

宏利中证 500 指数增强型证券投资基金
(LOF)
2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：宏利基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 08 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 01 月 01 日起至 2023 年 06 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	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	11
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	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53
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	54

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	54
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	54
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	54
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
7.12 投资组合报告附注	55
§ 8 基金份额持有人信息	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
8.2 期末上市基金前十名持有人	56
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
§ 9 开放式基金份额变动	56
§ 10 重大事件揭示	57
10.1 基金份额持有人大会决议	57
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	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	57
10.4 基金投资策略的改变	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	57
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	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	57
10.8 其他重大事件	61
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	62
11.1 影响投资者决策的其他重要信息	62
§ 12 备查文件目录	62
12.1 备查文件目录	62
12.2 存放地点	62
12.3 查阅方式	62

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	宏利中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF)
基金简称	宏利 500 指数增强 (LOF)
基金主代码	162216
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 11 月 6 日
基金管理人	宏利基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	203,391,785.93 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2019 年 12 月 5 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票型指数增强基金，在对中证 500 指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%，力争获取超越标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用指数增强型投资策略，在控制与比较基准偏离风险的前提下，综合利用多种量化投资模型和指数增强技术，力争获得超越业绩比较基准的投资收益。
业绩比较基准	95%×中证 500 指数收益率+5%×1 年期定期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为股票型指数增强型基金，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		宏利基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	徐娇	许俊
	联系电话	66577766	010-66596688
	电子邮箱	irm@manulifefund.com.cn	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		400-698-8888	95566
传真		010-66577666	010-66594942
注册地址		北京市朝阳区针织路 23 号楼中国人寿金融中心 6 层 02-07 单元	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		北京市朝阳区针织路 23 号楼中国人寿金融中心 6 层 02-07 单元	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		100026	100818
法定代表人		高贵鑫	葛海蛟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
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、基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 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	2,180,633.61
本期利润	3,843,824.88
加权平均基金份额本期利润	0.0186
本期加权平均净值利润率	1.38%
本期基金份额净值增长率	1.04%
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	180,154,591.19
期末可供分配基金份额利润	0.8858
期末基金资产净值	266,120,314.02
期末基金份额净值	1.3084
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	38.18%

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2. 所述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

3. 对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

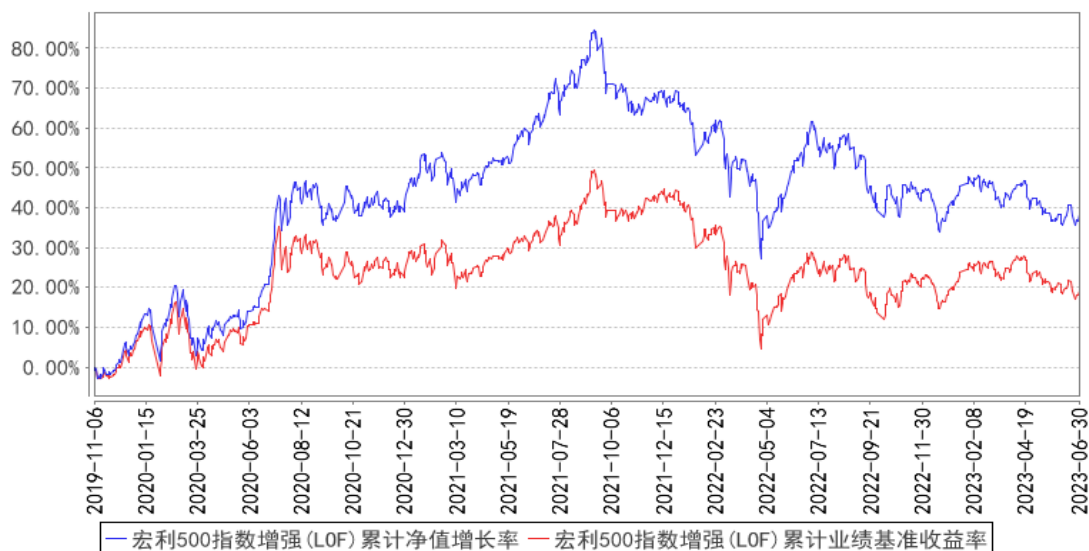
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.85%	0.92%	-0.76%	0.89%	1.61%	0.03%
过去三个月	-3.70%	0.76%	-5.09%	0.78%	1.39%	-0.02%
过去六个月	1.04%	0.73%	2.23%	0.75%	-1.19%	-0.02%
过去一年	-12.67%	0.92%	-6.59%	0.91%	-6.08%	0.01%

过去三年	12.69%	1.14%	2.66%	1.13%	10.03%	0.01%
自基金合同生效起至今	38.18%	1.21%	19.05%	1.21%	19.13%	0.00%

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

3.2.2 自基金合同生效以来基金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500指数增强(LOF)累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

§ 4 管理人报告

4.1 基金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		
李婷婷	本基金基金经理	2023 年 6 月 28 日	-	6 年	北京大学金融硕士；2017 年 7 月至今任职于宏利基金管理有限公司，曾任策略投资部助理研究员、研究员，现任基金经理。具备 6 年基金从业经验，具有基金从业资格。
刘洋	策略投资部副总监	2019 年 11 月 6 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，

	理；基金经理				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，未发现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，风险管理部对可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，对异常交易发生前后不同投资组合买卖该异常交易证券的情况进行分析，定期对各投资组合的交易行为进行整体分析评估，定期向风险控制委员会提交公募基金和特定客户资产组合的交易行为分析报告。如发现疑似异常交易情况，相关投资组合经理对该交易情况进行合理性解释。监察稽核部定期对异常交易制度的执行和控制工作进行稽核。

本报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合的同日反向交易成交较少的单边交易量均不超过该证券当日成交量的 5%，在本报告期内也未发生因异常交易而受到监管机构处罚的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年上半年的权益市场经历了几个不同的阶段。一季度延续了去年四季度以来的反弹行情，结构从超跌板块带领的普涨逐渐演化为以数字经济与 AI 为催化的结构性行情，符合一季报发布前的业绩真空期的特点。同时由于增量资金匮乏，资金的存量博弈造成机构重仓的成长与质量风格受挫。二季度进入 4 月份股价重回基本面定价，但出于对业绩延续性的担忧，财报定价行情延续时间不长。随后市场震荡回调，前期各热点领域也出现快速轮动与获利资金兑现，市场主线再次走向不确定。虽在行业板块与细分赛道上难以出现持续性机会，但贯穿整个上半年的市场风格却有稳定的延续性，即选择低估值、低波动、低杠杆与小市值，资金在不确定的宏观环境与复苏斜率中坚持着低风险与确定性偏好。

