

# 宏利风险预算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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>7</b>
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	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	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	11
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	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>12</b>
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	17
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>36</b>
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
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	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46
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	46

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	46
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 .....	46
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 .....	46
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	46
7.12 投资组合报告附注 .....	47
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>48</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	48
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	48
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>48</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>48</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	48
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 .....	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	48
10.4 基金投资策略的改变 .....	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	49
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 .....	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	49
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>51</b>
11.1 影响投资者决策的其他重要信息 .....	51
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>51</b>
12.1 备查文件目录 .....	51
12.2 存放地点 .....	52
12.3 查阅方式 .....	52

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	宏利风险预算混合型证券投资基金
基金简称	宏利风险预算混合
基金主代码	162205
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005 年 4 月 5 日
基金管理人	宏利基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	66,111,696.47 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过风险预算的投资策略，力争获取超过业绩比较基准的长期稳定回报，分享市场向上带来的收益，控制市场向下的风险。
投资策略	本基金的投资管理全面引进一种全新的投资策略——风险预算。风险预算是指基金在投资组合构建和调整前基于对市场信心度的判断来分配风险，然后根据风险的分配限制来调整具体资产的投资策略，使未来的投资组合满足风险预算的要求，也就是说投资组合在构建和调整前其风险就已锁定。风险预算的策略将体现在投资的各个环节。大量应用数量化的事前和事后的风险控制手段是本基金的重要特色。投资组合资产配置比例的一个重要参考来自于数理化的风险预算。
业绩比较基准	一年期银行定期存款利率(税后)*50%+富时中国 A200 指数*20%+中证金融债指数*15%+中证企业债指数*10%+中证国债指数*5%。
风险收益特征	基金的投资目标和投资范围决定了本基金属于风险较低的证券投资基金。

### 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	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	徐娇	陆志俊
	联系电话	66577766	95559
	电子邮箱	irm@manulifefund.com.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		400-698-8888	95559
传真		010-66577666	021-62701216
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	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 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	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码		100026	200336
法定代表人		高贵鑫	任德奇

## 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	宏利基金管理有限公司	北京市朝阳区针织路 23 号楼中国人寿金融中心 6 层 02-07 单元

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	1,073,069.89
本期利润	1,517,335.31
加权平均基金份额本期利润	0.0227
本期加权平均净值利润率	2.02%
本期基金份额净值增长率	2.02%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	8,124,653.34
期末可供分配基金份额利润	0.1229
期末基金资产净值	74,236,349.81
期末基金份额净值	1.1229
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	541.51%

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

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.50%	0.28%	0.37%	0.17%	0.13%	0.11%

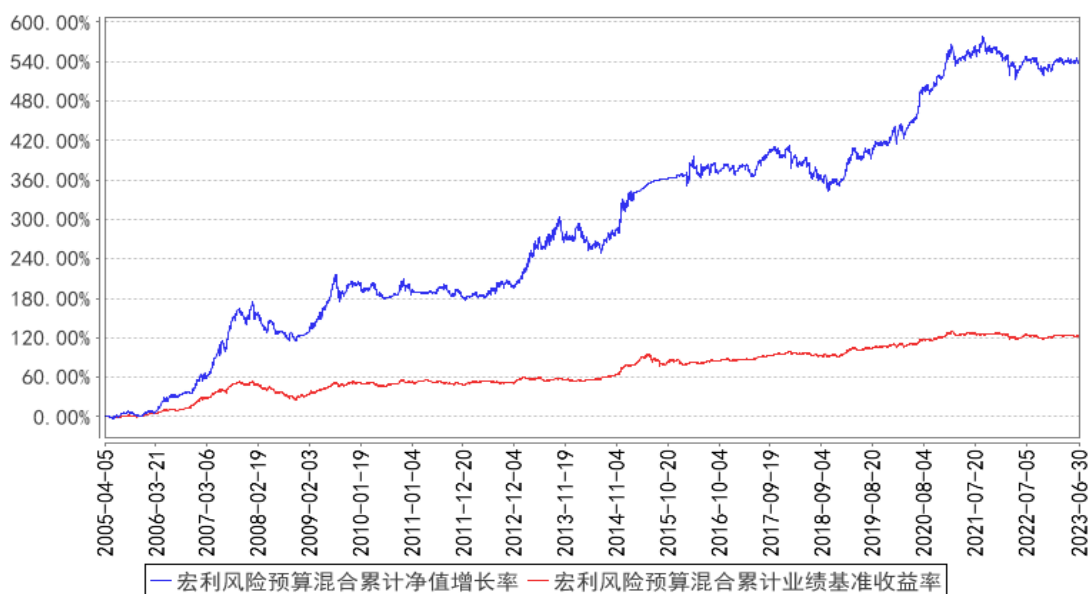
过去三个月	0.17%	0.25%	-0.34%	0.16%	0.51%	0.09%
过去六个月	2.02%	0.24%	0.83%	0.16%	1.19%	0.08%
过去一年	-0.82%	0.27%	-1.12%	0.19%	0.30%	0.08%
过去三年	12.81%	0.37%	5.10%	0.24%	7.71%	0.13%
自基金合同生效起至今	541.51%	0.65%	122.70%	0.33%	418.81%	0.32%

注：本基金业绩比较基准： $5\% \times$  中证国债指数  $+ 15\% \times$  中证金融债指数  $+ 10\% \times$  中证企业债指数  $+ 20\% \times$  富时中国 A200 指数  $+ 50\% \times$  税后一年期银行定期存款利率。

富时中国 A200 指数是富时指数公司编制的包含上海、深圳两个证券交易所总市值最大的 200 只股票并以流通股本加权的股票指数，具有良好的市场代表性。中证国债指数的样本涵盖了三个市场中（银行间市场，沪深交易所）的一年期以上的国债，中证金融债指数样本涵盖银行间市场上一年期以上的金融债，中证企业债指数样本涵盖了三个市场上一年期以上的企业债，分别反映了我国债券市场不同信用类别债券的整体价格变动趋势，具有良好的市场代表性。

