

宏利风险预算混合型证券投资基金 2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：宏利基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	51

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	51
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	52
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	52
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	52
7.12 投资组合报告附注	52
§ 8 基金份额持有人信息	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53
§ 9 开放式基金份额变动	53
§ 10 重大事件揭示	54
10.1 基金份额持有人大会决议	54
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	54
10.4 基金投资策略的改变	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	54
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	54
§ 11 备查文件目录	56
11.1 备查文件目录	56
11.2 存放地点	56
11.3 查阅方式	56

§ 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	61,305,957.36 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		宏利基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	徐娇	方圆
	联系电话	66577766	95559
	电子邮箱	irm@manulifefund.com.cn	fangy_20@bankcomm.com
客户服务电话		400-698-8888	95559
传真		010-66577666	021-62701216
注册地址		北京市朝阳区针织路 23 号楼中国人寿金融中心 6 层 02-07 单元	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号
办公地址		北京市朝阳区针织路 23 号楼中国人寿金融中心 6 层 02-07 单元	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码		100026	200336
法定代表人		高贵鑫	任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	https://www.manulifefund.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	宏利基金管理有限公司	北京市朝阳区针织路 23 号楼中国人寿金融中心 6 层 02-07 单元

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024年1月1日-2024年6月30日)
本期已实现收益	809,722.82
本期利润	878,592.38
加权平均基金份额本期利润	0.0141
本期加权平均净值利润率	1.27%
本期基金份额净值增长率	1.30%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)
期末可供分配利润	7,355,441.96
期末可供分配基金份额利润	0.1200
期末基金资产净值	68,661,399.32
期末基金份额净值	1.1200
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)
基金份额累计净值增长率	539.85%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④

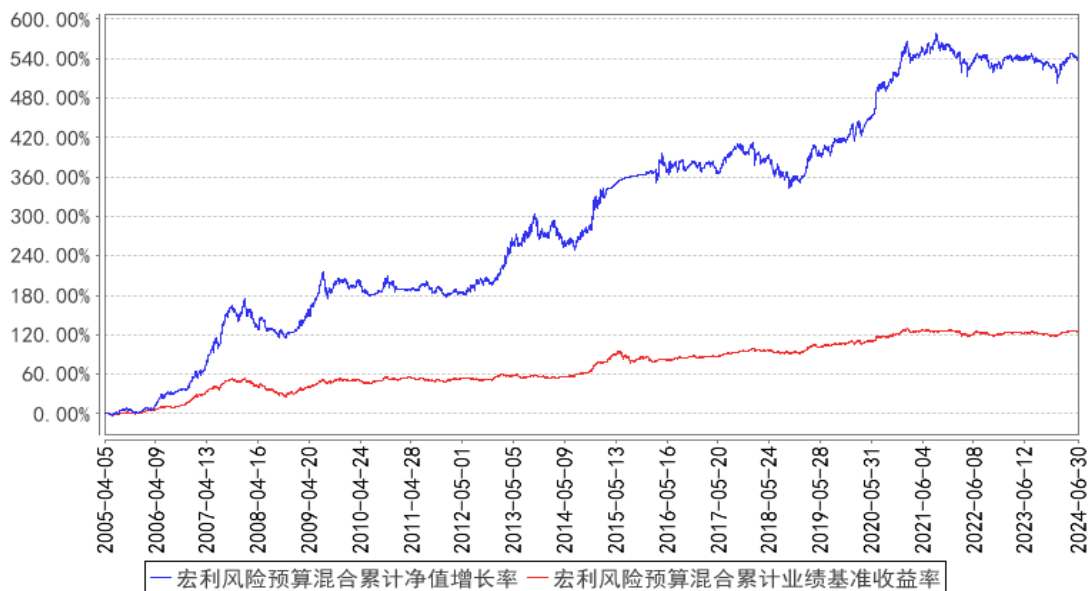
过去一个月	-0.67%	0.23%	-0.38%	0.09%	-0.29%	0.14%
过去三个月	0.95%	0.25%	0.32%	0.14%	0.63%	0.11%
过去六个月	1.30%	0.36%	1.99%	0.17%	-0.69%	0.19%
过去一年	-0.26%	0.30%	0.85%	0.17%	-1.11%	0.13%
过去三年	-2.10%	0.34%	-1.26%	0.21%	-0.84%	0.13%
自基金合同生效起至今	539.85%	0.63%	124.58%	0.32%	415.27%	0.31%

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。

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

宏利风险预算混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

截至报告期末本公司股东及持股比例分别为：宏利投资管理（新加坡）私人有限公司：51%；宏利投资管理（香港）有限公司：49%。

宏利基金管理有限公司原名湘财合丰基金管理有限公司、湘财荷银基金管理有限公司、泰达荷银基金管理有限公司、泰达宏利基金管理有限公司，成立于 2002 年 6 月。截至 2024 年 6 月 30 日，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、宏利睿智成长混合型证券投资基金、宏利中债-绿色普惠主题金融债券优选指数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		
蔡熠阳	固收研究部副总经理兼基金经理	2023 年 9 月 25 日	-	7 年	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，现任固收研究部副总经理兼基金经理。具备 7 年基金从业经验，具有基金从业资格。
刘欣	总经理助理兼基金经理	2016 年 9 月 26 日	-	17 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 17 年基金从业经验，17 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	2024 年 7 月 30 日	7 年	北京大学金融硕士；2017 年 7 月至今任职于宏利基金管理有限公司，曾任策略投资部助理研究员、研究员，现任基金经理。具备 7 年基金从业经验，具有基金从业资格。

注：1、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。

2、本基金基金经理刘欣于 2024 年 7 月 30 日离任，由现任基金经理蔡熠阳先生单独管理。公司于 2024 年 7 月 31 日发布《宏利风险预算混合型证券投资基金基金经理变更公告》。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人建立了公平交易制度和流程，并严格执行制度的规定。在投资管理活动中，本基金管理人公平对待不同投资组合，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和投资决策方面享有平等机会；严格执行投资管理职能和交易执行职能的隔离；在交易环节实行集中交易制度，并确保公平交易可操作、可评估、可稽核、可持续；交易部运用交易系统中设置的公平交易功能并按照时间优先、价格优先的原则严格执行所有指令；对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，交易部按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配，确保各投资组合享有公平的投资机会。风险管理部事后对本报告期的公平交易执行情况进行数量统计、分析。在本报告期内，未发现利益输送、不公平对待不同投资组合的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金管理人建立了异常交易的监控与报告制度，对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控，风险管理部定期对各投资组合的交易行为进行分析评估，向公司风险控制委员会提交公募基金和特定客户资产组合的交易行为分析报告。本报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合的同日反向交易成交较少的单边交易量均不超过该证券当日成交量的 5%。在本报告期内也未发生因异常交易而受到监管机构的处罚情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024 年二季度 A 股整体下跌，代表全市场的中证全指下跌约 8%。结构上看分化很大，少数股票上涨，多数股票下跌，其中高股息风格与美股映射的 AI 方向明显上涨，沪深 300 为首的大盘股微涨，小盘股和消费相关股票下跌较多。大类资产角度看，美股、黄金、国内长期国债上涨，港股先涨后跌，美国长期债券下跌。整体看市场观望气息较浓重，投资者对基本面较担心。当前 A 股在低波动低成交量状态下运行，投资机会主要来自内部结构化差异。宏观基本面层面，中游制造业数据较好，地产在政策支持下有企稳迹象，消费预期较弱；外围美国降息预期渐行渐近。