本基金在操作中恪守基金合同，采用指数增强策略，严格控制跟踪误差及其他风险属性。使用量化选股手段，力争挑选盈利质量高、盈利增速稳定、估值合理的中盘绩优股票。选股风格偏向长期基本面，较好的控制了持仓换手率与交易成本。持仓结构分散以控制个股风险，仓位保持合理稳定。本报告期内，本基金增加了电子、机械、传媒的配置，减少了食品饮料、基础化工、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 1.3084 元；本报告期基金份额净值增长率为 1.04%，业绩比较基准收益率为 2.23%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，二季度以来市场的震荡整理或已接近阶段性底部，对于下半年的市场表现不悲观。当前各项经济政策相继推出，涵盖了促进民营经济发展壮大、扩大内需促消费、大城市城中村改造、发展数字经济与 AI 产业等各个领域。从外部变量看，人民币汇率或已经得到阶段性稳定，地缘政治因素处于缓和窗口期，美国加息尾部风险或已较大程度得到市场定价，北向资金亦已暂时扭转了净流出趋势。大部分行业与市场整体估值处于相对低位，同时交易拥挤度也较低，股权风险溢价高点预示权益资产的高性价比。建议关注超跌且存在预期改善可能的顺周期品种，如消费、金融、建筑、有色等，同时继续看好科技板块在中周期的主线地位与配置价值。下半年市场结构分化的格局料将出现一定程度的缓和，风格或相对更加均衡，短期若出现反弹行情，可配置宽基指数参与。

基于基金合同与投资观点，本基金在选股策略上倾向于选择盈利质量高、公司治理规范、估值合理、有长期业绩成长能力的股票。在严格控制行业与风格暴露风险的前提下获取稳定的选股

超额收益。在持仓上选择不过分暴露个股相对权重，分散投资以期平衡组合风险。

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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对宏利中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购

赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：宏利中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF)

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
资产：			
银行存款	6.4.7.1	6,712,884.10	3,049,524.28
结算备付金		1,216,003.96	996,101.37
存出保证金		38,309.44	90,372.94
交易性金融资产	6.4.7.2	258,933,994.69	274,736,850.49
其中：股票投资		249,670,386.66	260,792,148.87
基金投资		-	-
债券投资		9,263,608.03	13,944,701.62
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		148,789.40	214,633.56
应收股利		-	-
应收申购款		207,535.39	366,237.95
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		267,257,516.98	279,453,720.59

负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 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		-	-
应付清算款		3,443.46	-
应付赎回款		144,268.95	23,647.07
应付管理人报酬		218,016.18	251,790.24
应付托管费		43,603.20	50,358.03
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	727,871.17	1,001,776.58
负债合计		1,137,202.96	1,327,571.92
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	85,965,722.83	90,779,313.92
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	180,154,591.19	187,346,834.75
净资产合计		266,120,314.02	278,126,148.67
负债和净资产总计		267,257,516.98	279,453,720.59

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.3084 元，基金份额总额 203,391,785.93 份。

6.2 利润表

会计主体：宏利中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF)

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
一、营业总收入		5,715,678.94	-42,114,563.14
1. 利息收入		15,590.82	46,504.63
其中：存款利息收入	6.4.7.13	15,590.82	46,504.63
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		-	-

证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		4,004,124.33	-64,894,261.62
其中：股票投资收益	6.4.7.14	795,637.79	-69,386,974.77
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	96,150.41	134,278.64
资产支持证券投资 收益	6.4.7.16	-	-
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	3,112,336.13	4,358,434.51
以摊余成本计量的 金融资产终止确认产生的 收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.20	1,663,191.27	22,538,207.47
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	32,772.52	194,986.38
减：二、营业总支出		1,871,854.06	2,892,516.24
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,383,214.22	2,226,071.20
2. 托管费	6.4.10.2.2	276,642.84	445,214.32
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		9,151.10	11,691.07
其中：卖出回购金融资产 支出		9,151.10	11,691.07
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	202,845.90	209,539.65
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		3,843,824.88	-45,007,079.38
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		3,843,824.88	-45,007,079.38
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		3,843,824.88	-45,007,079.38

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：宏利中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF)

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)	90,779,313.92	-	187,346,834.75	278,126,148.67
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)	90,779,313.92	-	187,346,834.75	278,126,148.67
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-4,813,591.09	-	-7,192,243.56	-12,005,834.65
(一)、综合收益总额	-	-	3,843,824.88	3,843,824.88
(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)	-4,813,591.09	-	-11,036,068.44	-15,849,659.53
其中：1. 基金申购款	8,761,387.54	-	19,053,608.33	27,814,995.87
2. 基金赎回款	-13,574,978.63	-	-30,089,676.77	-43,664,655.40
(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)	85,965,722.83	-	180,154,591.19	266,120,314.02
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	142,875,201.27	-	399,314,541.50	542,189,742.77

资产(基金净值)				
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)	142,875,201.27	-	399,314,541.50	542,189,742.77
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-43,621,046.17	-	-146,746,083.12	-190,367,129.29
(一)、综合收益总额	-	-	-45,007,079.38	-45,007,079.38
(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)	-43,621,046.17	-	-101,739,003.74	-145,360,049.91
其中: 1. 基金申购款	32,879,622.73	-	79,274,476.33	112,154,099.06
2. 基金赎回款	-76,500,668.90	-	-181,013,480.07	-257,514,148.97
(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)	99,254,155.10	-	252,568,458.38	351,822,613.48

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

宏利中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) (原名为泰达宏利中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF), 以下简称“本基金”) 由泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金 (以下简称“泰达宏利中证 500 指数分级基金”) 转型而来。根据基金管理人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) 于 2019 年 10 月 29 日发布的《泰达宏利基金管理有限公司关于泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金实施转型的公告》, 原泰达宏利中证 500 指数分级基金以现场方式召开了基金份额持有人大会。基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效, 基金管理人根据基金份额持有人大会的授权, 定于 2019 年 11 月 6 日正式实施基金转型。《泰达宏利中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金合同》自 2019 年 11 月 6 日起生效。本基金为契约型开放式, 存续期限不定。本基金的基金管理人为宏利基金管理有限公司, 基金托管人为中国银行股份有限公司 (以下简称“中国银行”)。

根据本基金的基金管理人 2023 年 6 月 17 日发布的《宏利基金管理有限公司关于旗下基金更名事宜的公告》, 本基金自 2023 年 6 月 20 日起更名为宏利中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF)。

经深圳证券交易所 (以下简称“深交所”) 深证上[2019]776 号核准, 本基金 5,381,032.00 份基金份额于 2019 年 12 月 5 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外, 基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《宏利中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金合同》的有关规定, 本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具, 包括国内依法发行上市的股票 (包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券 (包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、次级债券、可交换债券、可转换债券等)、债券回购、资产支持证券、股指期货、货币市场工具、同业存单及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于股票组合的比例不低于基金资产的 80%, 投资组合中投资于中证 500 指数成份股及备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后, 基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%, 其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金投资股指期货及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的相关规定。本基金的业绩比较基准为: $95\% \times \text{中证 500 指数收益率} + 5\% \times 1 \text{ 年期定期存款利率 (税后)}$ 。

