

宏利京元宝货币市场基金 2025 年年度报告

2025 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：北京银行股份有限公司

送出日期：2026 年 3 月 31 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。

基金托管人北京银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 3 月 27 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，容诚会计师事务所（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 2025 年 1 月 1 日起至 2025 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.....	13
§4 管理人报告	14
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	14
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	16
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	16
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.....	17
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	18
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	18
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	19
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.....	19
§5 托管人报告	19
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	19
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.....	19
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.....	19
§6 审计报告	19
6.1 审计报告基本信息.....	19
6.2 审计报告的基本内容.....	19
§7 年度财务报表	21
7.1 资产负债表.....	21
7.2 利润表.....	23
7.3 净资产变动表.....	24
7.4 报表附注.....	26
§8 投资组合报告	53
8.1 期末基金资产组合情况.....	53
8.2 债券回购融资情况.....	53

8.3 基金投资组合平均剩余期限.....	54
8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明	54
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54
8.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细	55
8.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离	55
8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细	56
8.9 投资组合报告附注.....	56
§9 基金份额持有人信息.....	57
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	57
9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	57
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	58
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	58
9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况.....	58
§10 开放式基金份额变动.....	58
§11 重大事件揭示.....	59
11.1 基金份额持有人大会决议.....	59
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	59
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	59
11.4 基金投资策略的改变.....	59
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	59
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	59
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	60
11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	61
11.9 其他重大事件.....	61
§12 影响投资者决策的其他重要信息	62
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	62
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	63
§13 备查文件目录.....	63
13.1 备查文件目录.....	63
13.2 存放地点.....	63
13.3 查阅方式.....	63

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	宏利京元宝货币市场基金			
基金简称	宏利京元宝货币			
基金主代码	003711			
基金运作方式	契约型开放式			
基金合同生效日	2016年11月23日			
基金管理人	宏利基金管理有限公司			
基金托管人	北京银行股份有限公司			
报告期末基金份额总额	4,024,159,188.02份			
基金合同存续期	不定期			
下属分级基金的基金简称	宏利京元宝货币 A	宏利京元宝货币 B	宏利京元宝货币 E	宏利京元宝货币 F
下属分级基金的交易代码	003711	003712	021118	024581
报告期末下属分级基金的份额总额	101,211,093.99份	3,888,686,623.68份	34,260,238.06份	1,232.29份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险，保持流动性的前提下，力争为基金份额持有人创造稳定的、高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金将在深入研究国内外的宏观经济走势、货币政策变化趋势、市场资金供求状况的基础上，分析和判断利率走势与收益率曲线变化趋势，并综合考虑各类投资品种的收益性、流动性和风险特征，对基金资产组合进行积极管理。
业绩比较基准	同期七天通知存款税后利率。
风险收益特征	本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的长期风险和收益率低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。

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	北京银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	徐娇
	联系电话	66577766
	电子邮箱	irm@manulifefund.com.cn
客户服务电话	400-698-8888	95526
传真	010-66577666	010-89661115
注册地址	北京市朝阳区针织路23号楼中国人寿金融中心6层02-07单元	北京市西城区金融大街甲17号首层
办公地址	北京市朝阳区针织路23号楼中国人寿金融中心6层02-07单元	北京市西城区金融大街丙17号
邮政编码	100026	100033

法定代表人	DING WEN CONG (丁闻聪)	霍学文
-------	---------------------	-----

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	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	容诚会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢 10 层 1001-1 至 1001-26
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	2025 年				2024 年				2023 年			
	2025 年 6 月 16 日(基金合同生效日)-2025 年 12 月 31 日	2024 年 3 月 28 日(基金合同生效日)-2024 年 12 月 31 日	2024 年 3 月 28 日(基金合同生效日)-2024 年 12 月 31 日	2023 年 12 月 31 日	2024 年 3 月 28 日(基金合同生效日)-2024 年 12 月 31 日	2024 年 3 月 28 日(基金合同生效日)-2024 年 12 月 31 日	2024 年 3 月 28 日(基金合同生效日)-2024 年 12 月 31 日	2023 年 12 月 31 日	2024 年 3 月 28 日(基金合同生效日)-2024 年 12 月 31 日	2024 年 3 月 28 日(基金合同生效日)-2024 年 12 月 31 日	2024 年 3 月 28 日(基金合同生效日)-2024 年 12 月 31 日	2023 年 12 月 31 日
	宏利京元宝货币 A	宏利京元宝货币 B	宏利京元宝货币 E	宏利京元宝货币 F	宏利京元宝货币 A	宏利京元宝货币 B	宏利京元宝货币 E	宏利京元宝货币 F	宏利京元宝货币 A	宏利京元宝货币 B	宏利京元宝货币 E	宏利京元宝货币 F
本期已实现收益	1,337,253.83	23,390,403.96	24,555,700.70	373.26	1,046,501.11	69,585,378.38	834.58	-	1,186,147.14	170,811,722.23	-	-
本期利润	1,337,253.83	23,390,403.96	24,555,700.70	373.26	1,046,501.11	69,585,378.38	834.58	-	1,186,147.14	170,811,722.23	-	-
本期净值收益率	1.2043%	1.4478%	1.4557%	0.7150%	1.6684%	1.9125%	1.3687%	-	1.9266%	2.1715%	-	-
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末				2024 年末				2023 年末			

期末基金资产净值	101,211,093.99	3,888,686.62	34,260,238.06	1,232,299	95,754,392.49	2,310,181.88	5,071.61		58,101,771.80	4,272,281.01		
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000		1.0000	1.0000		
3.1.3 累计期末指标	2025 年末				2024 年末				2023 年末			
累计净值收益率	23.8358%	26.5750%	2.8443%	0.7150%	22.3621%	24.7687%	1.3687%		20.3541%	22.4273%		

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。由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

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

3. 本基金收益分配按日结转份额。

4. 根据宏利基金管理有限公司 2024 年 3 月 28 日发布的《关于宏利京元宝货币市场基金增加 E 类基金份额并相应修订基金合同等法律文件的公告》，本基金于 2024 年 3 月 28 日起增加收取销售服务费的 E 类基金份额，已有的 A 类和 B 类基金份额业务规则保持不变，并对本基金基金合同作相应修改。

5. 根据宏利基金管理有限公司 2025 年 6 月 14 日发布的《关于宏利京元宝货币市场基金增加 F 类基金份额并相应修订基金合同等法律文件的公告》，本基金于 2025 年 6 月 16 日起增加收取销售服务费的 F 类基金份额，已有的 A 类、B 类、E 类基金份额业务规则保持不变，并对本基金基金合同作相应修改。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

宏利京元宝货币 A

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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	0.2744%	0.0002%	0.3403%	0.0000%	-0.0659%	0.0002%

过去六个月	0.5350%	0.0004%	0.6805%	0.0000%	-0.145 5%	0.0004 %
过去一年	1.2043%	0.0007%	1.3500%	0.0000%	-0.145 7%	0.0007 %
过去三年	4.8752%	0.0012%	4.0537%	0.0000%	0.8215 %	0.0012 %
过去五年	9.2026%	0.0012%	6.7537%	0.0000%	2.4489 %	0.0012 %
自基金合同生效起 至今	23.8358 %	0.0026%	12.3016%	0.0000%	11.534 2%	0.0026 %

宏利京元宝货币 B

阶段	份额净 值收益 率①	份额净值 收益率标 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	0.3351%	0.0002%	0.3403%	0.0000%	-0.005 2%	0.0002 %
过去六个月	0.6569%	0.0004%	0.6805%	0.0000%	-0.023 6%	0.0004 %
过去一年	1.4478%	0.0007%	1.3500%	0.0000%	0.0978 %	0.0007 %
过去三年	5.6330%	0.0012%	4.0537%	0.0000%	1.5793 %	0.0012 %
过去五年	10.5211 %	0.0012%	6.7537%	0.0000%	3.7674 %	0.0012 %
自基金合同生效起 至今	26.5750 %	0.0026%	12.3016%	0.0000%	14.273 4%	0.0026 %

宏利京元宝货币 E

阶段	份额净 值收益	份额净值 收益率标	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准 收益率标准 差	①—③	②—④
----	------------	--------------	----------------	----------------------	-----	-----