### 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

宏利风险预算混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

宏利投资管理（香港）有限公司：49%。

宏利基金管理有限公司原名湘财合丰基金管理有限公司、湘财荷银基金管理有限公司、泰达荷银基金管理有限公司、泰达宏利基金管理有限公司，成立于 2002 年 6 月。截至目前，公司管理着包括宏利价值优化型系列基金、宏利行业精选混合型证券投资基金、宏利风险预算混合型证券投资基金、宏利货币市场基金、宏利效率优选混合型证券投资基金（LOF）、宏利首选企业股票型证券投资基金、宏利市值优选混合型证券投资基金、宏利集利债券型证券投资基金、宏利品质生活灵活配置混合型证券投资基金、宏利红利先锋混合型证券投资基金、宏利沪深 300 指数增强型证券投资基金、宏利领先中小盘混合型证券投资基金、宏利聚利债券型证券投资基金（LOF）、宏利中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）、宏利逆向策略混合型证券投资基金、宏利宏达混合型证券投资基金、宏利淘利债券型证券投资基金、宏利转型机遇股票型证券投资基金、宏利改革动力量化策略灵活配置混合型证券投资基金、宏利复兴伟业灵活配置混合型证券投资基金、宏利新起点灵活配置混合型证券投资基金、宏利蓝筹价值混合型证券投资基金、宏利创益灵活配置混合型证券投资基金、宏利活期友货币市场基金、宏利汇利债券型证券投资基金、宏利睿智稳健灵活配置混合型证券投资基金、宏利京元宝货币市场基金、宏利纯利债券型证券投资基金、宏利溢利债券型证券投资基金、宏利恒利债券型证券投资基金、宏利全能优选混合型基金中基金（FOF）、宏利交利 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、宏利金利 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、宏利绩优增长灵活配置混合型证券投资基金、宏利泽利 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、宏利泰和平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、宏利印度机会股票型证券投资基金（QDII）、宏利永利债券型证券投资基金、宏利消费行业量化精选混合型证券投资基金、宏利中证主要消费红利指数型证券投资基金、宏利泰和稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、宏利价值长青混合型证券投资基金、宏利乐盈 66 个月定期开放债券型证券投资基金、宏利高研发创新 6 个月持有期混合型证券投资基金、宏利波控回报 12 个月持有期混合型证券投资基金、宏利消费服务混合型证券投资基金、宏利新能源股票型证券投资基金、宏利中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金、宏利悠然养老目标日期 2025 一年持有期混合型基金中基金（FOF）、宏利新兴景气龙头混合型证券投资基金、宏利景气领航两年持有期混合型证券投资基金、宏利中短债债券型证券投资基金、宏利先进制造股票型证券投资基金、宏利景气智选 18 个月持有期混合型证券投资基金、宏利昇利一年定期开放债券型发起式证券投资基金、宏利闽利一年定期开放债券型发起式证券投资基金、宏利悠享养老目标日期 2030 一年持有期混合型基金中基金（FOF）、宏利添盈两年定期开放债券型证券投资基金在内的六十只证券投资基金。

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



持续增值。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘欣	总经理助理兼基金经理	2016年9月26日	-	16年	清华大学理学硕士；2007年7月至2008年12月就职于工银瑞信基金管理有限公司；2008年12月至2011年7月就职于嘉实基金管理有限公司；2011年7月加盟宏利基金管理有限公司，曾担任产品与金融工程部高级研究员、金融工程部副总经理、金融工程部总经理、投资副总监，现担任公司总经理助理兼基金经理；具备16年基金从业经验，16年证券投资管理经验，具有基金从业资格。
宁霄	固定收益部总经理助理；基金经理	2020年11月4日	-	15年	中国人民大学金融工程硕士；2006年4月至2007年3月，任职于兴业全球基金管理有限公司基金运营部，担任基金TA清算；2007年8月至2011年3月，任职于华夏基金管理有限公司，担任基金会计；2013年7月至今任职于宏利基金管理有限公司，曾先后担任债券交易员、交易部交易主管、交易部总经理助理、基金经理助理、基金经理，现任固定收益部总经理助理兼基金经理。具备15年证券从业经验，10年证券投资管理经验，具有基金从业资格。
李婷婷	本基金基金经理助理	2019年11月18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	策略投资部副总经理；基金经理助理	2017年04月21日	2023年01月13日	8年	北京大学理学硕士；2015年1月至2015年4月就职于九坤投资（北京）有限公司，2015年5月加入宏利基金管理有限公司，任职于金融工程部，先后担任助理研究员、研究员、基金经理助理、策略投资部总经理助理等职务，现担任策略投资部副总经理兼基金经理；具备8年证券投资管理经验，具有基金从业资格。

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

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

本基金在操作中，无论从仓位管理还是选股结构上，均体现出相对保守的投资风格。在仓位层面，采用目标波动率策略，通过动态调整控制产品整体波动风险。在选股层面，投资风格偏向低估值盈利稳定的大盘蓝筹股。本报告期内，本基金增加了医药、计算机、食品饮料的配置，减

少了银行、煤炭、交通运输的配置。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.1229 元；本报告期基金份额净值增长率为 2.02%，业绩比较基准收益率为 0.83%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，尽管年初以来市场呈现原地波动、结构分化特征，我们仍维持 A 股整体权益资产估值分位数较低，处于投资价值较高区域的判断，港股观点类似。而与上个季度不同的是，我们认为随着经济压力增加，正面催化剂将逐渐增加，有利于市场反弹。而在风格层面，要重点关注外资对市场的认可程度，能否在催化中完成重新向机构化转变的过程。如果北向资金能形成可观的正向流入，则市场风格可能重新向 2019、2020 转变，否则反弹将更类似与 2009、2013。无论任一情况发生，就整体而言，站在当前估值位置，应对市场更为乐观。在投资策略层面，我们将积极关注资金趋势变化引起的可能市场中期风格变化，以及下半年从日历角度，市场风格在年底可能切向大盘价值。

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

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。报告期内相关基金估值政策由托管银行进行复核。公司估值委员会主任由主管基金运营的副总经理担任，成员包括但不限于督察长、主管投研的副总经理或投资总监、权益投资部、研究部、策略投资部、固定收益部、合规风控部门、基金运营部的主要负责人；委员会秘书由基金运营部负责人担任。所有人员均具有丰富的专业工作经历，具备良好的专业经验和专业胜任能力。

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

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

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

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，基金托管人在宏利风险预算混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，宏利基金管理有限公司在宏利风险预算混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

