

# 宏利京元宝货币市场基金 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：北京银行股份有限公司

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。

基金托管人北京银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 08 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 01 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	14
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>15</b>
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 净资产变动表.....	17
6.4 报表附注.....	20
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>39</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 债券回购融资情况.....	39
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	40
7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明.....	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	41
7.6 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.....	41
7.7 “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.....	42
7.8 期末按实际利率计算的账面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.....	42
7.9 投资组合报告附注.....	42
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>43</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	43
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	43
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	44
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>44</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>45</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	45
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.....	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	45
10.4 基金投资策略的改变.....	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	45
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.....	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	45
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	46
10.9 其他重大事件.....	46
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>46</b>
11.1 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.....	46
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>47</b>
12.1 备查文件目录.....	47
12.2 存放地点.....	47
12.3 查阅方式.....	47

## § 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	4,994,083,435.69 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
下属分级基金的交易代码	003711	003712	021118
报告期末下属分级基金的份额总额	57,151,319.80 份	4,936,927,089.28 份	5,026.61 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	高贵鑫	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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="https://www.manulifefund.com.cn">https://www.manulifefund.com.cn</a>
基金中期报告备置地点	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
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)			2024年3月28日(基金合同生效日)-2024年6月30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	
本期已实现收益	555,335.51	44,076,515.42	25.34	
本期利润	555,335.51	44,076,515.42	25.34	
本期净值收益率	0.9254%	1.0460%	0.5066%	
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)			
期末基金资产净值	57,151,319.80	4,936,927,089.28	5,026.61	
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)			
累计净值收益率	21.4679%	23.7079%	0.5066%	

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 类收费模式，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。

### 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
过去一个月	0.1393%	0.0011%	0.1110%	0.0000%	0.0283%	0.0011%
过去三个月	0.4256%	0.0007%	0.3366%	0.0000%	0.0890%	0.0007%
过去六个月	0.9254%	0.0007%	0.6732%	0.0000%	0.2522%	0.0007%
过去一年	1.8730%	0.0008%	1.3537%	0.0000%	0.5193%	0.0008%
过去三年	5.9127%	0.0009%	4.0537%	0.0000%	1.8590%	0.0009%
自基金合同生效起至今	21.4679%	0.0025%	10.2711%	0.0000%	11.1968%	0.0025%

宏利京元宝货币 B

阶段	份额净	份额净值	业绩比较基	业绩比较基准	①—③	②—④
----	-----	------	-------	--------	-----	-----

	值收益 率①	收益率标 准差②	准收益率③	收益率标准 差④		
过去一个月	0.1590%	0.0011%	0.1110%	0.0000%	0.0480 %	0.0011 %
过去三个月	0.4856%	0.0007%	0.3366%	0.0000%	0.1490 %	0.0007 %
过去六个月	1.0460%	0.0007%	0.6732%	0.0000%	0.3728 %	0.0007 %
过去一年	2.1183%	0.0008%	1.3537%	0.0000%	0.7646 %	0.0008 %
过去三年	6.6785%	0.0009%	4.0537%	0.0000%	2.6248 %	0.0009 %
自基金合同生效起 至今	23.7079 %	0.0025%	10.2711%	0.0000%	13.436 8%	0.0025 %

## 宏利京元宝货币 E

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
过去一个月	0.1594%	0.0011%	0.1110%	0.0000%	0.0484 %	0.0011 %
过去三个月	0.4869%	0.0007%	0.3366%	0.0000%	0.1503 %	0.0007 %
自基金合同生效起 至今	0.5066%	0.0007%	0.3514%	0.0000%	0.1552 %	0.0007 %

