

宏利价值优化型稳定类行业混合型证券投资 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

| | |
|---|-----------|
| § 1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示 | 2 |
| 1.2 目录 | 3 |
| § 2 基金简介 | 5 |
| 2.1 基金基本情况 | 5 |
| 2.2 基金产品说明 | 5 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人 | 5 |
| 2.4 信息披露方式 | 6 |
| 2.5 其他相关资料 | 6 |
| § 3 主要财务指标和基金净值表现 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 6 |
| 3.2 基金净值表现 | 6 |
| § 4 管理人报告 | 8 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 8 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 | 9 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 9 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 | 10 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 10 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 11 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 11 |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 | 11 |
| § 5 托管人报告 | 12 |
| 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 |
| § 6 半年度财务会计报告（未经审计） | 12 |
| 6.1 资产负债表 | 12 |
| 6.2 利润表 | 13 |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表 | 15 |
| 6.4 报表附注 | 17 |
| § 7 投资组合报告 | 40 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 40 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 40 |
| 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 | 41 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 43 |
| 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 | 47 |
| 7.12 投资组合报告附注 | 47 |
| §8 基金份额持有人信息..... | 48 |
| 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 |
| §9 开放式基金份额变动..... | 48 |
| §10 重大事件揭示 | 48 |
| 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 |
| 10.8 其他重大事件 | 51 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息 | 51 |
| 11.1 影响投资者决策的其他重要信息 | 51 |
| §12 备查文件目录 | 52 |
| 12.1 备查文件目录 | 52 |
| 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 | 宏利价值优化型稳定类行业混合型证券投资基金 |
| 基金简称 | 宏利稳定混合 |
| 基金主代码 | 162203 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2003 年 4 月 25 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 | 144,563,310.47 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 本基金主要投资于稳定行业类别中内在价值被相对低估，并与同行业类别上市公司相比具有更高增长潜力的上市公司。在有效控制投资组合风险的前提下，为基金份额持有人提供长期稳定的投资回报。 |
| 投资策略 | 采用“自上而下”的投资方法，具体体现在资产配置、行业配置和个股选择的全过程中。 |
| 业绩比较基准 | 65%×富时中国 A600 稳定行业指数+35%×上证国债指数。 |
| 风险收益特征 | 本基金在证券投资基金中属于较高风险的基金品种。 |

注：本基金管理人于 2023 年 7 月 29 日发布《宏利基金管理有限公司关于宏利价值优化型成长类行业混合型证券投资基金、周期类行业混合型证券投资基金、稳定类行业混合型证券投资基金业绩比较基准变更并修订招募说明书的公告》，自 2023 年 8 月 1 日起，本基金的业绩比较基准更改为 10%×中信稳定风格指数+40%×中信消费风格指数+15%×中信金融风格指数+35%×上证国债指数。

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 |
| | 联系电话 | 66577766 |
| | 电子邮箱 | irm@manulifefund.com.cn |
| 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 | 中国证券报 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | https://www.manulifefund.com.cn |
| 基金中期报告备置地点 | 基金管理人、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 | -19,614,690.26 |
| 本期利润 | -30,707,338.29 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.2080 |
| 本期加权平均净值利润率 | -10.65% |
| 本期基金份额净值增长率 | -10.72% |
| 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 | 110,238,946.64 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.7626 |
| 期末基金资产净值 | 254,802,257.11 |
| 期末基金份额净值 | 1.7626 |
| 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 | 811.33% |

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 | -2.14% | 1.27% | -0.17% | 2.14% | -1.97% | -0.87% |

| | | | | | | |
|------------|---------|-------|---------|-------|---------|--------|
| 过去三个月 | -10.76% | 1.17% | -1.26% | 1.29% | -9.50% | -0.12% |
| 过去六个月 | -10.72% | 1.03% | -1.26% | 0.97% | -9.46% | 0.06% |
| 过去一年 | -25.06% | 1.05% | -8.70% | 0.83% | -16.36% | 0.22% |
| 过去三年 | -4.00% | 1.27% | -0.23% | 0.82% | -3.77% | 0.45% |
| 自基金合同生效起至今 | 811.33% | 1.34% | 224.02% | 1.05% | 587.31% | 0.29% |

注：本基金业绩比较基准： $65\% \times$ 富时中国 A600 稳定行业指数 $+35\% \times$ 上证国债指数。

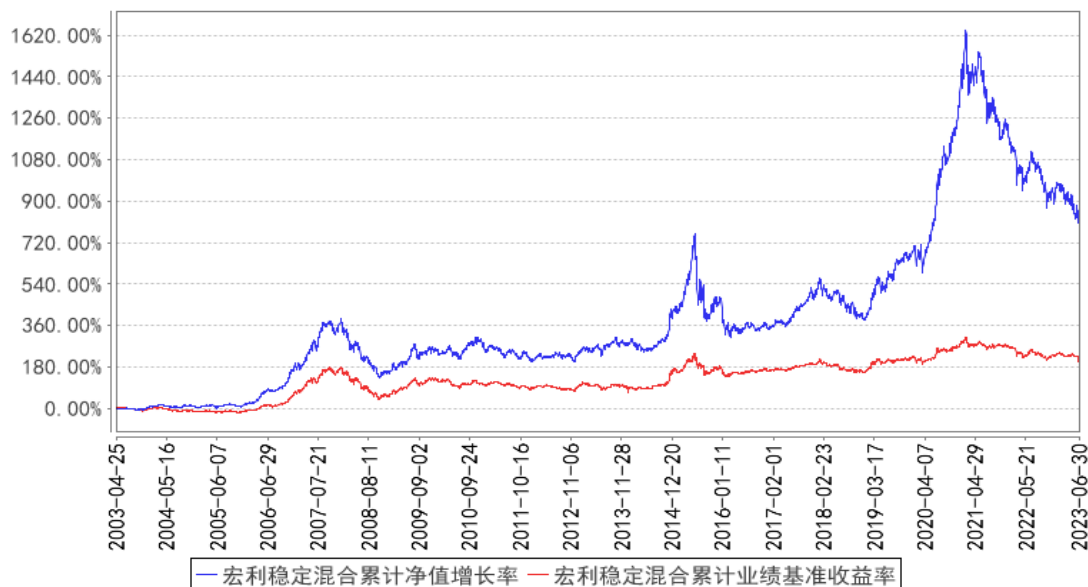
上证国债指数选取的样本为在上海证券交易所上市交易的、除浮息债外的国债品种，样本国债的剩余期限分布均匀，收益率曲线较为完整、合理，而且参与主体丰富，竞价交易连续性更强，能反映出市场利率的瞬息变化，客观、真实地标示出利率市场整体的收益风险度。

富时中国 A600 稳定行业指数是从富时中国 A600 行业指数中重新归类而成，成份股按照全球公认并已广泛采用的富时指数全球行业分类系统进行分类，全面体现稳定行业类别的风险收益特征。

