

# 宏利逆向策略混合型证券投资基金 2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：宏利基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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>7</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
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	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54
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	54
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	54
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	54

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 .....	54
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	54
7.12 投资组合报告附注 .....	54
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>55</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	55
8.3 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 .....	56
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>56</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>56</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	56
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 .....	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	56
10.4 基金投资策略的改变 .....	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	56
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 .....	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	57
<b>§ 11 备查文件目录 .....</b>	<b>58</b>
11.1 备查文件目录 .....	58
11.2 存放地点 .....	58
11.3 查阅方式 .....	58

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	宏利逆向策略混合型证券投资基金
基金简称	宏利逆向策略混合
基金主代码	229002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年5月23日
基金管理人	宏利基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	58,698,188.19份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过运用逆向投资策略,在有效控制投资组合风险的前提下,努力为投资者谋求资产的长期稳定增值。
投资策略	结合逆向投资核心理念和中国市场实际,本基金着重于资产配置策略和精选个股策略。在资产配置过程中,通过联邦模型寻找大类资产(股票或债券)被低估的时机,逆向投资于被低估的资产类别;在个股精选过程中,一方面利用估值和反转策略逆向精选个股,另一方面依据逆向投资理念把握事件冲击等不易量化的逆向投资机会,并辅以严格的优质公司特征分析及投资时机分析,力求获得逆向投资策略带来的长期超额收益。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*75%+上证国债指数收益率*25%
风险收益特征	本基金为混合型基金,属于高风险、高收益的基金品种,其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金。

### 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	中国建设银行股份有限公司
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	021-60637228
传真	010-66577666	021-60635778
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25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	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码	100026	100033
法定代表人	高贵鑫	张金良

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
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)
本期已实现收益	1,308,986.17
本期利润	-2,303,594.30
加权平均基金份额本期利润	-0.0360
本期加权平均净值利润率	-1.94%
本期基金份额净值增长率	-2.02%
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	36,386,642.82
期末可供分配基金份额利润	0.6199
期末基金资产净值	108,108,653.45
期末基金份额净值	1.842
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	175.09%

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

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-3.36%	0.78%	-2.32%	0.36%	-1.04%	0.42%
过去三个月	-1.71%	0.88%	-1.11%	0.56%	-0.60%	0.32%
过去六个月	-2.02%	1.23%	1.74%	0.67%	-3.76%	0.56%
过去一年	-13.68%	1.03%	-6.09%	0.65%	-7.59%	0.38%

过去三年	-38.44%	1.20%	-23.43%	0.78%	-15.01%	0.42%
自基金合同生效起至今	175.09%	1.51%	45.86%	1.02%	129.23%	0.49%

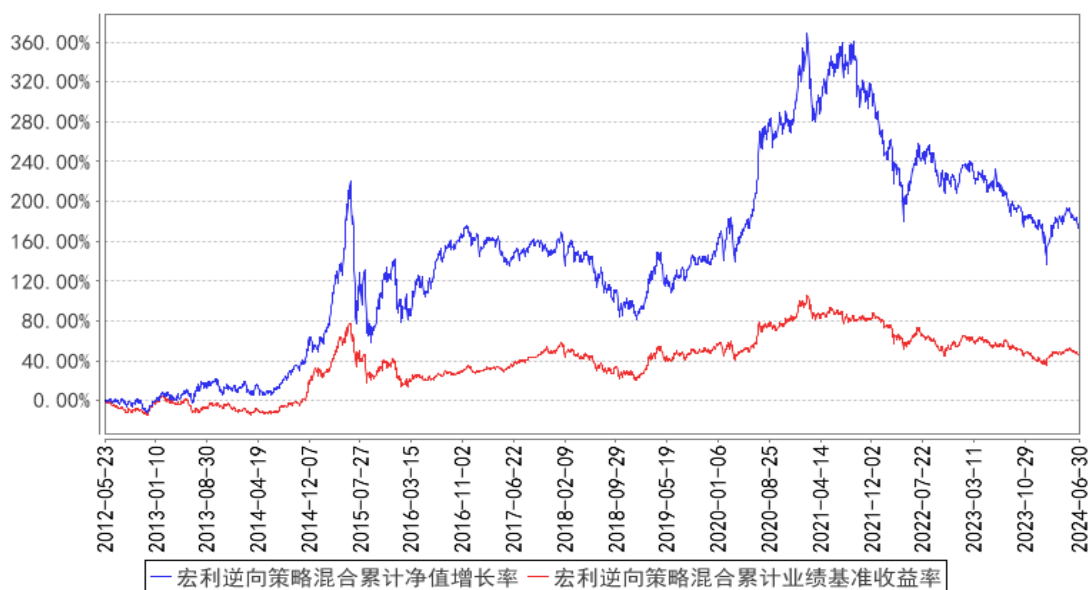
注：本基金的业绩比较基准：沪深 300 指数收益率\*75%+上证国债指数收益率\*25%。

沪深 300 指数由中证指数有限公司编制，指数样本选取沪深两个证券市场共 300 只股票，覆盖了大部分流通市值。成份股为市场代表性好，流动性高，交易活跃的主流投资股票，能够反映市场主流投资的收益情况，是沪深市场整体走势的最具代表性的跨市场指数，所以比较适合作为本基金权益类资产部分的比较基准。

在本基金中，债券资产部分的投资主要是以降低投资组合整体风险为目的，所以在选择业绩比较基准过程中我们选择了成分券流动性较好，且风险较低的上证国债指数作为债券投资部分的业绩比较基准，该指数选取在上海证券交易所上市的所有固定利率国债为样本，按照国债发行量加权而成，具有良好的市场代表性。

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

宏利逆向策略混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

宏利投资管理（香港）有限公司：49%。

宏利基金管理有限公司原名湘财合丰基金管理有限公司、湘财荷银基金管理有限公司、泰达荷银基金管理有限公司、泰达宏利基金管理有限公司，成立于 2002 年 6 月。截至 2024 年 6 月 30 日，公司管理着包括宏利价值优化型系列基金、宏利行业精选混合型证券投资基金、宏利风险预算混合型证券投资基金、宏利货币市场基金、宏利效率优选混合型证券投资基金（LOF）、宏利首选企业股票型证券投资基金、宏利市值优选混合型证券投资基金、宏利集利债券型证券投资基金、宏利红利先锋混合型证券投资基金、宏利沪深 300 指数增强型证券投资基金、宏利领先中小盘混合型证券投资基金、宏利聚利债券型证券投资基金（LOF）、宏利中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）、宏利逆向策略混合型证券投资基金、宏利宏达混合型证券投资基金、宏利淘利债券型证券投资基金、宏利转型机遇股票型证券投资基金、宏利改革动力量化策略灵活配置混合型证券投资基金、宏利复兴伟业灵活配置混合型证券投资基金、宏利新起点灵活配置混合型证券投资基金、宏利蓝筹价值混合型证券投资基金、宏利创益灵活配置混合型证券投资基金、宏利活期友货币市场基金、宏利汇利债券型证券投资基金、宏利睿智稳健灵活配置混合型证券投资基金、宏利京元宝货币市场基金、宏利纯利债券型证券投资基金、宏利溢利债券型证券投资基金、宏利恒利债券型证券投资基金、宏利全能优选混合型基金中基金（FOF）、宏利交利 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、宏利金利 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、宏利绩优增长灵活配置混合型证券投资基金、宏利泽利 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、宏利泰和平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、宏利印度机会股票型证券投资基金（QDII）、宏利永利债券型证券投资基金、宏利消费行业量化精选混合型证券投资基金、宏利中证主要消费红利指数型证券投资基金、宏利泰和稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、宏利价值长青混合型证券投资基金、宏利乐盈 66 个月定期开放债券型证券投资基金、宏利高研发创新 6 个月持有期混合型证券投资基金、宏利波控回报 12 个月持有期混合型证券投资基金、宏利消费服务混合型证券投资基金、宏利新能源股票型证券投资基金、宏利中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金、宏利悠然养老目标日期 2025 一年持有期混合型基金中基金（FOF）、宏利新兴景气龙头混合型证券投资基金、宏利景气领航两年持有期混合型证券投资基金、宏利中短债债券型证券投资基金、宏利先进制造股票型证券投资基金、宏利景气智选 18 个月持有期混合型证券投资基金、宏利昇利一年定期开放债券型发起式证券投资基金、宏利闽利一年定期开放债券型发起式证券投资基金、宏利悠享养老目标日期 2030 一年持有期混合型基金中基金（FOF）、宏利添盈两年定期开放债券型证券投资基金、宏利医药健康混合型发起式证券投资基金、宏利睿智成长混合型证券投资基金、宏利中债-绿色普惠主题金融债券优选指数证券投资基金在内的六十多只证券投资基金。



