏泊尔	100	5,000.00	0.00
56	03998	波司登	1,578	4,801.12	0.00
57	301189	奥尼电子	150	4,588.50	0.00
58	301166	优宁维	97	4,165.18	0.00
59	301053	远信工业	155	3,932.35	0.00
60	301196	唯科科技	95	3,225.25	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	000063	中兴通讯	25,022,270.94	14.70
2	603019	中科曙光	24,276,040.00	14.26
3	000977	浪潮信息	22,746,855.24	13.36
4	000938	紫光股份	22,351,702.64	13.13
5	300896	爱美客	18,848,582.00	11.07
6	603027	千禾味业	18,615,759.20	10.94
7	688041	海光信息	17,941,157.78	10.54
8	601138	工业富联	17,696,836.00	10.40
9	000858	五粮液	17,324,860.00	10.18
10	002025	航天电器	17,280,289.00	10.15
11	600519	贵州茅台	16,918,909.00	9.94
12	300017	网宿科技	16,492,517.09	9.69
13	688037	芯源微	15,533,437.24	9.12
14	300567	精测电子	15,445,793.00	9.07
15	000568	泸州老窖	14,598,901.80	8.58
16	601318	中国平安	14,455,853.00	8.49
17	601628	中国人寿	14,344,045.00	8.43
18	688502	茂莱光学	14,249,836.44	8.37
19	300015	爱尔眼科	13,694,153.20	8.04
20	300674	宇信科技	12,545,967.11	7.37
21	688981	中芯国际	12,075,958.48	7.09
22	002371	北方华创	10,707,985.00	6.29
23	603369	今世缘	10,497,469.00	6.17
24	000988	华工科技	10,058,339.65	5.91
25	688050	爱博医疗	9,784,311.16	5.75
26	002612	朗姿股份	9,532,645.00	5.60
27	688072	拓荆科技	9,442,381.94	5.55
28	600487	亨通光电	9,419,393.00	5.53
29	300251	光线传媒	8,949,796.59	5.26
30	300595	欧普康视	8,947,190.90	5.26
31	688515	裕太微	8,590,358.23	5.05
32	600702	舍得酒业	8,492,212.00	4.99
33	002847	盐津铺子	8,491,942.00	4.99
34	600312	平高电气	8,428,295.16	4.95
35	688568	中科星图	8,411,772.92	4.94
36	600879	航天电子	8,411,575.00	4.94
37	688048	长光华芯	8,191,344.36	4.81
38	600977	中国电影	7,785,488.00	4.57

39	603138	海量数据	7,696,131.65	4.52
40	002991	甘源食品	7,662,252.00	4.50
41	300788	中信出版	7,495,339.00	4.40
42	688012	中微公司	7,096,989.72	4.17
43	603589	口子窖	6,461,555.00	3.80
44	002913	奥士康	6,259,508.00	3.68
45	000400	许继电气	6,136,833.00	3.60
46	600809	山西汾酒	6,022,210.00	3.54
47	002304	洋河股份	5,908,799.00	3.47
48	000860	顺鑫农业	5,784,640.00	3.40
49	688489	三未信安	5,369,028.68	3.15
50	688366	昊海生科	4,952,988.53	2.91
51	688120	华海清科	4,951,691.12	2.91
52	603306	华懋科技	4,919,318.00	2.89
53	688066	航天宏图	4,911,654.23	2.89
54	000963	华东医药	4,800,036.00	2.82
55	000596	古井贡酒	4,621,070.34	2.71
56	002049	紫光国微	4,371,526.00	2.57
57	688498	源杰科技	4,271,430.67	2.51
58	300548	博创科技	4,217,325.00	2.48
59	688017	绿的谐波	4,108,875.07	2.41
60	300308	中际旭创	4,053,945.00	2.38
61	601179	中国西电	4,033,615.00	2.37
62	300252	金信诺	3,865,903.00	2.27
63	300638	广和通	3,862,828.50	2.27
64	300533	冰川网络	3,729,946.00	2.19
65	300339	润和软件	3,685,838.80	2.17
66	300474	景嘉微	3,651,499.00	2.14
67	600038	中直股份	3,598,736.00	2.11
68	300226	上海钢联	3,529,971.00	2.07
69	601988	中国银行	3,510,900.00	2.06
70	000738	航发控制	3,500,958.00	2.06

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	000977	浪潮信息	24,393,484.00	14.33
2	603019	中科曙光	23,109,631.22	13.57
3	688041	海光信息	18,684,122.96	10.98
4	603027	千禾味业	17,760,872.06	10.43