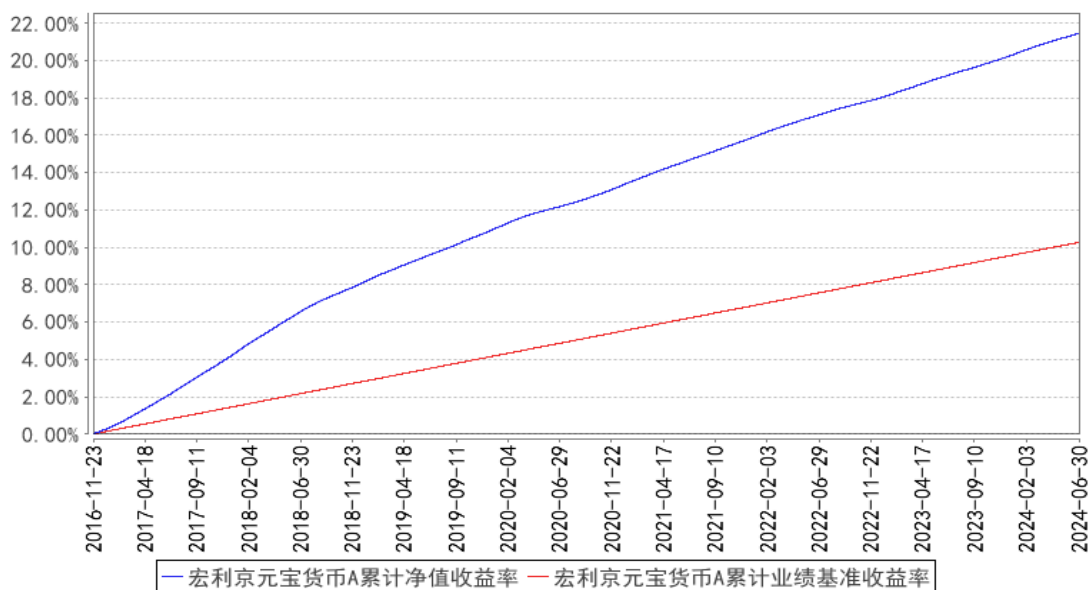
注： 1、本基金的业绩比较基准：同期七天通知存款利率(税后)。

2、本基金收益分配按日结转份额。

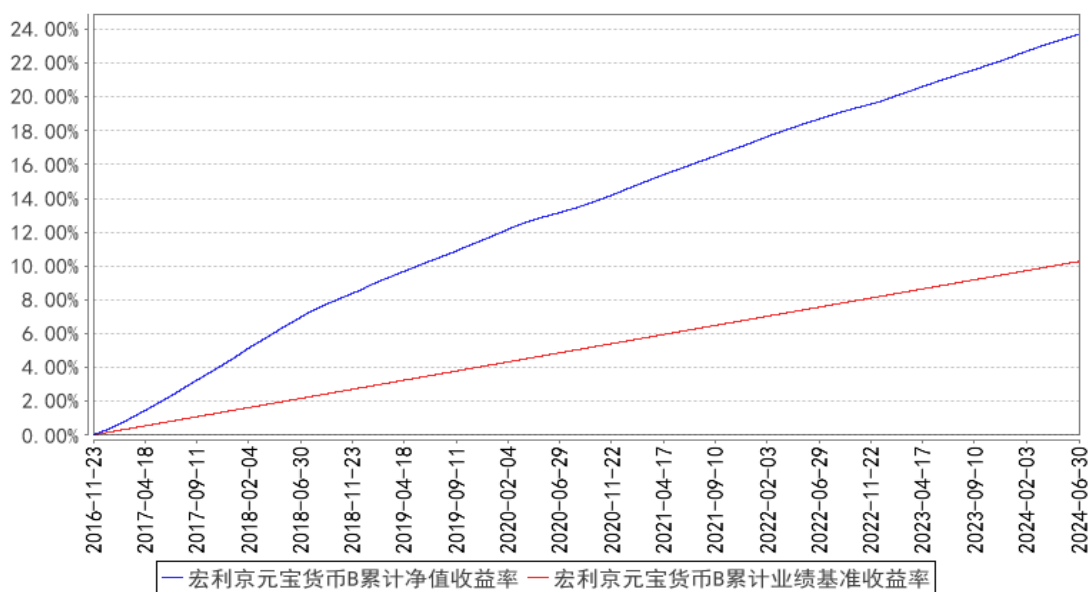


### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

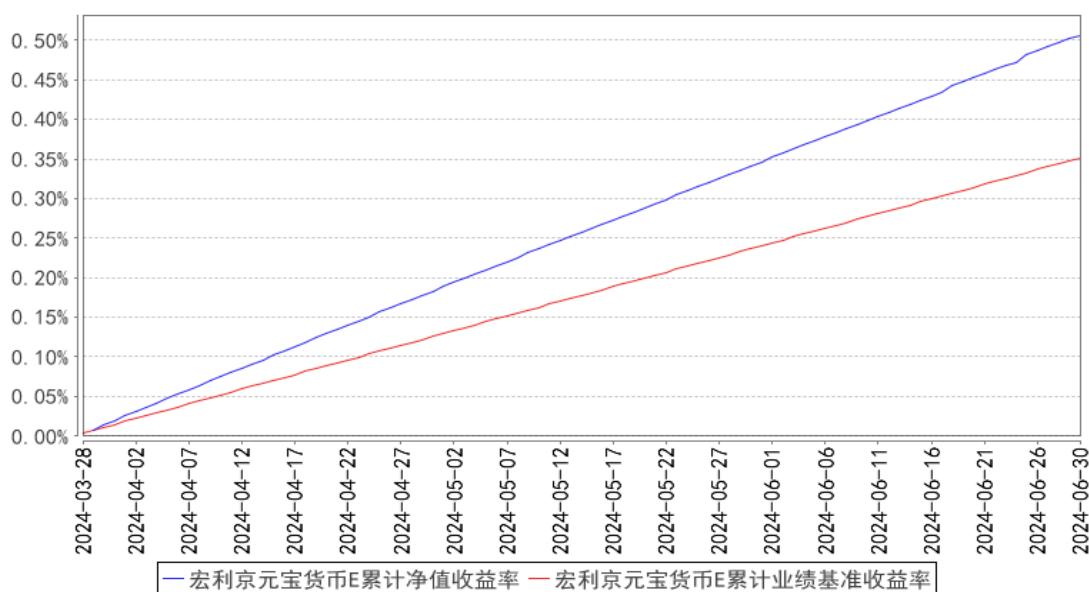
宏利京元宝货币A累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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



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 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、宏利波控回报 12 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、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基金中基金（FOF）、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 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、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		
周丹娜	本基金基金经理	2022 年 9 月 5 日	-	10 年	毕业于法国里尔第二大学，国际金融分析专业，硕士研究生。自 2014 年 9 月起任职于宏利基金管理有限公司，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 10 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	-	7 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 7 年基金从业经验，具有基金从业资格。
