

宏利中证 500 指数增强型证券投资基金  
(LOF)  
2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：宏利基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人宏利基金管理有限公司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。本年度报告已经全体独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 03 月 28 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。

本报告财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
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	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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	14
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>14</b>
6.1 审计报告基本信息	14
6.2 审计报告的基本内容	14
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>16</b>
7.1 资产负债表	16
7.2 利润表	17
7.3 净资产变动表	18
7.4 报表附注	20
<b>§ 8 投资组合报告</b>	<b>53</b>

8.1 期末基金资产组合情况 .....	53
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	53
8.3 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 .....	55
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	66
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	68
8.6 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 .....	68
8.7 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 .....	68
8.8 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 .....	68
8.9 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 .....	68
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	69
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	69
8.12 投资组合报告附注 .....	69
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>70</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	70
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	70
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	70
9.4 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 .....	70
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>71</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>71</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	71
11.2 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 .....	71
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	71
11.4 基金投资策略的改变 .....	71
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	71
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	71
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	72
11.8 其他重大事件 .....	76
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>76</b>
12.1 影响投资者决策的其他重要信息 .....	76
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>77</b>
13.1 备查文件目录 .....	77
13.2 存放地点 .....	77
13.3 查阅方式 .....	77

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	宏利中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF)
基金简称	宏利 500 指数增强 (LOF)
基金主代码	162216
基金运作方式	上市契约型开放式 (LOF)
基金合同生效日	2019 年 11 月 6 日
基金管理人	宏利基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	197,571,106.48 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2019 年 12 月 5 日

### 2.2 基金产品说明

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

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

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="https://www.manulifefund.com.cn">https://www.manulifefund.com.cn</a>
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座 普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2023 年	2022 年	2021 年
本期已实现收益	-28,963,384.94	-79,487,935.17	77,609,882.35
本期利润	-23,623,903.64	-91,656,861.82	65,128,598.43
加权平均基金份额本期利润	-0.1161	-0.3400	0.2177
本期加权平均净值利润率	-8.97%	-23.92%	14.24%
本期基金份额净值增长率	-9.58%	-19.27%	18.21%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
期末可供分配利润	147,810,979.34	187,346,834.75	399,314,541.50
期末可供分配基金份额利润	0.7481	0.8723	1.1813
期末基金资产净值	231,316,546.60	278,126,148.67	542,189,742.77
期末基金份额净值	1.1708	1.2949	1.6039
3.1.3 累计期末指	2023 年末	2022 年末	2021 年末

标			
基金份额 累计净值 增长率	23.65%	36.75%	69.38%

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

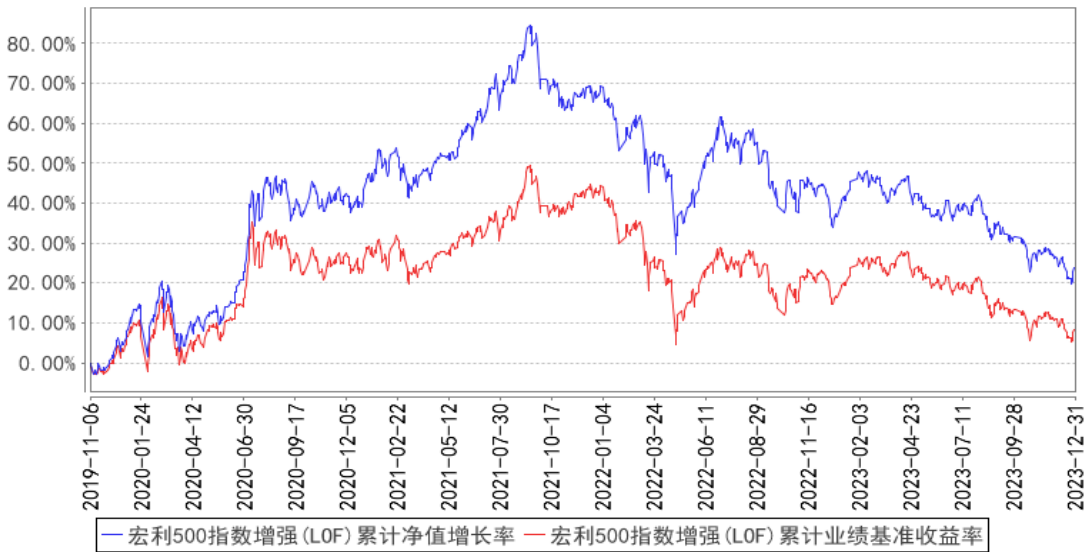
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	-6.11%	0.77%	-4.34%	0.82%	-1.77%	-0.05%
过去六个月	-10.52%	0.79%	-8.99%	0.81%	-1.53%	-0.02%
过去一年	-9.58%	0.76%	-6.96%	0.78%	-2.62%	-0.02%
过去三年	-13.71%	1.04%	-13.68%	1.03%	-0.03%	0.01%
自基金合同生效起 至今	23.65%	1.17%	8.35%	1.17%	15.30%	0.00%

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

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

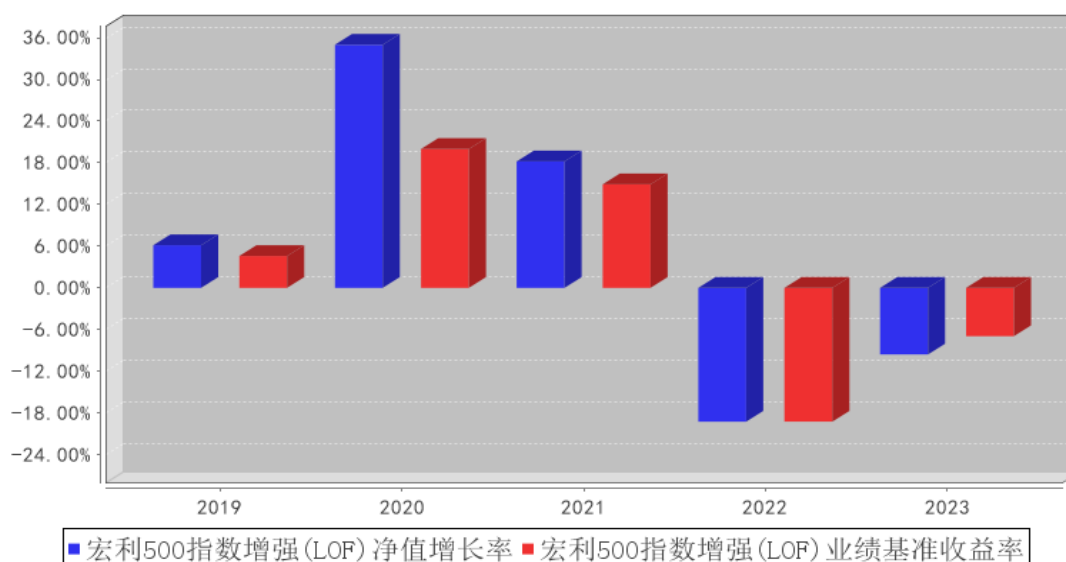
宏利500指数增强(LOF)累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

宏利500指数增强(LOF)基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金转型之日为 2019 年 11 月 6 日，2019 年份额净值增长率的计算期间为 2019 年 11 月 6 日至 2019 年 12 月 31 日。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

根据本基金合同及基金实际运作的情况，本基金近三年未进行利润分配。目前无其他收益分配安排。

## § 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、宏利医药健康混合型发起式证券投资基金在内的六十多只证券投资基金。

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		
刘洋	策略投资部副总经理；基金	2019 年 11 月 6 日	-	8 年	北京大学理学硕士；2015 年 1 月至 2015 年 4 月就职于九坤投资（北京）有限公司，2015 年 5 月加入宏利基金管理有限公司，

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

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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人建立了公平交易制度和内部控制流程,严格执行相关制度规定。在投资管理活动中,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;在交易环节实行集中交易制度,交易部运用交易系统内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,确保公平交易可操作、可评估、可稽核、可持续;对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以基金管理人名义进行的交易,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。

基金管理人的风险管理部定期对基金管理人管理的不同投资组合的收益率差异进行分析,对连续四个季度期间内、不同时间窗下(日内、3 日内、5 日内)基金管理人管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析,并经公司管理层审核签署后存档备查。基金管理人的监察稽核部定期对公平交易制度的执行和控制工作进行稽核。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

基金管理人的风险管理部事后从交易指令的公平性、同日反向交易、不同窗口下的同向交易溢价率和风格相似的基金的业绩等方面,对报告期内的公平交易执行情况进行统计分析。本报告期内,交易指令多为指令下达人管理的多只资产组合同时下发,未发现明显的非公平交易指令;基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易,严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易;场外交易的交易价格与市场价格一致,场内交易的溢价率在剔除交易时间差

异、交易数量悬殊、市场波动剧烈等因素后，处于正常范围之内；基金管理人管理的各投资组合的业绩由于投资策略、管理风格、业绩基准等方面的因素而有所不同。

本报告期内，本基金管理人管理的各投资组合之间未发现利益输送或不公平对待不同组合的情况。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

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

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年 A 股行情一波三折，先扬后抑，在国内与海外多种因素共同作用下，延续了 2022 年以来的震荡调整走势。一季度由于防疫政策调整带来的政策红利周期以及预期的突变，市场迎来了全方位的反弹。其中由于消费场景恢复与北向资金的持续净流入，消费类板块相对占优。另外随着 GhatGPT 的横空出世，AI 大模型与自动内容生成技术震撼全球，AI 产业链主题投资热潮在春节后开始兴起，成为年内为数不多的成长板块亮点。二季度乃至下半年市场整体震荡走弱，美联储偏鹰的态度与人民币贬值压力造成北向资金流出，“中特估”概念为代表的低估值低波动高红利风格成为资金的选择，微盘股走出独立行情，煤炭与石油石化等上游资源板块随着现货价格走高，同时也不乏华为产业链与减肥药等题材亮点。市场风格以大盘低估值与小微盘的哑铃型结构贯穿全年，反应了资金低风险偏好同时流动性相对充裕的局面。