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，投资风格以低估值盈利稳定的大盘蓝筹股为主，部分争取中小盘统计套利机会。本报告期内，本基金增加了银行、电子、煤炭的配置，减少了计算机、医药、消费者服务板块的配置。

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 1.1200 元；本报告期基金份额净值增长率为 1.30%，业绩

比较基准收益率为 1.99%。

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，考虑到当前估值已经反映比较悲观的预期，认为当前市场下行空间有限，具有较好的赔率，比较看多市场。从胜率角度，考虑到当前经济环境的不确定性，市场复苏的过程可能不会很快，但包括监管积极改革市场、港股上涨、美国降息预期等线索正在显现。在股票结构配置上仍将保持均衡的方式，低估值防御性股票在年内三次达到相对基金平均 20%的超额收益后有所回撤，仍提供一定空间，这类股票由于具有高股息低估值特征，使得二级市场定价层面会离公司基本面更近，相对更类似绝对收益，体现出抗跌但向上弹性也不是很强的特征。此外大型成长股可能是如果出现反弹的较好标的。

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

低于 5000 万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内，宏利基金管理有限公司在宏利风险预算混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由宏利基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关宏利风险预算混合型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：宏利风险预算混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	52,715.23	314,427.73
结算备付金		562,870.37	548,533.37
存出保证金		10,463.76	6,424.79
交易性金融资产	6.4.7.2	69,644,068.77	67,348,277.22
其中：股票投资		20,464,021.09	21,416,719.48
基金投资		-	-
债券投资		49,180,047.68	45,931,557.74
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-

买入返售金融资产	6.4.7.4	-	2,951,975.85
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		3,811.76	11,576.51
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		70,273,929.89	71,181,215.47
负债和净资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		720,000.00	-
应付清算款		30,184.62	200,000.00
应付赎回款		-	25,674.07
应付管理人报酬		39,635.38	41,777.38
应付托管费		11,324.39	11,936.40
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		639,479.12	641,059.57
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	171,907.06	243,709.55
负债合计		1,612,530.57	1,164,156.97
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	61,305,957.36	63,329,606.24
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	7,355,441.96	6,687,452.26
净资产合计		68,661,399.32	70,017,058.50
负债和净资产总计		70,273,929.89	71,181,215.47

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.1200 元，基金份额总额 61,305,957.36 份。

6.2 利润表

会计主体：宏利风险预算混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年1月1日至2024 年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年6月30日
一、营业总收入		1,287,216.86	1,971,627.40
1. 利息收入		38,648.43	7,721.58
其中：存款利息收入	6.4.7.13	10,474.02	7,151.52
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		28,174.41	570.06
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,177,981.93	1,516,853.85
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-308,046.49	669,846.52
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	1,110,157.35	604,693.05
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	375,871.07	242,314.28
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	68,869.56	444,265.42
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	1,716.94	2,786.55
减：二、营业总支出		408,624.48	454,292.09
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	240,295.35	260,352.39
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	68,655.82	92,983.08
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		11,196.72	12,694.76
其中：卖出回购金融资产支出		11,196.72	12,694.76
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		2,055.65	2.50

8. 其他费用	6.4.7.23	86,420.94	88,259.36
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		878,592.38	1,517,335.31
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		878,592.38	1,517,335.31
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		878,592.38	1,517,335.31

6.3 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	63,329,606.24	-	6,687,452.26	70,017,058.50
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	63,329,606.24	-	6,687,452.26	70,017,058.50
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-2,023,648.88	-	667,989.70	-1,355,659.18
（一）、综合收益总额	-	-	878,592.38	878,592.38
（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）	-2,023,648.88	-	-210,602.68	-2,234,251.56
其中：1. 基金申购款	1,186,979.75	-	126,603.17	1,313,582.92
2. 基金赎回款	-3,210,628.63	-	-337,205.85	-3,547,834.48
（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	61,305,957.36	-	7,355,441.96	68,661,399.32
项目	上年度可比期间			
	2023年1月1日至2023年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	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）	-2,295,746.24	-	1,232,846.76	-1,062,899.48
（一）、综合收益总额	-	-	1,517,335.31	1,517,335.31
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-2,295,746.24	-	-284,488.55	-2,580,234.79
其中：1. 基金申购款	1,729,177.04	-	209,857.57	1,939,034.61
2. 基金赎回款	-4,024,923.28	-	-494,346.12	-4,519,269.40
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（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	66,111,696.47	-	8,124,653.34	74,236,349.81
-----------	---------------	---	--------------	---------------

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>高贵鑫</u>	<u>王泉</u>	<u>石楠</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

宏利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%。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2024 年度上半年财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 06 月 30 日的财务状况以及 2024 年度上半年的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

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

知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
活期存款	52,715.23
等于：本金	52,679.51
加：应计利息	35.72
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	52,715.23

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	21,073,127.09	-	20,464,021.09	-609,106.00
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	225,533.51	18,570,773.51	33,475.43
	银行间市场	30,014,478.05	318,174.17	276,621.95
	合计	48,326,242.62	543,707.68	49,180,047.68
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	69,399,369.71	543,707.68	69,644,068.77	-299,008.62

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资**6.4.7.5.1 债权投资情况**

本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末未计提债权投资减值准备。

6.4.7.6 其他债权投资**6.4.7.6.1 其他债权投资情况**

本基金本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末未计提其他债权投资减值准备。

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

本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末未有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2024 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	94,933.76
其中：交易所市场	92,051.47
银行间市场	2,882.29
应付利息	-
预提费用	76,130.70
其他	842.60
合计	171,907.06

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	63,329,606.24	63,329,606.24
本期申购	1,186,979.75	1,186,979.75
本期赎回（以“-”号填列）	-3,210,628.63	-3,210,628.63
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	61,305,957.36	61,305,957.36

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

6.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期末未有其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	14,943,375.71	-8,255,923.45	6,687,452.26
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-

