

宏利风险预算混合型证券投资基金 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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 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 1 月 1 日起至 2023 年 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	6
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
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
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	14
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	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
§ 7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表	16
7.2 利润表	18
7.3 净资产变动表	19
7.4 报表附注	21
§ 8 投资组合报告	49
8.1 期末基金资产组合情况	49
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	50

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	50
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	63
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	65
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	65
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	66
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	66
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	66
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	66
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	66
8.12 投资组合报告附注	66
§ 9 基金份额持有人信息	67
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	67
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	67
§ 10 开放式基金份额变动	67
§ 11 重大事件揭示	68
11.1 基金份额持有人大会决议	68
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	68
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	68
11.4 基金投资策略的改变	68
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	68
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	68
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	68
11.8 其他重大事件	71
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	71
12.1 影响投资者决策的其他重要信息	71
§ 13 备查文件目录	71
13.1 备查文件目录	71
13.2 存放地点	72
13.3 查阅方式	72

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	宏利风险预算混合型证券投资基金
基金简称	宏利风险预算混合
基金主代码	162205
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005 年 4 月 5 日
基金管理人	宏利基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	63,329,606.24 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		宏利基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	徐娇	陆志俊
	联系电话	66577766	95559
	电子邮箱	irm@manulifefund.com.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		400-698-8888	95559
传真		010-66577666	021-62701216
注册地址		北京市朝阳区针织路 23 号楼中国人寿金融中心 6 层 02-07 单元	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号
办公地址		北京市朝阳区针织路 23 号楼中国人寿金融中心 6 层 02-07 单元	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码		100026	200336
法定代表人		高贵鑫	任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	https://www.manulifefund.com.cn
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	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、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	266,209.10	-10,877,857.20	43,467,062.99
本期利润	376,822.69	-12,834,026.94	17,824,034.84
加权平均基金份额本期利润	0.0057	-0.1133	0.0423
本期加权平均净值利润率	0.51%	-9.70%	3.33%
本期基金份额净值增长率	0.45%	-4.17%	2.96%
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	6,687,452.26	6,891,806.58	57,372,102.18
期末可供分配基金份额利润	0.1056	0.1007	0.2483
期末基金资产净值	70,017,058.50	75,299,249.29	288,385,874.57
期末基金份额净值	1.1056	1.1007	1.2483
3.1.3 累	2023 年末	2022 年末	2021 年末

计期末指标			
基金份额累计净值增长率	531.62%	528.82%	556.17%

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. 对期末可供分配利润，采用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	-0.94%	0.24%	-0.81%	0.19%	-0.13%	0.05%
过去六个月	-1.54%	0.24%	-1.12%	0.18%	-0.42%	0.06%
过去一年	0.45%	0.24%	-0.30%	0.17%	0.75%	0.07%
过去三年	-0.90%	0.35%	-1.60%	0.22%	0.70%	0.13%
过去五年	39.29%	0.39%	14.89%	0.24%	24.40%	0.15%
自基金合同生效起至今	531.62%	0.64%	120.20%	0.32%	411.42%	0.32%

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

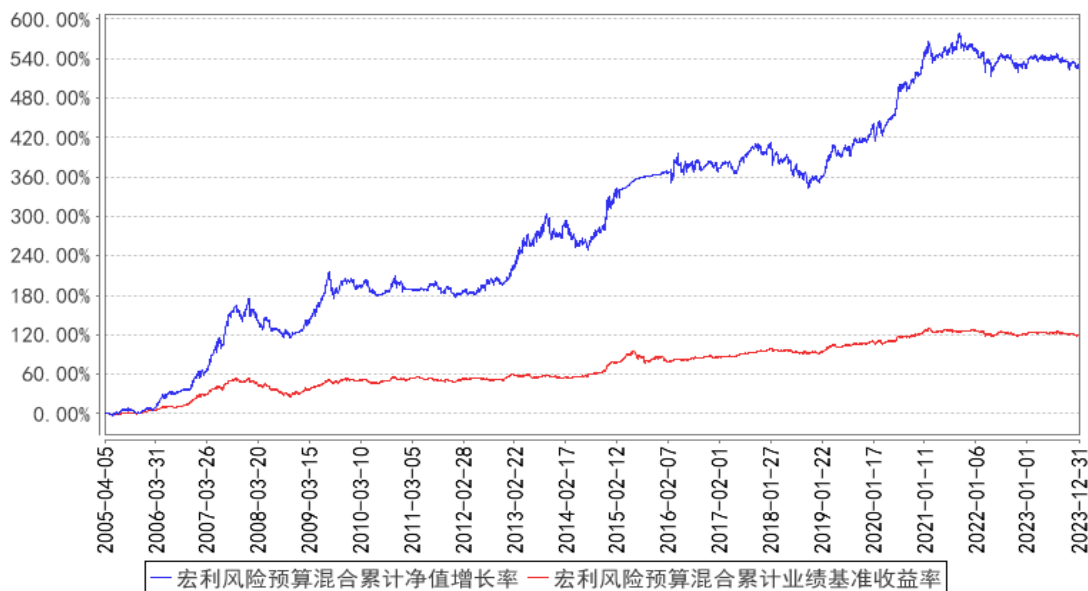
富时中国 A200 指数是富时指数公司编制的包含上海、深圳两个证券交易所总市值最大的 200 只股票并以流通股本加权的股票指数，具有良好的市场代表性。中证国债指数的样本涵盖了三个市场中（银行间市场，沪深交易所）的一年期以上的国债，中证金融债指数样本涵盖银行间市场上一年期以上的金融债，中证企业债指数样本涵盖了三个市场上一年期以上的企业债，分别反映了我国债券市场不同信用类别债券的整体价格变动趋势，具有良好的市场代表性。

自 2013 年 3 月 30 日起本基金业绩比较基准变更为“ $5\% \times \text{中证国债指数} + 15\% \times \text{中证金融债指数} + 10\% \times \text{中证企业债指数} + 20\% \times \text{富时中国 A200 指数} + 50\% \times \text{税后一年期银行定期存款利率}$ ”。原比较基准为：“ $\text{一年期银行定期存款利率(税后)} * 50\% + \text{富时中国 A200 指数} * 20\% + \text{新华巴克莱资本中国政府机构债指数} * 15\% + \text{新华巴克莱资本中国企业债指数} * 10\% + \text{新华巴克莱资本中国国}$

债指数*5%。详情请参照我公司 2013 年 3 月 30 日发布的《泰达宏利风险预算混合型证券投资基金关于变更业绩比较基准及修改基金合同的公告》。

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

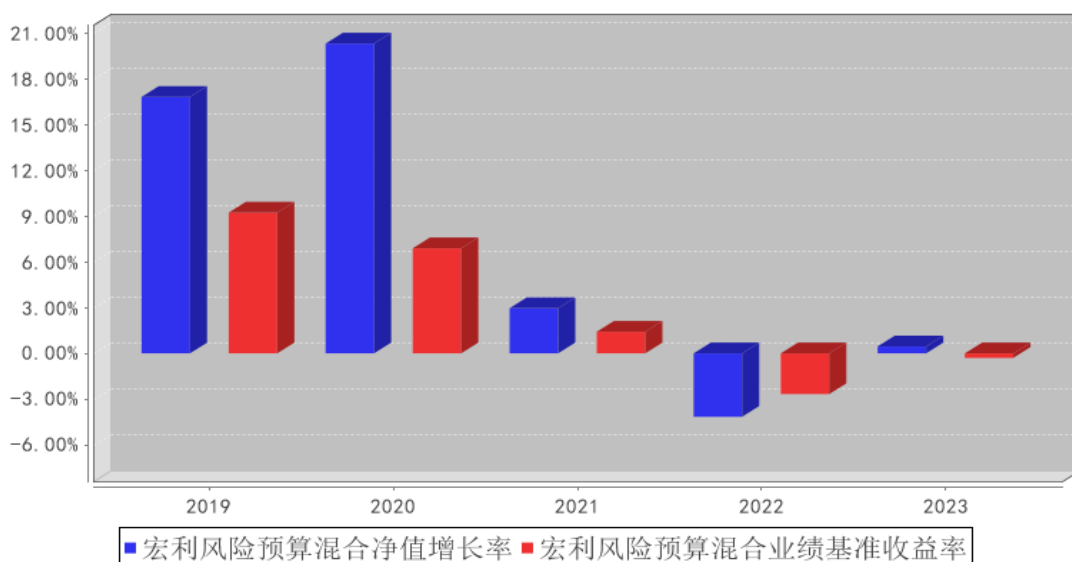
宏利风险预算混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金在建仓期结束和本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 过去五年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