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、盈利增速稳定、估值合理的中盘绩优股票。选股风格偏向长期基本面，较好的控制了持仓换手率与交易成本。持仓结构分散以控制个股风险，仓位保持合理稳定。本报告期内，本基金增加了电子、机械、商贸零售的配置，减少了基础化工、食品饮料、轻工制造的配置。

#### 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 1.1708 元；本报告期基金份额净值增长率为-9.58%，业绩比较基准收益率为-6.96%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

随着市场情绪阶段性见底回升，政策性资金入场缓解流动性压力，市场参与者对国内经济基本面以及政策预期进行重新定价，各类资金具备了底部增配的意愿，资金面正反馈开始形成。2023 年下半年以来政策对于资本市场的支持力度明显加强，如印花税调整、降准降息、规范大股东减持行为、降低融资保证金率等，同时房地产方面降低存量房贷利率与二套房判定标准，核心城市优化限购措施，都在一定程度上提振了大众参与消费与投资的信心与积极性。2024 年春节期间旅游、出行、观影等消费数据超出市场预期，表明了居民仍具备极大的消费潜力。美债利率在年内的下行趋势降低了中美利差与人民币汇率压力。以上内外部因素都使得市场前期相对悲观的预期得到修正，带动以北向资金为代表的外部资金与保险、养老为代表的国内长期资金增配 A 股市场。关注年报中基本面持续修复、目前景气水平相对较高的板块，以及基本面已经在底部、目前已经显示修复迹象的板块，后续相对具备确定性。同时在市场普遍回暖的行情下建议使用宽基或行业指数产品参与，增加投资胜率。

基于基金合同与投资观点，本基金在选股策略上倾向于选择盈利质量高、公司治理规范、估值合理、有长期业绩成长能力的股票。在严格控制行业与风格暴露风险的前提下获取稳定的选股超额收益。在持仓上选择不过分暴露个股相对权重，分散投资以平衡组合风险。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

在本报告期内，基金管理人为防范和化解经营风险，确保基金投资的合法合规、切实维护基金份额持有人的最大利益，基金管理人主要采取了如下监察稽核措施：本基金管理人根据《证券投资基金法》等相关法律、法规、规章和公司管理制度，督察长、监察稽核部、风险管理部定期与不定期的对基金的投资、交易、研发、市场销售、信息披露等方面进行事前、事中或事后的监督检查。

同时，公司制定了具体严格的投资授权流程与权限；在证券投资交易前由研究部门建立可供投资的基础库并定期进行全面维护更新和适时对个股进行维护更新，通过信息技术建立多级投资交易预警系统，并把禁选股票排除在交易系统之外；设立专人负责信息披露工作，信息披露做到真实、准确、完整、及时；引入外方股东在风险控制方面的先进经验，完善公司风险管理指标及流程，监控公司各项业务的运作状况和风险程度；独立于各业务部门的内部监察人员日常对公司经营、基金运作及员工行为的合规性进行定期和不定期检查，发现问题及时督促有关部门整改，

并定期制作监察稽核报告报公司董事会及外部监管部门。

#### 4.7 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、运营部的主要负责人；委员会秘书由运营部负责人担任。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。

#### 4.8 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。

#### 4.9 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二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2024)第 23620 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	宏利中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) 全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了宏利中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) (原泰达宏利中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF)，以下简称“宏利 500 指数增强 (LOF) 基金”) 的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会 (以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会 (以下简称“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，公允反映了宏利 500 指数增强 (LOF) 基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于宏利 500 指数增强 (LOF) 基金，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责	宏利 500 指数增强 (LOF) 基金的基金管理人宏利基金管理有

任	<p>限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估宏利 500 指数增强 (LOF) 基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算宏利 500 指数增强 (LOF) 基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督宏利 500 指数增强 (LOF) 基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(一)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二)了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三)评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四)对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能导致对宏利 500 指数增强 (LOF) 基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致宏利 500 指数增强 (LOF) 基金不能持续经营。</p> <p>(五)评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容,并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>

会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	薛竞	魏佳亮
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼	
审计报告日期	2024 年 3 月 26 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：宏利中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF)

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	14,027,437.20	3,049,524.28
结算备付金		940,877.75	996,101.37
存出保证金		15,598.56	90,372.94
交易性金融资产	7.4.7.2	217,623,432.83	274,736,850.49
其中：股票投资		217,623,432.83	260,792,148.87
基金投资		—	—
债券投资		—	13,944,701.62
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
其他投资		—	—
衍生金融资产	7.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	7.4.7.4	—	—
债权投资	7.4.7.5	—	—
其中：债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—
其他投资		—	—
其他债权投资	7.4.7.6	—	—
其他权益工具投资	7.4.7.7	—	—
应收清算款		—	214,633.56
应收股利		—	—
应收申购款		143,112.62	366,237.95
递延所得税资产		—	—
其他资产	7.4.7.8	—	—
资产总计		232,750,458.96	279,453,720.59
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		54.20	-
应付赎回款		314,118.61	23,647.07
应付管理人报酬		196,955.05	251,790.24
应付托管费		39,391.00	50,358.03
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	883,393.50	1,001,776.58
负债合计		1,433,912.36	1,327,571.92
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.10	83,505,567.26	90,779,313.92
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	147,810,979.34	187,346,834.75
净资产合计		231,316,546.60	278,126,148.67
负债和净资产总计		232,750,458.96	279,453,720.59

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.1708 元，基金份额总额 197,571,106.48 份。

## 7.2 利润表

会计主体：宏利中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF)

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		-20,041,832.12	-86,597,646.32
1. 利息收入		48,253.83	65,746.85
其中：存款利息收入	7.4.7.13	48,253.83	65,746.85
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-25,475,737.76	-74,740,516.15
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-29,443,595.08	-80,894,214.99

基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	81,911.43	276,195.30
资产支持证券投资 收益	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	3,885,945.89	5,877,503.54
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）	7.4.7.20	5,339,481.30	-12,168,926.65
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	7.4.7.21	46,170.51	246,049.63
<b>减：二、营业总支出</b>		3,582,071.52	5,059,215.50
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,639,052.88	3,853,174.00
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	527,810.58	770,634.87
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		9,151.10	23,900.73
其中：卖出回购金融资产 支出		9,151.10	23,900.73
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		3.31	-
8. 其他费用	7.4.7.23	406,053.65	411,505.90
<b>三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）</b>		-23,623,903.64	-91,656,861.82
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-” 号填列）</b>		-23,623,903.64	-91,656,861.82
<b>五、其他综合收益的税后 净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-23,623,903.64	-91,656,861.82

### 7.3 净资产变动表

会计主体：宏利中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF)

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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	90,779,313.92	-	187,346,834.75	278,126,148.67
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	90,779,313.92	-	187,346,834.75	278,126,148.67
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-7,273,746.66	-	-39,535,855.41	-46,809,602.07
（一）、综合收益总额	-	-	-23,623,903.64	-23,623,903.64
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-7,273,746.66	-	-15,911,951.77	-23,185,698.43
其中：1. 基金申购款	15,266,139.46	-	31,690,339.28	46,956,478.74
2. 基金赎回款	-22,539,886.12	-	-47,602,291.05	-70,142,177.17
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	83,505,567.26	-	147,810,979.34	231,316,546.60
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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	142,875,201.27	-	399,314,541.50	542,189,742.77
加：会计政策变更	-	-	-	-

前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	142,875,201.27	-	399,314,541.50	542,189,742.77
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-52,095,887.35	-	-211,967,706.75	-264,063,594.10
(一)、综合收益总额	-	-	-91,656,861.82	-91,656,861.82
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-52,095,887.35	-	-120,310,844.93	-172,406,732.28
其中：1. 基金申购款	56,542,019.90	-	131,545,524.85	188,087,544.75
2. 基金赎回款	-108,637,907.25	-	-251,856,369.78	-360,494,277.03
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	90,779,313.92	-	187,346,834.75	278,126,148.67

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

宏利中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) (原名为泰达宏利中证 500 指数增强型证券投资

基金 (LOF)，以下简称“本基金”) 由泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金 (以下简称“泰达宏利中证 500 指数分级基金”) 转型而来。根据基金管理人宏利基金管理有限公司 (原泰达宏利基金管理有限公司，已于 2023 年 4 月 20 日办理完成工商变更登记) 于 2019 年 10 月 29 日发布的《泰达宏利基金管理有限公司关于泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金实施转型的公告》，原泰达宏利中证 500 指数分级基金以现场方式召开了基金份额持有人大会。基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效，基金管理人根据基金份额持有人大会的授权，定于 2019 年 11 月 6 日正式实施基金转型。《泰达宏利中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金合同》自 2019 年 11 月 6 日起生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为宏利基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司 (以下简称“中国银行”)。

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

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

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

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定 (以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、

中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《宏利中证 500 指数增强型证券投资基金(LOF)基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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。

### 7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具,是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时,确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

##### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为:以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

##### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具,分别采用以下两种方式进行计量:

##### 以摊余成本计量:

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标,且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致,即在特定日期产生的现金流量,仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

##### 以公允价值计量且其变动计入当期损益:

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具,以公允价值计量且其变动计入当期损

益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资、资产支持证券投资 and 基金投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

#### 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

#### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### (3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失

准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的以公允价值计量的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金

额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净资产比例计

算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，其中场外基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资，场内基金份额持有人只能选择现金分红。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的

经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566 号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 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。

根据中国证监会于 2024 年 1 月颁布的修订后的《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〉》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

#### 7.4.5.2 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。

#### 7.4.5.3 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。

#### 7.4.6 税项

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

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

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

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

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

(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。根

据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(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。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	14,027,437.20	3,049,524.28
等于：本金	14,026,129.03	3,049,244.45
加：应计利息	1,308.17	279.83
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	14,027,437.20	3,049,524.28

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		223,025,492.97	-	217,623,432.83	-5,402,060.14
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-

基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		223,025,492.97	-	217,623,432.83	-5,402,060.14
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日				
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		271,468,433.36	-	260,792,148.87	-10,676,284.49
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	13,855,486.95	154,471.62	13,944,701.62	-65,256.95
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	13,855,486.95	154,471.62	13,944,701.62	-65,256.95
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		285,323,920.31	154,471.62	274,736,850.49	-10,741,541.44