	率①	准差②		④		
过去三个月	0.3364%	0.0002%	0.3403%	0.0000%	-0.0039%	0.0002%
过去六个月	0.6611%	0.0004%	0.6805%	0.0000%	-0.0194%	0.0004%
过去一年	1.4557%	0.0007%	1.3500%	0.0000%	0.1057%	0.0007%
自基金合同生效起至今	2.8443%	0.0009%	2.3819%	0.0000%	0.4624%	0.0009%

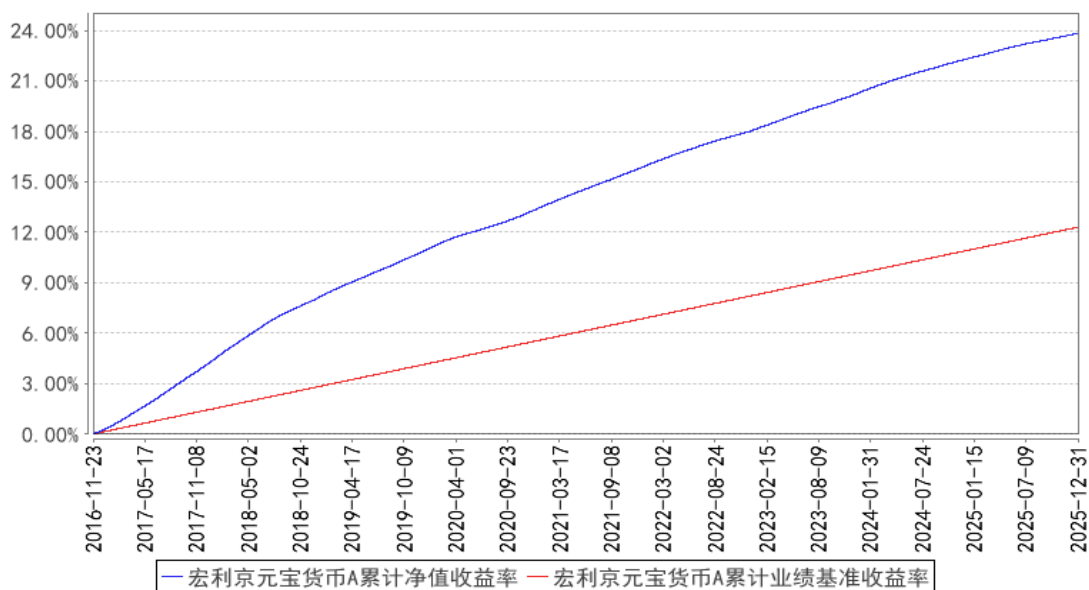
宏利京元宝货币 F

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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	0.3359%	0.0003%	0.3403%	0.0000%	-0.0044%	0.0003%
过去六个月	0.6512%	0.0005%	0.6805%	0.0000%	-0.0293%	0.0005%
自基金合同生效起至今	0.7150%	0.0008%	0.7360%	0.0000%	-0.0210%	0.0008%

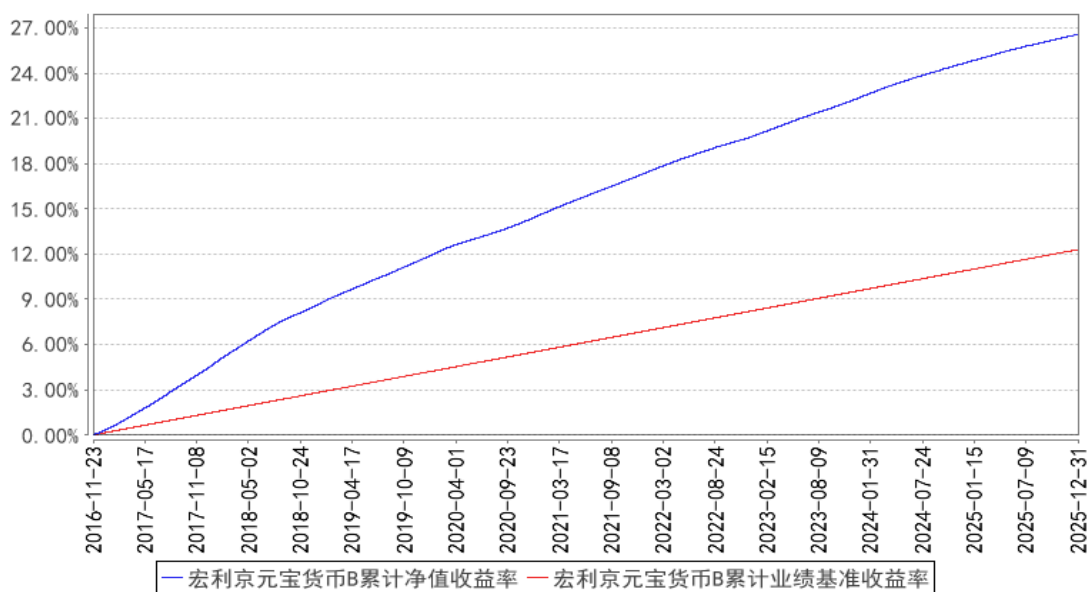
注：本基金的业绩比较基准：同期七天通知存款利率（税后）。

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

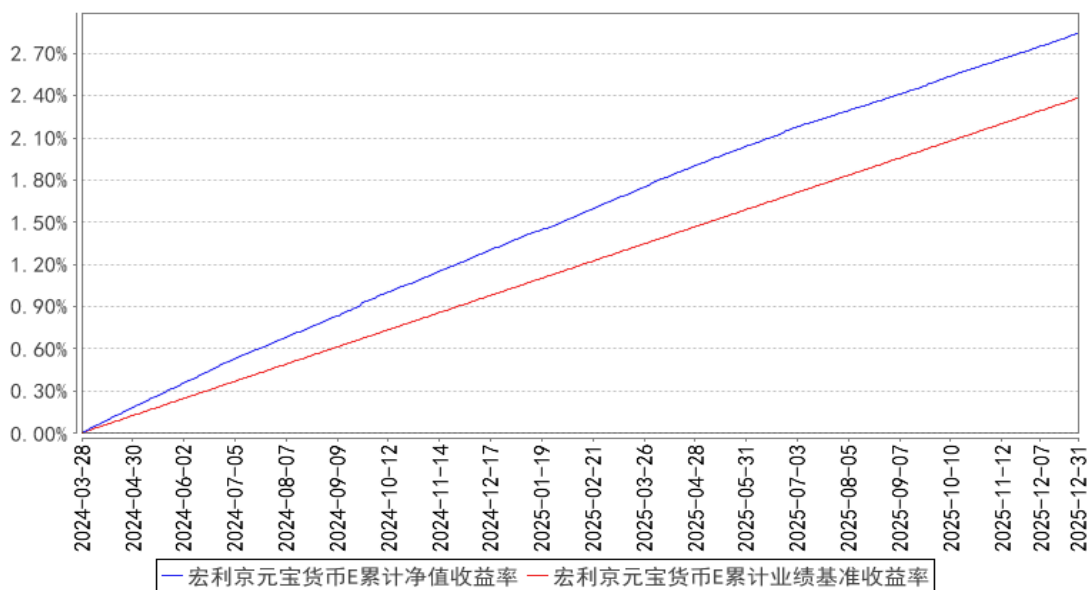
宏利京元宝货币A累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



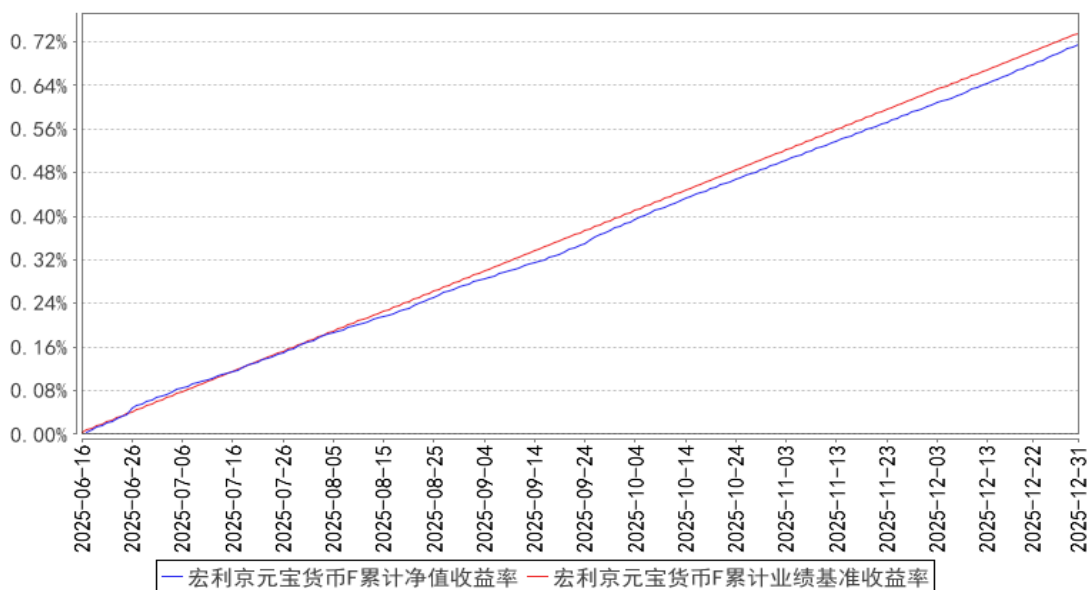
宏利京元宝货币B累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



