

# 宏利波控回报 12 个月持有期混合型证券投资 基金 2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：宏利基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业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	6
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
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
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	18
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>45</b>
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
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	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	57
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	57

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 .....	57
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 .....	57
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 .....	57
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	58
7.12 投资组合报告附注 .....	58
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>59</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	59
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	59
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>59</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>59</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	59
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 .....	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	60
10.4 基金投资策略的改变 .....	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	60
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 .....	60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	60
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>62</b>
11.1 影响投资者决策的其他重要信息 .....	62
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>62</b>
12.1 备查文件目录 .....	62
12.2 存放地点 .....	62
12.3 查阅方式 .....	63

## § 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	757,220,940.76 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	秦一楠
	联系电话	66577766	010-66060069
	电子邮箱	irm@manulifefund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
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(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	17,230,960.50
本期利润	25,075,347.99
加权平均基金份额本期利润	0.0294
本期加权平均净值利润率	2.98%
本期基金份额净值增长率	2.86%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-8,816,826.00
期末可供分配基金份额利润	-0.0116
期末基金资产净值	751,483,279.73
期末基金份额净值	0.9924
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-0.76%

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	0.50%	0.24%	0.51%	0.14%	-0.01%	0.10%

过去三个月	0.72%	0.21%	0.18%	0.13%	0.54%	0.08%
过去六个月	2.86%	0.20%	1.05%	0.13%	1.81%	0.07%
过去一年	0.58%	0.23%	-0.31%	0.16%	0.89%	0.07%
自基金合同生效起至今	-0.76%	0.25%	-0.84%	0.18%	0.08%	0.07%

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。

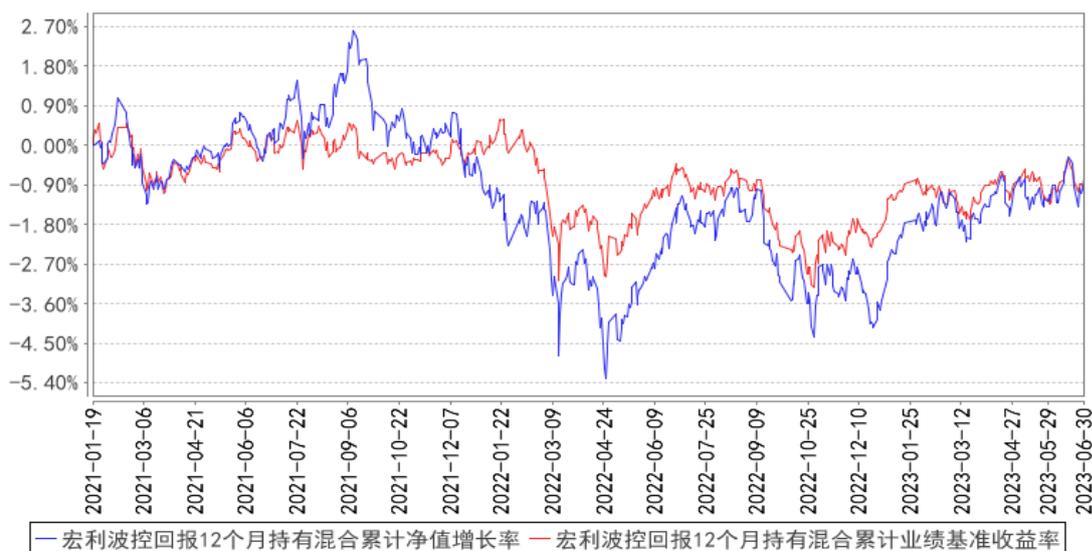
中证 800 指数是由中证指数有限公司编制，其成分股由中证 500 和沪深 300 成分股一起构成，中证 800 指数综合反映沪深市场内大中小市值公司的整体状况，适合作为本基金的业绩比较基准。

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

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

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

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘欣	总经理助理兼基金经理	2021 年 1 月 19 日	-	16 年	清华大学理学硕士；2007 年 7 月至 2008 年 12 月就职于工银瑞信基金管理有限公司；2008 年 12 月至 2011 年 7 月就职于嘉实基金管理有限公司；2011 年 7 月加盟宏利基金管理有限公司，曾担任产品与金融工程部高级研究员、金融工程部副总经理、金融工程部总经理、投资副总监，现担任公司总经理助理兼基金经理；具备 16 年基金从业经验，16 年证券投资管理经验，具有基金从业资格。
宁霄	固定收益部总经理助理；基金经理	2021 年 8 月 9 日	-	15 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、基金经理，现任固定收益部总经理助理兼基金经理。具备 15 年证券从业经验，10 年证券投资管理经验，具有基金从业资格。
曾慧桐	本基金基金经理	2022 年 8 月 9 日	-	11 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 11 年基金从业经验，具有基金从业资格。
师婧	国际业务部总经理助理；基金经理助理	2021 年 5 月 13 日	-	13 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

	理				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 13 年证券投资管理经验,具有基金从业资格。
陈星屹	信用研究部 总经理; 基金经理助理	2022 年 8 月 4 日	-	8 年	金融学硕士;2011 年 4 月至 2016 年 12 月,任职于大公国际资信评估有限公司,担任评级副总监兼任评审委委员;2016 年 12 月至 2021 年 7 月,任职于长城财富保险资产管理股份有限公司,担任信用评估部总经理;2021 年 7 月加入宏利基金管理有限公司,现任固收研究部总经理兼任基金经理助理;具有 8 年证券从业经验,具有基金从业资格。
刘洋	策略投资部 副总经理; 基金经理助理	2021 年 7 月 5 日	2023 年 01 月 13 日	8 年	北京大学理学硕士;2015 年 1 月至 2015 年 4 月就职于九坤投资(北京)有限公司,2015 年 5 月加入宏利基金管理有限公司,任职于金融工程部,先后担任助理研究员、研究员、基金经理助理、策略投资部总经理助理等职务,现担任策略投资部副总经理兼基金经理;具备 8 年证券投资管理经验,具有基金从业资格。

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守相关法律法规以及基金合同的约定,本基金运作整体合法合规,没有出现损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

本基金在操作中，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，投资风格偏向低估值盈利稳定的大盘蓝筹股。本报告期内，本基金增加了计算机、医药、食品饮料的配置，减少了银行、煤炭、交通运输的配置。

#### 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 0.9924 元；本报告期基金份额净值增长率为 2.86%，业绩比较基准收益率为 1.05%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，尽管年初以来市场呈现原地波动、结构分化特征，我们仍维持 A 股整体权益资产估值分位数较低，处于投资价值较高区域的判断，港股观点类似。而与上个季度不同的是，我们认为随着经济压力增加，正面催化剂将逐渐增加，有利于市场反弹。而在风格层面，要重点关注

外资对市场的认可程度，能否在催化中完成重新向机构化转变的过程。如果北向资金能形成可观的正向流入，则市场风格可能重新向 2019、2020 转变，否则反弹将更类似与 2009、2013。无论任一情况发生，就整体而言，站在当前估值位置，应对市场更为乐观。在投资策略层面，我们将积极关注资金趋势变化引起的可能市场中期风格变化，以及下半年从日历角度，市场风格在年底可能切向大盘价值。

