

宏利波控回报 12 个月持有期混合型证券投资
基金
2024 年中期报告

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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2024 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 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 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
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
§ 5 托管人报告	12
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	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55
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	55
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	55
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	55

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	55
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	56
7.12 投资组合报告附注	56
§ 8 基金份额持有人信息	57
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	57
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57
§ 9 开放式基金份额变动	58
§ 10 重大事件揭示	58
10.1 基金份额持有人大会决议	58
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	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
10.4 基金投资策略的改变	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
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	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	58
§ 11 备查文件目录	60
11.1 备查文件目录	60
11.2 存放地点	60
11.3 查阅方式	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	宏利波控回报 12 个月持有期混合型证券投资基金
基金简称	宏利波控回报 12 个月持有混合
基金主代码	010845
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 1 月 19 日
基金管理人	宏利基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	483,839,863.19 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，通过积极主动的管理，力争创造高于业绩比较基准的投资收益与长期资本增值。
投资策略	本基金将采取目标波动风险预算技术进行资产配置，量化与基本面结合的股票投资策略进行权益部分投资，以及采用多种策略进行固定收益部分投资。通过综合运用以上技术，本基金将优化投资过程，在限制组合整体预期波动率的前提下，实现风险约束下投资组合 alpha 的最大化，以便获得尽可能高回报。
业绩比较基准	中债综合指数收益率×85%+中证 800 指数收益率×10%+恒生指数收益率（经汇率调整）×5%。
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。本基金可投资港股通标的股票，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

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	中国农业银行股份有限公司
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	95599
传真	010-66577666	010-68121816
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	北京市东城区建国门内大街 69 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 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	100026	100031
法定代表人	高贵鑫	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	https://www.manulifefund.com.cn
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(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	4,525,909.26
本期利润	8,882,008.37
加权平均基金份额本期利润	0.0159
本期加权平均净值利润率	1.60%
本期基金份额净值增长率	1.60%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-5,847,770.17
期末可供分配基金份额利润	-0.0121
期末基金资产净值	484,021,264.49
期末基金份额净值	1.0004
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	0.04%

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

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	-0.42%	0.19%	0.05%	0.08%	-0.47%	0.11%
过去三个月	1.14%	0.21%	0.99%	0.11%	0.15%	0.10%

过去六个月	1.60%	0.31%	2.22%	0.15%	-0.62%	0.16%
过去一年	0.81%	0.26%	1.30%	0.14%	-0.49%	0.12%
过去三年	-0.29%	0.26%	0.29%	0.17%	-0.58%	0.09%
自基金合同生效起至今	0.04%	0.25%	0.44%	0.17%	-0.40%	0.08%

注：本基金业绩比较基准：中债综合指数收益率×85%+中证 800 指数收益率×10%+恒生指数收益率(经汇率调整)×5%

中债综合指数由中央国债登记结算有限公司编制，该指数旨在综合反映债券全市场整体价格和投资回报情况。指数涵盖了银行间市场和交易所市场，具有广泛的市场代表性，适合作为本基金的业绩比较基准。

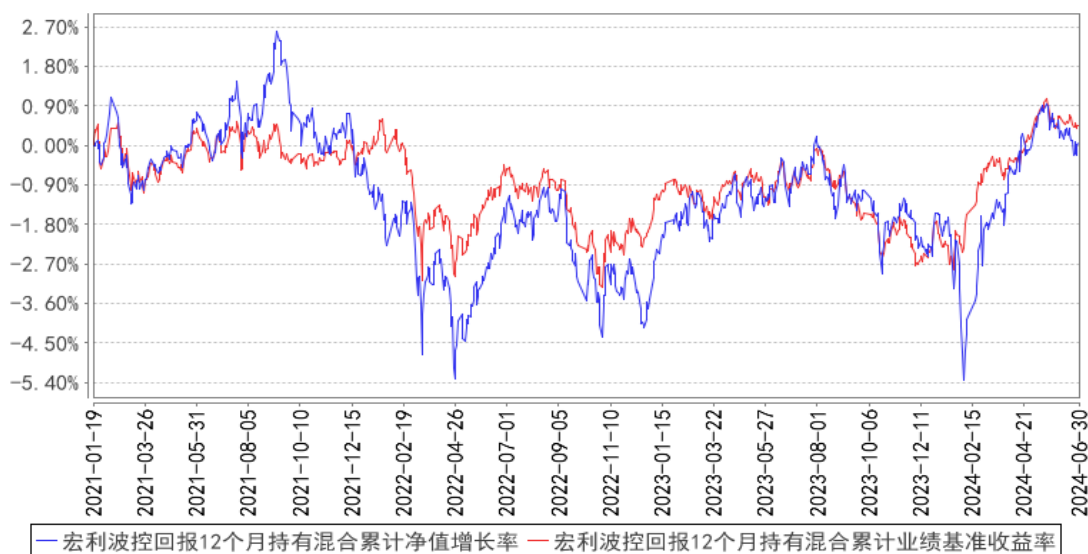
中证 800 指数是由中证指数有限公司编制，其成分股由中证 500 和沪深 300 成分股一起构成，中证 800 指数综合反映沪深市场内大中小市值公司的整体状况，适合作为本基金的业绩比较基准。

恒生指数是由恒生指数服务有限公司编制，以香港股票市场中的 50 家上市股票为成分股样本，以其发行量为权数的加权平均股价指数，是反映香港股市价幅趋势最有影响的一种股价指数。

根据本基金的投资范围和投资比例，选用上述业绩比较基准能够客观、合理地反映本基金的风险收益特征。

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

宏利波控回报12个月持有混合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 2024 年 6 月 30 日，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、宏利医药健康混合型发起式证券投资基金、宏利睿智成长混合型证券投资基金、宏利中债-绿色普惠主题金融债券优选指数证券投资基金在内的六十多只证券投资基金。

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	2021 年 1 月 19 日	-	17 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基金经理；具备 17 年基金从业经验，17 年证券投资管理经验，具有基金从业资格。
宁霄	本基金基金经理	2021 年 8 月 9 日	-	16 年	中国人民大学金融工程硕士；2006 年 4 月至 2007 年 3 月，任职于兴业全球基金管理有限公司基金运营部，担任基金 TA 清算；2007 年 8 月至 2011 年 3 月，任职于华夏基金管理有限公司，担任基金会计；2013 年 7 月至今任职于宏利基金管理有限公司，曾先后担任债券交易员、交易部交易主管、交易部总经理助理、基金经理助理，2020 年 4 月起担任基金经理。具备 16 年证券从业经验，11 年证券投资管理经验，具有基金从业资格。
曾蕙桐	本基金基金经理	2022 年 8 月 9 日	-	12 年	中国人民大学工商管理硕士研究生。2006 年 8 月至 2010 年 8 月任职于美国开放系统控制技术有限公司北京分公司；2012 年 7 月加入宏利基金管理有限公司，历任专户理财部业务经理、固定收益部研究员、信用研究部分析师、固收研究部分析师，现任基金经理。具备 12 年基金从业经验，具有基金从业资格。
师婧	国际业务部总经理	2021 年 05 月 13 日	-	14 年	新加坡南洋理工大学理学硕士；2010 年 7 月至 2017 年 9 月任职于新加坡辉立资本集

	助理；本 基金基金 经理助理	日			团旗下的辉立证券,其中 2010 年 7 月至 2015 年 6 月担任高级全球股票交易员,负责参与全球 20 个国家和地区的股票交易;2015 年 7 月至 2017 年 9 月担任基金组合经理,主要负责中国香港地区以及亚洲二级市场的投资和全球大类资产的配置投资管理工作;2017 年 9 月加入宏利基金管理有限公司,任职于国际业务部,先后担任基金经理助理、基金经理等职,现任国际业务部总经理助理兼基金经理;具有 14 年证券投资管理经验,具有基金从业资格。
--	----------------------	---	--	--	--

注：1、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。

2、本基金基金经理刘欣于 2024 年 7 月 30 日离任,增聘刘晓晨先生为该基金的基金经理,该基金由刘晓晨先生、宁霄先生、曾慧桐女士共同管理,公司于 2024 年 7 月 31 日发布《宏利波控回报 12 个月持有期混合型证券投资基金基金经理变更公告》。