宏利风险预算混合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



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分 红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总 额	年度利润分配合计	备注

2023 年	-	-	-	-
2022 年	0.9410	3,897,273.39	3,315,691.87	7,212,965.26
2021 年	0.8390	38,105,240.88	3,372,135.42	41,477,376.30
合计	1.7800	42,002,514.27	6,687,827.29	48,690,341.56

§ 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		
刘欣	总经理助理兼基金经理	2016 年 9 月 26 日	-	16 年	清华大学理学硕士；2007 年 7 月至 2008 年 12 月就职于工银瑞信基金管理有限公司；2008 年 12 月至 2011 年 7 月就职于嘉实基金管理有限公司；2011 年 7 月加盟宏利基金管理有限公司，曾担任产品与金融工程部高级研究员、金融工程部副总经理、金融工程部总经理、投资副总监，现担任公司总经理助理兼基金经理；具备 16 年基金从业经验，16 年证券投资管理经验，具有基金从业资格。
蔡熠阳	固收研究部副总经理（主持工作）兼基金经理	2023 年 9 月 25 日	-	6 年	毕业于上海财经大学金融专业，硕士研究生。自 2017 年 6 月至 2023 年 7 月任职于中欧基金管理有限公司，历任产业研究组组长、基金经理助理；自 2023 年 7 月起任职于宏利基金管理有限公司，曾任固收研究部副总经理（主持工作），现任固收研究部副总经理（主持工作）兼基金经理。具备 6 年基金从业经验，具有基金从业资格。
宁霄	本基金基金经理	2020 年 11 月 4 日	2023 年 9 月 15 日	15 年	中国人民大学金融工程硕士；2006 年 4 月至 2007 年 3 月，任职于兴业全球基金管理有限公司基金运营部，担任基金 TA 清算；2007 年 8 月至 2011 年 3 月，任职于华夏基金管理有限公司，担任基金会计；2013 年 7 月至今任职于宏利基金管理有限公司，曾先后担任债券交易员、交易部交易主管、交易部总经理助理、基金经理助理，2020 年 4 月起担任基金经理。具备 15 年

					证券从业经验，10 年证券投资管理经验，具有基金从业资格。
李婷婷	本基金基金经理助理	2019 年 11 月 18 日	-	6 年	北京大学金融硕士；2017 年 7 月至今任职于宏利基金管理有限公司，曾任策略投资部助理研究员、研究员，现任基金经理。具备 6 年基金从业经验，具有基金从业资格。
刘洋	策略投资部副总经理；基金经理助理	2017 年 04 月 21 日	2023 年 01 月 13 日	8 年	北京大学理学硕士；2015 年 1 月至 2015 年 4 月就职于九坤投资（北京）有限公司，2015 年 5 月加入宏利基金管理有限公司，任职于金融工程部，先后担任助理研究员、研究员、基金经理助理、策略投资部总经理助理等职务，现担任策略投资部副总经理兼基金经理；具备 8 年证券投资管理经验，具有基金从业资格。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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中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，除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，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 年全年 A 股整体持平，内部呈现结构性分化，一方面大盘高分红尤其是央企，以及小微盘股票走出上涨趋势，另一方面机构重仓的高盈利、高成长股票呈现下跌。就整体而言，市场仍然延续了 2022 年趋势，并体现出机构资金拥挤部位下跌多，机构资金稀疏部位上涨的特征。题材方面，尽管海外 AI 技术发展带来对应美股大涨，但 A 股对应标的仅在年初上涨，后续延续性较低。从整体看，资金驱动市场风格较为明显。宏观层面，相对较弱的宏观引导市场预期，观望气息较浓，市场在思考与日本历史比较。市场对降息预期较高，30 年国债收益率大幅下行。

本基金在操作中，无论从仓位管理还是选股结构上，均体现出相对保守的投资风格。在仓位层面，采用目标波动率策略，通过动态调整控制产品整体波动风险。在选股层面，投资风格偏向低估值盈利稳定的大盘蓝筹股。本报告期内，本基金增加了汽车、计算机、有色金属的配置，减少了银行、煤炭、电力设备及新能源的配置。

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 1.1056 元；本报告期基金份额净值增长率为 0.45%，业绩比较基准收益率为-0.30%。

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，仍然坚持看好市场，市场估值已经被极度压缩，PB 约 1.4 倍，与过去十年市场低点 PB 基本一致。不同种类股票经过过去几年止损盘逐步出清，卖出压力逐渐减弱。另一方面，在与日本 90 年代历史比较中，本轮 A 股下跌起点估值不贵，中证全指在 21 年下跌起点市盈率 20 倍，沪深 300 市盈率 17 倍，而日本股市在高位市盈率 90 倍，两者不具备可比性。但仍需关注宏观长期较低预期对市场的影响，尤其是较低迷的房价下带来的相关资产重估。资金面方面，ETF 增量资金入市，北上资金流出缓和甚至出现净流入，边际力量正在向有利于 A 股方向运动。

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

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

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

本报告期内，宏利基金管理有限公司在宏利风险预算混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，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

本报告期内，由宏利基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关宏利风险预算混合型证券投资基金的年度报告中财务指标、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 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 23643 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	宏利风险预算混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了宏利风险预算混合型证券投资基金(原泰达宏利风险预算混合型证券投资基金,以下简称“宏利风险预算混合基金”)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,公允反映了宏利风险预算混合基金 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,我们独立于宏利风险预算混合基金,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任	<p>宏利风险预算混合基金的基金管理人宏利基金管理有限公司(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风险预算混合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风险预算混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督宏利风险预算混合基金的财务报告过程。</p>

<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<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，就可能对宏利风险预算混合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风险预算混合基金不能持续经营。</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>
<p>会计师事务所的名称</p>	<p>普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)</p>
<p>注册会计师的姓名</p>	<p>薛竞 魏佳亮</p>
<p>会计师事务所的地址</p>	<p>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</p>
<p>审计报告日期</p>	<p>2024 年 3 月 26 日</p>

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：宏利风险预算混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 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
资产：			
货币资金	7.4.7.1	314,427.73	889,805.68
结算备付金		548,533.37	195,673.57
存出保证金		6,424.79	7,689.16
交易性金融资产	7.4.7.2	67,348,277.22	74,180,776.26
其中：股票投资		21,416,719.48	22,657,434.64
基金投资		-	-
债券投资		45,931,557.74	51,523,341.62
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	2,951,975.85	1,499,780.82
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		11,576.51	17,994.99
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		71,181,215.47	76,791,720.48
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		200,000.00	499,561.64
应付赎回款		25,674.07	12,506.24
应付管理人报酬		41,777.38	46,848.48
应付托管费		11,936.40	16,731.60
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		641,059.57	636,667.16
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	243,709.55	280,156.07
负债合计		1,164,156.97	1,492,471.19
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	63,329,606.24	68,407,442.71
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	6,687,452.26	6,891,806.58
净资产合计		70,017,058.50	75,299,249.29
负债和净资产总计		71,181,215.47	76,791,720.48

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.1056 元，基金份额总额 63,329,606.24 份。

7.2 利润表

会计主体：宏利风险预算混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 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
一、营业总收入		1,265,766.66	-11,313,957.78
1. 利息收入		25,139.74	29,553.56
其中：存款利息收入	7.4.7.13	13,436.49	29,334.38
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		11,703.25	219.18
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,126,318.76	-9,518,281.25
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-1,135,046.48	-13,830,276.88
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	1,872,521.34	3,822,672.16
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
收益			
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	388,843.90	489,323.47
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	110,613.59	-1,956,169.74
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	3,694.57	130,939.65
减：二、营业总支出		888,943.97	1,520,069.16
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	516,429.38	942,373.44
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	176,223.68	336,561.96
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		22,248.26	20,986.10
其中：卖出回购金融资产支出		22,248.26	20,986.10
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		724.54	1,782.66
8. 其他费用	7.4.7.23	173,318.11	218,365.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		376,822.69	-12,834,026.94
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		376,822.69	-12,834,026.94
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		376,822.69	-12,834,026.94

7.3 净资产变动表

会计主体：宏利风险预算混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 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	68,407,442.71	-	6,891,806.58	75,299,249.29
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	68,407,442.71	-	6,891,806.58	75,299,249.29