#### 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

本报告期内，由宏利基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关宏利风险预算混合型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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：宏利风险预算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	690,505.36	889,805.68
结算备付金		265,930.93	195,673.57
存出保证金		6,332.47	7,689.16
交易性金融资产	6.4.7.2	74,195,643.07	74,180,776.26
其中：股票投资		21,899,321.18	22,657,434.64

基金投资		-	-
债券投资		52,296,321.89	51,523,341.62
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	-	1,499,780.82
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		5,429.59	17,994.99
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		75,163,841.42	76,791,720.48
<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		-	499,561.64
应付赎回款		65,418.90	12,506.24
应付管理人报酬		42,704.79	46,848.48
应付托管费		15,251.73	16,731.60
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		636,671.53	636,667.16
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	167,444.66	280,156.07
负债合计		927,491.61	1,492,471.19
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	66,111,696.47	68,407,442.71
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	8,124,653.34	6,891,806.58
净资产合计		74,236,349.81	75,299,249.29
负债和净资产总计		75,163,841.42	76,791,720.48

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.1229 元，基金份额总额 66,111,696.47 份。

## 6.2 利润表

会计主体：宏利风险预算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>		1,971,627.40	-9,335,084.40
1. 利息收入		7,721.58	21,515.97
其中：存款利息收入	6.4.7.13	7,151.52	21,515.97
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		570.06	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,516,853.85	-9,206,945.97
其中：股票投资收益	6.4.7.14	669,846.52	-12,191,130.32
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	604,693.05	2,803,121.85
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	242,314.28	181,062.50
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	444,265.42	-272,963.18
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	2,786.55	123,308.78
<b>减：二、营业总支出</b>		454,292.09	990,249.47
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	260,352.39	632,095.91
2. 托管费	6.4.10.2.2	92,983.08	225,748.55

3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		12,694.76	16,847.80
其中：卖出回购金融资产支出		12,694.76	16,847.80
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		2.50	1,782.66
8. 其他费用	6.4.7.23	88,259.36	113,774.55
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>1,517,335.31</b>	<b>-10,325,333.87</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>1,517,335.31</b>	<b>-10,325,333.87</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>1,517,335.31</b>	<b>-10,325,333.87</b>

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：宏利风险预算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）	68,407,442.71	-	6,891,806.58	75,299,249.29
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）	68,407,442.71	-	6,891,806.58	75,299,249.29
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-2,295,746.24	-	1,232,846.76	-1,062,899.48
（一）、综合收益总额	-	-	1,517,335.31	1,517,335.31
（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）	-2,295,746.24	-	-284,488.55	-2,580,234.79

其中：1. 基金申购款	1,729,177.04	-	209,857.57	1,939,034.61
2. 基金赎回款	-4,024,923.28	-	-494,346.12	-4,519,269.40
(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)	66,111,696.47	-	8,124,653.34	74,236,349.81
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)	231,013,772.39	-	57,372,102.18	288,385,874.57
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)	231,013,772.39	-	57,372,102.18	288,385,874.57
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-149,009,156.24	-	-46,532,485.08	-195,541,641.32
(一)、综合收益总额	-	-	-10,325,333.87	-10,325,333.87
(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)	-149,009,156.24	-	-28,994,185.95	-178,003,342.19
其中：1. 基金申购款	9,701,426.68	-	1,283,095.92	10,984,522.60
2. 基金赎回款	-158,710,582.92	-	-30,277,281.87	-188,987,864.79
(三)、本期向基金份额持有人分	-	-	-7,212,965.26	-7,212,965.26



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）	82,004,616.15	-	10,839,617.10	92,844,233.25

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

宏利风险预算混合型证券投资基金(以下简称“本基金”，原湘财荷银风险预算混合型证券投资基金，后更名为泰达荷银风险预算混合型证券投资基金，后更名为泰达宏利风险预算混合型证券投资基金)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2004]第 216 号《关于同意湘财荷银风险预算混合型证券投资基金设立的批复》核准，由湘财荷银基金管理有限公司(于 2006 年 4 月 27 日更名为泰达荷银基金管理有限公司，于 2010 年 3 月 9 日更名为泰达宏利基金管理有限公司，于 2023 年 4 月 20 日更名为宏利基金管理有限公司)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《湘财荷银风险预算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 545,676,458.77 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2005)第 45 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《湘财荷银风险预算混合型证券投资基金基金合同》于 2005 年 4 月 5 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 545,863,991.51 份基金份额，其中认购资金利息折合 187,532.74 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，基金托管人为交通银行股份有限公司(以下简称“交通银行”)。

经中国证监会同意，本基金于 2006 年 6 月 6 日更名为泰达荷银风险预算混合型证券投资基金。根据本基金的基金管理人 2010 年 3 月 17 日发布的《泰达宏利基金管理有限公司关于变更公司旗下公募基金名称的公告》，本基金自公告发布之日起更名为泰达宏利风险预算混合型证券投资基金。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 日起更名为宏利风险预算混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《宏利风险预算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国内依法公开发行、上市的股票、债券、货币市场工具及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具，其中股票投资比例范围为基金资产净值的 0%-50%，债券投资比例范围为基金资产净值的 20%-70%，货币市场工具投资比例范围为基金资产净值的 5%-80%。自 2013 年 3 月 30 日起，本基金的业绩比较基准由一年期银行定期存款利率(税后)×50%+富时中国 A200 指数×20%+新华巴克莱资本中国政府机构债指数×15%+新华巴克莱资本中国企业债指数×10%+新华巴克莱资本中国国债指数×5%，变更为一年期银行定期存款利率(税后)×50%+富时中国 A200 指数×20%+中证金融债指数×15%+中证企业债指数×10%+中证国债指数×5%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券基金业协会(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》、《宏利风险预算混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通

知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

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

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

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
活期存款	690,505.36

等于：本金	689,871.56
加：应计利息	633.80
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	690,505.36

#### 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	22,575,592.63	-	21,899,321.18	-676,271.45	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	40,839,698.60	607,915.08	42,143,108.78	695,495.10
	银行间市场	10,129,450.00	77,213.11	10,153,213.11	-53,450.00
	合计	50,969,148.60	685,128.19	52,296,321.89	642,045.10
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	73,544,741.23	685,128.19	74,195,643.07	-34,226.35	