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

基金管理人的风险管理部事后从交易指令的公平性、同日反向交易、不同时间窗口下的同向交易溢价率和风格相似的基金的业绩等方面,对报告期内的公平交易执行情况进行统计分析。本报告期内,交易指令多为指令下达人管理的多只资产组合同时下发,无明显的非公平交易指令;基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易,严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易;场外交易的交易价格与市场价格一致,场内交易的溢价率在剔除交易时间差异、交易数量悬殊、市场波动剧烈等因素后,处于正常范围之内;基金管理人管理的各投资组合的业绩由于投资策略、管理风格、业绩基准等方面的因素而有所不同。

本报告期内,本基金管理人管理的各投资组合之间未发现利益输送或不公平对待不同组合的情况。

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。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，除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，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

2024 年二季度 A 股整体下跌，代表全市场的中证全指下跌约 8%。结构上看分化很大，少数股票上涨，多数股票下跌，其中高股息风格与美股映射的 AI 方向明显上涨，沪深 300 为首的大盘股微涨，小盘股和消费相关股票下跌较多。大类资产角度看，美股、黄金、国内长期国债上涨，港股先涨后跌，美国长期债券下跌。整体看市场观望气息较浓重，投资者对基本面较担心。当前 A 股在低波动低成交量状态下运行，投资机会主要来自内部结构化差异。宏观基本面层面，中游制造业数据较好，地产在政策支持下有企稳迹象，消费预期较弱；外围美国降息预期渐行渐近。

本基金在操作中，无论从仓位管理还是选股结构上，均体现出相对保守的投资风格。在仓位层面，采用目标波动率策略，通过动态调整控制产品整体波动风险。在选股层面，投资风格以低估值盈利稳定的大盘蓝筹股为主，部分争取中小盘统计套利机会。本基金在操作中运用少量股指期货对组合进行套期保值，尽量在边际上降低组合波动。本报告期内，本基金增加了银行、煤炭、电子的配置，减少了基础化工、医药、计算机板块的配置。

4.4.2 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 1.0004 元；本报告期基金份额净值增长率为 1.60%，业绩比较基准收益率为 2.22%。

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，考虑到当前估值已经反映比较悲观的预期，认为当前市场下行空间有限，具有较好的赔率，比较看多市场。从胜率角度，考虑到当前经济环境的不确定性，市场复苏的过程可能不会很快，但包括监管积极改革市场、港股上涨、美国降息预期等线索正在显现。在股票结构配置上仍将保持均衡的方式，低估值防御性股票在年内三次达到相对基金平均 20% 的超额收益后有所回撤，仍提供一定空间，这类股票由于具有高股息低估值特征，使得二级市场定价层面会离公司基本面更近，相对更类似绝对收益，体现出抗跌但向上弹性也不是很强的特征。此外大型成长股可能是如果出现反弹的较好标的。

基于基金合同与投资观点，我们的配置偏向于具有真实业绩成长且估值合理的绩优蓝筹股票，并采用目标波动率策略对产品整体风险波动进行控制。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

根据本基金合同及基金实际运作的情况，本基金本报告期内未进行利润分配。目前无其他利润分配安排。

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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—宏利基金管理有限公司 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，宏利基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额

申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，宏利基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 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：宏利波控回报 12 个月持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	1,810,914.14	3,274,385.80
结算备付金		6,037,846.52	2,458,466.66
存出保证金		3,043,494.15	67,806.09
交易性金融资产	6.4.7.2	564,169,150.05	673,176,710.82
其中：股票投资		137,012,988.68	161,866,648.62
基金投资		-	-
债券投资		427,156,161.37	511,310,062.20
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		520,354.21	-
应收股利		-	-
应收申购款		69.39	842.05

递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		575,581,828.46	678,978,211.42
负债和净资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		89,707,679.33	59,823,197.79
应付清算款		-	-
应付赎回款		683,816.01	1,366,308.93
应付管理人报酬		323,499.83	422,872.55
应付托管费		80,874.94	105,718.14
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		17,948.87	22,871.11
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	746,744.99	926,655.16
负债合计		91,560,563.97	62,667,623.68
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	483,839,863.19	625,964,032.29
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	181,401.30	-9,653,444.55
净资产合计		484,021,264.49	616,310,587.74
负债和净资产总计		575,581,828.46	678,978,211.42

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0004 元，基金份额总额 483,839,863.19 份。

6.2 利润表

会计主体：宏利波控回报 12 个月持有期混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024年1月1日至2024 年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年6月30日
一、营业总收入		12,677,047.04	30,939,421.90
1. 利息收入		160,295.58	267,175.88
其中：存款利息收入	6.4.7.13	100,738.52	247,189.58
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		59,557.06	19,986.30
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		8,160,652.35	22,827,858.53
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-165,849.87	8,035,868.28
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	8,993,537.19	12,644,299.79
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	-3,210,393.16	-
股利收益	6.4.7.19	2,543,358.19	2,147,690.46
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	4,356,099.11	7,844,387.49
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	-	-
减：二、营业总支出		3,795,038.67	5,864,073.91
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,204,118.12	3,341,815.45
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	551,029.57	835,453.82
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		888,037.02	1,507,864.83
其中：卖出回购金融资产支出		888,037.02	1,507,864.83
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		16,344.68	29,275.88
8. 其他费用	6.4.7.23	135,509.28	149,663.93
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		8,882,008.37	25,075,347.99
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		8,882,008.37	25,075,347.99
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		8,882,008.37	25,075,347.99

6.3 净资产变动表

会计主体：宏利波控回报 12 个月持有期混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	625,964,032.29	-	-9,653,444.55	616,310,587.74
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	625,964,032.29	-	-9,653,444.55	616,310,587.74
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-142,124,169.10	-	9,834,845.85	-132,289,323.25
（一）、综合收益总额	-	-	8,882,008.37	8,882,008.37
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-142,124,169.10	-	952,837.48	-141,171,331.62
其中：1. 基金申购款	372,327.61	-	-4,661.61	367,666.00
2. 基金赎回款	-142,496,496.71	-	957,499.09	-141,538,997.62
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	483,839,863.19	-	181,401.30	484,021,264.49
项目	上年度可比期间 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	962,486,521.19	-	-33,839,963.56	928,646,557.63
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	962,486,521.19	-	-33,839,963.56	928,646,557.63
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-205,265,580.43	-	28,102,302.53	-177,163,277.90
（一）、综合收益总额	-	-	25,075,347.99	25,075,347.99
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-205,265,580.43	-	3,026,954.54	-202,238,625.89
其中：1. 基金申购款	221,303.17	-	-3,226.36	218,076.81
2. 基金赎回款	-205,486,883.60	-	3,030,180.90	-202,456,702.70
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	757,220,940.76	-	-5,737,661.03	751,483,279.73

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

宏利波控回报 12 个月持有期混合型证券投资基金(原名为泰达宏利波控回报 12 个月持有期混合型证券投资基金,以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2020]3080 号《关于准予泰达宏利波控回报 12 个月持有期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《泰达宏利波控回报 12 个月持有期混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,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 2,008,875,688.59 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(2021)第 0002 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰达宏利波控回报 12 个月持有期混合型证券投资基金基金合同》于 2021 年 1 月 19 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 2,010,228,447.39 份基金份额,其中认购资金利息折合 1,352,758.80 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,基金托管人为中国农业银行股份有限公司(以下简称“中国农业银行”)。

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 日起更名为宏利波控回报 12 个月持有期混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《宏利波控回报 12 个月持有期混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资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(包含创业板及其他经中国证监会允许上市的股票和存托凭证)、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换公司债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、股指期货、国债期货、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款等以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为:本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 0%-30%(投资于港股通标的股票的比例为股票资产的 0%-50%);本基金投资于同业存单的比例不超过基金资产的 20%;本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,保持不低于基金资产净值 5%的现金或者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。其他金融

工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。本基金的业绩比较基准为中债综合指数收益率 $\times 85\%$ + 中证 800 指数收益率 $\times 10\%$ + 恒生指数收益率 (经汇率调整) $\times 5\%$ 。

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》、《宏利波控回报 12 个月持有期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 2024 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 2024 年 06 月 30 日的财务状况以及 2024 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

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[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税

[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

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

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通或深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	1,810,914.14
等于：本金	1,810,405.40
加：应计利息	508.74
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	1,810,914.14

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	140,059,222.32	-	137,012,988.68	-3,046,233.64	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	183,347,471.04	2,610,264.99	187,768,844.49	1,811,108.46
	银行间市场	232,433,836.39	2,910,316.88	239,387,316.88	4,043,163.61
	合计	415,781,307.43	5,520,581.87	427,156,161.37	5,854,272.07
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	555,840,529.75	5,520,581.87	564,169,150.05	2,808,038.43	