基于基金合同与投资观点，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 2023 年 1 月 1 日至 2023 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：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	5,809,784.65	11,705,130.56
结算备付金		29,336,420.51	29,767,503.85
存出保证金		63,426.92	68,874.36
交易性金融资产	6.4.7.2	840,072,701.56	916,924,088.62
其中：股票投资		188,986,898.21	236,239,121.44
基金投资		-	-
债券投资		651,085,803.35	680,684,967.18

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		423,733.14	401,872.00
应收股利		-	-
应收申购款		674.39	923.03
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		875,706,741.17	958,868,392.42
<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		122,023,020.03	17,793,735.71
应付清算款		2,150.00	9,070,623.23
应付赎回款		613,744.01	1,462,857.64
应付管理人报酬		502,114.21	639,048.86
应付托管费		125,528.52	159,762.22
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		45,625.65	33,693.28
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	911,279.02	1,062,113.85
负债合计		124,223,461.44	30,221,834.79
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	757,220,940.76	962,486,521.19
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-5,737,661.03	-33,839,963.56
净资产合计		751,483,279.73	928,646,557.63
负债和净资产总计		875,706,741.17	958,868,392.42

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.9924 元，基金份额总额 757,220,940.76 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：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>		30,939,421.90	-18,267,848.34
1. 利息收入		267,175.88	205,880.33
其中：存款利息收入	6.4.7.13	247,189.58	171,319.16
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		19,986.30	34,561.17
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		22,827,858.53	-35,585,913.02
其中：股票投资收益	6.4.7.14	8,035,868.28	-55,919,533.37
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	12,644,299.79	18,494,129.61
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	2,147,690.46	1,839,490.74
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	7,844,387.49	17,112,184.35
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	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		5,864,073.91	7,849,187.99
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,341,815.45	5,621,303.05
2. 托管费	6.4.10.2.2	835,453.82	1,405,325.73
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		1,507,864.83	634,448.39

其中：卖出回购金融资产支出		1,507,864.83	634,448.39
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		29,275.88	19,524.32
8. 其他费用	6.4.7.23	149,663.93	168,586.50
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		25,075,347.99	-26,117,036.33
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		25,075,347.99	-26,117,036.33
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		25,075,347.99	-26,117,036.33

### 6.3 净资产（基金净值）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：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）	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（基金净值）	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基金净值变动数（净值减少以“-”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	-205,486,883.6	-	3,030,180.90	-202,456,702.70

回款	0			
(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)	757,220,940.76	-	-5,737,661.03	751,483,279.73
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)	2,016,415,931.75	-	-5,736,945.86	2,010,678,985.89
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)	2,016,415,931.75	-	-5,736,945.86	2,010,678,985.89
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-807,837,247.40	-	-10,346,811.31	-818,184,058.71
(一)、综合收益总额	-	-	-26,117,036.33	-26,117,036.33
(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)	-807,837,247.40	-	15,770,225.02	-792,067,022.38
其中: 1. 基金申购款	741,670.17	-	-17,908.67	723,761.50
2. 基金赎回款	-808,578,917.57	-	15,788,133.69	-792,790,783.88
(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）	1,208,578,684.35	-	-16,083,757.17	1,192,494,927.18

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（包含中小板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票）、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）。基金的投资组合比例为：基金的投资组合比例为：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%）；投资于同业存单的比例不超过基金资产的 20%；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×85%+中证 800 指数收益率×10%+恒生指数收益率(经汇率调整)×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 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[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

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

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

## 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	5,809,784.65
等于：本金	5,801,435.65
加：应计利息	8,349.00
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	5,809,784.65

## 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	194,122,696.76	-	188,986,898.21	-5,135,798.55	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	300,848,296.76	3,395,035.26	304,795,873.96	552,541.94
	银行间市场	340,400,393.40	3,159,729.39	346,289,929.39	2,729,806.60
	合计	641,248,690.16	6,554,764.65	651,085,803.35	3,282,348.54
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	835,371,386.92	6,554,764.65	840,072,701.56	-1,853,450.01	

## 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有其他资产。

**6.4.7.9 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	795,166.84
其中：交易所市场	783,033.40
银行间市场	12,133.44
应付利息	-
预提费用	116,112.18
合计	911,279.02

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	962,486,521.19	962,486,521.19
本期申购	221,303.17	221,303.17
本期赎回（以“-”号填列）	-205,486,883.60	-205,486,883.60
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	757,220,940.76	757,220,940.76

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	-30,426,618.52	-3,413,345.04	-33,839,963.56
本期利润	17,230,960.50	7,844,387.49	25,075,347.99
本期基金份额交易产生的变动数	4,378,832.02	-1,351,877.48	3,026,954.54
其中：基金申购款	-4,744.68	1,518.32	-3,226.36
基金赎回款	4,383,576.70	-1,353,395.80	3,030,180.90
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-8,816,826.00	3,079,164.97	-5,737,661.03

#### 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	65,470.64
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	54,261.31
其他	127,457.63
合计	247,189.58

#### 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	8,035,868.28
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	8,035,868.28

##### 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	913,252,186.10
减：卖出股票成本总额	902,530,469.78
减：交易费用	2,685,848.04
买卖股票差价收入	8,035,868.28

##### 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	11,226,904.83
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,417,394.96
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	12,644,299.79

**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	807,851,907.63
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	796,195,652.85
减：应计利息总额	10,226,935.40
减：交易费用	11,924.42
买卖债券差价收入	1,417,394.96

**6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期末未有债券投资收益-赎回差价收入。

**6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期末未有债券投资收益-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	2,147,690.46
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	2,147,690.46

#### 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	7,844,387.49
股票投资	1,784,109.58
债券投资	6,060,277.91
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	7,844,387.49

#### 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
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

审计费用	47,604.81
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	23,951.75
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	149,663.93

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金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

本基金本报告期末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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,341,815.45	5,621,303.05
其中：支付销售机构的客户维护费	1,655,829.43	2,626,227.88

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	835,453.82	1,405,325.73

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。

##### 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。

#### 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

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	5,809,784.65	65,470.64	8,528,215.96	74,877.77

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

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
301395	仁信新材	2023年6月21日	1个月内（含）	新股未上市	26.68	26.68	4,676	124,755.68	124,755.68	-
301395	仁信新材	2023年6月21日	1-6个月（含）	新股流通受限	26.68	26.68	520	13,873.60	13,873.60	-
301292	海科	2023年6月	1个月内（含）	新股未上市	19.99	19.99	5,241	104,767.59	104,767.59	-