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末未持有期货合约。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

**6.4.7.4 买入返售金融资产****6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

**6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明**

无。

**6.4.7.5 债权投资****6.4.7.5.1 债权投资情况**

本基金本报告期末未持有债权投资。

**6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况**

本基金本报告期末未计提债权投资减值准备。

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

本基金本报告期末未持有其他债权投资。

**6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况**

本基金本报告期末未计提其他债权投资减值准备。

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

本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

**6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况**

本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

**6.4.7.8 其他资产**

本基金本报告期末未有其他资产。

**6.4.7.9 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	58.07
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	88,119.63

其中：交易所市场	88,119.63
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	78,424.36
其他	842.60
合计	167,444.66

#### 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	68,407,442.71	68,407,442.71
本期申购	1,729,177.04	1,729,177.04
本期赎回（以“-”号填列）	-4,024,923.28	-4,024,923.28
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	66,111,696.47	66,111,696.47

注：若本基金有分红及转换业务，申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期末未有其他综合收益。

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	15,884,739.70	-8,992,933.12	6,891,806.58
本期利润	1,073,069.89	444,265.42	1,517,335.31
本期基金份额交易产生的变动数	-551,484.72	266,996.17	-284,488.55
其中：基金申购款	415,660.59	-205,803.02	209,857.57
基金赎回款	-967,145.31	472,799.19	-494,346.12
本期已分配利润	-	-	-
本期末	16,406,324.87	-8,281,671.53	8,124,653.34

#### 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
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	1,865.09

其他	73.46
合计	7,151.52

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 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	669,846.52
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	669,846.52

##### 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	94,088,898.76
减：卖出股票成本总额	93,136,736.13
减：交易费用	282,316.11
买卖股票差价收入	669,846.52

##### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期末未有股票投资收益-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	740,688.21
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-135,995.16
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	604,693.05

##### 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	22,104,704.39

额	
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	21,799,920.32
减：应计利息总额	440,603.59
减：交易费用	175.64
买卖债券差价收入	-135,995.16

#### 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

本基金本报告期末有贵金属投资收益-买卖贵金属差价收入。

##### 6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期末有贵金属投资收益-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	242,314.28
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	242,314.28

**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	444,265.42
股票投资	-22,233.48
债券投资	466,498.90
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	444,265.42

**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	2,767.61
基金转换费收入	18.94
合计	2,786.55

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**

本基金本报告期末有信用减值损失。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行费用	235.00
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	88,259.36

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期末有存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：1. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联交易单元进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联交易单元进行债券交易。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均未有应支付关联方的佣金。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	260,352.39	632,095.91
其中：支付销售机构的客户维护费	106,016.01	148,306.84

注：支付基金管理人宏利基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.70%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.70%/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	92,983.08	225,748.55

注：支付基金托管人交通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。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未有与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）的交易。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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

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

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	690,505.36	5,212.97	896,957.57	16,593.82

注：1. 本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按约定利率计息。

2. 本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。于2023年6月30日的相关余额在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示(2022年6月30日：同)。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未有在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均未有其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2023年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注

601916	浙商 银行	2023 年 6 月 27 日	1-6 个 月 (含)	配股 流通 受限	2.02	2.64	1,620	3,272.40	4,276.80	-
--------	----------	-----------------------	----------------	----------------	------	------	-------	----------	----------	---

注：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。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未有银行间市场债券正回购。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未有交易所市场债券正回购。

#### 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

本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金，属于较低风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。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“风险和收益高于保本基金而低于平衡型基金，谋求稳定和可持续的绝对收益”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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行交通银行，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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

于 2023 年 6 月 30 日，本基金持有除国债、央行票据、政策性金融债和同业存单以外的债券、资产支持证券投资占基金资产净值的比例为 0.75% (2022 年 12 月 31 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)。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的债券投资。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

##### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

##### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	51,523,341.62

合计	-	51,523,341.62
----	---	---------------

注：以上未评级的债券投资中包括国债、政策性金融债及央行票据等。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2023 年 6 月 30 日，除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额将在一个月以内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证

券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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

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

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

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款、结算备付金和存出保证金等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

##### 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	690,505.36	-	-	-	690,505.36
结算备付金	265,930.93	-	-	-	265,930.93
存出保证金	6,332.47	-	-	-	6,332.47
交易性金融资产	27,754,075.16	14,703,331.54	9,838,915.19	21,899,321.18	74,195,643.07
应收申购款	-	-	-	5,429.59	5,429.59
资产总计	28,716,843.92	14,703,331.54	9,838,915.19	21,904,750.77	75,163,841.42
负债					
应付赎回款	-	-	-	65,418.90	65,418.90
应付管理人报酬	-	-	-	42,704.79	42,704.79
应付托管费	-	-	-	15,251.73	15,251.73
应交税费	-	-	-	636,671.53	636,671.53
其他负债	-	-	-	167,444.66	167,444.66
负债总计	-	-	-	927,491.61	927,491.61
利率敏感度缺口	28,716,843.92	14,703,331.54	9,838,915.19	20,977,259.16	74,236,349.81
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	889,805.68	-	-	-	889,805.68
结算备付金	195,673.57	-	-	-	195,673.57
存出保证金	7,689.16	-	-	-	7,689.16
交易性金融资产	28,231,244.71	15,820,616.44	7,471,480.47	22,657,434.64	74,180,776.26
买入返售金融资产	1,499,780.82	-	-	-	1,499,780.82
应收申购款	-	-	-	17,994.99	17,994.99
资产总计	30,824,193.94	15,820,616.44	7,471,480.47	22,675,429.63	76,791,720.48
负债					
应付赎回款	-	-	-	12,506.24	12,506.24
应付管理人报酬	-	-	-	46,848.48	46,848.48
应付托管费	-	-	-	16,731.60	16,731.60
应付清算款	-	-	-	499,561.64	499,561.64
应交税费	-	-	-	636,667.16	636,667.16
其他负债	-	-	-	280,156.07	280,156.07
负债总计	-	-	-	1,492,471.19	1,492,471.19
利率敏感度缺口	30,824,193.94	15,820,616.44	7,471,480.47	21,182,958.44	75,299,249.29

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的到期日予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）

