

宏利沪深 300 指数增强型证券投资基金 2024 年第 3 季度报告

2024 年 9 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

报告送出日期：2024 年 10 月 25 日

§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。

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 2024 年 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告期间为 2024 年 07 月 01 日至 2024 年 09 月 30 日。

§2 基金产品概况

基金简称	宏利沪深 300 指数	
基金主代码	162213	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 3 月 16 日	
报告期末基金份额总额	928,517,738.80 份	
投资目标	本基金为股票型指数增强基金，在对沪深 300 指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%，力争获取超越标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。	
投资策略	本基金采用指数增强型投资策略，在控制与比较基准偏离风险的前提下，综合利用多种量化投资模型和指数增强技术，力争获得超越业绩比较基准的投资收益。	
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×95%+同业存款利率×5%。	
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。	
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	
下属分级基金的基金简称	宏利沪深 300 指数 A	宏利沪深 300 指数 C
下属分级基金的交易代码	162213	003548
报告期末下属分级基金的份额总额	663,768,890.69 份	264,748,848.11 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2024 年 7 月 1 日-2024 年 9 月 30 日）	
	宏利沪深 300 指数 A	宏利沪深 300 指数 C
1. 本期已实现收益	-44,546,394.02	-15,918,023.63
2. 本期利润	135,936,561.70	54,116,854.11
3. 加权平均基金份额本期利润	0.2236	0.2484
4. 期末基金资产净值	1,149,690,307.59	453,470,246.14
5. 期末基金份额净值	1.7321	1.7128

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。

3.2 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

宏利沪深 300 指数 A

阶段	净值增长率①	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
过去三个月	13.92%	1.40%	15.25%	1.51%	-1.33%	-0.11%
过去六个月	12.58%	1.11%	12.92%	1.19%	-0.34%	-0.08%
过去一年	8.95%	0.99%	8.53%	1.05%	0.42%	-0.06%
过去三年	-14.09%	1.01%	-16.43%	1.04%	2.34%	-0.03%
过去五年	27.81%	1.10%	5.59%	1.12%	22.22%	-0.02%
自基金合同生效起至今	32.25%	1.16%	-1.10%	1.17%	33.35%	-0.01%

宏利沪深 300 指数 C

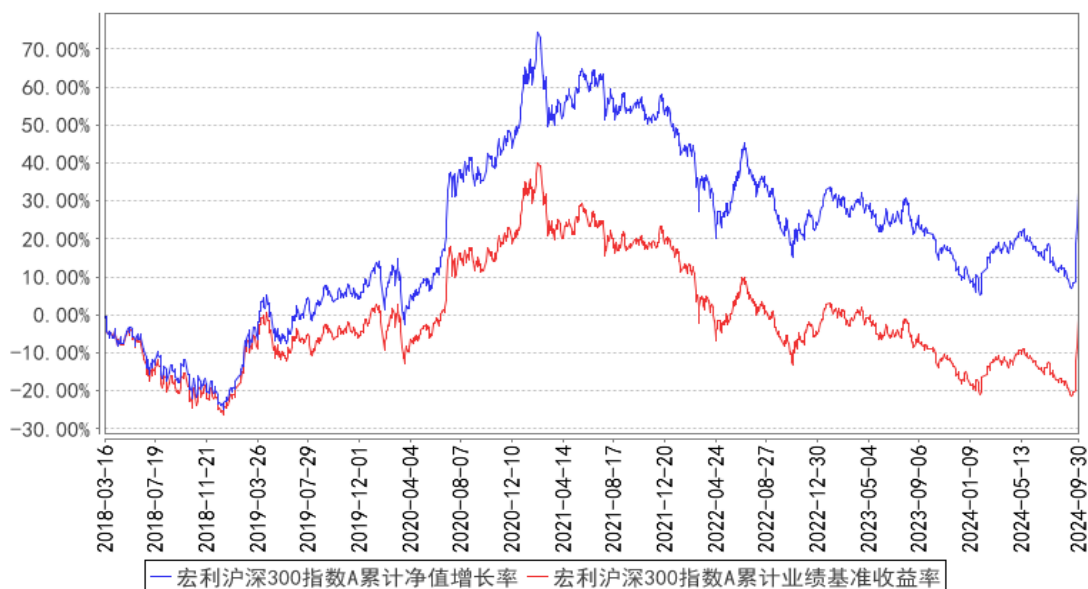
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	13.83%	1.40%	15.25%	1.51%	-1.42%	-0.11%