宏利京元宝货币E累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

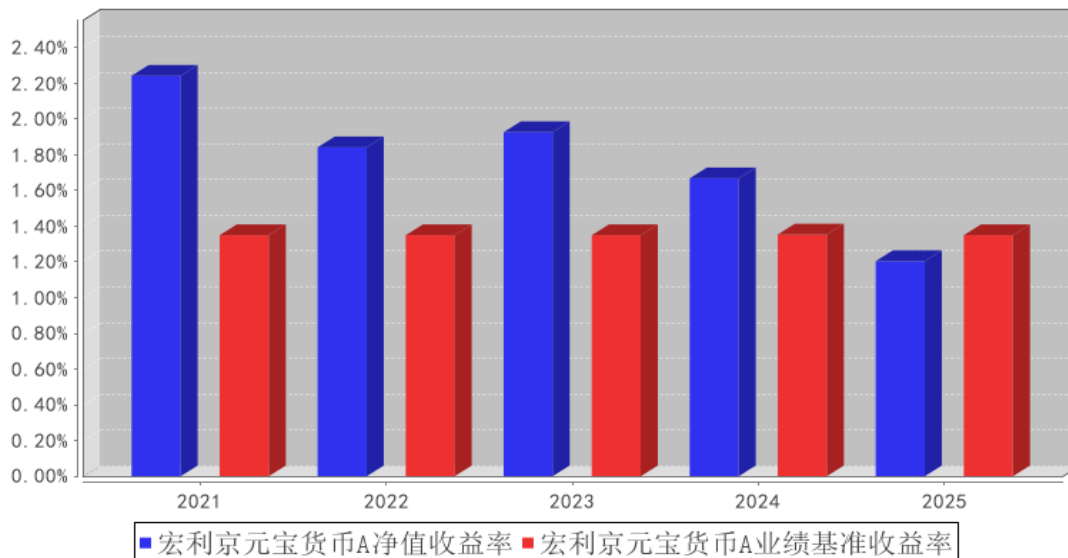


宏利京元宝货币F累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

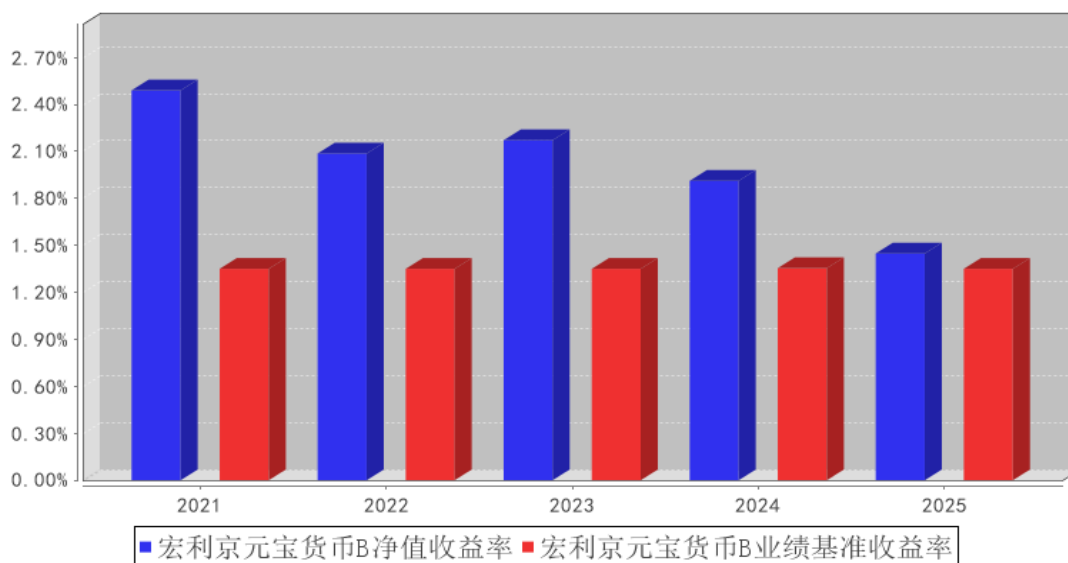


3.2.3 过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

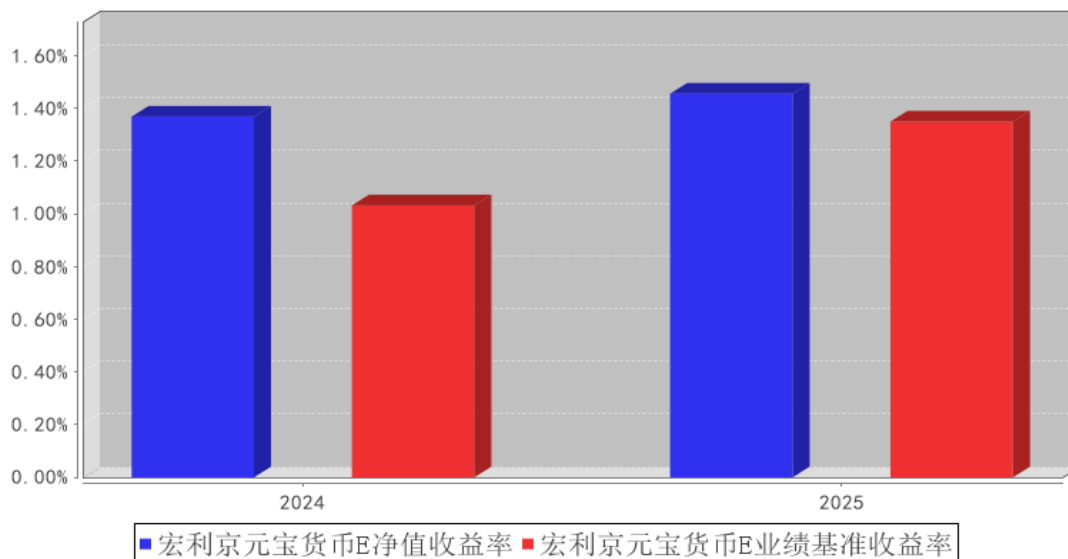
宏利京元宝货币A基金每年净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比如



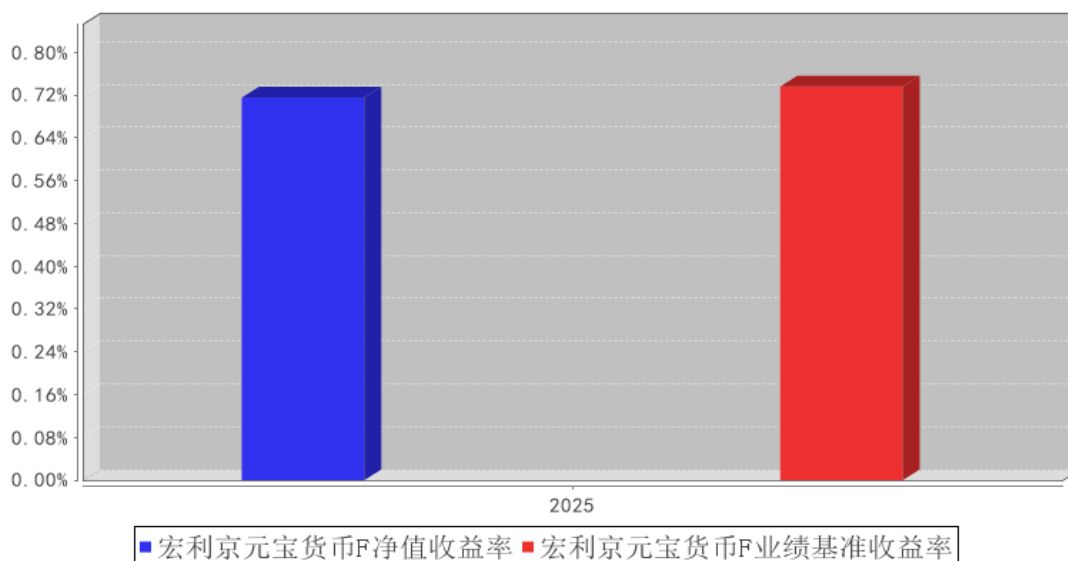
宏利京元宝货币B基金每年净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比如