	市场利率上升 25 个基点	490,000.00	-370,000.00
	市场利率下降 25 个基点	-470,000.00	390,000.00

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金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投资比例为基金资产净值的 0%-50%，债券为 20%-70%，货币市场工具为 5%-80%。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	21,899,321.18	29.50	22,657,434.64	30.09
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	21,899,321.18	29.50	22,657,434.64	30.09

#### 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%	860,000.00	1,010,000.00
	沪深 300 指数下降 5%	-860,000.00	-1,010,000.00

#### 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	22,451,300.82	22,657,434.64
第二层次	51,744,342.25	51,523,341.62

第三层次	-	-
合计	74,195,643.07	74,180,776.26

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换事项发生的当年年初为确认各层次之间转换的时点。

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

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	21,899,321.18	29.14
	其中：股票	21,899,321.18	29.14
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	52,296,321.89	69.58
	其中：债券	52,296,321.89	69.58
	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	956,436.29	1.27

8	其他各项资产	11,762.06	0.02
9	合计	75,163,841.42	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,118,930.00	1.51
C	制造业	14,026,194.58	18.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	191,810.00	0.26
E	建筑业	17,108.00	0.02
F	批发和零售业	312,802.00	0.42
G	交通运输、仓储和邮政业	163,538.40	0.22
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,844,271.20	2.48
J	金融业	2,594,438.40	3.49
K	房地产业	16,824.00	0.02
L	租赁和商务服务业	612,262.60	0.82
M	科学研究和技术服务业	647,150.00	0.87
N	水利、环境和公共设施管理业	15,480.00	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	212,840.00	0.29
R	文化、体育和娱乐业	125,672.00	0.17
S	综合	-	-
	合计	21,899,321.18	29.50

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	14,000	649,600.00	0.88
2	600036	招商银行	19,700	645,372.00	0.87
3	600690	海尔智家	25,100	589,348.00	0.79
4	601888	中国中免	4,600	508,438.00	0.68
5	603027	千禾味业	23,200	489,984.00	0.66
6	601899	紫金矿业	42,000	477,540.00	0.64

7	603259	药明康德	7,400	461,094.00	0.62
8	601658	邮储银行	91,400	446,946.00	0.60
9	688235	百济神州	3,977	433,930.47	0.58
10	000338	潍柴动力	34,600	431,116.00	0.58
11	600660	福耀玻璃	10,800	387,180.00	0.52
12	600519	贵州茅台	200	338,200.00	0.46
13	603309	维力医疗	21,600	334,152.00	0.45
14	000568	泸州老窖	1,500	314,355.00	0.42
15	601088	中国神华	10,000	307,500.00	0.41
16	002605	姚记科技	6,600	306,438.00	0.41
17	002460	赣锋锂业	4,200	256,032.00	0.34
18	601398	工商银行	48,100	231,842.00	0.31
19	000661	长春高新	1,600	218,080.00	0.29
20	300533	冰川网络	4,000	199,840.00	0.27
21	601288	农业银行	56,400	199,092.00	0.27
22	601138	工业富联	7,600	191,520.00	0.26
23	688111	金山办公	400	188,888.00	0.25
24	300624	万兴科技	1,600	187,440.00	0.25
25	600585	海螺水泥	7,400	175,676.00	0.24
26	000977	浪潮信息	3,600	174,600.00	0.24
27	002020	京新药业	12,200	156,404.00	0.21
28	002463	沪电股份	7,000	146,580.00	0.20
29	301239	普瑞眼科	1,400	137,312.00	0.18
30	603661	恒林股份	4,000	132,640.00	0.18
31	002763	汇洁股份	14,800	131,128.00	0.18
32	300394	天孚通信	1,200	128,196.00	0.17
33	603993	洛阳钼业	23,600	125,788.00	0.17
34	603757	大元泵业	4,200	125,328.00	0.17
35	603768	常青股份	7,000	124,390.00	0.17
36	688569	铁科轨道	2,895	121,792.65	0.16
37	605066	天正电气	12,800	120,448.00	0.16
38	603289	泰瑞机器	10,400	116,688.00	0.16
39	002478	常宝股份	15,600	116,220.00	0.16
40	300494	盛天网络	4,680	116,017.20	0.16
41	603238	诺邦股份	9,200	116,012.00	0.16
42	603283	赛腾股份	2,600	115,700.00	0.16
43	600612	老凤祥	1,600	111,808.00	0.15
44	300791	仙乐健康	3,800	110,352.00	0.15
45	603808	歌力思	8,400	110,292.00	0.15
46	002517	恺英网络	7,000	110,180.00	0.15
47	000063	中兴通讯	2,400	109,296.00	0.15
48	002867	周大生	6,000	106,680.00	0.14
49	601939	建设银行	16,400	102,664.00	0.14

50	300181	佐力药业	8,400	102,564.00	0.14
51	688037	芯源微	592	101,202.40	0.14
52	600702	舍得酒业	800	99,160.00	0.13
53	603129	春风动力	600	97,140.00	0.13
54	603639	海利尔	5,400	96,768.00	0.13
55	601965	中国汽研	4,600	94,990.00	0.13
56	688551	科威尔	1,400	91,812.00	0.12
57	603689	皖天然气	10,400	91,208.00	0.12
58	003011	海象新材	2,800	90,300.00	0.12
59	300896	爱美客	200	88,990.00	0.12
60	300866	安克创新	1,000	87,500.00	0.12
61	600197	伊力特	3,200	86,944.00	0.12
62	600602	云赛智联	5,600	84,336.00	0.11
63	002643	万润股份	4,800	83,568.00	0.11
64	002959	小熊电器	1,000	83,500.00	0.11
65	300354	东华测试	1,800	80,460.00	0.11
66	300622	博士眼镜	3,400	80,240.00	0.11
67	603303	得邦照明	5,800	80,098.00	0.11
68	002829	星网宇达	1,800	79,074.00	0.11
69	603878	武进不锈	9,320	78,754.00	0.11
70	002419	天虹股份	13,400	78,390.00	0.11
71	603466	风语筑	5,600	77,840.00	0.10
72	603383	顶点软件	1,400	77,588.00	0.10
73	002749	国光股份	6,800	77,044.00	0.10
74	603019	中科曙光	1,500	76,350.00	0.10
75	300408	三环集团	2,600	76,310.00	0.10
76	688793	倍轻松	1,415	76,268.50	0.10
77	301103	何氏眼科	1,800	75,528.00	0.10
78	002947	恒铭达	3,600	75,024.00	0.10
79	603040	新坐标	2,800	74,452.00	0.10
80	603517	绝味食品	2,000	74,300.00	0.10
81	603368	柳药集团	3,000	74,130.00	0.10
82	600129	太极集团	1,200	71,388.00	0.10
83	603556	海兴电力	2,800	70,672.00	0.10
84	603758	秦安股份	6,600	70,224.00	0.09
85	601728	中国电信	12,400	69,812.00	0.09
86	002942	新农股份	3,800	68,970.00	0.09
87	603688	石英股份	600	68,304.00	0.09
88	603508	思维列控	4,000	68,200.00	0.09
89	603551	奥普家居	5,200	67,236.00	0.09
90	300787	海能实业	3,400	66,980.00	0.09
91	301061	匠心家居	1,800	66,510.00	0.09
92	002345	潮宏基	8,400	66,024.00	0.09