其他	-	-	-
本期期初	14,943,375.71	-8,255,923.45	6,687,452.26
本期利润	809,722.82	68,869.56	878,592.38
本期基金份额交易产生的变动数	-458,725.93	248,123.25	-210,602.68
其中：基金申购款	268,841.35	-142,238.18	126,603.17
金赎回款	-727,567.28	390,361.43	-337,205.85
本期已分配利润	-	-	-
本期末	15,294,372.60	-7,938,930.64	7,355,441.96

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
活期存款利息收入		6,197.39
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		4,194.60
其他		82.03
合计		10,474.02

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入		-308,046.49

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	-308,046.49

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	128,644,045.87
减：卖出股票成本总额	128,628,699.89
减：交易费用	323,392.47
买卖股票差价收入	-308,046.49

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期末未有股票投资收益-证券出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	708,637.12
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	401,520.23
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	1,110,157.35

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	75,331,114.50
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	74,055,727.85
减：应计利息总额	869,752.59
减：交易费用	4,113.83
买卖债券差价收入	401,520.23

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期末未有债券投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期末有债券投资收益-申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益**6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成**

本基金本报告期末有资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期末有资产支持证券投资收益-买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期末有资产支持证券投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期末有资产支持证券投资收益-申购差价收入。

6.4.7.17 贵金属投资收益**6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金本报告期末有贵金属投资收益。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期末有贵金属投资收益-买卖贵金属差价收入。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期末有贵金属投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期末有贵金属投资收益-申购差价收入。

6.4.7.18 衍生工具收益**6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期末有衍生工具收益-买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期末有衍生工具收益-其他投资收益。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	375,871.07
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	375,871.07

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	68,869.56
股票投资	-158,621.84
债券投资	227,491.40
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	68,869.56

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	955.59
基金转换费收入	761.35
合计	1,716.94

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期末未有信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	27,349.14
信息披露费	39,781.56
证券出借违约金	-
银行费用	690.24
账户维护费	18,000.00

其他	600.00
合计	86,420.94

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期末有存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均未有应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日

当期发生的基金应支付的管理费	240,295.35	260,352.39
其中：应支付销售机构的客户维护费	100,313.48	106,016.01
应支付基金管理人的净管理费	139,981.87	154,336.38

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年6月30日	2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	68,655.82	92,983.08

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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

于本基金本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	52,715.23	6,197.39	690,505.36	5,212.97

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。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未有在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均未有其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2024年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 720,000.00 元，于 2024 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

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

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发

行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资、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。

6.4.13.2.1 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 2024年6月30日	上年度末 2023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。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	36,605,628.77	21,509,216.55
AAA 以下	3,418,371.69	38,840.18
未评级	9,156,047.22	21,319,980.68
合计	49,180,047.68	42,868,037.41

注：以上未评级的债券投资中包括国债、政策性金融债及央行票据等。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

于 2024 年 6 月 30 日，除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

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

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

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：

根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	52,715.23	-	-	-	52,715.23
结算备付金	562,870.37	-	-	-	562,870.37
存出保证金	10,463.76	-	-	-	10,463.76
交易性金融资产	7,237,425.91	27,288,346.08	14,654,275.69	20,464,021.09	69,644,068.77
应收申购款	-	-	-	3,811.76	3,811.76
资产总计	7,863,475.27	27,288,346.08	14,654,275.69	20,467,832.85	70,273,929.89
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	39,635.38	39,635.38
应付托管费	-	-	-	11,324.39	11,324.39
应付清算款	-	-	-	30,184.62	30,184.62
卖出回购金融资产款	720,000.00	-	-	-	720,000.00
应交税费	-	-	-	639,479.12	639,479.12
其他负债	-	-	-	171,907.06	171,907.06

负债总计	720,000.00	-	-	892,530.57	1,612,530.57
利率敏感度缺口	7,143,475.27	27,288,346.08	14,654,275.69	19,575,302.28	68,661,399.32
上年度末 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

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的到期日予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	380,000.00	210,000.00
市场利率上升 25 个基点	-380,000.00	-210,000.00	

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以

外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023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	20,464,021.09	29.80	21,416,719.48	30.59
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	20,464,021.09	29.80	21,416,719.48	30.59

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

	动	本期末 (2024 年 6 月 30 日)	上年度末 (2023 年 12 月 31 日)
	沪深 300 指数上升 5%		1,080,000.00
沪深 300 指数下降 5%		-1,080,000.00	-830,000.00

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	20,464,021.09	21,455,559.66
第二层次	49,180,047.68	45,892,717.56
第三层次	-	-
合计	69,644,068.77	67,348,277.22

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换事项发生的当年年初为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2023 年 12 月 31 日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告**7.1 期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	20,464,021.09	29.12
	其中：股票	20,464,021.09	29.12
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	49,180,047.68	69.98
	其中：债券	49,180,047.68	69.98
	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	615,585.60	0.88
8	其他各项资产	14,275.52	0.02
9	合计	70,273,929.89	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合**7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合**

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	27,168.00	0.04
B	采矿业	1,903,332.00	2.77
C	制造业	11,319,405.05	16.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	895,427.20	1.30
E	建筑业	442,974.00	0.65
F	批发和零售业	406,625.12	0.59

G	交通运输、仓储和邮政业	503,652.00	0.73
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	650,829.92	0.95
J	金融业	3,586,919.00	5.22
K	房地产业	7,056.00	0.01
L	租赁和商务服务业	209,306.00	0.30
M	科学研究和技术服务业	126,234.00	0.18
N	水利、环境和公共设施管理业	127,802.80	0.19
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	24,640.00	0.04
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	222,794.00	0.32
S	综合	9,856.00	0.01
	合计	20,464,021.09	29.80

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601899	紫金矿业	21,400	375,998.00	0.55
2	000333	美的集团	5,800	374,100.00	0.54
3	601009	南京银行	35,400	367,806.00	0.54
4	601088	中国神华	8,200	363,834.00	0.53
5	600036	招商银行	10,500	358,995.00	0.52
6	601169	北京银行	54,600	318,864.00	0.46
7	002674	兴业科技	30,000	306,600.00	0.45
8	002594	比亚迪	1,200	300,300.00	0.44
9	600660	福耀玻璃	6,200	296,980.00	0.43
10	300773	拉卡拉	22,400	278,432.00	0.41
11	600690	海尔智家	9,500	269,610.00	0.39
12	601838	成都银行	16,000	243,040.00	0.35
13	601318	中国平安	5,800	239,888.00	0.35
14	601800	中国交建	25,400	227,076.00	0.33
15	601288	农业银行	51,400	224,104.00	0.33
16	600398	海澜之家	23,600	218,064.00	0.32
17	605599	莱百股份	16,600	211,318.00	0.31
18	601916	浙商银行	76,200	210,312.00	0.31
19	600926	杭州银行	16,000	208,800.00	0.30
20	000338	潍柴动力	12,800	207,872.00	0.30
21	603558	健盛集团	19,600	195,020.00	0.28