宏利京元宝货币E基金每年净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



宏利京元宝货币F基金每年净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金自 2024 年 3 月 28 日增设 E 类基金份额类别，自 2025 年 6 月 16 日增设 F 类基金份额类别，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算，不按整个自然年度折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

宏利京元宝货币 A

年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	年度利润 分配合计	备注
2025 年	1,337,641.99	-	-388.16	1,337,253.83	-
2024 年	1,056,224.26	-	-9,723.15	1,046,501.11	-
2023 年	1,180,610.79	-	5,536.35	1,186,147.14	-

合计	3,574,477.04	-	-4,574.96	3,569,902.08	-
----	--------------	---	-----------	--------------	---

宏利京元宝货币 B

年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	年度利润 分配合计	备注
2025 年	23,340,164.14	-	50,239.82	23,390,403.96	-
2024 年	70,558,850.84	-	-973,472.46	69,585,378.38	-
2023 年	171,166,297.82	-	-354,575.59	170,811,722.23	-
合计	265,065,312.80	-	-1,277,808.23	263,787,504.57	-

宏利京元宝货币 E

年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	年度利润 分配合计	备注
2025 年	23,163.15	-	1,392.55	24,555.70	-
2024 年	834.34	-	0.24	834.58	-
合计	23,997.49	-	1,392.79	25,390.28	-

宏利京元宝货币 F

年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	年度利润 分配合计	备注
2025 年	373.21	-	0.05	373.26	-
合计	373.21	-	0.05	373.26	-

注：宏利京元宝货币市场基金 E 类成立于 2024 年 3 月 28 日，宏利京元宝货币市场基金 F 类成立于 2025 年 6 月 16 日。

§ 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、宏利半导体产业混合型发起式证券投资基金、宏利鑫享 90 天持有期债券型证券投资基金、宏利价值驱动六个月持有期混合型证券投资基金、宏利高端装备股票型证券投资基金、宏利中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、宏利中证 A500 指数增强型证券投资基金、宏利悦利利率债债券型证券投资基金、宏利中证 A50 指数增强型证券投资基金、宏利睿智领航混合型证券投资基金、宏利悦享 30 天持有期债券型证券投资基金、宏利集享债券型证券投资基金、宏利嘉利债券型证券投资基金、宏利鼎森稳健 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、宏利盛享债券型证券投资基金、宏利优势企业混合型证券投资基金在内的七十多只证券投资基金。

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		
周丹娜	本基金基金经理	2022年9月5日	-	11年	法国里尔第二大学国际金融分析硕士研究生；2014年9月至今任职于宏利基金管理有限公司，曾先后担任交易部助理交易员、交易员、交易主管、交易部总经理助理、固定收益部研究员，现任固定收益部基金经理。具备11年基金从业经验，具有基金从业资格。
沈乔昶	本基金基金经理	2023年9月15日	-	8年	毕业于华东政法大学产业经济学专业，硕士研究生。自2017年7月至2022年12月任职于汇添富基金管理股份有限公司，担任投资研究总部债券交易员；自2022年12月起任职于宏利基金管理有限公司，曾任固定收益部基金经理助理，现任固定收益部基金经理。具备8年基金从业经验，具有基金从业资格。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人建立了公平交易制度和内部控制流程，严格执行相关制度规定。在投资管理活动中，公平对待不同投资组合，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和投资决策方面享有平等机会；在交易环节实行集中交易制度，交易部运用交易系统内的公平交易功能并按照时间优先、价格优先的原则严格执行所有指令，确保公平交易可操作、可评估、可稽核、可持续；对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以基金管理人名义进行的交易，交易部按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配，确保各投资组合享有公平的投资机会。

基金管理人的风险控制与基金评估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、不同时间窗口下（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，并向管理层报告。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

基金管理人的风险控制与基金评估部事后从交易指令的公平性、同日反向交易、不同时间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，无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，风险控制与基金评估部定期对各投资组合的交易行为进行分析评估。

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

4.4 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

本基金报告期内，在市场及监管政策的变化中，灵活调整组合中各类资产的比例和组合剩余期限。根据组合负债端特点，紧跟时点节奏，以同业存单、银行间逆回购为主要配置资产，保持了较好的流动性，为投资者提供了相对稳定的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期宏利京元宝货币 A 的基金份额净值收益率为 1.2043%，本报告期宏利京元宝货币 B 的基金份额净值收益率为 1.4478%，本报告期宏利京元宝货币 E 的基金份额净值收益率为 1.4557%，同期业绩基准收益率为 1.3500%；本报告期宏利京元宝货币 F 的基金份额净值收益率为 0.7150%，同期业绩基准收益率为 0.7360%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2025 年，中国经济实现稳健增长，顺利达成 5% 的年度增长目标：受政策靠前发力、促消费政策退坡、关税冲击等影响，GDP 增速“前高后低”。生产端韧性凸显，工业增加值增速稳中有进，呈现“二产降、三产升”的结构优化格局；外需在关税反复博弈中，“抢出口”及贸易多元化发展助力出口增速保持高位，内需短政策退坡，消费降速，仍显不足；价格方面，CPI 趋近于零，PPI

连续负增，不及年初通胀预期。货币政策保持适度宽松基调，先后通过利率传导优化、逆周期调节强化、工具协同创新、国债买卖重启的组合拳，以“逆周期调节”为目标，操作向精细化、精准化升级。财政政策扩张力度显著增强，支出呈现“靠前发力、投资于人、实物偏慢”的特征。2025 年，债券市场结束了连续两年的快速下行进入低位震荡：开年收益率即处在全年低点，尽管 4 月初的关税扰动对债市形成阶段性支撑，但下半年伴随股债比价修复、基金监管扰动，债市迎来逐步调整行情，至年末调整有所加剧。全年受央行政策调控、关税博弈、股债跷板三大主线驱动，收益率“N 型”走势运行。

展望 2026，货币政策将延续“适度宽松”基调，财政政策保持“积极扩张”的主线，政策与资源将进一步向高新技术产业集聚，为经济转型提供良好基础。在国内经济持续修复的基本面情况和海外复杂的国际形势下，债券市场或仍将维持区间震荡行情。

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、研究、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。

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，并制定了相关工作制度。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。估值委员会成员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。报告期内相关基金估值政策由托管银行进行复核。

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。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供银行间同业市场交易的债券品种和交易所市场交易的债券品种的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供流通受限股票的折扣率数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金的利润分配方式为按日结转份额。根据相关法律法规及基金合同，本基金每日采用红利再投资的方式将各类基金份额的已实现收益全额分配给基金份额持有人。

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

无。

§ 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，本基金托管人在托管宏利京元宝货币市场基金过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

在本报告期内，本基金托管人按照相关法律法规、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本基金托管人复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容，复核内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	容诚审字[2026]200Z1878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	宏利京元宝货币市场基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了宏利京元宝货币市场基金（以下简称“宏利京元宝货币基金”）财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负

	<p>债表，2025 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</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，公允反映了宏利京元宝货币基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 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。按照中国注册会计师职业道德守则和中国注册会计师独立性准则，我们独立于宏利京元宝货币基金，并遵守了独立性准则中适用于公众利益实体财务报表审计的规定，同时履行了职业道德方面的其他责任。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>
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>宏利京元宝货币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京元宝货币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京元宝货币基金、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京元宝货币基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）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，</p>

	<p>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>(2) 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>(3) 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>(4) 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，就可能对宏利京元宝货币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京元宝货币基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	容诚会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	曹阳 姜爱悦
会计师事务所的地址	北京市西城区阜成门外大街22号1幢10层1001-1至1001-26
审计报告日期	2026年3月27日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：宏利京元宝货币市场基金

