

# 宏利消费服务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

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
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	13
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	13
<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>14</b>
6.1 资产负债表	14
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>46</b>
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
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	48
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	60
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	60

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 .....	60
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 .....	60
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 .....	60
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	60
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	61
7.12 投资组合报告附注 .....	61
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>62</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	62
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	62
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>62</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>63</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	63
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 .....	63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	63
10.4 基金投资策略的改变 .....	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	63
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 .....	63
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	63
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>68</b>
11.1 影响投资者决策的其他重要信息 .....	68
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>68</b>
12.1 备查文件目录 .....	68
12.2 存放地点 .....	68
12.3 查阅方式 .....	68

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	宏利消费服务混合型证券投资基金	
基金简称	宏利消费服务混合	
基金主代码	011431	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 3 月 16 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	809,469,085.88 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	宏利消费服务混合 A	宏利消费服务混合 C
下属分级基金的交易代码	011431	011432
报告期末下属分级基金的份额总额	420,086,731.68 份	389,382,354.20 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点关注消费服务类优质企业的投资机会,在严格控制风险、保持良好流动性的前提下,追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金重点投资于消费及服务行业的上市公司,长期投资于稳健发展的龙头企业,争取实现基金资产的长期稳健增值。
业绩比较基准	申银万国消费品指数收益率×50%+恒生消费品制造及服务业指数收益率(使用估值汇率折算)×20%+中债综合指数收益率×30%。
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期风险及预期收益水平高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金。本基金将投资港股通标的股票,需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	宏利基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	徐娇
	联系电话	66577766
	电子邮箱	irm@manulifefund.com.cn
客户服务电话	400-698-8888	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	<a href="https://www.manulifefund.com.cn">https://www.manulifefund.com.cn</a>
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	宏利基金管理有限公司	北京市朝阳区针织路 23 号楼中国人寿金融中心 6 层 02-07 单元

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023年1月1日-2023年6月30日)	
	宏利消费服务混合 A	宏利消费服务混合 C
本期已实现收益	-16,984,524.50	-20,369,123.51
本期利润	-10,694,939.71	-34,633,353.17
加权平均基金份额本期利润	-0.0296	-0.0785
本期加权平均净值利润率	-3.72%	-9.93%
本期基金份额净值增长率	-0.59%	-0.89%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)	
	宏利消费服务混合 A	宏利消费服务混合 C
期末可供分配利润	-100,596,619.96	-97,265,287.43
期末可供分配基金份额利润	-0.2395	-0.2498
期末基金资产净值	319,490,111.72	292,117,066.77
期末基金份额净值	0.7605	0.7502
3.1.3 累计期末	报告期末(2023年6月30日)	

指标		
基金份额累计净值增长率	-23.95%	-24.98%

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

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

宏利消费服务混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.22%	0.96%	1.70%	0.71%	-0.48%	0.25%
过去三个月	-7.04%	0.79%	-5.03%	0.59%	-2.01%	0.20%
过去六个月	-0.59%	0.83%	-3.25%	0.64%	2.66%	0.19%
过去一年	-7.81%	0.95%	-8.65%	0.80%	0.84%	0.15%
自基金合同生效起至今	-23.95%	1.24%	-13.90%	0.90%	-10.05%	0.34%

宏利消费服务混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.17%	0.97%	1.70%	0.71%	-0.53%	0.26%
过去三个月	-7.18%	0.79%	-5.03%	0.59%	-2.15%	0.20%
过去六个月	-0.89%	0.83%	-3.25%	0.64%	2.36%	0.19%
过去一年	-8.36%	0.95%	-8.65%	0.80%	0.29%	0.15%
自基金合同生效起至今	-24.98%	1.24%	-13.90%	0.90%	-11.08%	0.34%

注：本基金的业绩比较基准：申银万国消费品指数收益率×50%+恒生消费品制造及服务指数收益率（使用估值汇率折算）×20%+中债综合指数收益率×30%。

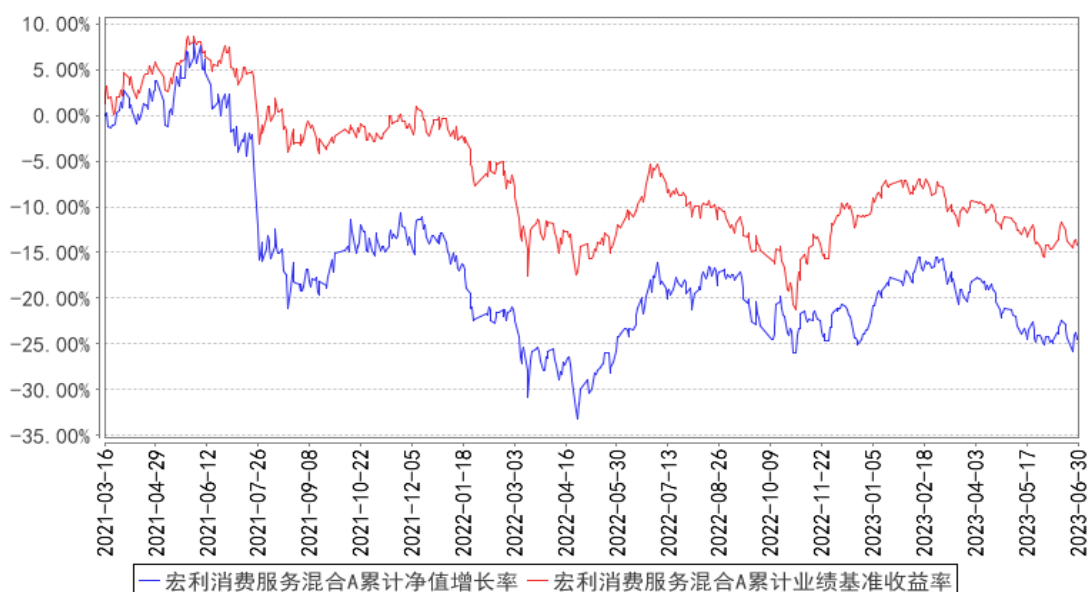
申银万国消费品指数是申银万国股价系列指数旗下一只主题指数，基于申万行业分类标准编制，用以表征消费品上市公司整体股价表现。申银万国消费品指数编制合理、透明，市场覆盖率较广，不易被操纵，标的股票与本基金投资策略、投资风格比较匹配，适合作为本基金 A 股股票投资的业绩比较基准。

恒生消费品制造及服务业指数是由恒生指数服务有限公司编制，该指数以恒生综合指数成分股为样本空间，从中选取消费品制造业和消费品服务业的股票作为样本股。恒生消费品制造及服务业指数编制合理、透明，市场覆盖率较广，不易被操纵，标的股票与本基金投资策略、投资风格比较匹配，适合作为本基金港股通标的股票投资的业绩比较基准。

中债综合指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制，样本债券涵盖的范围更加全面，具有广泛的市场代表性，涵盖主要交易市场（银行间市场、交易所市场等）、不同发行主体（政府、企业等）和期限（长期、中期、短期等），能够很好地反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势，适合作为本基金债券投资的业绩比较基准。

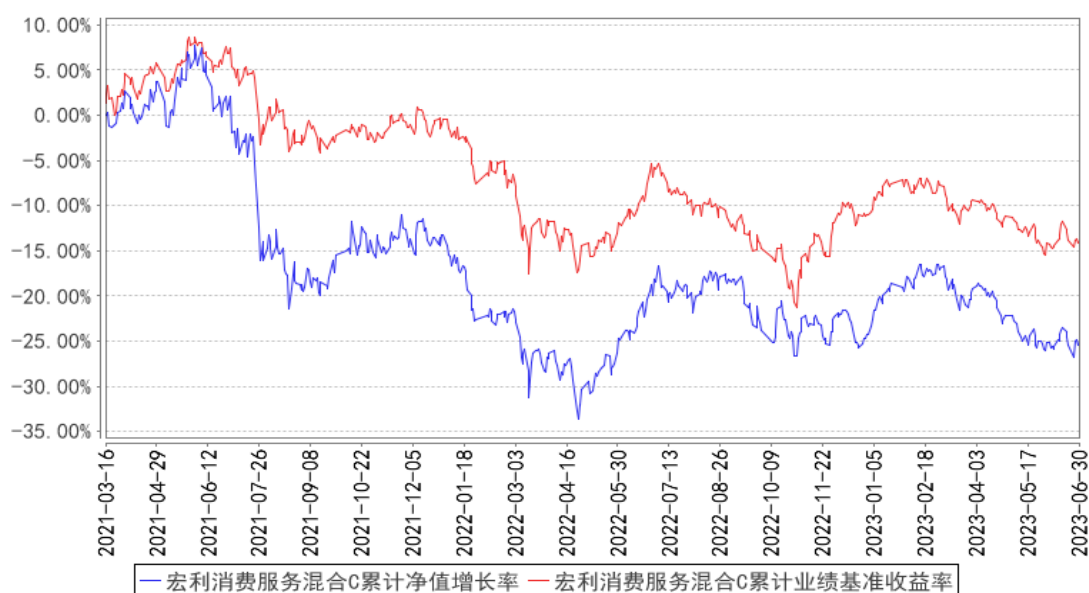
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