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

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
----	------------------------

	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-26,016,780.00	-	-	-
其中：股 指期货投资	-26,016,780.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-26,016,780.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IF2412	IF2412	-24.00	-24,638,400.00	1,378,380.00
合计				1,378,380.00
减：可抵销期货 暂收款				1,378,380.00
净额				-

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

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有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024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	643,263.33
其中：交易所市场	636,274.46
银行间市场	6,988.87
应付利息	-
预提费用	103,481.66
合计	746,744.99

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	625,964,032.29	625,964,032.29
本期申购	372,327.61	372,327.61
本期赎回（以“-”号填列）	-142,496,496.71	-142,496,496.71
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	483,839,863.19	483,839,863.19

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-13,876,273.49	4,222,828.94	-9,653,444.55
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-13,876,273.49	4,222,828.94	-9,653,444.55
本期利润	4,525,909.26	4,356,099.11	8,882,008.37
本期基金份额交易产生的变动数	3,502,594.06	-2,549,756.58	952,837.48
其中：基金申购款	-9,481.28	4,819.67	-4,661.61
基金赎回款	3,512,075.34	-2,554,576.25	957,499.09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-5,847,770.17	6,029,171.47	181,401.30

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	37,511.40
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	29,501.07
其他	33,726.05
合计	100,738.52

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 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-165,849.87
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	-165,849.87

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
	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	984,300,288.17
减：卖出股票成本总额	982,014,858.14
减：交易费用	2,451,279.90
买卖股票差价收入	-165,849.87

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
	2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	7,064,103.15
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,929,434.04
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	8,993,537.19

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
	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	393,071,000.83
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	385,017,757.19
减：应计利息总额	6,117,327.75
减：交易费用	6,481.85
买卖债券差价收入	1,929,434.04

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**

本基金本报告期末未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

本基金本报告期末未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

本基金本报告期末未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

本基金本报告期末未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**

本基金本报告期末未有贵金属投资收益。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期末未有贵金属投资收益-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

本基金本报告期末未有贵金属投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期末未有贵金属投资收益-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**

本基金本报告期末未有衍生工具收益-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

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	-3,210,393.16

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,543,358.19
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	2,543,358.19

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	2,977,719.11
股票投资	491,590.38
债券投资	2,486,128.73
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	1,378,380.00
权证投资	-
期货投资	1,378,380.00
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	4,356,099.11

6.4.7.21 其他收入

本基金本报告期末有其他收入。

6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期末有信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	34,809.32
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	22,427.62
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	135,509.28

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

本基金本报告期未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
中国农业银行股份有限公司(中国农业银行)	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

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未有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
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,204,118.12	3,341,815.45
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,093,017.63	1,655,829.43
应支付基金管理人的净管理费	1,111,100.49	1,685,986.02

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 0.80%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×0.80%/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
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	551,029.57	835,453.82

注：支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 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 × 0.20% / 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未有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未有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未有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固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固有资金投资本基金。

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

于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		上年度可比期间	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		2023 年 1 月 1 日至 2023 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
中国农业银行	1,810,914.14	37,511.40	5,809,784.65	65,470.64

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，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有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未有其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2024 年 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
688692	达梦数据	2024年6月4日	1-6个月（含）	新股流通受限	86.96	174.93	175	15,218.00	30,612.75	-
603285	键邦股份	2024年6月28日	1个月内（含）	新股未上市	18.65	18.65	1,158	21,596.70	21,596.70	-
688709	成都华微	2024年1月31日	1-6个月（含）	新股流通受限	15.69	18.79	1,045	16,396.05	19,635.55	-
603350	安乃达	2024年6月26日	1个月内（含）	新股未上市	20.56	20.56	945	19,429.20	19,429.20	-
301536	星辰科技	2024年3月20日	1-6个月（含）	新股流通受限	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-
601033	永兴股份	2024年1月11日	1-6个月（含）	新股流通受限	16.20	15.96	876	14,191.20	13,980.96	-
688584	上海合晶	2024年2月1日	1-6个月（含）	新股流通受限	22.66	15.89	866	19,623.56	13,760.74	-
603341	龙旗科	2024年2月23日	1-6个月（含）	新股流通受限	26.00	37.49	298	7,748.00	11,172.02	-

	技									
688691	灿 芯 股 份	2024 年4月 2日	1-6个 月(含)	新股 流通 受限	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-
301587	中 瑞 股 份	2024 年3月 27日	1-6个 月(含)	新股 流通 受限	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-
001389	广 合 科 技	2024 年3月 26日	1-6个 月(含)	新股 流通 受限	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-
301539	宏 鑫 科 技	2024 年4月 3日	1-6个 月(含)	新股 流通 受限	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-
688695	中 创 股 份	2024 年3月 6日	1-6个 月(含)	新股 流通 受限	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
688530	欧 莱 新 材	2024 年4月 29日	1-6个 月(含)	新股 流通 受限	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
301502	华 阳 智 能	2024 年1月 26日	1-6个 月(含)	新股 流通 受限	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-
603325	博 隆 技 术	2024 年1月 3日	1-6个 月(含)	新股 流通 受限	72.46	68.06	66	4,782.36	4,491.96	-
603381	永 臻 股 份	2024 年6月 19日	1-6个 月(含)	新股 流通 受限	23.35	25.13	178	4,156.30	4,473.14	-
603344	星 德 胜	2024 年3月 13日	1-6个 月(含)	新股 流通 受限	19.18	22.66	182	3,490.76	4,124.12	-
001359	平 安 电 工	2024 年3月 19日	1-6个 月(含)	新股 流通 受限	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	-

603312	西典新能	2024年1月4日	1-6个月(含)	新股流通受限	29.02	25.36	130	3,772.60	3,296.80	-
603082	北自科技	2024年1月23日	1-6个月(含)	新股流通受限	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-
603375	盛景微	2024年1月17日	1-6个月(含)	新股流通受限	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	-
603285	键邦股份	2024年6月28日	1-6个月(含)	新股流通受限	18.65	18.65	129	2,405.85	2,405.85	-
603350	安乃达	2024年6月26日	1-6个月(含)	新股流通受限	20.56	20.56	106	2,179.36	2,179.36	-

注：1、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分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。

2、基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

3、基金作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

4、基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后 6 个月内不得转让。

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

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 30,006,164.38 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
150308	15 进出 08	2024 年 7 月 1 日	103.00	300,000	30,899,712.33
230205	23 国开 05	2024 年 7 月 1 日	106.51	34,000	3,621,273.86

合计				334,000	34,520,986.19
----	--	--	--	---------	---------------

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 59,701,514.95 元，于 2024 年 7 月 23 日先后到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 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

本基金为混合型基金，属于证券市场中的较高风险品种，其长期平均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。本基金投资的金融工具主要包括股票投资及债券投资等。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在严格控制风险的前提下，通过积极主动的管理，力争为基金份额持有人创造高于业绩比较基准的投资收益。

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。

本基金债券投资、资产支持证券投资 and 同业存单投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
AAA	333,670,094.41	372,085,322.20
AAA 以下	553,806.55	11,036,055.70
未评级	92,932,260.41	128,188,684.30
合计	427,156,161.37	511,310,062.20

注：以上未评级的债券投资中包括国债、政策性金融债及央行票据等。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

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 2024 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，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(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、存出保证金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,810,914.14	-	-	-	1,810,914.14
结算备付金	6,037,846.52	-	-	-	6,037,846.52
存出保证金	3,043,494.15	-	-	-	3,043,494.15
交易性金融资产	41,386,439.76	322,880,723.44	62,888,998.17	137,012,988.68	564,169,150.05
应收申购款	-	-	-	69.39	69.39
应收清算款	-	-	-	520,354.21	520,354.21
资产总计	52,278,694.57	322,880,723.44	62,888,998.17	137,533,412.28	575,581,828.46
负债					
应付赎回款	-	-	-	683,816.01	683,816.01
应付管理人报酬	-	-	-	323,499.83	323,499.83
应付托管费	-	-	-	80,874.94	80,874.94
卖出回购金融资产款	89,707,679.33	-	-	-	89,707,679.33
应交税费	-	-	-	17,948.87	17,948.87
其他负债	-	-	-	746,744.99	746,744.99
负债总计	89,707,679.33	-	-	1,852,884.64	91,560,563.97