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

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘欣	总经理助理兼基金经理	2014年1月3日	-	17年	清华大学理学硕士；2007年7月至2008年12月就职于工银瑞信基金管理有限公司；2008年12月至2011年7月就职于嘉实基金管理有限公司；2011年7月加盟宏利基金管理有限公司，曾担任产品与金融工程部高级研究员、金融工程部副总经理、金融工程部总经理、投资副总监，现担任公司总经理助理兼基金经理；具备17年基金从业经验，17年证券投资管理经验，具有基金从业资格。
李婷婷	本基金基金经理助理	2019年11月18日	-	7年	北京大学金融硕士，2017年7月加入宏利基金管理有限公司，曾任助理研究员，现任基金经理，具备7年基金从业经验，具有基金从业资格。

注：1、证券从业的含义遵从监管及行业协会相关规定。表中的任职日期和离任日期均指公司相关公告中披露的日期。

2、本基金基金经理刘欣于2024年7月30日离任，增聘刘洋先生为该基金的基金经理，该基金由刘洋先生单独管理，公司于2024年7月31日发布《宏利逆向策略混合型证券投资基金基金经理变更公告》。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

确保各投资组合享有公平的投资机会。风险管理部事后对本报告期的公平交易执行情况进行数量统计、分析。在本报告期内，未发现利益输送、不公平对待不同投资组合的情况。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

本基金在操作中，采用量化与基本面结合的投资方法，均衡配置组合，力争获取长期稳健的相对市场的超额收益。本基金在投资策略上做进一步优化，基于股票的分域定价和 DCF 现金流折现模型，均衡配置下述几类长期具有超额收益短期形成风格互补的策略，即基于近端现金流的业绩超预期策略、基于中期现金流的景气成长策略、基于远端现金流假设的核心资产策略、基于风险溢价变化的低估值策略以及基于大样本统计的小盘统计套利策略，并重点关注一些被市场定价忽略的逆向投资机会。从结构上分散由于市场风格大幅波动造成的风险。本报告期内，本基金增加了电子、煤炭、汽车板块的配置，减少了计算机、传媒、纺织服装板块的配置。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.842 元；本报告期基金份额净值增长率为-2.02%，业绩比较基准收益率为 1.74%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，考虑到当前估值已经反映比较悲观的预期，认为当前市场下行空间有限，具有较好的赔率，比较看多市场。从胜率角度，考虑到当前经济环境的不确定性，市场复苏的过程可能不会很快，但包括监管积极改革市场、港股上涨、美国降息预期等线索正在出现。在股票结构配

置上仍将保持均衡的方式，低估值防御性股票在年内三次达到相对基金平均 20%的超额收益后有所回撤，仍提供一定空间，这类股票由于具有高股息低估值特征，使得二级市场定价层面会离公司基本面更近，相对更类似绝对收益，体现出抗跌但向上弹性也不是很强的特征。此外大型成长股可能是如果出现反弹的较好标的。

基于基金合同与投资观点，将继续均衡配置各类具有长期超额收益的策略，并力争通过不断研究学习丰富策略体系。在交易时机和风格判断上，基于当前宏观与资金环境，保留少量灵活性，从逆向投资角度选取情绪相对低迷的时点参与，在情绪过度亢奋期退出。

#### 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

根据本基金基金合同及基金的实际运作情况，本基金于本报告期内未进行收益分配。

#### 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责

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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、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、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

## 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

本托管人复核审查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。

# § 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：宏利逆向策略混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	8,865,001.08	9,913,516.19
结算备付金		617,160.57	798,720.51
存出保证金		23,842.32	31,057.40
交易性金融资产	6.4.7.2	99,369,037.87	117,544,458.78
其中：股票投资		99,369,037.87	117,544,458.78
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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	-	-
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		27,266.58	21,686.60
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		108,902,308.42	128,309,439.48
<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		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		19,926.01	151,383.69
应付管理人报酬		136,085.56	161,415.61
应付托管费		22,680.93	26,902.60
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	614,962.47	721,858.13
负债合计		793,654.97	1,061,560.03
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	58,698,188.19	67,684,131.52
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	49,410,465.26	59,563,747.93
净资产合计		108,108,653.45	127,247,879.45
负债和净资产总计		108,902,308.42	128,309,439.48

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.842 元，基金份额总额 58,698,188.19 份。

## 6.2 利润表

会计主体：宏利逆向策略混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	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
<b>一、营业总收入</b>		-1,172,130.66	2,720,279.13
1. 利息收入		23,685.59	27,877.94
其中：存款利息收入	6.4.7.13	23,685.59	27,562.27
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		-	315.67
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,414,813.67	1,998,098.78
其中：股票投资收益	6.4.7.14	799,622.95	775,394.58
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	6,871.37
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	1,615,190.72	1,215,832.83
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	-3,612,580.47	690,211.22
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	1,950.55	4,091.19
<b>减：二、营业总支出</b>		1,131,463.64	1,441,922.33
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	884,293.80	1,150,681.86
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	147,382.24	191,780.32
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	99,787.60	99,460.15
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-2,303,594.30	1,278,356.80
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-2,303,594.30	1,278,356.80
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-2,303,594.30	1,278,356.80

### 6.3 净资产变动表

会计主体：宏利逆向策略混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	67,684,131.52	-	59,563,747.93	127,247,879.45
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	67,684,131.52	-	59,563,747.93	127,247,879.45
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-8,985,943.33	-	-10,153,282.67	-19,139,226.00
（一）、综合收益总额	-	-	-2,303,594.30	-2,303,594.30
（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）	-8,985,943.33	-	-7,849,688.37	-16,835,631.70
其中：1. 基金申购款	1,993,594.65	-	1,667,367.14	3,660,961.79
2. 基金赎回款	-10,979,537.98	-	-9,517,055.51	-20,496,593.49
（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	58,698,188.19	-	49,410,465.26	108,108,653.45
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	72,002,643.82	-	80,501,017.19	152,503,661.01
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	72,002,643.82	-	80,501,017.19	152,503,661.01
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-2,503,722.87	-	-1,698,357.94	-4,202,080.81
（一）、综合收益总额	-	-	1,278,356.80	1,278,356.80
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-2,503,722.87	-	-2,976,714.74	-5,480,437.61
其中：1. 基金申购款	2,858,586.01	-	3,388,886.29	6,247,472.30
2. 基金赎回款	-5,362,308.88	-	-6,365,601.03	-11,727,909.91
（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	69,498,920.95	-	78,802,659.25	148,301,580.20

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

石楠

会计机构负责人



## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

宏利逆向策略混合型证券投资基金(原名为泰达宏利逆向策略混合型证券投资基金,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[2011]第 1819 号《关于核准泰达宏利逆向策略股票型证券投资基金募集的批复》核准,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《泰达宏利逆向策略股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 552,493,750.59 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第 142 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰达宏利逆向策略股票型证券投资基金基金合同》于 2012 年 5 月 23 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 552,581,237.45 份基金份额,其中认购资金利息折合 87,486.86 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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)。

根据 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》,泰达宏利逆向策略股票型证券投资基金于 2015 年 7 月 30 日公告后更名为泰达宏利逆向策略混合型证券投资基金。根据本基金的基金管理人 2023 年 6 月 17 日发布的《宏利基金管理有限公司关于旗下基金更名事宜的公告》,本基金自 2023 年 6 月 20 日起更名为宏利逆向策略混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《宏利逆向策略混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行、上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、股指期货、权证、资产支持证券及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。本基金的投资组合比例为:股票资产(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)占基金资产的 60%-95%,固定收益类资产占基金资产的 0%-35%,权证占基金资产净值的 0%-3%,并保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率 $\times$ 75%+上证国债指数收益率 $\times$ 25%。

### 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》、《宏利逆向策略混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

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

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府

债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(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	8,865,001.08
等于：本金	8,864,141.45
加：应计利息	859.63
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	8,865,001.08

#### 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	103,365,723.63	-	99,369,037.87	-3,996,685.76
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	103,365,723.63	-	99,369,037.87	-3,996,685.76

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末未持有期货合约。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

##### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

#### 6.4.7.5 债权投资

##### 6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末未持有债权投资。

#### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末未计提债权投资减值准备。

#### 6.4.7.6 其他债权投资

##### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末未持有其他债权投资。

##### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末未计提其他债权投资减值准备。

#### 6.4.7.7 其他权益工具投资

##### 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

##### 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

#### 6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 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	11.73
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	520,943.14
其中：交易所市场	520,943.14
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	94,007.60
合计	614,962.47