报告截止日：2025年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	113,000,795.84	279,502,606.06
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	2,480,939,036.32	1,216,735,388.87
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		2,480,939,036.32	1,216,735,388.87
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	1,429,376,443.43	899,349,461.11
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		1,574,020.36	11,209,080.69
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		4,024,890,295.95	2,406,796,536.73
负债和净资产	附注号	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024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		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		212,935.74	322,291.99
应付托管费		70,978.61	107,430.68
应付销售服务费		34,539.91	39,061.06
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,166.93	-
应付利润		162,893.98	111,649.72
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	248,592.76	274,752.36
负债合计		731,107.93	855,185.81
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	4,024,159,188.02	2,405,941,350.92
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	-	-
净资产合计		4,024,159,188.02	2,405,941,350.92
负债和净资产总计		4,024,890,295.95	2,406,796,536.73

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额总额 4,024,159,188.02 份，其中宏利京元宝货币 A 基金份额总额 101,211,093.99 份，基金份额净值 1.0000 元；宏利京元宝货币 B 基金份额总额 3,888,686,623.68 份，基金份额净值 1.0000 元；宏利京元宝货币 E 基金份额总额 34,260,238.06

份,基金份额净值 1.0000 元;宏利京元宝货币 F 基金份额总额 1,232.29 份,基金份额净值 1.0000 元。

7.2 利润表

会计主体:宏利京元宝货币市场基金

本报告期:2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
一、营业总收入		29,147,137.87	80,307,551.44
1. 利息收入		11,619,334.17	48,800,202.45
其中:存款利息收入	7.4.7.13	1,521,874.38	24,943,448.51
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		10,097,459.79	23,856,753.94
其他利息收入		-	-
2. 投资收益(损失以“-”填列)		17,527,803.70	31,507,348.99
其中:股票投资收益	7.4.7.14	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	17,527,803.70	31,507,348.99
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	-	-
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	-	-
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	-	-
减:二、营业总支出		4,394,551.12	9,674,837.37
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,534,858.34	5,499,529.64
其中:暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	844,952.71	1,833,176.55

3. 销售服务费	7.4.10.2.3	436,716.68	518,822.78
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		291,184.66	1,506,357.48
其中：卖出回购金融资产支出		291,184.66	1,506,357.48
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		1,973.30	7,979.41
8. 其他费用	7.4.7.23	284,865.43	308,971.51
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		24,752,586.75	70,632,714.07
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		24,752,586.75	70,632,714.07
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		24,752,586.75	70,632,714.07

7.3 净资产变动表

会计主体：宏利京元宝货币市场基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	2,405,941,350.92	-	-	2,405,941,350.92
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	2,405,941,350.92	-	-	2,405,941,350.92
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,618,217,837.10	-	-	1,618,217,837.10
（一）、综合收益总额	-	-	24,752,586.75	24,752,586.75
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减	1,618,217,837.10	-	-	1,618,217,837.10

少以“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	28,638,215,985.44	-	-	28,638,215,985.44
2. 基金赎回款	-27,019,998,148.34	-	-	-27,019,998,148.34
(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)	-	-	-24,752,586.75	-24,752,586.75
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	4,024,159,188.02	-	-	4,024,159,188.02
项目	上年度可比期间 2024年1月1日至2024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	4,330,382,789.93	-	-	4,330,382,789.93
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	4,330,382,789.93	-	-	4,330,382,789.93
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-1,924,441,439.01	-	-	-1,924,441,439.01
(一)、综合收益总额	-	-	70,632,714.07	70,632,714.07
(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)	-1,924,441,439.01	-	-	-1,924,441,439.01
其中：1. 基金申购款	15,541,161,498.52	-	-	15,541,161,498.52

2. 基金赎回款	-17,465,602,937.53	-	-	-17,465,602,937.53
(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)	-	-	-70,632,714.07	-70,632,714.07
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	2,405,941,350.92	-	-	2,405,941,350.92

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：

DING WEN CONG (丁闻聪)

唐华

王泉

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

宏利京元宝货币市场基金(原名为泰达宏利京元宝货币市场基金,以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]2141号《关于准予泰达宏利京元宝货币市场基金注册的批复》注册,由宏利基金管理有限公司(原泰达宏利基金管理有限公司,已于2023年4月20日办理完成工商变更登记)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利京元宝货币市场基金基金合同》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人民币200,652,912.54元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第1505号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰达宏利京元宝货币市场基金基金合同》于2016年11月23日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为200,689,255.57份基金份额,其中认购资金利息折合36,343.03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,基金托管人为北京银行股份有限公司(以下简称“北京银行”)。

根据本基金的基金管理人2023年6月17日发布的《宏利基金管理有限公司关于旗下基金更名事宜的公告》,本基金自2023年6月20日起更名为宏利京元宝货币市场基金。

根据《关于宏利京元宝货币市场基金增加 E 类基金份额并相应修订基金合同等法律文件的公告》并报中国证监会备案，本基金自 2024 年 3 月 28 日起，增设 E 类基金份额。根据《关于宏利京元宝货币市场基金增加 F 类基金份额并相应修订基金合同等法律文件的公告》并报中国证监会备案，本基金自 2025 年 6 月 16 日起，增设 F 类基金份额。本基金分设四类基金份额 A 类、B 类、E 类和 F 类，不同类别的基金份额适用不同费率的销售服务费。四类基金份额分设不同的基金代码，并分别公布每万份基金已实现收益和 7 日年化收益率。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《宏利京元宝货币市场基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金，期限在 1 年以内（含 1 年）的银行存款、债券回购、中央银行票据和同业存单，剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券，以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。本基金的业绩比较基准为：同期七天通知存款税后利率。

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》、《宏利京元宝货币市场基金基金合同》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 2025 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 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 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或金融负债。

(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

本基金持有的金融资产主要为债务工具，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和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

(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。对于取得债券投资或资产支持证券投资支付的价款中包含的债券或资产支持证券投资起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在债券投资或资产支持证券投资的账面价值中。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资和资产支持证券投资按票面利率（对于贴现债为按发行价计算的利率）或合同利率每日计提应计利息，同时在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一计价日计算影子价格，以避免债券投资和资产支持证券投资的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生

重大偏离。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

为了避免投资组合的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离，从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果，基金管理人于每一计价日采用投资组合的公允价值计算影子价格。当影子价格确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的偏离度绝对值达到或超过 0.25%时，基金管理人应根据相关法律法规采取相应措施，使基金资产净值更能公允地反映基金投资组合价值。

计算影子价格时按如下原则确定债券投资和资产支持证券投资的公允价值：

(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。每份基金份额面值为 1.00 元。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列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 收入/(损失)的确认和计量

债券投资和资产支持证券投资在持有期间按实际利率计算确定的金额扣除在适用情况下由债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。

债券投资和资产支持证券投资处置时其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

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。

7.4.4.9 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务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。

7.4.4.10 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。申购的基金份额享有确认当日的分红权益,而赎回的基金份额不享有确认当日的分红权益。本基金以份额面值 1.00 元固定份额净值交易方式,每日计算当日收益并全部分配结转至应付收益科目,于下一工作日以红利再投资方式集中支付累计收益。

7.4.4.11 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。

7.4.4.12 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，本基金计算影子价格过程中确定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：

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。

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[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》、财政部、国家税务总局公告2025年第4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》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债券的转让收入免征增值税，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，免征增值税直至债券到期。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，包括买卖债券的差价收入，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。

(4) 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 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
活期存款	113,000,795.84	28,474,660.75
等于：本金	112,978,764.66	28,235,783.65
加：应计利息	22,031.18	238,877.10
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	251,027,945.31
等于：本金	-	250,000,000.00
加：应计利息	-	1,027,945.31
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	-	251,027,945.31
其他存款	-	-
等于：本金	-	-

加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	113,000,795.84	279,502,606.06

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025年12月31日			
		按实际利率计算的账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度(%)
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	2,480,939,036.32	2,481,128,341.38	189,305.06	0.0047
	合计	2,480,939,036.32	2,481,128,341.38	189,305.06	0.0047
资产支持证券		-	-	-	-
合计		2,480,939,036.32	2,481,128,341.38	189,305.06	0.0047
项目		上年度末 2024年12月31日			
		按实际利率计算的账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度(%)
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	1,216,735,388.87	1,217,281,919.41	546,530.54	0.0227
	合计	1,216,735,388.87	1,217,281,919.41	546,530.54	0.0227
资产支持证券		-	-	-	-
合计		1,216,735,388.87	1,217,281,919.41	546,530.54	0.0227

