

# 宏利聚利债券型证券投资基金 (LOF)

## 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：中国银行股份有限公司

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。

基金托管人中国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	5
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	6
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>12</b>
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>36</b>
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	37
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	38
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	38
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	38

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	38
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	38
7.11 投资组合报告附注 .....	38
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>40</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	40
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	40
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	40
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>40</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>41</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	41
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 .....	41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	41
10.4 基金投资策略的改变 .....	41
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	41
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 .....	41
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	41
10.8 其他重大事件 .....	45
<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>46</b>
12.1 备查文件目录 .....	46
12.2 存放地点 .....	46
12.3 查阅方式 .....	46

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	宏利聚利债券型证券投资基金 (LOF)
基金简称	宏利聚利债券 (LOF)
基金主代码	162215
基金运作方式	上市契约型开放式 (LOF)
基金合同生效日	2016 年 5 月 14 日
基金管理人	宏利基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,187,875,447.76 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2016 年 5 月 25 日

注：上述基金合同生效日为基金转型起始日（2016 年 5 月 14 日）

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于固定收益证券，在合理控制信用风险的基础上，通过积极主动的管理，力求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	从利率、信用等角度深入挖掘信用债市场投资机会，在有效控制流动性风险及信用风险等风险的前提下，力争创造稳健收益。
业绩比较基准	中债企业债总全价指数收益率×90%+中债国债总全价指数收益率×10%。
风险收益特征	本基金为较低风险品种，预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

### 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	中国银行股份有限公司
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	95566
传真	010-66577666	010-66594942
注册地址	北京市朝阳区针织路 23 号楼中国人寿金融中心 6 层 02-07 单元	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	北京市朝阳区针织路 23 号楼中国人寿金融中心 6 层 02-07 单元	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	100026	100818
法定代表人	高贵鑫	葛海蛟

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
----------------	------

登载基金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	中国证券登记结算有限责任公司	北京西城区太平桥大街 17 号

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024年1月1日-2024年6月30日)
本期已实现收益	22,554,802.65
本期利润	31,986,071.00
加权平均基金份额本期利润	0.0355
本期加权平均净值利润率	3.28%
本期基金份额净值增长率	3.39%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)
期末可供分配利润	421,550,148.59
期末可供分配基金份额利润	0.3549
期末基金资产净值	1,202,260,649.58
期末基金份额净值	1.012
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)
基金份额累计净值增长率	27.52%

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

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.54%	0.04%	0.26%	0.02%	0.28%	0.02%
过去三个月	1.79%	0.09%	0.65%	0.05%	1.14%	0.04%
过去六个月	3.39%	0.08%	1.60%	0.04%	1.79%	0.04%

过去一年	2.51%	0.11%	2.31%	0.04%	0.20%	0.07%
过去三年	5.22%	0.30%	3.74%	0.04%	1.48%	0.26%
自基金合同生效起至今	27.52%	0.44%	-7.65%	0.06%	35.17%	0.38%

注：本基金的业绩比较基准：中债企业债总全价指数收益率\*90%+中债国债总全价指数收益率\*10%

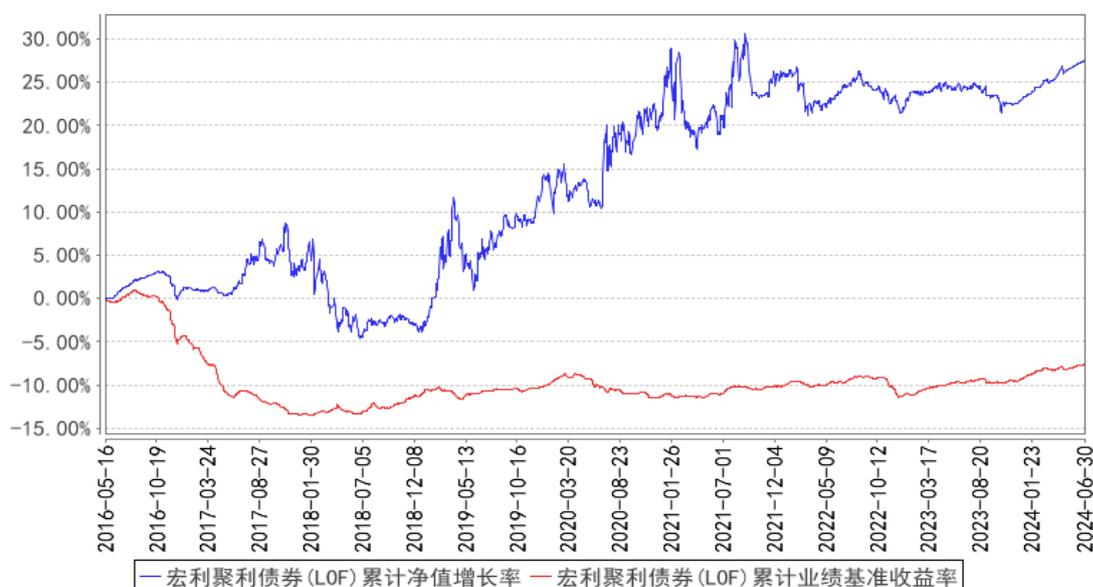
本基金集中投资于高收益信用债及国债，因此选取了中债企业债总全价指数和中债国债总全价指数作为基准。上述两个指数分别反映我国企业债市场和国债市场整体价格和投资回报情况，其样本与本基金的投资范围具有较高一致性，能够比较贴切的体现本基金的投资目标和风险收益特征。本基金根据在信用市场处于中性情况下的资产配置比例，赋予复合基准中两个指数以 90% 和 10% 的权重，可以较为公允的衡量基金管理人的投资管理能力。