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》、《宏利中证 500 指数增强型证券投资基金(LOF)基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年度上半年财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2023 年 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年度上半年的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无会计政策的变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无会计估计的变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无重大会计差错发生。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管

产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

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

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	6,712,884.10
等于：本金	6,712,280.10
加：应计利息	604.00
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	6,712,884.10

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	258,727,025.88	-	249,670,386.66	-9,056,639.22
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	164,518.03	9,263,608.03	-21,710.95
	银行间市场	-	-	-
	合计	164,518.03	9,263,608.03	-21,710.95
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	267,847,826.83	164,518.03	258,933,994.69	-9,078,350.17

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和负债。

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	223.64
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	583,887.38
其中：交易所市场	583,887.38
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	93,760.15
指数使用费	50,000.00
合计	727,871.17

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	214,780,518.45	90,779,313.92
本期申购	20,729,097.55	8,761,387.54
本期赎回 (以“-”号填列)	-32,117,830.07	-13,574,978.63
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	203,391,785.93	85,965,722.83

注：1. 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。

2. 截至 2023 年 6 月 30 日止，本基金于深交所上市的基金份额为 4,564,450.00 份 (2022 年 12 月 31 日：11,149,065.00 份)，托管在场外未上市交易的基金份额为 198,827,335.93 份 (2022 年 12 月 31 日：203,631,453.45 份)。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

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	204,628,792.78	-17,281,958.03	187,346,834.75
本期利润	2,180,633.61	1,663,191.27	3,843,824.88
本期基金份额交易产生的变动数	-11,091,486.09	55,417.65	-11,036,068.44
其中：基金申购款	19,996,215.06	-942,606.73	19,053,608.33
基金赎回款	-31,087,701.15	998,024.38	-30,089,676.77
本期已分配利润	-	-	-
本期末	195,717,940.30	-15,563,349.11	180,154,591.19

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	7,275.45
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	7,831.01
其他	484.36
合计	15,590.82

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	795,637.79
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	795,637.79

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	638,563,861.14
减：卖出股票成本总额	635,861,013.57
减：交易费用	1,907,209.78
买卖股票差价收入	795,637.79

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	130,836.41
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-34,686.00
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	96,150.41

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	4,820,790.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成	4,734,686.00

本总额	
减：应计利息总额	120,790.00
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-34,686.00

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期末有债券投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期末有债券投资收益-申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期末有资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期末有资产支持证券投资收益-买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期末有资产支持证券投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期末有资产支持证券投资收益-申购差价收入。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期末有贵金属投资收益。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内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

本基金本报告期内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	3,112,336.13
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	3,112,336.13

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	1,663,191.27
股票投资	1,619,645.27
债券投资	43,546.00
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	1,663,191.27

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	32,772.52
合计	32,772.52

注：本基金的场外赎回费率按持有期间递减，场内赎回费率为赎回金额的 0.5%，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期末未有信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78

信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	4,585.75
账户维护费	9,000.00
指数使用费	100,000.00
合计	202,845.90

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期没有存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
宏利基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国银行股份有限公司(中国银行)	基金托管人、基金代销机构

注：1. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,383,214.22	2,226,071.20
其中：支付销售机构的客户维护费	496,676.84	511,820.33

注：支付基金管理人宏利基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.0% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.0% / 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	276,642.84	445,214.32

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.2% 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 × 0.2% / 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可比期间均无与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用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
中国银行	6,712,884.10	7,275.45	7,053,623.27	31,201.49

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
301292	海科新源	2023年6月29日	1个月内（含）	新股未上市	19.99	19.99	4,158	83,118.42	83,118.42	-
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	462	9,235.38	9,235.38	-
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	3,039	81,080.52	81,080.52	-
301395	仁信	2023年6月	1-6个月（含）	新股流通	26.68	26.68	338	9,017.84	9,017.84	-

	新材	21 日		受限						
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	1,157	63,635.00	63,635.00	-
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	129	7,095.00	7,095.00	-
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	2,131	55,022.42	55,022.42	-
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	237	6,119.34	6,119.34	-
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	1,471	54,279.90	54,279.90	-
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	164	6,051.60	6,051.60	-
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	-
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	1,457	28,936.02	26,313.42	-
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	233	6,896.80	16,640.86	-
301317	鑫磊股份	2023 年 1 月 12 日	1-6 个月 (含)	新股流通受限	20.67	26.17	571	11,802.57	14,943.07	-
688472	阿特	2023 年 6 月	1-6 个月 (含)	新股流通	11.10	17.04	863	9,579.30	14,705.52	-

	斯曼恩斯特	2 日		受限						
301325	斯曼恩斯特	2023 年 5 月 4 日	1-6 个月 (含)	新股流通受限	76.80	107.95	132	10,137.60	14,249.40	-
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	317	7,535.09	13,596.13	-
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	297	9,658.44	12,583.89	-
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	416	15,758.08	12,267.84	-
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	-
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	277	7,406.98	11,268.36	-
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	92	12,493.60	11,077.72	-
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	167	11,235.76	10,926.81	-
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	114	8,194.32	10,556.40	-
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	75	11,428.50	10,197.75	-
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	582	9,451.68	9,864.90	-
301291	明	2023	1-6 个月 (含)	新股	38.13	31.03	310	11,820.30	9,619.30	-

	阳电气	2023年6月21日	月(含)	流通受限						
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	209	12,188.88	9,480.24	-
688352	顾中科技	2023年4月11日	1-6个月(含)	新股流通受限	12.10	12.07	780	9,438.00	9,414.60	-
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	261	12,047.76	9,322.92	-
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	243	8,784.45	9,265.59	-
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	174	7,598.58	9,230.70	-
688334	西高院	2023年6月9日	1-6个月(含)	新股流通受限	14.16	16.21	551	7,802.16	8,931.71	-
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	346	10,456.12	8,823.00	-
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	97	7,275.00	8,803.72	-
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	169	7,434.31	8,715.33	-
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	262	9,342.92	8,714.12	-
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	412	4,894.56	8,660.24	-

301429	森泰股份	2023年4月10日	1-6个月(含)	新股流通受限	28.75	21.02	411	11,816.25	8,639.22	-
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	353	7,716.58	8,419.05	-
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	335	7,091.95	7,872.50	-
688484	南芯科技	2023年3月28日	1-6个月(含)	新股流通受限	39.99	36.71	211	8,437.89	7,745.81	-
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	64	8,051.20	7,553.92	-
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	150	8,682.00	7,375.50	-
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	230	6,131.80	7,245.00	-
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	315	7,767.90	7,090.65	-
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	516	7,641.96	7,084.68	-
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	206	8,744.70	6,791.82	-
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	354	7,405.68	6,782.64	-
301305	朗坤环	2023年5月15日	1-6个月(含)	新股流通受限	25.25	19.69	343	8,660.75	6,753.67	-