注：1. 偏离金额=影子定价-摊余成本；

2. 偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

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

无。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

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
----	-----

	2025 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	1,429,376,443.43	-
合计	1,429,376,443.43	-
项目	上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	899,349,461.11	-
合计	899,349,461.11	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

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

无。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

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

无。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.8 其他资产

无。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 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	39,592.76	55,752.36
其中：交易所市场	-	-
银行间市场	39,592.76	55,752.36
应付利息	-	-
预提费用	209,000.00	219,000.00
合计	248,592.76	274,752.36

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

宏利京元宝货币 A

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	95,754,392.49	95,754,392.49
本期申购	657,991,184.17	657,991,184.17
本期赎回（以“-”号填列）	-652,534,482.67	-652,534,482.67
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	101,211,093.99	101,211,093.99

宏利京元宝货币 B

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,310,181,886.82	2,310,181,886.82
本期申购	27,893,541,038.96	27,893,541,038.96
本期赎回（以“-”号填列）	-26,315,036,302.10	-26,315,036,302.10
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	3,888,686,623.68	3,888,686,623.68

宏利京元宝货币 E

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	5,071.61	5,071.61
本期申购	86,474,314.05	86,474,314.05
本期赎回(以“-”号填列)	-52,219,147.60	-52,219,147.60
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	34,260,238.06	34,260,238.06

宏利京元宝货币 F

项目	本期 2025年6月16日(基金合同生效日)至2025年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	209,448.26	209,448.26
本期赎回(以“-”号填列)	-208,215.97	-208,215.97
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	1,232.29	1,232.29

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

2. 根据本公司 2025 年 6 月 14 日发布的《关于宏利京元宝货币市场基金增加 F 类基金份额并相应修订基金合同等法律文件的公告》，本基金于 2025 年 6 月 16 日起增加 F 类基金份额，并对本基金基金合同作相应修改。

7.4.7.11 其他综合收益

无。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

宏利京元宝货币 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	1,337,253.83	-	1,337,253.83
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-

本期已分配利润	-1,337,253.83	-	-1,337,253.83
本期末	-	-	-

宏利京元宝货币 B

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	23,390,403.96	-	23,390,403.96
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-23,390,403.96	-	-23,390,403.96
本期末	-	-	-

宏利京元宝货币 E

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	24,555.70	-	24,555.70
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-24,555.70	-	-24,555.70
本期末	-	-	-

宏利京元宝货币 F

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	373.26	-	373.26
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-373.26	-	-373.26

本期末	-	-	-
-----	---	---	---

注：宏利京元宝货币市场基金 F 类成立于 2025 年 6 月 16 日，详见《关于宏利京元宝货币市场基金增加 F 类基金份额并相应修订基金合同等法律文件的公告》。

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	173,500.20	1,741,216.37
定期存款利息收入	1,338,749.15	23,177,809.24
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	-	-
其他	9,625.03	24,422.90
合计	1,521,874.38	24,943,448.51

7.4.7.14 股票投资收益

无。

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	17,838,591.89	32,277,854.42
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-310,788.19	-770,505.43
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	17,527,803.70	31,507,348.99

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	8,643,001,844.85	8,899,442,683.08

减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	8,634,969,650.30	8,880,367,318.96
减：应计利息总额	8,342,982.74	19,845,869.55
减：交易费用	-	-
买卖债券差价收入	-310,788.19	-770,505.43

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

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

无。

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

无。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

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

无。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

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

无。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

7.4.7.19 股利收益

无。

7.4.7.20 公允价值变动收益

无。

7.4.7.21 其他收入

无。

7.4.7.22 信用减值损失

无。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
审计费用	80,000.00	90,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	47,665.43	61,096.51
账户维护费	36,000.00	36,000.00
其他	1,200.00	1,875.00
合计	284,865.43	308,971.51

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**

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

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
北京银行股份有限公司(北京银行)	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：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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

无。

7.4.10.1.2 债券交易

无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

7.4.10.1.4 权证交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

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 2025年1月1日至2025年12 月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,534,858.34	5,499,529.64
其中：应支付销售机构的客户维护费	433,469.58	461,815.98
应支付基金管理人的净管理费	2,101,388.76	5,037,713.66

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 0.15%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×0.15%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12 月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	844,952.71	1,833,176.55

注：支付基金托管人北京银行的托管费按前一日基金资产净值 0.05%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×0.05%/当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费 的各关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日				
	当期发生的基金应支付的销售服务费				
	宏利京元宝货 币 A	宏利京元宝货 币 B	宏利京元宝货 币 E	宏利京元宝货 币 F	合计
宏利基金管理有 限公司	4,712.29	81,486.77	0.29	2.91	86,202.26
北京银行	825.37	8,558.16	-	-	9,383.53
合计	5,537.66	90,044.93	0.29	2.91	95,585.79
获得销售服务费 的各关联方名称	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日				
	当期发生的基金应支付的销售服务费				
	宏利京元宝货 币 A	宏利京元宝货 币 B	宏利京元宝货 币 E	宏利京元宝货 币 F	合计
宏利基金管理有 限公司	4,864.27	275,806.76	-	-	280,671.03
北京银行	674.44	4,009.23	-	-	4,683.67
合计	5,538.71	279,815.99	-	-	285,354.70

注：1. 支付基金销售机构的销售服务费按前一日对应级别基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给宏利基金管理有限公司，再由宏利基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。A类基金份额、B类基金份额、E类基金份额和F类基金份额约定的销售服务费年费率分别为0.25%、0.01%、0.25%和0.25%。根据《关于宏利基金管理有限公司旗下部分基金开展销售服务费费率优惠活动的公告》，自2024年3月28日起，E类基金份额约定的销售服务费年费率为0.01%。根据《关于宏利基金管理有限公司旗下部分基金开展销售服务费费率优惠活动的公告》，自2025年6月16日起，F类基金份额约定的销售服务费年费率为0.01%。其计算公式为：
日A/B/E/F类基金份额销售服务费=前一日A/B/E/F类基金份额的基金资产净值×对应级别约定年费率/当年天数。

2. 宏利京元宝货币市场基金E类成立于2024年3月28日，详见《关于宏利京元宝货币市场基金增加E类基金份额并相应修订基金合同等法律文件的公告》。宏利京元宝货币市场基金F类成立于2025年6月16日，详见《关于宏利京元宝货币市场基金增加F类基金份额并相应修订基金合同等法律文件的公告》。

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

单位：人民币元

本期

2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
北京银行	49,960,860.27	-	-	-	253,800,000.00	10,540.08
上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
北京银行	99,621,963.47	-	-	-	6,633,985,000.00	450,576.66

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

无。

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

无。

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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日			
	宏利京元宝货币 A	宏利京元宝货币 B	宏利京元宝货币 E	宏利京元宝货币 F
基金合同生效日 (2016 年 11 月 23 日)持有的基金份额	-	-	-	-
报告期初持有的基金份额	-	7,421.04	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	107.47	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-	-	-
报告期末持有的基金份额	-	7,528.51	-	-

报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	0.0002%	-	-
项目	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日			上年度可比期间 -
	宏利京元宝货币 A	宏利京元宝货币 B	宏利京元宝货币 E	宏利京元宝货币 F
基金合同生效日（2016年11月23日）持有的基金份额	-	-	-	-
报告期初持有的基金份额	-	0.00	-	-
报告期内申购/买入总份额	-	29,767,421.04	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	29,760,000.00	-	-
报告期末持有的基金份额	-	7,421.04	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	0.0003%	-	-

注：1. 期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额，期间赎回/卖出总份额含转换出份额；

2. 本基金管理人投资本基金时所适用的费率为本基金基金合同中约定的费率。

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

无。

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 2025年1月1日至2025年12月31日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024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
北京银行	113,000,795.84	173,500.20	28,474,660.75	1,741,216.37

注：本基金的活期银行存款由基金托管人北京银行保管，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

无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

宏利京元宝货币 A				
已按再投资形式转 实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分配合 计	备注
1,337,641.99	-	-388.16	1,337,253.83	-
宏利京元宝货币 B				
已按再投资形式转 实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分配合 计	备注
23,340,164.14	-	50,239.82	23,390,403.96	-
宏利京元宝货币 E				
已按再投资形式转 实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分配合 计	备注
23,163.15	-	1,392.55	24,555.70	-
宏利京元宝货币 F				
已按再投资形式转 实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分配合 计	备注
373.21	-	0.05	373.26	-