宏利消费服务混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图





宏利消费服务混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

截至报告期末本公司股东及持股比例分别为：宏利投资管理（新加坡）私人有限公司：51%；宏利投资管理（香港）有限公司：49%。

宏利基金管理有限公司原名湘财合丰基金管理有限公司、湘财荷银基金管理有限公司、泰达荷银基金管理有限公司、泰达宏利基金管理有限公司，成立于 2002 年 6 月。截至目前，公司管理着包括宏利价值优化型系列基金、宏利行业精选混合型证券投资基金、宏利风险预算混合型证券投资基金、宏利货币市场基金、宏利效率优选混合型证券投资基金（LOF）、宏利首选企业股票型证券投资基金、宏利市值优选混合型证券投资基金、宏利集利债券型证券投资基金、宏利品质生活灵活配置混合型证券投资基金、宏利红利先锋混合型证券投资基金、宏利沪深 300 指数增强型证券投资基金、宏利领先中小盘混合型证券投资基金、宏利聚利债券型证券投资基金（LOF）、宏利中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）、宏利逆向策略混合型证券投资基金、宏利宏达混合型证券投资基金、宏利淘利债券型证券投资基金、宏利转型机遇股票型证券投资基金、宏利改革动力量化策略灵活配置混合型证券投资基金、宏利复兴伟业灵活配置混合型证券投资基金、宏利新起点灵活配置混合型证券投资基金、宏利蓝筹价值混合型证券投资基金、宏利创益灵活配置混合型证券投资基金、宏利活期友货币市场基金、宏利汇利债券型证券投资基金、宏利睿智稳健灵活配置混合型证券投资基金、宏利京元宝货币市场基金、宏利纯利债券型证券投资基金、宏利溢

利债券型证券投资基金、宏利恒利债券型证券投资基金、宏利全能优选混合型基金中基金（FOF）、宏利交利 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、宏利金利 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、宏利绩优增长灵活配置混合型证券投资基金、宏利泽利 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、宏利泰和平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、宏利印度机会股票型证券投资基金（QDII）、宏利永利债券型证券投资基金、宏利消费行业量化精选混合型证券投资基金、宏利中证主要消费红利指数型证券投资基金、宏利泰和稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、宏利价值长青混合型证券投资基金、宏利乐盈 66 个月定期开放债券型证券投资基金、宏利高研发创新 6 个月持有期混合型证券投资基金、宏利波控回报 12 个月持有期混合型证券投资基金、宏利消费服务混合型证券投资基金、宏利新能源股票型证券投资基金、宏利中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金、宏利悠然养老目标日期 2025 一年持有期混合型基金中基金（FOF）、宏利新兴景气龙头混合型证券投资基金、宏利景气领航两年持有期混合型证券投资基金、宏利中短债债券型证券投资基金、宏利先进制造股票型证券投资基金、宏利景气智选 18 个月持有期混合型证券投资基金、宏利昇利一年定期开放债券型发起式证券投资基金、宏利闽利一年定期开放债券型发起式证券投资基金、宏利悠享养老目标日期 2030 一年持有期混合型基金中基金（FOF）、宏利添盈两年定期开放债券型证券投资基金在内的六十只证券投资基金。

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

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
周少博	研究部总经理助理兼基金经理	2021 年 12 月 29 日	-	8 年	毕业于北京大学，世界经济硕士研究生。2015 年 7 月至今任职于宏利基金管理有限公司，曾任研究部助理研究员、研究员、高级研究员、研究部总经理助理，现任研究部总经理助理兼基金经理。具备 8 年基金从业经验，具有基金从业资格。
吴华	资深基金经理	2021 年 3 月 16 日	2023 年 3 月 13 日	19 年	北京大学金融学硕士；2004 年 6 月至 2006 年 3 月就职于易方达基金管理有限公司，担任宏观策略分析师；2006 年 4 月至 2011 年 4 月就职于中国国际金融有限公司，先后就职于研究部、资产管理部，担任经理、副总经理等职位；2011 年 5 月加入宏利基金管理有限公司，现任资深基金经理；具备 19 年证券从业经验，19 年证券投资管理经验，具有基金从业资格。

刘欣	总经理助理兼本基金基金经理助理	2021 年 12 月 28 日	2023 年 01 月 13 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。
----	-----------------	------------------	------------------	------	--

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人建立了公平交易制度和流程，并严格执行制度的规定。在投资管理活动中，本基金管理人公平对待不同投资组合，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和投资决策方面享有平等机会；严格执行投资管理职能和交易执行职能的隔离；在交易环节实行集中交易制度，并确保公平交易可操作、可评估、可稽核、可持续；交易部运用交易系统中设置的公平交易功能并按照时间优先、价格优先的原则严格执行所有指令；对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，交易部按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配，确保各投资组合享有公平的投资机会。风险管理部事后对本报告期的公平交易执行情况进行数量统计、分析。在本报告期内，未发现利益输送、不公平对待不同投资组合的情况。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金管理人建立了异常交易的监控与报告制度，对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控，风险管理部定期对各投资组合的交易行为进行分析评估，向公司风险控制委员会提交公募基金和特定客户资产组合的交易行为分析报告。本报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合的同日反向交易成交较少的单边交易量均不超过该证券当日成交量的 5%。在本报告期内也未发生因异常交易而受到监管机构的处罚情况。

## 4.4 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

整体消费环境来看，2023 年上半年，我国社会零售总额 22.7 万亿元，同比增长 8.2%，近两年复合增速 3.6%，整体消费体现出了较强的韧性。近两年复合增速的月度趋势来看，2023 年上半年呈现出了前高后低的趋势，细分来看，金银珠宝和化妆品等细分行业增速领先整体消费大盘。进入 2023 年下半年，随着国民经济的恢复，整体消费环境也将进入复苏周期，消费行业上市公司的基本面迎来改善。

本基金一直坚守契约合同约定操作，投资消费服务细分行业里的优质公司。仓位水平上，本基金持续保持合理的仓位水平，不做过多的仓位调整。行业配置上，仍然看好我国消费服务相关行业和公司的确定性机会，但子行业集中度上保持相对均衡，能够在获得相对确定性收益的同时避免宏观或者政策层面不确定性对组合造成的冲击。个股配置上，尽量回避估值较高的个股，在业绩增速和估值中尽量做到平衡。

本基金持有消费服务相关优质公司，同时努力寻找在市场波动中错误定价的机会，并且在消费类资产中寻找阶段性成长类机会，努力在获得超额收益的同时控制组合的整体回撤。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末宏利消费服务混合 A 的基金份额净值为 0.7605 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.59%，截至本报告期末宏利消费服务混合 C 的基金份额净值为 0.7502 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.89%，同期业绩比较基准收益率为-3.25%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从宏观经济来看，随着稳增长措施的逐步落地，展望 2023 年下半年整体宏观经济有望稳中有升，居民收入水平持续提高，相应的消费的需求也将得到有利支撑。行业层面，随着国货崛起、消费升级和品牌集中度提升，我国消费细分行业龙头有望持续受益。最后，整体消费行业相关公司的估值分位水平仍处于过去三年的中枢和中枢偏下水平，不管是从绝对估值还是相对估值来看，当前消费行业相关公司具有不错的估值性价比。因此，整体来看，消费服务类资产在当前时间点看未来 1-2 年，具有较好的投资机会。

## 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。报告期内相关基金估值政策由托管银行进行复核。公司估值委员会主任由主管基金运营的副总经理担任，成员包括但不限于督察长、主管投研的副总经理或投资总监、权益投资部、研究部、策略投