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

##### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末及上年度末均未持有期货合约。

##### 7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末及上年度末均未持有黄金衍生品。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

##### 7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

#### 7.4.7.5 债权投资

##### 7.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末及上年度末均未持有债权投资。

**7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况**

本基金本报告期末及上年度末均未计提债权投资减值准备。

**7.4.7.6 其他债权投资****7.4.7.6.1 其他债权投资情况**

本基金本报告期末及上年度末均未持有其他债权投资。

**7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况**

本基金本报告期末及上年度末均未计提其他债权投资减值准备。

**7.4.7.7 其他权益工具投资****7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况**

本基金本报告期末及上年度末均未持有其他权益工具投资。

**7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况**

本基金本报告期末及上年度末均未持有其他权益工具投资。

**7.4.7.8 其他资产**

本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

**7.4.7.9 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	454.98	60.41
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	648,438.52	767,216.17
其中：交易所市场	648,438.52	767,216.17
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	184,500.00	184,500.00
指数使用费	50,000.00	50,000.00
合计	883,393.50	1,001,776.58

**7.4.7.10 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 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	214,780,518.45	90,779,313.92
本期申购	36,119,151.34	15,266,139.46
本期赎回（以“-”号填列）	-53,328,563.31	-22,539,886.12
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	197,571,106.48	83,505,567.26

注：1. 若本基金有分红及转换业务，申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

2. 截至 2023 年 12 月 31 日止，本基金于深交所上市的基金份额为 4,259,436.00 份 (2022 年 12 月 31 日：11,149,065.00 份)，托管在场外未上市交易的基金份额为 193,311,670.48 份 (2022 年 12 月 31 日：203,631,453.45 份)。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

#### 7.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期末及上年度末均未有其他综合收益。

#### 7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	204,628,792.78	-17,281,958.03	187,346,834.75
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	204,628,792.78	-17,281,958.03	187,346,834.75
本期利润	-28,963,384.94	5,339,481.30	-23,623,903.64
本期基金份额交易产生的变动数	-16,339,985.91	428,034.14	-15,911,951.77
其	33,837,201.44	-2,146,862.16	31,690,339.28

中： 基金 申购 款			
金赎 回款	-50,177,187.35	2,574,896.30	-47,602,291.05
本期 已分 配利 润	-	-	-
本期 末	159,325,421.93	-11,514,442.59	147,810,979.34

7.4.7.13 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	32,678.50	40,010.11
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	14,872.08	23,496.61
其他	703.25	2,240.13
合计	48,253.83	65,746.85

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 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12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资收益——买卖 股票差价收入	-29,443,595.08	-80,894,214.99
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	-29,443,595.08	-80,894,214.99

## 7.4.7.14.2 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12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
卖出股票成交总额	1,382,890,886.26	2,026,127,042.25
减：卖出股票成本总额	1,408,454,091.65	2,101,027,748.25
减：交易费用	3,880,389.69	5,993,508.99
买卖股票差价收入	-29,443,595.08	-80,894,214.99

## 7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均未有股票投资收益——证券出借差价收入。

## 7.4.7.15 债券投资收益

## 7.4.7.15.1 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12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
债券投资收益——利息收入	137,398.38	310,954.19
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-55,486.95	-34,758.89
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	81,911.43	276,195.30

## 7.4.7.15.2 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12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	14,091,870.00	26,524,224.37
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本	13,855,486.95	25,970,946.65

总额		
减：应计利息总额	291,870.00	588,007.97
减：交易费用	-	28.64
买卖债券差价收入	-55,486.95	-34,758.89

#### 7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均未有债券投资收益-赎回差价收入。

#### 7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均未有债券投资收益-申购差价收入。

#### 7.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间均未有资产支持证券投资收益。

##### 7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均未有资产支持证券投资收益-买卖资产支持证券差价收入。

##### 7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均未有资产支持证券投资收益-赎回差价收入。

##### 7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均未有资产支持证券投资收益-申购差价收入。

#### 7.4.7.17 贵金属投资收益

##### 7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间均未有贵金属投资收益。

##### 7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均未有贵金属投资收益-买卖贵金属差价收入。

##### 7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均未有贵金属投资收益-赎回差价收入。

##### 7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均未有贵金属投资收益-申购差价收入。

#### 7.4.7.18 衍生工具收益

##### 7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均未有衍生工具收益-买卖权证差价收入。

## 7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均未有衍生工具收益-其他投资收益。

## 7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	3,885,945.89	5,877,503.54
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	3,885,945.89	5,877,503.54

## 7.4.7.20 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	5,339,481.30	-12,168,926.65
股票投资	5,274,224.35	-12,103,669.70
债券投资	65,256.95	-65,256.95
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	5,339,481.30	-12,168,926.65

## 7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	46,170.51	246,049.63
合计	46,170.51	246,049.63

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

#### 7.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期及上年度可比期间均未有信用减值损失。

#### 7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	—	—
银行费用	8,051.63	13,505.90
账户维护费	18,000.00	18,000.00
指数使用费	200,000.00	200,000.00
其他	2.02	—
合计	406,053.65	411,505.90

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.016% 的年费率计提。基金合同生效后的指数许可使用费按日计提，按季支付。标的指数许可使用费的收取下限为每季（自然季度）人民币 50,000 元，计费区间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 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。

##### 7.4.8.2 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。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
宏利基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国银行股份有限公司（中国银行）	基金托管人、基金销售机构
宏利投资管理（香港）有限公司	基金管理人的股东
宏利投资管理（新加坡）私人有限公司	基金管理人的股东

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. 根据宏利基金管理有限公司（原泰达宏利基金管理有限公司）于 2022 年 11 月 30 日发布的公告，经公司股东会第七十三次会议决议及中国证监会证监许可[2022]2830 号核准，公司原股东天津市泰达国际控股（集团）有限公司将其持有的公司 51%股权转让给宏利投资管理（新加坡）私人有限公司。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 7.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 7.4.10.1.5 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。

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,639,052.88	3,853,174.00
其中：应支付销售机构的客户维护费	955,175.37	1,066,967.81
应支付基金管理人的净管理费	1,683,877.51	2,786,206.19

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

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	527,810.58	770,634.87

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.2%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.2%/当年天数。

**7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场债券(含回购)的交易。

**7.4.10.4 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****7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

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

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

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

**7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况****7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本基金的管理人在本报告期内及上年度可比期间内均未运用固有资金投资本基金。

**7.4.10.5.2 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**

本基金除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末及上年度末均未持有本基金。

**7.4.10.6 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12月 31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	14,027,437.20	32,678.50	3,049,524.28	40,010.11

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按约定利率计息。

**7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

**7.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

**7.4.11 利润分配情况**

本基金本报告期末进行利润分配。

**7.4.12 期末（2023年12月31日）本基金持有的流通受限证券****7.4.12.1 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

## 7.4.12.1.1 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
688549	中巨芯	2023年8月30日	1-6个月(含)	新股流通受限	5.18	8.09	1,825	9,453.50	14,764.25	-
301172	君逸数码	2023年7月19日	1-6个月(含)	新股流通受限	31.33	38.16	346	10,840.18	13,203.36	-
688627	精智达	2023年7月11日	1-6个月(含)	新股流通受限	46.77	87.72	139	6,501.03	12,193.08	-
301370	国科恒泰	2023年7月3日	1-6个月(含)	新股流通受限	13.39	16.01	744	9,962.16	11,911.44	-
688563	航材股份	2023年7月12日	1-6个月(含)	新股流通受限	78.99	60.49	183	14,455.17	11,069.67	-
688592	司南导航	2023年8月7日	1-6个月(含)	新股流通受限	50.50	50.53	216	10,908.00	10,914.48	-
688582	芯动联科	2023年6月21日	1-6个月(含)	新股流通受限	26.74	38.67	277	7,406.98	10,711.59	-
301372	科净源	2023年8月3日	1-6个月(含)	新股流通受限	45.00	43.59	226	10,170.00	9,851.34	-
688603	天承科技	2023年6月30日	1-6个月(含)	新股流通受限	55.00	74.14	129	7,095.00	9,564.06	-
301362	民爆光电	2023年7月27日	1-6个月(含)	新股流通受限	51.05	38.52	236	12,047.80	9,090.72	-
301509	金凯	2023年7月	1-6个月(含)	新股流通	56.56	62.23	145	8,201.20	9,023.35	-

	生科	26 日		受限						
688610	埃科光电	2023 年 7 月 10 日	1-6 个月 (含)	新股流通受限	73.33	51.00	176	12,906.08	8,976.00	-
301292	海科新源	2023 年 6 月 29 日	1-6 个月 (含)	新股流通受限	19.99	19.35	462	9,235.38	8,939.70	-
301291	明阳电气	2023 年 6 月 21 日	1-6 个月 (含)	新股流通受限	38.13	28.36	310	11,820.30	8,791.60	-
301261	恒工精密	2023 年 6 月 29 日	1-6 个月 (含)	新股流通受限	36.90	50.85	164	6,051.60	8,339.40	-
301489	思泉新材	2023 年 10 月 16 日	1-6 个月 (含)	新股流通受限	41.66	64.11	128	5,332.48	8,206.08	-
301251	威尔高	2023 年 8 月 30 日	1-6 个月 (含)	新股流通受限	28.88	34.59	228	6,584.64	7,886.52	-
603296	华勤技术	2023 年 8 月 1 日	1-6 个月 (含)	新股流通受限	80.80	77.75	99	7,999.20	7,697.25	-
688602	康鹏科技	2023 年 7 月 13 日	1-6 个月 (含)	新股流通受限	8.66	11.06	690	5,975.40	7,631.40	-
301202	朗威股份	2023 年 6 月 28 日	1-6 个月 (含)	新股流通受限	25.82	31.80	237	6,119.34	7,536.60	-
688716	中研股份	2023 年 9 月 13 日	1-6 个月 (含)	新股流通受限	29.66	36.39	206	6,109.96	7,496.34	-
301511	德福科	2023 年 8 月 8 日	1-6 个月 (含)	新股流通受限	28.00	22.67	323	9,044.00	7,322.41	-