自 2023 年 8 月 1 日起，本基金的业绩比较基准更改为 $10\% \times$ 中信稳定风格指数 $+40\% \times$ 中信消费风格指数 $+15\% \times$ 中信金融风格指数 $+35\% \times$ 上证国债指数。

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

宏利稳定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 | | |
| 邱楠宇 | 本基金基金经理 | 2021 年 12 月 29 日 | - | 8 年 | 金融学硕士研究生；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，现任基金经理。具备 8 年基金从业经验，具有基金从业资格。 |
| 刘欣 | 总经理助理兼基金经理 | 2020 年 11 月 19 日 | 2023 年 3 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

2023 年上半年市场波动较大，结构性行情为主。二季度以来，板块间表现分化巨大，TMT、家电、机械、电力正收益靠前，超额收益较为明显，而与经济恢复相关的地产链、消费跌幅领先。我们的观点是，首先，当前宏观经济和市场经历从年初的“强预期、弱现实”转向“弱预期、弱现实”，导致消费医疗和地产产业链回落明显。但经济的复苏方向是有信心的，只是恢复需要一定的时间，因此随着估值的回落过多，又会逐步价值修复。其次，TMT 板块的强势崛起，背后是 AI 科技的爆发和快速迭代带来了新的产业趋势，这对于 TMT 行业的未来将产生新的、巨大的机会和变化。

作为大类行业基金，根据合同规定，需要重点投资于具有稳定特征的食品饮料、大金融、交通运输、农林牧渔、电力公用事业、服务业等领域，本基金的操作正是严格遵守合同行业规定的。受限于可投行业范围，配置策略上会更倾向于适当降低预期回报率下追求绝对收益。投资思路，自上而下与自下而上相配合，重点以行业比较和精选个股为思路。回顾二季度操作，结构上，在估值修复合理后，对于业绩好的消费龙头、底部反转的保险行业增加配置较多，适当建仓底部逐渐改善的电力农业，个股上集中在需求端表现较好、一季报占优的方向。同时在维持非银的配置基础上，在符合产品规定的情况下，适当配置了类消费属性的部分优质传媒个股。

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 1.7626 元；本报告期基金份额净值增长率为-10.72%，业绩比较基准收益率为-1.26%。

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，维持前期观点，对市场依然长期看好、充满信心，具体到年内的市场而言，保持

乐观、降低预期。此前判断年内行情有两大因子，其一是国内的政策落地力度和效果，其二是海外风险演绎情况。近期我们观测到国内政策正在显露出效果，经济逐步恢复的方向没有改变；而国外的美国经济正经历高通胀的压力，俄乌战争进入僵持阶段，相较之下国内经济和市场的演绎方向机会大于风险。因此我们依然对国内市场保持乐观和信心。

市场对于经济修复的预期是容易偏激的，年初过于乐观，当下过于悲观，但不改经济修复的趋势，其中消费中有相当优质公司既表现出优异的业绩，估值又回落到较低的水平，因此越发具有中长期配置价值。

基于基金合同与投资观点，我们的配置在上述行业范围内，会根据对宏观经济、行业比较、公司发展的研究和判断，动态配置具备比较优势的板块，重点集中优势龙头公司。

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合规守信情况声明

本报告期内，基金托管人在宏利价值优化型稳定类行业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合规守信、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价值优化型稳定类行业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价值优化型稳定类行业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：宏利价值优化型稳定类行业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 |
|------------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 1,983,132.46 | 8,413,886.28 |
| 结算备付金 | | 2,189,549.30 | 2,610,271.78 |
| 存出保证金 | | 135,514.79 | 205,503.29 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 300,157,292.61 | 341,121,059.59 |
| 其中：股票投资 | | 232,238,732.52 | 273,035,421.04 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 67,918,560.09 | 68,085,638.55 |
| 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 | | 2,719,761.86 | 1,261,680.13 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 50,983.29 | 75,917.64 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.8 | - | - |
| 资产总计 | | 307,236,234.31 | 353,688,318.71 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2023年6月30日 | 上年度末 2022年12月31日 |
| 负债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | 51,017,121.12 | 53,039,858.90 |
| 应付清算款 | | - | 1,643,368.09 |
| 应付赎回款 | | 11,486.81 | 23,438.47 |
| 应付管理人报酬 | | 324,856.95 | 381,324.64 |
| 应付托管费 | | 54,142.83 | 63,554.10 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | 516.80 | 516.80 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.9 | 1,025,852.69 | 854,739.57 |
| 负债合计 | | 52,433,977.20 | 56,006,800.57 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.10 | 144,563,310.47 | 150,778,062.70 |
| 其他综合收益 | 6.4.7.11 | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.12 | 110,238,946.64 | 146,903,455.44 |
| 净资产合计 | | 254,802,257.11 | 297,681,518.14 |
| 负债和净资产总计 | | 307,236,234.31 | 353,688,318.71 |

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.7626 元，基金份额总额 144,563,310.47 份。

6.2 利润表

会计主体：宏利价值优化型稳定类行业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 |
|------------------------|------------|--|---|
| 一、营业总收入 | | -27,471,174.32 | -31,456,958.00 |
| 1. 利息收入 | | 48,596.78 | 62,311.45 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.13 | 48,596.78 | 62,311.45 |
| 债券利息收入 | | - | - |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | - | - |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | -16,434,991.03 | -37,493,419.65 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.14 | -19,508,928.64 | -40,776,618.23 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.15 | 321,517.61 | 887,579.19 |
| 资产支持证券投资 | 6.4.7.16 | - | - |
| 收益 | | | |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.17 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.18 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.19 | 2,752,420.00 | 2,395,619.39 |
| 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 | -11,092,648.03 | 5,948,127.50 |
| 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 | 7,867.96 | 26,022.70 |
| 减：二、营业总支出 | | 3,236,163.97 | 3,697,169.07 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 2,150,803.90 | 2,595,916.64 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 358,467.28 | 432,652.77 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | - | - |
| 4. 投资顾问费 | | - | - |
| 5. 利息支出 | | 657,974.22 | 599,216.09 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 657,974.22 | 599,216.09 |
| 6. 信用减值损失 | 6.4.7.22 | - | - |
| 7. 税金及附加 | | - | - |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.23 | 68,918.57 | 69,383.57 |

| | | | |
|---------------------|--|----------------|----------------|
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -30,707,338.29 | -35,154,127.07 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -30,707,338.29 | -35,154,127.07 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | -30,707,338.29 | -35,154,127.07 |