资部、固定收益部、合规风控部门、基金运营部的主要负责人；委员会秘书由基金运营部负责人担任。所有人员均具有丰富的专业工作经历，具备良好的专业经验和专业胜任能力。

基金经理参与估值委员会对相关停牌品种估值的讨论，发表相关意见和建议，但涉及停牌品种的基金经理不参与最终的投票表决。

本报告期内，本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同及基金的实际运作情况，本基金于本报告期内未进行收益分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内本基金未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对宏利消费服务混合型证券投资基金（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：宏利消费服务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	60,670,214.31	41,335,692.86
结算备付金		2,191,685.46	1,539,998.24
存出保证金		347,855.68	108,028.36
交易性金融资产	6.4.7.2	551,089,355.17	295,971,776.13
其中：股票投资		551,089,355.17	295,971,776.13
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		2,600,788.11	1,504,315.49
应收股利		6,214.05	33,718.11
应收申购款		1,472,867.25	2,606.61
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		618,378,980.03	340,496,135.80
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		3,061,819.99	5.27
应付赎回款		447,367.98	3,813.21

应付管理人报酬		738,507.61	416,345.56
应付托管费		123,084.61	69,390.94
应付销售服务费		137,590.53	69,203.86
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	2,263,430.82	951,014.94
负债合计		6,771,801.54	1,509,773.78
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	809,469,085.88	445,064,013.29
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-197,861,907.39	-106,077,651.27
净资产合计		611,607,178.49	338,986,362.02
负债和净资产总计		618,378,980.03	340,496,135.80

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 809,469,085.88 份，其中宏利消费服务混合 A 基金份额总额 420,086,731.68 份，基金份额净值 0.7605 元；宏利消费服务混合 C 基金份额总额 389,382,354.20 份，基金份额净值 0.7502 元。

## 6.2 利润表

会计主体：宏利消费服务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>		-38,741,573.57	-9,881,490.95
1. 利息收入		156,711.10	62,711.94
其中：存款利息收入	6.4.7.13	156,711.10	61,068.76
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		-	1,643.18
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-31,058,688.62	-8,295,133.70
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-37,507,296.62	-9,819,364.55
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	63,531.47
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	6,448,608.00	1,460,699.38
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	-7,974,644.87	-1,656,476.97
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	135,048.82	7,407.78
<b>减：二、营业总支出</b>		6,586,719.31	1,601,672.84
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	4,668,230.53	1,244,992.68
2. 托管费	6.4.10.2.2	778,038.44	207,498.84
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,016,877.53	46,423.18
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	0.04
8. 其他费用	6.4.7.23	123,572.81	102,758.10
<b>三、利润总额（亏损总额     以“-”号填列）</b>		-45,328,292.88	-11,483,163.79
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”     号填列）</b>		-45,328,292.88	-11,483,163.79
<b>五、其他综合收益的税后     净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-45,328,292.88	-11,483,163.79

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：宏利消费服务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）	445,064,013.29	-	-106,077,651.2	338,986,362.02



			7	
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）	445,064,013.29	-	-106,077,651.27	338,986,362.02
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	364,405,072.59	-	-91,784,256.12	272,620,816.47
（一）、综合收益总额	-	-	-45,328,292.88	-45,328,292.88
（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）	364,405,072.59	-	-46,455,963.24	317,949,109.35
其中：1. 基金申购款	820,699,662.14	-	-148,996,704.97	671,702,957.17
2. 基金赎回款	-456,294,589.55	-	102,540,741.73	-353,753,847.82
（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）	809,469,085.88	-	-197,861,907.39	611,607,178.49
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）	225,582,408.31	-	-29,006,778.53	196,575,629.78
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)	225,582,408.31	-	-29,006,778.53	196,575,629.78
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-12,994,769.73	-	-8,329,920.64	-21,324,690.37
(一)、综合收益总额	-	-	-11,483,163.79	-11,483,163.79
(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)	-12,994,769.73	-	3,153,243.15	-9,841,526.58
其中：1. 基金申购款	5,876,619.22	-	-1,388,470.37	4,488,148.85
2. 基金赎回款	-18,871,388.95	-	4,541,713.52	-14,329,675.43
(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)	212,587,638.58	-	-37,336,699.17	175,250,939.41

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

宏利消费服务混合型证券投资基金(原名为泰达宏利消费服务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]2822号《关

于准予泰达宏利消费服务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《泰达宏利消费服务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 403,101,301.12 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 0314 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泰达宏利消费服务混合型证券投资基金基金合同》于 2021 年 3 月 16 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 403,344,934.03 份基金份额，其中认购资金利息折合 243,632.91 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 日起更名为宏利消费服务混合型证券投资基金。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《宏利消费服务混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)，港股通标的股票、债券(包括国债、地方政府债、政府支持债券、政府支持机构债券、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券(含分离交易可转债的纯债部分)、可交换债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据)、债券回购、资产支持证券、货币市场工具、银行存款(包括定期存款、协议存款、通知存款等)、同业存单、股指期货、国债期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 60%-95%，其中，投资于消费服务相关的股票的比例不低于非现金基金资产的 80%，投资于港股通标的股票比例占股票投资比例的 0%-50%；每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；股指期货、国债期货、股票期权的投资比例遵循国家相关法律法规。本基金的业绩比较基准为申银万国

消费品指数收益率×50%+恒生消费品制造及服务业指数收益率(使用估值汇率折算)×20%+中债综合指数收益率×30%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(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》、《宏利消费服务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) 对基金通过深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过深港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

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

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

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
活期存款	60,670,214.31

等于：本金	60,665,513.28
加：应计利息	4,701.03
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	60,670,214.31

#### 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	566,297,516.06	-	551,089,355.17	-15,208,160.89
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	566,297,516.06	-	551,089,355.17	-15,208,160.89

#### 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买断式逆回购交易中取得的债券。

**6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明**

无。

**6.4.7.5 债权投资****6.4.7.5.1 债权投资情况**

本基金本报告期末未持有债权投资。

**6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况**

本基金本报告期末未计提债权投资减值准备。

**6.4.7.6 其他债权投资****6.4.7.6.1 其他债权投资情况**

本基金本报告期末未持有其他债权投资。

**6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况**

本基金本报告期末未计提其他债权投资减值准备。

**6.4.7.7 其他权益工具投资****6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况**

本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

**6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况**

本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

**6.4.7.8 其他资产**

本基金本报告期末未持有其他资产。

**6.4.7.9 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	2,169,670.67

其中：交易所市场	2,169,670.67
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	93,760.15
合计	2,263,430.82

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

##### 宏利消费服务混合 A

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	262,032,844.94	262,032,844.94
本期申购	171,020,466.23	171,020,466.23
本期赎回（以“-”号填列）	-12,966,579.49	-12,966,579.49
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	420,086,731.68	420,086,731.68

##### 宏利消费服务混合 C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	183,031,168.35	183,031,168.35
本期申购	649,679,195.91	649,679,195.91
本期赎回（以“-”号填列）	-443,328,010.06	-443,328,010.06
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	389,382,354.20	389,382,354.20

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期末未有其他综合收益。

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

##### 宏利消费服务混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-51,044,582.59	-10,532,102.87	-61,576,685.46
本期利润	-16,984,524.50	6,289,584.79	-10,694,939.71
本期基金份额交易产生	-27,232,397.15	-1,092,597.64	-28,324,994.79



的变动数			
其中：基金申购款	-29,802,482.53	-1,205,167.86	-31,007,650.39
基金赎回款	2,570,085.38	112,570.22	2,682,655.60
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-95,261,504.24	-5,335,115.72	-100,596,619.96

## 宏利消费服务混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-37,114,520.77	-7,386,445.04	-44,500,965.81
本期利润	-20,369,123.51	-14,264,229.66	-34,633,353.17
本期基金份额交易产生的变动数	-34,661,261.06	16,530,292.61	-18,130,968.45
其中：基金申购款	-119,719,934.26	1,730,879.68	-117,989,054.58
基金赎回款	85,058,673.20	14,799,412.93	99,858,086.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-92,144,905.34	-5,120,382.09	-97,265,287.43

## 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	108,562.66
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	33,994.98
其他	14,153.46
合计	156,711.10

## 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	-37,507,296.62
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	-37,507,296.62

## 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	1,805,766,331.98

减：卖出股票成本总额	1,837,286,673.31
减：交易费用	5,986,955.29
买卖股票差价收入	-37,507,296.62

#### 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

本基金本报告期内未有债券投资收益。

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期末有债券投资收益-买卖债券差价收入。

##### 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

本基金本报告期内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

本基金本报告期内未有资产支持证券投资收益-买卖差价收入。

##### 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内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

本基金本报告期内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

本基金本报告期内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

本基金本报告期内未有贵金属投资收益-买卖差价收入。

##### 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**

本基金本报告期内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**

本基金本报告期内未有衍生工具收益-买卖权证差价收入。

**6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本基金本报告期内未有衍生工具收益-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	6,448,608.00
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	6,448,608.00