宁霄	本基金基金经理	2022 年 9 月 1 日	2024 年 3 月 4 日	16 年	中国人民大学金融工程硕士；2006 年 4 月至 2007 年 3 月，任职于兴业全球基金管理有限公司基金运营部，担任基金 TA 清算；2007 年 8 月至 2011 年 3 月，任职于华夏基金管理有限公司，担任基金会计；2013 年 7 月至今任职于宏利基金管理有限公司，曾先后担任债券交易员、交易部交易主管、交易部总经理助理、基金经理助理，2020 年 4 月起担任基金经理。具备 16 年证券从业经验，11 年证券投资基金管理经验，具有基金从业资格。

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024 年上半年，尽管外部环境复杂性、严峻性和不确定性显著上升，国内结构调整持续深化带来新挑战，但宏观政策效应持续释放、外需回暖、新质生产力加速发展等因素形成了新的支撑。最终上半年 GDP 同比增速录得 5.0%，总体来看，上半年国民经济延续了恢复向好态势，运行总体稳中有进。上半年债市的主线是地产政策、其他超预期政策发力及经济企稳压力之间的博弈，债券市场收益率总体走低，期间经历两次回调，利率曲线陡峭。上半年 CPI 和 PPI 表现符合预期，通胀温和抬升，制造业 PMI 短暂突破后又重回荣枯线以下，微观层面的能动性仍不足，地产销售数据筑底企稳仍处于底部区间，现阶段基本面对债市难以形成掣肘。在“资产荒”行情的驱动下，信用债继续表现亮眼，信用利差和等级利差继续压缩。上半年央行进行了一次降准操作，M1 和 M2 增速相对有所下滑，在淡化金融数据对债市的影响后，央行对债市超涨的担忧成为影响债市波动的重要因素。海外方面，欧洲央行率先开启降息进程以提振经济；美联储货币政策偏鸽，仍没有迈出降息的第一步，美国经济增速放缓，我国汇率压力相对得以缓解，国内货币政策仍有想象空间。