中债企业债总全价指数和中债国债总全价指数由中央国债登记结算有限责任公司编制并发布。中央国债登记结算公司是财政部唯一授权主持建立、运营全国国债托管系统的机构，是中国人民银行指定的全国银行间债券市场债券登记、托管、结算机构和商业银行柜台记账式国债交易的一级托管人，作为指数发布主体具有绝对权威性。

中债企业债总全价指数和中债国债总全价指数的构成品种完全覆盖了本基金的投资范围，反映债券全市场的整体价格和投资回报情况；同时，这两个指数在市场上具有较高的知名度，被广大投资者所认同，适合作为本基金的业绩比较基准。

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

宏利聚利债券(LOF)累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

宏利基金管理有限公司原名湘财合丰基金管理有限公司、湘财荷银基金管理有限公司、泰达荷银基金管理有限公司、泰达宏利基金管理有限公司，成立于 2002 年 6 月。截至 2024 年 6 月 30 日，公司管理着包括宏利价值优化型系列基金、宏利行业精选混合型证券投资基金、宏利风险预算混合型证券投资基金、宏利货币市场基金、宏利效率优选混合型证券投资基金 (LOF)、宏利首选企业股票型证券投资基金、宏利市值优选混合型证券投资基金、宏利集利债券型证券投资基金、宏利红利先锋混合型证券投资基金、宏利沪深 300 指数增强型证券投资基金、宏利领先中小盘混合型证券投资基金、宏利聚利债券型证券投资基金 (LOF)、宏利中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF)、宏利逆向策略混合型证券投资基金、宏利宏达混合型证券投资基金、宏利淘利债券型证券投资基金、宏利转型机遇股票型证券投资基金、宏利改革动力量化策略灵活配置混合型证券投资基金、宏利复兴伟业灵活配置混合型证券投资基金、宏利新起点灵活配置混合型证券投资基金、宏利蓝筹价值混合型证券投资基金、宏利创益灵活配置混合型证券投资基金、宏利活期友货币市场基金、宏利汇利债券型证券投资基金、宏利睿智稳健灵活配置混合型证券投资基金、宏利京元宝货币市场基金、宏利纯利债券型证券投资基金、宏利溢利债券型证券投资基金、宏利恒利债券型证券投资基金、宏利全能优选混合型基金中基金 (FOF)、宏利交利 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、宏利金利 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、宏利绩优增长灵活配置混合型证券投资基金、宏利泽利 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、宏利泰和平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金 (FOF)、宏利印度机会股票型证券投资基金 (QDII)、宏利永利债券型证券投资基金、宏利消费行业量化精选混合型证券投资基金、宏利中证主要消费红利指数型证券投资基金、宏利泰和稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金 (FOF)、宏利价值长青混合型证券投资基金、宏利乐盈 66 个月定期开放债券型证券投资基金、宏利高研发创新 6 个月持有期混合型证券投资基金、宏利波控回报 12 个月持有期混合型证券投资基金、宏利消费服务混合型证券投资基金、宏利新能源股票型证券投资基金、宏利中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金、宏利悠然养老目标日期 2025 一年持有期混合型基金中基金 (FOF)、宏利新兴景气龙头混合型证券投资基金、宏利景气领航两年持有期混合型证券投资基金、宏利中短债债券型证券投资基金、宏利先进制造股票型证券投资基金、宏利景气智选 18 个月持有期混合型证券投资基金、宏利