5	300017	网宿科技	17,424,195.00	10.24
6	300896	爱美客	17,241,155.00	10.13
7	000858	五粮液	16,866,546.32	9.91
8	600519	贵州茅台	16,162,602.00	9.49
9	002025	航天电器	15,899,175.00	9.34
10	002371	北方华创	15,295,855.00	8.99
11	300760	迈瑞医疗	13,976,606.52	8.21
12	688072	拓荆科技	13,974,028.84	8.21
13	000568	泸州老窖	13,971,257.00	8.21
14	601628	中国人寿	13,556,030.00	7.96
15	688502	茂莱光学	13,465,014.31	7.91
16	688981	中芯国际	13,240,333.86	7.78
17	601318	中国平安	13,158,296.36	7.73
18	688120	华海清科	13,108,665.56	7.70
19	300015	爱尔眼科	12,388,754.31	7.28
20	002049	紫光国微	12,337,583.40	7.25
21	000938	紫光股份	12,252,873.15	7.20
22	000063	中兴通讯	12,226,729.00	7.18
23	300674	宇信科技	12,165,262.94	7.15
24	603369	今世缘	9,991,544.00	5.87
25	300416	苏试试验	9,900,036.00	5.82
26	688037	芯源微	9,362,079.16	5.50
27	688050	爱博医疗	9,361,165.83	5.50
28	300251	光线传媒	9,142,995.00	5.37
29	300788	中信出版	9,049,747.00	5.32
30	688568	中科星图	8,989,791.86	5.28
31	600879	航天电子	8,442,022.00	4.96
32	603138	海量数据	8,434,648.31	4.95
33	300595	欧普康视	8,274,218.83	4.86
34	000738	航发控制	8,213,354.00	4.82
35	002612	朗姿股份	7,998,379.96	4.70
36	002847	盐津铺子	7,987,374.00	4.69
37	688012	中微公司	7,944,094.58	4.67
38	600977	中国电影	7,896,213.00	4.64
39	000988	华工科技	7,882,992.00	4.63
40	000733	振华科技	7,710,757.26	4.53
41	601138	工业富联	7,701,434.00	4.52
42	600702	舍得酒业	7,622,836.00	4.48
43	688122	西部超导	7,601,604.09	4.47
44	688776	国光电气	7,597,538.08	4.46
45	688515	裕太微	7,500,629.42	4.41
46	002991	甘源食品	7,012,957.00	4.12
47	688308	欧科亿	6,904,341.26	4.06

48	002913	奥士康	6,903,774.00	4.06
49	603712	七一二	6,796,514.73	3.99
50	300567	精测电子	6,720,507.00	3.95
51	300308	中际旭创	6,131,061.06	3.60
52	603589	口子窖	6,072,964.00	3.57
53	000400	许继电气	5,961,696.00	3.50
54	002304	洋河股份	5,672,036.82	3.33
55	600809	山西汾酒	5,547,296.00	3.26
56	688489	三未信安	5,375,272.63	3.16
57	688016	心脉医疗	5,178,495.78	3.04
58	002908	德生科技	5,122,415.00	3.01
59	000860	顺鑫农业	5,119,906.00	3.01
60	002549	凯美特气	5,084,346.00	2.99
61	688066	航天宏图	4,907,271.29	2.88
62	603306	华懋科技	4,778,301.00	2.81
63	000596	古井贡酒	4,312,686.00	2.53
64	300122	智飞生物	4,302,298.63	2.53
65	300339	润和软件	4,291,166.00	2.52
66	300638	广和通	4,213,190.00	2.47
67	000963	华东医药	4,049,473.00	2.38
68	688366	昊海生科	4,041,872.36	2.37
69	300533	冰川网络	3,924,158.00	2.31
70	300226	上海钢联	3,834,600.65	2.25
71	600312	平高电气	3,767,636.00	2.21
72	300274	阳光电源	3,738,811.00	2.20
73	601179	中国西电	3,736,073.00	2.19
74	688017	绿的谐波	3,621,640.56	2.13
75	605507	国邦医药	3,484,679.00	2.05

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。

#### 7.4.3 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	779,387,829.66
卖出股票收入（成交）总额	786,902,146.28

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

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	8,977,272.99	5.13

2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	8,977,272.99	5.13

## 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	019663	21 国债 15	88,000	8,977,272.99	5.13

注：以上为本基金本报告期末持有的全部债券投资。

## 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投资。

## 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。

## 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

在报告期内，本基金未投资于国债期货。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

本报告期本基金未投资国债期货。

## 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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，紫光股份有限公司于 2023 年 3 月 31 日曾受到北京市规划和自然资源委员会海淀分局公开处罚；沈阳芯源微电子设备股份有限公司于 2022 年 9 月

16 日曾受到沈阳市城乡建设局公开处罚。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票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	110,471.98
2	应收清算款	5,315,367.20
3	应收股利	8,003.55
4	应收利息	-
5	应收申购款	19,797.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,453,639.85

### 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 (%)
宏利价值长青混合 A	4,294	49,651.38	-	-	213,203,015.64	100.00

宏利价值长青混合 C	1,632	6,666.39	-	-	10,879,545.32	100.00
合计	5,926	37,813.46	-	-	224,082,560.96	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	宏利价值长青混合 A	36,943.48	0.0173
	宏利价值长青混合 C	0.00	0.0000
	合计	36,943.48	0.0165

## 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	宏利价值长青混合 A	-
	宏利价值长青混合 C	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	宏利价值长青混合 A	0~10
	宏利价值长青混合 C	-
	合计	0~10

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	宏利价值长青混合 A	宏利价值长青混合 C
基金合同生效日 （2020年6月24日） 基金份额总额	1,264,090,576.56	14,627,670.59
本报告期期初基金份额总额	227,960,801.69	11,943,539.86
本报告期基金总申购份额	3,335,606.72	3,820,972.57
减：本报告期基金总赎回份额	18,093,392.77	4,884,967.11
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份	213,203,015.64	10,879,545.32



额总额

## § 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，基金托管人无重大人事变动。

### 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

本报告期内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，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

### 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	1	799,344,262.45	51.03	744,430.20	51.04	-
申港证券	1	722,737,999.82	46.14	673,086.26	46.15	-
华西证券	2	43,662,542.41	2.79	40,663.95	2.79	-
国泰君安	2	545,171.26	0.03	272.59	0.02	-

开源证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-

注：（一）本基金本报告期撤销中信证券 47256 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 (%)
中信证券	-	-	-	-	-	-
申港证券	1,696,196.20	100.00	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-

## § 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

宏利价值长青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