本基金报告期内积极调整货币资产配置结构，合理调整组合的期限和资产分布，积极增配高等级信用和同业存单等资产，迎合银行间资金价格的变化调整组合杠杆比率，为投资者提供了相对稳定的收益和流动性管理支持。

### 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 0.9254%，本报告期宏利京元宝货币 B 的基金份额净值收益率为 1.0460%，同期业绩基准收益率为 0.6732%。本报告期宏利京元宝货币 E 的基金份额净值收益率为 0.5066%，同期业绩基准收益率为 0.3514%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，货币政策持续宽松推进社会综合融资成本稳中有降，财政政策大概率更加积极，但地产持续回落带来的经济压力在短时间内难以用其他行业来弥补。整体来说债市利多因素仍然较多，但债券收益率曲线或已逼近历史极低水平，短期内或仍处于震荡状态。

## 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

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。

#### 4.8 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，本基金托管人在托管宏利京元宝货币市场基金的过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定，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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

在本报告期内，本托管人复核了本中期报告中的财务指标、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，保证复核内容真实、准确和完整。

## § 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：宏利京元宝货币市场基金

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
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	1,752,423,866.17	1,334,477,977.88
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,481,323,138.60	1,876,492,917.06
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,481,323,138.60	1,876,492,917.06
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	1,731,364,028.26	1,451,831,624.88
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		30,720,948.00	9,071.20
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		4,995,831,981.03	4,662,811,591.02
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2023 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	330,037,881.37
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		571,519.58	633,891.90
应付托管费		190,506.54	211,297.28
应付销售服务费		49,387.31	54,147.25
应付投资顾问费		-	-
应交税费		2,185.31	5,637.41
应付利润		728,216.40	1,094,845.09
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	206,730.20	391,100.79
负债合计		1,748,545.34	332,428,801.09
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	4,994,083,435.69	4,330,382,789.93
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-	-
净资产合计		4,994,083,435.69	4,330,382,789.93
负债和净资产总计		4,995,831,981.03	4,662,811,591.02

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 4,994,083,435.69 份，其中宏利京元宝货币 A 基金份额总额 57,151,319.80 份，基金份额净值 1.0000 元；宏利京元宝货币 B 基金份额总额 4,936,927,089.28 份，基金份额净值 1.0000 元；宏利京元宝货币 E 基金份额总额 5,026.61 份，基金份额净值 1.0000 元。

## 6.2 利润表

会计主体：宏利京元宝货币市场基金

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
<b>一、营业总收入</b>		50,094,805.11	110,215,431.16
1. 利息收入		29,176,524.33	62,381,471.82
其中：存款利息收入	6.4.7.13	14,264,717.89	25,521,052.71
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		14,911,806.44	36,860,419.11
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		20,918,280.78	47,830,994.34
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	20,918,280.78	47,830,994.34



资产支持证券投资 收益	6.4.7.16	-	-
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	-	-
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	-	-
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	-	2,965.00
<b>减：二、营业总支出</b>		5,462,928.84	10,269,884.93
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,194,496.87	6,869,122.77
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,064,832.28	2,289,707.68
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	284,674.67	533,947.68
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		734,315.17	380,123.68
其中：卖出回购金融资产 支出		734,315.17	380,123.68
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		5,644.64	11,253.00
8. 其他费用	6.4.7.23	178,965.21	185,730.12
<b>三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）</b>		44,631,876.27	99,945,546.23
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-” 号填列）</b>		44,631,876.27	99,945,546.23
<b>五、其他综合收益的税后 净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		44,631,876.27	99,945,546.23