	技									
301528	多浦乐	2023年8月17日	1-6个月(含)	新股流通受限	71.80	68.91	106	7,610.80	7,304.46	-
301505	苏州规划	2023年7月12日	1-6个月(含)	新股流通受限	26.35	35.81	194	5,111.90	6,947.14	-
301210	金杨股份	2023年6月21日	1-6个月(含)	新股流通受限	57.88	45.48	150	8,682.00	6,822.00	-
301393	昊帆生物	2023年7月5日	1-6个月(含)	新股流通受限	67.68	59.37	112	7,580.16	6,649.44	-
301456	盘古智能	2023年7月6日	1-6个月(含)	新股流通受限	37.96	30.39	211	8,009.56	6,412.29	-
301468	博盈特焊	2023年7月12日	1-6个月(含)	新股流通受限	47.58	30.22	212	10,086.96	6,406.64	-
301395	仁信新材	2023年6月21日	1-6个月(含)	新股流通受限	26.68	18.69	338	9,017.84	6,317.22	-
301525	儒竞科技	2023年8月23日	1-6个月(含)	新股流通受限	99.57	81.46	75	7,467.75	6,109.50	-
688646	逸飞激光	2023年7月21日	1-6个月(含)	新股流通受限	46.80	36.07	169	7,909.20	6,095.83	-
688693	锆威特	2023年8月10日	1-6个月(含)	新股流通受限	40.83	43.41	136	5,552.88	5,903.76	-
301559	中集环科	2023年9月26日	1-6个月(含)	新股流通受限	24.22	18.24	320	7,750.40	5,836.80	-
301550	斯	2023	1-6个月(含)	新股	37.56	43.57	133	4,995.48	5,794.81	-

	菱股份	2023年9月6日	1-6个月(含)	流通受限						
301517	陕西华达	2023年10月9日	1-6个月(含)	新股流通受限	26.87	43.69	129	3,466.23	5,636.01	-
301515	港通医疗	2023年7月13日	1-6个月(含)	新股流通受限	31.16	28.27	199	6,200.84	5,625.73	-
301371	敷尔佳	2023年7月24日	1-6个月(含)	新股流通受限	55.68	37.58	143	7,962.24	5,373.94	-
688612	威迈斯	2023年7月19日	1-6个月(含)	新股流通受限	47.29	37.97	141	6,667.89	5,353.77	-
301548	崇德科技	2023年9月11日	1-6个月(含)	新股流通受限	66.80	58.99	83	5,544.40	4,896.17	-
688657	浩辰软件	2023年9月25日	1-6个月(含)	新股流通受限	103.40	78.23	62	6,410.80	4,850.26	-
301520	万邦医药	2023年9月18日	1-6个月(含)	新股流通受限	67.88	52.74	90	6,109.20	4,746.60	-
603119	浙江荣泰	2023年7月21日	1-6个月(含)	新股流通受限	15.32	23.87	167	2,558.44	3,986.29	-
688450	光格科技	2023年7月17日	1-6个月(含)	新股流通受限	53.09	36.42	108	5,733.72	3,933.36	-
603273	天元智能	2023年10月16日	1-6个月(含)	新股流通受限	9.50	18.97	178	1,691.00	3,376.66	-
603276	恒兴新	2023年9月18日	1-6个月(含)	新股流通受限	25.73	24.88	117	3,010.41	2,910.96	-

	材									
603075	热威股份	2023 年 9 月 1 日	1-6 个月 (含)	新股流通受限	23.10	23.31	113	2,610.30	2,634.03	-

注：1、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新股中需要限售的部分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。

2、基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

3、基金作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

4、基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后 6 个月内不得转让。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额。

7.4.12.4 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

本基金是一只股票型指数增强型投资基金，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、货币市场工具投资、权证投资及资产支持证券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

7.4.13.1 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。

#### 7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，因此违约可能性很小；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、资产支持证券和同业存单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。

##### 7.4.13.2.1 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。

##### 7.4.13.2.2 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。

##### 7.4.13.2.3 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。

##### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本报告期末本产品未持有按长期信用评级列示的债券投资（于 2022 年 12 月 31 日，本基金未

持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券投资)。

#### 7.4.13.2.5 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。

#### 7.4.13.2.6 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。

### 7.4.13.3 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 12 月 31 日, 除附注 7.4.12.3 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约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。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%, 且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司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 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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

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

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

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					

货币资金	14,027,437.20	-	-	-	14,027,437.20
结算备付金	940,877.75	-	-	-	940,877.75
存出保证金	15,598.56	-	-	-	15,598.56
交易性金融资产	-	-	-	-217,623,432.83	217,623,432.83
应收申购款	-	-	-	143,112.62	143,112.62
资产总计	14,983,913.51	-	-	-217,766,545.45	232,750,458.96
负债					
应付赎回款	-	-	-	314,118.61	314,118.61
应付管理人报酬	-	-	-	196,955.05	196,955.05
应付托管费	-	-	-	39,391.00	39,391.00
应付清算款	-	-	-	54.20	54.20
其他负债	-	-	-	883,393.50	883,393.50
负债总计	-	-	-	1,433,912.36	1,433,912.36
利率敏感度缺口	14,983,913.51	-	-	-216,332,633.09	231,316,546.60
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					
货币资金	3,049,524.28	-	-	-	3,049,524.28
结算备付金	996,101.37	-	-	-	996,101.37
存出保证金	90,372.94	-	-	-	90,372.94
交易性金融资产	13,944,701.62	-	-	-260,792,148.87	274,736,850.49
应收申购款	599.98	-	-	365,637.97	366,237.95
应收清算款	-	-	-	214,633.56	214,633.56
资产总计	18,081,300.19	-	-	-261,372,420.40	279,453,720.59
负债					
应付赎回款	-	-	-	23,647.07	23,647.07
应付管理人报酬	-	-	-	251,790.24	251,790.24
应付托管费	-	-	-	50,358.03	50,358.03
其他负债	-	-	-	1,001,776.58	1,001,776.58
负债总计	-	-	-	1,327,571.92	1,327,571.92
利率敏感度缺口	18,081,300.19	-	-	-260,044,848.48	278,126,148.67

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的到期日予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

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

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 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	217,623,432.83	94.08	260,792,148.87	93.77
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	217,623,432.83	94.08	260,792,148.87	93.77

## 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证 500 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 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	中证 500 指数上升 5%	10,410,000.00	12,110,000.00
	中证 500 指数下降 5%	-10,410,000.00	-12,110,000.00

## 7.4.14 公允价值

## 7.4.14.1 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。

## 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

## 7.4.14.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	217,282,388.52	259,614,448.57
第二层次	26,325.19	13,944,701.62
第三层次	314,719.12	1,177,700.30
合计	217,623,432.83	274,736,850.49

## 7.4.14.2.2 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。

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	—	1,177,700.30	1,177,700.30
当期购买	—	846,498.30	846,498.30
当期出售/结算	—	—	—
转入第三层次	—	—	—
转出第三层次	—	2,231,698.33	2,231,698.33
当期利得或损失总额	—	522,218.85	522,218.85
其中：计入损益的利得或损失	—	522,218.85	522,218.85
计入其他综合收益的利得或损失	—	—	—
期末余额	—	314,719.12	314,719.12
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	—	668.60	668.60
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	—	1,148,668.00	1,148,668.00
当期购买	—	2,101,396.18	2,101,396.18
当期出售/结算	—	—	—
转入第三层次	—	—	—
转出第三层次	—	1,821,070.71	1,821,070.71
当期利得或损失总额	—	-251,293.17	-251,293.17
其中：计入损益的利得或损失	—	-251,293.17	-251,293.17

计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,177,700.30	1,177,700.30
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-125,244.70	-125,244.70

注：于 2023 年 12 月 31 日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。于 2023 年度，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

#### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流通受限股票	314,719.12	平均价格亚式期权模型	预期波动率	14.62%-219.88%	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流通受限股票	1,177,700.30	平均价格亚式期权模型	预期波动率	18.91%-247.56%	负相关

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 12 月 31 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)。

#### 7.4.14.4 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。

#### 7.4.15 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。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	217,623,432.83	93.50
	其中：股票	217,623,432.83	93.50
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	14,968,314.95	6.43
8	其他各项资产	158,711.18	0.07
9	合计	232,750,458.96	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 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	85,900.00	0.04
B	采矿业	7,173,830.00	3.10
C	制造业	119,148,610.71	51.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,525,361.00	2.39
E	建筑业	506,700.00	0.22
F	批发和零售业	8,882,035.33	3.84
G	交通运输、仓储和邮政业	4,648,693.00	2.01
H	住宿和餐饮业	1,877,524.00	0.81
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,493,330.11	6.70
J	金融业	15,038,624.00	6.50
K	房地产业	4,196,778.00	1.81
L	租赁和商务服务业	2,165,439.00	0.94
M	科学研究和技术服务业	924,149.80	0.40
N	水利、环境和公共	949,639.00	0.41

	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	1,742,210.00	0.75
R	文化、体育和娱乐业	4,031,977.00	1.74
S	综合	993,204.00	0.43
	合计	193,384,004.95	83.60

### 8.2.2 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	614,822.00	0.27
C	制造业	17,268,255.74	7.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	571,143.00	0.25
E	建筑业	333,989.00	0.14
F	批发和零售业	889,340.44	0.38
G	交通运输、仓储和邮政业	198,642.00	0.09
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,668,920.62	1.15
J	金融业	531,026.00	0.23
K	房地产业	321,138.00	0.14
L	租赁和商务服务业	189,818.00	0.08
M	科学研究和技术服务业	316,241.74	0.14
N	水利、环境和公共设施管理业	9,851.34	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	326,240.00	0.14
S	综合	-	-
	合计	24,239,427.88	10.48