三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-5,077,836.47	-	-204,354.32	-5,282,190.79
(一)、综合收益总额	-	-	376,822.69	376,822.69
(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)	-5,077,836.47	-	-581,177.01	-5,659,013.48
其中：1.基金申购款	2,957,272.68	-	348,335.87	3,305,608.55
2.基金赎回款	-8,035,109.15	-	-929,512.88	-8,964,622.03
(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	63,329,606.24	-	6,687,452.26	70,017,058.50
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	231,013,772.39	-	57,372,102.18	288,385,874.57
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	231,013,772.39	-	57,372,102.18	288,385,874.57
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-162,606,329.68	-	-50,480,295.60	-213,086,625.28
(一)、综合收益总额	-	-	-12,834,026.94	-12,834,026.94
(二)、本期基金份额交易产生的	-162,606,329.6	-	-30,433,303.40	-193,039,633.08

净资产变动数 (净资产减少以 “-”号填列)	8			
其中：1. 基金申 购款	11,545,042.64	-	1,490,847.13	13,035,889.77
2. 基金赎 回款	-174,151,372.3 2	-	-31,924,150.53	-206,075,522.85
(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)	-	-	-7,212,965.26	-7,212,965.26
(四)、其他综合 收益结转留存收 益	-	-	-	-
四、本期期末净 资产	68,407,442.71	-	6,891,806.58	75,299,249.29

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

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

基金份额。本基金的基金管理人为宏利基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司（以下简称“交通银行”）。

经中国证监会同意，本基金于 2006 年 6 月 6 日更名为泰达荷银风险预算混合型证券投资基金。根据本基金的基金管理人 2010 年 3 月 17 日发布的《泰达宏利基金管理有限公司关于变更公司旗下公募基金名称的公告》，本基金自公告发布之日起更名为泰达宏利风险预算混合型证券投资基金。根据本基金的基金管理人 2023 年 6 月 17 日发布的《宏利基金管理有限公司关于旗下基金更名事宜的公告》，本基金自 2023 年 6 月 20 日起更名为宏利风险预算混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《宏利风险预算混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围是国内依法发行、上市的股票（包括存托凭证）、债券、货币市场工具以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。其中，股票投资范围为所有在国内依法发行的、具有良好流动性的 A 股（包括存托凭证）；债券投资范围包括一年以上的国债、金融债、企业债、可转债等；货币市场工具包括短期票据、回购、银行存款以及一年以内（含一年）的国债、金融债、企业债等。本基金大类资产的投资比例范围是：股票 0—50%，债券 20%—70%，货币市场工具 5%—80%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。自 2013 年 3 月 30 日起，本基金的业绩比较基准由一年期银行定期存款利率（税后）×50%+富时中国 A200 指数×20%+新华巴克莱资本中国政府机构债指数×15%+新华巴克莱资本中国企业债指数×10%+新华巴克莱资本中国国债指数×5%，变更为一年期银行定期存款利率（税后）×50%+富时中国 A200 指数×20%+中证金融债指数×15%+中证企业债指数×10%+中证国债指数×5%。

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》、《宏利风险预算混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 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商业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商业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，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。

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。

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，但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。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	314,427.73	889,805.68
等于：本金	314,266.65	889,373.52
加：应计利息	161.08	432.16
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	314,427.73	889,805.68

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	21,867,203.64	-	21,416,719.48	-450,484.16	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	13,539,679.96	159,930.50	13,705,575.50	5,965.04
	银行间市场	31,741,559.06	407,782.24	32,225,982.24	76,640.94
	合计	45,281,239.02	567,712.74	45,931,557.74	82,605.98
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	67,148,442.66	567,712.74	67,348,277.22	-367,878.18	
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	23,311,472.61	-	22,657,434.64	-654,037.97	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	39,416,322.80	524,958.20	40,143,253.20	201,972.20
	银行间市场	11,163,526.00	242,988.42	11,380,088.42	-26,426.00
	合计	50,579,848.80	767,946.62	51,523,341.62	175,546.20
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	73,891,321.41	767,946.62	74,180,776.26	-478,491.77	

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**

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	2,951,975.85	-
银行间市场	-	-
合计	2,951,975.85	-
项目	上年度末 2022年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	1,499,780.82	-
银行间市场	-	-
合计	1,499,780.82	-

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	25.73	18.71
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	98,841.22	90,294.76
其中：交易所市场	96,429.97	90,142.26
银行间市场	2,411.25	152.50
应付利息	-	-
预提费用	144,000.00	189,000.00
其他	842.60	842.60
合计	243,709.55	280,156.07

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	68,407,442.71	68,407,442.71
本期申购	2,957,272.68	2,957,272.68
本期赎回（以“-”号填列）	-8,035,109.15	-8,035,109.15
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	63,329,606.24	63,329,606.24

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。

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	15,884,739.70	-8,992,933.12	6,891,806.58
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	15,884,739.70	-8,992,933.12	6,891,806.58
本期利润	266,209.10	110,613.59	376,822.69
本期基金份额交易产生的变动数	-1,207,573.09	626,396.08	-581,177.01
其中：基金申购款	706,021.02	-357,685.15	348,335.87
金赎回款	-1,913,594.11	984,081.23	-929,512.88
本期已分配利润	-	-	-
本期末	14,943,375.71	-8,255,923.45	6,687,452.26

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	9,020.28	22,500.66
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	4,301.93	6,255.73
其他	114.28	577.99
合计	13,436.49	29,334.38

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	-1,135,046.48	-13,830,276.88
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	-1,135,046.48	-13,830,276.88

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	205,011,761.24	315,612,960.55
减：卖出股票成本总额	205,565,227.71	328,541,272.94
减：交易费用	581,580.01	901,964.49
买卖股票差价收入	-1,135,046.48	-13,830,276.88

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	1,445,567.29	2,575,149.25
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	426,954.05	1,247,522.91
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	1,872,521.34	3,822,672.16

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	91,492,146.59	235,972,462.49
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	89,548,072.71	231,667,048.98
减：应计利息总额	1,514,509.15	3,055,486.62
减：交易费用	2,610.68	2,403.98
买卖债券差价收入	426,954.05	1,247,522.91

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	388,843.90	489,323.47
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	388,843.90	489,323.47

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	110,613.59	-1,956,169.74
股票投资	203,553.81	173,438.24
债券投资	-92,940.22	-2,129,607.98
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	110,613.59	-1,956,169.74

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	3,672.46	130,572.41
基金转换费收入	22.11	367.24
合计	3,694.57	130,939.65

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。

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	55,000.00	60,000.00
信息披露费	80,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	1,118.11	1,165.00
账户维护费	36,000.00	36,000.00

其他	1,200.00	1,200.00
合计	173,318.11	218,365.00

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、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	516,429.38	942,373.44
其中：应支付销售机构的客户维护费	211,624.31	268,189.65
应支付基金管理人的净管理费	304,805.07	674,183.79

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

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	176,223.68	336,561.96

注：于 2023 年 10 月 8 日前，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。

根据《宏利基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修改基金合同等法律文件的公告》，自 2023 年 10 月 9 日起，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 0.20% 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 × 0.20% / 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。

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
交通银行	314,427.73	9,020.28	889,805.68	22,500.66

注：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。

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。

7.4.10.8 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。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

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

本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金，属于较低风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益高于保本基金而低于平衡型基金，谋求稳定和可持续的绝对收益”的风险收益目标。

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同责任，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，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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	3,063,520.33	-
合计	3,063,520.33	-

注：以上未评级的债券投资中包括超短期融资券等。

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。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	21,509,216.55	-
AAA 以下	38,840.18	-
未评级	21,319,980.68	51,523,341.62
合计	42,868,037.41	51,523,341.62

注：以上未评级的债券投资中包括国债、政策性金融债及央行票据等。

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。

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发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 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。

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

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	314,427.73	-	-	-	314,427.73
结算备付金	548,533.37	-	-	-	548,533.37
存出保证金	6,424.79	-	-	-	6,424.79
交易性金融资产	12,928,380.84	33,003,176.90	-	21,416,719.48	67,348,277.22
买入返售金融资产	2,951,975.85	-	-	-	2,951,975.85
应收申购款	-	-	-	11,576.51	11,576.51
资产总计	16,749,742.58	33,003,176.90	-	21,428,295.99	71,181,215.47
负债					
应付赎回款	-	-	-	25,674.07	25,674.07
应付管理人报酬	-	-	-	41,777.38	41,777.38
应付托管费	-	-	-	11,936.40	11,936.40
应付清算款	-	-	-	200,000.00	200,000.00
应交税费	-	-	-	641,059.57	641,059.57