### 6.3 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：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	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)	663,700,645.76	-	-	663,700,645.76
(一)、综合收益总额	-	-	44,631,876.27	44,631,876.27
(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)	663,700,645.76	-	-	663,700,645.76
其中：1. 基金申购款	6,898,902,919.86	-	-	6,898,902,919.86
2. 基金赎回款	-6,235,202,274.10	-	-	-6,235,202,274.10
(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)	-	-	-44,631,876.27	-44,631,876.27
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	4,994,083,435.69	-	-	4,994,083,435.69
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	10,693,545,996	-	-	10,693,545,996

	.07			07
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	10,693,545,996.07	-	-	10,693,545,996.07
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-4,167,049,416.31	-	-	-4,167,049,416.31
(一)、综合收益总额	-	-	99,945,546.23	99,945,546.23
(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)	-4,167,049,416.31	-	-	-4,167,049,416.31
其中：1. 基金申购款	13,201,859,685.69	-	-	13,201,859,685.69
2. 基金赎回款	-17,368,909,102.00	-	-	-17,368,909,102.00
(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)	-	-	-99,945,546.23	-99,945,546.23
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	6,526,496,579.76	-	-	6,526,496,579.76

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：

高贵鑫

基金管理人负责人

王泉

主管会计工作负责人

石植

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 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《宏利京元宝货币市场基金基金合同》和《宏利京元宝货币市场基金招募说明书》并报中国证监会备案,本基金根据投资者持有的基金份额数量级别将基金份额分为A类、B类和E类,不同级别的基金份额适用不同费率的销售服务费。

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。

### 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》、《宏利京元宝货币市场基金基金合同》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

本基金本报告期内无会计政策的变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无会计估计的变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无重大会计差错发生。

#### 6.4.6 税项

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

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖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。

#### 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	50,068,463.51
等于：本金	50,036,875.22
加：应计利息	31,588.29
减：坏账准备	-
定期存款	1,702,355,402.66
等于：本金	1,700,000,000.00
加：应计利息	2,355,402.66
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	1,050,783,888.87
存款期限 1-3 个月	100,031,666.68
存款期限 3 个月以上	551,539,847.11
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	1,752,423,866.17

注：定期存款的存款期限指票面存期。

##### 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				
	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	1,481,323,138.60	1,481,732,221.79	409,083.19	0.0082
	合计	1,481,323,138.60	1,481,732,221.79	409,083.19	0.0082
资产支持证券	-	-	-	-	
合计	1,481,323,138.60	1,481,732,221.79	409,083.19	0.0082	

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。

**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**

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	1,731,364,028.26	-
合计	1,731,364,028.26	-

**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	68,441.04
其中：交易所市场	-
银行间市场	68,441.04
应付利息	-
预提费用	138,289.16
合计	206,730.20

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

## 宏利京元宝货币 A

项目	本期 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	58,101,771.80	58,101,771.80
本期申购	38,460,669.52	38,460,669.52
本期赎回（以“-”号填列）	-39,411,121.52	-39,411,121.52
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	57,151,319.80	57,151,319.80

## 宏利京元宝货币 B

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	4,272,281,018.13	4,272,281,018.13
本期申购	6,860,437,223.73	6,860,437,223.73



本期赎回（以“-”号填列）	-6,195,791,152.58	-6,195,791,152.58
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	4,936,927,089.28	4,936,927,089.28

## 宏利京元宝货币 E

项目	本期 2024年3月28日（基金合同生效日）至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	5,026.61	5,026.61
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
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	5,026.61	5,026.61

注：1、申购含红利再投、转换入、级别调整入份额；赎回含转换出、级别调整出份额。

2、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 类收费模式，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。

## 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

## 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	555,335.51	-	555,335.51
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	-555,335.51	-	-555,335.51

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	44,076,515.42	-	44,076,515.42
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	-44,076,515.42	-	-44,076,515.42
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	25.34	-	25.34
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	-25.34	-	-25.34
本期末	-	-	-

注：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》。

## 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	770,509.63
定期存款利息收入	13,494,208.26
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	14,264,717.89

**6.4.7.14 股票投资收益**

本基金本报告期末未有股票投资收益。

**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	21,758,196.74
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-839,915.96
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	20,918,280.78