#### 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	67,684,131.52	67,684,131.52
本期申购	1,993,594.65	1,993,594.65
本期赎回（以“-”号填列）	-10,979,537.98	-10,979,537.98
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	58,698,188.19	58,698,188.19

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

#### 6.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期末未有其他综合收益。

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	40,034,881.76	19,528,866.17	59,563,747.93
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	40,034,881.76	19,528,866.17	59,563,747.93
本期利润	1,308,986.17	-3,612,580.47	-2,303,594.30
本期基金份额交易产生的变动数	-4,957,225.11	-2,892,463.26	-7,849,688.37
其中：基金申购款	1,065,876.39	601,490.75	1,667,367.14
基金赎回款	-6,023,101.50	-3,493,954.01	-9,517,055.51
本期已分配利润	-	-	-
本期末	36,386,642.82	13,023,822.44	49,410,465.26

#### 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	16,291.36
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	7,179.40
其他	214.83
合计	23,685.59

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	799,622.95
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-

股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	799,622.95

#### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	646,069,606.95
减：卖出股票成本总额	643,659,196.82
减：交易费用	1,610,787.18
买卖股票差价收入	799,622.95

#### 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

本基金本报告期末有债券投资收益。

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期末有债券投资收益-买卖债券差价收入。

##### 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

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,615,190.72
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,615,190.72

#### 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	-3,612,580.47
股票投资	-3,612,580.47
债券投资	-
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	-3,612,580.47

#### 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	1,944.21
基金转换费收入	6.34
合计	1,950.55

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

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

#### 6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期末未有信用减值损失。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	29,835.26
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	1,280.00
账户维护费	9,000.00
合计	99,787.60

#### 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
中国建设银行股份有限公司(中国建设银行)	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	884,293.80	1,150,681.86
其中：应支付销售机构的客户维护费	340,507.75	426,264.47
应支付基金管理人的净管理费	543,786.05	724,417.39

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 1.50%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×1.50%/当年天数。

###### 6.4.10.2.2 基金托管费

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托管费	147,382.24	191,780.32

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

**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的银行间同业市场的债券（含回购）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均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
中国建设银行	8,865,001.08	16,291.36	12,678,459.03	20,217.46

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，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度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**

本基金本报告期内未进行利润分配。

## 6.4.12 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

## 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
603350	安乃达	2024年6月26日	1个月内(含)	新股未上市	20.56	20.56	511	10,506.16	10,506.16	-
603285	键邦股份	2024年6月28日	1个月内(含)	新股未上市	18.65	18.65	472	8,802.80	8,802.80	-
688692	达梦数据	2024年6月4日	1-6个月(含)	新股流通受限	86.96	174.93	39	3,391.44	6,822.27	-
688691	灿芯股份	2024年4月2日	1-6个月(含)	新股流通受限	19.86	42.51	137	2,720.82	5,823.87	-
688530	欧莱新材	2024年4月29日	1-6个月(含)	新股流通受限	9.60	16.10	317	3,043.20	5,103.70	-
688709	成都华微	2024年1月31日	1-6个月(含)	新股流通受限	15.69	18.79	209	3,279.21	3,927.11	-
601033	永兴股份	2024年1月11日	1-6个月(含)	新股流通受限	16.20	15.96	170	2,754.00	2,713.20	-
688584	上海合晶	2024年2月1日	1-6个月(含)	新股流通受限	22.66	15.89	166	3,761.56	2,637.74	-
603341	龙旗科技	2024年2月23日	1-6个月(含)	新股流通受限	26.00	37.49	62	1,612.00	2,324.38	-
603082	北	2024	1-6个	新股	21.28	29.49	56	1,191.68	1,651.44	-

	自科技	2024年1月23日	1-6个月(含)	流通受限						
603325	博隆技术	2024年1月3日	1-6个月(含)	新股流通受限	72.46	68.06	20	1,449.20	1,361.20	-
603375	盛景微	2024年1月17日	1-6个月(含)	新股流通受限	38.18	38.90	31	1,183.58	1,205.90	-
603350	安乃达	2024年6月26日	1-6个月(含)	新股流通受限	20.56	20.56	57	1,171.92	1,171.92	-
603381	永臻股份	2024年6月19日	1-6个月(含)	新股流通受限	23.35	25.13	45	1,050.75	1,130.85	-
603312	西典新能	2024年1月4日	1-6个月(含)	新股流通受限	29.02	25.36	42	1,218.84	1,065.12	-
603285	键邦股份	2024年6月28日	1-6个月(含)	新股流通受限	18.65	18.65	53	988.45	988.45	-

注：1、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

2、基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起6个月内不得转让。

3、基金作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起12个月内不得转让。

4、基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后6个月内不得转让。

#### 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

本基金是一只偏股混合型证券投资基金，属于较高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、货币市场工具投资等。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“风险和收益相匹配”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建设银行，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**

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债券投资。

#### **6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### **6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

### **6.4.13.3 流动性风险**

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

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

于 2024 年 6 月 30 日，除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以

内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

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

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

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



#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	8,865,001.08	-	-	-	8,865,001.08
结算备付金	617,160.57	-	-	-	617,160.57
存出保证金	23,842.32	-	-	-	23,842.32
交易性金融资产	-	-	-	99,369,037.87	99,369,037.87
应收申购款	-	-	-	27,266.58	27,266.58
资产总计	9,506,003.97	-	-	99,396,304.45	108,902,308.42
负债					
应付赎回款	-	-	-	19,926.01	19,926.01
应付管理人报酬	-	-	-	136,085.56	136,085.56
应付托管费	-	-	-	22,680.93	22,680.93
其他负债	-	-	-	614,962.47	614,962.47
负债总计	-	-	-	793,654.97	793,654.97
利率敏感度缺口	9,506,003.97	-	-	98,602,649.48	108,108,653.45
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	9,913,516.19	-	-	-	9,913,516.19
结算备付金	798,720.51	-	-	-	798,720.51
存出保证金	31,057.40	-	-	-	31,057.40
交易性金融资产	-	-	-	117,544,458.78	117,544,458.78
应收申购款	-	-	-	21,686.60	21,686.60

资产总计	10,743,294.10	-	-	117,566,145.38	128,309,439.48
负债					
应付赎回款		-	-	151,383.69	151,383.69
应付管理人报酬		-	-	161,415.61	161,415.61
应付托管费		-	-	26,902.60	26,902.60
其他负债		-	-	721,858.13	721,858.13
负债总计		-	-	1,061,560.03	1,061,560.03
利率敏感度缺口	10,743,294.10	-	-	-116,504,585.35	127,247,879.45

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，本基金未持有交易性债券投资(2023 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)占基金资产的 60%-95%，固定收益类资产占基金资产的 0%-35%，权证占基金资产净值的 0%-3%，并保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计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。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	99,369,037.87	91.92	117,544,458.78	92.37
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	99,369,037.87	91.92	117,544,458.78	92.37

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	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)
	沪深 300 指数上升 5%	5,700,000.00	4,870,000.00
	沪深 300 指数下降 5%	-5,700,000.00	-4,870,000.00

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次: 相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次: 除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次: 相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位: 人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	99,311,801.76	117,369,806.23
第二层次	21,469.33	14,911.23
第三层次	35,766.78	159,741.32
合计	99,369,037.87	117,544,458.78

#### 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。

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

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	99,369,037.87	91.25
	其中：股票	99,369,037.87	91.25
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-

4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	9,482,161.65	8.71
8	其他各项资产	51,108.90	0.05
9	合计	108,902,308.42	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	337,892.00	0.31
B	采矿业	8,337,936.62	7.71
C	制造业	66,007,810.20	61.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,657,405.86	4.31
E	建筑业	1,262,024.00	1.17
F	批发和零售业	1,416,788.36	1.31
G	交通运输、仓储和邮政业	1,741,710.40	1.61
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,792,335.31	2.58
J	金融业	10,145,241.52	9.38
K	房地产业	14,994.00	0.01
L	租赁和商务服务业	516,401.00	0.48
M	科学研究和技术服务业	845,502.00	0.78
N	水利、环境和公共设施管理业	508,607.60	0.47
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	275,768.00	0.26
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	439,629.00	0.41
S	综合	68,992.00	0.06
	合计	99,369,037.87	91.92