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：宏利价值优化型稳定类行业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） | 150,778,062.70 | - | 146,903,455.44 | 297,681,518.14 |
| 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） | 150,778,062.70 | - | 146,903,455.44 | 297,681,518.14 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -6,214,752.23 | - | -36,664,508.80 | -42,879,261.03 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | -30,707,338.29 | -30,707,338.29 |
| （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） | -6,214,752.23 | - | -5,957,170.51 | -12,171,922.74 |
| 其中：1. 基金申购款 | 4,384,012.29 | - | 4,139,834.24 | 8,523,846.53 |
| 2. 基金赎回款 | -10,598,764.52 | - | -10,097,004.75 | -20,695,769.27 |
| （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) | 144,563,310.47 | - | 110,238,946.64 | 254,802,257.11 |
| 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) | 156,571,752.44 | - | 246,549,147.61 | 403,120,900.05 |
| 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) | 156,571,752.44 | - | 246,549,147.61 | 403,120,900.05 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | -4,995,462.33 | - | -41,628,225.10 | -46,623,687.43 |
| (一)、综合收益总额 | - | - | -35,154,127.07 | -35,154,127.07 |
| (二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列) | -4,995,462.33 | - | -6,474,098.03 | -11,469,560.36 |
| 其中: 1. 基金申购款 | 9,302,002.04 | - | 11,807,022.28 | 21,109,024.32 |
| 2. 基金赎回款 | -14,297,464.37 | - | -18,281,120.31 | -32,578,584.68 |
| (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) | 151,576,290.11 | - | 204,920,922.51 | 356,497,212.62 |

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：

| | | |
|------------|-----------|-----------|
| <u>高贵鑫</u> | <u>王泉</u> | <u>石楠</u> |
| 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

宏利价值优化型系列行业类别证券投资基金(以下简称“本系列基金”，原湘财合丰价值优化型系列行业类别开放式证券投资基金，后更名为泰达荷银价值优化型系列行业类别证券投资基金，后更名为泰达宏利价值优化型系列行业类别证券投资基金)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[2003]第 21 号《关于同意湘财合丰价值优化型成长类行业证券投资基金、周期类行业证券投资基金、稳定类行业证券投资基金设立的批复》核准，由基金发起人湘财合丰基金管理有限公司(于 2004 年 1 月 9 日更名为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《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《湘财合丰价值优化型成长类行业证券投资基金、周期类行业证券投资基金、稳定类行业证券投资基金基金契约》发起，并于 2003 年 4 月 25 日募集成立。

本系列基金的基金名称于 2004 年 10 月 13 日改为湘财合丰价值优化型成长类行业证券投资基金、周期类行业证券投资基金、稳定类行业证券投资基金，于 2006 年 6 月 6 日改为泰达荷银价值优化型成长类行业证券投资基金、周期类行业证券投资基金、稳定类行业证券投资基金。根据本系列基金的基金管理人 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》，本系列基金自公告发布之日起更名为泰达宏利价值优化型成长类行业证券投资基金、周期类行业证券投资基金、稳定类行业证券投资基金。根据 2014 年中国证监会令 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》，本系列基金于 2015 年 7 月 22 日公告后更名为泰达宏利价值优化型成长类行业混合型证券投资基金、周期类行业混合型证券投资基金、稳定类行业混合型证券投资基金。根据本系列基金的基金管理人 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》，本系列基金自 2023 年 6 月 20 日起更名为宏利价值优化型成长类行业混合型证券投资基金、周期类行业混合型证券投资基金、稳定类行业混合型证券投资基金。

本系列基金为契约型开放式，存续期限不定，目前下设三个子基金，分别为宏利价值优化型

稳定类行业混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)、宏利价值优化型成长类行业混合型证券投资基金和宏利价值优化型周期类行业混合型证券投资基金。本系列基金首次设立募集不包括认购资金利息共募集 2,630,119,050.77 元,其中包括本基金 981,354,890.63 元、宏利价值优化型成长类行业混合型证券投资基金 1,021,628,749.98 元和宏利价值优化型周期类行业混合型证券投资基金 627,135,410.16 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道验字(2003)第 50 号验资报告予以验证。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”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《宏利价值优化型成长类行业混合型证券投资基金、周期类行业混合型证券投资基金、稳定类行业混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本系列基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票和债券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中股票投资部分分别主要投资于成长、稳定、周期三个行业类别中依据市净率和市盈率与每股预期收益增长率之比所确定的具有增长潜力的价值优化型股票。每只行业类别基金投资于股票、债券的比重不低于该基金资产总值的 80%,投资于国债的比重不低于该基金资产净值的 20%。本基金的业绩比较基准为:富时中国 A600 稳定行业指数×65%+上证国债指数×35%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《宏利价值优化型成长类行业混合型证券投资基金、周期类行业混合型证券投资基金、稳定类行业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 | 1,983,132.46 |
| 等于：本金 | 1,982,825.38 |
| 加：应计利息 | 307.08 |
| 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 | 1,983,132.46 |

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 | 248,691,321.95 | - | 232,238,732.52 | -16,452,589.43 | |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - | - | |
| 债券 | 交易所市场 | 67,106,739.00 | 632,340.09 | 67,918,560.09 | 179,481.00 |
| | 银行间市场 | - | - | - | - |
| | 合计 | 67,106,739.00 | 632,340.09 | 67,918,560.09 | 179,481.00 |
| 资产支持证券 | - | - | - | - | |
| 基金 | - | - | - | - | |

| | | | | |
|----|----------------|------------|----------------|----------------|
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 315,798,060.95 | 632,340.09 | 300,157,292.61 | -16,273,108.43 |

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 | 21.47 |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | 967,242.65 |
| 其中：交易所市场 | 967,242.65 |
| 银行间市场 | - |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 58,588.57 |
| 合计 | 1,025,852.69 |

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 | 150,778,062.70 | 150,778,062.70 |
| 本期申购 | 4,384,012.29 | 4,384,012.29 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -10,598,764.52 | -10,598,764.52 |
| 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 | 144,563,310.47 | 144,563,310.47 |

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 | 181,530,200.32 | -34,626,744.88 | 146,903,455.44 |
| 本期利润 | -19,614,690.26 | -11,092,648.03 | -30,707,338.29 |
| 本期基金份额交易产 | -7,276,810.90 | 1,319,640.39 | -5,957,170.51 |

| | | | |
|----------|----------------|----------------|----------------|
| 生的变动数 | | | |
| 其中：基金申购款 | 5,081,849.19 | -942,014.95 | 4,139,834.24 |
| 基金赎回款 | -12,358,660.09 | 2,261,655.34 | -10,097,004.75 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 154,638,699.16 | -44,399,752.52 | 110,238,946.64 |

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 | | 28,624.10 |
| 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 | | 18,707.19 |
| 其他 | | 1,265.49 |
| 合计 | | 48,596.78 |

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 | | -19,508,928.64 |
| 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 | | -19,508,928.64 |

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 | | 993,528,011.61 |
| 减：卖出股票成本总额 | | 1,010,052,395.29 |
| 减：交易费用 | | 2,984,544.96 |
| 买卖股票差价收入 | | -19,508,928.64 |

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期末有股票投资收益-证券出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|------------------------------|----------------------|
| | 2023年1月1日至2023年6月30日 |
| 债券投资收益——利息收入 | 749,919.06 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | -428,401.45 |
| 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 | 321,517.61 |

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|------------------------|----------------------|
| | 2023年1月1日至2023年6月30日 |
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 68,374,503.27 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 67,787,581.73 |
| 减：应计利息总额 | 1,015,322.99 |
| 减：交易费用 | - |
| 买卖债券差价收入 | -428,401.45 |