过去六个月	12.41%	1.11%	12.92%	1.19%	-0.51%	-0.08%
过去一年	8.64%	0.99%	8.53%	1.05%	0.11%	-0.06%
过去三年	-14.86%	1.01%	-16.43%	1.04%	1.57%	-0.03%
过去五年	25.92%	1.10%	5.59%	1.12%	20.33%	-0.02%
自基金合同生效起至今	30.25%	1.16%	-1.10%	1.17%	31.35%	-0.01%

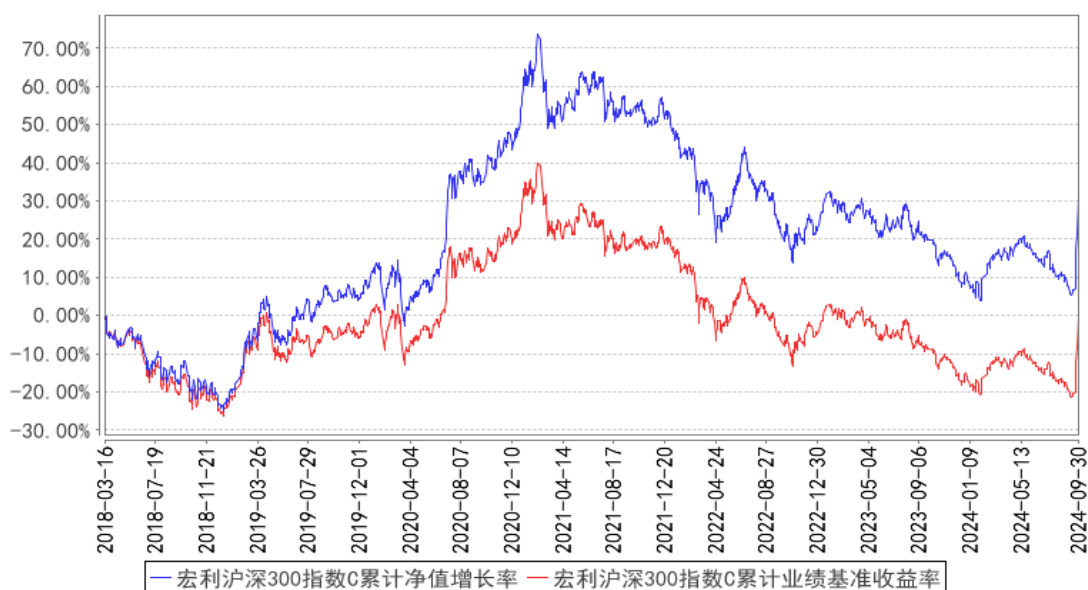
注：本基金业绩比较基准： $95\% \times$ 沪深 300 指数收益率 $+5\% \times$ 同业存款利率。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

宏利沪深300指数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



宏利沪深300指数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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李婷婷	本基金基金经理	2024年7月30日	-	7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，现任策略投资部基金经理。具备7年基金从业经验，具有基金从业资格。
刘洋	资深基金经理	2019年1月9日	-	9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，历任于金融工程部，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、策略投资部副总经理等职务，现任策略投资部资深基金经理；具备9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 公平交易专项说明

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。在本报告期内，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 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度市场主体处于回调阶段，指数年内再次探底，成交量明显萎缩，交易情绪处于阶段性低点。市场风格出现一定变化，高分红、大盘价值风格在三季度回撤，或因板块内部拥挤度达到较高水平，同时对应部分行业半年报数据欠佳，或现货价格出现下跌等。另一方面小微盘风格得到喘息机会，三季度行情保持稳定，具有一定超额收益。9月下旬随着美联储如期降息，国内政策空间相对更加乐观，同时人民币汇率回升，交易情绪得到修正，反弹行情有望持续。