利率敏感度缺口	-37,428,984.76	322,880,723.44	62,888,998.17	135,680,527.64	484,021,264.49
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	3,274,385.80	-	-	-	3,274,385.80
结算备付金	2,458,466.66	-	-	-	2,458,466.66
存出保证金	67,806.09	-	-	-	67,806.09
交易性金融资产	86,797,722.27	383,129,169.23	41,383,170.70	161,866,648.62	673,176,710.82
应收申购款	-	-	-	842.05	842.05
资产总计	92,598,380.82	383,129,169.23	41,383,170.70	161,867,490.67	678,978,211.42
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,366,308.93	1,366,308.93
应付管理人报酬	-	-	-	422,872.55	422,872.55
应付托管费	-	-	-	105,718.14	105,718.14
卖出回购金融资产款	59,823,197.79	-	-	-	59,823,197.79
应交税费	-	-	-	22,871.11	22,871.11
其他负债	-	-	-	926,655.16	926,655.16
负债总计	59,823,197.79	-	-	2,844,425.89	62,667,623.68
利率敏感度缺口	32,775,183.03	383,129,169.23	41,383,170.70	159,023,064.78	616,310,587.74

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

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	5,500,000.00	7,220,000.00
	市场利率上升 25 个基点	-5,200,000.00	-6,780,000.00

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。

本基金将采取目标波动风险预算技术进行资产配置，量化与基本面相结合的股票投资策略进行权益部分投资，以及采用多种策略进行固定收益部分投资。通过综合运用以上技术，本基金将优化投资过程，在限制组合整体预期波动率的前提下，实现风险约束下投资组合 alpha 的最大化，以便获得尽可能高回报。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。本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 0%-30%（投资于港股通标的股票的比例为股票资产的 0%-50%）；本基金投资于同业存单的比例不超过基金资产的 20%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者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 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	137,012,988.68	28.31	161,866,648.62	26.26
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	137,012,988.68	28.31	161,866,648.62	26.26

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（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月）

			31 日)
	沪深 300 指数上升 5%	6,110,000.00	6,280,000.00
	沪深 300 指数下降 5%	-6,110,000.00	-6,280,000.00

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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	138,835,525.80	163,458,379.24
第二层次	425,153,123.60	509,213,748.44
第三层次	180,500.65	504,583.14
合计	564,169,150.05	673,176,710.82

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

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	137,012,988.68	23.80
	其中：股票	137,012,988.68	23.80
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	427,156,161.37	74.21
	其中：债券	427,156,161.37	74.21
	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	7,848,760.66	1.36
8	其他各项资产	3,563,917.75	0.62
9	合计	575,581,828.46	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	156,216.00	0.03
B	采矿业	13,062,180.00	2.70
C	制造业	71,185,226.62	14.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,716,589.38	1.18
E	建筑业	3,300,000.00	0.68
F	批发和零售业	2,880,527.28	0.60
G	交通运输、仓储和邮政业	3,535,306.20	0.73
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,078,356.80	0.84

J	金融业	28,033,497.36	5.79
K	房地产业	37,343.88	0.01
L	租赁和商务服务业	1,583,585.00	0.33
M	科学研究和技术服务业	834,016.00	0.17
N	水利、环境和公共设施管理业	725,716.16	0.15
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	141,680.00	0.03
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,697,692.00	0.35
S	综合	45,056.00	0.01
	合计	137,012,988.68	28.31

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	601088	中国神华	64,000	2,839,680.00	0.59
2	600036	招商银行	82,100	2,806,999.00	0.58
3	601328	交通银行	372,700	2,784,069.00	0.58
4	601009	南京银行	257,200	2,672,308.00	0.55
5	601899	紫金矿业	149,400	2,624,958.00	0.54
6	000333	美的集团	39,400	2,541,300.00	0.53
7	601169	北京银行	423,654	2,474,139.36	0.51
8	002674	兴业科技	232,900	2,380,238.00	0.49
9	002594	比亚迪	9,300	2,327,325.00	0.48
10	600660	福耀玻璃	46,626	2,233,385.40	0.46
11	300773	拉卡拉	174,900	2,174,007.00	0.45
12	600690	海尔智家	73,000	2,071,740.00	0.43
13	601838	成都银行	123,300	1,872,927.00	0.39
14	601318	中国平安	44,900	1,857,064.00	0.38
15	600398	海澜之家	184,000	1,700,160.00	0.35
16	601800	中国交建	187,100	1,672,674.00	0.35
17	605599	菜百股份	128,400	1,634,532.00	0.34
18	600926	杭州银行	125,200	1,633,860.00	0.34
19	601916	浙商银行	590,100	1,628,676.00	0.34
20	000338	潍柴动力	99,800	1,620,752.00	0.33
21	605368	蓝天燃气	110,000	1,500,400.00	0.31
22	603558	健盛集团	150,600	1,498,470.00	0.31
23	000928	中钢国际	268,400	1,489,620.00	0.31
24	601658	邮储银行	291,300	1,476,891.00	0.31
25	601717	郑煤机	91,000	1,346,800.00	0.28

26	000921	海信家电	41,100	1,325,064.00	0.27
27	601888	中国中免	21,100	1,318,539.00	0.27
28	600642	申能股份	148,600	1,312,138.00	0.27
29	603515	欧普照明	75,200	1,303,968.00	0.27
30	600901	江苏金租	253,900	1,282,195.00	0.26
31	600000	浦发银行	154,900	1,274,827.00	0.26
32	601919	中远海控	73,080	1,132,009.20	0.23
33	603993	洛阳钼业	129,800	1,103,300.00	0.23
34	600188	兖矿能源	46,300	1,052,399.00	0.22
35	601225	陕西煤业	40,600	1,046,262.00	0.22
36	601398	工商银行	182,500	1,040,250.00	0.21
37	002048	宁波华翔	78,600	1,017,084.00	0.21
38	601857	中国石油	82,600	852,432.00	0.18
39	600919	江苏银行	113,800	845,534.00	0.17
40	300502	新易盛	7,600	802,180.00	0.17
41	601988	中国银行	160,400	741,048.00	0.15
42	601688	华泰证券	59,300	734,727.00	0.15
43	601019	山东出版	57,000	673,740.00	0.14
44	002128	电投能源	30,100	635,110.00	0.13
45	601939	建设银行	85,600	633,440.00	0.13
46	601098	中南传媒	50,900	632,178.00	0.13
47	300628	亿联网络	16,800	617,736.00	0.13
48	003006	百亚股份	25,900	613,830.00	0.13
49	688578	艾力斯	9,600	611,904.00	0.13
50	002014	永新股份	63,580	602,738.40	0.12
51	601166	兴业银行	33,800	595,556.00	0.12
52	601126	四方股份	30,985	595,531.70	0.12
53	601598	中国外运	105,200	592,276.00	0.12
54	601229	上海银行	81,400	590,964.00	0.12
55	000157	中联重科	74,000	568,320.00	0.12
56	002466	天齐锂业	18,600	556,326.00	0.11
57	002032	苏泊尔	10,900	546,090.00	0.11
58	600985	淮北矿业	32,500	544,050.00	0.11
59	688408	中信博	5,836	537,378.88	0.11
60	603658	安图生物	11,600	534,412.00	0.11
61	002533	金杯电工	52,250	519,887.50	0.11
62	605333	沪光股份	18,500	515,225.00	0.11
63	002003	伟星股份	40,800	512,040.00	0.11
64	603298	杭叉集团	25,760	505,926.40	0.10
65	603855	华荣股份	22,500	497,475.00	0.10
66	002475	立讯精密	12,600	495,306.00	0.10
67	002028	思源电气	7,400	495,060.00	0.10
68	000933	神火股份	23,900	483,497.00	0.10