**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	-7,974,644.87
股票投资	-7,974,644.87
债券投资	-
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	-7,974,644.87

**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	134,744.19
基金转换费收入	304.63
合计	135,048.82

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期内未有信用减值损失。

#### 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	22,943.37
账户维护费	9,000.00
其他	2,369.29
合计	123,572.81

#### 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、注册登记机构、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	4,668,230.53	1,244,992.68
其中：支付销售机构的客户维护费	889,113.13	565,606.51

注：支付基金管理人宏利基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.50% / 当年天数。上述相关费用包含实际支付金额和税金。

#### 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	778,038.44	207,498.84

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 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.25% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	宏利消费服务混合 A	宏利消费服务混合 C	合计
宏利基金管理有限公司	-	672,522.93	672,522.93
中国银行股份有限公司	-	9,963.44	9,963.44
合计	-	682,486.37	682,486.37
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	宏利消费服务混合 A	宏利消费服务混合 C	合计
宏利基金管理有限公司	-	340.41	340.41
中国银行股份有限公司	-	9,461.42	9,461.42
合计	-	9,801.83	9,801.83

注：支付基金销售机构的销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值 0.4% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给宏利基金管理有限公司，再由宏利基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日 C 类基金份额销售服务费 = 前一日 C 类基金份额基金资产净值 × 0.4% / 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自有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本基金本报告期内及上年度可比期间未运用自有资金投资本基金。

**6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

**6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	60,670,214.31	108,562.66	24,095,913.04	56,003.91

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**

本基金本报告期内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**

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

**6.4.11 利润分配情况**

本基金本报告期内未进行利润分配。

**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
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	海科新源	2023年6月29日	1个月内（含）	新股未上市	19.99	19.99	5,241	104,767.59	104,767.59	-
301292	海科	2023年6月	1-6个月（含）	新股流通	19.99	19.99	583	11,654.17	11,654.17	-

	新源	月 29 日		受限							
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	55	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	55	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	36.9	36.9	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	36.9	36.9	198	7,306.20	7,306.20	-	
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	4,233	84,067.38	76,447.98	-	
301325	曼恩斯特	2023 年 5 月 4 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	76.8	107.95	364	27,955.20	39,293.80	-	
001286	陕西能源	2023 年 3 月 31 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	9.6	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-	
688472	阿特斯	2023 年 6 月 2 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	11.1	17.04	2,004	22,244.40	34,148.16	-	
688531	日联	2023 年 3 月	1-6 个月(含)	新股流通	152.38	135.97	237	36,114.06	32,224.89	-	



	科技	月 24 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	954	36,137.52	28,133.46	-	
688352	颀中科技	2023 年 4 月 11 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	12.1	12.07	2,287	27,672.70	27,604.09	-	
688576	西山科技	2023 年 5 月 30 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	135.8	120.41	223	30,283.40	26,851.43	-	
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	704	25,449.60	26,843.52	-	
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	628	16,792.72	25,547.04	-	
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	390	26,239.20	25,517.70	-	
301293	三博脑科	2023 年 4 月 25 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	29.6	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-	
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	641	25,633.59	23,531.11	-	
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	126	30,940.56	15,385.86	-	
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	60	0.00	7,326.60	转增股	
001287	中电	2023 年 3 月	1-6 个月(含)	新股流通	11.88	21.02	1,077	12,794.76	22,638.54	-	

	港	月 30 日		受限							
688552	航天南湖	2023 年 5 月 8 日	1-6 个 月(含)	新股 流通 受限	21.17	23.5	946	20,026.82	22,231.00	-	
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	708	26,996.04	21,969.24	-	
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	400	17,468.00	21,220.00	-	
688458	美芯晟	2023 年 5 月 15 日	1-6 个 月(含)	新股 流通 受限	75	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	125.8	118.03	163	20,505.40	19,238.89	-	
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	694	14,344.98	18,161.98	-	
301262	海看股份	2023 年 6 月 13 日	1-6 个 月(含)	新股 流通 受限	30.22	25.5	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	-	
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	393	9,341.61	16,855.77	-	
601061	中信	2023 年 3	1-6 个 月(含)	新股 流通	6.58	7.58	2,130	14,015.40	16,145.40	-	

	金属	月 30 日		受限							
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	611	18,488.86	15,476.63	-	
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	-	
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	-	
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	888	12,574.08	14,394.48	-	
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	-	
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	798	12,959.52	13,526.10	-	
688433	华曙高科	2023 年 4 月 7 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	26.66	31.5	418	11,143.88	13,167.00	-	
688623	双元	2023 年 5 月	1-6 个月(含)	新股流通	125.88	86.79	150	18,882.00	13,018.50	-	

	科技	月 31 日		受限							
301360	荣旗科技	2023 年 4 月 17 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	71.88	92.6	134	9,631.92	12,408.40	-	
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	17.8	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	森泰股份	2023 年 4 月 10 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	28.75	21.02	499	14,346.25	10,488.98	-	
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	72.5	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	-	
601065	江盐	2023 年 3 月	1-6 个月(含)	新股流通	10.36	11.84	786	8,142.96	9,306.24	-	

	集团	月 31 日		受限							
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	19.2	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	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	25.1	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	25.1	96	0.00	2,409.60	转增股	
688535	华海诚科	2023 年 3 月 28 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	35	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-	
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	-	
301439	泓淋电力	2023 年 3 月 10 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	19.99	16.9	475	9,495.25	8,027.50	-	
301203	国泰环保	2023 年 3 月 28 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	46.13	34.4	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	2023 年 5 月	1-6 个月(含)	新股流通	32.6	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-	

	电子	月 16 日		受限							
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	126	9,254.70	5,876.64	-	
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	15.9	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	19.6	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

本基金为混合型证券投资基金，预期收益及风险水平低于股票型基金，高于货币市场基金与债券型基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、货币市场工具、股指期货、资产支持证券等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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。本基金的活期银行

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。

于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券投资、资产支持证券投资 and 同业存单投资（2022 年 12 月 31 日：本基金未持有债券投资、资产支持证券投资 and 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》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股票不得超过该上



上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

## 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	60,670,214.31	-	-	-	60,670,214.31
结算备付金	2,191,685.46	-	-	-	2,191,685.46
存出保证金	347,855.68	-	-	-	347,855.68
交易性金融资产	-	-	-	551,089,355.17	551,089,355.17
应收股利	-	-	-	6,214.05	6,214.05
应收申购款	0.01	-	-	1,472,867.24	1,472,867.25
应收清算款	-	-	-	2,600,788.11	2,600,788.11
资产总计	63,209,755.46	-	-	555,169,224.57	618,378,980.03
负债					
应付赎回款	-	-	-	447,367.98	447,367.98
应付管理人报酬	-	-	-	738,507.61	738,507.61
应付托管费	-	-	-	123,084.61	123,084.61
应付清算款	-	-	-	3,061,819.99	3,061,819.99
应付销售服务费	-	-	-	137,590.53	137,590.53
其他负债	-	-	-	2,263,430.82	2,263,430.82
负债总计	-	-	-	6,771,801.54	6,771,801.54
利率敏感度缺口	63,209,755.46	-	-	548,397,423.03	611,607,178.49
上年度末 2022 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	41,335,692.86	-	-	-	41,335,692.86
结算备付金	1,539,998.24	-	-	-	1,539,998.24
存出保证金	108,028.36	-	-	-	108,028.36
交易性金融资产	-	-	-	295,971,776.13	295,971,776.13
应收股利	-	-	-	33,718.11	33,718.11
应收申购款	0.01	-	-	2,606.60	2,606.61
应收清算款	-	-	-	1,504,315.49	1,504,315.49
资产总计	42,983,719.47	-	-	297,512,416.33	340,496,135.80
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,813.21	3,813.21
应付管理人报酬	-	-	-	416,345.56	416,345.56
应付托管费	-	-	-	69,390.94	69,390.94
应付清算款	-	-	-	5.27	5.27
应付销售服务费	-	-	-	69,203.86	69,203.86
其他负债	-	-	-	951,014.94	951,014.94
负债总计	-	-	-	1,509,773.78	1,509,773.78
利率敏感度缺口	42,983,719.47	-	-	296,002,642.55	338,986,362.02

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，本基金未持有交易性债券投资(2022 年 12 月 31 日：本基金未持有交易性债券投资)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2022 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	71,983,822.32	-	71,983,822.32
资产合计	-	71,983,822.32	-	71,983,822.32
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇 风险敞口净额	-	71,983,822.32	-	71,983,822.32
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	24,225,516.77	-	24,225,516.77
资产合计	-	24,225,516.77	-	24,225,516.77
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇 风险敞口净额	-	24,225,516.77	-	24,225,516.77