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	---------	--------------

1	000333	美的集团	25,900	1,670,550.00	1.55
2	601899	紫金矿业	87,200	1,532,104.00	1.42
3	300502	新易盛	14,100	1,488,255.00	1.38
4	601009	南京银行	120,600	1,253,034.00	1.16
5	300628	亿联网络	32,500	1,195,025.00	1.11
6	688578	艾力斯	17,700	1,128,198.00	1.04
7	600985	淮北矿业	55,113	922,591.62	0.85
8	603658	安图生物	19,700	907,579.00	0.84
9	688408	中信博	9,700	893,176.00	0.83
10	300308	中际旭创	6,420	885,189.60	0.82
11	601328	交通银行	117,100	874,737.00	0.81
12	605333	沪光股份	31,300	871,705.00	0.81
13	002475	立讯精密	22,100	868,751.00	0.80
14	603298	杭叉集团	43,820	860,624.80	0.80
15	002028	思源电气	12,700	849,630.00	0.79
16	000933	神火股份	41,000	829,430.00	0.77
17	003006	百亚股份	34,800	824,760.00	0.76
18	000921	海信家电	25,300	815,672.00	0.75
19	601800	中国交建	91,200	815,328.00	0.75
20	600919	江苏银行	108,300	804,669.00	0.74
21	688278	特宝生物	14,900	797,895.00	0.74
22	600660	福耀玻璃	16,500	790,350.00	0.73
23	300857	协创数据	13,700	780,900.00	0.72
24	601088	中国神华	17,500	776,475.00	0.72
25	600036	招商银行	22,400	765,856.00	0.71
26	600900	长江电力	25,900	749,028.00	0.69
27	601799	星宇股份	6,500	728,260.00	0.67
28	603198	迎驾贡酒	12,500	718,750.00	0.66
29	600809	山西汾酒	3,300	695,904.00	0.64
30	600188	兖矿能源	30,400	690,992.00	0.64
31	688766	普冉股份	7,099	689,809.83	0.64
32	601169	北京银行	117,300	685,032.00	0.63
33	603379	三美股份	16,900	661,466.00	0.61
34	000568	泸州老窖	4,600	660,054.00	0.61
35	300005	探路者	130,900	655,809.00	0.61
36	000544	中原环保	81,500	641,405.00	0.59
37	688138	清溢光电	29,500	634,250.00	0.59
38	601288	农业银行	143,800	626,968.00	0.58
39	000543	皖能电力	68,500	606,225.00	0.56
40	000488	晨鸣纸业	172,500	596,850.00	0.55
41	300573	兴齐眼药	3,588	588,432.00	0.54
42	002463	沪电股份	16,106	587,869.00	0.54
43	600519	贵州茅台	400	586,956.00	0.54

44	301429	森泰股份	36,700	561,510.00	0.52
45	002179	中航光电	14,600	555,530.00	0.51
46	002674	兴业科技	54,200	553,924.00	0.51
47	000883	湖北能源	90,600	544,506.00	0.50
48	688233	神工股份	28,100	541,487.00	0.50
49	603556	海兴电力	11,500	538,545.00	0.50
50	601058	赛轮轮胎	38,300	536,200.00	0.50
51	600480	凌云股份	54,100	531,803.00	0.49
52	600690	海尔智家	18,600	527,868.00	0.49
53	603088	宁波精达	69,800	525,594.00	0.49
54	002594	比亚迪	2,100	525,525.00	0.49
55	601965	中国汽研	31,000	523,590.00	0.48
56	301345	涛涛车业	9,500	523,450.00	0.48
57	603605	珀莱雅	4,700	521,653.00	0.48
58	601838	成都银行	34,100	517,979.00	0.48
59	600114	东睦股份	35,300	507,967.00	0.47
60	300394	天孚通信	5,740	507,530.80	0.47
61	603348	文灿股份	18,300	506,727.00	0.47
62	300773	拉卡拉	40,700	505,901.00	0.47
63	603239	浙江仙通	35,600	488,076.00	0.45
64	300953	震裕科技	9,000	487,800.00	0.45
65	601857	中国石油	46,900	484,008.00	0.45
66	601318	中国平安	11,682	483,167.52	0.45
67	002920	德赛西威	5,500	478,995.00	0.44
68	600315	上海家化	26,900	478,282.00	0.44
69	605599	菜百股份	37,500	477,375.00	0.44
70	688050	爱博医疗	6,500	476,580.00	0.44
71	000423	东阿阿胶	7,400	463,240.00	0.43
72	601916	浙商银行	162,800	449,328.00	0.42
73	603739	蔚蓝生物	34,600	447,032.00	0.41
74	600160	巨化股份	18,500	446,405.00	0.41
75	003021	兆威机电	9,660	445,809.00	0.41
76	603558	健盛集团	44,500	442,775.00	0.41
77	603993	洛阳钼业	51,000	433,500.00	0.40
78	601077	渝农商行	85,800	430,716.00	0.40
79	603809	豪能股份	51,796	418,511.68	0.39
80	301219	腾远钴业	10,800	413,208.00	0.38
81	603228	景旺电子	12,900	410,220.00	0.38
82	605368	蓝天燃气	29,600	403,744.00	0.37
83	600642	申能股份	45,200	399,116.00	0.37
84	600398	海澜之家	42,400	391,776.00	0.36
85	600183	生益科技	18,500	389,610.00	0.36
86	605183	确成股份	24,200	374,132.00	0.35

87	000338	潍柴动力	23,000	373,520.00	0.35
88	301327	华宝新能	6,500	372,450.00	0.34
89	600926	杭州银行	28,300	369,315.00	0.34
90	603786	科博达	5,700	365,655.00	0.34
91	300832	新产业	5,400	364,176.00	0.34
92	601225	陕西煤业	13,700	353,049.00	0.33
93	600025	华能水电	32,600	351,428.00	0.33
94	601658	邮储银行	69,100	350,337.00	0.32
95	000928	中钢国际	62,600	347,430.00	0.32
96	002139	拓邦股份	32,500	345,150.00	0.32
97	601127	赛力斯	3,700	337,144.00	0.31
98	603337	杰克股份	12,800	336,896.00	0.31
99	601633	长城汽车	13,200	333,960.00	0.31
100	601666	平煤股份	29,400	329,280.00	0.30
101	600901	江苏金租	64,900	327,745.00	0.30
102	300679	电连技术	8,100	325,863.00	0.30
103	601398	工商银行	56,500	322,050.00	0.30
104	300552	万集科技	8,600	321,468.00	0.30
105	688253	英诺特	8,300	316,313.00	0.29
106	603515	欧普照明	18,000	312,120.00	0.29
107	300638	广和通	18,100	309,510.00	0.29
108	600547	山东黄金	11,100	303,918.00	0.28
109	601717	郑煤机	20,500	303,400.00	0.28
110	600348	华阳股份	30,200	300,792.00	0.28
111	002372	伟星新材	19,400	299,148.00	0.28
112	688076	诺泰生物	3,800	297,464.00	0.28
113	600000	浦发银行	35,900	295,457.00	0.27
114	601888	中国中免	4,700	293,703.00	0.27
115	601919	中远海控	18,900	292,761.00	0.27
116	688498	源杰科技	2,200	288,178.00	0.27
117	300761	立华股份	12,500	283,000.00	0.26
118	688019	安集科技	2,226	280,030.80	0.26
119	002668	TCL 智家	30,600	277,236.00	0.26
120	688510	航亚科技	15,050	277,070.50	0.26
121	002340	格林美	42,800	272,636.00	0.25
122	601166	兴业银行	15,300	269,586.00	0.25
123	002922	伊戈尔	12,200	266,692.00	0.25
124	002048	宁波华翔	20,300	262,682.00	0.24
125	301162	国能日新	6,000	261,360.00	0.24
126	000526	学大教育	4,200	258,720.00	0.24
127	688631	莱斯信息	4,121	255,584.42	0.24
128	002128	电投能源	12,000	253,200.00	0.23
129	000977	浪潮信息	6,900	250,953.00	0.23