### 8.2.3 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投资。

## 8.3 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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000039	中集集团	349,200	2,671,380.00	1.15
2	600859	王府井	162,600	2,596,722.00	1.12
3	000932	华菱钢铁	457,000	2,353,550.00	1.02
4	000960	锡业股份	157,300	2,252,536.00	0.97
5	002138	顺络电子	78,700	2,125,687.00	0.92
6	600153	建发股份	201,500	1,940,445.00	0.84
7	002683	广东宏大	96,600	1,939,728.00	0.84
8	600390	五矿资本	413,100	1,933,308.00	0.84
9	600258	首旅酒店	120,200	1,877,524.00	0.81
10	603218	日月股份	149,400	1,848,078.00	0.80
11	600885	宏发股份	65,800	1,818,712.00	0.79
12	002025	航天电器	35,500	1,704,710.00	0.74
13	600392	盛和资源	161,800	1,647,124.00	0.71
14	688006	杭可科技	68,170	1,600,631.60	0.69
15	600497	驰宏锌锗	311,200	1,571,560.00	0.68
16	000887	中鼎股份	123,300	1,525,221.00	0.66
17	603707	健友股份	98,900	1,483,500.00	0.64
18	002064	华峰化学	220,300	1,478,213.00	0.64
19	601108	财通证券	190,200	1,475,952.00	0.64
20	000728	国元证券	211,200	1,442,496.00	0.62
21	000591	太阳能	250,000	1,395,000.00	0.60
22	601717	郑煤机	109,095	1,380,051.75	0.60
23	002032	苏泊尔	25,900	1,372,959.00	0.59
24	002373	千方科技	121,800	1,365,378.00	0.59
25	000987	越秀资本	224,600	1,352,092.00	0.58
26	600707	彩虹股份	198,600	1,340,550.00	0.58
27	688180	君实生物	31,800	1,330,194.00	0.58
28	600737	中粮糖业	157,900	1,301,096.00	0.56
29	300009	安科生物	125,980	1,287,515.60	0.56
30	300357	我武生物	44,300	1,284,700.00	0.56
31	603866	桃李面包	166,700	1,276,922.00	0.55
32	300850	新强联	39,500	1,257,285.00	0.54
33	600582	天地科技	230,300	1,252,832.00	0.54
34	002653	海思科	53,200	1,231,580.00	0.53
35	000997	新大陆	62,400	1,223,664.00	0.53
36	688099	晶晨股份	19,519	1,222,474.97	0.53
37	603160	汇顶科技	17,600	1,216,160.00	0.53
38	002563	森马服饰	209,400	1,208,238.00	0.52
39	688208	道通科技	50,606	1,201,892.50	0.52

40	000423	东阿阿胶	24,300	1,198,476.00	0.52
41	603225	新凤鸣	83,400	1,184,280.00	0.51
42	000623	吉林敖东	77,900	1,179,406.00	0.51
43	002008	大族激光	56,500	1,170,680.00	0.51
44	688234	天岳先进	17,600	1,162,832.00	0.50
45	601636	旗滨集团	168,900	1,155,276.00	0.50
46	300866	安克创新	13,000	1,151,800.00	0.50
47	601058	赛轮轮胎	95,500	1,122,125.00	0.49
48	000089	深圳机场	172,200	1,107,246.00	0.48
49	002044	美年健康	180,800	1,086,608.00	0.47
50	002010	传化智联	230,900	1,066,758.00	0.46
51	601991	大唐发电	430,800	1,042,536.00	0.45
52	688772	珠海冠宇	47,307	1,041,227.07	0.45
53	000636	风华高科	75,800	1,035,428.00	0.45
54	002739	万达电影	78,700	1,024,674.00	0.44
55	600066	宇通客车	77,100	1,021,575.00	0.44
56	000959	首钢股份	294,000	1,017,240.00	0.44
57	603317	天味食品	75,200	999,408.00	0.43
58	002120	韵达股份	133,500	995,910.00	0.43
59	000402	金融街	273,900	994,257.00	0.43
60	000009	中国宝安	84,600	993,204.00	0.43
61	600801	华新水泥	79,800	991,914.00	0.43
62	688779	长远锂科	134,797	984,018.10	0.43
63	000031	大悦城	330,100	980,397.00	0.42
64	002463	沪电股份	43,620	964,874.40	0.42
65	688188	柏楚电子	3,734	945,112.74	0.41
66	600282	南钢股份	251,400	930,180.00	0.40
67	601966	玲珑轮胎	48,000	923,040.00	0.40
68	600755	厦门国贸	131,900	919,343.00	0.40
69	688331	荣昌生物	14,700	912,282.00	0.39
70	601198	东兴证券	110,200	906,946.00	0.39
71	300383	光环新网	92,500	899,100.00	0.39
72	000513	丽珠集团	25,600	896,256.00	0.39
73	600637	东方明珠	118,800	893,376.00	0.39
74	002185	华天科技	103,900	885,228.00	0.38
75	600109	国金证券	96,300	874,404.00	0.38
76	002028	思源电气	16,800	874,272.00	0.38
77	300251	光线传媒	106,400	867,160.00	0.37
78	601179	中国西电	175,800	866,694.00	0.37
79	002791	坚朗五金	21,300	862,437.00	0.37
80	300682	朗新集团	52,600	862,114.00	0.37
81	601128	常熟银行	134,200	857,538.00	0.37
82	600316	洪都航空	40,300	853,151.00	0.37

83	601168	西部矿业	58,800	839,076.00	0.36
84	300296	利亚德	135,000	810,000.00	0.35
85	002507	涪陵榨菜	56,500	807,385.00	0.35
86	002625	光启技术	54,500	805,510.00	0.35
87	002152	广电运通	65,500	803,030.00	0.35
88	600765	中航重机	41,900	800,709.00	0.35
89	600867	通化东宝	73,000	790,590.00	0.34
90	300677	英科医疗	33,500	782,560.00	0.34
91	601997	贵阳银行	150,400	773,056.00	0.33
92	002422	科伦药业	26,500	769,825.00	0.33
93	688690	纳微科技	27,590	756,517.80	0.33
94	000898	鞍钢股份	303,000	754,470.00	0.33
95	002384	东山精密	41,300	750,834.00	0.32
96	600827	百联股份	79,100	750,659.00	0.32
97	600739	辽宁成大	63,600	749,208.00	0.32
98	002273	水晶光电	54,600	739,284.00	0.32
99	300058	蓝色光标	102,300	734,514.00	0.32
100	600416	湘电股份	46,200	733,656.00	0.32
101	601106	中国一重	253,900	731,232.00	0.32
102	000630	铜陵有色	221,400	726,192.00	0.31
103	002439	启明星辰	26,700	720,900.00	0.31
104	300001	特锐德	35,300	709,530.00	0.31
105	002465	海格通信	55,200	709,320.00	0.31
106	600348	华阳股份	72,300	705,648.00	0.31
107	600008	首创环保	262,300	705,587.00	0.31
108	001203	大中矿业	69,300	704,781.00	0.30
109	301236	软通动力	14,900	688,380.00	0.30
110	600129	太极集团	14,800	687,608.00	0.30
111	600536	中国软件	18,900	685,314.00	0.30
112	600663	陆家嘴	77,300	676,375.00	0.29
113	600704	物产中大	151,100	669,373.00	0.29
114	002958	青农商行	254,200	666,004.00	0.29
115	002262	恩华药业	24,500	664,440.00	0.29
116	002966	苏州银行	102,600	662,796.00	0.29
117	300017	网宿科技	84,400	662,540.00	0.29
118	601233	桐昆股份	43,600	659,668.00	0.29
119	600655	豫园股份	105,000	652,050.00	0.28
120	002600	领益智造	95,900	648,284.00	0.28
121	600879	航天电子	83,500	643,785.00	0.28
122	603927	中科软	21,100	632,578.00	0.27
123	600325	华发股份	87,200	628,712.00	0.27
124	300395	菲利华	17,100	625,176.00	0.27
125	603026	胜华新材	13,600	623,696.00	0.27

126	002092	中泰化学	100,900	615,490.00	0.27
127	000563	陕国投 A	202,200	614,688.00	0.27
128	002624	完美世界	51,900	614,496.00	0.27
129	603379	三美股份	17,900	608,600.00	0.26
130	000581	威孚高科	39,900	601,293.00	0.26
131	688276	百克生物	10,879	596,277.99	0.26
132	603858	步长制药	34,900	593,649.00	0.26
133	600528	中铁工业	79,200	589,248.00	0.25
134	300776	帝尔激光	9,600	578,496.00	0.25
135	600977	中国电影	47,100	576,504.00	0.25
136	002056	横店东磁	41,600	563,264.00	0.24
137	002131	利欧股份	246,600	562,248.00	0.24
138	688521	芯原股份	11,245	561,800.20	0.24
139	000930	中粮科技	84,600	561,744.00	0.24
140	600160	巨化股份	33,800	557,362.00	0.24
141	600535	天士力	32,400	551,448.00	0.24
142	688002	睿创微纳	12,438	550,008.36	0.24
143	000738	航发控制	26,900	535,310.00	0.23
144	002511	中顺洁柔	53,500	535,000.00	0.23
145	688105	诺唯赞	16,700	534,734.00	0.23
146	603568	伟明环保	33,000	528,000.00	0.23
147	000156	华数传媒	71,200	524,744.00	0.23
148	300601	康泰生物	19,100	518,565.00	0.22
149	600095	湘财股份	68,600	515,186.00	0.22
150	600208	新湖中宝	236,500	513,205.00	0.22
151	600959	江苏有线	161,500	507,110.00	0.22
152	601958	金钼股份	53,600	506,520.00	0.22
153	300003	乐普医疗	31,100	502,576.00	0.22
154	688728	格科微	24,500	501,515.00	0.22
155	688385	复旦微电	12,700	490,601.00	0.21
156	600928	西安银行	147,300	490,509.00	0.21
157	300212	易华录	15,500	487,475.00	0.21
158	603882	金域医学	7,700	481,789.00	0.21
159	688567	孚能科技	29,410	479,677.10	0.21
160	000050	深天马 A	45,000	479,250.00	0.21
161	300144	宋城演艺	48,300	476,721.00	0.21
162	300558	贝达药业	9,200	474,260.00	0.21
163	601231	环旭电子	30,900	466,899.00	0.20
164	603355	莱克电气	20,800	463,840.00	0.20
165	600060	海信视像	21,900	457,710.00	0.20
166	603156	养元饮品	20,700	440,082.00	0.19
167	000878	云南铜业	40,400	439,956.00	0.19
168	300207	欣旺达	29,600	436,896.00	0.19