## 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	所有外币相对人民币升值 5%	3,600,000.00	1,210,000.00
	所有外币相对人民币贬值 5%	-3,600,000.00	-1,210,000.00

## 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产占基金资产的比例为 60%-95%，其中，投资于消费服务相关的股票的比例不低于非现金基金资产的 80%，投资于港股通标的股票比例占股票投资比例的 0-50%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约、股票期权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	551,089,355.17	90.11	295,971,776.13	87.31
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	551,089,355.17	90.11	295,971,776.13	87.31

#### 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%	19,660,000.00	13,630,000.00
	沪深 300 指数下降 5%	-19,660,000.00	-13,630,000.00

#### 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	549,552,874.26	295,330,737.58
第二层次	483,368.94	-
第三层次	1,053,111.97	641,038.55
合计	551,089,355.17	295,971,776.13

#### 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

本基金本报告期内无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

## § 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	551,089,355.17	89.12
	其中：股票	551,089,355.17	89.12
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-

4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	62,861,899.77	10.17
8	其他各项资产	4,427,725.09	0.72
9	合计	618,378,980.03	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	12,380,125.00	2.02
B	采矿业	793,104.00	0.13
C	制造业	343,942,971.32	56.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	52,994.59	0.01
E	建筑业	1,338,639.15	0.22
F	批发和零售业	44,276,378.23	7.24
G	交通运输、仓储和邮政业	41,495,016.57	6.78
H	住宿和餐饮业	3,232,488.00	0.53
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,411,514.33	2.85
J	金融业	294,200.00	0.05
K	房地产业	12,495,654.00	2.04
L	租赁和商务服务业	5,723.31	0.00
M	科学研究和技术服务业	1,081,499.69	0.18
N	水利、环境和公共设施管理业	249,369.60	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	23,782.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	32,072.20	0.01
S	综合	-	-
	合计	479,105,532.85	78.34

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
地产建筑业	-	-
电信服务	-	-
能源	-	-
金融	-	-
公用事业	-	-

消费者非必需品	24,411,049.42	3.99
医疗保健	20,210,110.76	3.30
基础材料	15,321,205.49	2.51
消费者常用品	5,644,256.01	0.92
工业	5,249,888.73	0.86
信息技术	1,147,311.91	0.19
合计	71,983,822.32	11.77

### 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	000568	泸州老窖	139,800	29,297,886.00	4.79
2	000858	五粮液	169,500	27,725,115.00	4.53
3	002345	潮宏基	3,076,800	24,183,648.00	3.95
4	600285	羚锐制药	1,462,300	23,484,538.00	3.84
5	603518	锦泓集团	1,856,602	21,072,432.70	3.45
6	603198	迎驾贡酒	317,900	20,282,020.00	3.32
7	601021	春秋航空	345,701	19,867,436.47	3.25
8	300705	九典制药	750,300	19,830,429.00	3.24
9	600861	北京人力	847,350	19,658,520.00	3.21
10	603309	维力医疗	1,209,000	18,703,230.00	3.06
11	06600	赛生药业	1,847,258	17,951,042.17	2.94
12	600519	贵州茅台	9,855	16,664,805.00	2.72
13	06616	环球新材国际	3,794,000	15,321,205.49	2.51
14	688575	亚辉龙	777,276	14,340,742.20	2.34
15	300369	绿盟科技	1,077,400	13,327,438.00	2.18
16	603209	兴通股份	598,740	12,699,275.40	2.08
17	600223	福瑞达	1,217,900	12,495,654.00	2.04
18	301363	美好医疗	280,499	12,339,151.01	2.02
19	09896	名创优品	362,400	11,042,849.49	1.81
20	000950	重药控股	1,610,800	10,840,684.00	1.77
21	300138	晨光生物	572,700	10,251,330.00	1.68
22	002727	一心堂	351,500	9,279,600.00	1.52
23	600211	西藏药业	152,400	9,052,560.00	1.48
24	002262	恩华药业	291,400	8,983,862.00	1.47
25	002790	瑞尔特	878,700	8,435,520.00	1.38
26	603369	今世缘	154,400	8,152,320.00	1.33
27	300856	科思股份	96,400	7,593,428.00	1.24
28	002567	唐人神	1,022,000	6,796,300.00	1.11
29	300498	温氏股份	346,100	6,350,935.00	1.04
30	002674	兴业科技	486,500	6,008,275.00	0.98
31	00921	海信家电	320,390	5,937,402.76	0.97
32	01910	新秀丽	279,300	5,690,949.21	0.93
33	002100	天康生物	652,000	5,379,000.00	0.88



34	06100	同道猎聘	627,800	5,249,888.73	0.86
35	605377	华旺科技	237,800	4,292,290.00	0.70
36	600327	大东方	890,400	4,140,360.00	0.68
37	688239	航宇科技	53,714	3,757,294.30	0.61
38	600812	华北制药	644,100	3,600,519.00	0.59
39	605499	东鹏饮料	20,800	3,596,320.00	0.59
40	002299	圣农发展	174,300	3,337,845.00	0.55
41	601007	金陵饭店	379,400	3,232,488.00	0.53
42	300729	乐歌股份	175,000	3,122,000.00	0.51
43	001872	招商港口	180,000	3,108,600.00	0.51
44	600233	圆通速递	201,400	2,932,384.00	0.48
45	603477	巨星农牧	80,700	2,691,345.00	0.44
46	00168	青岛啤酒股份	40,000	2,625,799.04	0.43
47	301367	怡和嘉业	16,173	2,399,102.82	0.39
48	09955	智云健康	314,400	2,258,091.29	0.37
49	603363	傲农生物	227,300	2,084,341.00	0.34
50	03331	维达国际	110,882	1,993,504.23	0.33
51	603567	珍宝岛	129,800	1,941,808.00	0.32
52	600298	安琪酵母	47,600	1,723,596.00	0.28
53	603535	嘉诚国际	104,800	1,701,952.00	0.28
54	600276	恒瑞医药	32,300	1,547,170.00	0.25
55	600572	康恩贝	221,500	1,517,275.00	0.25
56	688111	金山办公	3,053	1,441,687.66	0.24
57	000032	深桑达 A	40,200	1,322,580.00	0.22
58	300119	瑞普生物	71,900	1,279,820.00	0.21
59	002840	华统股份	75,200	1,176,128.00	0.19
60	03998	波司登	380,595	1,157,973.23	0.19
61	00981	中芯国际	61,000	1,147,311.91	0.19
62	688232	新点软件	19,645	1,057,097.45	0.17
63	06689	洪九果品	62,100	1,023,718.65	0.17
64	688334	西高院	55,666	998,207.36	0.16
65	688526	科前生物	40,752	969,490.08	0.16
66	002092	中泰化学	130,200	839,790.00	0.14
67	603517	绝味食品	22,600	839,590.00	0.14
68	688582	芯动联科	17,824	831,179.64	0.14
69	000603	盛达资源	65,600	793,104.00	0.13
70	002555	三七互娱	18,900	659,232.00	0.11
71	600398	海澜之家	94,400	649,472.00	0.11
72	300502	新易盛	9,500	645,715.00	0.11
73	000048	京基智农	32,300	630,496.00	0.10
74	603676	卫信康	44,300	612,226.00	0.10
75	002507	涪陵榨菜	33,200	607,892.00	0.10
76	601333	广深铁路	153,300	607,068.00	0.10

77	301280	珠城科技	16,909	604,665.84	0.10
78	002831	裕同科技	24,500	597,555.00	0.10
79	688048	长光华芯	6,186	584,700.72	0.10
80	01368	特步国际	79,087	581,874.73	0.10
81	605507	国邦医药	27,300	580,671.00	0.09
82	601872	招商轮船	97,600	565,104.00	0.09
83	300624	万兴科技	3,900	456,885.00	0.07
84	600166	福田汽车	97,300	330,820.00	0.05
85	688501	青达环保	14,272	317,552.00	0.05
86	603345	安井食品	2,100	308,280.00	0.05
87	605080	浙江自然	10,220	306,395.60	0.05
88	603931	格林达	9,800	298,410.00	0.05
89	000776	广发证券	20,000	294,200.00	0.05
90	688443	智翔金泰	9,532	293,279.44	0.05
91	600180	瑞茂通	46,200	276,276.00	0.05
92	688258	卓易信息	3,671	244,965.83	0.04
93	300774	倍杰特	17,044	198,392.16	0.03
94	300881	盛德鑫泰	5,800	191,110.00	0.03
95	301395	仁信新材	5,196	138,629.28	0.02
96	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.02
97	688429	时创能源	3,452	98,752.08	0.02
98	301170	锡南科技	2,496	92,283.70	0.02
99	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.01
100	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.01
101	688249	晶合集成	4,233	76,447.98	0.01
102	688419	耐科装备	1,780	75,792.40	0.01
103	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.01
104	688152	麒麟信安	665	61,366.20	0.01
105	688420	N美腾	1,548	59,954.04	0.01
106	301325	曼恩斯特	364	39,293.80	0.01
107	001282	三联锻造	1,045	37,026.15	0.01
108	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.01
109	688472	阿特斯	2,004	34,148.16	0.01
110	688531	日联科技	237	32,224.89	0.01
111	688352	颀中科技	2,287	27,604.09	0.00
112	688576	西山科技	223	26,851.43	0.00
113	688146	中船特气	704	26,843.52	0.00
114	301310	鑫宏业	390	25,517.70	0.00
115	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
116	688484	南芯科技	641	23,531.11	0.00
117	301368	丰立智能	337	23,317.03	0.00
118	301297	富乐德	1,015	22,847.65	0.00
119	688507	索辰科技	186	22,712.46	0.00