130	601229	上海银行	34,300	249,018.00	0.23
131	300207	欣旺达	16,200	245,754.00	0.23
132	600285	羚锐制药	9,900	239,679.00	0.22
133	002755	奥赛康	24,800	239,320.00	0.22
134	300181	佐力药业	15,800	238,896.00	0.22
135	688629	华丰科技	9,000	237,240.00	0.22
136	002023	海特高新	25,800	236,070.00	0.22
137	603486	科沃斯	5,000	235,900.00	0.22
138	688022	瀚川智能	17,200	235,812.00	0.22
139	688169	石头科技	600	235,560.00	0.22
140	002928	华夏航空	37,000	234,580.00	0.22
141	688095	福昕软件	5,000	229,050.00	0.21
142	688127	蓝特光学	12,250	225,277.50	0.21
143	300482	万孚生物	8,966	218,770.40	0.20
144	688283	坤恒顺维	6,200	213,156.00	0.20
145	002648	卫星化学	11,400	204,972.00	0.19
146	301061	匠心家居	4,200	197,232.00	0.18
147	600489	中金黄金	13,100	193,880.00	0.18
148	002371	北方华创	600	191,934.00	0.18
149	002155	湖南黄金	10,400	188,240.00	0.17
150	600938	中国海油	5,700	188,100.00	0.17
151	000725	京东方 A	45,100	184,459.00	0.17
152	003019	宸展光电	6,860	173,763.80	0.16
153	603889	新澳股份	22,300	172,602.00	0.16
154	603408	建霖家居	13,000	171,470.00	0.16
155	601988	中国银行	36,200	167,244.00	0.15
156	603160	汇顶科技	2,400	165,000.00	0.15
157	601688	华泰证券	13,300	164,787.00	0.15
158	300979	华利集团	2,700	164,295.00	0.15
159	300049	福瑞股份	3,200	161,088.00	0.15
160	601019	山东出版	13,600	160,752.00	0.15
161	300384	三联虹普	12,100	158,752.00	0.15
162	600256	广汇能源	22,800	152,760.00	0.14
163	001965	招商公路	12,800	151,808.00	0.14
164	688336	三生国健	7,400	150,590.00	0.14
165	601098	中南传媒	11,500	142,830.00	0.13
166	603113	金能科技	25,900	141,673.00	0.13
167	002130	沃尔核材	9,800	138,376.00	0.13
168	002003	伟星股份	11,000	138,050.00	0.13
169	300577	开润股份	6,600	137,478.00	0.13
170	002106	莱宝高科	12,500	136,250.00	0.13
171	603686	福龙马	17,800	135,636.00	0.13
172	002014	永新股份	14,300	135,564.00	0.13

173	688036	传音控股	1,760	134,710.40	0.12
174	002035	华帝股份	21,600	134,568.00	0.12
175	000600	建投能源	21,100	132,930.00	0.12
176	601598	中国外运	23,600	132,868.00	0.12
177	603855	华荣股份	6,000	132,660.00	0.12
178	601126	四方股份	6,900	132,618.00	0.12
179	600737	中粮糖业	13,700	131,383.00	0.12
180	002267	陕天然气	17,300	130,788.00	0.12
181	601179	中国西电	16,200	130,248.00	0.12
182	002540	亚太科技	24,400	129,076.00	0.12
183	000157	中联重科	16,800	129,024.00	0.12
184	002991	甘源食品	2,100	127,365.00	0.12
185	002466	天齐锂业	4,200	125,622.00	0.12
186	601566	九牧王	14,900	125,458.00	0.12
187	002032	苏泊尔	2,500	125,250.00	0.12
188	300636	同和药业	12,300	125,091.00	0.12
189	002532	天山铝业	15,200	123,272.00	0.11
190	301308	江波龙	1,300	123,162.00	0.11
191	600219	南山铝业	32,300	123,063.00	0.11
192	300790	宇瞳光学	9,100	122,850.00	0.11
193	605166	聚合顺	11,700	122,733.00	0.11
194	603008	喜临门	7,000	121,310.00	0.11
195	000426	兴业银锡	8,800	119,504.00	0.11
196	603225	新凤鸣	7,600	118,484.00	0.11
197	002533	金杯电工	11,900	118,405.00	0.11
198	600362	江西铜业	5,000	118,400.00	0.11
199	300673	佩蒂股份	9,000	118,080.00	0.11
200	002697	红旗连锁	25,400	117,602.00	0.11
201	688213	思特威	2,400	116,400.00	0.11
202	603093	南华期货	13,300	115,178.00	0.11
203	603158	腾龙股份	16,300	114,752.00	0.11
204	688566	吉贝尔	5,100	114,750.00	0.11
205	688108	赛诺医疗	12,800	114,432.00	0.11
206	002415	海康威视	3,700	114,367.00	0.11
207	600546	山煤国际	7,800	114,036.00	0.11
208	600395	盘江股份	18,800	112,988.00	0.10
209	603600	永艺股份	10,700	111,708.00	0.10
210	002840	华统股份	6,600	109,494.00	0.10
211	603368	柳药集团	6,200	108,500.00	0.10
212	600066	宇通客车	4,200	108,360.00	0.10
213	600582	天地科技	15,300	105,417.00	0.10
214	601101	昊华能源	11,400	104,766.00	0.10
215	688676	金盘科技	2,000	104,300.00	0.10

216	300815	玉禾田	8,800	102,432.00	0.09
217	601898	中煤能源	8,200	102,336.00	0.09
218	600873	梅花生物	10,200	102,204.00	0.09
219	301055	张小泉	8,600	101,996.00	0.09
220	688030	山石网科	9,641	100,748.45	0.09
221	688656	浩欧博	4,387	100,593.91	0.09
222	688516	奥特维	2,400	100,344.00	0.09
223	603501	韦尔股份	1,000	99,370.00	0.09
224	002612	朗姿股份	7,100	98,122.00	0.09
225	002705	新宝股份	6,900	97,083.00	0.09
226	001230	劲旅环境	6,960	96,674.40	0.09
227	600015	华夏银行	15,000	96,000.00	0.09
228	002468	申通快递	11,400	95,760.00	0.09
229	002315	焦点科技	3,500	94,360.00	0.09
230	002942	新农股份	8,000	94,320.00	0.09
231	002937	兴瑞科技	4,000	93,240.00	0.09
232	000513	丽珠集团	2,500	93,025.00	0.09
233	000900	现代投资	25,300	92,598.00	0.09
234	000538	云南白药	1,800	92,070.00	0.09
235	301130	西点药业	3,900	91,377.00	0.08
236	603727	博迈科	6,900	90,804.00	0.08
237	600887	伊利股份	3,500	90,440.00	0.08
238	603150	万朗磁塑	3,500	87,640.00	0.08
239	300783	三只松鼠	4,000	87,480.00	0.08
240	605068	明新旭腾	6,600	86,988.00	0.08
241	600941	中国移动	800	86,000.00	0.08
242	002154	报喜鸟	15,800	85,952.00	0.08
243	300492	华图山鼎	900	84,780.00	0.08
244	600707	彩虹股份	12,200	83,082.00	0.08
245	601168	西部矿业	4,600	82,570.00	0.08
246	600803	新奥股份	3,900	81,120.00	0.08
247	603979	金诚信	1,600	80,848.00	0.07
248	600619	海立股份	15,500	80,135.00	0.07
249	688020	方邦股份	2,400	80,064.00	0.07
250	605377	华旺科技	6,040	80,030.00	0.07
251	002152	广电运通	7,600	79,496.00	0.07
252	603259	药明康德	2,000	78,380.00	0.07
253	000975	银泰黄金	4,800	78,192.00	0.07
254	300748	金力永磁	6,000	77,760.00	0.07
255	600018	上港集团	13,400	77,452.00	0.07
256	301269	华大九天	1,000	77,050.00	0.07
257	603351	威尔药业	3,800	76,988.00	0.07
258	301196	唯科科技	2,600	76,778.00	0.07

259	601702	华峰铝业	4,200	76,692.00	0.07
260	600694	大商股份	4,440	74,636.40	0.07
261	000983	山西焦煤	7,200	74,232.00	0.07
262	688058	宝兰德	3,560	74,154.80	0.07
263	002752	昇兴股份	14,600	73,876.00	0.07
264	601369	陕鼓动力	9,200	73,784.00	0.07
265	600760	中航沈飞	1,800	72,180.00	0.07
266	300750	宁德时代	400	72,012.00	0.07
267	600308	华泰股份	22,800	71,592.00	0.07
268	688767	博拓生物	2,800	70,196.00	0.06
269	603568	伟明环保	3,400	69,972.00	0.06
270	000690	宝新能源	13,600	69,360.00	0.06
271	600673	东阳光	9,800	68,992.00	0.06
272	601811	新华文轩	4,900	68,649.00	0.06
273	601728	中国电信	11,100	68,265.00	0.06
274	002572	索菲亚	4,400	67,452.00	0.06
275	601601	中国太保	2,400	66,864.00	0.06
276	002273	水晶光电	3,900	66,222.00	0.06
277	300435	中泰股份	5,600	65,912.00	0.06
278	601816	京沪高铁	12,200	65,514.00	0.06
279	601665	齐鲁银行	13,300	65,303.00	0.06
280	603583	捷昌驱动	3,200	65,216.00	0.06
281	600089	特变电工	4,700	65,189.00	0.06
282	601311	骆驼股份	8,100	64,962.00	0.06
283	301045	天禄科技	3,400	64,804.00	0.06
284	600346	恒力石化	4,600	64,170.00	0.06
285	600508	上海能源	4,500	63,675.00	0.06
286	603203	快克智能	2,700	63,666.00	0.06
287	603639	海利尔	5,200	63,284.00	0.06
288	603897	长城科技	3,600	63,180.00	0.06
289	002737	葵花药业	2,700	63,126.00	0.06
290	601872	招商轮船	7,400	62,530.00	0.06
291	300048	合康新能	13,400	62,042.00	0.06
292	600718	东软集团	7,500	62,025.00	0.06
293	688486	龙迅股份	1,080	61,884.00	0.06
294	688352	颀中科技	5,400	61,614.00	0.06
295	000063	中兴通讯	2,200	61,534.00	0.06
296	603115	海星股份	5,900	61,360.00	0.06
297	002563	森马服饰	10,500	61,005.00	0.06
298	000848	承德露露	7,700	60,522.00	0.06
299	002919	名臣健康	5,200	60,372.00	0.06
300	601333	广深铁路	18,600	60,264.00	0.06
301	603871	嘉友国际	3,360	59,438.40	0.05