**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	4,820,583,459.23
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	4,807,953,037.70
减：应计利息总额	13,470,337.49
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-839,915.96

**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**

本基金本报告期末未有债券投资收益-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**

本基金本报告期末未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**

本基金本报告期末未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**

本基金本报告期末未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**

本基金本报告期末有股利收益。

**6.4.7.20 公允价值变动收益**

本基金本报告期末有公允价值变动收益。

**6.4.7.21 其他收入**

本基金本报告期末有其他收入。

**6.4.7.22 信用减值损失**

本基金本报告期末有信用减值损失。

**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	69,616.82
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	30,401.05
账户维护费	18,000.00

其他	1,275.00
合计	178,965.21

#### 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

本基金本报告期没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
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

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无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	3,194,496.87	6,869,122.77
其中：应支付销售机构的客户维护费	181,766.01	290,159.87
应支付基金管理人的净管理费	3,012,730.86	6,578,962.90

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。

#### 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	1,064,832.28	2,289,707.68

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。

#### 6.4.10.2.3 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			
	2024年1月1日至2024年6月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	宏利京元宝货币	宏利京元宝货币	宏利京元宝货币	合计
	A	B	E	
宏利基金管理有限公司	188.54	182,435.27	-	182,623.81
北京银行	245.45	4.09	-	249.54
合计	433.99	182,439.36	-	182,873.35
获得销售服务费的各关联方名称	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销售服务费			
	宏利京元宝货币	宏利京元宝货币	宏利京元宝货币	合计
	A	B	E	
宏利基金管理有限公司	1,646.44	372,908.98	-	374,555.42
北京银行	848.87	-	-	848.87
合计	2,495.31	372,908.98	-	375,404.29

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 类基金份额和 E 类基金份额约定的销售服务费年费率分别为 0.25%、0.01%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，A 类基金份额、B 类基金份额和 E 类基金份额约定的销售服务费年费率分别为 0.25%、0.01%和 0.01%。其计算公式为：日销售服务费=前一日基金资产净值×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》。

#### 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

单位：人民币元

本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 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	-	-	-	-	2,186,365,000.00	148,111.94
上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 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	-	-	-	-	-	-

#### 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无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

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

#### 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自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自有资金投资本基金。

##### 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

份额单位：份

宏利京元宝货币 B

关联方名称	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例 (%)
北京银行	1,500,859,536.54	30.0528	200,000,000.00	4.6185

注：基金管理人之外的其他关联方投资本基金按照公告的费率条款执行，不存在费率优惠的情况。

#### 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
北京银行	50,068,463.51	770,509.63	1,088,267.19	4,176.46

注：本基金的银行存款由基金托管人北京银行保管，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可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 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可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 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
561,673.14	-	-6,337.63	555,335.51	-
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
44,436,807.21	-	-360,291.79	44,076,515.42	-
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
24.61	-	0.73	25.34	-

#### 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

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额。

#### 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。

##### 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北京银行，定期存款存放在广发银行股份有限公司、华夏银行股份有

限公司、杭州银行股份有限公司、江苏银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、上海银行股份有限公司、兴业银行股份有限公司、浙商银行股份有限公司，因而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，违约风险可能性很小。

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值产的 10%。

本基金债券投资、资产支持证券投资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	-	283,670,904.69
合计	-	283,670,904.69

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

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	-	1,240,823,370.04
合计	-	1,240,823,370.04

#### 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	上年度末
--------	-----	------

	2024 年 6 月 30 日	2023 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	59,564,139.04	351,998,642.33
合计	59,564,139.04	351,998,642.33

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》、《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》(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。