69	600582	天地科技	68,200	469,898.00	0.10
70	300308	中际旭创	3,380	466,034.40	0.10
71	600900	长江电力	16,000	462,720.00	0.10
72	300857	协创数据	8,100	461,700.00	0.10
73	001965	招商公路	38,400	455,424.00	0.09
74	688278	特宝生物	8,483	454,264.65	0.09
75	601898	中煤能源	36,300	453,024.00	0.09
76	000544	中原环保	56,700	446,229.00	0.09
77	601799	星宇股份	3,800	425,752.00	0.09
78	600873	梅花生物	41,800	418,836.00	0.09
79	603198	迎驾贡酒	7,000	402,500.00	0.08
80	000513	丽珠集团	10,700	398,147.00	0.08
81	688766	普冉股份	4,080	396,453.60	0.08
82	688138	清溢光电	18,025	387,537.50	0.08
83	000568	泸州老窖	2,700	387,423.00	0.08
84	600809	山西汾酒	1,800	379,584.00	0.08
85	301429	森泰股份	24,500	374,850.00	0.08
86	000488	晨鸣纸业	107,600	372,296.00	0.08
87	603379	三美股份	9,200	360,088.00	0.07
88	603088	宁波精达	47,400	356,922.00	0.07
89	002179	中航光电	9,200	350,060.00	0.07
90	603368	柳药集团	20,000	350,000.00	0.07
91	000538	云南白药	6,800	347,820.00	0.07
92	603605	珀莱雅	3,100	344,069.00	0.07
93	600018	上港集团	59,200	342,176.00	0.07
94	300005	探路者	67,400	337,674.00	0.07
95	300573	兴齐眼药	2,048	335,872.00	0.07
96	688050	爱博医疗	4,526	331,846.32	0.07
97	600480	凌云股份	33,500	329,305.00	0.07
98	603259	药明康德	8,400	329,196.00	0.07
99	601369	陕鼓动力	41,000	328,820.00	0.07
100	000543	皖能电力	36,600	323,910.00	0.07
101	688233	神工股份	16,800	323,736.00	0.07
102	603348	文灿股份	11,500	318,435.00	0.07
103	301345	涛涛车业	5,700	314,070.00	0.06
104	601965	中国汽研	18,400	310,776.00	0.06
105	600114	东睦股份	21,500	309,385.00	0.06
106	601811	新华文轩	22,000	308,220.00	0.06
107	603739	蔚蓝生物	23,800	307,496.00	0.06
108	002463	沪电股份	8,400	306,600.00	0.06
109	603239	浙江仙通	21,800	298,878.00	0.06
110	002572	索菲亚	19,400	297,402.00	0.06
111	600315	上海家化	16,700	296,926.00	0.06

112	000883	湖北能源	49,400	296,894.00	0.06
113	601058	赛轮轮胎	21,000	294,000.00	0.06
114	600519	贵州茅台	200	293,478.00	0.06
115	300953	震裕科技	5,400	292,680.00	0.06
116	603556	海兴电力	6,200	290,346.00	0.06
117	600089	特变电工	20,900	289,883.00	0.06
118	603809	豪能股份	35,560	287,324.80	0.06
119	600887	伊利股份	11,000	284,240.00	0.06
120	002737	葵花药业	12,100	282,898.00	0.06
121	002920	德赛西威	3,200	278,688.00	0.06
122	301219	腾远钴业	7,200	275,472.00	0.06
123	600737	中粮糖业	28,400	272,356.00	0.06
124	605183	确成股份	17,400	269,004.00	0.06
125	003021	兆威机电	5,780	266,747.00	0.06
126	603337	杰克股份	9,900	260,568.00	0.05
127	601077	渝农商行	51,000	256,020.00	0.05
128	600585	海螺水泥	10,800	254,772.00	0.05
129	300394	天孚通信	2,860	252,881.20	0.05
130	301327	华宝新能	4,400	252,120.00	0.05
131	600998	九州通	51,431	250,983.28	0.05
132	600219	南山铝业	65,800	250,698.00	0.05
133	000423	东阿阿胶	4,000	250,400.00	0.05
134	600160	巨化股份	10,300	248,539.00	0.05
135	603279	景津装备	10,900	236,421.00	0.05
136	002139	拓邦股份	20,700	219,834.00	0.05
137	688036	传音控股	2,760	211,250.40	0.04
138	300832	新产业	3,100	209,064.00	0.04
139	688019	安集科技	1,660	208,828.00	0.04
140	603730	岱美股份	20,930	208,044.20	0.04
141	688510	航亚科技	11,300	208,033.00	0.04
142	603228	景旺电子	6,500	206,700.00	0.04
143	600348	华阳股份	20,600	205,176.00	0.04
144	600183	生益科技	9,700	204,282.00	0.04
145	600025	华能水电	18,900	203,742.00	0.04
146	300552	万集科技	5,400	201,852.00	0.04
147	000923	河钢资源	11,600	199,752.00	0.04
148	603786	科博达	3,100	198,865.00	0.04
149	002267	陕天然气	26,200	198,072.00	0.04
150	300679	电连技术	4,900	197,127.00	0.04
151	601666	平煤股份	17,600	197,120.00	0.04
152	002922	伊戈尔	9,000	196,740.00	0.04
153	301055	张小泉	16,200	192,132.00	0.04
154	301162	国能日新	4,400	191,664.00	0.04

155	603816	顾家家居	5,800	187,282.00	0.04
156	601633	长城汽车	7,400	187,220.00	0.04
157	688656	浩欧博	8,160	187,108.80	0.04
158	603187	海容冷链	16,000	186,560.00	0.04
159	688631	莱斯信息	3,000	186,060.00	0.04
160	688498	源杰科技	1,400	183,386.00	0.04
161	002668	TCL 智家	20,200	183,012.00	0.04
162	300146	汤臣倍健	13,500	182,925.00	0.04
163	601127	赛力斯	2,000	182,240.00	0.04
164	601566	九牧王	21,600	181,872.00	0.04
165	001230	劲旅环境	13,080	181,681.20	0.04
166	002508	老板电器	8,200	181,220.00	0.04
167	600547	山东黄金	6,600	180,708.00	0.04
168	002942	新农股份	15,300	180,387.00	0.04
169	688629	华丰科技	6,800	179,248.00	0.04
170	002372	伟星新材	11,400	175,788.00	0.04
171	688030	山石网科	16,800	175,560.00	0.04
172	688253	英诺特	4,600	175,306.00	0.04
173	603351	威尔药业	8,600	174,236.00	0.04
174	301130	西点药业	7,400	173,382.00	0.04
175	688076	诺泰生物	2,200	172,216.00	0.04
176	603150	万朗磁塑	6,800	170,272.00	0.04
177	605068	明新旭腾	12,800	168,704.00	0.03
178	600285	羚锐制药	6,900	167,049.00	0.03
179	002106	莱宝高科	15,200	165,680.00	0.03
180	301196	唯科科技	5,600	165,368.00	0.03
181	002557	洽洽食品	5,800	163,502.00	0.03
182	603113	金能科技	29,800	163,006.00	0.03
183	002304	洋河股份	2,000	161,480.00	0.03
184	003019	宸展光电	6,340	160,592.20	0.03
185	688767	博拓生物	6,400	160,448.00	0.03
186	002216	三全食品	14,600	160,308.00	0.03
187	688169	石头科技	400	157,040.00	0.03
188	300761	立华股份	6,900	156,216.00	0.03
189	300638	广和通	8,900	152,190.00	0.03
190	603160	汇顶科技	2,200	151,250.00	0.03
191	002540	亚太科技	28,400	150,236.00	0.03
192	603203	快克智能	6,300	148,554.00	0.03
193	002340	格林美	23,200	147,784.00	0.03
194	300384	三联虹普	11,200	146,944.00	0.03
195	300815	玉禾田	12,400	144,336.00	0.03
196	605166	聚合顺	13,600	142,664.00	0.03
197	000526	学大教育	2,300	141,680.00	0.03

198	000848	承德露露	17,200	135,192.00	0.03
199	300207	欣旺达	8,800	133,496.00	0.03
200	603486	科沃斯	2,800	132,104.00	0.03
201	688022	瀚川智能	9,600	131,616.00	0.03
202	002236	大华股份	8,500	131,410.00	0.03
203	002158	汉钟精机	7,800	130,416.00	0.03
204	300181	佐力药业	8,600	130,032.00	0.03
205	002755	奥赛康	13,400	129,310.00	0.03
206	688058	宝兰德	6,186	128,854.38	0.03
207	688127	蓝特光学	7,000	128,730.00	0.03
208	688095	福昕软件	2,800	128,268.00	0.03
209	002023	海特高新	14,000	128,100.00	0.03
210	000977	浪潮信息	3,500	127,295.00	0.03
211	603889	新澳股份	16,400	126,936.00	0.03
212	002928	华夏航空	20,000	126,800.00	0.03
213	603639	海利尔	10,400	126,568.00	0.03
214	603408	建霖家居	9,400	123,986.00	0.03
215	603115	海星股份	11,800	122,720.00	0.03
216	300482	万孚生物	5,000	122,000.00	0.03
217	002648	卫星化学	6,600	118,668.00	0.02
218	688283	坤恒顺维	3,400	116,892.00	0.02
219	603281	江瀚新材	5,200	116,740.00	0.02
220	601101	昊华能源	12,600	115,794.00	0.02
221	002697	红旗连锁	25,000	115,750.00	0.02
222	603093	南华期货	13,300	115,178.00	0.02
223	603948	建业股份	7,000	113,960.00	0.02
224	000906	浙商中拓	16,900	113,906.00	0.02
225	601311	骆驼股份	13,800	110,676.00	0.02
226	688389	普门科技	6,800	110,568.00	0.02
227	603686	福龙马	14,400	109,728.00	0.02
228	603181	皇马科技	12,200	109,678.00	0.02
229	600489	中金黄金	7,400	109,520.00	0.02
230	603897	长城科技	6,200	108,810.00	0.02
231	300435	中泰股份	9,200	108,284.00	0.02
232	600941	中国移动	1,000	107,500.00	0.02
233	002937	兴瑞科技	4,600	107,226.00	0.02
234	605377	华旺科技	8,040	106,530.00	0.02
235	002035	华帝股份	17,000	105,910.00	0.02
236	600211	西藏药业	3,240	105,559.20	0.02
237	603886	元祖股份	7,000	105,420.00	0.02
238	603579	荣泰健康	6,780	104,818.80	0.02
239	603878	武进不锈	16,000	104,640.00	0.02
240	603303	得邦照明	9,100	104,468.00	0.02