93	688029	南微医学	800	65,248.00	0.09
94	002801	微光股份	2,400	64,944.00	0.09
95	603215	比依股份	3,600	64,584.00	0.09
96	688410	山外山	1,200	63,000.00	0.08
97	300768	迪普科技	3,800	62,966.00	0.08
98	300577	开润股份	3,800	61,902.00	0.08
99	601988	中国银行	15,600	60,996.00	0.08
100	603600	永艺股份	6,400	60,864.00	0.08
101	002929	润建股份	1,400	60,774.00	0.08
102	603339	四方科技	3,800	60,458.00	0.08
103	603327	福蓉科技	5,000	59,400.00	0.08
104	300304	云意电气	10,600	58,724.00	0.08
105	603115	海星股份	3,800	58,406.00	0.08
106	300638	广和通	2,560	58,060.80	0.08
107	603090	宏盛股份	2,600	57,850.00	0.08
108	603321	梅轮电梯	7,400	57,646.00	0.08
109	002223	鱼跃医疗	1,600	57,584.00	0.08
110	300532	今天国际	2,800	57,568.00	0.08
111	000997	新大陆	3,000	56,700.00	0.08
112	603365	水星家纺	4,000	56,240.00	0.08
113	300855	图南股份	1,580	55,805.60	0.08
114	300796	贝斯美	4,600	55,338.00	0.07
115	688257	新锐股份	2,080	55,140.80	0.07
116	688472	阿特斯	3,000	55,080.00	0.07
117	002782	可立克	3,600	55,044.00	0.07
118	601766	中国中车	8,400	54,600.00	0.07
119	603579	荣泰健康	2,600	54,392.00	0.07
120	603313	梦百合	5,400	54,162.00	0.07
121	603408	建霖家居	5,200	54,028.00	0.07
122	600261	阳光照明	14,800	54,020.00	0.07
123	600488	津药药业	9,600	53,952.00	0.07
124	002392	北京利尔	14,800	53,576.00	0.07
125	603968	醋化股份	3,000	53,280.00	0.07
126	688766	普冉股份	498	53,196.36	0.07
127	603928	兴业股份	4,400	53,108.00	0.07
128	603488	展鹏科技	6,600	52,998.00	0.07
129	603386	骏亚科技	4,600	52,210.00	0.07
130	300124	汇川技术	800	51,368.00	0.07
131	603367	辰欣药业	3,200	48,576.00	0.07
132	300231	银信科技	5,400	48,114.00	0.06
133	002560	通达股份	5,000	47,600.00	0.06
134	300775	三角防务	1,400	47,292.00	0.06
135	002011	盾安环境	3,400	47,022.00	0.06



136	688390	固德威	280	46,720.80	0.06
137	002322	理工能科	4,400	45,760.00	0.06
138	002367	康力电梯	5,000	45,650.00	0.06
139	301257	普蕊斯	800	44,960.00	0.06
140	002233	塔牌集团	5,800	44,776.00	0.06
141	300444	双杰电气	5,800	44,660.00	0.06
141	603515	欧普照明	2,200	44,660.00	0.06
143	603156	养元饮品	1,800	44,460.00	0.06
144	688295	中复神鹰	1,200	44,016.00	0.06
145	600583	海油工程	7,400	43,290.00	0.06
146	002948	青岛银行	13,800	43,194.00	0.06
147	600419	天润乳业	2,600	42,172.00	0.06
148	300002	神州泰岳	3,000	42,000.00	0.06
149	000552	甘肃能化	12,600	41,958.00	0.06
150	688387	信科移动	5,000	41,750.00	0.06
151	688297	中无人机	800	41,032.00	0.06
152	688305	科德数控	400	40,104.00	0.05
153	603277	银都股份	1,800	39,312.00	0.05
154	601211	国泰君安	2,800	39,172.00	0.05
155	600011	华能国际	4,200	38,892.00	0.05
156	301004	嘉益股份	1,000	38,800.00	0.05
157	002600	领益智造	5,600	38,696.00	0.05
158	300193	佳士科技	5,000	38,200.00	0.05
159	002027	分众传媒	5,600	38,136.00	0.05
160	688276	百克生物	600	37,560.00	0.05
161	002073	软控股份	5,600	37,072.00	0.05
162	603788	宁波高发	3,000	36,960.00	0.05
163	002149	西部材料	2,200	36,938.00	0.05
164	300371	汇中股份	2,800	36,680.00	0.05
165	002533	金杯电工	4,400	35,904.00	0.05
166	002540	亚太科技	6,200	35,836.00	0.05
167	603535	嘉诚国际	2,200	35,728.00	0.05
168	002106	莱宝高科	4,200	35,700.00	0.05
169	601958	金铝股份	3,200	35,680.00	0.05
170	002160	常铝股份	8,800	35,552.00	0.05
171	000541	佛山照明	6,200	35,402.00	0.05
172	001696	宗申动力	5,000	35,400.00	0.05
173	603871	嘉友国际	2,240	35,190.40	0.05
174	000923	河钢资源	2,600	35,100.00	0.05
175	300274	阳光电源	300	34,989.00	0.05
176	603385	惠达卫浴	4,600	34,638.00	0.05
177	002937	兴瑞科技	1,400	34,440.00	0.05
178	603948	建业股份	1,600	34,400.00	0.05