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 | 2,752,420.00 |
| 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 | 2,752,420.00 |

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 | -11,092,648.03 |
| 股票投资 | -11,615,900.36 |
| 债券投资 | 523,252.33 |
| 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 | -11,092,648.03 |

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 | 7,686.93 |
| 基金转换费收入 | 181.03 |
| 合计 | 7,867.96 |

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，本系列基金各行业类别在基金间免费转换。

6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期未有信用减值损失。

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 | 19,835.79 |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行费用 | 730.00 |
| 账户维护费 | 18,000.00 |
| 其他 | 600.00 |
| 合计 | 68,918.57 |

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

本基金本报告期未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 | 2,150,803.90 | 2,595,916.64 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 667,276.33 | 772,350.64 |

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 1.5% 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 × 1.5% / 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 | 358,467.28 | 432,652.77 |

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 | 1,983,132.46 | 28,624.10 | 10,738,530.90 | 37,869.27 |

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 |
| 688343 | 云天励飞 | 2023年3月28日 | 1-6个月（含） | 新股流通受限 | 43.92 | 50.67 | 4,160 | 182,707.20 | 210,787.20 | - |
| 688539 | 高华科技 | 2023年4月11日 | 1-6个月（含） | 新股流通受限 | 38.22 | 43.49 | 3,520 | 134,534.40 | 153,084.80 | - |
| 001286 | 陕西能源 | 2023年3月31日 | 1-6个月（含） | 新股流通受限 | 9.60 | 9.41 | 3,767 | 36,163.20 | 35,447.47 | - |
| 688249 | 晶合集成 | 2023年4月24日 | 1-6个月（含） | 新股流通受限 | 19.86 | 18.06 | 1,481 | 29,412.66 | 26,746.86 | - |
| 301293 | 三博脑科 | 2023年4月25日 | 1-6个月（含） | 新股流通受限 | 29.60 | 71.42 | 236 | 6,985.60 | 16,855.12 | - |
| 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 | 619 | 12,794.73 | 16,199.23 | - |
| 301325 | 曼恩斯特 | 2023年5月4日 | 1-6个月（含） | 新股流通受限 | 76.80 | 107.95 | 137 | 10,521.60 | 14,789.15 | - |
| 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 | 344 | 8,176.88 | 14,754.16 | - |
| 688478 | 晶 | 2023 | 1-6个月 | 新股 | 32.52 | 42.37 | 317 | 10,308.84 | 13,431.29 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|-----------------|-----------|--------|--------|--------|-----|-----------|-----------|---|
| | 升股份 | 年 4 月 13 日 | 月(含) | 流通受限 | | | | | | |
| 688531 | 日联科技 | 2023 年 3 月 24 日 | 1-6 个月(含) | 新股流通受限 | 152.38 | 135.97 | 81 | 12,342.78 | 11,013.57 | - |
| 301360 | 荣旗科技 | 2023 年 4 月 17 日 | 1-6 个月(含) | 新股流通受限 | 71.88 | 92.60 | 118 | 8,481.84 | 10,926.80 | - |
| 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 | 605 | 9,825.20 | 10,254.75 | - |
| 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 | 220 | 12,830.40 | 9,979.20 | - |
| 688352 | 顾中科技 | 2023 年 4 月 11 日 | 1-6 个月(含) | 新股流通受限 | 12.10 | 12.07 | 823 | 9,958.30 | 9,933.61 | - |
| 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 | 259 | 9,362.85 | 9,875.67 | - |
| 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 | 433 | 12,448.75 | 9,101.66 | - |
| 001287 | 中电港 | 2023 年 3 月 30 日 | 1-6 个月(含) | 新股流通受限 | 11.88 | 21.02 | 429 | 5,096.52 | 9,017.58 | - |
| 688552 | 航天南湖 | 2023 年 5 月 8 日 | 1-6 个月(含) | 新股流通受限 | 21.17 | 23.50 | 359 | 7,600.03 | 8,436.50 | - |
| 688581 | 安杰思 | 2023 年 5 月 12 日 | 1-6 个月(含) | 新股流通受限 | 125.80 | 118.03 | 71 | 8,931.80 | 8,380.13 | - |
| 688484 | 南 | 2023 | 1-6 个 | 新股 | 39.99 | 36.71 | 225 | 8,997.75 | 8,259.75 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|----------|--------|-------|-------|-----|----------|----------|-----|
| | 芯科技 | 2023年3月28日 | 1-6个月(含) | 新股流通受限 | | | | | | |
| 688433 | 华曙高科 | 2023年4月7日 | 1-6个月(含) | 新股流通受限 | 26.66 | 31.50 | 245 | 6,531.70 | 7,717.50 | - |
| 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 | 541 | 8,012.21 | 7,427.93 | - |
| 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 | 379 | 7,928.68 | 7,261.64 | - |
| 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 | 292 | 8,757.08 | 6,946.68 | - |
| 301203 | 国泰环保 | 2023年3月28日 | 1-6个月(含) | 新股流通受限 | 46.13 | 34.40 | 195 | 8,995.35 | 6,708.00 | - |
| 688535 | 华海诚科 | 2023年3月28日 | 1-6个月(含) | 新股流通受限 | 35.00 | 51.23 | 129 | 4,515.00 | 6,608.67 | - |
| 601061 | 中信金属 | 2023年3月30日 | 1-6个月(含) | 新股流通受限 | 6.58 | 7.58 | 849 | 5,586.42 | 6,435.42 | - |
| 301281 | 科源制药 | 2023年3月28日 | 1-6个月(含) | 新股流通受限 | 44.18 | 25.10 | 173 | 7,643.14 | 4,342.30 | - |
| 301281 | 科源制药 | 2023年5月26日 | 1-6个月(含) | 新股流通受限 | 0.00 | 25.10 | 69 | 0.00 | 1,731.90 | 转增股 |
| 301439 | 泓淋电力 | 2023年3月10日 | 1-6个月(含) | 新股流通受限 | 19.99 | 16.90 | 358 | 7,156.42 | 6,050.20 | - |
| 688479 | 友友 | 2023 | 1-6个月(含) | 新股 | 33.99 | 29.49 | 197 | 6,696.03 | 5,809.53 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|-----------------|-----------|--------|-------|-------|-----|----------|----------|---|
| | 车科技 | 年 5 月 4 日 | 月(含) | 流通受限 | | | | | | |
| 603135 | 中重科技 | 2023 年 3 月 29 日 | 1-6 个月(含) | 新股流通受限 | 17.80 | 17.89 | 287 | 5,108.60 | 5,134.43 | - |
| 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 | 97 | 7,124.65 | 4,524.08 | - |
| 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 | 291 | 3,393.06 | 3,567.66 | - |
| 601065 | 江盐集团 | 2023 年 3 月 31 日 | 1-6 个月(含) | 新股流通受限 | 10.36 | 11.84 | 282 | 2,921.52 | 3,338.88 | - |
| 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 | 90 | 2,513.70 | 2,972.70 | - |
| 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 | 103 | 2,130.04 | 2,625.47 | - |
| 603137 | 恒尚节能 | 2023 年 4 月 10 日 | 1-6 个月(含) | 新股流通受限 | 15.90 | 17.09 | 139 | 2,210.10 | 2,375.51 | - |
| 001324 | 长青科技 | 2023 年 5 月 12 日 | 1-6 个月(含) | 新股流通受限 | 18.88 | 19.60 | 114 | 2,152.32 | 2,234.40 | - |
| 001367 | 海森药业 | 2023 年 3 月 30 日 | 1-6 个月(含) | 新股流通受限 | 44.48 | 39.48 | 55 | 2,446.40 | 2,171.40 | - |