22	605368	蓝天燃气	14,200	193,688.00	0.28
23	601658	邮储银行	37,800	191,646.00	0.28
24	000928	中钢国际	34,400	190,920.00	0.28
25	000921	海信家电	5,900	190,216.00	0.28
26	601717	郑煤机	11,600	171,680.00	0.25
27	603515	欧普照明	9,800	169,932.00	0.25
28	600642	申能股份	19,200	169,536.00	0.25
29	600000	浦发银行	20,000	164,600.00	0.24
30	600901	江苏金租	32,400	163,620.00	0.24
31	601888	中国中免	2,600	162,474.00	0.24
32	600188	兖矿能源	6,800	154,564.00	0.23
33	300502	新易盛	1,400	147,770.00	0.22
34	603993	洛阳钼业	17,200	146,200.00	0.21
35	601919	中远海控	9,400	145,606.00	0.21
36	601225	陕西煤业	5,400	139,158.00	0.20
37	002048	宁波华翔	10,600	137,164.00	0.20
38	601398	工商银行	24,000	136,800.00	0.20
39	600919	江苏银行	18,200	135,226.00	0.20
40	601857	中国石油	11,600	119,712.00	0.17
41	300628	亿联网络	3,200	117,664.00	0.17
42	688578	艾力斯	1,800	114,732.00	0.17
43	003006	百亚股份	4,600	109,020.00	0.16
44	600985	淮北矿业	6,400	107,136.00	0.16
45	603658	安图生物	2,200	101,354.00	0.15
46	603298	杭叉集团	5,080	99,771.20	0.15
47	601988	中国银行	20,600	95,172.00	0.14
48	605333	沪光股份	3,400	94,690.00	0.14
49	002475	立讯精密	2,400	94,344.00	0.14
50	601688	华泰证券	7,600	94,164.00	0.14
51	002028	思源电气	1,400	93,660.00	0.14
52	000933	神火股份	4,600	93,058.00	0.14
53	688408	中信博	1,000	92,080.00	0.13
54	601799	星宇股份	800	89,632.00	0.13
55	002128	电投能源	4,200	88,620.00	0.13
56	300308	中际旭创	640	88,243.20	0.13
57	601019	山东出版	7,400	87,468.00	0.13
58	600900	长江电力	3,000	86,760.00	0.13
59	000568	泸州老窖	600	86,094.00	0.13
60	688278	特宝生物	1,600	85,680.00	0.12
61	601166	兴业银行	4,800	84,576.00	0.12
62	600809	山西汾酒	400	84,352.00	0.12
63	601939	建设银行	11,200	82,880.00	0.12
64	601098	中南传媒	6,600	81,972.00	0.12

65	688766	普冉股份	840	81,622.80	0.12
66	603198	迎驾贡酒	1,400	80,500.00	0.12
67	601229	上海银行	11,000	79,860.00	0.12
68	300857	协创数据	1,400	79,800.00	0.12
69	300573	兴齐眼药	480	78,720.00	0.11
70	000544	中原环保	10,000	78,700.00	0.11
71	601126	四方股份	4,000	76,880.00	0.11
72	002014	永新股份	8,000	75,840.00	0.11
73	601598	中国外运	13,400	75,442.00	0.11
74	000157	中联重科	9,400	72,192.00	0.11
75	002466	天齐锂业	2,400	71,784.00	0.10
76	002003	伟星股份	5,600	70,280.00	0.10
77	002032	苏泊尔	1,400	70,140.00	0.10
78	688138	清溢光电	3,260	70,090.00	0.10
79	002179	中航光电	1,800	68,490.00	0.10
80	301429	森泰股份	4,400	67,320.00	0.10
81	603605	珀莱雅	600	66,594.00	0.10
82	000488	晨鸣纸业	19,200	66,432.00	0.10
83	603855	华荣股份	3,000	66,330.00	0.10
84	002533	金杯电工	6,600	65,670.00	0.10
85	688050	爱博医疗	880	64,521.60	0.09
86	603088	宁波精达	8,400	63,252.00	0.09
87	603379	三美股份	1,600	62,624.00	0.09
88	000543	皖能电力	7,000	61,950.00	0.09
89	002920	德赛西威	700	60,963.00	0.09
90	601965	中国汽研	3,600	60,804.00	0.09
91	600582	天地科技	8,800	60,632.00	0.09
92	300005	探路者	12,000	60,120.00	0.09
93	600480	凌云股份	6,000	58,980.00	0.09
94	002463	沪电股份	1,600	58,400.00	0.09
95	688233	神工股份	3,000	57,810.00	0.08
96	601898	中煤能源	4,600	57,408.00	0.08
97	001965	招商公路	4,800	56,928.00	0.08
98	603556	海兴电力	1,200	56,196.00	0.08
99	603348	文灿股份	2,000	55,380.00	0.08
100	301345	涛涛车业	1,000	55,100.00	0.08
101	600114	东睦股份	3,800	54,682.00	0.08
102	603739	蔚蓝生物	4,200	54,264.00	0.08
103	300953	震裕科技	1,000	54,200.00	0.08
104	600873	梅花生物	5,400	54,108.00	0.08
105	301219	腾远钴业	1,400	53,564.00	0.08
106	600315	上海家化	3,000	53,340.00	0.08
107	601058	赛轮轮胎	3,800	53,200.00	0.08

108	000883	湖北能源	8,800	52,888.00	0.08
109	603368	柳药集团	3,000	52,500.00	0.08
110	603239	浙江仙通	3,800	52,098.00	0.08
111	000513	丽珠集团	1,400	52,094.00	0.08
112	603809	豪能股份	6,424	51,905.92	0.08
113	003021	兆威机电	1,120	51,688.00	0.08
114	000538	云南白药	1,000	51,150.00	0.07
115	601077	渝农商行	10,000	50,200.00	0.07
116	000423	东阿阿胶	800	50,080.00	0.07
117	300394	天孚通信	560	49,515.20	0.07
118	603337	杰克股份	1,800	47,376.00	0.07
119	605183	确成股份	3,000	46,380.00	0.07
120	301327	华宝新能	800	45,840.00	0.07
121	600018	上港集团	7,600	43,928.00	0.06
122	600160	巨化股份	1,800	43,434.00	0.06
123	601369	陕鼓动力	5,200	41,704.00	0.06
124	300832	新产业	600	40,464.00	0.06
125	688019	安集科技	320	40,256.00	0.06
126	600348	华阳股份	4,000	39,840.00	0.06
127	601811	新华文轩	2,800	39,228.00	0.06
128	603259	药明康德	1,000	39,190.00	0.06
129	600025	华能水电	3,600	38,808.00	0.06
130	603786	科博达	600	38,490.00	0.06
131	002139	拓邦股份	3,600	38,232.00	0.06
132	603228	景旺电子	1,200	38,160.00	0.06
133	601666	平煤股份	3,400	38,080.00	0.06
134	600183	生益科技	1,800	37,908.00	0.06
135	002737	葵花药业	1,600	37,408.00	0.05
136	300552	万集科技	1,000	37,380.00	0.05
137	688631	莱斯信息	600	37,212.00	0.05
138	002572	索菲亚	2,400	36,792.00	0.05
139	601127	赛力斯	400	36,448.00	0.05
140	600737	中粮糖业	3,800	36,442.00	0.05
141	600887	伊利股份	1,400	36,176.00	0.05
142	600089	特变电工	2,600	36,062.00	0.05
143	688510	航亚科技	1,943	35,770.63	0.05
144	601633	长城汽车	1,400	35,420.00	0.05
145	600219	南山铝业	9,200	35,052.00	0.05
146	002922	伊戈尔	1,600	34,976.00	0.05
147	301162	国能日新	800	34,848.00	0.05
148	002267	陕天然气	4,600	34,776.00	0.05
149	002668	TCL 智家	3,800	34,428.00	0.05
150	002372	伟星新材	2,200	33,924.00	0.05