其他负债	-	-	-	243,709.55	243,709.55
负债总计	-	-	-	1,164,156.97	1,164,156.97
利率敏感度缺口	16,749,742.58	33,003,176.90	-	20,264,139.02	70,017,058.50
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	889,805.68	-	-	-	889,805.68
结算备付金	195,673.57	-	-	-	195,673.57
存出保证金	7,689.16	-	-	-	7,689.16
交易性金融资产	28,231,244.71	15,820,616.44	7,471,480.47	22,657,434.64	74,180,776.26
买入返售金融资产	1,499,780.82	-	-	-	1,499,780.82
应收申购款	-	-	-	17,994.99	17,994.99
资产总计	30,824,193.94	15,820,616.44	7,471,480.47	22,675,429.63	76,791,720.48
负债					
应付赎回款	-	-	-	12,506.24	12,506.24
应付管理人报酬	-	-	-	46,848.48	46,848.48
应付托管费	-	-	-	16,731.60	16,731.60
应付清算款	-	-	-	499,561.64	499,561.64
应交税费	-	-	-	636,667.16	636,667.16
其他负债	-	-	-	280,156.07	280,156.07
负债总计	-	-	-	1,492,471.19	1,492,471.19
利率敏感度缺口	30,824,193.94	15,820,616.44	7,471,480.47	21,182,958.44	75,299,249.29

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的到期日予以分类。

7.4.13.4.1.2 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 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	210,000.00	390,000.00
市场利率上升 25 个基点	-210,000.00	-370,000.00	

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。本基金投资组合中股票投资比例为基金资产净值的 0%-50%，债券为 20%-70%，货币市场工具为 5%-80%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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	21,416,719.48	30.59	22,657,434.64	30.09
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	21,416,719.48	30.59	22,657,434.64	30.09

7.4.13.4.3.2 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 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	830,000.00	1,010,000.00
	沪深 300 指数下降 5%	-830,000.00	-1,010,000.00

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	21,455,559.66	22,657,434.64
第二层次	45,892,717.56	51,523,341.62
第三层次	-	-
合计	67,348,277.22	74,180,776.26

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	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
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	-	-	-
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	-	2,182,437.33	2,182,437.33
当期购买	-	109,980.00	109,980.00
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	2,132,102.35	2,132,102.35
当期利得或损失总额	-	-160,314.98	-160,314.98
其中：计入损益的利得或损失	-	-160,314.98	-160,314.98
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-

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	-	-	-
---	---	---	---

注：于 2022 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

无。

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	21,416,719.48	30.09
	其中：股票	21,416,719.48	30.09
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	45,931,557.74	64.53
	其中：债券	45,931,557.74	64.53
	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	2,951,975.85	4.15
	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	862,961.10	1.21
8	其他各项资产	18,001.30	0.03
9	合计	71,181,215.47	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	87,706.00	0.13
B	采矿业	1,626,382.00	2.32
C	制造业	12,397,865.48	17.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	361,189.00	0.52
E	建筑业	60,468.00	0.09
F	批发和零售业	604,234.00	0.86
G	交通运输、仓储和邮政业	279,034.00	0.40
H	住宿和餐饮业	15,352.00	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,123,889.00	1.61
J	金融业	2,788,725.00	3.98
K	房地产业	64,198.00	0.09
L	租赁和商务服务业	648,330.00	0.93
M	科学研究和技术服务业	917,264.00	1.31
N	水利、环境和公共设施管理业	143,573.00	0.21
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	22,734.00	0.03
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	266,384.00	0.38
S	综合	9,392.00	0.01
	合计	21,416,719.48	30.59

8.2.2 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。

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

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	601899	紫金矿业	59,800	745,108.00	1.06
2	603259	药明康德	10,000	727,600.00	1.04
3	600690	海尔智家	34,100	716,100.00	1.02
4	002594	比亚迪	3,600	712,800.00	1.02
5	600660	福耀玻璃	17,000	635,630.00	0.91
6	000338	潍柴动力	42,400	578,760.00	0.83
7	601318	中国平安	14,200	572,260.00	0.82
8	601888	中国中免	6,600	552,354.00	0.79
9	600036	招商银行	18,300	509,106.00	0.73

10	000921	海信家电	23,300	475,320.00	0.68
11	603993	洛阳钼业	78,600	408,720.00	0.58
12	601916	浙商银行	140,800	354,816.00	0.51
13	601088	中国神华	10,000	313,500.00	0.45
14	601288	农业银行	80,000	291,200.00	0.42
15	600585	海螺水泥	12,400	279,744.00	0.40
16	601658	邮储银行	57,600	250,560.00	0.36
17	600153	建发股份	14,200	136,746.00	0.20
18	600919	江苏银行	20,000	133,800.00	0.19
19	603323	苏农银行	29,600	123,136.00	0.18
20	000333	美的集团	2,200	120,186.00	0.17
21	601398	工商银行	24,500	117,110.00	0.17
22	002563	森马服饰	19,600	113,092.00	0.16
23	300440	运达科技	15,100	112,495.00	0.16
24	600066	宇通客车	8,300	109,975.00	0.16
25	002739	万达电影	8,200	106,764.00	0.15
26	605066	天正电气	11,500	105,570.00	0.15
27	002763	汇洁股份	12,500	105,125.00	0.15
28	301004	嘉益股份	2,300	104,535.00	0.15
29	600926	杭州银行	10,400	104,104.00	0.15
30	002262	恩华药业	3,800	103,056.00	0.15
31	603115	海星股份	7,000	102,480.00	0.15
32	600737	中粮糖业	12,200	100,528.00	0.14
33	300729	乐歌股份	5,600	100,296.00	0.14
34	603298	杭叉集团	4,000	99,520.00	0.14
35	300638	广和通	5,000	95,150.00	0.14
36	603365	水星家纺	6,400	92,032.00	0.13
37	600016	民生银行	24,400	91,256.00	0.13
38	605599	菜百股份	6,100	90,829.00	0.13
39	603886	元祖股份	4,900	89,327.00	0.13
40	600398	海澜之家	12,000	89,040.00	0.13
41	603551	奥普家居	8,400	88,956.00	0.13
42	601818	光大银行	29,800	86,420.00	0.12
43	601988	中国银行	21,500	85,785.00	0.12
44	301027	华蓝集团	6,800	85,068.00	0.12
45	600023	浙能电力	17,700	81,597.00	0.12
46	603112	华翔股份	6,700	81,405.00	0.12
47	600887	伊利股份	3,000	80,250.00	0.11
48	300573	兴齐眼药	440	80,220.80	0.11
49	600481	双良节能	9,400	79,524.00	0.11
50	300622	博士眼镜	4,000	79,320.00	0.11
51	002452	长高电新	11,000	78,100.00	0.11
52	688226	威腾电气	4,147	77,963.60	0.11

53	688617	惠泰医疗	200	77,700.00	0.11
54	000933	神火股份	4,600	77,280.00	0.11
55	605189	富春染织	4,700	76,140.00	0.11
56	002228	合兴包装	22,000	75,460.00	0.11
57	300532	今天国际	4,400	72,248.00	0.10
58	301037	保立佳	3,600	71,748.00	0.10
59	002083	孚日股份	13,800	69,552.00	0.10
60	301055	张小泉	4,800	69,216.00	0.10
61	603238	诺邦股份	4,800	66,000.00	0.09
62	300286	安科瑞	2,500	64,825.00	0.09
63	301236	软通动力	1,400	64,680.00	0.09
64	688111	金山办公	200	63,240.00	0.09
65	603600	永艺股份	5,700	62,928.00	0.09
66	002393	力生制药	2,400	62,640.00	0.09
67	603661	恒林股份	1,400	62,398.00	0.09
68	600097	开创国际	5,800	62,002.00	0.09
69	603928	兴业股份	4,600	61,502.00	0.09
70	601566	九牧王	6,000	59,820.00	0.09
71	603321	梅轮电梯	7,000	59,780.00	0.09
72	300543	朗科智能	5,400	58,968.00	0.08
73	603739	蔚蓝生物	3,800	57,836.00	0.08
74	300251	光线传媒	7,000	57,050.00	0.08
75	301196	唯科科技	1,600	55,008.00	0.08
76	003002	壶化股份	3,600	54,684.00	0.08
77	603408	建霖家居	4,200	53,928.00	0.08
78	605166	聚合顺	5,400	53,568.00	0.08
79	688627	精智达	600	53,508.00	0.08
80	603823	百合花	5,400	53,136.00	0.08
81	605268	王力安防	5,400	52,596.00	0.08
82	600826	兰生股份	5,900	52,156.00	0.07
83	603889	新澳股份	7,200	51,264.00	0.07
84	300721	怡达股份	3,400	50,762.00	0.07
85	688399	硕世生物	930	50,740.80	0.07
86	003016	欣贺股份	6,200	50,654.00	0.07
87	688188	柏楚电子	200	50,622.00	0.07
88	002942	新农股份	2,500	49,125.00	0.07
89	603108	润达医疗	2,400	48,840.00	0.07
90	002867	周大生	3,200	48,576.00	0.07
91	603757	大元泵业	2,000	48,480.00	0.07
92	002382	蓝帆医疗	7,200	48,096.00	0.07
93	688589	力合微	1,200	47,892.00	0.07
94	300787	海能实业	2,800	47,096.00	0.07
95	300577	开润股份	3,200	46,944.00	0.07