	新源	月 29 日		市						
301292	海科新源	2023 年 6 月 29 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	19.99	19.99	583	11,654.17	11,654.17	-
688249	晶合集成	2023 年 4 月 24 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	19.86	18.06	4,616	91,673.76	83,364.96	-
301202	朗威股份	2023 年 6 月 28 日	1 个月内(含)	新股未上市	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-
301202	朗威股份	2023 年 6 月 28 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-
688603	天承科技	2023 年 6 月 30 日	1 个月内(含)	新股未上市	55.00	55.00	1,251	68,805.00	68,805.00	-
688603	天承科技	2023 年 6 月 30 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	55.00	55.00	140	7,700.00	7,700.00	-
301261	恒工精密	2023 年 6 月 29 日	1 个月内(含)	新股未上市	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50	-
301261	恒工精密	2023 年 6 月 29 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20	-
688472	阿特斯	2023 年 6 月 2 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	11.10	17.04	2,783	30,891.30	47,422.32	-
301358	湖南裕能	2023 年 2 月 1 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	23.77	42.89	1,080	25,671.60	46,321.20	-
301325	曼恩	2023 年 5 月	1-6 个月(含)	新股流通	76.80	107.95	364	27,955.20	39,293.80	-

	斯特	月 4 日		受限							
688443	智翔金泰	2023 年 6 月 13 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	37.88	29.49	1,326	50,228.88	39,103.74	-	
688531	日联科技	2023 年 3 月 24 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	152.38	135.97	266	40,533.08	36,168.02	-	
001286	陕西能源	2023 年 3 月 31 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-	
601916	浙商银行	2023 年 6 月 27 日	1-6 个月(含)	配股流通受限	2.02	2.64	12,360	24,967.20	32,630.40	-	
301291	明阳电气	2023 年 6 月 21 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	38.13	31.03	974	37,138.62	30,223.22	-	
688146	中船特气	2023 年 4 月 13 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	36.15	38.13	784	28,341.60	29,893.92	-	
688576	西山科技	2023 年 5 月 30 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	135.80	120.41	240	32,592.00	28,898.40	-	
001287	中电港	2023 年 3 月 30 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	11.88	21.02	1,365	16,216.20	28,692.30	-	
688352	颀中科技	2023 年 4 月 11 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	12.10	12.07	2,361	28,568.10	28,497.27	-	
301310	鑫宏业	2023 年 5 月 26 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	67.28	65.43	409	27,517.52	26,760.87	-	
688484	南芯	2023 年 3 月	1-6 个月(含)	新股流通	39.99	36.71	724	28,952.76	26,578.04	-	

	科技	月 28 日		受限							
688582	芯动联科	2023 年 6 月 21 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	26.74	40.68	648	17,327.52	26,360.64	-	
688507	索辰科技	2023 年 4 月 10 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	245.56	122.11	140	34,378.40	17,095.40	-	
688507	索辰科技	2023 年 6 月 20 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	0.00	122.11	67	0.00	8,181.37	转增股	
301293	三博脑科	2023 年 4 月 25 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-	
688552	航天南湖	2023 年 5 月 8 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	21.17	23.50	956	20,238.52	22,466.00	-	
688543	国科军工	2023 年 6 月 14 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	43.67	53.05	410	17,904.70	21,750.50	-	
688570	天玛智控	2023 年 5 月 29 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	30.26	25.33	838	25,357.88	21,226.54	-	
601061	中信金属	2023 年 3 月 30 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	6.58	7.58	2,699	17,759.42	20,458.42	-	
688458	美芯晟	2023 年 5 月 15 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	75.00	90.76	221	16,575.00	20,057.96	-	
688581	安杰思	2023 年 5 月 12 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	125.80	118.03	163	20,505.40	19,238.89	-	
301317	鑫磊	2023 年 1 月	1-6 个月(含)	新股流通	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98	-	

	股份	月 12 日		受限						
301262	海看股份	2023 年 6 月 13 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	30.22	25.50	692	20,912.24	17,646.00	-
301383	天键股份	2023 年 5 月 31 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	46.16	35.72	493	22,756.88	17,609.96	-
688478	晶升股份	2023 年 4 月 13 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	32.52	42.37	402	13,073.04	17,032.74	-
301439	泓淋电力	2023 年 3 月 10 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	19.99	16.90	949	18,970.51	16,038.10	-
688623	双元科技	2023 年 5 月 31 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	125.88	86.79	178	22,406.64	15,448.62	-
301332	德尔玛	2023 年 5 月 9 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	14.81	13.73	1,122	16,616.82	15,405.06	-
301399	英特科技	2023 年 5 月 16 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	43.99	51.57	293	12,889.07	15,110.01	-
301408	华人健康	2023 年 2 月 22 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	16.24	16.95	879	14,274.96	14,899.05	-
301305	朗坤环境	2023 年 5 月 15 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	25.25	19.69	753	19,013.25	14,826.57	-
301397	溯联股份	2023 年 6 月 15 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	53.27	40.20	362	19,283.74	14,552.40	-
688334	西高	2023 年 6 月	1-6 个月(含)	新股流通	14.16	16.21	888	12,574.08	14,394.48	-

	院	月 9 日		受限						
301387	光大同创	2023 年 4 月 10 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	58.32	45.36	307	17,904.24	13,925.52	-
301210	金杨股份	2023 年 6 月 21 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	57.88	49.17	281	16,264.28	13,816.77	-
688512	慧智微	2023 年 5 月 8 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	20.92	19.16	721	15,083.32	13,814.36	-
688433	华曙高科	2023 年 4 月 7 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00	-
301360	荣旗科技	2023 年 4 月 17 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	-
301345	涛涛车业	2023 年 3 月 10 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	73.45	46.64	266	19,537.70	12,406.24	-
301315	威士顿	2023 年 6 月 13 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-
688523	航天环宇	2023 年 5 月 26 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	-
603135	中重科技	2023 年 3 月 29 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	17.80	17.89	628	11,178.40	11,234.92	-
301225	恒勃股份	2023 年 6 月 8 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	35.66	33.26	333	11,874.78	11,075.58	-
301429	森泰	2023 年 4 月	1-6 个月(含)	新股流通	28.75	21.02	499	14,346.25	10,488.98	-

	股份	月 10 日		受限							
601065	江盐集团	2023 年 3 月 31 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	10.36	11.84	875	9,065.00	10,360.00	-	
688631	莱斯信息	2023 年 6 月 19 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-	
688479	友车科技	2023 年 5 月 4 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68	-	
301232	飞沃科技	2023 年 6 月 8 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30	-	
301376	致欧科技	2023 年 6 月 14 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-	
301386	未来电器	2023 年 3 月 21 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-	
688429	时创能源	2023 年 6 月 20 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-	
301170	锡南科技	2023 年 6 月 16 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-	
301281	科源制药	2023 年 3 月 28 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	44.18	25.10	241	10,647.38	6,049.10	-	
301281	科源制药	2023 年 5 月 26 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	0.00	25.10	96	0.00	2,409.60	转增股	
688535	华海	2023 年 3 月	1-6 个月(含)	新股流通	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-	