151	301055	张小泉	2,800	33,208.00	0.05
152	600585	海螺水泥	1,400	33,026.00	0.05
153	600547	山东黄金	1,200	32,856.00	0.05
154	603351	威尔药业	1,600	32,416.00	0.05
155	600998	九州通	6,624	32,325.12	0.05
156	001230	劲旅环境	2,320	32,224.80	0.05
157	300679	电连技术	800	32,184.00	0.05
158	688656	浩欧博	1,400	32,102.00	0.05
159	601566	九牧王	3,800	31,996.00	0.05
160	688629	华丰科技	1,200	31,632.00	0.05
161	688030	山石网科	3,000	31,350.00	0.05
162	688076	诺泰生物	400	31,312.00	0.05
163	002942	新农股份	2,600	30,654.00	0.04
164	688036	传音控股	400	30,616.00	0.04
165	002106	莱宝高科	2,800	30,520.00	0.04
166	688253	英诺特	800	30,488.00	0.04
167	603279	景津装备	1,400	30,366.00	0.04
168	688767	博拓生物	1,200	30,084.00	0.04
169	603150	万朗磁塑	1,200	30,048.00	0.04
170	603113	金能科技	5,400	29,538.00	0.04
171	301196	唯科科技	1,000	29,530.00	0.04
172	600285	羚锐制药	1,200	29,052.00	0.04
173	605068	明新旭腾	2,200	28,996.00	0.04
174	603486	科沃斯	600	28,308.00	0.04
175	603203	快克智能	1,200	28,296.00	0.04
176	301130	西点药业	1,200	28,116.00	0.04
177	603187	海容冷链	2,400	27,984.00	0.04
178	603730	岱美股份	2,780	27,633.20	0.04
179	002540	亚太科技	5,200	27,508.00	0.04
180	603160	汇顶科技	400	27,500.00	0.04
181	688095	福昕软件	600	27,486.00	0.04
182	300638	广和通	1,600	27,360.00	0.04
183	300761	立华股份	1,200	27,168.00	0.04
184	002340	格林美	4,200	26,754.00	0.04
185	300384	三联虹普	2,000	26,240.00	0.04
186	688498	源杰科技	200	26,198.00	0.04
187	003019	宸展光电	1,030	26,089.90	0.04
188	603816	顾家家居	800	25,832.00	0.04
189	300815	玉禾田	2,200	25,608.00	0.04
190	605166	聚合顺	2,400	25,176.00	0.04
191	002648	卫星化学	1,400	25,172.00	0.04
192	688022	瀚川智能	1,800	24,678.00	0.04
193	000526	学大教育	400	24,640.00	0.04

194	300146	汤臣倍健	1,800	24,390.00	0.04
195	300207	欣旺达	1,600	24,272.00	0.04
196	688058	宝兰德	1,164	24,246.12	0.04
197	300181	佐力药业	1,600	24,192.00	0.04
198	000923	河钢资源	1,400	24,108.00	0.04
199	000848	承德露露	3,000	23,580.00	0.03
200	603889	新澳股份	3,000	23,220.00	0.03
201	002755	奥赛康	2,400	23,160.00	0.03
202	002928	华夏航空	3,600	22,824.00	0.03
203	002557	洽洽食品	800	22,552.00	0.03
204	603281	江瀚新材	1,000	22,450.00	0.03
205	002508	老板电器	1,000	22,100.00	0.03
206	688127	蓝特光学	1,200	22,068.00	0.03
207	601101	昊华能源	2,400	22,056.00	0.03
208	002023	海特高新	2,400	21,960.00	0.03
209	603639	海利尔	1,800	21,906.00	0.03
210	000977	浪潮信息	600	21,822.00	0.03
211	600941	中国移动	200	21,500.00	0.03
212	603408	建霖家居	1,600	21,104.00	0.03
213	603897	长城科技	1,200	21,060.00	0.03
214	600803	新奥股份	1,000	20,800.00	0.03
214	603115	海星股份	2,000	20,800.00	0.03
216	603093	南华期货	2,400	20,784.00	0.03
217	600489	中金黄金	1,400	20,720.00	0.03
218	688283	坤恒顺维	600	20,628.00	0.03
219	002697	红旗连锁	4,400	20,372.00	0.03
220	000906	浙商中拓	3,000	20,220.00	0.03
221	605377	华旺科技	1,520	20,140.00	0.03
222	300049	福瑞股份	400	20,136.00	0.03
223	603501	韦尔股份	200	19,874.00	0.03
224	603686	福龙马	2,600	19,812.00	0.03
225	603181	皇马科技	2,200	19,778.00	0.03
226	002216	三全食品	1,800	19,764.00	0.03
227	688018	乐鑫科技	200	19,736.00	0.03
228	603587	地素时尚	1,600	19,648.00	0.03
229	603948	建业股份	1,200	19,536.00	0.03
230	300482	万孚生物	800	19,520.00	0.03
231	688389	普门科技	1,200	19,512.00	0.03
232	002088	鲁阳节能	1,600	19,344.00	0.03
233	601311	骆驼股份	2,400	19,248.00	0.03
234	603579	荣泰健康	1,240	19,170.40	0.03
235	301308	江波龙	200	18,948.00	0.03
236	300435	中泰股份	1,600	18,832.00	0.03