昇利一年定期开放债券型发起式证券投资基金、宏利闽利一年定期开放债券型发起式证券投资基金、宏利悠享养老目标日期 2030 一年持有期混合型基金中基金 (FOF)、宏利添盈两年定期开放债券型证券投资基金、宏利医药健康混合型发起式证券投资基金、宏利睿智成长混合型证券投资基金、宏利中债-绿色普惠主题金融债券优选指数证券投资基金在内的六十多只证券投资基金。

本公司采用团队投资方式，即通过整个投资团队全体人员的共同努力，力求实现基金财产的持续增值。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李宇璐	本基金基金经理	2021 年 11 月 11 日	-	8 年	英国伯明翰大学国际银行货币学硕士研究生。2012 年 1 月至 2014 年 12 月任职于大公国际资信评估有限公司，担任行业组长；2015 年 1 月至 2016 年 3 月任职于安邦保险集团有限公司，担任信用评审经理；2016 年 3 月至 2021 年 3 月任职于建信养老金管理有限责任公司，担任投资经理；2021 年 4 月加入宏利基金管理有限公司，任职于固定收益部，曾任基金经理助理，现任基金经理。具备 8 年证券从业经验，8 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遵规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

统计、分析。在本报告期内，未发现利益输送、不公平对待不同投资组合的情况。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

国内方面，基本面仍为缓慢复苏区间，7 月 EPMI 46.1，仍处于历史较低位置。三中全会决定稿发布，整体呈现出以“科技、创新和安全”为内核的、针对体制机制的全面梳理和改革，更偏重供给端。继公报中明确“坚定不移实现全年经济社会发展目标”后，稳增长政策明显加码。货币政策首当其冲，7 月降息操作密集落地，OMO、LPR、MLF 相继降息，新一轮存款利率调降、保险预定利率调降亦跟随推进，广谱利率下行趋势延续。此外，财政部、发改委出台文件，加大对设备更新、消费品以旧换新的支持力度。

机构行为方面，压降手工补息前后的机构行为：银行买盘趋弱，非银买盘趋强，负债压力下，银行减持债券，非银青睐的短端、高等级信用表现强势。信用债板块各行业收益率、利差点位触及历史低点，无论从信用债收益率、利差的绝对水平还是分位数，目前都较为尴尬。短期内基本面和货币政策有利于债券收益率下台阶的利多的情况下，年初机构配置行为或继续成为影响债市行情的重点。若后市看牛平（或至少长端稳定），建议哑铃型策略，短久期为主+长久期普通信用债。

本基金主要以利率债及银行商业金融债、银行次级债、保险永续债和地方债的波段操作为主，积极把握杠杆策略和久期策略，小仓位参与可转债。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.012 元；本报告期基金份额净值增长率为 3.39%，业绩比较基准收益率为 1.60%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

预计下半年宏观经济仍将维持弱复苏的态势，在一定程度上有利于债券市场，债券收益率预期震荡中下行，在绝对收益的指导框架下，注重风险敞口和组合回撤的管理。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同及基金实际运作的情况，本基金管理人于2024年3月22日公告对2024年度收益进行分配，按每10份基金份额派发0.9550元进行利润分配，权益登记日为2024年3月26日，场内除权日为2024年3月27日、场外除权日为2024年3月26日，红利发放日为2024年3月28日，共分配73,084,097.16元。本基金管理人于2024年6月21日公告对2024年度收益进行分配，按每10份基金份额派发0.4760元进行利润分配，权益登记日为2024年6月25日，场内除权日为2024年6月26日、场外除权日为2024年6月25日，红利发放日为2024年6月27日，共分配55,948,988.66元。

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

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

## 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：宏利聚利债券型证券投资基金 (LOF)

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	24,031,461.03	679,533.56
结算备付金		859,480.63	292,842.57
存出保证金		26,060.65	11,657.21
交易性金融资产	6.4.7.2	1,154,883,523.84	1,232,893,999.87
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,154,883,523.84	1,232,893,999.87
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	80,035,138.37	-
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		109.35	8,693.04
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		1,259,835,773.87	1,233,886,726.25
<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		37,022,048.50	194,037,714.39
应付清算款		20,004,964.37	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		298,504.66	277,480.91
应付托管费		99,501.57	92,493.64
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		72,734.87	71,057.38
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	77,370.32	157,161.40
负债合计		57,575,124.29	194,635,907.72
<b>净资产:</b>			
实收基金	6.4.7.10	780,710,500.99	610,350,012.33
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	421,550,148.59	428,900,806.20
净资产合计		1,202,260,649.58	1,039,250,818.53
负债和净资产总计		1,259,835,773.87	1,233,886,726.25