	诚科	月 28 日		受限						
601133	柏诚股份	2023 年 3 月 31 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	11.66	12.26	664	7,742.24	8,140.64	-
301203	国泰环保	2023 年 3 月 28 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	-
300804	广康生化	2023 年 6 月 15 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	42.45	32.97	226	9,593.70	7,451.22	-
301337	亚华电子	2023 年 5 月 16 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-
001328	登康口腔	2023 年 3 月 29 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-
001282	三联锻造	2023 年 5 月 15 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-
603137	恒尚节能	2023 年 4 月 10 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	-
001324	长青科技	2023 年 5 月 12 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
001367	海森药业	2023 年 3 月 30 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-

注：1、根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

2、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的设定限售期的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市

后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

3、“新股流通受限受限期”指新股上市日至受限期结束日；“新股未上市受限期”指新股成功认购日至新股上市日。

4、基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则此新增股票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

#### 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的股票。

#### 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

本基金本报告期末未有银行间市场债券正回购。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，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 122,023,020.03 元，截至 2023 年 7 月 19 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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	23,083,328.66
合计	-	23,083,328.66

注：以上未评级的债券投资中包括超短期融资券等。

##### 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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	-	-

A-1 以下	-	-
未评级	-	11,910,201.33
合计	-	11,910,201.33

#### 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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	394,440,400.70	311,114,749.79
AAA 以下	8,179,835.62	30,676,989.04
未评级	248,465,567.03	303,899,698.36
合计	651,085,803.35	645,691,437.19

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 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时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家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 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、买入返售金融资产和债券投资等。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	5,809,784.65	-	-	-	5,809,784.65
结算备付金	29,336,420.51	-	-	-	29,336,420.51
存出保证金	63,426.92	-	-	-	63,426.92
交易性金融资产	80,573,773.56	500,820,527.50	69,691,502.29	188,986,898.21	840,072,701.56
应收申购款	-	-	-	674.39	674.39
应收清算款	-	-	-	423,733.14	423,733.14
<b>资产总计</b>	<b>115,783,405.64</b>	<b>500,820,527.50</b>	<b>69,691,502.29</b>	<b>189,411,305.74</b>	<b>875,706,741.17</b>
<b>负债</b>					
应付赎回款	-	-	-	613,744.01	613,744.01
应付管理人报酬	-	-	-	502,114.21	502,114.21
应付托管费	-	-	-	125,528.52	125,528.52
应付清算款	-	-	-	2,150.00	2,150.00
卖出回购金融资产款	122,023,020.03	-	-	-	122,023,020.03
应交税费	-	-	-	45,625.65	45,625.65
其他负债	-	-	-	911,279.02	911,279.02
<b>负债总计</b>	<b>122,023,020.03</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>2,200,441.41</b>	<b>124,223,461.44</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>-6,239,614.39</b>	<b>500,820,527.50</b>	<b>69,691,502.29</b>	<b>187,210,864.33</b>	<b>751,483,279.73</b>
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
<b>资产</b>					
银行存款	11,705,130.56	-	-	-	11,705,130.56
结算备付金	29,767,503.85	-	-	-	29,767,503.85
存出保证金	68,874.36	-	-	-	68,874.36
交易性金融资产	121,421,819.24	559,263,147.94	-	236,239,121.44	916,924,088.62
应收申购款	-	-	-	923.03	923.03
应收清算款	-	-	-	401,872.00	401,872.00
<b>资产总计</b>	<b>162,963,328.01</b>	<b>559,263,147.94</b>	<b>-</b>	<b>236,641,916.47</b>	<b>958,868,392.42</b>
<b>负债</b>					
应付赎回款	-	-	-	1,462,857.64	1,462,857.64
应付管理人报酬	-	-	-	639,048.86	639,048.86
应付托管费	-	-	-	159,762.22	159,762.22

应付清算款	-	-	-	9,070,623.23	9,070,623.23
卖出回购金融资产款	17,793,735.71	-	-	-	17,793,735.71
应交税费	-	-	-	33,693.28	33,693.28
其他负债	-	-	-	1,062,113.85	1,062,113.85
负债总计	17,793,735.71	-	-	12,428,099.08	30,221,834.79
利率敏感度缺口	145,169,592.30	559,263,147.94	-	-224,213,817.39	928,646,557.63

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（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	市场利率上升25个基点	-3,840,000.00	-2,880,000.00
市场利率下降25个基点	3,890,000.00	2,900,000.00	

#### 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 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	188,986,898.21	25.15	236,239,121.44	25.44
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	188,986,898.21	25.15	236,239,121.44	25.44

#### 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%	7,510,000.00	9,940,000.00
	沪深 300 指数下降 5%	-7,510,000.00	-9,940,000.00

## 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	187,280,472.76	234,785,684.38
第二层次	651,601,802.69	680,684,967.18
第三层次	1,190,426.11	1,453,437.06
合计	840,072,701.56	916,924,088.62

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换事项发生的当年年初为确认各层次之间转换的时点。

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

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2022 年 12 月 31 日：同）。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	188,986,898.21	21.58
	其中：股票	188,986,898.21	21.58
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	651,085,803.35	74.35
	其中：债券	651,085,803.35	74.35
	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	35,146,205.16	4.01
8	其他各项资产	487,834.45	0.06
9	合计	875,706,741.17	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	9,060,783.00	1.21
C	制造业	119,578,656.05	15.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,562,119.47	0.21
E	建筑业	1,815,532.15	0.24
F	批发和零售业	2,655,770.97	0.35
G	交通运输、仓储和邮政业	1,731,112.00	0.23
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,631,056.81	2.21
J	金融业	22,304,237.20	2.97
K	房地产业	285,970.00	0.04
L	租赁和商务服务业	5,019,657.00	0.67
M	科学研究和技术服务业	5,354,154.13	0.71

N	水利、环境和公共设施管理业	125,766.57	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,877,766.86	0.25
R	文化、体育和娱乐业	984,316.00	0.13
S	综合	-	-
	合计	188,986,898.21	25.15

### 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	601318	中国平安	115,300	5,349,920.00	0.71
2	600036	招商银行	163,200	5,346,432.00	0.71
3	600690	海尔智家	204,000	4,789,920.00	0.64
4	601888	中国中免	37,700	4,166,981.00	0.55
5	603027	千禾味业	189,200	3,995,904.00	0.53
6	601899	紫金矿业	341,300	3,880,581.00	0.52
7	603259	药明康德	60,400	3,763,524.00	0.50
8	601658	邮储银行	745,400	3,645,006.00	0.49
9	688235	百济神州	32,520	3,548,257.20	0.47
10	000338	潍柴动力	282,100	3,514,966.00	0.47
11	600660	福耀玻璃	88,100	3,158,385.00	0.42
12	603309	维力医疗	176,200	2,725,814.00	0.36
13	601328	交通银行	469,400	2,722,520.00	0.36
14	002605	姚记科技	54,400	2,525,792.00	0.34
15	601088	中国神华	81,400	2,503,050.00	0.33
16	000568	泸州老窖	11,800	2,472,926.00	0.33
17	002460	赣锋锂业	34,000	2,072,640.00	0.28
18	601398	工商银行	390,900	1,884,138.00	0.25
19	000661	长春高新	13,200	1,799,160.00	0.24
20	300533	冰川网络	33,000	1,648,680.00	0.22
21	688111	金山办公	3,400	1,605,548.00	0.21
22	601138	工业富联	61,800	1,557,360.00	0.21
23	300624	万兴科技	13,000	1,522,950.00	0.20
24	600519	贵州茅台	900	1,521,900.00	0.20
25	000977	浪潮信息	30,200	1,464,700.00	0.19
26	600585	海螺水泥	60,500	1,436,270.00	0.19
27	002020	京新药业	99,200	1,271,744.00	0.17
28	301239	普瑞眼科	12,400	1,216,192.00	0.16
29	002463	沪电股份	56,600	1,185,204.00	0.16