	境									
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	115	8,337.50	6,718.30	-
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	262	7,928.12	6,636.46	-
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	259	4,972.80	6,612.27	-
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	272	8,157.28	6,470.88	-
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	187	8,626.31	6,432.80	-
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	215	5,435.20	6,422.05	-
688535	华海诚科	2023年3月28日	1-6个月(含)	新股流通受限	35.00	51.23	124	4,340.00	6,352.52	-
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	813	5,349.54	6,162.54	-
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	348	6,956.52	5,881.20	-
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	166	7,333.88	4,166.60	-
301281	科源制	2023年5月26日	1-6个月(含)	新股流通受限	0.00	25.10	67	0.00	1,681.70	转增股

	药									
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	163	5,542.00	5,693.59	-
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	64	8,056.32	5,554.56	-
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	188	6,390.12	5,544.12	-
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	274	4,877.20	4,901.86	-
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	151	4,922.60	4,585.87	-
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	93	6,830.85	4,337.52	-
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	279	3,253.14	3,420.54	-
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	272	2,817.92	3,220.48	-
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	84	2,346.12	2,774.52	-
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	99	2,047.32	2,523.51	-
603137	恒尚节	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	-

	能									
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	53	2,357.44	2,092.44	-

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股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为股票型指数增强型基金，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、货币市场工具投资、权证投资及资产支持证券投资等。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争取将以上

风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行，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，因此违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据、政策性金融债和同业存单以外的债券投资、资产支持证券投资。(2022 年 12 月 31 日：同)。

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》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
资产					
银行存款	6,712,884.10	-	-	-	6,712,884.10
结算备付金	1,216,003.96	-	-	-	1,216,003.96
存出保证金	38,309.44	-	-	-	38,309.44
交易性金融资产	9,263,608.03	-	-	-249,670,386.66	258,933,994.69
应收申购款	-	-	-	207,535.39	207,535.39
应收清算款	-	-	-	148,789.40	148,789.40
资产总计	17,230,805.53	-	-	-250,026,711.45	267,257,516.98
负债					
应付赎回款	-	-	-	144,268.95	144,268.95
应付管理人报酬	-	-	-	218,016.18	218,016.18
应付托管费	-	-	-	43,603.20	43,603.20
应付清算款	-	-	-	3,443.46	3,443.46
其他负债	-	-	-	727,871.17	727,871.17

负债总计	-	-	-	1,137,202.96	1,137,202.96
利率敏感度缺口	17,230,805.53	-	-	-248,889,508.49	266,120,314.02
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,049,524.28	-	-	-	3,049,524.28
结算备付金	996,101.37	-	-	-	996,101.37
存出保证金	90,372.94	-	-	-	90,372.94
交易性金融资产	13,944,701.62	-	-	-260,792,148.87	274,736,850.49
应收申购款	599.98	-	-	365,637.97	366,237.95
应收清算款	-	-	-	214,633.56	214,633.56
资产总计	18,081,300.19	-	-	-261,372,420.40	279,453,720.59
负债					
应付赎回款	-	-	-	23,647.07	23,647.07
应付管理人报酬	-	-	-	251,790.24	251,790.24
应付托管费	-	-	-	50,358.03	50,358.03
其他负债	-	-	-	1,001,776.58	1,001,776.58
负债总计	-	-	-	1,327,571.92	1,327,571.92
利率敏感度缺口	18,081,300.19	-	-	-260,044,848.48	278,126,148.67

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的到期日予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2023 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金净资产的比例为 3.48%（2022 年 12 月 31 日：5.01%），因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响（2022 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应

对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于中证 500 指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金资产的 80%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	249,670,386.66	93.82	260,792,148.87	93.77
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	249,670,386.66	93.82	260,792,148.87	93.77

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%	9,470,000.00	12,110,000.00
	沪深 300 指数下降 5%	-9,470,000.00	-12,110,000.00

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	248,748,406.41	259,614,448.57
第二层次	9,638,263.45	13,944,701.62
第三层次	547,324.83	1,177,700.30
合计	258,933,994.69	274,736,850.49

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	249,670,386.66	93.42
	其中：股票	249,670,386.66	93.42
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	9,263,608.03	3.47
	其中：债券	9,263,608.03	3.47
	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	7,928,888.06	2.97
8	其他各项资产	394,634.23	0.15
9	合计	267,257,516.98	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	2,848,332.00	1.07
B	采矿业	9,446,975.00	3.55
C	制造业	127,483,698.78	47.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,333,743.00	3.13
E	建筑业	4,078,267.00	1.53
F	批发和零售业	8,365,068.70	3.14
G	交通运输、仓储和邮政业	2,226,549.00	0.84
H	住宿和餐饮业	2,488,135.00	0.93
I	信息传输、软件和信息技术服务业	19,489,220.00	7.32
J	金融业	19,168,432.00	7.20
K	房地产业	4,455,654.00	1.67
L	租赁和商务服务业	1,142,027.00	0.43

M	科学研究和技术服务业	425,103.00	0.16
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	718,440.00	0.27
R	文化、体育和娱乐业	3,894,038.00	1.46
S	综合	134,106.00	0.05
	合计	214,697,788.48	80.68

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,238,705.00	0.47
B	采矿业	2,182,722.00	0.82
C	制造业	24,061,678.85	9.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.01
E	建筑业	29,922.68	0.01
F	批发和零售业	31,778.33	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	1,448,278.00	0.54
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,357,248.16	1.64
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	525,506.00	0.20
M	科学研究和技术服务业	570,744.36	0.21
N	水利、环境和公共设施管理业	13,186.47	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	16,640.86	0.01
R	文化、体育和娱乐业	460,740.00	0.17
S	综合	-	-
	合计	34,972,598.18	13.14

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

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

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	300308	中际旭创	26,600	3,922,170.00	1.47
2	300146	汤臣倍健	149,700	3,589,806.00	1.35
3	600096	云天化	202,100	3,449,847.00	1.30
4	000783	长江证券	582,100	3,376,180.00	1.27
5	600109	国金证券	387,900	3,363,093.00	1.26
6	002025	航天电器	52,700	3,362,260.00	1.26
7	600170	上海建工	1,208,300	3,250,327.00	1.22
8	000997	新大陆	169,900	3,211,110.00	1.21
9	000728	国元证券	491,300	3,203,276.00	1.20
10	000591	太阳能	468,200	3,174,396.00	1.19
11	688390	固德威	18,897	3,153,153.42	1.18
12	000750	国海证券	930,100	3,115,835.00	1.17
13	600143	金发科技	354,400	3,093,912.00	1.16
14	600038	中直股份	77,500	3,086,050.00	1.16
15	601717	郑煤机	247,000	3,075,150.00	1.16
16	600863	内蒙华电	740,500	3,073,075.00	1.15
17	600582	天地科技	522,400	3,045,592.00	1.14
18	002244	滨江集团	342,800	3,023,496.00	1.14
19	601128	常熟银行	439,900	3,000,118.00	1.13
20	002518	科士达	74,600	2,984,746.00	1.12
21	688208	道通科技	97,207	2,946,344.17	1.11
22	600315	上海家化	100,800	2,924,208.00	1.10
23	300861	美畅股份	66,600	2,888,442.00	1.09
24	688819	天能股份	76,819	2,830,011.96	1.06
25	600862	中航高科	99,900	2,528,469.00	0.95
26	600258	首旅酒店	131,300	2,488,135.00	0.93
27	688006	杭可科技	80,872	2,464,169.84	0.93
28	002373	千方科技	178,200	2,430,648.00	0.91
29	600297	广汇汽车	1,156,700	2,405,936.00	0.90
30	600985	淮北矿业	203,200	2,340,864.00	0.88
31	603885	吉祥航空	144,300	2,226,549.00	0.84
32	000155	川能动力	130,700	1,882,080.00	0.71
33	600598	北大荒	138,400	1,844,872.00	0.69
34	301029	怡合达	37,500	1,675,500.00	0.63
35	000709	河钢股份	725,700	1,640,082.00	0.62
36	000012	南玻 A	266,200	1,586,552.00	0.60