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.012 元，基金份额总额 1,187,875,447.76 份。

## 6.2 利润表

会计主体：宏利聚利债券型证券投资基金 (LOF)

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>		34,832,047.42	983,713.23
1. 利息收入		192,853.97	14,590.35
其中：存款利息收入	6.4.7.13	39,325.02	3,958.92
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		153,528.95	10,631.43
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		25,207,577.52	226,497.57
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	25,207,577.52	226,497.57
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	-	-
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	9,431,268.35	737,566.84
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	347.58	5,058.47
<b>减：二、营业总支出</b>		2,845,976.42	254,141.66
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,444,264.65	118,153.69
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	481,421.59	33,758.26
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		809,663.24	16,008.06
其中：卖出回购金融资产支出		809,663.24	16,008.06
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		986.27	1,114.09
8. 其他费用	6.4.7.23	109,640.67	85,107.56
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		31,986,071.00	729,571.57
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		31,986,071.00	729,571.57
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-

六、综合收益总额		31,986,071.00	729,571.57
----------	--	---------------	------------

### 6.3 净资产变动表

会计主体：宏利聚利债券型证券投资基金 (LOF)

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	610,350,012.33	-	428,900,806.20	1,039,250,818.53
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	610,350,012.33	-	428,900,806.20	1,039,250,818.53
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	170,360,488.66	-	-7,350,657.61	163,009,831.05
(一)、综合收益总额	-	-	31,986,071.00	31,986,071.00
(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)	170,360,488.66	-	89,696,357.21	260,056,845.87
其中：1. 基金申购款	297,642,493.96	-	178,134,614.44	475,777,108.40
2. 基金赎回款	-127,282,005.30	-	-88,438,257.23	-215,720,262.53
(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)	-	-	-129,033,085.82	-129,033,085.82
(四)、其他综合收益结转留存收	-	-	-	-

益				
四、本期期末净资产	780,710,500.99	-	421,550,148.59	1,202,260,649.58
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	28,522,244.85	-	24,347,647.03	52,869,891.88
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	28,522,244.85	-	24,347,647.03	52,869,891.88
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-11,157,168.24	-	-8,864,289.04	-20,021,457.28
(一)、综合收益总额	-	-	729,571.57	729,571.57
(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)	-11,157,168.24	-	-9,593,860.61	-20,751,028.85
其中：1. 基金申购款	30,027.64	-	26,623.41	56,651.05
2. 基金赎回款	-11,187,195.88	-	-9,620,484.02	-20,807,679.90
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	17,365,076.61	-	15,483,357.99	32,848,434.60

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：

高贵鑫王泉石楠

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

宏利聚利债券型证券投资基金 (LOF) (原名为泰达宏利聚利债券型证券投资基金 (LOF), 以下简称“本基金”), 由泰达宏利聚利分级债券型证券投资基金 (以下简称“泰达宏利聚利分级债券基金”) 转型而来。根据《泰达宏利聚利分级债券型证券投资基金基金合同》的有关规定, 基金合同生效满五年后, 满足基金合同约定的存续条件, 泰达宏利聚利分级债券基金无需召开基金份额持有人大会, 将自动转换为上市开放式基金 (LOF), 基金份额仍将在深圳证券交易所上市交易。原泰达宏利聚利分级债券基金更名为泰达宏利聚利债券型证券投资基金 (LOF)。本基金为上市契约型开放式, 存续期限不定。泰达宏利聚利分级债券基金于转换前的基金资产净值为 2,406,935,014.91 元, 已于 2016 年 5 月 13 日全部转为本基金的基金资产净值, 按照本基金的基金份额净值 1.000 元折合为 2,406,935,014.91 份泰达宏利聚利债券型证券投资基金 (LOF) 基金份额, 并由本基金管理人向中国证券登记结算有限责任公司提交份额变更登记申请。本基金的基金管理人为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), 基金托管人为中国银行股份有限公司 (以下简称“中国银行”)。