7.4.12 期末（2025 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

无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

本基金投资于各类货币市场工具，属于低风险合理稳定收益品种。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“低风险、高流动性和持续稳定收益”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，建立了董事会下设立专门委员会为核心的、由管理层、督察长、风险控制与基金评估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专门委员会，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；管理层可以设立履行风险管理职能的委员会，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控制与基金评估部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。

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

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行北京银行，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金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；在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，不投资于短期信用评级在 A-1 级以下或长期信用评级在 AA+级以下的债券，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。本基金投资于主体信用评级低于 AAA 的机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 10%，其中单一机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 2%。且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券不得超过该商业银行最近一个季度末的净资产的 10%。

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 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	110,618,907.02	60,175,783.85
合计	110,618,907.02	60,175,783.85

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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	2,267,934,043.36	1,056,372,607.31
合计	2,267,934,043.36	1,056,372,607.31

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 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	102,386,085.94	100,186,997.71
合计	102,386,085.94	100,186,997.71

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。此外，本基金还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，除发生巨额赎回、连续 3 个交易日累计赎回 20%以上或者连续 5 个交易日累计赎回 30%以上的情形外，债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%。

于 2025 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》、《货币市场基金监督管理办法》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，通过监控基金平均剩余期限、平均剩余存续期限、高流动资产占比、持仓集中度、投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)，并结合份额持有人集中度变化予以实现。

一般情况下，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天，平均剩余存续期限在每个交易日均不得超过 240 天，且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求；当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 20%时，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过 90 天，平均剩余存续期不得超过 180 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 20%；当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 50%时，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 60 天，平均剩余存续期在每个交易日均不得超过 120 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 30%。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的

基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司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货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的 10%。

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 10%。

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。

本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人每日通过“影子定价”对本基金面临的市场风险进行监控，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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	不计息	合计
资产					
货币资金	113,000,795.84	-	-	-	113,000,795.84
交易性金融资产	2,480,939,036.32	-	-	-	2,480,939,036.32
买入返售金融资产	1,429,376,443.43	-	-	-	1,429,376,443.43

应收申购款	-	-	-	1,574,020.36	1,574,020.36
资产总计	4,023,316,275.59	-	-	1,574,020.36	4,024,890,295.95
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	212,935.74	212,935.74
应付托管费	-	-	-	70,978.61	70,978.61
应付销售服务费	-	-	-	34,539.91	34,539.91
应付利润	-	-	-	162,893.98	162,893.98
应交税费	-	-	-	1,166.93	1,166.93
其他负债	-	-	-	248,592.76	248,592.76
负债总计	-	-	-	731,107.93	731,107.93
利率敏感度缺口	4,023,316,275.59	-	-	842,912.43	4,024,159,188.02
上年度末 2024年12月31日	6个月以内	6个月 -1年	1-5年	不计息	合计
资产					
货币资金	279,502,606.06	-	-	-	279,502,606.06
交易性金融资产	1,206,714,212.42	10,021,176.45	-	-	1,216,735,388.87
买入返售金融资产	899,349,461.11	-	-	-	899,349,461.11
应收申购款	-	-	-	11,209,080.69	11,209,080.69
资产总计	2,385,566,279.59	10,021,176.45	-	11,209,080.69	2,406,796,536.73
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	322,291.99	322,291.99
应付托管费	-	-	-	107,430.68	107,430.68
应付销售服务费	-	-	-	39,061.06	39,061.06
应付利润	-	-	-	111,649.72	111,649.72
其他负债	-	-	-	274,752.36	274,752.36
负债总计	-	-	-	855,185.81	855,185.81
利率敏感度缺口	2,385,566,279.59	10,021,176.45	-	10,353,894.88	2,405,941,350.92

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

于2025年12月31日，在影子定价机制有效的前提下，若市场利率变动25个基点且其他市场变量保持不变，本基金净资产将不会产生重大变动(2024年12月31日：同)。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。

本基金主要投资于定期存款和银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

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 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
第一层次	-	-
第二层次	2,480,939,036.32	1,216,735,388.87
第三层次	-	-
合计	2,480,939,036.32	1,216,735,388.87

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。

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

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

无。

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 2025 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(2024 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	固定收益投资	2,480,939,036.32	61.64
	其中：债券	2,480,939,036.32	61.64
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,429,376,443.43	35.51
	其中：买断式回购的 买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备 付金合计	113,000,795.84	2.81
4	其他各项资产	1,574,020.36	0.04
5	合计	4,024,890,295.95	100.00

8.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	1.20	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的说明

本基金本报告期末未出现债券正回购的资金余额超过基金资产净值 20%的情况。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	17
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	53
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	14

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余期限未出现超过 120 天的情况。

8.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值比例 (%)	各期限负债占基金资产净值比例 (%)
1	30 天以内	86.51	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	2.23	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	11.16	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	99.90	-

8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本基金本报告期内未出现投资组合平均剩余存续期超过 240 天的情况。

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	按实际利率计算的账面价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	102,386,085.94	2.54
	其中：政策性金融债	102,386,085.94	2.54
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	110,618,907.02	2.75

6	中期票据	-	-
7	同业存单	2,267,934,043.36	56.36
8	其他	-	-
9	合计	2,480,939,036.32	61.65
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

8.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	按实际利率计算的账面价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	112502003	25 工商银行 CD003	2,000,000	199,938,334.09	4.97
2	112508314	25 中信银行 CD314	2,000,000	199,893,446.67	4.97
3	112502002	25 工商银行 CD002	1,000,000	99,973,514.43	2.48
4	112506002	25 交通银行 CD002	1,000,000	99,973,504.07	2.48
5	112594501	25 杭州银行 CD058	1,000,000	99,973,080.69	2.48
6	112509003	25 浦发银行 CD003	1,000,000	99,969,133.82	2.48
7	112594580	25 广州农村商业银行 CD039	1,000,000	99,968,772.68	2.48
8	112505009	25 建设银行 CD009	1,000,000	99,964,679.67	2.48
9	112518250	25 华夏银行 CD250	1,000,000	99,946,723.34	2.48
10	112506013	25 交通银行 CD013	1,000,000	99,942,251.32	2.48

8.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25 (含) -0.5% 间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0260%
报告期内偏离度的最低值	-0.0157%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0105%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25% 情况说明

本基金本报告期内未出现负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本基金本报告期内未出现正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 基金计价方法说明

本基金采用摊余成本法计价，即计价对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率每日计提利息，并考虑其买入时的溢价与折价在其剩余期限内平均摊销。本基金通过每日分红使基金份额净值维持在 1.0000 元。

8.9.2 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，上海浦东发展银行股份有限公司于 2025 年 10 月 29 日曾受到国家外汇管理局上海市分局公开处罚，于 2025 年 10 月 31 日、2025 年 12 月 19 日曾受到国家金融监督管理总局公开处罚。中国工商银行股份有限公司于 2025 年 12 月 10 日曾受到央行公开处罚，于 2025 年 12 月 18 日曾受到国家外汇管理局北京市分局公开处罚。华夏银行股份有限公司于 2025 年 11 月 26 日曾受到央行公开处罚，于 2025 年 9 月 5 日曾受到国家金融监督管理总局公开处罚。中信银行股份有限公司于 2025 年 9 月 22 日曾受到央行公开处罚，于 2025 年 9 月 12 日曾受到国家金融监督管理总局公开处罚。中国建设银行股份有限公司于 2025 年 3 月 27 日曾受到央行公开处罚，于 2025 年 9 月 12 日曾受到国家金融监督管理总局公开处罚。交通银行股份有限公司于 2025 年 12 月 10 日曾受到央行公开处罚。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。

8.9.3 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	-
2	应收清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	1,574,020.36
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-

7	其他	-
8	合计	1,574,020.36

8.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

1. 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。
2. 报告期内没有需说明的证券投资决策程序。

§ 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

份额级别	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 (%)
宏利京元宝货币 A	32,182	3,144.96	43,416,189.44	42.90	57,794,904.55	57.10
宏利京元宝货币 B	3,182	1,222,088.82	3,642,298,410.95	93.66	246,388,212.73	6.34
宏利京元宝货币 E	4,527	7,567.98	0.00	0.00	34,260,238.06	100.00
宏利京元宝货币 F	2	616.14	0.00	0.00	1,232.29	100.00
合计	39,893	100,873.82	3,685,714,600.39	91.59	338,444,587.63	8.41