302	000950	重药控股	12,200	59,414.00	0.05
303	000737	北方铜业	6,400	59,392.00	0.05
304	603885	吉祥航空	5,400	59,346.00	0.05
305	003816	中国广核	12,800	59,264.00	0.05
306	688018	乐鑫科技	600	59,208.00	0.05
307	600585	海螺水泥	2,500	58,975.00	0.05
308	603496	恒为科技	2,400	58,680.00	0.05
309	603281	江瀚新材	2,600	58,370.00	0.05
310	603187	海容冷链	5,000	58,300.00	0.05
311	688208	道通科技	2,400	57,936.00	0.05
312	601231	环旭电子	3,600	57,780.00	0.05
313	603055	台华新材	5,700	57,741.00	0.05
314	600916	中国黄金	6,000	57,720.00	0.05
315	600497	驰宏锌锗	10,800	57,672.00	0.05
316	301182	凯旺科技	2,600	57,668.00	0.05
317	603986	兆易创新	600	57,372.00	0.05
318	601500	通用股份	10,700	57,138.00	0.05
319	601528	瑞丰银行	12,100	57,112.00	0.05
320	603948	建业股份	3,500	56,980.00	0.05
321	300866	安克创新	800	56,968.00	0.05
322	600998	九州通	11,642	56,812.96	0.05
323	000821	京山轻机	5,000	56,650.00	0.05
324	688234	天岳先进	1,200	56,304.00	0.05
325	002707	众信旅游	9,800	56,252.00	0.05
326	002245	蔚蓝锂芯	7,200	55,800.00	0.05
327	002345	潮宏基	11,800	55,696.00	0.05
328	000409	云鼎科技	6,900	55,683.00	0.05
329	000420	吉林化纤	17,600	55,616.00	0.05
330	603393	新天然气	1,600	55,584.00	0.05
331	600095	湘财股份	9,300	55,428.00	0.05
332	603181	皇马科技	6,088	54,731.12	0.05
333	603279	景津装备	2,500	54,225.00	0.05
334	002396	星网锐捷	4,100	54,161.00	0.05
335	300059	东方财富	5,000	52,800.00	0.05
336	600966	博汇纸业	11,000	52,580.00	0.05
337	000906	浙商中拓	7,700	51,898.00	0.05
338	603087	甘李药业	1,100	50,952.00	0.05
339	601700	风范股份	11,600	50,924.00	0.05
340	601137	博威合金	3,300	50,292.00	0.05
341	002911	佛燃能源	5,499	50,260.86	0.05
342	603296	华勤技术	900	49,707.00	0.05
343	688389	普门科技	3,000	48,780.00	0.05
344	600956	新天绿能	5,900	48,203.00	0.04

345	000997	新大陆	3,400	47,294.00	0.04
346	002088	鲁阳节能	3,900	47,151.00	0.04
347	603303	得邦照明	4,100	47,068.00	0.04
348	603730	岱美股份	4,730	47,016.20	0.04
349	002293	罗莱生活	5,800	46,864.00	0.04
350	002701	奥瑞金	11,200	46,592.00	0.04
351	300193	佳士科技	6,200	46,004.00	0.04
352	603878	武进不锈	7,000	45,780.00	0.04
353	002096	易普力	3,800	45,220.00	0.04
354	603816	顾家家居	1,400	45,206.00	0.04
355	603886	元祖股份	3,000	45,180.00	0.04
356	601021	春秋航空	800	45,064.00	0.04
357	605050	福然德	5,100	44,931.00	0.04
358	000923	河钢资源	2,600	44,772.00	0.04
359	603579	荣泰健康	2,860	44,215.60	0.04
360	603587	地素时尚	3,600	44,208.00	0.04
361	300470	中密控股	1,300	43,953.00	0.04
362	601339	百隆东方	8,200	42,722.00	0.04
363	600284	浦东建设	8,000	42,720.00	0.04
364	301236	软通动力	1,200	42,252.00	0.04
365	002947	恒铭达	1,200	42,240.00	0.04
366	000596	古井贡酒	200	42,214.00	0.04
367	300146	汤臣倍健	3,100	42,005.00	0.04
368	002508	老板电器	1,900	41,990.00	0.04
369	600323	瀚蓝环境	2,000	41,800.00	0.04
370	300921	南凌科技	2,400	41,568.00	0.04
371	002841	视源股份	1,400	41,342.00	0.04
372	688219	会通股份	5,300	41,181.00	0.04
373	603699	纽威股份	2,400	41,088.00	0.04
374	603518	锦泓集团	4,600	40,480.00	0.04
375	002304	洋河股份	500	40,370.00	0.04
376	600729	重庆百货	1,800	40,248.00	0.04
377	002839	张家港行	10,000	40,200.00	0.04
378	301185	鸥玛软件	2,800	40,124.00	0.04
379	601860	紫金银行	16,000	40,000.00	0.04
380	603119	浙江荣泰	2,250	39,870.00	0.04
381	300002	神州泰岳	4,900	39,788.00	0.04
382	603053	成都燃气	4,100	39,606.00	0.04
383	002557	洽洽食品	1,400	39,466.00	0.04
384	002043	兔宝宝	3,800	39,406.00	0.04
385	688075	安旭生物	1,169	39,383.61	0.04
386	688480	赛恩斯	1,400	39,004.00	0.04
387	002517	恺英网络	4,050	38,677.50	0.04

388	603995	甬金股份	2,200	38,544.00	0.04
389	002997	瑞鹄模具	1,200	38,364.00	0.04
390	000030	富奥股份	7,800	38,298.00	0.04
391	603035	常熟汽饰	3,000	38,040.00	0.04
392	002004	华邦健康	10,000	38,000.00	0.04
393	603689	皖天然气	4,600	37,812.00	0.03
394	002242	九阳股份	3,600	37,728.00	0.03
395	301498	乖宝宠物	700	37,660.00	0.03
396	000703	恒逸石化	5,300	37,577.00	0.03
397	300415	伊之密	1,800	37,404.00	0.03
398	002216	三全食品	3,400	37,332.00	0.03
399	688188	柏楚电子	200	36,910.00	0.03
400	605077	华康股份	2,400	36,600.00	0.03
401	600713	南京医药	8,600	36,292.00	0.03
402	002788	鹭燕医药	4,600	36,248.00	0.03
403	002807	江阴银行	9,600	36,192.00	0.03
403	603519	立霸股份	3,200	36,192.00	0.03
405	003000	劲仔食品	3,000	36,150.00	0.03
406	600790	轻纺城	11,200	36,064.00	0.03
407	600125	铁龙物流	6,000	35,820.00	0.03
408	300349	金卡智能	3,000	35,760.00	0.03
409	603630	拉芳家化	3,400	35,734.00	0.03
410	603444	吉比特	200	35,602.00	0.03
411	603535	嘉诚国际	2,200	35,508.00	0.03
412	603128	华贸物流	6,000	34,620.00	0.03
413	300453	三鑫医疗	5,400	34,506.00	0.03
414	600233	圆通速递	2,200	34,430.00	0.03
415	300121	阳谷华泰	4,400	34,320.00	0.03
416	603323	苏农银行	7,100	34,151.00	0.03
417	300463	迈克生物	3,000	34,140.00	0.03
418	600028	中国石化	5,400	34,128.00	0.03
419	601985	中国核电	3,200	34,112.00	0.03
420	300622	博士眼镜	2,800	34,076.00	0.03
421	002545	东方铁塔	5,000	34,050.00	0.03
422	603800	道森股份	1,700	34,000.00	0.03
423	002550	千红制药	6,300	33,957.00	0.03
424	301087	可孚医疗	1,000	33,900.00	0.03
425	002440	闰土股份	6,200	33,666.00	0.03
426	603112	华翔股份	3,200	33,632.00	0.03
427	002993	奥海科技	900	33,480.00	0.03
428	600035	楚天高速	7,800	33,462.00	0.03
429	000501	武商集团	5,000	33,350.00	0.03
430	600886	国投电力	1,800	32,832.00	0.03