96	601500	通用股份	11,200	46,368.00	0.07
97	600809	山西汾酒	200	46,146.00	0.07
98	600727	鲁北化工	7,000	46,060.00	0.07
99	603328	依顿电子	5,600	45,640.00	0.07
100	000531	穗恒运 A	6,800	45,492.00	0.06
101	600180	瑞茂通	7,400	45,066.00	0.06
102	603897	长城科技	2,200	45,056.00	0.06
103	605336	帅丰电器	3,000	44,640.00	0.06
104	600644	乐山电力	6,400	44,544.00	0.06
105	002601	龙佰集团	2,600	44,538.00	0.06
106	603360	百傲化学	4,200	44,394.00	0.06
107	300441	鲍斯股份	6,400	44,096.00	0.06
108	601100	恒立液压	800	43,744.00	0.06
109	002852	道道全	4,000	43,280.00	0.06
110	603610	麒盛科技	3,600	42,912.00	0.06
111	002016	世荣兆业	6,800	42,772.00	0.06
112	002588	史丹利	6,700	42,746.00	0.06
113	002469	三维化学	7,000	42,420.00	0.06
114	603967	中创物流	4,100	42,394.00	0.06
115	300349	金卡智能	3,400	42,228.00	0.06
116	002282	博深股份	5,200	42,120.00	0.06
117	688687	凯因科技	1,200	41,832.00	0.06
118	603530	神马电力	2,000	41,480.00	0.06
119	002674	兴业科技	3,400	41,378.00	0.06
120	688026	洁特生物	2,400	41,376.00	0.06
121	600279	重庆港	9,200	40,940.00	0.06
122	603338	浙江鼎力	800	40,936.00	0.06
123	603556	海兴电力	1,400	40,642.00	0.06
124	000589	贵州轮胎	6,600	40,392.00	0.06
125	002158	汉钟精机	1,800	40,068.00	0.06
125	002479	富春环保	8,400	40,068.00	0.06
127	603198	迎驾贡酒	600	39,774.00	0.06
128	601965	中国汽研	1,800	39,708.00	0.06
129	300193	佳士科技	5,100	39,627.00	0.06
130	002627	三峡旅游	7,400	39,516.00	0.06
131	301248	杰创智能	2,200	38,742.00	0.06
132	300453	三鑫医疗	5,000	38,150.00	0.05
133	300124	汇川技术	600	37,884.00	0.05
134	002109	兴化股份	7,800	36,972.00	0.05
135	300395	菲利华	1,000	36,560.00	0.05
136	601579	会稽山	3,400	36,516.00	0.05
137	003012	东鹏控股	4,400	36,300.00	0.05
138	603165	荣晟环保	3,000	35,940.00	0.05

139	002171	楚江新材	4,800	35,904.00	0.05
140	600576	祥源文旅	4,800	35,712.00	0.05
141	000949	新乡化纤	11,000	35,530.00	0.05
142	301028	东亚机械	3,000	35,190.00	0.05
143	000543	皖能电力	5,600	35,056.00	0.05
144	601728	中国电信	6,400	34,624.00	0.05
145	605006	山东玻纤	5,000	34,500.00	0.05
146	600729	重庆百货	1,200	33,840.00	0.05
147	000923	河钢资源	2,000	33,600.00	0.05
148	002035	华帝股份	5,400	33,534.00	0.05
149	002466	天齐锂业	600	33,474.00	0.05
150	002212	天融信	3,400	33,252.00	0.05
151	000404	长虹华意	5,600	32,984.00	0.05
152	300190	维尔利	7,800	32,604.00	0.05
153	002533	金杯电工	4,000	32,320.00	0.05
154	600268	国电南自	4,600	32,062.00	0.05
155	002367	康力电梯	4,200	31,584.00	0.05
156	301097	天益医疗	600	31,578.00	0.05
157	301021	英诺激光	1,200	31,572.00	0.05
158	603508	思维列控	2,000	31,400.00	0.04
159	002179	中航光电	800	31,200.00	0.04
160	601609	金田股份	4,600	31,142.00	0.04
161	000612	焦作万方	5,400	31,050.00	0.04
162	000597	东北制药	5,800	31,030.00	0.04
163	002463	沪电股份	1,400	30,968.00	0.04
164	600261	阳光照明	9,400	30,738.00	0.04
165	002970	锐明技术	1,000	30,610.00	0.04
166	002283	天润工业	5,200	30,420.00	0.04
167	601138	工业富联	2,000	30,240.00	0.04
168	600941	中国移动	300	29,844.00	0.04
169	000628	高新发展	600	29,808.00	0.04
170	300718	长盛轴承	1,600	29,680.00	0.04
171	000035	中国天楹	6,000	29,640.00	0.04
172	300631	久吾高科	1,000	29,170.00	0.04
173	002956	西麦食品	2,000	28,660.00	0.04
174	688670	金迪克	1,000	28,460.00	0.04
175	688600	皖仪科技	1,400	28,280.00	0.04
176	300782	卓胜微	200	28,200.00	0.04
177	603816	顾家家居	800	28,000.00	0.04
178	300584	海辰药业	1,200	27,936.00	0.04
179	600693	东百集团	6,900	27,669.00	0.04
180	600612	老凤祥	400	27,600.00	0.04
181	688659	元琛科技	2,200	27,390.00	0.04

182	300565	科信技术	1,800	27,216.00	0.04
183	601211	国泰君安	1,800	26,784.00	0.04
184	688037	芯源微	200	26,722.00	0.04
185	600746	江苏索普	3,600	26,352.00	0.04
186	301033	迈普医学	600	26,124.00	0.04
187	300967	晓鸣股份	1,800	25,704.00	0.04
188	603303	得邦照明	2,000	25,700.00	0.04
189	601366	利群股份	4,700	25,662.00	0.04
190	600966	博汇纸业	4,100	25,461.00	0.04
191	603577	汇金通	2,400	24,960.00	0.04
192	002233	塔牌集团	3,500	24,780.00	0.04
193	002803	吉宏股份	1,200	24,672.00	0.04
194	605050	福然德	2,000	24,660.00	0.04
195	002948	青岛银行	8,000	24,400.00	0.03
196	600379	宝光股份	2,400	24,120.00	0.03
197	603010	万盛股份	2,200	23,738.00	0.03
198	300625	三雄极光	1,600	23,712.00	0.03
199	001230	劲旅环境	1,000	23,460.00	0.03
200	301182	凯旺科技	1,000	23,380.00	0.03
201	300066	三川智慧	4,600	23,230.00	0.03
202	002612	朗姿股份	1,200	23,076.00	0.03
203	001336	楚环科技	800	22,976.00	0.03
204	600547	山东黄金	1,000	22,870.00	0.03
205	603377	东方时尚	5,400	22,734.00	0.03
206	300308	中际旭创	200	22,582.00	0.03
207	002555	三七互娱	1,200	22,572.00	0.03
208	603197	保隆科技	400	22,560.00	0.03
209	002252	上海莱士	2,800	22,400.00	0.03
210	002731	萃华珠宝	2,000	22,120.00	0.03
211	002011	盾安环境	1,600	22,000.00	0.03
212	003000	劲仔食品	1,800	21,996.00	0.03
213	300860	锋尚文化	400	21,852.00	0.03
214	002032	苏泊尔	400	21,204.00	0.03
215	002557	洽洽食品	600	20,892.00	0.03
216	300594	朗进科技	1,000	20,880.00	0.03
217	688656	浩欧博	600	20,856.00	0.03
218	603421	鼎信通讯	2,200	20,680.00	0.03
219	600637	东方明珠	2,700	20,304.00	0.03
220	688098	申联生物	2,711	20,278.28	0.03
221	601158	重庆水务	3,500	19,845.00	0.03
222	601898	中煤能源	2,000	19,380.00	0.03
223	600650	锦江在线	2,000	19,140.00	0.03
224	300212	易华录	600	18,870.00	0.03