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

2、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中

基金参与网下申购获得的设定限售期的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

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

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未有银行间市场债券正回购。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 51,017,121.12 元，于 2023 年 7 月 3 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金，属于较高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

管理以及进行投资风险分析与绩效评估。

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行交通银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

本基金债券投资的信用评级情况按《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，本基金未持有除国债、央行票据、政策性金融债和同业存单以外的债券投资、资产支持证券投资(2022 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

于 2023 年 6 月 30 日，除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额将在一个月以内到

期且计息(该利息金额不重大)外,本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息,可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息,因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(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市公司可流通股股票的 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股票,不得超过该上市公司可流通股股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

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

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

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 | 1,983,132.46 | - | - | - | 1,983,132.46 |
| 结算备付金 | 2,189,549.30 | - | - | - | 2,189,549.30 |
| 存出保证金 | 135,514.79 | - | - | - | 135,514.79 |
| 交易性金融资产 | 67,918,560.09 | - | - | -232,238,732.52 | 300,157,292.61 |
| 应收申购款 | - | - | - | 50,983.29 | 50,983.29 |
| 应收清算款 | - | - | - | 2,719,761.86 | 2,719,761.86 |
| 资产总计 | 72,226,756.64 | - | - | -235,009,477.67 | 307,236,234.31 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 11,486.81 | 11,486.81 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 324,856.95 | 324,856.95 |
| 应付托管费 | - | - | - | 54,142.83 | 54,142.83 |
| 卖出回购金融资产款 | 51,017,121.12 | - | - | - | 51,017,121.12 |
| 应交税费 | - | - | - | 516.80 | 516.80 |
| 其他负债 | - | - | - | 1,025,852.69 | 1,025,852.69 |
| 负债总计 | 51,017,121.12 | - | - | 1,416,856.08 | 52,433,977.20 |
| 利率敏感度缺口 | 21,209,635.52 | - | - | -233,592,621.59 | 254,802,257.11 |
| 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 | 8,413,886.28 | - | - | - | 8,413,886.28 |
| 结算备付金 | 2,610,271.78 | - | - | - | 2,610,271.78 |

| | | | | |
|-----------|---------------|---|-----------------|----------------|
| 存出保证金 | 205,503.29 | - | - | 205,503.29 |
| 交易性金融资产 | 68,085,638.55 | - | -273,035,421.04 | 341,121,059.59 |
| 应收申购款 | - | - | 75,917.64 | 75,917.64 |
| 应收清算款 | - | - | 1,261,680.13 | 1,261,680.13 |
| 资产总计 | 79,315,299.90 | - | -274,373,018.81 | 353,688,318.71 |
| 负债 | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | 23,438.47 | 23,438.47 |
| 应付管理人报酬 | - | - | 381,324.64 | 381,324.64 |
| 应付托管费 | - | - | 63,554.10 | 63,554.10 |
| 应付清算款 | - | - | 1,643,368.09 | 1,643,368.09 |
| 卖出回购金融资产款 | 53,039,858.90 | - | - | 53,039,858.90 |
| 应交税费 | - | - | 516.80 | 516.80 |
| 其他负债 | - | - | 854,739.57 | 854,739.57 |
| 负债总计 | 53,039,858.90 | - | 2,966,941.67 | 56,006,800.57 |
| 利率敏感度缺口 | 26,275,441.00 | - | -271,406,077.14 | 297,681,518.14 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的到期日予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 | | |
|----|--------------------|-----------------------------|-------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末（2023年6月30日） | 上年度末（2022年12月31日） |
| | 市场利率上升25个基点 | 80,000.00 | -60,000.00 |
| | 市场利率下降25个基点 | -80,000.00 | 60,000.00 |

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、债券的比重不低于该基金资产总值的 80%，投资于国债的比重不低于该基金资产净值的 20%。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 | 232,238,732.52 | 91.14 | 273,035,421.04 | 91.72 |
| 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 | 232,238,732.52 | 91.14 | 273,035,421.04 | 91.72 |

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% | 11,890,000.00 | 12,340,000.00 |

| | | | |
|--|-------------------|----------------|----------------|
| | 沪深 300 指数下降 5% | -11,890,000.00 | -12,340,000.00 |
|--|-------------------|----------------|----------------|

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 | 231,535,473.72 | 272,159,860.03 |
| 第二层次 | 67,918,560.09 | 68,085,638.55 |
| 第三层次 | 703,258.80 | 875,561.01 |
| 合计 | 300,157,292.61 | 341,121,059.59 |

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 | 232,238,732.52 | 75.59 |
| | 其中：股票 | 232,238,732.52 | 75.59 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 67,918,560.09 | 22.11 |
| | 其中：债券 | 67,918,560.09 | 22.11 |
| | 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 | 4,172,681.76 | 1.36 |
| 8 | 其他各项资产 | 2,906,259.94 | 0.95 |
| 9 | 合计 | 307,236,234.31 | 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 | 7,241,179.00 | 2.84 |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 136,539,945.45 | 53.59 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 2,362,117.47 | 0.93 |
| E | 建筑业 | 5,943.17 | 0.00 |
| F | 批发和零售业 | 25,707.75 | 0.01 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 2,331,812.00 | 0.92 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 26,672,353.75 | 10.47 |

| | | | |
|---|---------------|----------------|-------|
| J | 金融业 | 47,053,588.40 | 18.47 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 2,084,657.65 | 0.82 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 2,773,085.76 | 1.09 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 16,855.12 | 0.01 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 5,131,487.00 | 2.01 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 232,238,732.52 | 91.14 |