120	001287	中电港	1,077	22,638.54	0.00
121	688552	航天南湖	946	22,231.00	0.00
122	301291	明阳电气	708	21,969.24	0.00
123	688543	国科军工	400	21,220.00	0.00
124	688458	美芯晟	221	20,057.96	0.00
125	688581	安杰思	163	19,238.89	0.00
126	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00
127	301262	海看股份	692	17,646.00	0.00
128	301383	天键股份	493	17,609.96	0.00
129	603173	福斯达	588	17,316.60	0.00
130	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
131	301358	湖南裕能	393	16,855.77	0.00
132	601061	中信金属	2,130	16,145.40	0.00
133	688570	天玛智控	611	15,476.63	0.00
134	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
135	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
136	301305	朗坤环境	753	14,826.57	0.00
137	603230	内蒙新华	1,141	14,718.90	0.00
138	301101	明月镜片	351	14,401.53	0.00
139	603190	亚通精工	470	14,382.00	0.00
140	301120	新特电气	939	14,291.58	0.00
141	301387	光大同创	307	13,925.52	0.00
142	301210	金杨股份	281	13,816.77	0.00
143	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
144	301165	锐捷网络	220	13,578.40	0.00
145	301408	华人健康	798	13,526.10	0.00
146	603162	海通发展	774	13,196.70	0.00
147	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
148	688623	双元科技	150	13,018.50	0.00
149	301175	中科环保	2,039	12,702.97	0.00
150	301052	果麦文化	252	12,428.64	0.00
151	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
152	301215	中汽股份	1,961	12,295.47	0.00
153	301048	金鹰重工	843	11,776.71	0.00
154	301162	国能日新	148	11,674.24	0.00
155	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
156	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
157	001278	一彬科技	473	11,247.94	0.00
158	603135	中重科技	628	11,234.92	0.00
159	301225	恒勃股份	333	11,075.58	0.00
160	603073	彩蝶实业	530	11,055.80	0.00
161	301391	卡莱特	94	11,013.98	0.00
162	603130	云中马	480	10,900.80	0.00

163	001333	光华股份	426	10,705.38	0.00
164	301017	漱玉平民	555	10,567.20	0.00
165	301429	森泰股份	499	10,488.98	0.00
166	001260	坤泰股份	484	10,401.16	0.00
167	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
168	001366	播恩集团	645	9,945.90	0.00
169	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
170	301083	百胜智能	416	9,734.40	0.00
171	001300	三柏硕	763	9,690.10	0.00
172	301095	广立微	117	9,670.05	0.00
173	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
174	301090	华润材料	758	9,565.96	0.00
175	301020	密封科技	421	9,518.81	0.00
176	301046	能辉科技	290	9,483.00	0.00
177	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
178	001299	美能能源	576	9,394.56	0.00
179	601065	江盐集团	786	9,306.24	0.00
180	301361	众智科技	322	9,077.18	0.00
181	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
182	603280	南方路机	363	8,922.54	0.00
183	001368	通达创智	351	8,922.42	0.00
184	001256	炜冈科技	474	8,721.60	0.00
185	603065	宿迁联盛	581	8,656.90	0.00
186	301078	孩子王	753	8,606.79	0.00
187	301330	熵基科技	238	8,515.64	0.00
188	301281	科源制药	337	8,458.70	0.00
189	301359	东南电子	328	8,357.44	0.00
190	301066	万事利	482	8,309.68	0.00
191	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
192	301316	慧博云通	359	8,203.15	0.00
193	301028	东亚机械	733	8,172.95	0.00
194	603291	联合水务	536	8,152.56	0.00
195	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
196	301439	泓淋电力	475	8,027.50	0.00
197	301117	佳缘科技	124	8,012.88	0.00
198	688372	伟测科技	52	7,963.80	0.00
199	301366	一博科技	182	7,907.90	0.00
200	301230	泓博医药	176	7,902.40	0.00
201	300814	中富电路	328	7,901.52	0.00
202	301290	东星医疗	246	7,884.30	0.00
203	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
204	301133	金钟股份	286	7,596.16	0.00
205	001234	泰慕士	333	7,592.40	0.00

206	301313	凡拓数创	177	7,492.41	0.00
207	300804	广康生化	226	7,451.22	0.00
208	301377	鼎泰高科	323	7,429.00	0.00
209	301111	粤万年青	379	7,420.82	0.00
210	301379	天山电子	262	7,317.66	0.00
211	301026	浩通科技	203	7,251.16	0.00
212	301338	凯格精机	186	7,235.40	0.00
213	301138	华研精机	197	7,166.86	0.00
214	301041	金百泽	215	7,120.80	0.00
215	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
216	301059	金三江	492	6,888.00	0.00
217	301199	迈赫股份	216	6,877.44	0.00
218	301256	华融化学	765	6,777.90	0.00
219	301236	软通动力	249	6,775.29	0.00
220	603150	万朗磁塑	251	6,616.36	0.00
221	301195	北路智控	142	6,611.52	0.00
222	600150	中国船舶	200	6,582.00	0.00
223	301132	满坤科技	215	6,318.85	0.00
224	301038	深水规院	346	6,259.14	0.00
225	301327	华宝新能	79	6,249.69	0.00
226	301161	唯万密封	263	6,077.93	0.00
227	301288	清研环境	350	6,041.00	0.00
228	301296	新巨丰	356	6,009.28	0.00
229	301248	杰创智能	265	5,901.55	0.00
230	301389	隆扬电子	324	5,890.32	0.00
231	301345	涛涛车业	126	5,876.64	0.00
232	301121	紫建电子	116	5,874.24	0.00
233	301223	中荣股份	311	5,821.92	0.00
234	301102	兆讯传媒	213	5,723.31	0.00
235	301139	元道通信	198	5,720.22	0.00
236	301091	深城交	307	5,685.64	0.00
237	688469	中芯集成	1,000	5,670.00	0.00
238	301285	鸿日达	390	5,651.10	0.00
239	301335	天元宠物	235	5,602.40	0.00
240	301212	联盛化学	171	5,598.54	0.00
241	301365	矩阵股份	340	5,596.40	0.00
242	301098	金埔园林	460	5,543.00	0.00
243	301097	天益医疗	115	5,500.45	0.00
244	301235	华康医疗	172	5,473.04	0.00
245	301328	维峰电子	94	5,352.36	0.00
246	301158	德石股份	309	5,348.79	0.00
247	600718	东软集团	500	5,330.00	0.00
248	301137	哈焊华通	296	5,289.52	0.00