225	600129	太极集团	400	18,584.00	0.03
226	301308	江波龙	200	18,410.00	0.03
227	603920	世运电路	1,000	18,280.00	0.03
228	605123	派克新材	200	18,240.00	0.03
229	002154	报喜鸟	3,200	18,176.00	0.03
230	002274	华昌化工	2,400	18,120.00	0.03
231	603927	中科软	600	17,988.00	0.03
232	000568	泸州老窖	100	17,942.00	0.03
233	600676	交运股份	4,000	17,640.00	0.03
234	300274	阳光电源	200	17,518.00	0.03
235	600332	白云山	600	17,160.00	0.02
236	002128	电投能源	1,200	17,124.00	0.02
237	600594	益佰制药	3,000	17,070.00	0.02
238	600094	大名城	5,600	16,800.00	0.02
239	000544	中原环保	2,400	16,656.00	0.02
240	000019	深粮控股	2,200	16,588.00	0.02
241	600426	华鲁恒升	600	16,554.00	0.02
242	000848	承德露露	2,100	16,485.00	0.02
243	300218	安利股份	1,200	16,260.00	0.02
244	688443	智翔金泰	400	15,980.00	0.02
245	600886	国投电力	1,200	15,816.00	0.02
246	000791	甘肃能源	2,800	15,596.00	0.02
246	688556	高测股份	400	15,596.00	0.02
248	002860	星帅尔	1,200	15,540.00	0.02
249	605116	奥锐特	600	15,492.00	0.02
250	600309	万华化学	200	15,364.00	0.02
251	603590	康辰药业	400	15,232.00	0.02
252	603859	能科科技	400	15,092.00	0.02
253	002777	久远银海	600	15,066.00	0.02
254	603063	禾望电气	600	15,000.00	0.02
255	300550	和仁科技	1,000	14,990.00	0.02
256	001208	华菱线缆	1,600	14,864.00	0.02
257	002657	中科金财	800	14,576.00	0.02
258	688168	安博通	400	14,464.00	0.02
259	688195	腾景科技	400	14,396.00	0.02
260	002991	甘源食品	200	14,292.00	0.02
261	688288	鸿泉物联	600	14,256.00	0.02
262	000513	丽珠集团	400	14,004.00	0.02
262	300320	海达股份	1,800	14,004.00	0.02
264	688598	金博股份	200	13,980.00	0.02
265	002027	分众传媒	2,200	13,904.00	0.02
266	603516	淳中科技	600	13,482.00	0.02
267	300179	四方达	1,500	13,365.00	0.02

268	000977	浪潮信息	400	13,280.00	0.02
269	002215	诺普信	1,600	13,216.00	0.02
270	688234	天岳先进	200	13,214.00	0.02
271	002891	中宠股份	500	13,175.00	0.02
272	603214	爱婴室	800	13,088.00	0.02
273	300639	凯普生物	1,400	13,076.00	0.02
274	300520	科大国创	600	13,044.00	0.02
275	600556	天下秀	2,200	13,002.00	0.02
276	301383	天键股份	200	13,000.00	0.02
277	002115	三维通信	1,800	12,996.00	0.02
277	600867	通化东宝	1,200	12,996.00	0.02
279	002488	金固股份	1,800	12,924.00	0.02
280	002947	恒铭达	400	12,872.00	0.02
281	300188	国投智能	800	12,816.00	0.02
282	300378	鼎捷软件	600	12,786.00	0.02
283	301257	普蕊斯	200	12,700.00	0.02
284	603871	嘉友国际	800	12,688.00	0.02
285	605168	三人行	200	12,672.00	0.02
286	601101	昊华能源	2,000	12,640.00	0.02
287	000919	金陵药业	1,600	12,592.00	0.02
288	002790	瑞尔特	1,200	12,528.00	0.02
288	300132	青松股份	2,400	12,528.00	0.02
288	600750	江中药业	600	12,528.00	0.02
291	002757	南兴股份	800	12,512.00	0.02
292	002166	莱茵生物	1,600	12,432.00	0.02
293	601137	博威合金	800	12,424.00	0.02
294	600161	天坛生物	400	12,376.00	0.02
295	300348	长亮科技	1,200	12,372.00	0.02
296	002649	博彦科技	1,000	12,270.00	0.02
297	300531	优博讯	800	12,264.00	0.02
298	300769	德方纳米	200	12,206.00	0.02
299	300660	江苏雷利	400	12,104.00	0.02
300	300603	立昂技术	1,200	12,084.00	0.02
301	300482	万孚生物	400	12,068.00	0.02
302	002693	双成药业	1,600	12,016.00	0.02
303	600986	浙文互联	2,200	12,012.00	0.02
304	002599	盛通股份	1,800	12,006.00	0.02
305	603826	坤彩科技	200	11,806.00	0.02
306	000681	视觉中国	800	11,760.00	0.02
307	300925	法本信息	1,000	11,750.00	0.02
308	002372	伟星新材	800	11,576.00	0.02
309	688165	埃夫特	1,000	11,460.00	0.02
310	300846	首都在线	800	11,432.00	0.02

311	603439	贵州三力	600	11,328.00	0.02
312	600135	乐凯胶片	1,400	11,298.00	0.02
313	603489	八方股份	200	10,990.00	0.02
314	300379	东方通	600	10,968.00	0.02
315	603181	皇马科技	1,000	10,930.00	0.02
316	300752	隆利科技	600	10,902.00	0.02
317	002401	中远海科	600	10,872.00	0.02
318	300302	同有科技	800	10,832.00	0.02
319	002881	美格智能	400	10,824.00	0.02
320	300548	博创科技	400	10,788.00	0.02
321	300386	飞天诚信	1,000	10,730.00	0.02
322	000039	中集集团	1,400	10,710.00	0.02
323	603280	南方路机	400	10,696.00	0.02
324	603123	翠微股份	1,000	10,650.00	0.02
325	603755	日辰股份	400	10,632.00	0.02
326	688609	九联科技	800	10,560.00	0.02
327	600346	恒力石化	800	10,536.00	0.02
328	300979	华利集团	200	10,528.00	0.02
329	002735	王子新材	800	10,400.00	0.01
329	600795	国电电力	2,500	10,400.00	0.01
331	688420	美腾科技	400	10,336.00	0.01
332	600587	新华医疗	400	10,316.00	0.01
333	603636	南威软件	800	10,256.00	0.01
334	300436	广生堂	400	10,252.00	0.01
334	301235	华康医疗	400	10,252.00	0.01
336	600377	宁沪高速	1,000	10,250.00	0.01
337	002819	东方中科	400	10,244.00	0.01
338	603399	吉翔股份	1,000	10,230.00	0.01
339	605287	德才股份	600	10,182.00	0.01
340	688579	山大地纬	800	10,160.00	0.01
341	300442	润泽科技	400	10,148.00	0.01
342	301072	中捷精工	400	10,100.00	0.01
343	601633	长城汽车	400	10,088.00	0.01
344	601021	春秋航空	200	10,040.00	0.01
345	688488	艾迪药业	800	10,008.00	0.01
346	001268	联合精密	400	10,000.00	0.01
347	000937	冀中能源	1,400	9,996.00	0.01
348	600985	淮北矿业	600	9,978.00	0.01
349	688028	沃尔德	400	9,956.00	0.01
350	301135	瑞德智能	400	9,928.00	0.01
351	300592	华凯易佰	400	9,908.00	0.01
352	300288	朗玛信息	600	9,870.00	0.01
352	688158	优刻得	600	9,870.00	0.01