169	000937	冀中能源	60,900	434,826.00	0.19
170	600143	金发科技	53,700	429,063.00	0.19
171	002326	永太科技	36,900	428,778.00	0.19
172	600141	兴发集团	23,400	427,050.00	0.18
173	300088	长信科技	62,900	420,801.00	0.18
174	601000	唐山港	119,500	418,250.00	0.18
175	002690	美亚光电	21,100	414,404.00	0.18
176	000729	燕京啤酒	47,900	413,377.00	0.18
177	000723	美锦能源	61,800	411,588.00	0.18
178	000598	兴蓉环境	72,100	410,249.00	0.18
179	000539	粤电力 A	82,600	403,914.00	0.17
180	002925	盈趣科技	20,700	403,029.00	0.17
181	600038	中直股份	10,400	400,712.00	0.17
182	601077	渝农商行	98,000	399,840.00	0.17
183	600863	内蒙华电	102,200	398,580.00	0.17
184	601555	东吴证券	54,000	394,740.00	0.17
185	688072	拓荆科技	1,704	394,135.20	0.17
186	300253	卫宁健康	54,200	389,698.00	0.17
187	300595	欧普康视	17,200	388,376.00	0.17
188	002414	高德红外	51,700	377,410.00	0.16
189	601598	中国外运	71,200	373,088.00	0.16
190	603529	爱玛科技	14,800	370,592.00	0.16
191	688536	思瑞浦	2,514	367,798.20	0.16
192	601828	美凯龙	94,100	364,167.00	0.16
193	600377	宁沪高速	35,200	360,800.00	0.16
194	600177	雅戈尔	54,900	359,595.00	0.16
195	600862	中航高科	16,000	354,400.00	0.15
196	605358	立昂微	12,896	353,221.44	0.15
197	002372	伟星新材	24,200	350,174.00	0.15
198	600820	隧道股份	60,400	347,904.00	0.15
199	000519	中兵红箭	24,700	346,788.00	0.15
200	600546	山煤国际	19,400	339,694.00	0.15
201	000027	深圳能源	52,580	339,141.00	0.15
202	000988	华工科技	11,300	336,288.00	0.15
203	002409	雅克科技	6,000	334,380.00	0.14
204	000703	恒逸石化	49,100	329,952.00	0.14
205	002568	百润股份	13,300	327,313.00	0.14
206	603737	三棵树	6,800	323,748.00	0.14
207	601608	中信重工	82,600	318,836.00	0.14
208	000967	盈峰环境	66,600	316,350.00	0.14
209	688520	神州细胞	5,800	312,446.00	0.14
210	603712	七一二	9,800	308,798.00	0.13
211	600373	中文传媒	22,900	301,822.00	0.13

212	300418	昆仑万维	8,000	299,200.00	0.13
213	601298	青岛港	48,200	297,876.00	0.13
214	688032	禾迈股份	1,100	297,000.00	0.13
215	002532	天山铝业	49,000	294,490.00	0.13
216	600529	山东药玻	11,500	294,400.00	0.13
217	600481	双良节能	34,700	293,562.00	0.13
218	603893	瑞芯微	4,600	291,640.00	0.13
219	600155	华创云信	34,900	291,066.00	0.13
220	600839	四川长虹	53,300	281,957.00	0.12
221	600967	内蒙一机	33,000	272,580.00	0.12
222	688052	纳芯微	1,600	266,960.00	0.12
223	600521	华海药业	17,800	261,126.00	0.11
224	688220	翱捷科技	3,700	260,628.00	0.11
225	301029	怡合达	10,100	260,378.00	0.11
226	601098	中南传媒	25,600	260,352.00	0.11
227	688301	奕瑞科技	800	260,208.00	0.11
228	600563	法拉电子	2,800	259,280.00	0.11
229	603127	昭衍新药	10,780	255,593.80	0.11
230	603228	景旺电子	11,200	252,672.00	0.11
231	600597	光明乳业	28,600	249,678.00	0.11
232	300568	星源材质	16,000	246,720.00	0.11
233	000559	万向钱潮	46,900	243,411.00	0.11
234	600350	山东高速	34,800	241,512.00	0.10
235	688029	南微医学	2,410	233,288.00	0.10
236	002558	巨人网络	20,900	232,826.00	0.10
237	300257	开山股份	14,700	231,672.00	0.10
238	002244	滨江集团	31,200	226,824.00	0.10
239	688107	安路科技	6,100	224,358.00	0.10
240	002673	西部证券	35,200	224,224.00	0.10
241	002423	中粮资本	33,400	223,112.00	0.10
242	600022	山东钢铁	162,500	222,625.00	0.10
243	000683	远兴能源	36,100	211,907.00	0.09
244	601992	金隅集团	110,800	211,628.00	0.09
245	300394	天孚通信	2,300	210,496.00	0.09
246	002155	湖南黄金	18,300	203,862.00	0.09
247	002156	通富微电	8,800	203,456.00	0.09
248	600329	达仁堂	6,000	201,900.00	0.09
249	600482	中国动力	11,200	201,712.00	0.09
250	601778	晶科科技	56,200	196,700.00	0.09
251	688005	容百科技	4,900	195,020.00	0.08
252	002572	索菲亚	12,100	192,995.00	0.08
253	600808	马钢股份	70,800	192,576.00	0.08
254	601880	辽港股份	132,800	192,560.00	0.08

255	600126	杭钢股份	35,100	187,083.00	0.08
256	600498	烽火通信	11,000	183,040.00	0.08
257	600906	财达证券	24,200	181,500.00	0.08
258	000825	太钢不锈	48,400	180,532.00	0.08
259	001914	招商积余	14,800	177,008.00	0.08
260	300244	迪安诊断	7,300	173,813.00	0.08
261	603650	彤程新材	5,200	173,160.00	0.07
262	002517	恺英网络	15,400	172,018.00	0.07
263	300748	金力永磁	8,300	167,826.00	0.07
264	000970	中科三环	16,200	167,670.00	0.07
265	601187	厦门银行	32,800	166,296.00	0.07
266	600021	上海电力	19,300	163,278.00	0.07
267	600167	联美控股	28,000	158,760.00	0.07
268	600062	华润双鹤	8,500	158,100.00	0.07
269	603883	老百姓	5,200	155,428.00	0.07
270	600580	卧龙电驱	13,000	152,490.00	0.07
271	002608	江苏国信	22,600	148,482.00	0.06
272	603267	鸿远电子	2,900	145,580.00	0.06
273	601162	天风证券	46,700	144,303.00	0.06
274	300026	红日药业	33,200	140,768.00	0.06
275	002850	科达利	1,600	135,136.00	0.06
276	000709	河钢股份	63,400	135,042.00	0.06
277	300529	健帆生物	5,900	131,157.00	0.06
278	300285	国瓷材料	5,600	129,472.00	0.06
279	001872	招商港口	8,100	129,276.00	0.06
280	000933	神火股份	7,600	127,680.00	0.06
281	600004	白云机场	13,000	127,140.00	0.05
282	300724	捷佳伟创	1,700	125,817.00	0.05
283	002030	达安基因	12,700	122,936.00	0.05
284	002487	大金重工	4,600	122,452.00	0.05
285	601228	广州港	37,700	118,001.00	0.05
286	002468	申通快递	15,000	116,850.00	0.05
287	688169	石头科技	400	113,180.00	0.05
288	603826	坤彩科技	1,900	112,157.00	0.05
289	300037	新宙邦	2,300	108,790.00	0.05
290	600927	永安期货	6,900	108,399.00	0.05
291	002065	东华软件	17,500	107,975.00	0.05
292	000778	新兴铸管	28,100	107,342.00	0.05
293	002508	老板电器	4,900	106,722.00	0.05
294	300070	碧水源	21,100	105,289.00	0.05
295	603056	德邦股份	7,200	104,184.00	0.05
296	600566	济川药业	3,300	103,719.00	0.04
297	300604	长川科技	2,700	102,573.00	0.04