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 | 000568 | 泸州老窖 | 105,500 | 22,109,635.00 | 8.68 |
| 2 | 601318 | 中国平安 | 381,000 | 17,678,400.00 | 6.94 |
| 3 | 000858 | 五粮液 | 90,700 | 14,835,799.00 | 5.82 |
| 4 | 600519 | 贵州茅台 | 8,395 | 14,195,945.00 | 5.57 |
| 5 | 603027 | 千禾味业 | 630,400 | 13,314,048.00 | 5.23 |
| 6 | 000596 | 古井贡酒 | 52,600 | 13,012,188.00 | 5.11 |
| 7 | 603444 | 吉比特 | 22,700 | 11,148,197.00 | 4.38 |
| 8 | 603198 | 迎驾贡酒 | 162,600 | 10,373,880.00 | 4.07 |
| 9 | 300533 | 冰川网络 | 204,400 | 10,211,824.00 | 4.01 |
| 10 | 601601 | 中国太保 | 387,900 | 10,077,642.00 | 3.96 |
| 11 | 603369 | 今世缘 | 186,400 | 9,841,920.00 | 3.86 |
| 12 | 300033 | 同花顺 | 50,200 | 8,799,056.00 | 3.45 |
| 13 | 002304 | 洋河股份 | 55,500 | 7,289,925.00 | 2.86 |
| 14 | 000860 | 顺鑫农业 | 162,400 | 5,471,256.00 | 2.15 |
| 15 | 300251 | 光线传媒 | 634,300 | 5,131,487.00 | 2.01 |
| 16 | 002555 | 三七互娱 | 144,500 | 5,040,160.00 | 1.98 |
| 17 | 603589 | 口子窖 | 99,600 | 4,915,260.00 | 1.93 |
| 18 | 300972 | 万辰生物 | 86,200 | 3,822,108.00 | 1.50 |
| 19 | 601138 | 工业富联 | 147,200 | 3,709,440.00 | 1.46 |
| 20 | 600958 | 东方证券 | 279,352 | 2,709,714.40 | 1.06 |
| 21 | 601628 | 中国人寿 | 75,900 | 2,653,464.00 | 1.04 |
| 22 | 601901 | 方正证券 | 398,400 | 2,605,536.00 | 1.02 |
| 23 | 002385 | 大北农 | 386,400 | 2,550,240.00 | 1.00 |
| 24 | 300308 | 中际旭创 | 17,200 | 2,536,140.00 | 1.00 |
| 25 | 601336 | 新华保险 | 68,800 | 2,529,776.00 | 0.99 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 26 | 688480 | 赛恩斯 | 81,506 | 2,523,425.76 | 0.99 |
| 27 | 002646 | 天佑德酒 | 185,400 | 2,501,046.00 | 0.98 |
| 28 | 603477 | 巨星农牧 | 70,100 | 2,337,835.00 | 0.92 |
| 29 | 603008 | 喜临门 | 86,300 | 2,173,034.00 | 0.85 |
| 30 | 301058 | 中粮科工 | 147,800 | 2,061,810.00 | 0.81 |
| 31 | 002043 | 兔宝宝 | 121,600 | 1,326,656.00 | 0.52 |
| 32 | 600233 | 圆通速递 | 89,900 | 1,308,944.00 | 0.51 |
| 33 | 002100 | 天康生物 | 155,700 | 1,284,525.00 | 0.50 |
| 34 | 600011 | 华能国际 | 133,300 | 1,234,358.00 | 0.48 |
| 35 | 000663 | 永安林业 | 94,000 | 1,144,920.00 | 0.45 |
| 36 | 000690 | 宝新能源 | 155,600 | 1,092,312.00 | 0.43 |
| 37 | 600975 | 新五丰 | 113,100 | 1,081,236.00 | 0.42 |
| 38 | 601333 | 广深铁路 | 258,300 | 1,022,868.00 | 0.40 |
| 39 | 300705 | 九典制药 | 28,500 | 753,255.00 | 0.30 |
| 40 | 603518 | 锦泓集团 | 45,900 | 520,965.00 | 0.20 |
| 41 | 600760 | 中航沈飞 | 11,400 | 513,000.00 | 0.20 |
| 42 | 601566 | 九牧王 | 42,300 | 508,446.00 | 0.20 |
| 43 | 688249 | 晶合集成 | 14,808 | 278,227.35 | 0.11 |
| 44 | 603116 | 红蜻蜓 | 41,600 | 263,744.00 | 0.10 |
| 45 | 000888 | 峨眉山A | 21,200 | 242,952.00 | 0.10 |
| 46 | 688343 | 云天励飞 | 4,160 | 210,787.20 | 0.08 |
| 47 | 301325 | 曼恩斯特 | 1,363 | 155,166.15 | 0.06 |
| 48 | 688539 | 高华科技 | 3,520 | 153,084.80 | 0.06 |
| 49 | 688352 | 颀中科技 | 8,224 | 109,403.05 | 0.04 |
| 50 | 301387 | 光大同创 | 2,193 | 107,307.29 | 0.04 |
| 51 | 688552 | 航天南湖 | 3,583 | 89,971.46 | 0.04 |
| 52 | 688581 | 安杰思 | 708 | 86,406.26 | 0.03 |
| 53 | 688512 | 慧智微 | 3,784 | 77,677.04 | 0.03 |
| 54 | 301332 | 德尔玛 | 5,408 | 76,977.36 | 0.03 |
| 55 | 301281 | 科源制药 | 2,419 | 63,503.46 | 0.02 |
| 56 | 688479 | 友车科技 | 1,963 | 61,385.55 | 0.02 |
| 57 | 001286 | 陕西能源 | 3,767 | 35,447.47 | 0.01 |
| 58 | 001282 | 三联锻造 | 894 | 31,675.50 | 0.01 |
| 59 | 001324 | 长青科技 | 1,131 | 23,764.29 | 0.01 |
| 60 | 301297 | 富乐德 | 1,015 | 22,847.65 | 0.01 |
| 61 | 301293 | 三博脑科 | 236 | 16,855.12 | 0.01 |
| 62 | 301317 | 鑫磊股份 | 619 | 16,199.23 | 0.01 |
| 63 | 301358 | 湖南裕能 | 344 | 14,754.16 | 0.01 |
| 64 | 688478 | 晶升股份 | 317 | 13,431.29 | 0.01 |
| 65 | 688531 | 日联科技 | 81 | 11,013.57 | 0.00 |
| 66 | 301360 | 荣旗科技 | 118 | 10,926.80 | 0.00 |
| 67 | 301408 | 华人健康 | 605 | 10,254.75 | 0.00 |
| 68 | 688146 | 中船特气 | 259 | 9,875.67 | 0.00 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-----|----------|------|
| 69 | 301429 | 森泰股份 | 433 | 9,101.66 | 0.00 |
| 70 | 001287 | 中电港 | 429 | 9,017.58 | 0.00 |
| 71 | 688484 | 南芯科技 | 225 | 8,259.75 | 0.00 |
| 72 | 688433 | 华曙高科 | 245 | 7,717.50 | 0.00 |
| 73 | 301386 | 未来电器 | 292 | 6,946.68 | 0.00 |
| 74 | 301203 | 国泰环保 | 195 | 6,708.00 | 0.00 |
| 75 | 688535 | 华海诚科 | 129 | 6,608.67 | 0.00 |
| 76 | 601061 | 中信金属 | 849 | 6,435.42 | 0.00 |
| 77 | 301439 | 泓淋电力 | 358 | 6,050.20 | 0.00 |
| 78 | 603135 | 中重科技 | 287 | 5,134.43 | 0.00 |
| 79 | 301345 | 涛涛车业 | 97 | 4,524.08 | 0.00 |
| 80 | 601133 | 柏诚股份 | 291 | 3,567.66 | 0.00 |
| 81 | 601065 | 江盐集团 | 282 | 3,338.88 | 0.00 |
| 82 | 688469 | 中芯集成 | 500 | 2,835.00 | 0.00 |
| 83 | 001328 | 登康口腔 | 103 | 2,625.47 | 0.00 |
| 84 | 603137 | 恒尚节能 | 139 | 2,375.51 | 0.00 |
| 85 | 001367 | 海森药业 | 55 | 2,171.40 | 0.00 |