241	000900	现代投资	28,500	104,310.00	0.02
242	600803	新奥股份	5,000	104,000.00	0.02
243	002088	鲁阳节能	8,600	103,974.00	0.02
244	002293	罗莱生活	12,800	103,424.00	0.02
245	301061	匠心家居	2,200	103,312.00	0.02
246	603587	地素时尚	8,400	103,152.00	0.02
247	300048	合康新能	22,200	102,786.00	0.02
248	002831	裕同科技	4,000	102,360.00	0.02
249	002155	湖南黄金	5,600	101,360.00	0.02
250	605050	福然德	11,500	101,315.00	0.02
251	300193	佳士科技	13,400	99,428.00	0.02
252	603501	韦尔股份	1,000	99,370.00	0.02
253	600284	浦东建设	18,400	98,256.00	0.02
254	603600	永艺股份	9,400	98,136.00	0.02
255	600395	盘江股份	16,200	97,362.00	0.02
256	601339	百隆东方	18,600	96,906.00	0.02
257	002371	北方华创	300	95,967.00	0.02
258	603699	纽威股份	5,600	95,872.00	0.02
259	300470	中密控股	2,800	94,668.00	0.02
260	688075	安旭生物	2,800	94,332.00	0.02
261	000725	京东方 A	22,900	93,661.00	0.02
262	600346	恒力石化	6,600	92,070.00	0.02
263	600323	瀚蓝环境	4,400	91,960.00	0.02
264	002947	恒铭达	2,600	91,520.00	0.02
265	601860	紫金银行	36,600	91,500.00	0.02
266	301045	天禄科技	4,800	91,488.00	0.02
267	600066	宇通客车	3,500	90,300.00	0.02
268	603053	成都燃气	9,300	89,838.00	0.02
269	002997	瑞鹄模具	2,800	89,516.00	0.02
270	688480	赛恩斯	3,200	89,152.00	0.02
271	600308	华泰股份	28,300	88,862.00	0.02
272	002839	张家港行	22,000	88,440.00	0.02
273	601700	风范股份	20,000	87,800.00	0.02
274	603995	甬金股份	5,000	87,600.00	0.02
275	603689	皖天然气	10,600	87,132.00	0.02
276	603035	常熟汽饰	6,800	86,224.00	0.02
277	002919	名臣健康	7,400	85,914.00	0.02
278	605077	华康股份	5,600	85,400.00	0.02
279	688336	三生国健	4,185	85,164.75	0.02
280	002043	兔宝宝	8,200	85,034.00	0.02
281	000596	古井贡酒	400	84,428.00	0.02
282	600790	轻纺城	26,000	83,720.00	0.02
283	000030	富奥股份	17,000	83,470.00	0.02

284	002415	海康威视	2,700	83,457.00	0.02
285	002004	华邦健康	21,900	83,220.00	0.02
286	600713	南京医药	19,600	82,712.00	0.02
287	600125	铁龙物流	13,800	82,386.00	0.02
288	603630	拉芳家化	7,800	81,978.00	0.02
289	002993	奥海科技	2,200	81,840.00	0.02
290	603519	立霸股份	7,200	81,432.00	0.02
291	603535	嘉诚国际	5,000	80,700.00	0.02
292	300049	福瑞股份	1,600	80,544.00	0.02
293	002788	鹭燕医药	10,200	80,376.00	0.02
294	688020	方邦股份	2,400	80,064.00	0.02
295	002807	江阴银行	21,200	79,924.00	0.02
296	603323	苏农银行	16,600	79,846.00	0.02
297	603128	华贸物流	13,800	79,626.00	0.02
298	003000	劲仔食品	6,600	79,530.00	0.02
299	300415	伊之密	3,800	78,964.00	0.02
300	601985	中国核电	7,400	78,884.00	0.02
301	603112	华翔股份	7,400	77,774.00	0.02
302	002345	潮宏基	16,400	77,408.00	0.02
303	600886	国投电力	4,200	76,608.00	0.02
304	300121	阳谷华泰	9,800	76,440.00	0.02
305	600035	楚天高速	17,800	76,362.00	0.02
306	300349	金卡智能	6,400	76,288.00	0.02
307	601179	中国西电	9,400	75,576.00	0.02
308	300622	博士眼镜	6,200	75,454.00	0.02
309	300453	三鑫医疗	11,800	75,402.00	0.02
310	600233	圆通速递	4,800	75,120.00	0.02
311	300463	迈克生物	6,600	75,108.00	0.02
312	600256	广汇能源	11,200	75,040.00	0.02
313	002440	闰土股份	13,800	74,934.00	0.02
314	002545	东方铁塔	11,000	74,910.00	0.02
315	301087	可孚医疗	2,200	74,580.00	0.02
316	002550	千红制药	13,800	74,382.00	0.02
317	600433	冠豪高新	27,400	72,610.00	0.02
318	600938	中国海油	2,200	72,600.00	0.01
319	601728	中国电信	11,800	72,570.00	0.01
320	601601	中国太保	2,600	72,436.00	0.01
321	600760	中航沈飞	1,800	72,180.00	0.01
322	300750	宁德时代	400	72,012.00	0.01
323	600362	江西铜业	3,000	71,040.00	0.01
324	002130	沃尔核材	5,000	70,600.00	0.01
325	000651	格力电器	1,800	70,596.00	0.01
326	300304	云意电气	10,800	70,308.00	0.01

327	600546	山煤国际	4,800	70,176.00	0.01
328	000731	四川美丰	10,400	68,952.00	0.01
329	603365	水星家纺	4,400	68,860.00	0.01
330	603606	东方电缆	1,400	68,334.00	0.01
331	300636	同和药业	6,700	68,139.00	0.01
332	688213	思特威	1,400	67,900.00	0.01
333	688566	吉贝尔	3,000	67,500.00	0.01
334	605266	健之佳	2,600	67,470.00	0.01
335	000830	鲁西化工	5,800	67,222.00	0.01
336	603158	腾龙股份	9,500	66,880.00	0.01
337	300577	开润股份	3,200	66,656.00	0.01
338	301182	凯旺科技	3,000	66,540.00	0.01
339	002532	天山铝业	8,200	66,502.00	0.01
340	301308	江波龙	700	66,318.00	0.01
341	688108	赛诺医疗	7,400	66,156.00	0.01
342	300790	宇瞳光学	4,900	66,150.00	0.01
343	000426	兴业银锡	4,800	65,184.00	0.01
344	300408	三环集团	2,200	64,218.00	0.01
345	300791	仙乐健康	2,520	63,504.00	0.01
346	300673	佩蒂股份	4,800	62,976.00	0.01
347	688676	金盘科技	1,200	62,580.00	0.01
348	600015	华夏银行	9,600	61,440.00	0.01
349	600694	大商股份	3,600	60,516.00	0.01
350	688018	乐鑫科技	600	59,208.00	0.01
351	002555	三七互娱	4,500	58,725.00	0.01
352	688516	奥特维	1,400	58,534.00	0.01
353	300760	迈瑞医疗	200	58,182.00	0.01
354	002991	甘源食品	900	54,585.00	0.01
355	601168	西部矿业	3,000	53,850.00	0.01
356	002563	森马服饰	9,200	53,452.00	0.01
357	605188	国光连锁	6,800	52,700.00	0.01
358	001336	楚环科技	2,400	52,440.00	0.01
359	601702	华峰铝业	2,800	51,128.00	0.01
360	603989	艾华集团	3,600	50,616.00	0.01
361	603979	金诚信	1,000	50,530.00	0.01
362	600707	彩虹股份	7,400	50,394.00	0.01
363	603328	依顿电子	6,400	50,304.00	0.01
364	002152	广电运通	4,800	50,208.00	0.01
365	603225	新凤鸣	3,200	49,888.00	0.01
366	603738	泰晶科技	3,600	49,104.00	0.01
367	605111	新洁能	1,600	48,944.00	0.01
368	601163	三角轮胎	3,200	48,704.00	0.01
369	300979	华利集团	800	48,680.00	0.01