179	000543	皖能电力	5,200	34,320.00	0.05
180	601137	博威合金	2,200	34,232.00	0.05
181	000030	富奥股份	6,700	33,768.00	0.05
182	002852	道道全	2,600	33,618.00	0.05
183	605266	健之佳	400	33,532.00	0.05
184	603012	创力集团	5,400	33,318.00	0.04
185	600897	厦门空港	1,600	33,104.00	0.04
186	605006	山东玻纤	4,400	33,000.00	0.04
187	603366	日出东方	5,600	32,536.00	0.04
188	601003	柳钢股份	8,000	32,320.00	0.04
189	002448	中原内配	4,600	32,200.00	0.04
190	601818	光大银行	10,400	31,928.00	0.04
191	603855	华荣股份	1,200	31,920.00	0.04
191	605158	华达新材	4,200	31,920.00	0.04
193	300856	科思股份	400	31,508.00	0.04
194	603486	科沃斯	400	31,108.00	0.04
195	002603	以岭药业	1,200	30,828.00	0.04
195	600724	宁波富达	8,400	30,828.00	0.04
197	600312	平高电气	2,400	29,736.00	0.04
198	300314	戴维医疗	1,400	29,596.00	0.04
199	300308	中际旭创	200	29,490.00	0.04
200	002990	盛视科技	800	29,440.00	0.04
201	002397	梦洁股份	8,400	29,148.00	0.04
202	002612	朗姿股份	1,200	28,536.00	0.04
203	601857	中国石油	3,800	28,386.00	0.04
204	300631	久吾高科	800	27,984.00	0.04
205	003006	百亚股份	1,600	27,648.00	0.04
206	600863	内蒙华电	6,600	27,390.00	0.04
207	002402	和而泰	1,600	27,168.00	0.04
208	300726	宏达电子	600	26,832.00	0.04
209	603816	顾家家居	700	26,705.00	0.04
210	603949	雪龙集团	1,600	25,248.00	0.03
211	600218	全柴动力	2,800	25,088.00	0.03
211	603279	景津装备	800	25,088.00	0.03
213	002739	万达电影	2,000	25,080.00	0.03
214	605168	三人行	290	24,922.60	0.03
215	000060	中金岭南	5,200	24,700.00	0.03
216	002372	伟星新材	1,200	24,648.00	0.03
217	300978	东箭科技	1,800	24,534.00	0.03
218	000878	云南铜业	2,200	24,310.00	0.03
219	000777	中核科技	1,800	24,282.00	0.03
220	000999	华润三九	400	24,264.00	0.03
221	002818	富森美	1,800	23,814.00	0.03

222	300384	三联虹普	1,400	23,786.00	0.03
223	603619	中曼石油	1,400	23,688.00	0.03
224	601686	友发集团	3,400	23,256.00	0.03
225	601021	春秋航空	400	22,988.00	0.03
226	600828	茂业商业	6,200	22,940.00	0.03
227	002300	太阳电缆	2,600	22,854.00	0.03
228	603823	百合花	1,820	22,568.00	0.03
229	300724	捷佳伟创	200	22,470.00	0.03
230	002327	富安娜	2,600	21,892.00	0.03
231	002335	科华数据	600	21,570.00	0.03
232	002563	森马服饰	3,400	21,148.00	0.03
233	603421	鼎信通讯	2,000	20,900.00	0.03
234	002293	罗莱生活	1,800	20,700.00	0.03
235	603587	地素时尚	1,400	20,496.00	0.03
236	600060	海信视像	800	19,800.00	0.03
237	603577	汇金通	2,000	19,640.00	0.03
238	600481	双良节能	1,400	19,572.00	0.03
239	000938	紫光股份	600	19,110.00	0.03
239	600919	江苏银行	2,600	19,110.00	0.03
241	002955	鸿合科技	800	18,840.00	0.03
242	601916	浙商银行	7,020	18,532.80	0.02
243	688152	麒麟信安	200	18,456.00	0.02
244	002056	横店东磁	1,000	18,210.00	0.02
245	688626	翔宇医疗	400	18,204.00	0.02
246	688208	道通科技	600	18,186.00	0.02
247	300908	仲景食品	400	18,140.00	0.02
248	688357	建龙微纳	280	18,113.20	0.02
249	300465	高伟达	1,800	17,874.00	0.02
250	002912	中新赛克	400	17,604.00	0.02
251	605300	佳禾食品	800	17,392.00	0.02
252	002060	粤水电	2,600	17,108.00	0.02
253	002966	苏州银行	2,600	17,030.00	0.02
254	300130	新国都	600	16,998.00	0.02
255	002115	三维通信	2,600	16,952.00	0.02
256	000002	万科 A	1,200	16,824.00	0.02
257	688187	时代电气	400	16,744.00	0.02
258	000921	海信家电	600	16,170.00	0.02
259	002839	张家港行	3,800	16,074.00	0.02
260	002518	科士达	400	16,004.00	0.02
261	300009	安科生物	1,600	16,000.00	0.02
262	301039	中集车辆	1,200	15,876.00	0.02
263	603136	天目湖	600	15,480.00	0.02
264	002991	甘源食品	200	15,340.00	0.02

265	688288	鸿泉物联	600	15,252.00	0.02
266	601717	郑煤机	1,200	14,940.00	0.02
267	601006	大秦铁路	2,000	14,860.00	0.02
268	601336	新华保险	400	14,708.00	0.02
269	002568	百润股份	400	14,540.00	0.02
270	002429	兆驰股份	2,600	14,300.00	0.02
271	600229	城市传媒	1,600	13,632.00	0.02
272	300129	泰胜风能	1,400	13,426.00	0.02
273	002415	海康威视	400	13,244.00	0.02
274	605599	菜百股份	1,000	13,210.00	0.02
275	601998	中信银行	2,200	13,156.00	0.02
276	003029	吉大正元	400	12,980.00	0.02
277	002970	锐明技术	400	12,596.00	0.02
278	600016	民生银行	3,200	12,000.00	0.02
279	600926	杭州银行	1,000	11,750.00	0.02
280	300012	华测检测	600	11,700.00	0.02
281	688428	诺诚健华	1,000	11,550.00	0.02
282	601975	招商南油	3,800	10,868.00	0.01
283	601577	长沙银行	1,400	10,864.00	0.01
284	600161	天坛生物	400	10,860.00	0.01
285	603565	中谷物流	1,000	10,800.00	0.01
286	300161	华中数控	200	10,704.00	0.01
287	688315	诺禾致源	400	10,620.00	0.01
288	600901	江苏金租	2,520	10,407.60	0.01
289	603939	益丰药房	280	10,360.00	0.01
290	605009	豪悦护理	200	9,600.00	0.01
291	601928	凤凰传媒	800	9,120.00	0.01
292	600329	达仁堂	200	8,978.00	0.01