237	301061	匠心家居	400	18,784.00	0.03
238	002035	华帝股份	3,000	18,690.00	0.03
239	002937	兴瑞科技	800	18,648.00	0.03
240	002415	海康威视	600	18,546.00	0.03
241	300048	合康新能	4,000	18,520.00	0.03
242	603303	得邦照明	1,600	18,368.00	0.03
243	603878	武进不锈	2,800	18,312.00	0.03
244	000900	现代投资	5,000	18,300.00	0.03
245	002155	湖南黄金	1,000	18,100.00	0.03
246	603886	元祖股份	1,200	18,072.00	0.03
247	600066	宇通客车	700	18,060.00	0.03
248	600395	盘江股份	3,000	18,030.00	0.03
249	000725	京东方 A	4,400	17,996.00	0.03
250	300193	佳士科技	2,400	17,808.00	0.03
251	002293	罗莱生活	2,200	17,776.00	0.03
252	603600	永艺股份	1,700	17,748.00	0.03
253	601339	百隆东方	3,400	17,714.00	0.03
254	605050	福然德	2,000	17,620.00	0.03
255	603699	纽威股份	1,000	17,120.00	0.02
256	600284	浦东建设	3,200	17,088.00	0.02
257	600211	西藏药业	520	16,941.60	0.02
258	600346	恒力石化	1,200	16,740.00	0.02
259	002158	汉钟精机	1,000	16,720.00	0.02
259	600323	瀚蓝环境	800	16,720.00	0.02
261	688480	赛恩斯	600	16,716.00	0.02
262	601860	紫金银行	6,600	16,500.00	0.02
263	603689	皖天然气	2,000	16,440.00	0.02
264	688336	三生国健	800	16,280.00	0.02
265	688213	思特威	334	16,199.00	0.02
266	600309	万华化学	200	16,172.00	0.02
267	002304	洋河股份	200	16,148.00	0.02
268	603535	嘉诚国际	1,000	16,140.00	0.02
269	600760	中航沈飞	400	16,040.00	0.02
270	603519	立霸股份	1,400	15,834.00	0.02
271	601700	风范股份	3,600	15,804.00	0.02
272	600308	华泰股份	5,000	15,700.00	0.02
273	000651	格力电器	400	15,688.00	0.02
274	002555	三七互娱	1,200	15,660.00	0.02
275	002236	大华股份	1,000	15,460.00	0.02
276	603053	成都燃气	1,600	15,456.00	0.02
277	301269	华大九天	200	15,410.00	0.02
278	002831	裕同科技	600	15,354.00	0.02
279	002839	张家港行	3,800	15,276.00	0.02

280	605077	华康股份	1,000	15,250.00	0.02
281	301045	天禄科技	800	15,248.00	0.02
282	603035	常熟汽饰	1,200	15,216.00	0.02
283	600713	南京医药	3,600	15,192.00	0.02
284	601985	中国核电	1,400	14,924.00	0.02
285	002993	奥海科技	400	14,880.00	0.02
286	600790	轻纺城	4,600	14,812.00	0.02
287	600256	广汇能源	2,200	14,740.00	0.02
288	000030	富奥股份	3,000	14,730.00	0.02
289	603112	华翔股份	1,400	14,714.00	0.02
289	603630	拉芳家化	1,400	14,714.00	0.02
291	600546	山煤国际	1,000	14,620.00	0.02
292	600886	国投电力	800	14,592.00	0.02
293	002043	兔宝宝	1,400	14,518.00	0.02
294	601179	中国西电	1,800	14,472.00	0.02
295	003000	劲仔食品	1,200	14,460.00	0.02
296	002004	华邦健康	3,800	14,440.00	0.02
297	603323	苏农银行	3,000	14,430.00	0.02
298	600125	铁龙物流	2,400	14,328.00	0.02
299	002807	江阴银行	3,800	14,326.00	0.02
300	300349	金卡智能	1,200	14,304.00	0.02
301	300866	安克创新	200	14,242.00	0.02
302	600362	江西铜业	600	14,208.00	0.02
303	002788	鹭燕医药	1,800	14,184.00	0.02
304	002130	沃尔核材	1,000	14,120.00	0.02
305	002947	恒铭达	400	14,080.00	0.02
306	300121	阳谷华泰	1,800	14,040.00	0.02
307	603995	甬金股份	800	14,016.00	0.02
308	002919	名臣健康	1,200	13,932.00	0.02
309	603128	华贸物流	2,400	13,848.00	0.02
310	600035	楚天高速	3,200	13,728.00	0.02
311	300463	迈克生物	1,200	13,656.00	0.02
312	002545	东方铁塔	2,000	13,620.00	0.02
313	301087	可孚医疗	400	13,560.00	0.02
314	601728	中国电信	2,200	13,530.00	0.02
315	300470	中密控股	400	13,524.00	0.02
316	688566	吉贝尔	600	13,500.00	0.02
317	688075	安旭生物	400	13,476.00	0.02
318	688020	方邦股份	400	13,344.00	0.02
319	301182	凯旺科技	600	13,308.00	0.02
320	600433	冠豪高新	5,000	13,250.00	0.02
321	002345	潮宏基	2,800	13,216.00	0.02
322	600938	中国海油	400	13,200.00	0.02

323	300791	仙乐健康	520	13,104.00	0.02
324	002440	闰土股份	2,400	13,032.00	0.02
325	300304	云意电气	2,000	13,020.00	0.02
326	002550	千红制药	2,400	12,936.00	0.02
327	600015	华夏银行	2,000	12,800.00	0.02
328	002997	瑞鹄模具	400	12,788.00	0.02
329	300453	三鑫医疗	2,000	12,780.00	0.02
330	603158	腾龙股份	1,800	12,672.00	0.02
331	600233	圆通速递	800	12,520.00	0.02
331	603365	水星家纺	800	12,520.00	0.02
333	688108	赛诺医疗	1,400	12,516.00	0.02
334	300577	开润股份	600	12,498.00	0.02
335	300415	伊之密	600	12,468.00	0.02
336	300636	同和药业	1,200	12,204.00	0.02
337	300622	博士眼镜	1,000	12,170.00	0.02
337	300979	华利集团	200	12,170.00	0.02
339	002991	甘源食品	200	12,130.00	0.02
340	000731	四川美丰	1,800	11,934.00	0.02
341	300408	三环集团	400	11,676.00	0.02
342	000830	鲁西化工	1,000	11,590.00	0.02
343	002532	天山铝业	1,400	11,354.00	0.02
344	601601	中国太保	400	11,144.00	0.02
345	603296	华勤技术	200	11,046.00	0.02
346	601702	华峰铝业	600	10,956.00	0.02
347	000426	兴业银锡	800	10,864.00	0.02
348	300790	宇瞳光学	800	10,800.00	0.02
349	002315	焦点科技	400	10,784.00	0.02
350	601168	西部矿业	600	10,770.00	0.02
351	600993	马应龙	400	10,668.00	0.02
352	605198	安德利	400	10,560.00	0.02
353	300673	佩蒂股份	800	10,496.00	0.02
354	688676	金盘科技	200	10,430.00	0.02
355	600989	宝丰能源	600	10,398.00	0.02
356	605266	健之佳	400	10,380.00	0.02
357	603979	金诚信	200	10,106.00	0.01
358	600694	大商股份	600	10,086.00	0.01
359	600406	国电南瑞	400	9,984.00	0.01
360	600673	东阳光	1,400	9,856.00	0.01
361	000975	银泰黄金	600	9,774.00	0.01
362	603606	东方电缆	200	9,762.00	0.01
363	688208	道通科技	400	9,656.00	0.01
364	601231	环旭电子	600	9,630.00	0.01
365	600707	彩虹股份	1,400	9,534.00	0.01