注：1、分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）；

- 2、截止本报告期末，本基金机构投资者占比较高，请投资者关注相关风险。

9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
1	保险类机构	310,269,040.93	7.71
2	银行类机构	300,375,646.49	7.46
3	其他机构	200,048,627.17	4.97
4	券商类机构	200,040,613.46	4.97
5	券商类机构	200,008,201.68	4.97
6	其他机构	150,183,679.40	3.73
7	保险类机构	150,030,460.10	3.73
8	其他机构	120,024,368.08	2.98
9	银行类机构	100,046,932.60	2.49

10	保险类机构	100,024,313.59	2.49
----	-------	----------------	------

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	宏利京元宝货币 A	24,260.61	0.0240
	宏利京元宝货币 B	51,106.43	0.0013
	宏利京元宝货币 E	5,143.14	0.0150
	宏利京元宝货币 F	1,007.40	81.7502
	合计	81,517.58	0.0020

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

报告期末，本公司高级管理人员、本基金基金经理、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。

9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

无。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	宏利京元宝货币 A	宏利京元宝货币 B	宏利京元宝货币 E	宏利京元宝货币 F
基金合同生效日（2016年11月23日）基金份额总额	91,130,773.05	109,558,482.52	-	-
本报告期期初基金份额总额	95,754,392.49	2,310,181,886.82	5,071.61	-
本报告期基金总申购份额	657,991,184.17	27,893,541,038.96	86,474,314.05	209,448.26
减：本报告期基金总赎回份额	652,534,482.67	26,315,036,302.10	52,219,147.60	208,215.97
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-	-
本报告期末基金	101,211,093.99	3,888,686,623.68	34,260,238.06	1,232.29

份额总额				
------	--	--	--	--

注：宏利京元宝货币市场基金 F 类成立于 2025 年 6 月 16 日，详见《关于宏利京元宝货币市场基金增加 F 类基金份额并相应修订基金合同等法律文件的公告》。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未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、基金管理人于 2025 年 3 月 8 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》，自 2025 年 3 月 7 日起公司首席信息官由高贵鑫先生变更为唐华先生。

2、基金管理人于 2025 年 11 月 1 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》，自 2025 年 11 月 1 日起公司副总理由宋扬先生变更为刘业伟先生。

3、报告期内，未发生基金托管人专门基金托管部门的重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期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，本年度支付给容诚会计师事务所(特殊普通合伙)审计费用为人民币 80,000.00 元，该审计机构对本基金提供审计服务的连续年限为 2 年。

11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

管理人受调查或处罚等情况 1	内容	
受到调查或处罚等措施的主体	宏利基金管理有限公司	
受到调查或处罚等措施的时间	2025 年 7 月 17 日	
采取调查或处罚等措施的机构	国家外汇管理局北京市分局	
受到调查或处罚等措施类型	行政处罚	-
受到的具体措施类型	警告，罚款	
受到调查或处罚等措施的原因	其他问题	违反外汇登记管理规定
受到处罚的依据	《中华人民共和国外汇管理条例》(中华人民共和国国务院令 第 532 号)第四十八条第(五)项	
管理人采取整改措施的情况(如提出整改意见)	因股权转让前(2021 年)公司外汇登记证缺失，公司于 2025 年受外汇管理部门警告及罚款处罚(7 万元)。公司已于 2022	

	年完成外汇登记证补充办理，现已缴纳全部罚款完成整改，对公司业务及产品运作无实质影响。
其他	无

11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

报告期内，未发生托管人受调查或处罚等情况。

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，未发生托管人相关从业人员受调查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
国泰海通证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-

注：（一）本基金本报告期无交易单元变动。

（二）交易单元选择的标准和程序

1、选择标准

公司根据证监会相关法规，制定了公司券商交易服务及费用管理的相关制度。根据制度中规定：对于符合以下评选标准的券商，由公司交易部评估筛选后提交公司交易服务商管理小组批准后可纳入公司交易服务商备选池。

（1）基本情况：包括但不限于资本充足、近三年财务状况良好；主要股东经营稳健；具备高效、安全的通讯条件，能够提供有效交易执行服务。（2）公司治理：公司治理完善，经营行为规范，具备健全的内控制度，合规管理体系，风险管理稳健。（3）研究实力：有固定的研究机构和数量足够的专职研究团队；研究覆盖面广，能涵盖宏观经济、行业、公司等各项领域；研究报告分析严谨，观点独立、客观，并有完善的研究报告质量和合规保障机制。

2、选择程序

（1）公司建立了交易服务商管理小组作为公司交易服务商及交易费用管理的决策机构，负责对服务券商选择、服务评价、交易佣金分配及交易费用管理等相关事宜进行审议决定。（2）公司

新设基金的交易服务商从公司交易服务商备选池筛选后提交至公司交易服务商管理小组审批。(3) 公司和相关证券公司签订协议，并通知基金托管人。

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

本基金本报告期末租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期内未出现偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

11.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于宏利京元宝货币市场基金春节假期前暂停申购、转换转入业务的公告	《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站及公司网站	2025 年 01 月 22 日
2	宏利京元宝货币市场基金恢复申购（含转换转入、定期定额投资）并限制大额申购（大额转换转入）业务的公告	《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站及公司网站	2025 年 01 月 24 日
3	宏利京元宝货币市场基金调整大额申购、大额转换转入、大额定期定额投资业务的公告	《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站及公司网站	2025 年 02 月 18 日
4	宏利京元宝货币市场基金调整大额申购、大额转换转入、大额定期定额投资业务的公告	《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站及公司网站	2025 年 02 月 19 日
5	宏利京元宝货币市场基金调整大额申购、大额转换转入、大额定期定额投资业务的公告	《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站及公司网站	2025 年 02 月 20 日
6	宏利京元宝货币市场基金调整大额申购、大额转换转入、大额定期定额投资业务的公告	《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站及公司网站	2025 年 02 月 26 日
7	宏利京元宝货币市场基金调整大额申购、大额转换转入、大额定期定额投资业务的公告	《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站及公司网站	2025 年 02 月 27 日
8	宏利京元宝货币市场基金调整大额申购、大额转换转入、大额定期定额投资业务的公告	《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站及公司网站	2025 年 03 月 01 日
9	宏利基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站及公司网站	2025 年 3 月 8 日
10	关于宏利京元宝货币市场基金增加 F 类基金份额并相应修订基金合同等法律文件的公告	《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站及公司网站	2025 年 06 月 14 日
11		《证券时报》、中国证监会	2025 年 06 月 18 日

	关于宏利京元宝货币市场基金暂停通过部分销售机构的申购、定投及转换转入业务的公告	会基金电子披露网站及公司网站	
12	宏利京元宝货币市场基金调整非个人投资者大额申购（含转换转入）业务限额的公告	《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站及公司网站	2025 年 06 月 18 日
13	关于宏利京元宝货币市场基金恢复部分销售机构办理申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站及公司网站	2025 年 06 月 24 日
14	宏利京元宝货币市场基金调整非个人投资者大额申购（含转换转入）业务限额的公告	《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站及公司网站	2025 年 06 月 26 日
15	关于宏利京元宝货币市场基金恢复部分销售机构办理申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站及公司网站	2025 年 07 月 05 日
16	宏利基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站及公司网站	2025 年 11 月 01 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20250124~20250126, 20250716, 20250729~20250820, 20250828~20251222	305,839,447.02	4,429,593.91	-	310,269,040.93	7.7102
	2	20250124~20250126	235,885,722.08	101,399,489.08	337,285,211.16	-	0.0000
	3	20250624~20250701, 20250925~20251009	-	1,702,661,472.59	1,702,661,472.59	-	0.0000
	4	20250924	-	400,387,644.89	400,387,644.89	-	0.0000
	5	20250729~20250820	-	651,786,685.13	651,786,685.13	-	0.0000

产品特有风险

报告期内，本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额 20%的情况，易发生巨额赎回的情况，存在基金资产无法以合理价格及时变现以支付投资者赎回款的风险，以及基金份额净值出现大幅波动的风险。

注：报告期内，申购份额含红利再投资份额。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 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、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

2026 年 3 月 31 日