431	603927	中科软	1,800	32,562.00	0.03
432	300304	云意电气	5,000	32,550.00	0.03
433	600309	万华化学	400	32,344.00	0.03
434	002100	天康生物	4,600	31,878.00	0.03
435	000731	四川美丰	4,800	31,824.00	0.03
436	000651	格力电器	800	31,376.00	0.03
437	600433	冠豪高新	11,800	31,270.00	0.03
438	603708	家家悦	3,800	30,818.00	0.03
439	000830	鲁西化工	2,600	30,134.00	0.03
440	000860	顺鑫农业	1,800	30,132.00	0.03
441	002158	汉钟精机	1,800	30,096.00	0.03
442	002236	大华股份	1,900	29,374.00	0.03
443	603606	东方电缆	600	29,286.00	0.03
444	300408	三环集团	1,000	29,190.00	0.03
445	300760	迈瑞医疗	100	29,091.00	0.03
446	600987	航民股份	4,100	28,946.00	0.03
447	603609	禾丰股份	4,400	28,776.00	0.03
448	002649	博彦科技	3,600	28,656.00	0.03
449	603365	水星家纺	1,800	28,170.00	0.03
450	300973	立高食品	1,000	28,090.00	0.03
451	002489	浙江永强	11,800	27,966.00	0.03
452	300525	博思软件	2,200	27,940.00	0.03
453	600989	宝丰能源	1,600	27,728.00	0.03
454	300791	仙乐健康	1,100	27,720.00	0.03
455	001338	永顺泰	2,800	27,440.00	0.03
456	600688	上海石化	10,300	26,883.00	0.02
457	605266	健之佳	1,000	25,950.00	0.02
458	300124	汇川技术	500	25,650.00	0.02
459	002831	裕同科技	1,000	25,590.00	0.02
460	600845	宝信软件	800	25,544.00	0.02
461	600211	西藏药业	780	25,412.40	0.02
462	688588	凌志软件	3,600	24,660.00	0.02
463	002091	江苏国泰	3,600	24,516.00	0.02
464	600132	重庆啤酒	400	24,280.00	0.02
465	601975	招商南油	6,600	23,694.00	0.02
466	002311	海大集团	500	23,525.00	0.02
467	688362	甬矽电子	1,200	23,352.00	0.02
468	688150	莱特光电	1,200	23,280.00	0.02
469	688100	威胜信息	600	22,890.00	0.02
470	300662	科锐国际	1,400	22,582.00	0.02
471	603328	依顿电子	2,800	22,008.00	0.02
472	001336	楚环科技	1,000	21,850.00	0.02
473	603738	泰晶科技	1,600	21,824.00	0.02



474	002832	比音勒芬	900	21,753.00	0.02
475	605188	国光连锁	2,800	21,700.00	0.02
476	600662	外服控股	5,400	21,654.00	0.02
477	600761	安徽合力	1,000	21,640.00	0.02
478	002635	安洁科技	1,400	21,616.00	0.02
479	600839	四川长虹	4,800	21,552.00	0.02
480	000563	陕国投 A	7,800	21,450.00	0.02
481	600993	马应龙	800	21,336.00	0.02
482	601163	三角轮胎	1,400	21,308.00	0.02
483	600859	王府井	1,800	21,132.00	0.02
484	605198	安德利	800	21,120.00	0.02
485	603299	苏盐井神	2,200	20,900.00	0.02
486	002891	中宠股份	1,000	20,870.00	0.02
487	600461	洪城环境	1,800	20,844.00	0.02
488	300033	同花顺	200	20,740.00	0.02
489	688087	英科再生	800	20,704.00	0.02
490	600827	百联股份	2,800	20,664.00	0.02
491	002332	仙琚制药	1,800	20,538.00	0.02
492	601020	华钰矿业	1,600	20,480.00	0.02
493	600278	东方创业	3,800	20,406.00	0.02
494	601827	三峰环境	2,400	20,376.00	0.02
495	600050	中国联通	4,300	20,210.00	0.02
496	605128	上海沿浦	724	20,192.36	0.02
497	600968	海油发展	4,900	20,188.00	0.02
498	600598	北大荒	1,600	19,984.00	0.02
499	600406	国电南瑞	800	19,968.00	0.02
500	600882	妙可蓝多	1,600	19,952.00	0.02
501	000700	模塑科技	3,800	19,950.00	0.02
502	605339	南侨食品	1,400	19,908.00	0.02
503	603610	麒盛科技	2,000	19,760.00	0.02
504	603989	艾华集团	1,400	19,684.00	0.02
505	300532	今天国际	1,600	19,664.00	0.02
506	301359	东南电子	800	19,520.00	0.02
507	600757	长江传媒	2,400	19,344.00	0.02
508	600420	国药现代	1,800	19,224.00	0.02
509	603877	太平鸟	1,400	19,222.00	0.02
510	300856	科思股份	600	19,206.00	0.02
511	601298	青岛港	2,000	19,120.00	0.02
512	601877	正泰电器	1,000	19,060.00	0.02
513	000735	罗牛山	4,400	19,052.00	0.02
514	603666	亿嘉和	1,200	18,936.00	0.02
515	301127	天源环保	1,600	18,912.00	0.02
516	601000	唐山港	4,000	18,800.00	0.02

517	002252	上海莱士	2,400	18,768.00	0.02
518	688288	鸿泉物联	1,200	18,756.00	0.02
519	600674	川投能源	1,000	18,750.00	0.02
520	601628	中国人寿	600	18,630.00	0.02
521	002845	同兴达	1,400	18,508.00	0.02
522	600750	江中药业	800	18,488.00	0.02
523	600875	东方电气	1,000	18,450.00	0.02
524	603511	爱慕股份	1,500	18,420.00	0.02
525	600236	桂冠电力	2,400	18,408.00	0.02
526	605111	新洁能	600	18,354.00	0.02
527	603032	德新科技	1,600	18,288.00	0.02
528	300433	蓝思科技	1,000	18,250.00	0.02
529	000719	中原传媒	1,800	18,198.00	0.02
530	603919	金徽酒	1,000	18,170.00	0.02
531	601128	常熟银行	2,400	18,168.00	0.02
532	600850	电科数字	1,000	18,100.00	0.02
533	002749	国光股份	1,200	18,048.00	0.02
534	000810	创维数字	2,100	18,018.00	0.02
535	002643	万润股份	1,800	18,000.00	0.02
536	603688	石英股份	600	17,766.00	0.02
537	600176	中国巨石	1,600	17,680.00	0.02
538	600039	四川路桥	2,200	17,358.00	0.02
539	688118	普元信息	1,200	17,316.00	0.02
540	301169	零点有数	600	17,280.00	0.02
541	601808	中海油服	1,000	17,200.00	0.02
542	603233	大参林	1,200	17,160.00	0.02
543	688328	深科达	1,200	17,076.00	0.02
544	605098	行动教育	400	17,048.00	0.02
545	301135	瑞德智能	800	17,032.00	0.02
546	002027	分众传媒	2,800	16,968.00	0.02
547	600795	国电电力	2,800	16,772.00	0.02
548	601958	金钼股份	1,600	16,656.00	0.02
549	300130	新国都	1,000	16,640.00	0.02
550	000683	远兴能源	2,400	16,584.00	0.02
551	601138	工业富联	600	16,440.00	0.02
552	301052	果麦文化	800	16,400.00	0.02
553	301232	飞沃科技	600	16,332.00	0.02
554	600483	福能股份	1,400	16,324.00	0.02
555	605016	百龙创园	800	16,296.00	0.02
556	301313	凡拓数创	800	16,280.00	0.02
557	002790	瑞尔特	1,800	16,254.00	0.02
558	688168	安博通	600	16,140.00	0.01
559	002567	唐人神	3,000	16,080.00	0.01