#### 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。

#### 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	6个月以内	6个月-1年	1-5年	不计息	合计
资产					
货币资金	1,752,423,866.17	-	-	-	1,752,423,866.17
交易性金融资产	1,481,323,138.60	-	-	-	1,481,323,138.60
买入返售金融资产	1,731,364,028.26	-	-	-	1,731,364,028.26
应收申购款	-	-	-	30,720,948.00	30,720,948.00
资产总计	4,965,111,033.03	-	-	30,720,948.00	4,995,831,981.03
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	571,519.58	571,519.58
应付托管费	-	-	-	190,506.54	190,506.54
应付销售服务费	-	-	-	49,387.31	49,387.31
应付利润	-	-	-	728,216.40	728,216.40
应交税费	-	-	-	2,185.31	2,185.31
其他负债	-	-	-	206,730.20	206,730.20
负债总计	-	-	-	1,748,545.34	1,748,545.34
利率敏感度缺口	4,965,111,033.03	-	-	-28,972,402.66	4,994,083,435.69
上年度末 2023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	1,334,477,977.88	-	-	-	1,334,477,977.88
交易性金融资产	1,699,147,603.47	177,345,313.59	-	-	1,876,492,917.06
买入返售金融资产	1,451,831,624.88	-	-	-	1,451,831,624.88
应收申购款	-	-	-	9,071.20	9,071.20
资产总计	4,485,457,206.23	177,345,313.59	-	9,071.20	4,662,811,591.02
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	633,891.90	633,891.90
应付托管费	-	-	-	211,297.28	211,297.28
卖出回购金融资产款	330,037,881.37	-	-	-	330,037,881.37
应付销售服务费	-	-	-	54,147.25	54,147.25

应付利润	-	-	-	1,094,845.09	1,094,845.09
应交税费	-	-	-	5,637.41	5,637.41
其他负债	-	-	-	391,100.79	391,100.79
负债总计	330,037,881.37	-	-	2,390,919.72	332,428,801.09
利率敏感度缺口	4,155,419,324.86	177,345,313.59	-	-2,381,848.52	4,330,382,789.93

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

于 2024 年 6 月 30 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(2023 年 12 月 31 日：同)。

#### 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。

### 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	-	-
第二层次	1,481,323,138.60	1,876,492,917.06

第三层次	-	-
合计	1,481,323,138.60	1,876,492,917.06

#### 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的转换时点。

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。

#### 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	固定收益投资	1,481,323,138.60	29.65
	其中：债券	1,481,323,138.60	29.65
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,731,364,028.26	34.66
	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	1,752,423,866.17	35.08
4	其他各项资产	30,720,948.00	0.61
5	合计	4,995,831,981.03	100.00

### 7.2 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	1.79

	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。

## 7.3 基金投资组合平均剩余期限

### 7.3.1 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	37
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	54
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	30

### 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。

### 7.3.2 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的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	65.08	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	5.00	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	16.80	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	1.40	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	10.99	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	99.27	-

### 7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余存续期未出现超过 240 天的情况。



## 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	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	203,361,299.06	4.07
	其中：政策性金融债	203,361,299.06	4.07
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	411,388,389.99	8.24
6	中期票据	-	-
7	同业存单	866,573,449.55	17.35
8	其他	-	-
9	合计	1,481,323,138.60	29.66
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

## 7.6 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	012481161	24 国家能源 SCP005	1,000,000	100,396,801.84	2.01
2	112311119	23 平安银行 CD119	1,000,000	99,882,482.17	2.00
3	112315328	23 民生银行 CD328	1,000,000	99,795,996.16	2.00
4	112414131	24 江苏银行 CD131	1,000,000	99,585,798.77	1.99
5	112303209	23 农业银行 CD209	1,000,000	99,553,214.61	1.99
6	112498953	24 杭州银行 CD087	1,000,000	99,296,439.43	1.99
7	230211	23 国开 11	900,000	91,421,257.25	1.83
8	112309128	23 浦发银行 CD128	700,000	69,914,290.80	1.40
9	230216	23 国开 16	600,000	60,938,955.69	1.22
10	012480393	24 浙交投 SCP002	500,000	50,435,770.77	1.01

### 7.7 “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	0.0637%
报告期内偏离度的最低值	0.0069%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0398%

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期内负偏离度的绝对值未出现达到 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