370	600461	洪城环境	4,200	48,636.00	0.01
371	002315	焦点科技	1,800	48,528.00	0.01
372	600989	宝丰能源	2,800	48,524.00	0.01
373	300921	南凌科技	2,800	48,496.00	0.01
374	600993	马应龙	1,800	48,006.00	0.01
375	600761	安徽合力	2,200	47,608.00	0.01
376	601827	三峰环境	5,600	47,544.00	0.01
377	605198	安德利	1,800	47,520.00	0.01
378	603299	苏盐井神	5,000	47,500.00	0.01
379	603610	麒盛科技	4,800	47,424.00	0.01
380	603568	伟明环保	2,300	47,334.00	0.01
381	300492	华图山鼎	500	47,100.00	0.01
382	600420	国药现代	4,400	46,992.00	0.01
383	300748	金力永磁	3,600	46,656.00	0.01
384	301269	华大九天	600	46,230.00	0.01
385	600750	江中药业	2,000	46,220.00	0.01
386	601020	华钰矿业	3,600	46,080.00	0.01
387	301185	鸥玛软件	3,200	45,856.00	0.01
388	603032	德新科技	4,000	45,720.00	0.01
389	000975	银泰黄金	2,800	45,612.00	0.01
390	600757	长江传媒	5,600	45,136.00	0.01
391	600673	东阳光	6,400	45,056.00	0.01
392	603666	亿嘉和	2,800	44,184.00	0.01
393	601000	唐山港	9,400	44,180.00	0.01
394	601298	青岛港	4,600	43,976.00	0.01
395	600508	上海能源	3,100	43,865.00	0.01
396	601138	工业富联	1,600	43,840.00	0.01
397	601628	中国人寿	1,400	43,470.00	0.01
398	002332	仙琚制药	3,800	43,358.00	0.01
399	000983	山西焦煤	4,200	43,302.00	0.01
400	002635	安洁科技	2,800	43,232.00	0.01
401	000700	模塑科技	8,200	43,050.00	0.01
402	600236	桂冠电力	5,600	42,952.00	0.01
403	603233	大参林	3,000	42,900.00	0.01
404	300866	安克创新	600	42,726.00	0.01
405	301127	天源环保	3,600	42,552.00	0.01
406	601128	常熟银行	5,600	42,392.00	0.01
407	002845	同兴达	3,200	42,304.00	0.01
408	600176	中国巨石	3,800	41,990.00	0.01
409	600483	福能股份	3,600	41,976.00	0.01
410	600795	国电电力	7,000	41,930.00	0.01
411	300532	今天国际	3,400	41,786.00	0.01
412	603688	石英股份	1,400	41,454.00	0.01

413	600674	川投能源	2,200	41,250.00	0.01
414	601816	京沪高铁	7,600	40,812.00	0.01
415	603583	捷昌驱动	2,000	40,760.00	0.01
416	601665	齐鲁银行	8,300	40,753.00	0.01
417	605016	百龙创园	2,000	40,740.00	0.01
418	600026	中远海能	2,600	40,586.00	0.01
419	601872	招商轮船	4,800	40,560.00	0.01
420	600309	万华化学	500	40,430.00	0.01
421	300433	蓝思科技	2,200	40,150.00	0.01
422	002643	万润股份	4,000	40,000.00	0.01
423	600406	国电南瑞	1,600	39,936.00	0.01
424	002938	鹏鼎控股	1,000	39,760.00	0.01
425	600718	东软集团	4,800	39,696.00	0.01
426	601958	金钼股份	3,800	39,558.00	0.01
427	600039	四川路桥	5,000	39,450.00	0.01
428	688486	龙迅股份	688	39,422.40	0.01
429	603496	恒为科技	1,600	39,120.00	0.01
430	002252	上海莱士	5,000	39,100.00	0.01
431	688352	颀中科技	3,400	38,794.00	0.01
432	688208	道通科技	1,600	38,624.00	0.01
433	601231	环旭电子	2,400	38,520.00	0.01
434	603565	中谷物流	4,400	38,456.00	0.01
435	000719	中原传媒	3,800	38,418.00	0.01
436	300856	科思股份	1,200	38,412.00	0.01
437	603986	兆易创新	400	38,248.00	0.01
438	601333	广深铁路	11,800	38,232.00	0.01
439	603008	喜临门	2,200	38,126.00	0.01
440	002027	分众传媒	6,200	37,572.00	0.01
441	688234	天岳先进	800	37,536.00	0.01
442	688220	翱捷科技	1,000	37,460.00	0.01
443	600663	陆家嘴	4,234	37,343.88	0.01
444	002601	龙佰集团	2,000	37,140.00	0.01
445	688188	柏楚电子	200	36,910.00	0.01
446	000661	长春高新	400	36,708.00	0.01
447	600893	航发动力	1,000	36,550.00	0.01
448	000600	建投能源	5,800	36,540.00	0.01
449	600497	驰宏锌锗	6,800	36,312.00	0.01
450	002749	国光股份	2,400	36,096.00	0.01
451	000683	远兴能源	5,200	35,932.00	0.01
452	601500	通用股份	6,700	35,778.00	0.01
453	002273	水晶光电	2,100	35,658.00	0.01
454	600095	湘财股份	5,900	35,164.00	0.01
455	300783	三只松鼠	1,600	34,992.00	0.01

456	603393	新天然气	1,000	34,740.00	0.01
457	003816	中国广核	7,400	34,262.00	0.01
458	600956	新天绿能	4,100	33,497.00	0.01
459	000950	重药控股	6,600	32,142.00	0.01
460	601137	博威合金	2,100	32,004.00	0.01
461	000737	北方铜业	3,400	31,552.00	0.01
462	601528	瑞丰银行	6,600	31,152.00	0.01
463	002245	蔚蓝锂芯	4,000	31,000.00	0.01
464	603296	华勤技术	560	30,928.80	0.01
465	688692	达梦数据	175	30,612.75	0.01
466	000420	吉林化纤	9,600	30,336.00	0.01
467	000409	云鼎科技	3,700	29,859.00	0.01
468	002707	众信旅游	5,200	29,848.00	0.01
469	300059	东方财富	2,800	29,568.00	0.01
470	000821	京山轻机	2,600	29,458.00	0.01
471	002911	佛燃能源	3,217	29,403.38	0.01
472	688219	会通股份	3,674	28,546.98	0.01
473	603087	甘李药业	600	27,792.00	0.01
474	002840	华统股份	1,600	26,544.00	0.01
475	603119	浙江荣泰	1,480	26,225.60	0.01
476	600028	中国石化	4,100	25,912.00	0.01
477	603927	中科软	1,400	25,326.00	0.01
478	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.00
479	002096	易普力	2,000	23,800.00	0.00
480	600688	上海石化	8,400	21,924.00	0.00
481	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.00
482	301236	软通动力	600	21,126.00	0.00
483	300002	神州泰岳	2,600	21,112.00	0.00
484	300033	同花顺	200	20,740.00	0.00
485	688588	凌志软件	3,000	20,550.00	0.00
486	688709	成都华微	1,045	19,635.55	0.00
487	688362	甬矽电子	1,000	19,460.00	0.00
488	688150	莱特光电	1,000	19,400.00	0.00
489	600845	宝信软件	600	19,158.00	0.00
490	601877	正泰电器	1,000	19,060.00	0.00
491	600968	海油发展	4,600	18,952.00	0.00
492	600050	中国联通	4,000	18,800.00	0.00
493	600875	东方电气	1,000	18,450.00	0.00
494	600850	电科数字	1,000	18,100.00	0.00
495	300124	汇川技术	350	17,955.00	0.00
496	002649	博彦科技	2,200	17,512.00	0.00
497	601808	中海油服	1,000	17,200.00	0.00
498	605128	上海沿浦	616	17,180.24	0.00