根据《泰达宏利聚利分级债券型证券投资基金基金合同》、《泰达宏利聚利分级债券型证券投资基金招募说明书》和《泰达宏利聚利债券型证券投资基金 (LOF) 上市交易公告书》, 泰达宏利聚利分级债券基金将基金份额持有人初始有效认购的基金总份额按照 7:3 的比例分离为预期收益与预期风险不同的两种份额类别, 即优先类基金份额 (基金份额简称“聚利 A”) 和进取类基金份额 (基金份额简称“聚利 B”)。于转换日 (即 2016 年 5 月 13 日), 泰达宏利聚利分级债券基金的基金资产净值为 2,406,935,014.91 元, 按照本基金的基金份额净值 1.000 元转换为 2,406,935,014.91 份泰达宏利聚利债券型证券投资基金 (LOF) 基金份额 (其中, 聚利 A 的基金资产净值为 1,355,349,958.68 元, 转换为 1,355,349,958.68 份本基金份额; 聚利 B 的基金资产净值为 1,051,585,056.23 元, 转换为 1,051,585,056.23 份本基金份额)。

经深圳证券交易所 (以下简称“深交所”) 深证上字 [2016] 第 317 号文审核同意, 本基金场内交易总份额为 2,074,449,884.00 份, 于 2016 年 5 月 25 日在深交所挂牌交易 (交易代码: 162215)。未上市交易的基金份额托管在场外, 基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据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 日起更名为宏利聚利债券型证券投资基金 (LOF)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《宏利聚利债券型证券投资基金 (LOF) 基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的固定收益类金融工具，包括国内依法发行上市的国家债券、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、公司债券、短期融资券、资产证券化产品、可转换债券、可分离债券和回购等金融工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益证券品种(但需符合中国证监会的相关规定)。本基金在封闭期间，投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于信用债券的资产占基金固定收益类资产的比例合计不低于 80%，投资于非固定收益类资产的比例不高于基金资产的 20%。在开放期间，投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%；投资于非固定收益类资产的比例不高于基金资产的 20%，其中，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：中债企业债总全价指数收益率 $\times$ 90%+中债国债总全价指数收益率 $\times$ 10%。

#### 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》、《宏利聚利债券型证券投资基金 (LOF) 基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 6.4.6 税项

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

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

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

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

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

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
活期存款	24,031,461.03
等于：本金	24,030,302.81
加：应计利息	1,158.22
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	24,031,461.03

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	-	-	-	-	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	366,142,399.84	4,214,599.47	372,559,367.55	2,202,368.24
	银行间市场	762,178,379.97	8,720,156.29	782,324,156.29	11,425,620.03
	合计	1,128,320,779.81	12,934,755.76	1,154,883,523.84	13,627,988.27
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	1,128,320,779.81	12,934,755.76	1,154,883,523.84	13,627,988.27	

### 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	10,002,247.96	-
银行间市场	70,032,890.41	-
合计	80,035,138.37	-

#### 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持有其他资产。

#### 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	23,616.52
其中：交易所市场	-
银行间市场	23,616.52
应付利息	-
预提费用	53,753.80
合计	77,370.32

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	928,653,387.52	610,350,012.33
本期申购	452,817,797.82	297,642,493.96
本期赎回（以“-”号填列）	-193,595,737.58	-127,282,005.30
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	1,187,875,447.76	780,710,500.99

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

2. 截至2024年6月30日止，本基金于深交所上市的基金份额为21,844,595.00份（2023年12月31日：21,821,546.00份），托管在场外未上市交易的基金份额为1,166,030,852.76份（2023年12月31日：906,831,841.52份）。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申

购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期末未有其他综合收益。

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	474,759,988.34	-45,859,182.14	428,900,806.20
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	474,759,988.34	-45,859,182.14	428,900,806.20
本期利润	22,554,802.65	9,431,268.35	31,986,071.00
本期基金份额交易产生的变动数	99,316,187.83	-9,619,830.62	89,696,357.21
其中：基金申购款	196,663,349.49	-18,528,735.05	178,134,614.44
基金赎回款	-97,347,161.66	8,908,904.43	-88,438,257.23
本期已分配利润	-129,033,085.82	-	-129,033,085.82
本期	467,597,893.00	-46,047,744.41	421,550,148.59

末			
---	--	--	--

#### 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		24,301.99
定期存款利息收入		-
其他存款利息收入		-
结算备付金利息收入		5,864.36
其他		9,158.67
合计		39,325.02

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

本基金本报告期末有股票投资收益。

##### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期末有股票投资收益-买卖股票差价收入。

##### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期末有股票投资收益-证券出借差价收入。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
债券投资收益——利息收入		13,243,318.92
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入		11,964,258.60
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		25,207,577.52

##### 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		1,512,706,130.40
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额		1,486,145,580.70
减：应计利息总额		14,566,890.73