298	603816	顾家家居	2,900	101,500.00	0.04
299	600968	海油发展	33,600	95,760.00	0.04
300	601139	深圳燃气	13,800	95,082.00	0.04
301	600699	均胜电子	5,200	93,392.00	0.04
302	600435	北方导航	7,900	92,746.00	0.04
303	002761	浙江建投	9,000	92,340.00	0.04
304	000553	安道麦 A	13,300	92,302.00	0.04
305	002192	融捷股份	1,700	92,157.00	0.04
306	002399	海普瑞	7,600	89,148.00	0.04
307	002019	亿帆医药	6,000	88,680.00	0.04
308	300373	扬杰科技	2,400	88,080.00	0.04
309	600369	西南证券	21,500	87,935.00	0.04
310	002299	圣农发展	5,000	85,900.00	0.04
311	300363	博腾股份	3,400	85,510.00	0.04
312	300073	当升科技	2,200	84,040.00	0.04
313	002128	电投能源	5,600	79,912.00	0.03
314	600166	福田汽车	28,500	77,805.00	0.03
315	603000	人民网	2,700	75,546.00	0.03
316	688248	南网科技	3,000	74,910.00	0.03
317	000021	深科技	4,500	72,945.00	0.03
318	002936	郑州银行	34,600	69,546.00	0.03
319	688538	和辉光电	28,200	68,526.00	0.03
320	001227	兰州银行	26,300	68,380.00	0.03
321	600642	申能股份	10,600	68,052.00	0.03
322	600170	上海建工	28,400	66,456.00	0.03
323	600901	江苏金租	13,700	66,308.00	0.03
324	603885	吉祥航空	5,500	66,000.00	0.03
325	600549	厦门钨业	3,800	65,284.00	0.03
326	600764	中国海防	2,600	64,870.00	0.03
327	600998	九州通	9,033	63,321.33	0.03
328	002867	周大生	4,100	62,238.00	0.03
329	002432	九安医疗	1,600	60,272.00	0.03
330	002557	洽洽食品	1,700	59,194.00	0.03
331	003035	南网能源	11,200	58,912.00	0.03
332	600499	科达制造	5,100	53,805.00	0.02
333	002939	长城证券	6,000	48,000.00	0.02
334	002368	太极股份	1,600	47,248.00	0.02
335	600315	上海家化	2,200	46,596.00	0.02
336	600511	国药股份	1,600	45,792.00	0.02
337	600486	扬农化工	140	8,836.80	0.00
338	688295	中复神鹰	200	6,062.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	688319	欧林生物	58,231	920,049.80	0.40
2	600507	方大特钢	120,600	555,966.00	0.24
3	600941	中国移动	5,400	537,192.00	0.23
4	688617	惠泰医疗	1,300	505,050.00	0.22
5	300573	兴齐眼药	2,760	503,203.20	0.22
6	600623	华谊集团	77,300	497,812.00	0.22
7	688037	芯源微	3,500	467,635.00	0.20
8	601138	工业富联	30,400	459,648.00	0.20
9	600372	中航机载	32,400	427,032.00	0.18
10	603108	润达医疗	20,100	409,035.00	0.18
11	300741	华宝股份	19,100	408,931.00	0.18
12	600760	中航沈飞	9,200	388,056.00	0.17
13	002179	中航光电	9,500	370,500.00	0.16
14	300124	汇川技术	5,800	366,212.00	0.16
15	300308	中际旭创	3,100	350,021.00	0.15
16	002601	龙佰集团	20,400	349,452.00	0.15
17	688111	金山办公	1,100	347,820.00	0.15
18	600309	万华化学	4,500	345,690.00	0.15
19	600426	华鲁恒升	12,500	344,875.00	0.15
20	605589	圣泉集团	15,100	337,938.00	0.15
21	300638	广和通	17,600	334,928.00	0.14
22	600019	宝钢股份	53,700	318,441.00	0.14
23	002745	木林森	34,900	302,234.00	0.13
24	688223	晶科能源	32,000	283,520.00	0.12
25	002602	世纪华通	54,000	278,640.00	0.12
26	600556	天下秀	47,100	278,361.00	0.12
27	002459	晶澳科技	13,400	277,648.00	0.12
28	000612	焦作万方	48,100	276,575.00	0.12
29	301308	江波龙	3,000	276,150.00	0.12
30	600795	国电电力	63,700	264,992.00	0.11
31	600480	凌云股份	28,700	261,457.00	0.11
32	600489	中金黄金	25,900	257,964.00	0.11
33	000100	TCL 科技	59,900	257,570.00	0.11
34	688195	腾景科技	7,100	255,529.00	0.11
35	600705	中航产融	73,800	229,518.00	0.10
36	688235	百济神州	1,600	222,464.00	0.10
37	001979	招商蛇口	22,700	216,331.00	0.09
38	600667	太极实业	30,300	213,009.00	0.09
39	000819	岳阳兴长	10,700	193,456.00	0.08
40	000415	渤海租赁	88,700	189,818.00	0.08
41	688786	悦安新材	4,100	182,204.00	0.08
42	000951	中国重汽	13,600	181,696.00	0.08

43	002139	拓邦股份	18,600	181,536.00	0.08
44	002401	中远海科	10,000	181,200.00	0.08
45	600050	中国联通	40,600	177,828.00	0.08
46	601615	明阳智能	14,100	176,814.00	0.08
47	002410	广联达	10,300	176,542.00	0.08
48	600276	恒瑞医药	3,900	176,397.00	0.08
49	600880	博瑞传播	34,600	173,346.00	0.07
50	600519	贵州茅台	100	172,600.00	0.07
51	000333	美的集团	3,100	169,353.00	0.07
52	002396	星网锐捷	9,200	166,244.00	0.07
53	000651	格力电器	5,100	164,067.00	0.07
54	605377	华旺科技	8,300	158,447.00	0.07
55	002533	金杯电工	19,500	157,560.00	0.07
56	601728	中国电信	28,800	155,808.00	0.07
57	002241	歌尔股份	7,400	155,474.00	0.07
58	601857	中国石油	22,000	155,320.00	0.07
59	600023	浙能电力	33,300	153,513.00	0.07
60	002129	TCL 中环	9,800	153,272.00	0.07
61	601318	中国平安	3,800	153,140.00	0.07
62	601019	山东出版	16,300	152,894.00	0.07
63	300709	精研科技	4,900	152,831.00	0.07
64	600461	洪城环境	16,700	152,638.00	0.07
65	600180	瑞茂通	25,000	152,250.00	0.07
66	000906	浙商中拓	20,800	152,048.00	0.07
67	002083	孚日股份	30,100	151,704.00	0.07
68	601006	大秦铁路	21,000	151,410.00	0.07
69	002466	天齐锂业	2,700	150,633.00	0.07
70	600015	华夏银行	26,400	148,368.00	0.06
71	688443	智翔金泰	3,600	143,820.00	0.06
72	688508	芯朋微	2,900	142,709.00	0.06
73	000901	航天科技	15,200	141,664.00	0.06
74	605068	明新旭腾	6,300	141,372.00	0.06
75	300043	星辉娱乐	37,800	140,238.00	0.06
76	300274	阳光电源	1,600	140,144.00	0.06
77	002588	史丹利	21,600	137,808.00	0.06
78	601766	中国中车	25,700	135,182.00	0.06
79	300627	华测导航	4,300	133,386.00	0.06
80	688003	天准科技	3,400	127,568.00	0.06
81	002493	荣盛石化	11,900	123,165.00	0.05
82	000090	天健集团	26,300	120,980.00	0.05
83	601899	紫金矿业	9,200	114,632.00	0.05
84	301257	普蕊斯	1,800	114,300.00	0.05
85	002221	东华能源	11,000	113,300.00	0.05

86	002110	三钢闽光	27,600	111,780.00	0.05
87	000338	潍柴动力	8,100	110,565.00	0.05
88	300618	寒锐钴业	3,900	110,331.00	0.05
89	600588	用友网络	6,200	110,298.00	0.05
90	688226	威腾电气	5,800	109,040.00	0.05
91	000069	华侨城 A	33,700	104,807.00	0.05
92	688185	康希诺	1,400	104,328.00	0.05
93	600195	中牧股份	8,600	101,996.00	0.04
94	600782	新钢股份	28,200	98,418.00	0.04
95	002870	香山股份	2,700	96,849.00	0.04
96	605222	起帆电缆	4,900	94,472.00	0.04
97	688793	倍轻松	2,800	94,220.00	0.04
98	688009	中国通号	20,800	91,104.00	0.04
99	600547	山东黄金	3,800	86,906.00	0.04
100	688143	长盈通	2,400	84,840.00	0.04
101	002901	大博医疗	2,000	81,180.00	0.04
102	603296	华勤技术	987	78,639.57	0.03
103	301235	华康医疗	3,000	76,890.00	0.03
104	000059	华锦股份	13,900	76,311.00	0.03
105	301179	泽宇智能	2,900	75,255.00	0.03
106	002130	沃尔核材	9,500	71,725.00	0.03
107	688333	铂力特	600	69,540.00	0.03
108	600809	山西汾酒	300	69,219.00	0.03
109	003021	兆威机电	700	65,793.00	0.03
110	601100	恒立液压	1,200	65,616.00	0.03
111	300161	华中数控	1,700	61,030.00	0.03
112	605077	华康股份	2,800	60,592.00	0.03
113	603298	杭叉集团	2,400	59,712.00	0.03
114	002011	盾安环境	4,300	59,125.00	0.03
115	603259	药明康德	800	58,208.00	0.03
116	601965	中国汽研	2,500	55,150.00	0.02
117	000568	泸州老窖	300	53,826.00	0.02
118	603008	喜临门	3,000	51,030.00	0.02
119	002697	红旗连锁	10,200	50,796.00	0.02
120	002970	锐明技术	1,600	48,976.00	0.02
121	600029	南方航空	8,200	47,232.00	0.02
122	603273	天元智能	1,772	43,322.30	0.02
123	603119	浙江荣泰	1,667	40,286.29	0.02
124	603276	恒兴新材	1,162	30,415.36	0.01
125	688549	中巨芯	1,825	14,764.25	0.01
126	301172	君逸数码	346	13,203.36	0.01
127	300476	胜宏科技	700	12,915.00	0.01
128	688627	精智达	139	12,193.08	0.01