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------------|----------------|
| 1 | 601601 | 中国太保 | 35,266,790.00 | 11.85 |
| 2 | 300533 | 冰川网络 | 31,899,750.04 | 10.72 |
| 3 | 600702 | 舍得酒业 | 25,876,044.72 | 8.69 |
| 4 | 002555 | 三七互娱 | 24,361,377.18 | 8.18 |
| 5 | 603444 | 吉比特 | 23,606,099.00 | 7.93 |
| 6 | 300033 | 同花顺 | 22,546,291.00 | 7.57 |
| 7 | 600958 | 东方证券 | 22,194,604.00 | 7.46 |
| 8 | 002142 | 宁波银行 | 21,814,072.40 | 7.33 |
| 9 | 603027 | 千禾味业 | 21,064,696.53 | 7.08 |
| 10 | 603369 | 今世缘 | 19,889,059.00 | 6.68 |
| 11 | 601318 | 中国平安 | 19,188,331.00 | 6.45 |
| 12 | 300251 | 光线传媒 | 18,784,662.41 | 6.31 |
| 13 | 000858 | 五粮液 | 17,750,654.00 | 5.96 |
| 14 | 000568 | 泸州老窖 | 16,727,059.50 | 5.62 |
| 15 | 600809 | 山西汾酒 | 16,573,055.60 | 5.57 |
| 16 | 601628 | 中国人寿 | 15,047,668.00 | 5.05 |
| 17 | 300972 | 万辰生物 | 14,329,338.00 | 4.81 |
| 18 | 000596 | 古井贡酒 | 13,861,986.00 | 4.66 |
| 19 | 300059 | 东方财富 | 13,090,000.00 | 4.40 |
| 20 | 603198 | 迎驾贡酒 | 12,695,353.00 | 4.26 |
| 21 | 002304 | 洋河股份 | 12,677,660.00 | 4.26 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 22 | 000860 | 顺鑫农业 | 12,481,457.46 | 4.19 |
| 23 | 603517 | 绝味食品 | 10,646,192.00 | 3.58 |
| 24 | 002517 | 恺英网络 | 10,450,651.00 | 3.51 |
| 25 | 601236 | 红塔证券 | 10,310,613.00 | 3.46 |
| 26 | 000333 | 美的集团 | 9,314,446.00 | 3.13 |
| 27 | 000661 | 长春高新 | 9,279,916.00 | 3.12 |
| 28 | 603477 | 巨星农牧 | 8,774,774.00 | 2.95 |
| 29 | 601658 | 邮储银行 | 8,411,766.00 | 2.83 |
| 30 | 603589 | 口子窖 | 8,172,529.00 | 2.75 |
| 31 | 300759 | 康龙化成 | 7,344,383.50 | 2.47 |
| 32 | 601138 | 工业富联 | 7,321,823.42 | 2.46 |
| 33 | 600754 | 锦江酒店 | 7,291,732.00 | 2.45 |
| 34 | 002385 | 大北农 | 7,187,751.00 | 2.41 |
| 35 | 000651 | 格力电器 | 7,037,043.49 | 2.36 |
| 36 | 601688 | 华泰证券 | 6,983,077.00 | 2.35 |
| 37 | 603866 | 桃李面包 | 6,701,445.00 | 2.25 |
| 38 | 601288 | 农业银行 | 6,693,678.00 | 2.25 |
| 39 | 601336 | 新华保险 | 6,566,517.00 | 2.21 |
| 40 | 001215 | 千味央厨 | 6,339,431.68 | 2.13 |
| 41 | 002607 | 中公教育 | 6,261,974.00 | 2.10 |
| 42 | 688480 | 赛恩斯 | 6,123,280.44 | 2.06 |
| 43 | 601456 | 国联证券 | 6,073,286.00 | 2.04 |
| 44 | 301058 | 中粮科工 | 6,028,017.81 | 2.02 |
| 45 | 002292 | 奥飞娱乐 | 6,027,444.00 | 2.02 |

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 | 002142 | 宁波银行 | 35,990,020.93 | 12.09 |
| 2 | 601601 | 中国太保 | 25,574,846.00 | 8.59 |
| 3 | 601628 | 中国人寿 | 23,117,806.00 | 7.77 |
| 4 | 300533 | 冰川网络 | 22,600,698.00 | 7.59 |
| 5 | 600702 | 舍得酒业 | 21,792,721.00 | 7.32 |
| 6 | 002555 | 三七互娱 | 20,973,956.00 | 7.05 |
| 7 | 600958 | 东方证券 | 17,897,115.00 | 6.01 |
| 8 | 600036 | 招商银行 | 16,998,855.00 | 5.71 |
| 9 | 301058 | 中粮科工 | 14,453,180.90 | 4.86 |
| 10 | 002517 | 恺英网络 | 14,046,641.00 | 4.72 |
| 11 | 600809 | 山西汾酒 | 13,846,947.00 | 4.65 |
| 12 | 300251 | 光线传媒 | 13,736,041.00 | 4.61 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 13 | 002385 | 大北农 | 13,484,354.00 | 4.53 |
| 14 | 300972 | 万辰生物 | 13,326,886.00 | 4.48 |
| 15 | 000001 | 平安银行 | 13,115,815.46 | 4.41 |
| 16 | 002549 | 凯美特气 | 12,564,878.00 | 4.22 |
| 17 | 601318 | 中国平安 | 12,543,164.00 | 4.21 |
| 18 | 300033 | 同花顺 | 12,532,108.00 | 4.21 |
| 19 | 300059 | 东方财富 | 12,074,288.04 | 4.06 |
| 20 | 603444 | 吉比特 | 11,603,852.00 | 3.90 |
| 21 | 600197 | 伊力特 | 11,503,760.00 | 3.86 |
| 22 | 603517 | 绝味食品 | 10,377,613.00 | 3.49 |
| 23 | 000333 | 美的集团 | 9,462,316.00 | 3.18 |
| 24 | 000860 | 顺鑫农业 | 9,190,866.00 | 3.09 |
| 25 | 601236 | 红塔证券 | 9,121,658.00 | 3.06 |
| 26 | 301267 | 华夏眼科 | 8,353,945.00 | 2.81 |
| 27 | 600861 | 北京人力 | 8,195,987.00 | 2.75 |
| 28 | 600030 | 中信证券 | 8,187,442.00 | 2.75 |
| 29 | 603369 | 今世缘 | 8,125,839.52 | 2.73 |
| 30 | 000661 | 长春高新 | 7,976,218.40 | 2.68 |
| 31 | 603027 | 千禾味业 | 7,912,905.36 | 2.66 |
| 32 | 600519 | 贵州茅台 | 7,909,051.99 | 2.66 |
| 33 | 603866 | 桃李面包 | 7,826,835.00 | 2.63 |
| 34 | 600875 | 东方电气 | 7,746,928.14 | 2.60 |
| 35 | 601658 | 邮储银行 | 7,589,316.00 | 2.55 |
| 36 | 600995 | 南网储能 | 7,068,637.00 | 2.37 |
| 37 | 002607 | 中公教育 | 7,035,667.00 | 2.36 |
| 38 | 600754 | 锦江酒店 | 6,959,959.00 | 2.34 |
| 39 | 600199 | 金种子酒 | 6,821,050.00 | 2.29 |
| 40 | 603477 | 巨星农牧 | 6,769,642.00 | 2.27 |
| 41 | 600419 | 天润乳业 | 6,691,106.00 | 2.25 |
| 42 | 000651 | 格力电器 | 6,666,223.00 | 2.24 |
| 43 | 601288 | 农业银行 | 6,640,296.00 | 2.23 |
| 44 | 001215 | 千味央厨 | 6,558,302.00 | 2.20 |
| 45 | 601688 | 华泰证券 | 6,537,930.00 | 2.20 |
| 46 | 301026 | 浩通科技 | 6,430,421.00 | 2.16 |
| 47 | 002727 | 一心堂 | 6,344,736.00 | 2.13 |
| 48 | 001269 | 欧晶科技 | 6,216,910.00 | 2.09 |
| 49 | 603733 | 仙鹤股份 | 6,201,356.28 | 2.08 |
| 50 | 000858 | 五粮液 | 6,189,185.00 | 2.08 |
| 51 | 002292 | 奥飞娱乐 | 6,111,644.00 | 2.05 |