249	301056	森赫股份	572	5,239.52	0.00
250	301152	天力锂能	116	5,180.56	0.00
251	301221	光庭信息	92	5,136.36	0.00
252	301055	张小泉	355	5,051.65	0.00
253	301182	凯旺科技	219	5,030.43	0.00
254	301040	中环海陆	241	4,952.55	0.00
255	301282	金禄电子	164	4,929.84	0.00
256	301025	读客文化	403	4,924.66	0.00
257	301181	标榜股份	163	4,904.67	0.00
258	301135	瑞德智能	178	4,880.76	0.00
259	301068	大地海洋	144	4,839.84	0.00
260	301081	严牌股份	483	4,805.85	0.00
261	301033	迈普医学	108	4,747.68	0.00
262	301032	新柴股份	513	4,591.35	0.00
263	301130	西点药业	166	4,561.68	0.00
264	301109	军信股份	276	4,556.76	0.00
265	301300	远翔新材	144	4,550.40	0.00
266	301176	逸豪新材	264	4,535.52	0.00
267	301072	中捷精工	181	4,534.05	0.00
268	301319	唯特偶	75	4,488.75	0.00
269	301233	盛帮股份	103	4,456.81	0.00
270	301356	天振股份	200	4,380.00	0.00
271	301200	大族数控	109	4,346.92	0.00
272	301049	超越科技	196	4,331.60	0.00
273	301222	浙江恒威	145	4,270.25	0.00
274	301063	海锅股份	153	4,262.58	0.00
275	301306	西测测试	109	4,234.65	0.00
276	301100	风光股份	202	4,173.32	0.00
277	600498	烽火通信	200	4,074.00	0.00
278	301053	远信工业	155	3,932.35	0.00
279	301079	邵阳液压	182	3,880.24	0.00
280	301036	双乐股份	205	3,839.65	0.00
281	301037	保立佳	212	3,777.84	0.00
282	301057	汇隆新材	218	3,758.32	0.00
283	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
284	301148	嘉戎技术	168	3,591.84	0.00
285	301190	善水科技	190	3,570.10	0.00
286	301206	三元生物	102	3,568.98	0.00
287	002867	周大生	200	3,556.00	0.00
288	688143	长盈通	94	3,543.80	0.00
289	301110	青木股份	70	3,530.10	0.00
290	301207	华兰疫苗	106	3,525.56	0.00
291	301027	华蓝集团	286	3,514.94	0.00

292	301258	富士莱	89	3,499.48	0.00
293	301276	嘉曼服饰	137	3,493.50	0.00
294	605138	盛泰集团	400	3,488.00	0.00
295	300854	中兰环保	203	3,227.70	0.00
296	301216	万凯新材	189	3,143.07	0.00
297	301189	奥尼电子	102	3,120.18	0.00
298	301309	万得凯	110	3,029.40	0.00
299	301092	争光股份	109	2,853.62	0.00
300	301237	和顺科技	96	2,850.24	0.00
301	300834	星辉环材	110	2,684.00	0.00
302	301219	腾远钴业	65	2,428.40	0.00
303	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
304	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
305	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
306	301196	唯科科技	63	2,138.85	0.00
307	688172	燕东微	74	1,759.72	0.00
308	600176	中国巨石	100	1,416.00	0.00
309	06186	中国飞鹤	307	1,234.09	0.00
310	688525	佰维存储	14	1,118.46	0.00
311	06078	海吉亚医疗	25	977.30	0.00
312	688410	山外山	14	735.00	0.00
313	688779	长远锂科	19	214.13	0.00
314	688175	高凌信息	2	66.24	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	603198	迎驾贡酒	45,236,265.00	13.34
2	002345	潮宏基	40,534,217.00	11.96
3	603309	维力医疗	40,332,879.79	11.90
4	000568	泸州老窖	37,788,616.00	11.15
5	000858	五粮液	37,347,836.93	11.02
6	603589	口子窖	34,414,602.00	10.15
7	000661	长春高新	34,287,004.84	10.11
8	601021	春秋航空	33,796,236.32	9.97
9	603966	法兰泰克	32,265,560.06	9.52
10	603369	今世缘	31,760,985.85	9.37
11	002304	洋河股份	31,413,977.84	9.27
12	600861	北京人力	30,262,147.72	8.93
13	300075	数字政通	30,079,154.00	8.87
14	600211	西藏药业	29,945,175.18	8.83
15	300339	润和软件	28,564,957.71	8.43

16	600285	羚锐制药	27,995,207.68	8.26
17	600519	贵州茅台	26,522,669.40	7.82
18	000913	钱江摩托	25,367,316.36	7.48
19	600976	健民集团	24,993,815.84	7.37
20	000989	九芝堂	24,165,829.88	7.13
21	300705	九典制药	22,159,631.20	6.54
22	300119	瑞普生物	21,431,220.96	6.32
23	603518	锦泓集团	20,461,166.52	6.04
24	600718	东软集团	19,685,262.00	5.81
25	603385	惠达卫浴	19,368,692.20	5.71
26	603658	安图生物	18,997,501.40	5.60
27	06616	环球新材国际	18,815,129.34	5.55
28	603387	基蛋生物	17,817,789.69	5.26
29	01138	中远海能	9,076,113.64	2.68
29	600026	中远海能	8,737,757.00	2.58
31	06600	赛生药业	17,406,138.09	5.13
32	603209	兴通股份	16,720,912.32	4.93
33	002275	桂林三金	16,544,705.40	4.88
34	300622	博士眼镜	16,493,264.00	4.87
35	300856	科思股份	16,349,704.50	4.82
36	600233	圆通速递	16,326,080.00	4.82
37	600738	丽尚国潮	16,310,514.00	4.81
38	603129	春风动力	16,274,068.44	4.80
39	002727	一心堂	16,036,978.00	4.73
40	600223	福瑞达	15,772,307.00	4.65
41	06078	海吉亚医疗	15,753,312.39	4.65
42	601989	中国重工	15,709,449.00	4.63
43	002299	圣农发展	15,460,827.00	4.56
44	002582	好想你	15,404,721.00	4.54
45	300369	绿盟科技	15,180,715.00	4.48
46	688575	亚辉龙	14,723,128.89	4.34
47	603128	华贸物流	14,184,627.04	4.18
48	002271	东方雨虹	13,851,230.53	4.09
49	002262	恩华药业	13,679,517.00	4.04
50	600993	马应龙	13,664,095.00	4.03
51	603787	新日股份	13,605,225.00	4.01
52	600986	浙文互联	13,593,379.08	4.01
53	000048	京基智农	13,591,857.66	4.01
54	300972	万辰生物	13,582,547.00	4.01
55	301363	美好医疗	12,985,709.04	3.83
56	002674	兴业科技	12,799,892.16	3.78
57	605377	华旺科技	12,720,304.00	3.75
58	000950	重药控股	12,428,754.00	3.67



59	300138	晨光生物	12,194,539.00	3.60
60	002567	唐人神	12,069,626.00	3.56
61	00921	海信家电	12,048,835.14	3.55
62	600195	中牧股份	11,843,779.01	3.49
63	600975	新五丰	11,572,250.16	3.41
64	603816	顾家家居	11,364,554.10	3.35
65	01910	新秀丽	11,348,280.50	3.35
66	002790	瑞尔特	11,275,588.40	3.33
67	06689	洪九果品	11,246,283.44	3.32
68	688139	海尔生物	11,159,034.86	3.29
69	01368	特步国际	11,061,653.51	3.26
70	001205	盛航股份	10,784,498.00	3.18
71	00700	腾讯控股	10,735,170.52	3.17
72	603871	嘉友国际	10,640,079.84	3.14
73	09896	名创优品	10,597,810.68	3.13
74	605507	国邦医药	10,535,825.00	3.11
75	600298	安琪酵母	9,908,909.28	2.92
76	00168	青岛啤酒股份	9,806,980.92	2.89
77	002100	天康生物	9,804,534.25	2.89
78	300997	欢乐家	9,626,410.00	2.84
79	002946	新乳业	9,401,933.00	2.77
80	603116	红蜻蜓	9,270,884.40	2.73
81	600872	中炬高新	9,252,066.00	2.73
82	688581	安杰思	9,154,260.55	2.70
83	300795	米奥会展	9,027,155.50	2.66
84	603811	诚意药业	9,005,521.48	2.66
85	06100	同道猎聘	8,900,361.34	2.63
86	600012	皖通高速	8,517,562.00	2.51
87	603517	绝味食品	8,500,085.00	2.51
88	301227	森鹰窗业	8,470,002.00	2.50
89	600496	精工钢构	8,315,059.00	2.45
90	002385	大北农	8,097,930.00	2.39
91	605266	健之佳	8,005,184.00	2.36
92	002332	仙琚制药	7,883,778.00	2.33
93	603282	亚光股份	7,773,451.39	2.29
94	301365	矩阵股份	7,467,358.62	2.20
95	00981	中芯国际	7,411,806.15	2.19
96	600482	中国动力	7,249,320.66	2.14
97	002864	盘龙药业	7,242,451.00	2.14
98	002078	太阳纸业	7,064,380.52	2.08
99	002867	周大生	6,984,079.00	2.06
100	605088	冠盛股份	6,789,358.00	2.00