354	000423	东阿阿胶	200	9,864.00	0.01
355	001205	盛航股份	600	9,822.00	0.01
356	301118	恒光股份	400	9,772.00	0.01
357	001238	浙江正特	400	9,748.00	0.01
358	600350	山东高速	1,400	9,716.00	0.01
359	301232	飞沃科技	200	9,698.00	0.01
360	603055	台华新材	800	9,632.00	0.01
361	600662	外服控股	2,000	9,600.00	0.01
362	002805	丰元股份	600	9,588.00	0.01
363	688077	大地熊	400	9,540.00	0.01
364	301361	众智科技	400	9,536.00	0.01
365	605008	长鸿高科	600	9,522.00	0.01
366	600025	华能水电	1,100	9,493.00	0.01
367	688517	金冠电气	600	9,474.00	0.01
368	300933	中辰股份	1,000	9,450.00	0.01
369	688489	三未信安	200	9,404.00	0.01
370	003021	兆威机电	100	9,399.00	0.01
371	000009	中国宝安	800	9,392.00	0.01
372	601228	广州港	3,000	9,390.00	0.01
373	601019	山东出版	1,000	9,380.00	0.01
374	600258	首旅酒店	600	9,372.00	0.01
375	600900	长江电力	400	9,336.00	0.01
375	688315	诺禾致源	400	9,336.00	0.01
377	301049	超越科技	400	9,264.00	0.01
378	300568	星源材质	600	9,252.00	0.01
379	002298	中电兴发	1,600	9,216.00	0.01
380	603258	电魂网络	400	9,192.00	0.01
381	002932	明德生物	400	9,188.00	0.01
382	300996	普联软件	400	9,160.00	0.01
383	301063	海锅股份	400	9,120.00	0.01
384	603187	海容冷链	600	9,096.00	0.01
385	688475	萤石网络	200	8,980.00	0.01
386	688718	唯赛勃	600	8,964.00	0.01
387	605589	圣泉集团	400	8,952.00	0.01
388	300659	中孚信息	400	8,888.00	0.01
389	301233	盛帮股份	200	8,884.00	0.01
390	301036	双乐股份	400	8,868.00	0.01
391	603182	嘉华股份	600	8,862.00	0.01
392	001260	坤泰股份	400	8,828.00	0.01
393	301148	嘉戎技术	400	8,820.00	0.01
394	600054	黄山旅游	800	8,704.00	0.01
395	002940	昂利康	400	8,684.00	0.01
395	300702	天宇股份	400	8,684.00	0.01

397	002205	国统股份	800	8,664.00	0.01
398	605077	华康股份	400	8,656.00	0.01
399	603057	紫燕食品	400	8,632.00	0.01
400	600216	浙江医药	800	8,584.00	0.01
401	600745	闻泰科技	200	8,462.00	0.01
402	605180	华生科技	600	8,400.00	0.01
403	688485	九州一轨	600	8,388.00	0.01
404	688180	君实生物	200	8,366.00	0.01
405	300036	超图软件	400	8,360.00	0.01
406	301053	远信工业	300	8,358.00	0.01
407	002929	润建股份	200	8,346.00	0.01
408	001231	农心科技	400	8,332.00	0.01
409	688177	百奥泰	200	8,248.00	0.01
410	301056	森赫股份	800	8,176.00	0.01
410	301429	森泰股份	400	8,176.00	0.01
412	002490	山东墨龙	1,800	8,172.00	0.01
412	301017	漱玉平民	400	8,172.00	0.01
414	600030	中信证券	400	8,148.00	0.01
415	301032	新柴股份	800	8,104.00	0.01
416	301161	唯万密封	400	8,088.00	0.01
417	603122	合富中国	1,000	8,050.00	0.01
418	688800	瑞可达	200	8,036.00	0.01
419	603073	彩蝶实业	400	8,028.00	0.01
420	603518	锦泓集团	800	8,016.00	0.01
421	688355	明志科技	400	7,960.00	0.01
422	300576	容大感光	200	7,852.00	0.01
423	603137	恒尚节能	400	7,848.00	0.01
424	000997	新大陆	400	7,844.00	0.01
425	688147	微导纳米	200	7,798.00	0.01
426	688448	磁谷科技	200	7,766.00	0.01
427	300254	仟源医药	800	7,704.00	0.01
428	688179	阿拉丁	400	7,664.00	0.01
429	603866	桃李面包	1,000	7,660.00	0.01
430	300802	矩子科技	400	7,648.00	0.01
431	688049	炬芯科技	200	7,614.00	0.01
432	301288	清研环境	400	7,592.00	0.01
433	301040	中环海陆	400	7,588.00	0.01
434	601958	金钼股份	800	7,560.00	0.01
435	300472	新元科技	800	7,552.00	0.01
436	301395	仁信新材	400	7,524.00	0.01
437	603899	晨光股份	200	7,510.00	0.01
438	600861	北京人力	400	7,496.00	0.01
439	603908	牧高笛	200	7,442.00	0.01

440	603619	中曼石油	400	7,408.00	0.01
441	001256	炜冈科技	400	7,404.00	0.01
442	600718	东软集团	800	7,400.00	0.01
443	301198	喜悦智行	600	7,284.00	0.01
444	600531	豫光金铅	1,200	7,260.00	0.01
445	301287	康力源	200	7,208.00	0.01
446	600548	深高速	800	7,192.00	0.01
447	688622	禾信仪器	200	7,190.00	0.01
448	300161	华中数控	200	7,180.00	0.01
449	600019	宝钢股份	1,200	7,116.00	0.01
450	301098	金埔园林	600	7,086.00	0.01
451	600497	驰宏锌锗	1,400	7,070.00	0.01
452	300642	透景生命	400	7,060.00	0.01
453	002880	卫光生物	200	7,026.00	0.01
454	300042	朗科科技	200	7,000.00	0.01
455	001896	豫能控股	1,600	6,992.00	0.01
456	300854	中兰环保	400	6,980.00	0.01
457	601801	皖新传媒	1,000	6,950.00	0.01
458	300791	仙乐健康	200	6,932.00	0.01
459	688369	致远互联	200	6,922.00	0.01
460	301079	邵阳液压	400	6,920.00	0.01
461	002990	盛视科技	200	6,906.00	0.01
462	300611	美力科技	600	6,894.00	0.01
463	003038	鑫铂股份	200	6,870.00	0.01
464	603272	联翔股份	400	6,752.00	0.01
465	600329	达仁堂	200	6,730.00	0.01
466	301057	汇隆新材	400	6,720.00	0.01
467	300043	星辉娱乐	1,800	6,678.00	0.01
467	603725	天安新材	600	6,678.00	0.01
469	301081	严牌股份	600	6,660.00	0.01
469	603650	彤程新材	200	6,660.00	0.01
471	301295	美硕科技	200	6,638.00	0.01
472	301220	亚香股份	200	6,610.00	0.01
473	002857	三晖电气	400	6,600.00	0.01
474	001366	播恩集团	400	6,588.00	0.01
475	301283	聚胶股份	200	6,576.00	0.01
476	600551	时代出版	600	6,534.00	0.01
477	000751	锌业股份	2,000	6,500.00	0.01
478	301158	德石股份	400	6,436.00	0.01
479	301353	普莱得	200	6,420.00	0.01
480	600859	王府井	400	6,388.00	0.01
481	003011	海象新材	300	6,369.00	0.01
482	002832	比音勒芬	200	6,340.00	0.01

483	301300	远翔新材	200	6,326.00	0.01
484	300627	华测导航	200	6,204.00	0.01
485	300804	广康生化	200	6,172.00	0.01
486	601107	四川成渝	1,400	6,146.00	0.01
487	002034	旺能环境	400	6,100.00	0.01
488	301237	和顺科技	200	6,094.00	0.01
489	301068	大地海洋	200	6,080.00	0.01
490	301365	矩阵股份	400	6,048.00	0.01
491	603151	邦基科技	400	6,036.00	0.01
492	002383	合众思壮	800	5,992.00	0.01
493	600754	锦江酒店	200	5,980.00	0.01
494	600757	长江传媒	800	5,960.00	0.01
495	000539	粤电力 A	1,200	5,868.00	0.01
496	601808	中海油服	400	5,848.00	0.01
497	603150	万朗磁塑	200	5,810.00	0.01
498	603225	新凤鸣	400	5,680.00	0.01
499	688175	高凌信息	200	5,586.00	0.01
500	600028	中国石化	1,000	5,580.00	0.01
500	601688	华泰证券	400	5,580.00	0.01
502	301130	西点药业	200	5,576.00	0.01
503	603822	嘉澳环保	200	5,562.00	0.01
504	301207	华兰疫苗	200	5,560.00	0.01
505	601068	中铝国际	1,200	5,544.00	0.01
505	603699	纽威股份	400	5,544.00	0.01
507	301273	瑞晨环保	200	5,518.00	0.01
508	301045	天禄科技	200	5,440.00	0.01
509	301227	森鹰窗业	200	5,414.00	0.01
510	301359	东南电子	200	5,322.00	0.01
511	600050	中国联通	1,200	5,256.00	0.01
512	000967	盈峰环境	1,100	5,225.00	0.01
513	000157	中联重科	800	5,224.00	0.01
514	002602	世纪华通	1,000	5,160.00	0.01
515	002465	海格通信	400	5,140.00	0.01
516	002919	名臣健康	200	5,128.00	0.01
517	300450	先导智能	200	5,120.00	0.01
518	600787	中储股份	1,000	5,100.00	0.01
519	603180	金牌厨柜	200	5,018.00	0.01
520	603787	新日股份	400	5,004.00	0.01
521	603233	大参林	200	4,980.00	0.01
522	300813	泰林生物	200	4,904.00	0.01
523	300045	华力创通	200	4,866.00	0.01
524	603113	金能科技	600	4,842.00	0.01
525	300130	新国都	200	4,840.00	0.01