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 | 980,871,607.13 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 993,528,011.61 |

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 | 67,918,560.09 | 26.66 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 67,918,560.09 | 26.66 |

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 | 019694 | 23 国债 01 | 153,000 | 15,469,775.51 | 6.07 |
| 2 | 019670 | 22 国债 05 | 149,000 | 15,035,908.41 | 5.90 |
| 3 | 019688 | 22 国债 23 | 140,000 | 14,156,696.44 | 5.56 |
| 4 | 102229 | 国债 2301 | 130,000 | 13,144,253.70 | 5.16 |
| 5 | 102223 | 国债 2223 | 100,000 | 10,111,926.03 | 3.97 |

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

本基金本报告期末投资于股指期货。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

本基金本报告期末投资于国债期货。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。

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 | 135,514.79 |
| 2 | 应收清算款 | 2,719,761.86 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 50,983.29 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 2,906,259.94 |

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数 (户) | 户均持有的 基金份额 | 持有人结构 | | | |
|--------------|---------------|--------------|----------------|----------------|----------------|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份额比 例 (%) | 持有份额 | 占总份额比 例 (%) |
| 24,060 | 6,008.45 | 1,647,898.57 | 1.14 | 142,915,411.90 | 98.86 |

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 | 160,531.32 | 0.1110 |

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 | 0~10 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|----------------------------------|----------------|
| 基金合同生效日 (2003 年 4 月 25 日) 基金份额总额 | 981,417,134.10 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 150,778,062.70 |
| 本报告期基金总申购份额 | 4,384,012.29 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 10,598,764.52 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 144,563,310.47 |

§ 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 (%) | |
| 华创证券 | 1 | 431,621,710.22 | 21.90 | 401,972.11 | 21.90 | - |
| 中金公司 | 2 | 382,640,186.49 | 19.42 | 356,353.77 | 19.42 | - |
| 光大证券 | 2 | 347,771,816.69 | 17.65 | 323,881.99 | 17.65 | - |
| 信达证券 | 1 | 255,875,973.28 | 12.99 | 238,298.12 | 12.99 | - |
| 东兴证券 | 1 | 230,056,611.59 | 11.68 | 214,253.21 | 11.68 | - |
| 民生证券 | 1 | 144,327,345.16 | 7.32 | 134,411.77 | 7.32 | - |
| 财信证券 | 2 | 102,972,227.23 | 5.23 | 95,898.57 | 5.23 | - |
| 银河证券 | 1 | 53,612,781.62 | 2.72 | 49,929.87 | 2.72 | - |
| 申万宏源 | 1 | 21,564,787.47 | 1.09 | 20,082.90 | 1.09 | - |
| 渤海证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 高华证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国联证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国盛证券 | 1 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 国泰君安 | 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(%) |
| 华创证券 | 77,846,530.28 | 57.89 | 428,384,000.00 | 33.58 | - | - |
| 中金公司 | 33,664,879.00 | 25.04 | 352,900,000.00 | 27.67 | - | - |
| 光大证券 | - | - | 292,428,000.00 | 22.92 | - | - |
| 信达证券 | - | - | 17,100,000.00 | 1.34 | - | - |
| 东兴证券 | 10,971,510.00 | 8.16 | 67,400,000.00 | 5.28 | - | - |
| 民生证券 | 11,983,000.00 | 8.91 | 51,300,000.00 | 4.02 | - | - |
| 财信证券 | - | - | 32,000,000.00 | 2.51 | - | - |
| 银河证券 | - | - | 17,100,000.00 | 1.34 | - | - |
| 申万宏源 | - | - | 17,000,000.00 | 1.33 | - | - |

| | | | | | | |
|----------|---|---|---|---|---|---|
| 渤海证 券 | - | - | - | - | - | - |
| 高华证 券 | - | - | - | - | - | - |
| 国联证 券 | - | - | - | - | - | - |
| 国盛证 券 | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君 安 | - | - | - | - | - | - |
| 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 | - | - | - | - | - | - |

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|-----------------------------------|----------------------------|------------------|
| 1 | 《泰达宏利价值优化型稳定类行业混合型证券投资基金基金经理变更公告》 | 《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站及公司网站 | 2023 年 03 月 14 日 |

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 影响投资者决策的其他重要信息

我公司已于 2023 年 4 月 22 日发布《关于公司法定名称变更的公告》，基金管理人名称由“泰达宏利基金管理有限公司”变更为“宏利基金管理有限公司”，该名称变更事项已于 2023 年 4 月完成工商变更登记手续。经基金托管人同意，并报中国证监会备案，我公司已于 2023 年 6 月 17 日发布《宏利基金管理有限公司关于旗下基金更名事宜的公告》，本基金名称改为宏利价值优化型稳定类行业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

基金管理人和托管人住所。

12.3 查阅方式

投资人可登录中国证监会基金电子披露网站 (<http://eid.csrc.gov.cn/fund>) 或者基金管理人互联网网站 (<https://www.manulifefund.com.cn>) 查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人宏利基金管理有限公司：客户服务中心电话：400-698-8888 或 010-66555662。

宏利基金管理有限公司

2023 年 8 月 31 日