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	603369	今世缘	35,245,788.00	10.40
2	300075	数字政通	33,660,559.00	9.93
3	000913	钱江摩托	32,636,910.00	9.63
4	002304	洋河股份	31,436,621.00	9.27
5	000661	长春高新	30,437,221.44	8.98
6	603589	口子窖	29,019,808.72	8.56
7	300339	润和软件	28,561,602.00	8.43
8	603966	法兰泰克	27,549,069.40	8.13
9	603198	迎驾贡酒	27,548,239.86	8.13
10	300119	瑞普生物	25,796,610.00	7.61
11	000989	九芝堂	24,688,208.51	7.28
12	600861	北京人力	23,947,553.50	7.06
13	605507	国邦医药	23,910,112.00	7.05
14	600976	健民集团	23,905,397.00	7.05
15	600211	西藏药业	22,474,011.00	6.63
16	002345	潮宏基	21,622,934.00	6.38
17	600519	贵州茅台	21,481,481.94	6.34
18	600975	新五丰	20,903,893.60	6.17
19	600718	东软集团	20,147,030.00	5.94
20	605266	健之佳	19,566,103.00	5.77
21	300856	科思股份	19,171,159.38	5.66
22	300972	万辰生物	18,836,360.00	5.56
23	001205	盛航股份	18,734,902.42	5.53
24	300181	佐力药业	18,024,286.00	5.32
25	603129	春风动力	17,911,066.48	5.28
26	002275	桂林三金	17,367,656.60	5.12
27	603871	嘉友国际	17,123,391.87	5.05
28	603658	安图生物	17,067,703.00	5.03
29	300622	博士眼镜	16,997,605.00	5.01
30	603385	惠达卫浴	16,861,305.52	4.97
31	603387	基蛋生物	16,821,927.00	4.96
32	01138	中远海能	8,627,658.93	2.55
32	600026	中远海能	7,613,724.44	2.25
34	601989	中国重工	15,443,475.58	4.56
35	000568	泸州老窖	15,221,572.35	4.49
36	603128	华贸物流	15,152,387.00	4.47
37	603309	维力医疗	15,024,711.80	4.43
38	06078	海吉亚医疗	14,775,214.44	4.36

39	000048	京基智农	14,518,389.60	4.28
40	002582	好想你	14,431,009.00	4.26
41	600233	圆通速递	14,062,567.00	4.15
42	002727	一心堂	13,538,297.00	3.99
43	002271	东方雨虹	13,032,562.50	3.84
44	600986	浙文互联	12,734,165.00	3.76
45	600993	马应龙	12,700,512.00	3.75
46	00570	中国中药	12,325,930.43	3.64
47	603787	新日股份	12,131,702.00	3.58
48	600195	中牧股份	12,125,962.00	3.58
49	600419	天润乳业	11,468,641.00	3.38
50	002946	新乳业	11,109,743.80	3.28
51	688139	海尔生物	10,894,847.35	3.21
52	601021	春秋航空	10,856,658.88	3.20
53	600738	丽尚国潮	10,702,835.00	3.16
54	603713	密尔克卫	9,941,138.80	2.93
55	600012	皖通高速	9,791,446.00	2.89
56	01368	特步国际	9,772,875.20	2.88
57	300795	米奥会展	9,723,122.50	2.87
58	06689	洪九果品	9,708,615.58	2.86
59	01530	三生制药	9,652,294.76	2.85
60	603811	诚意药业	9,559,468.00	2.82
61	603116	红蜻蜓	9,541,396.60	2.81
62	002299	圣农发展	9,515,315.00	2.81
63	00700	腾讯控股	9,453,045.99	2.79
64	300138	晨光生物	9,376,524.04	2.77
65	300997	欢乐家	9,205,063.00	2.72
66	603816	顾家家居	9,129,763.00	2.69
67	688581	安杰思	8,742,793.99	2.58
68	603282	亚光股份	8,405,284.60	2.48
69	600482	中国动力	8,314,576.00	2.45
70	301193	家联科技	8,253,313.00	2.43
71	002332	仙琚制药	8,183,328.00	2.41
72	600872	中炬高新	8,142,362.00	2.40
73	301367	怡和嘉业	8,056,591.00	2.38
74	603209	兴通股份	7,857,578.00	2.32
75	002385	大北农	7,839,422.00	2.31
76	00168	青岛啤酒股份	7,789,799.98	2.30
77	605377	华旺科技	7,769,147.00	2.29
78	600496	精工钢构	7,641,096.00	2.25
79	002864	盘龙药业	7,526,285.73	2.22
80	301227	森鹰窗业	7,526,116.36	2.22
81	00921	海信家电	7,463,348.16	2.20

82	301365	矩阵股份	7,406,377.00	2.18
83	688526	科前生物	7,389,898.30	2.18
84	002867	周大生	7,358,570.00	2.17
85	03998	波司登	7,310,251.25	2.16
86	002674	兴业科技	7,280,351.98	2.15
87	600298	安琪酵母	7,153,632.64	2.11
88	300860	锋尚文化	6,910,206.00	2.04

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	2,100,378,897.22
卖出股票收入（成交）总额	1,805,766,331.98

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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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辩护，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于国债期货。

## 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，春秋航空股份有限公司于 2022 年 12 月 5 日曾受到中国民用航空华北地区管理局公开处罚，于 2022 年 11 月 18 日曾受到中国民用航空中南地区管理局公开处罚。

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	347,855.68
2	应收清算款	2,600,788.11
3	应收股利	6,214.05
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,472,867.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,427,725.09

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

## 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
宏利消费服务混合 A	2,023	207,655.33	237,441,031.87	56.52	182,645,699.81	43.48
宏利消费服务混合 C	3,091	125,972.94	372,142,361.06	95.57	17,239,993.14	4.43
合计	5,114	158,284.92	609,583,392.93	75.31	199,885,692.95	24.69

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	宏利消费服务混合 A	1,011,052.07	0.2407
	宏利消费服务混合 C	2,871.69	0.0007
	合计	1,013,923.76	0.1253

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	宏利消费服务混合 A	宏利消费服务混合 C
基金合同生效日 (2021年3月16日) 基金份额总额	384,020,421.67	19,324,512.36
本报告期期初基金份额总额	262,032,844.94	183,031,168.35

本报告期基金总申购份额	171,020,466.23	649,679,195.91
减：本报告期基金总赎回份额	12,966,579.49	443,328,010.06
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	420,086,731.68	389,382,354.20

## § 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，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

### 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，本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 (%)	

中信证券	3	329,331,933.44	8.46	266,739.56	7.44	-
财信证券	2	302,283,879.55	7.76	281,516.14	7.85	-
信达证券	1	284,674,293.72	7.31	265,116.36	7.39	-
德邦证券	1	264,196,590.11	6.78	246,040.91	6.86	-
东北证券	2	233,914,116.95	6.01	217,844.07	6.07	-
华创证券	1	221,778,027.73	5.70	206,542.86	5.76	-
国盛证券	2	210,073,427.02	5.39	195,642.49	5.46	-
方正证券	1	209,307,837.39	5.38	194,927.97	5.44	-
华安证券	1	187,777,401.31	4.82	174,880.80	4.88	-
东亚前海	1	171,928,718.16	4.42	160,119.13	4.46	-
国海证券	1	161,143,726.68	4.14	150,072.18	4.18	-
浙商证券	1	159,404,114.87	4.09	148,453.10	4.14	-
西部证券	1	150,220,950.59	3.86	139,901.33	3.90	-
华西证券	1	130,121,198.85	3.34	121,183.04	3.38	-
国信证券	1	123,960,282.05	3.18	115,444.97	3.22	-
开源证券	1	98,350,374.35	2.53	91,594.97	2.55	-
财通证券	1	96,320,024.50	2.47	89,703.85	2.50	-
申万宏源	2	92,866,024.71	2.38	86,484.20	2.41	-
东吴证券	2	90,605,330.72	2.33	84,378.83	2.35	-
中金公司	1	77,185,024.93	1.98	71,879.74	2.00	-
国泰君安	1	72,291,761.53	1.86	67,326.39	1.88	-
东方财富	1	67,368,751.07	1.73	62,740.30	1.75	-



长江证券	1	53,518,836.99	1.37	49,841.48	1.39	-
中信建投	3	41,500,008.98	1.07	38,647.08	1.08	-
广发证券	1	39,219,067.64	1.01	36,523.50	1.02	-
民生证券	1	12,491,645.00	0.32	11,633.18	0.32	-
东方证券	3	12,097,460.20	0.31	11,265.89	0.31	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
太平洋	2	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-

注：（一）2023 年上半年本基金撤销平安证券，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(%)
中信证券	-	-	-	-	-	-
财信证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
东亚前海	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
中金公	-	-	-	-	-	-

司						
国泰君安	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
太平洋	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-

银河证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
中银国 际	-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期末通过租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

## § 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消费服务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