37	002384	东山精密	60,800	1,574,720.00	0.59
38	002625	光启技术	103,100	1,573,306.00	0.59
39	002422	科伦药业	52,200	1,549,296.00	0.58
40	600718	东软集团	136,100	1,450,826.00	0.55
41	000031	大悦城	391,300	1,432,158.00	0.54
42	002508	老板电器	56,600	1,431,414.00	0.54
43	600580	卧龙电驱	95,200	1,390,872.00	0.52
44	002563	森马服饰	218,700	1,360,314.00	0.51
45	600079	人福医药	49,900	1,344,306.00	0.51
46	300003	乐普医疗	58,900	1,331,729.00	0.50
47	688188	柏楚电子	6,700	1,263,352.00	0.47
48	688256	寒武纪	6,600	1,240,800.00	0.47
49	600160	巨化股份	89,600	1,234,688.00	0.46
50	600704	物产中大	246,500	1,217,710.00	0.46
51	002353	杰瑞股份	45,900	1,153,467.00	0.43
52	600859	王府井	57,800	1,143,862.00	0.43
53	300058	蓝色光标	118,100	1,142,027.00	0.43
54	300073	当升科技	22,500	1,132,425.00	0.43
55	002372	伟星新材	54,200	1,113,268.00	0.42
56	600486	扬农化工	12,700	1,110,234.00	0.42
57	000988	华工科技	29,200	1,109,892.00	0.42
58	600906	财达证券	152,100	1,095,120.00	0.41
59	600348	华阳股份	134,400	1,063,104.00	0.40
60	002223	鱼跃医疗	29,400	1,058,106.00	0.40
61	000807	云铝股份	82,500	1,050,225.00	0.39
62	000630	铜陵有色	363,000	1,049,070.00	0.39
63	002444	巨星科技	47,300	1,034,924.00	0.39
64	603444	吉比特	2,100	1,031,331.00	0.39
65	603737	三棵树	15,740	1,029,710.80	0.39
66	002463	沪电股份	48,900	1,023,966.00	0.38
67	002092	中泰化学	158,200	1,020,390.00	0.38
68	601168	西部矿业	96,000	1,008,960.00	0.38
69	000932	华菱钢铁	210,700	1,005,039.00	0.38
70	002299	圣农发展	52,400	1,003,460.00	0.38
71	002568	百润股份	27,400	995,990.00	0.37
72	603688	石英股份	8,700	990,408.00	0.37
73	300418	昆仑万维	24,300	978,804.00	0.37
74	002600	领益智造	141,100	975,001.00	0.37
75	002138	顺络电子	40,500	968,355.00	0.36
76	603939	益丰药房	25,640	948,680.00	0.36
77	600563	法拉电子	6,900	947,370.00	0.36
78	300866	安克创新	10,600	927,500.00	0.35
79	600369	西南证券	252,000	919,800.00	0.35

80	600497	驰宏锌锗	182,800	917,656.00	0.34
81	600418	江淮汽车	72,500	912,775.00	0.34
82	002065	东华软件	124,700	880,382.00	0.33
83	002739	万达电影	68,900	864,006.00	0.32
84	600549	厦门钨业	45,200	860,156.00	0.32
85	002273	水晶光电	71,600	854,904.00	0.32
86	600637	东方明珠	109,200	853,944.00	0.32
87	688002	睿创微纳	18,900	846,720.00	0.32
88	600489	中金黄金	81,600	842,928.00	0.32
89	002131	利欧股份	365,500	840,650.00	0.32
90	688536	思瑞浦	3,800	828,400.00	0.31
91	002738	中矿资源	16,200	825,228.00	0.31
92	688777	中控技术	13,050	819,279.00	0.31
93	002056	横店东磁	44,300	806,703.00	0.30
94	300136	信维通信	39,700	797,176.00	0.30
95	002966	苏州银行	119,000	779,450.00	0.29
96	300383	光环新网	71,800	771,850.00	0.29
97	600885	宏发股份	23,900	761,215.00	0.29
98	000878	云南铜业	68,400	755,820.00	0.28
99	300296	利亚德	114,500	747,685.00	0.28
100	600535	天士力	51,100	741,461.00	0.28
101	688385	复旦微电	14,739	738,423.90	0.28
102	600329	达仁堂	16,200	727,218.00	0.27
103	603233	大参林	25,940	726,579.40	0.27
104	603160	汇顶科技	15,700	726,125.00	0.27
105	000060	中金岭南	151,500	719,625.00	0.27
106	603456	九洲药业	26,100	714,618.00	0.27
107	601966	玲珑轮胎	32,100	713,262.00	0.27
108	002128	电投能源	52,800	698,016.00	0.26
109	300009	安科生物	69,180	691,800.00	0.26
110	603858	步长制药	33,300	685,647.00	0.26
111	000513	丽珠集团	17,400	677,034.00	0.25
112	601958	金钼股份	60,000	669,000.00	0.25
113	688295	中复神鹰	18,000	660,240.00	0.25
114	600566	济川药业	22,700	659,208.00	0.25
115	688099	晶晨股份	7,800	657,696.00	0.25
116	000739	普洛药业	37,000	656,380.00	0.25
117	600667	太极实业	90,200	654,852.00	0.25
118	002155	湖南黄金	52,700	642,940.00	0.24
119	600959	江苏有线	189,200	639,496.00	0.24
120	601231	环旭电子	42,200	631,312.00	0.24
121	300251	光线传媒	75,800	613,222.00	0.23
122	688082	盛美上海	5,500	607,200.00	0.23