30	300394	天孚通信	10,400	1,111,032.00	0.15
31	002763	汇洁股份	120,000	1,063,200.00	0.14
32	603661	恒林股份	31,800	1,054,488.00	0.14
33	603757	大元泵业	34,800	1,038,432.00	0.14
34	603993	洛阳钼业	191,600	1,021,228.00	0.14
35	603768	常青股份	56,400	1,002,228.00	0.13
36	688569	铁科轨道	23,065	970,344.55	0.13
37	605066	天正电气	102,800	967,348.00	0.13
38	300494	盛天网络	38,880	963,835.20	0.13
39	603283	赛腾股份	21,600	961,200.00	0.13
40	601800	中国交建	88,000	960,080.00	0.13
41	002478	常宝股份	127,400	949,130.00	0.13
42	603238	诺邦股份	75,000	945,750.00	0.13
43	603289	泰瑞机器	83,600	937,992.00	0.12
44	600612	老凤祥	13,400	936,392.00	0.12
45	600398	海澜之家	130,000	894,400.00	0.12
46	002517	恺英网络	56,800	894,032.00	0.12
47	603808	歌力思	67,600	887,588.00	0.12
48	300791	仙乐健康	30,400	882,816.00	0.12
49	002867	周大生	49,400	878,332.00	0.12
50	000063	中兴通讯	19,000	865,260.00	0.12
51	688037	芯源微	5,032	860,220.40	0.11
52	000738	航发控制	35,000	854,000.00	0.11
53	300181	佐力药业	69,000	842,490.00	0.11
54	601939	建设银行	132,800	831,328.00	0.11
55	300037	新宙邦	16,000	830,240.00	0.11
56	600702	舍得酒业	6,400	793,280.00	0.11
57	603639	海利尔	44,000	788,480.00	0.10
58	603129	春风动力	4,800	777,120.00	0.10
59	601965	中国汽研	37,600	776,440.00	0.10
60	300896	爱美客	1,700	756,415.00	0.10
61	603689	皖天然气	83,800	734,926.00	0.10
62	003011	海象新材	22,200	715,950.00	0.10
63	300017	网宿科技	100,000	711,000.00	0.09
64	688551	科威尔	10,781	707,017.98	0.09
65	300354	东华测试	15,600	697,320.00	0.09
66	600197	伊力特	25,600	695,552.00	0.09
67	605133	嵘泰股份	20,000	695,200.00	0.09
68	002643	万润股份	39,800	692,918.00	0.09
69	603019	中科曙光	13,400	682,060.00	0.09
70	688599	天合光能	16,000	681,760.00	0.09
71	600602	云赛智联	44,400	668,664.00	0.09
72	300866	安克创新	7,600	665,000.00	0.09

73	600150	中国船舶	20,000	658,200.00	0.09
74	603383	顶点软件	11,800	653,956.00	0.09
75	688793	倍轻松	12,000	646,800.00	0.09
76	603303	得邦照明	46,600	643,546.00	0.09
77	300622	博士眼镜	27,200	641,920.00	0.09
78	002829	星网宇达	14,600	641,378.00	0.09
79	301103	何氏眼科	15,200	637,792.00	0.08
80	002419	天虹股份	108,800	636,480.00	0.08
81	603878	武进不锈	74,560	630,032.00	0.08
82	002749	国光股份	55,400	627,682.00	0.08
83	603466	风语筑	44,800	622,720.00	0.08
84	600248	陕建股份	130,000	620,100.00	0.08
85	002959	小熊电器	7,400	617,900.00	0.08
86	002947	恒铭达	29,600	616,864.00	0.08
87	603517	绝味食品	16,600	616,690.00	0.08
88	300408	三环集团	21,000	616,350.00	0.08
89	002373	千方科技	45,000	613,800.00	0.08
90	603368	柳药集团	24,800	612,808.00	0.08
91	603040	新坐标	22,200	590,298.00	0.08
92	603556	海兴电力	23,200	585,568.00	0.08
93	002942	新农股份	31,400	569,910.00	0.08
94	601728	中国电信	100,400	565,252.00	0.08
95	603758	秦安股份	53,000	563,920.00	0.08
96	300787	海能实业	28,200	555,540.00	0.07
97	600129	太极集团	9,200	547,308.00	0.07
98	688410	山外山	10,400	546,000.00	0.07
99	603551	奥普家居	42,200	545,646.00	0.07
100	603508	思维列控	31,600	538,780.00	0.07
101	002345	潮宏基	68,000	534,480.00	0.07
102	301061	匠心家居	14,400	532,080.00	0.07
103	002929	润建股份	11,800	512,238.00	0.07
104	300768	迪普科技	30,800	510,356.00	0.07
105	002801	微光股份	18,800	508,728.00	0.07
106	603215	比依股份	28,200	505,908.00	0.07
107	300577	开润股份	30,600	498,474.00	0.07
108	603600	永艺股份	51,800	492,618.00	0.07
109	601988	中国银行	125,400	490,314.00	0.07
110	603339	四方科技	30,400	483,664.00	0.06
111	603327	福蓉科技	40,400	479,952.00	0.06
112	603688	石英股份	4,200	478,128.00	0.06
113	300855	图南股份	13,480	476,113.60	0.06
114	300304	云意电气	85,600	474,224.00	0.06
115	688029	南微医学	5,800	473,048.00	0.06