366	603299	苏盐井神	1,000	9,500.00	0.01
367	603666	亿嘉和	600	9,468.00	0.01
368	603328	依顿电子	1,200	9,432.00	0.01
369	688234	天岳先进	200	9,384.00	0.01
370	603225	新凤鸣	600	9,354.00	0.01
371	605188	国光连锁	1,200	9,300.00	0.01
372	002563	森马服饰	1,600	9,296.00	0.01
373	002635	安洁科技	600	9,264.00	0.01
373	600461	洪城环境	800	9,264.00	0.01
373	603087	甘李药业	200	9,264.00	0.01
376	600750	江中药业	400	9,244.00	0.01
377	603032	德新科技	800	9,144.00	0.01
378	601163	三角轮胎	600	9,132.00	0.01
379	600176	中国巨石	800	8,840.00	0.01
380	001336	楚环科技	400	8,740.00	0.01
381	600761	安徽合力	400	8,656.00	0.01
382	301185	鸥玛软件	600	8,598.00	0.01
383	603233	大参林	600	8,580.00	0.01
384	600420	国药现代	800	8,544.00	0.01
385	600508	上海能源	600	8,490.00	0.01
385	601827	三峰环境	1,000	8,490.00	0.01
387	601000	唐山港	1,800	8,460.00	0.01
388	601872	招商轮船	1,000	8,450.00	0.01
389	603989	艾华集团	600	8,436.00	0.01
390	002152	广电运通	800	8,368.00	0.01
391	688516	奥特维	200	8,362.00	0.01
392	601958	金钼股份	800	8,328.00	0.01
393	000983	山西焦煤	800	8,248.00	0.01
394	603568	伟明环保	400	8,232.00	0.01
395	603738	泰晶科技	600	8,184.00	0.01
396	603583	捷昌驱动	400	8,152.00	0.01
397	605016	百龙创园	400	8,148.00	0.01
398	600757	长江传媒	1,000	8,060.00	0.01
399	002643	万润股份	800	8,000.00	0.01
400	002938	鹏鼎控股	200	7,952.00	0.01
401	002845	同兴达	600	7,932.00	0.01
402	603610	麒盛科技	800	7,904.00	0.01
403	600039	四川路桥	1,000	7,890.00	0.01
404	601665	齐鲁银行	1,600	7,856.00	0.01
405	300748	金力永磁	600	7,776.00	0.01
406	601020	华钰矿业	600	7,680.00	0.01
407	600236	桂冠电力	1,000	7,670.00	0.01
408	601298	青岛港	800	7,648.00	0.01

409	601816	京沪高铁	1,400	7,518.00	0.01
410	600674	川投能源	400	7,500.00	0.01
411	688220	翱捷科技	200	7,492.00	0.01
412	600497	驰宏锌锗	1,400	7,476.00	0.01
413	002601	龙佰集团	400	7,428.00	0.01
414	300532	今天国际	600	7,374.00	0.01
415	000700	模塑科技	1,400	7,350.00	0.01
416	600893	航发动力	200	7,310.00	0.01
417	300433	蓝思科技	400	7,300.00	0.01
418	600795	国电电力	1,200	7,188.00	0.01
419	600095	湘财股份	1,200	7,152.00	0.01
420	601333	广深铁路	2,200	7,128.00	0.01
421	301127	天源环保	600	7,092.00	0.01
422	600663	陆家嘴	800	7,056.00	0.01
423	301236	软通动力	200	7,042.00	0.01
424	600483	福能股份	600	6,996.00	0.01
425	603565	中谷物流	800	6,992.00	0.01
426	603393	新天然气	200	6,948.00	0.01
427	603008	喜临门	400	6,932.00	0.01
428	300921	南凌科技	400	6,928.00	0.01
429	000683	远兴能源	1,000	6,910.00	0.01
430	002332	仙琚制药	600	6,846.00	0.01
430	688352	颀中科技	600	6,846.00	0.01
432	002273	水晶光电	400	6,792.00	0.01
433	600718	东软集团	800	6,616.00	0.01
434	600956	新天绿能	800	6,536.00	0.01
435	003816	中国广核	1,400	6,482.00	0.01
436	601500	通用股份	1,200	6,408.00	0.01
437	300856	科思股份	200	6,402.00	0.01
438	600845	宝信软件	200	6,386.00	0.01
439	000600	建投能源	1,000	6,300.00	0.01
440	002252	上海莱士	800	6,256.00	0.01
441	600026	中远海能	400	6,244.00	0.01
442	688219	会通股份	800	6,216.00	0.01
443	601628	中国人寿	200	6,210.00	0.01
444	002245	蔚蓝锂芯	800	6,200.00	0.01
445	605111	新洁能	200	6,118.00	0.01
446	601137	博威合金	400	6,096.00	0.01
447	000719	中原传媒	600	6,066.00	0.01
448	002027	分众传媒	1,000	6,060.00	0.01
449	002749	国光股份	400	6,016.00	0.01
450	603688	石英股份	200	5,922.00	0.01
451	000950	重药控股	1,200	5,844.00	0.01