499	000063	中兴通讯	600	16,782.00	0.00
500	601233	桐昆股份	1,000	15,960.00	0.00
501	002396	星网锐捷	1,200	15,852.00	0.00
502	301536	星辰科技	481	15,521.87	0.00
503	300525	博思软件	1,200	15,240.00	0.00
504	601216	君正集团	3,800	14,022.00	0.00
505	601033	永兴股份	876	13,980.96	0.00
506	688584	上海合晶	866	13,760.74	0.00
507	603341	龙旗科技	298	11,172.02	0.00
508	000997	新大陆	800	11,128.00	0.00
509	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
510	000810	创维数字	1,200	10,296.00	0.00
511	000703	恒逸石化	1,400	9,926.00	0.00
512	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
513	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
514	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
515	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
516	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
517	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
518	603082	北自科技	170	5,060.55	0.00
519	603325	博隆技术	66	4,491.96	0.00
520	603381	永臻股份	178	4,473.14	0.00
521	603344	星德胜	182	4,124.12	0.00
522	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
523	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
524	603375	盛景微	72	2,800.80	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	600398	海澜之家	10,545,626.00	1.71
2	600926	杭州银行	9,101,638.00	1.48
3	603259	药明康德	8,970,526.00	1.46
4	000921	海信家电	7,987,210.10	1.30
5	002594	比亚迪	7,675,548.00	1.25
6	601169	北京银行	7,343,273.24	1.19
7	000338	潍柴动力	7,331,838.00	1.19
8	601318	中国平安	7,309,127.00	1.19
9	600690	海尔智家	7,237,478.00	1.17
10	601919	中远海控	7,007,208.30	1.14
11	601899	紫金矿业	6,817,844.00	1.11
12	600642	申能股份	6,667,064.00	1.08

13	688235	百济神州	6,563,177.48	1.06
14	600036	招商银行	6,328,002.00	1.03
15	600660	福耀玻璃	6,245,936.24	1.01
16	601888	中国中免	5,995,526.00	0.97
17	002948	青岛银行	5,712,225.00	0.93
18	601328	交通银行	5,673,300.00	0.92
19	000333	美的集团	5,609,746.00	0.91
20	601088	中国神华	5,331,870.00	0.87

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	603259	药明康德	12,671,777.00	2.06
2	000921	海信家电	11,647,889.00	1.89
3	600690	海尔智家	11,583,202.00	1.88
4	002594	比亚迪	11,494,626.00	1.87
5	601899	紫金矿业	10,987,749.00	1.78
6	000338	潍柴动力	10,653,240.00	1.73
7	601318	中国平安	9,987,184.00	1.62
8	600398	海澜之家	9,910,411.00	1.61
9	600660	福耀玻璃	9,554,971.00	1.55
10	600926	杭州银行	8,475,963.00	1.38
11	601888	中国中免	8,325,668.00	1.35
12	600036	招商银行	7,945,438.00	1.29
13	603993	洛阳钼业	7,393,777.00	1.20
14	688235	百济神州	7,090,309.06	1.15
15	601919	中远海控	6,604,160.50	1.07
16	600066	宇通客车	6,281,862.58	1.02
17	002035	华帝股份	6,006,342.87	0.97
18	002948	青岛银行	5,848,386.00	0.95
19	600481	双良节能	5,746,178.45	0.93
20	600642	申能股份	5,671,367.00	0.92

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	956,669,607.82
卖出股票收入（成交）总额	984,300,288.17

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	135,526,112.98	28.00
	其中: 政策性金融债	51,944,269.18	10.73
4	企业债券	185,720,195.61	38.37
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	103,861,203.90	21.46
7	可转债(可交换债)	2,048,648.88	0.42
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	427,156,161.37	88.25

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	102100188	21 陕煤化 MTN001	400,000	42,240,612.02	8.73
2	092280134	22 工行二级资本债 04A	300,000	31,392,616.44	6.49
3	150308	15 进出 08	300,000	30,899,712.33	6.38
4	115253	23 首集 K1	300,000	30,655,440.00	6.33
5	2120089	21 北京银行永续债 01	200,000	21,580,819.67	4.46

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

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。

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

本基金投资国债期货，将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，在风险可控的前提下，适度参与国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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，招商银行股份有限公司于 2024 年 6 月 24 日曾受到国家金融监督管理总局公开处罚，2023 年 11 月 27 日曾受到国家外汇管理局深圳市分局公开处罚，于 2023 年 12 月 13 日曾受到国家金融监督管理总局深圳监管局公开处罚；交通银行股份有限公司于 2024 年 6 月 3 日曾受到国家金融监督管理总局公开处罚；南京银行股份有限公司于 2023 年 8 月 25 日曾受到国家外汇管理局江苏省分局公开处罚；北京银行股份有限公司于 2024 年 2 月 1 日曾受到国家金融监督管理总局北京监管局公开处罚。

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	3,043,494.15
2	应收清算款	520,354.21
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	69.39
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	3,563,917.75

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113021	中信转债	212,675.92	0.04
2	127084	柳工转 2	194,355.41	0.04
3	110075	南航转债	185,976.21	0.04
4	113055	成银转债	151,132.93	0.03
5	110079	杭银转债	144,920.68	0.03
6	113060	浙 22 转债	125,102.36	0.03
7	127020	中金转债	120,448.36	0.02
8	113047	旗滨转债	109,651.92	0.02
9	113061	拓普转债	106,828.74	0.02
10	113050	南银转债	100,329.67	0.02
11	113631	皖天转债	88,612.33	0.02
12	123107	温氏转债	88,339.33	0.02
13	113062	常银转债	85,647.36	0.02
14	113052	兴业转债	81,163.25	0.02
15	113037	紫银转债	76,862.24	0.02
16	110073	国投转债	75,767.77	0.02
17	127027	能化转债	51,402.96	0.01
18	113067	燃 23 转债	49,431.44	0.01

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，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

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 (%)
10,583	45,718.59	1,193,198.59	0.25	482,646,664.60	99.75

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
----	------------	--------------

基金管理人所有从业人员持有本基金	10.99	0.0000
------------------	-------	--------

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2021 年 1 月 19 日） 基金份额总额	2,010,228,447.39
本报告期期初基金份额总额	625,964,032.29
本报告期基金总申购份额	372,327.61
减：本报告期基金总赎回份额	142,496,496.71
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	483,839,863.19

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

- 1、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的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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 (%)	
兴业证券	1	445,050,854.78	22.95	420,972.18	22.95	-
申万宏源	1	413,819,290.06	21.34	391,437.08	21.34	-
长江证券	2	253,018,528.74	13.05	239,325.12	13.04	-
海通证券	1	207,590,390.89	10.70	196,364.51	10.70	-
中邮证券	1	140,626,077.22	7.25	133,018.79	7.25	-
首创证券	1	121,311,188.09	6.25	114,751.81	6.25	-
中泰证券	1	113,510,673.24	5.85	107,369.96	5.85	-
华福证券	1	110,107,017.74	5.68	104,151.95	5.68	-
华金证券	1	62,485,341.45	3.22	59,106.00	3.22	-
国金证券	1	41,778,470.54	2.15	39,517.20	2.15	-
中信建投	1	30,268,470.06	1.56	28,631.61	1.56	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
高盛证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

注：（一）本基金本报告期新增长江证券、中邮证券交易单元。

（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，使用其席位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 (%)
兴业证券	82,791,640.00	60.15	529,043,000.00	22.68	-	-
申万宏源	3,646,676.17	2.65	512,188,000.00	21.96	-	-
长江证券	20,355.02	0.01	293,918,000.00	12.60	-	-
海通证券	24,597.58	0.02	262,398,000.00	11.25	-	-
中邮证券	-	-	82,500,000.00	3.54	-	-

首创证券	5,099,470.00	3.70	38,500,000.00	1.65	-	-
中泰证券	-	-	170,226,000.00	7.30	-	-
华福证券	62,360.40	0.05	100,697,000.00	4.32	-	-
华金证券	5,369,765.58	3.90	131,490,000.00	5.64	-	-
国金证券	12,030.70	0.01	71,300,000.00	3.06	-	-
中信建投	93,271.62	0.07	139,900,000.00	6.00	-	-
渤海证券	40,521,300.00	29.44	-	-	-	-
高盛证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

§ 11 备查文件目录

11.1 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。

11.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

11.3 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

2024 年 8 月 31 日