减：交易费用	29,400.37
买卖债券差价收入	11,964,258.60

#### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期末有债券投资收益-赎回差价收入。

#### 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期末有债券投资收益-申购差价收入。

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期末有资产支持证券投资收益。

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

本基金本报告期末有资产支持证券投资收益-买卖资产支持证券差价收入。

##### 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期末有资产支持证券投资收益-赎回差价收入。

##### 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期末有资产支持证券投资收益-申购差价收入。

#### 6.4.7.17 贵金属投资收益

##### 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期末有贵金属投资收益。

##### 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期末有贵金属投资收益-买卖贵金属差价收入。

##### 6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期末有贵金属投资收益-赎回差价收入。

##### 6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期末有贵金属投资收益-申购差价收入。

#### 6.4.7.18 衍生工具收益

##### 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期末有衍生工具收益-买卖权证差价收入。

##### 6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期末有衍生工具收益-其他投资收益。

#### 6.4.7.19 股利收益

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

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	9,431,268.35
股票投资	-
债券投资	9,431,268.35
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	9,431,268.35

## 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	347.58
合计	347.58

注：本基金的场外赎回费率按持有期间递减，场内赎回费率为赎回金额的0.1%，不低于赎回费总额的25%归入基金资产。

## 6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期未有信用减值损失。

## 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	44,753.80
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行费用	16,286.87
账户维护费	18,000.00
其他	30,600.00
合计	109,640.67

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期末有存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均未有应支付关联方的佣金。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,444,264.65	118,153.69
其中：应支付销售机构的客户维护	109,086.20	11,922.49

费		
应支付基金管理人的净管理费	1,335,178.45	106,231.20

注：于 2023 年 10 月 8 日前，支付基金管理人宏利基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.70% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.70% / 当年天数。

根据《宏利基金管理有限公司关于调低旗下两只基金费率并修改基金合同等法律文件的公告》，自 2023 年 10 月 9 日起，支付基金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 0.30% 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 × 0.30% / 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	481,421.59	33,758.26

注：于 2023 年 10 月 8 日前，支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

根据《宏利基金管理有限公司关于调低旗下两只基金费率并修改基金合同等法律文件的公告》，自 2023 年 10 月 9 日起，支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 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 × 0.10% / 当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

## 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

## 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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

## 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

于本基金本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

## 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	24,031,461.03	24,301.99	828,847.83	3,229.91

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按约定利率计息。

## 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未有在承销期内参与关联方承销证券的情况。

## 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无其他关联交易事项。

## 6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2024年3月26日	2024年3月27日	2024年3月26日	0.9550	51,581,799.99	21,502,297.17	73,084,097.16	-
2	2024年6月25日	2024年6月26日	2024年6月25日	0.4760	43,336,635.28	12,612,353.38	55,948,988.66	-
合计	-	-	-	1.4310	94,918,435.27	34,114,650.55	129,033,085.82	-

## 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的股票。

#### 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

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 37,022,048.50 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
2405318	24 河南债 18	2024 年 7 月 5 日	100.92	390,000	39,360,114.25
合计				390,000	39,360,114.25

##### 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

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

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工

具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

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

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

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资、资产支持证券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

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的债券投资。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

##### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

##### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	-	699,151,373.11
AAA 以下	-	30,286,790.16
未评级	-	503,455,836.60
合计	-	1,232,893,999.87

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，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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

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

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

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	24,031,461.03	-	-	-	24,031,461.03
结算备付金	859,480.63	-	-	-	859,480.63
存出保证金	26,060.65	-	-	-	26,060.65
交易性金融资产	84,179,859.87	725,870,507.57	344,833,156.40	-	1,154,883,523.84
买入返售金融资产	80,035,138.37	-	-	-	80,035,138.37
应收申购款	-	-	-	109.35	109.35