526	603885	吉祥航空	400	4,800.00	0.01
527	688208	道通科技	200	4,750.00	0.01
528	601058	赛轮轮胎	400	4,700.00	0.01
529	002091	江苏国泰	600	4,698.00	0.01
530	601512	中新集团	600	4,626.00	0.01
531	603758	秦安股份	400	4,576.00	0.01
532	603878	武进不锈	600	4,530.00	0.01
533	002641	公元股份	900	4,527.00	0.01
534	000062	深圳华强	400	4,508.00	0.01
535	688389	普门科技	200	4,502.00	0.01
536	002611	东方精工	900	4,464.00	0.01
536	300292	吴通控股	1,200	4,464.00	0.01
538	603355	莱克电气	200	4,460.00	0.01
539	000690	宝新能源	1,000	4,430.00	0.01
539	600862	中航高科	200	4,430.00	0.01
541	002419	天虹股份	800	4,424.00	0.01
542	000156	华数传媒	600	4,422.00	0.01
543	002973	侨银股份	400	4,388.00	0.01
543	603898	好莱客	400	4,388.00	0.01
545	002666	德联集团	800	4,320.00	0.01
545	603337	杰克股份	200	4,320.00	0.01
547	002807	江阴银行	1,200	4,260.00	0.01
548	600138	中青旅	400	4,248.00	0.01
549	603579	荣泰健康	200	4,166.00	0.01
550	002701	奥瑞金	1,000	4,140.00	0.01
551	601966	玲珑轮胎	200	3,846.00	0.01
552	605377	华旺科技	200	3,818.00	0.01
553	605167	利柏特	400	3,796.00	0.01
554	603368	柳药集团	200	3,784.00	0.01
555	688015	交控科技	200	3,752.00	0.01
556	002396	星网锐捷	200	3,614.00	0.01
557	002749	国光股份	300	3,594.00	0.01
558	301078	孩子王	400	3,284.00	0.00
559	300682	朗新集团	200	3,278.00	0.00
560	002637	赞宇科技	300	3,219.00	0.00
561	300739	明阳电路	200	3,062.00	0.00
562	300452	山河药辅	200	2,848.00	0.00
563	300113	顺网科技	200	2,800.00	0.00
564	300900	广联航空	100	2,468.00	0.00
565	002517	恺英网络	200	2,234.00	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	002594	比亚迪	1,734,805.00	2.30
2	601888	中国中免	1,275,771.00	1.69
3	603259	药明康德	1,149,991.00	1.53
4	601899	紫金矿业	1,079,884.00	1.43
5	601088	中国神华	1,079,278.00	1.43
6	688235	百济神州	1,064,164.96	1.41
7	000921	海信家电	1,004,443.00	1.33
8	600036	招商银行	947,385.00	1.26
9	600660	福耀玻璃	909,480.00	1.21
10	600690	海尔智家	895,760.00	1.19
11	601838	成都银行	872,923.00	1.16
12	601916	浙商银行	866,224.40	1.15
13	601318	中国平安	843,168.00	1.12
14	603027	千禾味业	842,741.00	1.12
15	601658	邮储银行	821,860.00	1.09
16	600585	海螺水泥	795,737.00	1.06
17	601939	建设银行	792,325.00	1.05
18	603757	大元泵业	786,266.00	1.04
19	000338	潍柴动力	765,303.00	1.02
20	603587	地素时尚	746,417.79	0.99

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	601658	邮储银行	1,244,783.00	1.65
2	688235	百济神州	1,062,588.72	1.41
3	601899	紫金矿业	1,023,095.00	1.36
4	002594	比亚迪	992,946.00	1.32
5	600036	招商银行	957,895.00	1.27
6	601398	工商银行	942,600.00	1.25
7	600585	海螺水泥	932,653.00	1.24
8	601318	中国平安	909,963.00	1.21
9	600690	海尔智家	861,733.00	1.14
10	601838	成都银行	830,357.00	1.10
11	601088	中国神华	807,810.00	1.07
12	601888	中国中免	789,635.00	1.05
13	601939	建设银行	788,862.00	1.05
14	603259	药明康德	784,316.00	1.04

15	000338	潍柴动力	778,578.00	1.03
16	603027	千禾味业	776,495.00	1.03
17	300896	爱美客	774,721.00	1.03
18	603587	地素时尚	719,287.00	0.96
19	603757	大元泵业	710,290.00	0.94
20	600519	贵州茅台	699,724.00	0.93

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	204,120,958.74
卖出股票收入（成交）总额	205,011,761.24

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

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	8,241,568.19	11.77
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	5,425,167.13	7.75
5	企业短期融资券	3,063,520.33	4.38
6	中期票据	29,162,461.91	41.65
7	可转债（可交换债）	38,840.18	0.06
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	45,931,557.74	65.60

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

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	102280557	22 萧山交投 MTN001	40,000	4,127,888.96	5.90
2	102382094	23 招商蛇口 MTN001	40,000	4,026,338.80	5.75
3	019709	23 国债 16	40,000	4,020,931.51	5.74
4	102380302	23 东海水晶 MTN001	35,000	3,720,918.85	5.31
5	102381276	23 苏科技城	35,000	3,626,906.56	5.18

		MTN005			
--	--	--------	--	--	--

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

在报告期内，本基金未投资于股指期货。该策略符合基金合同的规定。

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

本报告期本基金未投资国债期货。

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，招商银行股份有限公司于 2023 年 11 月 27 日曾受到国家外汇管理局深圳市分局公开处罚，于 2023 年 12 月 13 日曾受到国家金融监督管理总局深圳监管局公开处罚。

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	6,424.79
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	11,576.51

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,001.30

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	118019	金盘转债	38,840.18	0.06

8.12.5 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。

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 (%)
5,217	12,139.08	94,347.43	0.15	63,235,258.81	99.85

9.2 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	80,070.32	0.1264

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2005 年 4 月 5 日) 基金份额总额	545,863,991.51
本报告期期初基金份额总额	68,407,442.71
本报告期基金总申购份额	2,957,272.68
减：本报告期基金总赎回份额	8,035,109.15
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	63,329,606.24

§ 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、本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、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

本报告期内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 55,000.00 元，该审计机构对本基金提供的审计服务的连续年限为 19 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 (%)	
开源证券	1	205,441,043.	50.24	192,523.75	50.27	-

		14				
信达证券	1	73,868,942.18	18.06	69,264.81	18.09	-
招商证券	1	31,955,738.56	7.81	30,226.47	7.89	-
民生证券	1	29,668,308.10	7.25	27,632.51	7.21	-
国信证券	1	18,704,375.74	4.57	17,420.68	4.55	-
东兴证券	1	17,765,922.30	4.34	16,545.90	4.32	-
中金公司	1	17,025,084.75	4.16	15,855.91	4.14	-
申万宏源	1	6,309,869.40	1.54	5,877.09	1.53	-
华泰证券	1	5,819,537.01	1.42	5,419.66	1.42	-
银河证券	1	1,711,302.16	0.42	1,593.66	0.42	-
财信证券	2	679,030.40	0.17	632.47	0.17	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	4	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
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、财信证券 009093 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。

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	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 (%)				的比例 (%)
开源证 券	83,048,755. 29	84.94	297,903,000. 00	92.00	-	-
信达证 券	1,135,398.8 0	1.16	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
民生证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	8,285,178.0 0	8.47	18,100,000.0 0	5.59	-	-
东兴证 券	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	7,800,000.00	2.41	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-
财信证 券	-	-	-	-	-	-
高华证 券	-	-	-	-	-	-
光大证 券	-	-	-	-	-	-
国联证 券	-	-	-	-	-	-
国盛证 券	-	-	-	-	-	-
华鑫证 券	-	-	-	-	-	-
西南证 券	-	-	-	-	-	-
湘财证 券	5,303,498.0 0	5.42	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
中投证 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	《宏利风险预算混合型证券投资基金基金经理变更公告》	《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站及公司网站	2023 年 09 月 16 日
2	《宏利风险预算混合型证券投资基金基金经理变更公告》	《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站及公司网站	2023 年 09 月 26 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风险预算混合型证券投资基金。

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。

3. 我司已于 2023 年 9 月 27 日发布《宏利基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修改基金合同等法律文件的公告》，经与托管行沟通，自 2023 年 10 月 9 日起，调低旗下部分基金的管理费率及托管费率，并对基金合同等法律文件的有关条款进行了修订。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准基金募集的文件；
- 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

基金管理人和基金托管人的住所。

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