123	000423	东阿阿胶	11,300	603,985.00	0.23
124	002156	通富微电	26,700	603,420.00	0.23
125	002185	华天科技	64,600	594,320.00	0.22
126	603228	景旺电子	22,800	584,820.00	0.22
127	603883	老百姓	19,500	582,075.00	0.22
128	601928	凤凰传媒	50,900	580,260.00	0.22
129	002624	完美世界	34,100	575,949.00	0.22
130	600998	九州通	54,385	564,516.30	0.21
131	000156	华数传媒	64,600	562,020.00	0.21
132	601098	中南传媒	48,300	560,280.00	0.21
133	600988	赤峰黄金	41,600	559,936.00	0.21
134	002745	木林森	60,700	558,440.00	0.21
135	688029	南微医学	6,697	546,207.32	0.21
136	600161	天坛生物	19,900	540,285.00	0.20
137	600062	华润双鹤	30,900	538,278.00	0.20
138	600707	彩虹股份	109,600	521,696.00	0.20
139	000933	神火股份	39,900	518,700.00	0.19
140	603882	金域医学	6,800	513,400.00	0.19
141	600521	华海药业	27,500	506,275.00	0.19
142	600373	中文传媒	37,800	503,496.00	0.19
143	688234	天岳先进	6,700	495,398.00	0.19
144	002409	雅克科技	6,700	488,296.00	0.18
145	002497	雅化集团	27,100	481,838.00	0.18
146	002240	盛新锂能	15,100	481,237.00	0.18
147	300604	长川科技	9,900	470,151.00	0.18
148	300373	扬杰科技	11,400	462,498.00	0.17
149	603156	养元饮品	18,700	461,890.00	0.17
150	605358	立昂微	12,496	458,978.08	0.17
151	000975	银泰黄金	39,000	456,300.00	0.17
152	600481	双良节能	30,700	429,186.00	0.16
153	300832	新产业	7,200	424,800.00	0.16
154	688521	芯原股份	5,800	417,136.00	0.16
155	603218	日月股份	21,100	400,689.00	0.15
156	600392	盛和资源	30,600	393,822.00	0.15
157	600655	豫园股份	56,400	386,904.00	0.15
158	601869	长飞光纤	10,400	384,904.00	0.14
159	000021	深科技	19,100	381,809.00	0.14
160	603707	健友股份	28,100	379,350.00	0.14
161	002294	信立泰	12,100	377,399.00	0.14
162	000831	中国稀土	12,500	370,000.00	0.14
163	002532	天山铝业	60,400	361,796.00	0.14
164	603589	口子窖	7,000	345,450.00	0.13
165	688072	拓荆科技	800	340,776.00	0.13

166	300595	欧普康视	11,100	335,109.00	0.13
167	603000	人民网	11,300	329,960.00	0.12
168	688220	翱捷科技	4,200	316,638.00	0.12
169	601665	齐鲁银行	80,500	315,560.00	0.12
170	000960	锡业股份	18,400	286,120.00	0.11
171	300676	华大基因	4,700	281,953.00	0.11
172	603338	浙江鼎力	5,000	280,050.00	0.11
173	002203	海亮股份	22,700	272,627.00	0.10
174	300088	长信科技	44,700	269,541.00	0.10
175	600867	通化东宝	25,100	262,044.00	0.10
176	600060	海信视像	10,500	259,875.00	0.10
177	002249	大洋电机	45,500	259,350.00	0.10
178	600529	山东药玻	9,500	258,590.00	0.10
179	000636	风华高科	16,800	257,712.00	0.10
180	600511	国药股份	6,600	256,410.00	0.10
181	688301	奕瑞科技	903	255,034.29	0.10
182	002192	融捷股份	3,700	247,271.00	0.09
183	300357	我武生物	7,200	242,136.00	0.09
184	002432	九安医疗	6,700	235,907.00	0.09
185	688772	珠海冠宇	10,800	217,620.00	0.08
186	688200	华峰测控	1,400	214,200.00	0.08
187	300182	捷成股份	33,400	210,754.00	0.08
188	300115	长盈精密	17,600	209,616.00	0.08
189	300244	迪安诊断	8,000	205,040.00	0.08
190	600008	首创环保	70,900	204,192.00	0.08
191	300748	金力永磁	6,300	188,496.00	0.07
192	603658	安图生物	3,600	186,228.00	0.07
193	603893	瑞芯微	2,500	182,125.00	0.07
194	300558	贝达药业	3,700	177,711.00	0.07
195	000970	中科三环	13,800	176,916.00	0.07
196	600820	隧道股份	28,800	173,088.00	0.07
197	603529	爱玛科技	5,000	161,100.00	0.06
198	300529	健帆生物	6,700	155,306.00	0.06
199	300026	红日药业	28,200	152,844.00	0.06
200	600765	中航重机	5,600	148,456.00	0.06
201	000050	深天马 A	15,900	145,962.00	0.05
202	603127	昭衍新药	3,500	143,150.00	0.05
203	300487	蓝晓科技	2,250	140,445.00	0.05
204	688276	百克生物	2,200	137,720.00	0.05
205	688520	神州细胞	2,400	136,176.00	0.05
206	300618	寒锐钴业	4,200	136,122.00	0.05
207	300363	博腾股份	4,600	136,114.00	0.05
208	300682	朗新科技	5,800	135,024.00	0.05

209	002030	达安基因	13,500	134,595.00	0.05
210	002019	亿帆医药	9,200	134,320.00	0.05
211	300677	英科医疗	6,100	134,200.00	0.05
212	600673	东阳光	18,600	134,106.00	0.05
213	600171	上海贝岭	7,300	133,225.00	0.05
214	300482	万孚生物	5,000	133,150.00	0.05
215	600556	天下秀	18,700	132,583.00	0.05
216	600056	中国医药	10,200	132,396.00	0.05
217	600166	福田汽车	38,800	131,920.00	0.05
218	688538	和辉光电	51,700	131,318.00	0.05

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600050	中国联通	476,900	2,289,120.00	0.86
2	600256	广汇能源	246,900	1,693,734.00	0.64
3	002489	浙江永强	354,800	1,436,940.00	0.54
4	301039	中集车辆	97,400	1,288,602.00	0.48
5	002458	益生股份	100,300	1,238,705.00	0.47
6	000717	中南股份	350,000	973,000.00	0.37
7	000048	京基智农	43,700	853,024.00	0.32
8	002478	常宝股份	105,500	785,975.00	0.30
9	000822	山东海化	110,000	749,100.00	0.28
10	600307	酒钢宏兴	472,100	731,755.00	0.27
11	601975	招商南油	232,300	664,378.00	0.25
12	300394	天孚通信	5,500	587,565.00	0.22
13	601138	工业富联	22,700	572,040.00	0.21
14	601208	东材科技	44,900	570,230.00	0.21
15	603019	中科曙光	11,000	559,900.00	0.21
16	300274	阳光电源	4,800	559,824.00	0.21
17	300114	中航电测	11,200	550,480.00	0.21
18	688239	航宇科技	7,800	545,610.00	0.21
19	300481	濮阳惠成	26,500	544,840.00	0.20
20	688297	中无人机	10,600	543,674.00	0.20
21	000063	中兴通讯	11,900	541,926.00	0.20
22	601965	中国汽研	26,100	538,965.00	0.20
23	600875	东方电气	28,800	537,120.00	0.20
24	603129	春风动力	3,300	534,270.00	0.20
25	300124	汇川技术	8,300	532,943.00	0.20
26	600941	中国移动	5,700	531,810.00	0.20
27	600309	万华化学	6,000	527,040.00	0.20
28	002643	万润股份	30,200	525,782.00	0.20
29	688111	金山办公	1,100	519,442.00	0.20
30	002230	科大讯飞	7,600	516,496.00	0.19