452	002707	众信旅游	1,000	5,740.00	0.01
453	000420	吉林化纤	1,800	5,688.00	0.01
454	603119	浙江荣泰	320	5,670.40	0.01
455	601528	瑞丰银行	1,200	5,664.00	0.01
456	000063	中兴通讯	200	5,594.00	0.01
457	605128	上海沿浦	200	5,578.00	0.01
458	000737	北方铜业	600	5,568.00	0.01
459	688486	龙迅股份	96	5,500.80	0.01
460	601138	工业富联	200	5,480.00	0.01
461	002911	佛燃能源	580	5,301.20	0.01
462	600028	中国石化	800	5,056.00	0.01
463	603496	恒为科技	200	4,890.00	0.01
464	000409	云鼎科技	600	4,842.00	0.01
465	002096	易普力	400	4,760.00	0.01
466	600688	上海石化	1,800	4,698.00	0.01
467	000821	京山轻机	400	4,532.00	0.01
468	300783	三只松鼠	200	4,374.00	0.01
469	300059	东方财富	400	4,224.00	0.01
470	600968	海油发展	1,000	4,120.00	0.01
471	688588	凌志软件	600	4,110.00	0.01
472	688362	甬矽电子	200	3,892.00	0.01
473	688150	莱特光电	200	3,880.00	0.01
474	601877	正泰电器	200	3,812.00	0.01
475	600050	中国联通	800	3,760.00	0.01
476	600875	东方电气	200	3,690.00	0.01
477	600850	电科数字	200	3,620.00	0.01
478	603927	中科软	200	3,618.00	0.01
479	601808	中海油服	200	3,440.00	0.01
480	002840	华统股份	200	3,318.00	0.00
481	300002	神州泰岳	400	3,248.00	0.00
482	601233	桐昆股份	200	3,192.00	0.00
483	002649	博彦科技	400	3,184.00	0.00
484	601216	君正集团	800	2,952.00	0.00
485	000997	新大陆	200	2,782.00	0.00
486	002396	星网锐捷	200	2,642.00	0.00
487	300525	博思软件	200	2,540.00	0.00
488	000810	创维数字	200	1,716.00	0.00
489	000703	恒逸石化	200	1,418.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
----	------	------	----------	----------------

1	600398	海澜之家	1,183,397.00	1.69
2	601169	北京银行	945,745.00	1.35
3	002594	比亚迪	930,608.00	1.33
4	603259	药明康德	903,540.00	1.29
5	000921	海信家电	901,388.00	1.29
6	000338	潍柴动力	840,988.00	1.20
7	600642	申能股份	840,066.80	1.20
8	600690	海尔智家	836,388.00	1.19
9	600660	福耀玻璃	834,851.00	1.19
10	600926	杭州银行	825,739.00	1.18
11	601899	紫金矿业	792,818.00	1.13
12	600036	招商银行	785,775.00	1.12
13	601919	中远海控	729,431.00	1.04
14	601288	农业银行	707,738.00	1.01
15	000333	美的集团	696,102.00	0.99
16	601318	中国平安	690,929.00	0.99
17	600919	江苏银行	678,912.00	0.97
18	601888	中国中免	676,846.00	0.97
19	002035	华帝股份	661,950.00	0.95
20	600481	双良节能	654,476.00	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。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002594	比亚迪	1,417,981.00	2.03
2	600690	海尔智家	1,414,277.00	2.02
3	603259	药明康德	1,390,162.00	1.99
4	000921	海信家电	1,347,706.00	1.92
5	601899	紫金矿业	1,325,395.00	1.89
6	000338	潍柴动力	1,296,796.00	1.85
7	600660	福耀玻璃	1,272,687.00	1.82
8	600398	海澜之家	1,089,993.00	1.56
9	601318	中国平安	1,045,409.00	1.49
10	600036	招商银行	1,009,479.00	1.44
11	601888	中国中免	1,002,451.00	1.43
12	603993	洛阳钼业	841,186.00	1.20
13	601288	农业银行	838,826.00	1.20
14	600066	宇通客车	787,173.00	1.12
15	600481	双良节能	781,494.00	1.12
16	600926	杭州银行	754,280.00	1.08

17	002035	华帝股份	746,040.50	1.07
18	688235	百济神州	717,129.18	1.02
19	600642	申能股份	712,877.10	1.02
20	601088	中国神华	700,219.00	1.00

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	127,834,623.34
卖出股票收入（成交）总额	128,644,045.87

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	4,062,460.27	5.92
2	央行票据	-	-
3	金融债券	17,915,675.28	26.09
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	14,508,313.24	21.13
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	12,693,598.89	18.49
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	49,180,047.68	71.63

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019709	23 国债 16	40,000	4,062,460.27	5.92
2	115462	23 交租 01	39,000	3,969,498.64	5.78
3	312400002	24 工行 TLAC 非资本债 01B	39,000	3,934,389.45	5.73
4	312410002	24 中行 TLAC 非资本债 01B	39,000	3,933,396.82	5.73
5	232380086	23 汉口银行二 级资本债 02	31,000	3,418,371.69	4.98

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

在报告期内，本基金未投资于股指期货。该策略符合基金合同的规定。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末投资于国债期货。该策略符合基金合同的规定。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，南京银行股份有限公司于 2023 年 8 月 25 日曾受到国家外汇管理局江苏省分局公开处罚；招商银行股份有限公司于 2023 年 11 月 27 日曾受到国家外汇管理局深圳市分局公开处罚，于 2023 年 12 月 13 日曾受到国家金融监督管理总局深圳监管局公开处罚，于 2024 年 6 月 24 日曾受到国家金融监督管理总局公开处罚；北京银行股份有限公司于 2024 年 2 月 1 日曾受到国家金融监督管理总局北京监管局公开处罚；中国银行股份有限公司于 2024 年 4 月 3 日曾受到国家外汇管理局北京市分局公开处罚，于 2023 年 12 月 28 日曾受到国家金融监督管理总局公开处罚，于 2023 年 11 月 29 日曾受到央行公开处罚；汉口银行股份有限公司于 2024 年 4 月 12 日、2023 年 9 月 25 日曾受到国家金融监督管理总局湖北监管局公开处罚，于 2023 年 7 月 5 日曾受到湖北银保监局公开处罚。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
----	----	----

1	存出保证金	10,463.76
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,811.76
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,275.52

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
5,074	12,082.37	94,347.43	0.15	61,211,609.93	99.85

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例(%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	84,419.92	0.1377

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2005年4月5日)基金份额总额	545,863,991.51
本报告期期初基金份额总额	63,329,606.24
本报告期基金总申购份额	1,186,979.75
减：本报告期基金总赎回份额	3,210,628.63
本报告期基金拆分变动份额	-

本报告期末基金份额总额

61,305,957.36

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金无投资策略的变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人及其相关高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
开源证券	1	108,230,830.05	42.20	102,359.19	42.19	-
信达证券	1	85,787,290.79	33.45	81,148.24	33.45	-
华泰证券	1	45,252,702.61	17.64	42,804.29	17.64	-
招商证券	1	8,754,276.36	3.41	8,280.75	3.41	-

中金公司	1	8,453,569.40	3.30	7,995.94	3.30	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
高盛证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-

注：（一）本基金本报告期新增天风证券交易单元。

（二）交易单元选择的标准和程序

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

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
开源证券	11,299,598.00	20.51	170,266,000.00	48.92	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	3,024,821.00	5.49	177,775,000.00	51.08	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
高盛证券	-	-	-	-	-	-

国盛证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
民生证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
西南证 券	-	-	-	-	-	-
湘财证 券	40,762,439. 00	74.00	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-

§ 11 备查文件目录

11.1 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。

11.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

11.3 查阅方式

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

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

宏利基金管理有限公司

2024 年 8 月 31 日