本基金在操作中恪守基金合同，采用指数增强策略，严格控制跟踪误差及其他风险属性。使用量化选股手段，挑选盈利质量高、盈利能力强、估值合理的大盘蓝筹股票。选股因子偏好长期稳定有效的基本面因子，有效降低组合换手率与交易成本。持仓结构分散以控制个股风险，仓位保持合理稳定。本报告期内，本基金增加了医药、非银行金融、交通运输的配置，减少了计算机、基础化工、房地产的配置。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截止至本报告期末宏利沪深 300 指数 A 基金份额净值为 1.7321 元,本报告期基金份额净值增长率为 13.92%;截止至本报告期末宏利沪深 300 指数 C 基金份额净值为 1.7128 元,本报告期基金份额净值增长率为 13.83%;同期业绩比较基准收益率为 15.25%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,484,610,304.76	92.23
	其中:股票	1,484,610,304.76	92.23
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	88,019,718.26	5.47
8	其他资产	37,040,880.33	2.30
9	合计	1,609,670,903.35	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	16,083,622.00	1.00
B	采矿业	74,639,432.14	4.66
C	制造业	686,393,913.69	42.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	54,635,613.50	3.41
E	建筑业	24,834,680.00	1.55
F	批发和零售业	3,159,597.00	0.20
G	交通运输、仓储和邮政业	62,340,370.21	3.89
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	82,728,382.00	5.16
J	金融业	358,176,964.94	22.34
K	房地产业	6,865,781.00	0.43
L	租赁和商务服务业	26,688,487.40	1.66
M	科学研究和技术服务业	17,846,487.12	1.11
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,414,393,331.00	88.23

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	64,397,672.46	4.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	65,704.00	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	171,717.00	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	258,856.00	0.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,547,059.62	0.28
J	金融业	661,777.00	0.04
K	房地产业	33,108.00	0.00
L	租赁和商务服务业	37,818.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	43,261.68	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	70,216,973.76	4.38

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	600519	贵州茅台	44,725	78,179,300.00	4.88
2	300750	宁德时代	250,470	63,090,888.30	3.94
3	601318	中国平安	850,781	48,571,087.29	3.03
4	600900	长江电力	1,192,250	35,827,112.50	2.23
5	601166	兴业银行	1,854,150	35,729,470.50	2.23
6	002594	比亚迪	115,570	35,515,816.70	2.22
7	600036	招商银行	915,335	34,425,749.35	2.15
8	600276	恒瑞医药	625,100	32,692,730.00	2.04
9	600030	中信证券	1,199,100	32,615,520.00	2.03
10	000651	格力电器	588,695	28,222,038.30	1.76

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	603328	依顿电子	1,107,500	10,211,150.00	0.64
2	603227	雪峰科技	752,800	6,300,936.00	0.39
3	301236	软通动力	69,000	3,554,880.00	0.22
4	688281	华秦科技	36,760	3,414,268.80	0.21
5	688212	澳华内镜	69,533	3,400,163.70	0.21

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货持仓和损益明细。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的，将利用股指期货剥离多头股票资产部分的系统性风险或建立适当的股指期货多头头寸对冲市场向上风险。

基金经理根据市场的变化、现货市场与期货市场的相关性等因素，计算需要用到的期货合约数量，对这个数量进行动态跟踪与测算，并进行适时灵活调整。同时，综合考虑各个月份期货合约之间的定价关系、套利机会、流动性以及保证金要求等因素，在各个月份期货合约之间进行动态配置，通过空头部分的优化创造额外收益。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货持仓和损益明细。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期没有投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本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，中信证券股份有限公司于 2024 年 1 月 5 日曾受到中国证监会公开处罚。招商银行股份有限公司于 2023 年 11 月 27 日曾受到国家外汇管理局深圳市分局公开处罚，于 2023 年 12 月 13 日曾受到国家金融监督管理总局深圳监管局公开处罚，于 2024 年 6 月 24 日曾受到国家金融监督管理总局公开处罚。兴业银行股份有限公司于 2024 年 7 月 17 日曾受到国家金融监督管理总局福建监管局公开处罚。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情

形。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	438,315.88
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	36,602,564.45
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	37,040,880.33

5.11.4 报告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有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	宏利沪深 300 指数 A	宏利沪深 300 指数 C
报告期期初基金份额总额	495,797,131.69	122,378,049.87
报告期期间基金总申购份额	214,305,065.50	239,780,595.04
减：报告期期间基金总赎回份额	46,333,306.50	97,409,796.80
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	663,768,890.69	264,748,848.11

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金的管理人在本报告期内未发生持有本基金份额变动的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金的管理人在本报告期内未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，基金管理人于 2024 年 8 月 13 日发布《宏利基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告》，公司总经理（法定代表人）、财务负责人由高贵鑫先生变更为 DING WEN CONG（丁闻聪）先生。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准本基金设立的文件；
- 2、《宏利沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《宏利沪深 300 指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《宏利沪深 300 指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

9.3 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。

宏利基金管理有限公司

2024 年 10 月 25 日