116	603321	梅轮电梯	60,200	468,958.00	0.06
117	000997	新大陆	24,800	468,720.00	0.06
118	002223	鱼跃医疗	13,000	467,870.00	0.06
119	300638	广和通	20,520	465,393.60	0.06
120	603115	海星股份	30,000	461,100.00	0.06
121	300796	贝斯美	38,200	459,546.00	0.06
122	300532	今天国际	22,200	456,432.00	0.06
123	688257	新锐股份	17,163	454,991.13	0.06
124	603090	宏盛股份	20,400	453,900.00	0.06
125	603365	水星家纺	31,600	444,296.00	0.06
126	002782	可立克	28,800	440,352.00	0.06
127	603313	梦百合	43,800	439,314.00	0.06
128	603968	醋化股份	24,600	436,896.00	0.06
129	300124	汇川技术	6,800	436,628.00	0.06
130	002392	北京利尔	120,600	436,572.00	0.06
131	600488	津药药业	77,400	434,988.00	0.06
132	603408	建霖家居	41,800	434,302.00	0.06
133	601766	中国中车	66,800	434,200.00	0.06
134	600261	阳光照明	118,800	433,620.00	0.06
135	603579	荣泰健康	20,400	426,768.00	0.06
136	603928	兴业股份	35,200	424,864.00	0.06
137	603386	骏亚科技	37,400	424,490.00	0.06
138	603488	展鹏科技	52,600	422,378.00	0.06
139	688472	阿特斯	23,183	421,966.32	0.06
140	601816	京沪高铁	80,000	420,800.00	0.06
141	301257	普蕊斯	7,400	415,880.00	0.06
142	300775	三角防务	11,800	398,604.00	0.05
143	603367	辰欣药业	26,000	394,680.00	0.05
144	300231	银信科技	44,200	393,822.00	0.05
145	002560	通达股份	40,800	388,416.00	0.05
146	002367	康力电梯	41,000	374,330.00	0.05
147	002011	盾安环境	26,800	370,644.00	0.05
148	603156	养元饮品	15,000	370,500.00	0.05
149	002322	理工能科	35,400	368,160.00	0.05
150	002233	塔牌集团	47,400	365,928.00	0.05
151	300444	双杰电气	46,600	358,820.00	0.05
152	002948	青岛银行	112,200	351,186.00	0.05
153	688766	普冉股份	3,278	350,155.96	0.05
154	600583	海油工程	59,400	347,490.00	0.05
155	688295	中复神鹰	9,440	346,259.20	0.05
156	603515	欧普照明	17,000	345,100.00	0.05
157	600419	天润乳业	21,200	343,864.00	0.05
158	000552	甘肃能化	101,800	338,994.00	0.05

159	688387	信科移动	40,000	334,000.00	0.04
160	300002	神州泰岳	23,800	333,200.00	0.04
161	688297	中无人机	6,400	328,256.00	0.04
162	300308	中际旭创	2,200	324,390.00	0.04
163	688305	科德数控	3,200	320,832.00	0.04
164	301004	嘉益股份	8,000	310,400.00	0.04
165	601211	国泰君安	21,800	304,982.00	0.04
166	002600	领益智造	44,000	304,040.00	0.04
167	300274	阳光电源	2,600	303,238.00	0.04
168	002027	分众传媒	44,400	302,364.00	0.04
169	002149	西部材料	18,000	302,220.00	0.04
170	600011	华能国际	32,600	301,876.00	0.04
171	605266	健之佳	3,600	301,788.00	0.04
172	300193	佳士科技	39,200	299,488.00	0.04
173	688582	芯动联科	6,476	299,402.44	0.04
174	002073	软控股份	45,000	297,900.00	0.04
175	603277	银都股份	13,600	297,024.00	0.04
176	688276	百克生物	4,737	296,536.20	0.04
177	603788	宁波高发	24,000	295,680.00	0.04
178	300371	汇中股份	22,480	294,488.00	0.04
179	300763	锦浪科技	2,800	291,480.00	0.04
180	002540	亚太科技	49,800	287,844.00	0.04
181	603871	嘉友国际	18,200	285,922.00	0.04
182	603535	嘉诚国际	17,600	285,824.00	0.04
183	002533	金杯电工	35,000	285,600.00	0.04
184	601958	金钼股份	25,600	285,440.00	0.04
185	001696	宗申动力	40,000	283,200.00	0.04
186	002106	莱宝高科	33,200	282,200.00	0.04
187	002160	常铝股份	69,800	281,992.00	0.04
188	000541	佛山照明	49,200	280,932.00	0.04
189	002937	兴瑞科技	11,400	280,440.00	0.04
190	603855	华荣股份	10,400	276,640.00	0.04
191	000543	皖能电力	41,400	273,240.00	0.04
192	000030	富奥股份	53,800	271,152.00	0.04
193	688390	固德威	1,624	270,980.64	0.04
194	000923	河钢资源	20,000	270,000.00	0.04
195	603385	惠达卫浴	35,800	269,574.00	0.04
196	601137	博威合金	17,200	267,632.00	0.04
197	603948	建业股份	12,400	266,600.00	0.04
198	603012	创力集团	42,600	262,842.00	0.03
199	002852	道道全	20,200	261,186.00	0.03
200	600897	厦门空港	12,600	260,694.00	0.03
201	605158	华达新材	34,000	258,400.00	0.03

202	605006	山东玻纤	34,400	258,000.00	0.03
203	603366	日出东方	44,200	256,802.00	0.03
204	601003	柳钢股份	62,800	253,712.00	0.03
205	601818	光大银行	82,400	252,968.00	0.03
206	002448	中原内配	36,000	252,000.00	0.03
207	605168	三人行	2,900	249,226.00	0.03
208	603486	科沃斯	3,200	248,864.00	0.03
209	688496	清越科技	12,200	242,536.00	0.03
210	600724	宁波富达	66,000	242,220.00	0.03
211	002603	以岭药业	9,000	231,210.00	0.03
212	600312	平高电气	18,400	227,976.00	0.03
213	603816	顾家家居	5,960	227,374.00	0.03
214	002397	梦洁股份	64,800	224,856.00	0.03
215	601857	中国石油	29,600	221,112.00	0.03
216	002990	盛视科技	6,000	220,800.00	0.03
217	600863	内蒙华电	52,200	216,630.00	0.03
218	300314	戴维医疗	10,200	215,628.00	0.03
219	603997	继峰股份	15,000	214,500.00	0.03
220	300631	久吾高科	6,000	209,880.00	0.03
221	003006	百亚股份	12,000	207,360.00	0.03
222	603279	景津装备	6,600	206,976.00	0.03
223	601021	春秋航空	3,600	206,892.00	0.03
224	300856	科思股份	2,600	204,802.00	0.03
225	002612	朗姿股份	8,600	204,508.00	0.03
226	002402	和而泰	11,800	200,364.00	0.03
227	600218	全柴动力	22,200	198,912.00	0.03
228	300726	宏达电子	4,400	196,768.00	0.03
229	603619	中曼石油	11,400	192,888.00	0.03
230	603949	雪龙集团	12,200	192,516.00	0.03
231	000777	中核科技	14,000	188,860.00	0.03
232	002739	万达电影	15,000	188,100.00	0.03
233	000060	中金岭南	39,400	187,150.00	0.02
234	300978	东箭科技	13,600	185,368.00	0.02
235	600741	华域汽车	10,000	184,600.00	0.02
236	000999	华润三九	3,000	181,980.00	0.02
237	601686	友发集团	26,600	181,944.00	0.02
238	600828	茂业商业	48,600	179,820.00	0.02
239	000878	云南铜业	16,200	179,010.00	0.02
240	002372	伟星新材	8,600	176,644.00	0.02
241	300384	三联虹普	10,200	173,298.00	0.02
242	000938	紫光股份	5,400	171,990.00	0.02
242	002818	富森美	13,000	171,990.00	0.02
244	002300	太阳电缆	19,200	168,768.00	0.02