本基金本报告期内正偏离度的绝对值未出现达到 0.5%的情况。

### 7.8 期末按实际利率计算的账面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。

### 7.9 投资组合报告附注

#### 7.9.1 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。

#### 7.9.2 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，江苏银行股份有限公司于 2023 年 8 月 10 日受到国家金融监督管理总局江苏监管局公开处罚。中国农业银行股份有限公司于 2023 年 8 月 15 日、2023 年 11 月 16 日曾受到国家金融监督管理总局公开处罚，于 2023 年 11 月 17 日曾受到国家外汇管理局北京市分局公开处罚。中国民生银行股份有限公司于 2023 年 8 月 2 日曾受到国家金融监督管理总局公开处罚，于 2023 年 8 月 16 日曾受到中国银行间市场交易商协会公开处罚。平安银行股份有限公司于 2024 年 5 月 14 日曾受到国家金融监督管理总局公开处罚，于 2023 年 7 月 7 日曾受到央行公开处罚，于 2023 年 12 月 12 日受到国家金融监督管理总局深圳监管局公开处罚，于 2023 年 12 月 19 日受到深圳监管局公开处罚。杭州银行股份有限公司于 2024 年 1 月 9 日曾受到国家金融监督管理总局浙江监管局公开处罚，于 2023 年 6 月 30 日曾受到浙江证监局公开处罚。

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。

### 7.9.3 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	30,720,948.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	30,720,948.00

### 7.9.4 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。

## § 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

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	33,977	1,682.06	386,968.29	0.68	56,764,351.51	99.32
宏利京元宝货币 B	248	19,906,964.07	4,934,160,561.28	99.94	2,766,528.00	0.06
宏利京元宝货币 E	3	1,675.54	0.00	0.00	5,026.61	100.00
合计	34,228	145,906.38	4,934,547,529.57	98.81	59,535,906.12	1.19

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。

### 8.2 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	银行类机构	1,500,859,536.54	30.05
2	银行类机构	1,330,471,602.97	26.64
3	保险类机构	303,209,247.35	6.07
4	保险类机构	250,492,563.39	5.02
5	银行类机构	206,083,870.83	4.13
6	银行类机构	200,114,604.87	4.01
7	银行类机构	158,309,254.63	3.17
8	银行类机构	153,485,295.75	3.07
9	银行类机构	151,448,410.21	3.03
10	券商类机构	150,509,184.95	3.01

### 8.3 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	23,794.32	0.0416
	宏利京元宝货币 B	0.00	0.0000
	宏利京元宝货币 E	5,025.61	99.9801
	合计	28,819.93	0.0006

## § 9 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
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	58,101,771.80	4,272,281,018.13	-
本报告期基金总申购份额	38,460,669.52	6,860,437,223.73	5,026.61
减：本报告期基金总赎回份额	39,411,121.52	6,195,791,152.58	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期末基金份额总额	57,151,319.80	4,936,927,089.28	5,026.61

注：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》。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期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、报告期内，史学通先生 2024 年 4 月 25 日起不再担任本基金托管人的专门基金托管部门负责人，暂由闫朝女士代为履职，2024 年 6 月 28 日，资产托管部总经理贺凌女士高管任职资格已完成证监会备案。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、本基金托管人、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金无投资策略的变化。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人及其相关高级管理人员未受到稽查或处罚。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 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 (%)	
银河证券	2	-	-	-	-	-

注：（一）本基金本报告期内无证券交易单元变动。

（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

本基金本报告期末通过租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

### 10.8 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。

### 10.9 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	2024 年 2 月 5 日
2	宏利京元宝货币市场基金基金经理变更公告	《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站及公司网站	2024 年 3 月 5 日
3	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	《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站及公司网站	2024 年 3 月 28 日
4	关于宏利京元宝货币市场基金劳动节假期前暂停申购、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	2024 年 4 月 25 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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	20240101~20240630	1,316,558,172.21	13,913,430.76	-	1,330,471,602.97	26.6410
	2	20240328~20240402, 20240618~20240630	200,000,000.00	3,002,784,182.68	1,701,924,646.14	1,500,859,536.54	30.0528
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 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准本基金设立的文件；
- 2、基金合同；
- 3、托管协议；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

### 12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

### 12.3 查阅方式

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

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

宏利基金管理有限公司

2024 年 8 月 31 日