129	301370	国科恒泰	744	11,911.44	0.01
130	688563	航材股份	183	11,069.67	0.00
131	688592	司南导航	216	10,914.48	0.00
132	688582	芯动联科	277	10,711.59	0.00
133	301372	科净源	226	9,851.34	0.00
134	688603	天承科技	129	9,564.06	0.00
135	301362	民爆光电	236	9,090.72	0.00
136	301509	金凯生科	145	9,023.35	0.00
137	688610	埃科光电	176	8,976.00	0.00
138	301292	海科新源	462	8,939.70	0.00
139	301291	明阳电气	310	8,791.60	0.00
140	301261	恒工精密	164	8,339.40	0.00
141	301489	思泉新材	128	8,206.08	0.00
142	301251	威尔高	228	7,886.52	0.00
143	688602	康鹏科技	690	7,631.40	0.00
144	301202	朗威股份	237	7,536.60	0.00
145	688716	中研股份	206	7,496.34	0.00
146	301511	德福科技	323	7,322.41	0.00
147	301528	多浦乐	106	7,304.46	0.00
148	301505	苏州规划	194	6,947.14	0.00
149	301210	金杨股份	150	6,822.00	0.00
150	301393	昊帆生物	112	6,649.44	0.00
151	301456	盘古智能	211	6,412.29	0.00
152	301468	博盈特焊	212	6,406.64	0.00
153	301395	仁信新材	338	6,317.22	0.00
154	301525	儒竞科技	75	6,109.50	0.00
155	688646	逸飞激光	169	6,095.83	0.00
156	688693	锆威特	136	5,903.76	0.00
157	301559	中集环科	320	5,836.80	0.00
158	301550	斯菱股份	133	5,794.81	0.00
159	301517	陕西华达	129	5,636.01	0.00
160	301515	港通医疗	199	5,625.73	0.00
161	688429	时创能源	259	5,488.21	0.00
162	301371	敷尔佳	143	5,373.94	0.00
163	688612	威迈斯	141	5,353.77	0.00
164	301548	崇德科技	83	4,896.17	0.00
165	688657	浩辰软件	62	4,850.26	0.00
166	301520	万邦医药	90	4,746.60	0.00
167	688450	光格科技	108	3,933.36	0.00
168	603075	热威股份	113	2,634.03	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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	000932	华菱钢铁	7,677,042.00	2.76
2	002025	航天电器	6,932,818.47	2.49
3	600580	卧龙电驱	6,524,117.00	2.35
4	688208	道通科技	6,519,512.10	2.34
5	600704	物产中大	6,402,810.00	2.30
6	600718	东软集团	6,293,459.77	2.26
7	000997	新大陆	6,244,500.00	2.25
8	000987	越秀资本	6,241,913.00	2.24
9	600258	首旅酒店	6,173,426.00	2.22
10	000009	中国宝安	6,082,332.00	2.19
11	600153	建发股份	6,018,919.00	2.16
12	600170	上海建工	6,003,256.72	2.16
13	600109	国金证券	5,933,769.00	2.13
14	000591	太阳能	5,890,314.00	2.12
15	600582	天地科技	5,794,828.00	2.08
16	600390	五矿资本	5,581,464.79	2.01
17	002299	圣农发展	5,559,347.00	2.00
18	603444	吉比特	5,343,756.00	1.92
19	300724	捷佳伟创	5,274,614.00	1.90
20	600021	上海电力	5,270,746.00	1.90

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。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300308	中际旭创	9,779,401.00	3.52
2	000997	新大陆	8,504,825.00	3.06
3	600718	东软集团	8,336,089.12	3.00
4	600582	天地科技	7,311,373.00	2.63
5	601555	东吴证券	7,028,234.50	2.53
6	600901	江苏金租	6,815,708.96	2.45
7	300017	网宿科技	6,674,271.45	2.40
8	600580	卧龙电驱	6,630,868.65	2.38
9	600155	华创云信	6,439,939.00	2.32
10	002624	完美世界	6,398,756.40	2.30
11	603444	吉比特	6,366,779.00	2.29
12	000728	国元证券	6,268,133.65	2.25
13	300136	信维通信	6,176,972.00	2.22
14	300073	当升科技	6,175,284.04	2.22

15	601128	常熟银行	6,171,158.00	2.22
16	601598	中国外运	6,154,802.87	2.21
17	002625	光启技术	6,082,563.00	2.19
18	600704	物产中大	6,067,819.00	2.18
19	600967	内蒙一机	6,067,175.00	2.18
20	688390	固德威	6,026,929.31	2.17
21	000932	华菱钢铁	6,016,340.00	2.16
22	600096	云天化	5,904,571.00	2.12
23	000778	新兴铸管	5,894,365.00	2.12
24	600438	通威股份	5,821,799.00	2.09
25	600373	中文传媒	5,755,529.00	2.07
26	600008	首创环保	5,751,425.00	2.07
27	300861	美畅股份	5,667,768.00	2.04
28	002373	千方科技	5,659,198.69	2.03
29	600170	上海建工	5,644,289.00	2.03
30	600598	北大荒	5,633,176.97	2.03
31	600021	上海电力	5,610,271.65	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。

#### 8.4.3 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	1,360,011,151.26
卖出股票收入（成交）总额	1,382,890,886.26

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。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

#### 8.7 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。

#### 8.8 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。

#### 8.9 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。

## 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 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。

### 8.11.2 本期国债期货投资评价

本报告期本基金没有投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 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，深圳顺络电子股份有限公司于 2023 年 8 月 19 日曾受到深圳市公安局龙华分局公开处罚。

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。

### 8.12.2 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。

### 8.12.3 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	15,598.56
2	应收清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	143,112.62
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	158,711.18

### 8.12.4 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。

## 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

## 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

## 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

## 8.12.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

## 9.1 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 (%)
27,877	7,087.24	23,623,817.21	11.96	173,947,289.27	88.04

## 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	黄华生	232,400.00	5.46
2	夏天江	152,408.00	3.58
3	于兆瑞	138,696.00	3.26
4	傅新彩	126,271.00	2.96
5	杨佳慧	104,833.00	2.46
6	王香云	101,600.00	2.39
7	胡晓颖	81,631.00	1.92
8	马春杰	74,915.00	1.76
9	林琛	72,346.00	1.70
10	胡丽春	66,000.00	1.55

注：持有人为本基金场内持有人。

## 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	86,166.67	0.0436

## 9.4 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、基金投资和研究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

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019 年 11 月 6 日） 基金份额总额	283,184,730.54
本报告期期初基金份额总额	214,780,518.45
本报告期基金总申购份额	36,119,151.34
减：本报告期基金总赎回份额	53,328,563.31
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	197,571,106.48

注：上述基金合同生效日的基金份额总额为基金转型起始日（2019 年 11 月 6 日）的基金份额总额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金没有召开基金份额持有人大会。

### 11.2 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，基金管理人于 2023 年 9 月 2 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》，聘任刁羽先生为公司副总经理；于 2023 年 11 月 21 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》，聘任宋扬先生为公司副总经理，刘晓玲女士不再担任公司副总经理职务。

2、本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金无投资策略的变化。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本年度本基金未更换会计师事务所，本年度支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计费用为人民币 60,000.00 元，该审计机构对本基金提供审计服务的连续年限为 12 年。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 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。

### 11.6.2 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。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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 (%)	
国泰君安	1	319,292,462.32	11.68	299,656.26	11.70	-
西南证券	2	212,646,716.60	7.78	199,886.46	7.80	-
财通证券	1	210,185,715.09	7.69	196,204.22	7.66	-
国盛证券	2	195,906,113.12	7.17	182,450.93	7.12	-
招商证券	1	186,276,622.20	6.81	175,237.15	6.84	-
浙商证券	1	171,776,303.51	6.28	159,975.72	6.25	-
东方证券	3	149,930,533.94	5.48	141,418.27	5.52	-
华西证券	1	139,324,353.64	5.10	129,755.60	5.07	-
开源证券	1	136,918,491.91	5.01	127,516.80	4.98	-
国投证券	2	132,231,462.26	4.84	124,553.12	4.86	-
华安证券	1	104,352,660.89	3.82	97,184.57	3.79	-
中泰证券	1	94,729,371.43	3.47	89,601.08	3.50	-
太平洋证券	2	91,920,418.15	3.36	85,604.46	3.34	-
长江证券	1	78,962,708.44	2.89	73,539.77	2.87	-
中信建投	3	72,557,800.72	2.65	67,572.42	2.64	-
中金公司	1	68,930,034.25	2.52	64,711.39	2.53	-
国金证券	1	62,131,102.6	2.27	58,772.00	2.29	-

		5				
东吴证券	2	49,725,162.89	1.82	47,036.49	1.84	-
华创证券	1	37,516,642.84	1.37	35,489.09	1.39	-
海通证券	2	37,457,482.58	1.37	35,429.68	1.38	-
广发证券	1	36,457,360.30	1.33	33,953.62	1.33	-
德邦证券	1	35,730,143.45	1.31	33,796.81	1.32	-
国联证券	1	33,899,971.86	1.24	31,570.00	1.23	-
国信证券	1	25,227,095.89	0.92	23,494.18	0.92	-
东北证券	2	20,775,158.44	0.76	19,652.18	0.77	-
信达证券	1	15,071,853.41	0.55	14,254.81	0.56	-
民生证券	1	12,709,156.78	0.46	12,023.32	0.47	-
中信证券	3	799,787.90	0.03	744.91	0.03	-
天风证券	1	126,141.55	0.00	117.49	0.00	-
华泰证券	2	94,466.30	0.00	87.97	0.00	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
东方财富	1	-	-	-	-	-
东亚前海	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
诚通证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-

注：（一）本基金本报告期新增民生证券 57634、国投证券 013064，撤销平安证券 55440、财信证券 28314、财信证券 340700 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。
- (3) 能为基金管理人提供高质量的研究咨询服务。

### 11.7.2 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 (%)
国泰君安	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	6,838,000.00	11.59	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	16,400,000.00	27.80	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	1,324,000.00	2.24	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	2,762,000.00	4.68	-	-
长江证	-	-	12,955,000.0	21.96	-	-

券			0			
中信建投	-	-	11,943,000.00	20.25	-	-
中金公司	-	-	6,768,000.00	11.47	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
东亚前海	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证	-	-	-	-	-	-

券						
国海证 券	-	-	-	-	-	-
江海证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-
西部证 券	-	-	-	-	-	-
湘财证 券	-	-	-	-	-	-
诚通证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-
中山证 券	-	-	-	-	-	-
中银国 际	-	-	-	-	-	-

## 11.8 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	《关于泰达宏利中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) 变更基金名称和场内简称的公告》	《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站及公司网站	2023 年 06 月 17 日
2	《宏利中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金经理变更公告》	《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站及公司网站	2023 年 6 月 30 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 影响投资者决策的其他重要信息

1. 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中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF)。

2. 我司已于 2023 年 9 月 9 日发布《宏利基金管理有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金明确投资范围包含存托凭证并修改基金合同、托管协议的公告》，经与各基金托管人协

商一致，并报中国证监会备案，决定对旗下部分基金相关法律文件进行修订，具体包括明确投资范围包含存托凭证、增加存托凭证的投资策略、投资比例限制、估值方法等，修订后法律文件自 2023 年 9 月 11 日起正式生效。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 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。

### 13.2 存放地点

基金管理人和托管人住所。

### 13.3 查阅方式

投资者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

2024 年 3 月 30 日