560	301159	三维天地	600	16,002.00	0.01
561	601233	桐昆股份	1,000	15,960.00	0.01
562	301290	东星医疗	800	15,928.00	0.01
563	002938	鹏鼎控股	400	15,904.00	0.01
564	300498	温氏股份	800	15,856.00	0.01
565	688077	大地熊	1,000	15,830.00	0.01
566	001278	一彬科技	1,000	15,810.00	0.01
567	603565	中谷物流	1,800	15,732.00	0.01
568	688369	致远互联	1,000	15,730.00	0.01
569	600026	中远海能	1,000	15,610.00	0.01
570	300594	朗进科技	1,100	15,422.00	0.01
571	688517	金冠电气	1,100	15,378.00	0.01
572	688175	高凌信息	1,040	15,371.20	0.01
573	301220	亚香股份	600	15,312.00	0.01
574	300533	冰川网络	1,100	15,268.00	0.01
575	603908	牧高笛	760	15,245.60	0.01
576	688355	明志科技	1,136	15,245.12	0.01
577	603822	嘉澳环保	800	15,128.00	0.01
578	605287	德才股份	1,200	15,108.00	0.01
579	688448	磁谷科技	800	15,104.00	0.01
580	600663	陆家嘴	1,700	14,994.00	0.01
581	688220	翱捷科技	400	14,984.00	0.01
582	688260	昀冢科技	1,000	14,870.00	0.01
583	002601	龙佰集团	800	14,856.00	0.01
584	600861	北京人力	900	14,688.00	0.01
585	600893	航发动力	400	14,620.00	0.01
586	688450	光格科技	600	14,604.00	0.01
587	300853	申昊科技	1,000	14,540.00	0.01
588	301063	海锅股份	1,000	14,340.00	0.01
589	605180	华生科技	1,200	14,220.00	0.01
590	001299	美能能源	1,200	14,160.00	0.01
591	688323	瑞华泰	1,400	14,098.00	0.01
592	688768	容知日新	600	14,046.00	0.01
593	301161	唯万密封	900	13,977.00	0.01
594	603968	醋化股份	1,400	13,888.00	0.01
595	301235	华康医疗	800	13,880.00	0.01
596	603151	邦基科技	1,200	13,848.00	0.01
597	688186	广大特材	1,400	13,622.00	0.01
598	300813	泰林生物	800	13,560.00	0.01
599	001268	联合精密	800	13,544.00	0.01
600	605336	帅丰电器	1,200	13,524.00	0.01
601	300251	光线传媒	1,600	13,456.00	0.01
602	301118	恒光股份	900	13,419.00	0.01

603	003011	海象新材	1,000	13,410.00	0.01
604	688600	皖仪科技	1,000	13,370.00	0.01
605	001366	播恩集团	1,200	13,320.00	0.01
606	603051	鹿山新材	600	13,098.00	0.01
607	688071	华依科技	600	13,002.00	0.01
608	688737	中自科技	800	12,960.00	0.01
609	301335	天元宠物	800	12,712.00	0.01
610	301158	德石股份	1,000	12,370.00	0.01
611	688092	爱科科技	560	11,956.00	0.01
612	688670	金迪克	1,000	11,780.00	0.01
613	603350	安乃达	568	11,678.08	0.01
614	601216	君正集团	3,000	11,070.00	0.01
615	603137	恒尚节能	1,000	10,200.00	0.01
616	603285	键邦股份	525	9,791.25	0.01
617	000661	长春高新	100	9,177.00	0.01
618	688709	成都华微	389	7,404.71	0.01
619	688692	达梦数据	39	6,822.27	0.01
620	688691	灿芯股份	137	5,823.87	0.01
621	688530	欧莱新材	317	5,103.70	0.00
622	601033	永兴股份	170	2,713.20	0.00
623	688584	上海合晶	166	2,637.74	0.00
624	603341	龙旗科技	62	2,324.38	0.00
625	603082	北自科技	56	1,651.44	0.00
626	603325	博隆技术	20	1,361.20	0.00
627	603375	盛景微	31	1,205.90	0.00
628	603381	永臻股份	45	1,130.85	0.00
629	603312	西典新能	42	1,065.12	0.00
630	301391	卡莱特	20	875.60	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300394	天孚通信	4,613,699.00	3.63
2	688278	特宝生物	3,758,607.41	2.95
3	003000	劲仔食品	3,622,277.00	2.85
4	601899	紫金矿业	3,620,832.00	2.85
5	603298	杭叉集团	3,277,703.18	2.58
6	603338	浙江鼎力	2,909,612.00	2.29
7	000338	潍柴动力	2,818,068.00	2.21
8	601666	平煤股份	2,763,333.00	2.17
9	688041	海光信息	2,744,832.78	2.16
10	002262	恩华药业	2,743,618.00	2.16

11	600985	淮北矿业	2,730,071.19	2.15
12	002648	卫星化学	2,657,032.00	2.09
13	300628	亿联网络	2,655,043.00	2.09
14	000921	海信家电	2,636,292.00	2.07
15	603556	海兴电力	2,561,182.50	2.01
16	002463	沪电股份	2,470,147.00	1.94
17	300181	佐力药业	2,420,365.00	1.90
18	600919	江苏银行	2,358,339.00	1.85
19	000933	神火股份	2,354,385.00	1.85
20	600188	兖矿能源	2,350,162.00	1.85

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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300394	天孚通信	5,499,621.00	4.32
2	601899	紫金矿业	4,944,796.00	3.89
3	002262	恩华药业	4,150,263.40	3.26
4	000921	海信家电	4,108,769.00	3.23
5	000338	潍柴动力	4,104,363.00	3.23
6	003000	劲仔食品	4,075,832.00	3.20
7	603338	浙江鼎力	3,693,417.00	2.90
8	603298	杭叉集团	3,683,347.00	2.89
9	601318	中国平安	3,373,004.76	2.65
10	002594	比亚迪	3,240,560.00	2.55
11	000933	神火股份	3,103,667.00	2.44
12	002463	沪电股份	3,100,875.00	2.44
13	600690	海尔智家	3,026,575.00	2.38
14	603259	药明康德	2,955,699.00	2.32
15	603993	洛阳钼业	2,885,554.00	2.27
16	600066	宇通客车	2,882,920.00	2.27
17	688041	海光信息	2,844,637.94	2.24
18	601288	农业银行	2,809,551.00	2.21
19	600660	福耀玻璃	2,808,341.00	2.21
20	688278	特宝生物	2,786,437.75	2.19
21	600919	江苏银行	2,785,441.00	2.19
22	301004	嘉益股份	2,693,792.00	2.12
23	002648	卫星化学	2,656,266.00	2.09
24	300573	兴齐眼药	2,648,108.00	2.08
25	601666	平煤股份	2,545,729.00	2.00

注：“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成

交单价乘以成交数量) 填列, 不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位: 人民币元

买入股票成本(成交)总额	629,096,356.38
卖出股票收入(成交)总额	646,069,606.95

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金股指期货投资将以套期保值为目的, 主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约, 通过多头或空头套期保值等策略进行操作。具体股指期货投资策略包括: (a) 对冲投资组合的系统性风险; (b) 有效管理现金流量、降低建仓或调仓过程中的冲击成本等。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资于国债期货。该策略符合基金合同的规定。

##### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期没有投资国债期货。

#### 7.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中, 南京银行股份有限公司于 2023 年 8 月 25 日曾受到国家外汇管理局江苏省分局公开处罚。

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

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	23,842.32
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	27,266.58
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	51,108.90

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
31,232	1,879.42	37.52	0.00	58,698,150.67	100.00

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	119,965.98	0.2044

## 8.3 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

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	-
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2012年5月23日） 基金份额总额	552,581,237.45
本报告期期初基金份额总额	67,684,131.52
本报告期基金总申购份额	1,993,594.65
减：本报告期基金总赎回份额	10,979,537.98
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	58,698,188.19

## § 10 重大事件揭示

## 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末未召开基金份额持有人大会。

## 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

## 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

## 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金无投资策略的变化。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期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 (%)	
华创证券	1	358,915,928.57	28.15	339,496.68	28.15	-
德邦证券	1	251,110,240.24	19.70	237,517.65	19.70	-
国泰君安	1	179,774,338.75	14.10	170,053.41	14.10	-
西部证券	1	118,695,570.13	9.31	112,278.13	9.31	-
申万宏源	1	99,699,743.80	7.82	94,307.27	7.82	-
华泰证券	2	95,130,834.96	7.46	89,986.06	7.46	-
海通证券	1	79,055,940.95	6.20	74,779.79	6.20	-
中泰证券	1	48,687,654.85	3.82	46,053.65	3.82	-
中信证券	2	24,274,737.02	1.90	22,961.99	1.90	-
国信证券	1	19,534,833.90	1.53	18,479.13	1.53	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
高盛证券	3	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-

注：（一）本基金本报告期新增交易单元为中信建投。

#### （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，使用其交易单元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。

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

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

### 11.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所

### 11.3 查阅方式

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

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

宏利基金管理有限公司

2024 年 8 月 31 日