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	688235	百济神州	890,481.20	1.18
2	601888	中国中免	747,108.00	0.99
3	603027	千禾味业	721,321.00	0.96
4	600519	贵州茅台	716,828.00	0.95
5	600036	招商银行	629,337.00	0.84
6	603757	大元泵业	618,379.00	0.82
7	300896	爱美客	536,122.00	0.71
8	600348	华阳股份	513,470.00	0.68
9	002594	比亚迪	505,358.00	0.67
10	601838	成都银行	502,917.00	0.67

11	601939	建设银行	467,306.00	0.62
12	601088	中国神华	452,725.00	0.60
13	300129	泰胜风能	449,633.00	0.60
14	688111	金山办公	439,504.00	0.58
15	002714	牧原股份	436,776.00	0.58
16	002833	弘亚数控	433,436.00	0.58
17	603309	维力医疗	430,409.00	0.57
18	000983	山西焦煤	396,549.00	0.53
19	603259	药明康德	386,214.00	0.51
20	300624	万兴科技	386,036.00	0.51

注：“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000983	山西焦煤	676,708.00	0.90
2	002594	比亚迪	637,375.00	0.85
3	600348	华阳股份	636,495.00	0.85
4	600036	招商银行	581,632.00	0.77
5	600585	海螺水泥	536,922.00	0.71
6	300896	爱美客	532,369.00	0.71
7	601658	邮储银行	526,356.00	0.70
8	600377	宁沪高速	509,930.00	0.68
9	300274	阳光电源	494,385.00	0.66
10	002833	弘亚数控	493,610.00	0.66
11	601838	成都银行	487,956.00	0.65
12	601899	紫金矿业	486,741.00	0.65
13	603757	大元泵业	479,169.00	0.64
14	300129	泰胜风能	447,686.16	0.59
15	002839	张家港行	442,726.00	0.59
16	002714	牧原股份	436,742.00	0.58
17	601699	潞安环能	436,052.00	0.58
18	600546	山煤国际	430,134.65	0.57
19	601988	中国银行	425,491.00	0.57
20	000338	潍柴动力	423,095.00	0.56

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	92,400,856.15
--------------	---------------

卖出股票收入（成交）总额	94,088,898.76
--------------	---------------

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	35,082,184.02	47.26
2	央行票据	-	-
3	金融债券	16,657,881.43	22.44
	其中：政策性金融债	16,657,881.43	22.44
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）	556,256.44	0.75
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	52,296,321.89	70.45

## 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	210303	21 进出 03	100,000	10,153,213.11	13.68
2	019693	22 国债 28	60,000	6,086,970.41	8.20
3	018008	国开 1802	58,450	6,061,926.37	8.17
4	019536	16 国债 08	52,280	5,640,287.24	7.60
5	019670	22 国债 05	54,000	5,449,255.40	7.34

## 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

在报告期内，本基金未投资于股指期货。该策略符合基金合同的规定。

## 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

本基金本报告期末投资国债期货。

### 7.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国平安保险(集团)股份有限公司于 2022 年 8 月 22 日曾受到国家外汇管理局深圳市分局公开处罚；招商银行于 2022 年 9 月 9 日曾受到银保监会公开处罚，于 2022 年 8 月 31 日曾受到央行公开处罚。

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	6,332.47
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	5,429.59
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,762.06

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	127049	希望转 2	556,256.44	0.75

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
5,443	12,146.19	94,347.43	0.14	66,017,349.04	99.86

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	513,011.04	0.7760

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	-
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2005 年 4 月 5 日) 基金份额总额	545,863,991.51
本报告期期初基金份额总额	68,407,442.71
本报告期基金总申购份额	1,729,177.04
减：本报告期基金总赎回份额	4,024,923.28
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	66,111,696.47

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金没有召开份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

- 1、本报告期内基金管理人未发生重大人事变动。
- 2、本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。



#### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内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

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

#### 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 (%)	
开源证券	1	79,319,916.37	42.58	73,866.02	42.57	-
信达证券	1	32,771,433.10	17.59	30,521.19	17.59	-
国信证券	1	18,704,375.74	10.04	17,420.68	10.04	-
东兴证券	1	17,765,922.30	9.54	16,545.90	9.54	-
中金公司	1	17,025,084.75	9.14	15,855.91	9.14	-
民生证券	1	12,420,378.84	6.67	11,568.38	6.67	-
华泰证券	1	5,819,537.01	3.12	5,419.66	3.12	-
银河证券	1	1,711,302.16	0.92	1,593.66	0.92	-
财信证券	2	679,030.40	0.36	632.47	0.36	-
申万宏源	1	89,208.00	0.05	83.08	0.05	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-

湘财证券	4	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

注：（一）本基金本报告期撤销平安证券 063100、中信证券 089100 交易单元。

（二）交易单元选择的标准和程序

基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其席位作为基金的专用交易单元，选择的标准是：

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

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
开源证券	26,939,738.80	75.24	76,700,000.00	74.76	-	-
信达证券	578,398.80	1.62	-	-	-	-
国信证券	8,285,178.00	23.14	18,100,000.00	17.64	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	7,800,000.00	7.60	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
财信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
高华证	-	-	-	-	-	-

券						
光大证 券	-	-	-	-	-	-
国联证 券	-	-	-	-	-	-
国盛证 券	-	-	-	-	-	-
华鑫证 券	-	-	-	-	-	-
西南证 券	-	-	-	-	-	-
湘财证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
中投证 券	-	-	-	-	-	-
中银国 际	-	-	-	-	-	-

## § 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风险预算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