资产总计	189,132,000.55	725,870,507.57	344,833,156.40	109.35	1,259,835,773.87
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	298,504.66	298,504.66
应付托管费	-	-	-	99,501.57	99,501.57
应付清算款	-	-	-	20,004,964.37	20,004,964.37
卖出回购金融资产款	37,022,048.50	-	-	-	37,022,048.50
应交税费	-	-	-	72,734.87	72,734.87
其他负债	-	-	-	77,370.32	77,370.32
负债总计	37,022,048.50	-	-	20,553,075.79	57,575,124.29
利率敏感度缺口	152,109,952.05	725,870,507.57	344,833,156.40	-20,552,966.44	1,202,260,649.58
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	679,533.56	-	-	-	679,533.56
结算备付金	292,842.57	-	-	-	292,842.57
存出保证金	11,657.21	-	-	-	11,657.21
交易性金融资产	311,078,091.36	666,901,003.72	254,914,904.79	-	1,232,893,999.87
应收申购款	-	-	-	8,693.04	8,693.04
资产总计	312,062,124.70	666,901,003.72	254,914,904.79	8,693.04	1,233,886,726.25
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	277,480.91	277,480.91
应付托管费	-	-	-	92,493.64	92,493.64
卖出回购金融资产款	194,037,714.39	-	-	-	194,037,714.39
应交税费	-	-	-	71,057.38	71,057.38
其他负债	-	-	-	157,161.40	157,161.40
负债总计	194,037,714.39	-	-	598,193.33	194,635,907.72
利率敏感度缺口	118,024,410.31	666,901,003.72	254,914,904.79	-589,500.29	1,039,250,818.53

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。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	23,360,000.00	15,260,000.00
市场利率上升 25 个基点	-21,830,000.00	-14,500,000.00	

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金在封闭期间，投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于信用债券的资产占基金固定收益类资产的比例合计不低于 80%，投资于非固定收益类资产的比例不高于基金资产的 20%。在开放期间，投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%；投资于非固定收益类资产的比例不高于基金资产的 20%，其中，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

于 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性权益类投资 (2023 年 12 月 31 日：同)，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2023 年 12 月 31 日：同)。

### 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	97,228,379.07	-
第二层次	1,057,655,144.77	1,232,893,999.87
第三层次	-	-
合计	1,154,883,523.84	1,232,893,999.87

##### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换事项发生的当年年初为确认各层次之间转换的时点。

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	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,154,883,523.84	91.67
	其中：债券	1,154,883,523.84	91.67

	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	80,035,138.37	6.35
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	24,890,941.66	1.98
8	其他各项资产	26,170.00	0.00
9	合计	1,259,835,773.87	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内股票。

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票投资。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未持有股票投资。

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

本基金本报告期内未持有股票投资。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未持有股票投资。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	33,937,729.73	2.82
2	央行票据	-	-
3	金融债券	544,498,051.53	45.29
	其中：政策性金融债	81,423,384.24	6.77
4	企业债券	136,521,795.06	11.36
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	108,232,187.97	9.00
8	同业存单	-	-
9	其他	331,693,759.55	27.59

10	合计	1,154,883,523.84	96.06
----	----	------------------	-------

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	148221	23 长江 Y1	500,000	54,097,983.56	4.50
2	198903	23 天津 106	500,000	52,505,573.77	4.37
3	230782	23 龙江 24	500,000	51,994,383.56	4.32
4	212380025	23 东莞农商行 债 01	500,000	51,738,273.22	4.30
5	240598	24 中航 G2	500,000	51,668,989.04	4.30

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资于国债期货。该策略符合基金合同的规定。

### 7.10.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

## 7.11 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，长江证券股份有限公司于 2024 年 7 月 13 日曾受到贵州银保监局公开处罚。中航证券有限公司于 2024 年 2 月 18 日曾受到上海证监局公开处罚，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，于 2023 年 8 月 4 日曾受到央行南昌中心支行公开处罚。天津银行股份有限公司于 2023 年 12 月 5 日受到央行天津市分行公开处罚。

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。

### 7.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.11.3 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	26,060.65
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	109.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	26,170.00

### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	132026	G 三峡 EB2	11,003,808.90	0.92
2	110059	浦发转债	10,247,890.12	0.85
3	127025	冀东转债	10,137,796.33	0.84
4	128136	立讯转债	9,962,724.35	0.83
5	113052	兴业转债	9,656,262.80	0.80
6	110079	杭银转债	9,598,579.67	0.80
7	113044	大秦转债	8,615,791.47	0.72
8	113037	紫银转债	6,657,368.35	0.55
9	123085	万顺转 2	6,225,923.22	0.52
10	113054	绿动转债	6,143,772.23	0.51
11	110075	南航转债	5,034,995.80	0.42
12	113655	欧 22 转债	3,883,018.60	0.32
13	113061	拓普转债	3,781,737.48	0.31
14	113047	旗滨转债	3,682,111.40	0.31
15	128134	鸿路转债	3,600,407.25	0.30

### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票投资。

### 7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
885	1,342,232.14	1,177,201,757.71	99.10	10,673,690.05	0.90

注：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 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	中国出口信用保险公司	13,800,000.00	63.17
2	张跃霞	3,766,490.00	17.24
3	赵瑞珍	1,212,253.00	5.55
4	云南省烟草公司楚雄州公司企业年金计划—中国工商银行股份有限公司	967,318.00	4.43
5	邵志艳	410,990.00	1.88
6	张东华	365,052.00	1.67
7	刘剑新	221,558.00	1.01
8	叶莉雅	177,247.00	0.81
9	管会会	110,716.00	0.51
10	吴天华	105,903.00	0.48

注：持有人为本基金场内持有人。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	40,783.70	0.0034

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2016 年 5 月 14 日) 基金份额总额	2,406,935,014.91
本报告期期初基金份额总额	928,653,387.52
本报告期基金总申购份额	452,817,797.82
减：本报告期基金总赎回份额	193,595,737.58
本报告期基金拆分变动份额	-

本报告期末基金份额总额

1, 187, 875, 447. 76

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，本基金以通讯开会方式召开了本基金基金份额持有人大会，大会表决投票时间为 2024 年 5 月 17 日至 2024 年 6 月 17 日 17:00 止。本次基金份额持有人大会于 2024 年 6 月 18 日表决通过了《关于宏利聚利债券型证券投资基金（LOF）修改基金合同有关事项的议案》。根据持有人大会通过的议案及方案说明，本次持有人大会决议自该日起生效。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内基金管理人未发生重大人事变动。  
2、本报告期内，经中国银行股份有限公司研究决定，郭德秋先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 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

本报告期内本基金无投资策略的变化。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期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 (%)	
财通证券	1	-	-	-	-	-

长江证券	1	-	-	-	-	-
诚通证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方财富	1	-	-	-	-	-
东方证券	3	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
国投证券	3	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中信建投	3	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

注：（一）本基金本报告期新增国泰君安证券交易单元。

（二）交易单元选择的标准和程序

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

单元，选择的标准是：

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

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
财通证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	16,997,590.00	4.15	64,000,000.00	14.55	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-

国投证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
华安证 券	-	-	-	-	-	-
华创证 券	6,155,371.3 3	1.50	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
江海证 券	-	-	-	-	-	-
开源证 券	25,947,845. 79	6.34	251,000,000. 00	57.05	-	-
民生证 券	161,167,635 .28	39.39	125,000,000. 00	28.41	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-
太平洋 证券	-	-	-	-	-	-
天风证 券	15,305,201. 47	3.74	-	-	-	-
西部证 券	-	-	-	-	-	-
西南证 券	30,083,525. 08	7.35	-	-	-	-
湘财证 券	62,956,150. 00	15.39	-	-	-	-
信达证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
浙商证 券	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-
中信建 投	-	-	-	-	-	-

中信证 券	-	-	-	-	-	-
中银国 际	90,559,000. 00	22.13	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	宏利聚利债券型证券投资基金(LOF)基金恢复大额申购、大额定期定额投资公告	《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1日
2	宏利聚利债券型证券投资基金(LOF)暂停大额申购、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	2024年3月20日
3	宏利聚利债券型证券投资基金(LOF)分红公告	《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22日
4	宏利聚利债券型证券投资基金(LOF)恢复大额申购、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	2024年3月29日
5	宏利基金管理有限公司关于以通讯开会方式召开宏利聚利债券型证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会的公告	《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站及公司网站	2024年5月17日
6	宏利基金管理有限公司关于以通讯开会方式召开宏利聚利债券型证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会的第一次提示性公告	《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站及公司网站	2024年5月18日
7	宏利基金管理有限公司关于以通讯开会方式召开宏利聚利债券型证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会的第二次提示性公告	《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站及公司网站	2024年5月20日
8	宏利聚利债券型证券投资基金(LOF)暂停大额申购、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	2024年6月6日
9	宏利基金管理有限公司关于宏利聚利债券型证券投资基金(LOF)停牌提示性公告	《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站及公司网站	2024年6月18日
10	宏利聚利债券型证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会公证书	《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站及公司网站	2024年6月19日
11	宏利基金管理有限公司关于宏利聚利债券型证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告	《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站及公司网站	2024年6月19日
12	宏利聚利债券型证券投资基金(LOF)	《证券时报》、中国证监会	2024年6月21日

	分红公告	会基金电子披露网站及公司网站	
13	宏利聚利债券型证券投资基金 (LOF) 恢复大额申购、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	2024 年 6 月 26 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	244,897,142.86	-	-	244,897,142.86	20.6164
	2	20240101~20240605	228,570,612.24	-	-	228,570,612.24	19.2420
	3	20240101~20240605	224,927,781.44	31,323,552.96	18,975,332.07	237,276,002.33	19.9748
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