31	002271	东方雨虹	18,800	512,488.00	0.19
32	300130	新国都	17,700	501,441.00	0.19
33	688599	天合光能	11,500	490,015.00	0.18
34	603619	中曼石油	28,900	488,988.00	0.18
35	002320	海峡股份	73,700	445,148.00	0.17
36	600026	中远海能	26,800	338,752.00	0.13
37	002912	中新赛克	7,500	330,075.00	0.12
38	002139	拓邦股份	23,600	307,980.00	0.12
39	688630	芯碁微装	3,300	277,266.00	0.10
40	300109	新开源	11,000	273,570.00	0.10
41	600211	西藏药业	4,600	273,240.00	0.10
42	002737	葵花药业	11,200	272,608.00	0.10
43	002049	紫光国微	2,900	270,425.00	0.10
44	603466	风语筑	19,400	269,660.00	0.10
45	002938	鹏鼎控股	11,100	269,619.00	0.10
46	300896	爱美客	600	266,970.00	0.10
47	300433	蓝思科技	22,700	266,952.00	0.10
48	300206	理邦仪器	17,700	266,916.00	0.10
49	000100	TCL 科技	67,600	266,344.00	0.10
50	601137	博威合金	17,100	266,076.00	0.10
51	002115	三维通信	40,700	265,364.00	0.10
52	002402	和而泰	15,600	264,888.00	0.10
53	002603	以岭药业	10,300	264,607.00	0.10
54	600745	闻泰科技	5,400	264,060.00	0.10
55	002484	江海股份	12,400	263,996.00	0.10
56	601600	中国铝业	47,800	262,422.00	0.10
57	300869	康泰医学	11,400	261,744.00	0.10
58	002027	分众传媒	38,200	260,142.00	0.10
59	002466	天齐锂业	3,700	258,667.00	0.10
60	300142	沃森生物	9,700	256,565.00	0.10
61	002415	海康威视	7,700	254,947.00	0.10
62	002371	北方华创	800	254,120.00	0.10
63	300232	洲明科技	27,800	254,092.00	0.10
64	688063	派能科技	1,000	198,250.00	0.07
65	600977	中国电影	13,600	191,080.00	0.07
66	300760	迈瑞医疗	600	179,880.00	0.07
67	688508	芯朋微	2,300	133,377.00	0.05
68	688582	芯动联科	2,761	127,643.76	0.05
69	688531	日联科技	750	110,442.00	0.04
70	301292	海科新源	4,620	92,353.80	0.03
71	301395	仁信新材	3,377	90,098.36	0.03
72	688603	天承科技	1,286	70,730.00	0.03
73	301202	朗威股份	2,368	61,141.76	0.02

74	301261	恒工精密	1,635	60,331.50	0.02
75	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.01
76	603137	恒尚节能	1,382	26,502.14	0.01
77	688249	晶合集成	1,457	26,313.42	0.01
78	301297	富乐德	1,015	22,847.65	0.01
79	301293	三博脑科	233	16,640.86	0.01
80	301317	鑫磊股份	571	14,943.07	0.01
81	688472	阿特斯	863	14,705.52	0.01
82	301325	曼恩斯特	132	14,249.40	0.01
83	301358	湖南裕能	317	13,596.13	0.01
84	688478	晶升股份	297	12,583.89	0.00
85	688443	智翔金泰	416	12,267.84	0.00
86	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
87	688576	西山科技	92	11,077.72	0.00
88	301310	鑫宏业	167	10,926.81	0.00
89	301360	荣旗科技	114	10,556.40	0.00
90	301408	华人健康	582	9,864.90	0.00
91	301291	明阳电气	310	9,619.30	0.00
92	301387	光大同创	209	9,480.24	0.00
93	688352	颀中科技	780	9,414.60	0.00
94	301383	天键股份	261	9,322.92	0.00
95	688146	中船特气	243	9,265.59	0.00
96	688543	国科军工	174	9,230.70	0.00
97	688334	西高院	551	8,931.71	0.00
98	301262	海看股份	346	8,823.00	0.00
99	688458	美芯晟	97	8,803.72	0.00
100	301399	英特科技	169	8,715.33	0.00
101	301225	恒勃股份	262	8,714.12	0.00
102	001287	中电港	412	8,660.24	0.00
103	301429	森泰股份	411	8,639.22	0.00
104	688523	航天环宇	353	8,419.05	0.00
105	688552	航天南湖	335	7,872.50	0.00
106	688484	南芯科技	211	7,745.81	0.00
107	688581	安杰思	64	7,553.92	0.00
108	301210	金杨股份	150	7,375.50	0.00
109	688433	华曙高科	230	7,245.00	0.00
110	301376	致欧科技	315	7,090.65	0.00
111	301332	德尔玛	516	7,084.68	0.00
112	300804	广康生化	206	6,791.82	0.00
113	688512	慧智微	354	6,782.64	0.00
114	301305	朗坤环境	343	6,753.67	0.00
115	301232	飞沃科技	115	6,718.30	0.00
116	688570	天玛智控	262	6,636.46	0.00

117	688429	时创能源	259	6,612.27	0.00
118	301386	未来电器	272	6,470.88	0.00
119	301203	国泰环保	187	6,432.80	0.00
120	688631	莱斯信息	215	6,422.05	0.00
121	688535	华海诚科	124	6,352.52	0.00
122	601061	中信金属	813	6,162.54	0.00
123	301439	泓淋电力	348	5,881.20	0.00
124	301281	科源制药	233	5,848.30	0.00
125	301170	锡南科技	163	5,693.59	0.00
126	688623	双元科技	64	5,554.56	0.00
127	688479	友车科技	188	5,544.12	0.00
128	603135	中重科技	274	4,901.86	0.00
129	301337	亚华电子	151	4,585.87	0.00
130	301345	涛涛车业	93	4,337.52	0.00
131	601133	柏诚股份	279	3,420.54	0.00
132	601065	江盐集团	272	3,220.48	0.00
133	001282	三联锻造	84	2,774.52	0.00
134	001328	登康口腔	99	2,523.51	0.00
135	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
136	001367	海森药业	53	2,092.44	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	603444	吉比特	4,885,483.00	1.76
2	600718	东软集团	4,796,889.77	1.72
3	000932	华菱钢铁	4,716,961.00	1.70
4	600704	物产中大	4,540,558.00	1.63
5	600373	中文传媒	4,534,953.50	1.63
6	600258	首旅酒店	4,439,559.00	1.60
7	300136	信维通信	4,377,477.00	1.57
8	600728	佳都科技	4,375,889.00	1.57
9	600096	云天化	4,369,462.00	1.57
10	002396	星网锐捷	4,304,308.00	1.55
11	600170	上海建工	4,246,771.72	1.53
12	600582	天地科技	4,209,866.00	1.51
13	002497	雅化集团	4,202,174.36	1.51
14	600580	卧龙电驱	4,168,999.00	1.50
15	002152	广电运通	4,149,934.00	1.49
16	300390	天华新能	4,143,410.48	1.49
17	600499	科达制造	3,948,825.00	1.42
18	600038	中直股份	3,922,941.00	1.41