245	603823	百合花	13,520	167,648.00	0.02
246	002293	罗莱生活	14,000	161,000.00	0.02
247	002912	中新赛克	3,600	158,436.00	0.02
248	600060	海信视像	6,400	158,400.00	0.02
249	002327	富安娜	18,800	158,296.00	0.02
250	300724	捷佳伟创	1,400	157,290.00	0.02
251	603421	鼎信通讯	15,000	156,750.00	0.02
252	002563	森马服饰	25,200	156,744.00	0.02
253	002955	鸿合科技	6,600	155,430.00	0.02
254	601717	郑煤机	12,400	154,380.00	0.02
255	300908	仲景食品	3,400	154,190.00	0.02
256	603577	汇金通	15,700	154,174.00	0.02
257	600481	双良节能	10,800	150,984.00	0.02
258	688188	柏楚电子	800	150,848.00	0.02
259	603587	地素时尚	10,200	149,328.00	0.02
260	600325	华发股份	15,000	147,750.00	0.02
261	600919	江苏银行	19,600	144,060.00	0.02
262	002335	科华数据	4,000	143,800.00	0.02
263	605300	佳禾食品	6,600	143,484.00	0.02
264	601916	浙商银行	53,560	141,398.40	0.02
265	301395	仁信新材	5,196	138,629.28	0.02
266	002991	甘源食品	1,800	138,060.00	0.02
267	002056	横店东磁	7,400	134,754.00	0.02
268	002568	百润股份	3,600	130,860.00	0.02
269	300130	新国都	4,600	130,318.00	0.02
270	688357	建龙微纳	2,000	129,380.00	0.02
271	002115	三维通信	19,800	129,096.00	0.02
272	300465	高伟达	13,000	129,090.00	0.02
273	002966	苏州银行	19,600	128,380.00	0.02
274	002371	北方华创	400	127,060.00	0.02
275	002060	粤水电	19,200	126,336.00	0.02
276	300009	安科生物	12,200	122,000.00	0.02
277	301039	中集车辆	9,200	121,716.00	0.02
278	688208	道通科技	4,000	121,240.00	0.02
279	300161	华中数控	2,200	117,744.00	0.02
280	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.02
281	600436	片仔癀	400	114,544.00	0.02
282	002839	张家港行	27,000	114,210.00	0.02
283	002970	锐明技术	3,600	113,364.00	0.02
284	000921	海信家电	4,200	113,190.00	0.02
285	000002	万科 A	8,000	112,160.00	0.01
286	688152	麒麟信安	1,192	109,997.76	0.01
287	601006	大秦铁路	14,800	109,964.00	0.01

288	688626	翔宇医疗	2,400	109,224.00	0.01
289	002518	科士达	2,600	104,026.00	0.01
290	603939	益丰药房	2,800	103,600.00	0.01
291	603136	天目湖	4,000	103,200.00	0.01
292	600166	福田汽车	30,000	102,000.00	0.01
293	002429	兆驰股份	18,400	101,200.00	0.01
294	600229	城市传媒	11,800	100,536.00	0.01
295	601998	中信银行	16,800	100,464.00	0.01
295	688187	时代电气	2,400	100,464.00	0.01
297	605599	菜百股份	7,600	100,396.00	0.01
298	300129	泰胜风能	10,400	99,736.00	0.01
299	000596	古井贡酒	400	98,952.00	0.01
300	601186	中国铁建	10,000	98,500.00	0.01
301	300012	华测检测	5,000	97,500.00	0.01
302	688288	鸿泉物联	3,726	94,714.92	0.01
303	688315	诺禾致源	3,400	90,270.00	0.01
304	600016	民生银行	24,000	90,000.00	0.01
305	603345	安井食品	600	88,080.00	0.01
306	601128	常熟银行	12,600	85,932.00	0.01
307	600926	杭州银行	7,200	84,600.00	0.01
308	601577	长沙银行	10,800	83,808.00	0.01
309	688249	晶合集成	4,616	83,364.96	0.01
310	688428	诺诚健华	7,200	83,160.00	0.01
311	603565	中谷物流	7,600	82,080.00	0.01
312	600161	天坛生物	3,000	81,450.00	0.01
313	601336	新华保险	2,200	80,894.00	0.01
314	600329	达仁堂	1,800	80,802.00	0.01
315	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.01
316	601975	招商南油	27,600	78,936.00	0.01
317	600480	凌云股份	10,000	78,600.00	0.01
318	003029	吉大正元	2,400	77,880.00	0.01
319	605009	豪悦护理	1,600	76,800.00	0.01
320	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.01
321	601928	凤凰传媒	6,400	72,960.00	0.01
322	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.01
323	600901	江苏金租	17,360	71,696.80	0.01
324	603605	珀莱雅	600	67,440.00	0.01
325	000737	北方铜业	10,000	53,900.00	0.01
326	688531	日联科技	353	49,088.39	0.01
327	301358	湖南裕能	1,080	46,321.20	0.01
328	002415	海康威视	1,200	39,732.00	0.01
329	301325	曼恩斯特	364	39,293.80	0.01
330	688443	智翔金泰	1,326	39,103.74	0.01

331	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
332	301291	明阳电气	974	30,223.22	0.00
333	600973	宝胜股份	6,200	30,070.00	0.00
334	688146	中船特气	784	29,893.92	0.00
335	688576	西山科技	240	28,898.40	0.00
336	001287	中电港	1,365	28,692.30	0.00
337	688352	颀中科技	2,361	28,497.27	0.00
338	301310	鑫宏业	409	26,760.87	0.00
339	688484	南芯科技	724	26,578.04	0.00
340	001979	招商蛇口	2,000	26,060.00	0.00
341	688507	索辰科技	207	25,276.77	0.00
342	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
343	301297	富乐德	1,015	22,847.65	0.00
344	688552	航天南湖	956	22,466.00	0.00
345	688543	国科军工	410	21,750.50	0.00
346	688570	天玛智控	838	21,226.54	0.00
347	601061	中信金属	2,699	20,458.42	0.00
348	688458	美芯晟	221	20,057.96	0.00
349	688581	安杰思	163	19,238.89	0.00
350	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00
351	301262	海看股份	692	17,646.00	0.00
352	301383	天键股份	493	17,609.96	0.00
353	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
354	688099	晶晨股份	191	16,105.12	0.00
355	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
356	688623	双元科技	178	15,448.62	0.00
357	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
358	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
359	301280	珠城科技	418	14,947.68	0.00
360	301408	华人健康	879	14,899.05	0.00
361	301305	朗坤环境	753	14,826.57	0.00
362	301397	溯联股份	362	14,552.40	0.00
363	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
364	301387	光大同创	307	13,925.52	0.00
365	301210	金杨股份	281	13,816.77	0.00
366	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
367	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
368	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
369	301345	涛涛车业	266	12,406.24	0.00
370	002917	金奥博	1,000	12,360.00	0.00
371	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
372	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
373	603135	中重科技	628	11,234.92	0.00

