

宏利中证 500 指数增强型证券投资基金  
(LOF)  
2024 年第 2 季度报告

2024 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

报告送出日期：2024 年 7 月 19 日

## §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。

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 2024 年 07 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告期间为 2024 年 04 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日。

## §2 基金产品概况

基金简称	宏利 500 指数增强 (LOF)
场内简称	宏利 500
基金主代码	162216
基金运作方式	上市契约型开放式 (LOF)
基金合同生效日	2019 年 11 月 6 日
报告期末基金份额总额	191,290,965.78 份
投资目标	本基金为股票型指数增强基金，在对中证 500 指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%，力争获取超越标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用指数增强型投资策略，在控制与比较基准偏离风险的前提下，综合利用多种量化投资模型和指数增强技术，力争获得超越业绩比较基准的投资收益。
业绩比较基准	$95\% \times \text{中证 500 指数收益率} + 5\% \times 1 \text{ 年期定期存款利率 (税后)}$
风险收益特征	本基金为股票型指数增强型基金，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。
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

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2024 年 4 月 1 日-2024 年 6 月 30 日）
1. 本期已实现收益	6,474,372.82
2. 本期利润	-6,530,447.16
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0339
4. 期末基金资产净值	214,572,465.69
5. 期末基金份额净值	1.1217

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。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率 ①	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
过去三个月	-2.99%	1.02%	-6.15%	1.09%	3.16%	-0.07%
过去六个月	-4.19%	1.44%	-8.43%	1.53%	4.24%	-0.09%
过去一年	-14.27%	1.15%	-16.66%	1.21%	2.39%	-0.06%
过去三年	-27.52%	1.12%	-25.88%	1.14%	-1.64%	-0.02%
自基金合同 生效起至今	18.46%	1.20%	-0.78%	1.21%	19.24%	-0.01%

注：本基金的业绩比较基准：中证 500 指数收益率\*95%+1 年期定期存款利率(税后)\*5%。

#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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500指数增强(LOF)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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李婷婷	本基金基金经理	2023年6月28日	-	7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7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	2019年11月6日	-	9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9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 公平交易专项说明

#### 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。在本报告期内，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 报告期内基金的投资策略和运作分析

二季度后半程市场出现阶段性波动与回调，一方面是基于前期市场上涨的正常调整，另一方面四、五月份金融数据低于预期，市场流动性短暂受限。目前市场的增量资金主要来自保险等中长期资金，因此红利风格仍然相对占优，以 AI 为代表的部分成长板块短期有所表现。市值维度更加偏向大市值风格，在经济修复初期大市值公司业绩确定性更高，同时估值相对中小盘更有优势，因此以沪深 300、A50 为代表的大盘宽基指数相对占优。

本基金在操作中恪守基金合同，采用指数增强策略，严格控制跟踪误差及其他风险属性。使用量化选股手段，挑选盈利质量高、盈利增速稳定、估值合理的中盘绩优股票。选股风格偏向长期基本面，较好的控制了持仓换手率与交易成本。持仓结构分散以控制个股风险，仓位保持合理稳定。本报告期内，本基金增加了机械、通信、电力设备及新能源的配置，减少了商贸零售、农林牧渔、煤炭的配置。

### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.1217 元；本报告期基金份额净值增长率为-2.99%，业绩

比较基准收益率为-6.15%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	200,422,491.89	92.91
	其中：股票	200,422,491.89	92.91
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	15,168,015.05	7.03
8	其他资产	129,487.34	0.06
9	合计	215,719,994.28	100.00

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	838,079.00	0.39
B	采矿业	5,737,413.00	2.67
C	制造业	114,590,719.02	53.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,270,634.00	2.92
E	建筑业	1,507,881.00	0.70
F	批发和零售业	2,721,743.88	1.27
G	交通运输、仓储和邮政业	5,323,863.00	2.48
H	住宿和餐饮业	192,660.00	0.09
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,404,091.95	5.78
J	金融业	15,929,111.40	7.42
K	房地产业	1,573,828.00	0.73

L	租赁和商务服务业	614,133.00	0.29
M	科学研究和技术服务业	385,845.60	0.18
N	水利、环境和公共设施管理业	333,396.00	0.16
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	3,243,075.00	1.51
S	综合	124,608.00	0.06
	合计	171,791,081.85	80.06

### 5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	2,239,046.00	1.04
C	制造业	21,239,762.84	9.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	898,632.00	0.42
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	568,602.80	0.26
G	交通运输、仓储和邮政业	188,758.00	0.09
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,370,240.60	0.64
J	金融业	785,652.00	0.37
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,116,346.00	0.52
M	科学研究和技术服务业	104,440.00	0.05
N	水利、环境和公共设施管理业	119,929.80	0.06
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	28,631,410.04	13.34

### 5.2.3 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。

## 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

### 5.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	300502	新易盛	28,800	3,039,840.00	1.42
2	601717	郑煤机	204,995	3,033,926.00	1.41
3	601991	大唐发电	916,800	2,759,568.00	1.29
4	002128	电投能源	126,600	2,671,260.00	1.24
5	002517	恺英网络	275,000	2,626,250.00	1.22
6	000630	铜陵有色	720,700	2,601,727.00	1.21
7	000830	鲁西化工	215,200	2,494,168.00	1.16
8	603160	汇顶科技	35,600	2,447,500.00	1.14
9	002340	格林美	381,400	2,429,518.00	1.13
10	600885	宏发股份	86,400	2,391,552.00	1.11

### 5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	002106	莱宝高科	122,400	1,334,160.00	0.62
2	000758	中色股份	255,600	1,298,448.00	0.61
3	688208	道通科技	47,300	1,141,822.00	0.53
4	300226	上海钢联	65,900	1,116,346.00	0.52
5	300679	电连技术	25,500	1,025,865.00	0.48

### 5.4 报告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。

### 5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

### 5.7 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。

### 5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货持仓和损益明细。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 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。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货持仓和损益明细。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本报告期本基金没有投资国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1 本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，鲁西化工集团股份有限公司于 2023 年 8 月 25 日、2024 年 6 月 5 日曾受到聊城高新技术产业开发区管理委员会公开处罚。

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。

### 5.11.2 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。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	36,907.31
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-

5	应收申购款	92,580.03
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	129,487.34

#### 5.11.4 报告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。

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

##### 5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

#### 5.11.6 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。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	193,537,908.50
报告期期间基金总申购份额	4,547,083.83
减：报告期期间基金总赎回份额	6,794,026.55
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	191,290,965.78

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

#### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金的管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。

#### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金的管理人在本报告期内未运用固有资金投资本基金。

## §8 备查文件目录

#### 8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准本基金设立的文件；

- 2、《宏利中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金合同》；
- 3、《宏利中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) 招募说明书》；
- 4、《宏利中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) 托管协议》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、中国证监会要求的其他文件。

## 8.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

## 8.3 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。

宏利基金管理有限公司

2024 年 7 月 19 日