19	000009	中国宝安	3,904,957.00	1.40
20	000726	鲁泰 A	3,895,110.00	1.40

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	300308	中际旭创	5,972,179.00	2.15
2	600967	内蒙一机	5,844,799.00	2.10
3	002624	完美世界	5,621,243.40	2.02
4	600718	东软集团	5,467,870.00	1.97
5	600438	通威股份	5,458,207.00	1.96
6	300136	信维通信	5,369,311.08	1.93
7	603444	吉比特	5,142,737.00	1.85
8	600373	中文传媒	4,899,946.00	1.76
9	600008	首创环保	4,886,192.00	1.76
10	600131	国网信通	4,876,452.82	1.75
11	300017	网宿科技	4,553,191.45	1.64
12	000932	华菱钢铁	4,517,499.00	1.62
13	601555	东吴证券	4,480,568.50	1.61
14	601598	中国外运	4,466,552.87	1.61
15	002152	广电运通	4,462,835.19	1.60
16	600728	佳都科技	4,399,417.00	1.58
17	600901	江苏金租	4,392,282.96	1.58
18	002396	星网锐捷	4,374,672.00	1.57
19	603345	安井食品	4,341,200.00	1.56
20	600820	隧道股份	4,334,466.00	1.56

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	623,119,606.09
卖出股票收入（成交）总额	638,563,861.14

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	9,263,608.03	3.48
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	9,263,608.03	3.48

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	019679	22 国债 14	91,000	9,263,608.03	3.48

注：以上为本基金本报告期末持有的全部债券投资。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

在报告期内，本基金未投资于国债期货。该策略符合基金合同的规定。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本报告期本基金没有投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，上海建工集团股份有限公司于 2023 年 5 月 30 日曾受到平湖市综合执法局公开处罚，于 2023 年 4 月 28 日曾受到济宁市住房和城乡建设局公开处罚，于 2023 年 4 月 27 日曾受到三亚市综合行政执法局海棠分局公开处罚，于 2023 年 4 月 24 日、2022 年 7 月 8 日曾受到嘉兴市人社局公开处罚，于 2022 年 7 月 14 日、2022 年 12 月 6 日、2023 年 4 月 18 日曾受到上海市民防监督管理事务中心公开处罚，于 2023 年 1 月 12 日曾受到南昌市自然资源和规划局公开处罚，于 2022 年 10 月 25 日曾受到上海市住房和城乡建设管理委员会公开处罚，于 2022 年 11 月 7 日曾受到南京市浦口区城乡建设局公开处罚，于 2022 年 10 月 12 日曾受到浙江省嘉兴市综合行政执法局公开处罚。

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	38,309.44
2	应收清算款	148,789.40
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	207,535.39
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	394,634.23

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

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

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 (%)
30,890	6,584.39	23,624,117.21	11.62	179,767,668.72	88.38

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	黄华生	232,400.00	5.09
2	夏天江	152,408.00	3.34
3	于兆瑞	138,696.00	3.04
4	傅新彩	126,271.00	2.77
5	杨佳慧	104,833.00	2.30
6	王香云	101,600.00	2.23
7	马超	92,695.00	2.03
8	胡晓颖	76,231.00	1.67
9	马春杰	74,515.00	1.63
10	林琛	72,346.00	1.58

注：持有人为本基金场内持有人。

8.3 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	29,161.18	0.0143

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2019 年 11 月 6 日) 基金份额总额	283,184,730.54
本报告期期初基金份额总额	214,780,518.45
本报告期基金总申购份额	20,729,097.55
减：本报告期基金总赎回份额	32,117,830.07

本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	203,391,785.93

§ 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未受到任何稽查或处罚。

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 (%)	
财通证券	1	179,063,530.80	14.27	166,764.52	14.27	-
浙商证券	1	171,776,303.51	13.68	159,975.72	13.68	-
华西证券	1	139,324,353.64	11.10	129,755.60	11.10	-

开源证券	1	108,449,741.34	8.64	101,002.88	8.64	-
华安证券	1	104,352,660.89	8.31	97,184.57	8.31	-
太平洋	2	91,799,446.83	7.31	85,491.81	7.31	-
长江证券	1	78,962,708.44	6.29	73,539.77	6.29	-
西南证券	2	77,585,973.96	6.18	72,257.24	6.18	-
中信建投	3	72,557,800.72	5.78	67,572.42	5.78	-
招商证券	1	65,225,961.48	5.20	60,742.93	5.20	-
广发证券	1	36,457,360.30	2.90	33,953.62	2.90	-
安信证券	1	36,166,253.41	2.88	33,682.33	2.88	-
中金公司	1	33,384,569.36	2.66	31,090.04	2.66	-
东方证券	3	27,567,407.88	2.20	25,672.99	2.20	-
国信证券	1	25,227,095.89	2.01	23,494.18	2.01	-
国泰君安	1	5,042,775.88	0.40	4,696.52	0.40	-
国联证券	1	1,328,923.00	0.11	1,237.58	0.11	-
中信证券	3	725,348.37	0.06	675.59	0.06	-
天风证券	1	126,141.55	0.01	117.49	0.01	-
华泰证券	2	94,466.30	0.01	87.97	0.01	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
财信证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方财富	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东亚前海	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-

江海证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
新时代证 券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-

注：(一)本基金本报告期撤销平安证券，新增民生证券交易单元。

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

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
财通证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	1,324,000.00	2.24	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
太平洋	-	-	2,762,000.00	4.68	-	-
长江证券	-	-	12,955,000.00	21.96	-	-
西南证	-	-	-	-	-	-

券						
中信建投	-	-	11,943,000.00	20.25	-	-
招商证券	-	-	6,838,000.00	11.59	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	6,768,000.00	11.47	-	-
东方证券	-	-	16,400,000.00	27.80	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
财信证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东亚前海	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证	-	-	-	-	-	-

券						
国海证 券	-	-	-	-	-	-
国金证 券	-	-	-	-	-	-
国盛证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
江海证 券	-	-	-	-	-	-
民生证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-
西部证 券	-	-	-	-	-	-
湘财证 券	-	-	-	-	-	-
新时代 证券	-	-	-	-	-	-
信达证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-
中山证 券	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
中银国 际	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《宏利中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金经理变更公告》	《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站及公司网站	2023 年 06 月 30 日

§ 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》，本基金的名称改为宏利中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF)。

§ 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

基金管理人和托管人住所。

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