374	301225	恒勃股份	333	11,075.58	0.00
375	301429	森泰股份	499	10,488.98	0.00
376	601065	江盐集团	875	10,360.00	0.00
377	300568	星源材质	600	10,314.00	0.00
378	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
379	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
380	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
381	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
382	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
383	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
384	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
385	301281	科源制药	337	8,458.70	0.00
386	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
387	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
388	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
389	300804	广康生化	226	7,451.22	0.00
390	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
391	600153	建发股份	500	5,455.00	0.00
392	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
393	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
394	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
395	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
396	001367	海森药业	55	2,171.40	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	688235	百济神州	7,912,808.54	0.85
2	603027	千禾味业	6,170,174.00	0.66
3	601888	中国中免	6,060,498.00	0.65
4	603757	大元泵业	5,620,345.00	0.61
5	000983	山西焦煤	5,027,409.48	0.54
6	600036	招商银行	4,991,606.00	0.54
7	600348	华阳股份	4,649,520.00	0.50
8	601838	成都银行	4,593,357.00	0.49
9	601939	建设银行	4,240,849.00	0.46
10	002714	牧原股份	4,232,861.00	0.46
11	300129	泰胜风能	4,099,041.00	0.44
12	601088	中国神华	3,880,779.00	0.42
13	002594	比亚迪	3,756,784.00	0.40
14	002833	弘亚数控	3,627,289.80	0.39
15	603309	维力医疗	3,545,981.50	0.38

16	000568	泸州老窖	3,460,637.00	0.37
17	001308	康冠科技	3,391,277.50	0.37
18	688111	金山办公	3,356,725.91	0.36
19	600908	无锡银行	3,351,564.00	0.36
20	603259	药明康德	3,336,642.00	0.36

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	000983	山西焦煤	7,699,251.94	0.83
2	600348	华阳股份	5,853,244.00	0.63
3	600036	招商银行	5,772,828.00	0.62
4	601899	紫金矿业	5,523,399.00	0.59
5	601658	邮储银行	5,425,069.00	0.58
6	600585	海螺水泥	5,234,387.50	0.56
7	002594	比亚迪	5,002,605.00	0.54
8	600377	宁沪高速	4,758,280.92	0.51
9	300274	阳光电源	4,486,837.00	0.48
10	601838	成都银行	4,441,555.00	0.48
11	603757	大元泵业	4,431,434.00	0.48
12	002839	张家港行	4,296,152.80	0.46
13	000338	潍柴动力	4,288,670.25	0.46
14	603444	吉比特	4,281,690.00	0.46
15	600690	海尔智家	4,246,240.10	0.46
16	002714	牧原股份	4,221,802.00	0.45
17	601699	潞安环能	4,205,089.00	0.45
18	002833	弘亚数控	4,160,865.50	0.45
19	300129	泰胜风能	4,101,069.04	0.44
20	601988	中国银行	4,075,098.00	0.44

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	853,494,136.97
卖出股票收入（成交）总额	913,252,186.10

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	58,682,202.00	7.81
2	央行票据	-	-
3	金融债券	152,578,694.61	20.30
	其中：政策性金融债	63,087,419.02	8.40
4	企业债券	252,649,964.94	33.62
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	187,174,941.80	24.91
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	651,085,803.35	86.64

### 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	42,310,312.33	5.63
2	019670	22 国债 05	400,000	40,364,854.80	5.37
3	185769	22 首股 02	380,000	38,414,805.92	5.11
4	185402	22 沪电 01	300,000	30,361,443.29	4.04
5	102281217	22 鲁黄金 MTN003 (科创票据)	300,000	30,146,311.48	4.01

### 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，中国平安保险(集团)股份有限公司于 2022 年 8 月 22 日曾受到国家外汇管理局深圳市分局公开处罚；招商银行于 2022 年 9 月 9 日曾受到银保监会公开处罚，于 2022 年 8 月 31 日曾受到央行公开处罚；东北证券股份有限公司于 2022 年 11 月 23 日曾受到国家外汇管理局吉林省分局公开处罚，于 2023 年 2 月 6 日收到中国证监会的立案调查书，被中国证监会立案调查，于 2023 年 6 月 20 日收到中国证监会《行政处罚决定书》，受到中国证监会的公开处罚。

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	63,426.92
2	应收清算款	423,733.14
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	674.39
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	487,834.45

#### 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

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 (%)
15,186	49,863.09	4,370,486.96	0.58	752,850,453.80	99.42

#### 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	53,210.56	0.0070

### § 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	962,486,521.19
本报告期基金总申购份额	221,303.17
减：本报告期基金总赎回份额	205,486,883.60
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	757,220,940.76

### § 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 (%)	
中信建投	1	444,312,114.33	25.35	413,789.44	25.35	-
海通证券	1	371,291,647.21	21.18	345,790.18	21.18	-
兴业证券	1	201,302,931.41	11.48	187,470.99	11.48	-
中信证券	1	186,702,603.65	10.65	173,873.71	10.65	-
东北证券	1	165,399,515.71	9.44	154,043.12	9.44	-
中泰证券	1	154,582,974.19	8.82	143,965.35	8.82	-
申万宏源	1	94,574,859.92	5.39	88,082.88	5.40	-
安信证券	1	85,601,574.62	4.88	79,719.76	4.88	-

国金证券	1	39,799,028.26	2.27	37,070.63	2.27	-
招商证券	1	4,901,020.82	0.28	4,564.53	0.28	-
长江证券	1	4,545,682.56	0.26	4,233.32	0.26	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-

注：（一）本基金本报告期新增华福证券 016639，撤销平安证券 012905 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(%)
中信建投	28,026,920.31	5.63	1,699,920,000.00	26.29	-	-
海通证券	362,412.50	0.07	534,000,000.00	8.26	-	-
兴业证券	329,298,724.00	66.18	1,534,700,000.00	23.74	-	-
中信证券	81,706,026.60	16.42	880,000,000.00	13.61	-	-
东北证券	-	-	324,700,000.00	5.02	-	-
中泰证券	332,704.80	0.07	463,000,000.00	7.16	-	-
申万宏源	3,006,900.00	0.60	436,500,000.00	6.75	-	-
安信证券	-	-	11,882,000.00	0.18	-	-
国金证	-	-	181,000,000.00	2.80	-	-

券			00			
招商证 券	8,166,470.0 0	1.64	47,000,000.0 0	0.73	-	-
长江证 券	506,403.00	0.10	352,300,000. 00	5.45	-	-
渤海证 券	46,181,246. 00	9.28	-	-	-	-
高华证 券	-	-	-	-	-	-
华宝证 券	-	-	-	-	-	-
华福证 券	-	-	-	-	-	-
首创证 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波控回报 12 个月持有期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