# 宏利中证 500 指数增强型证券投资基金
# (LOF)
# 2026 年中期报告

2026 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：2026 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 2026 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

**§1 重要提示及目录 ..... 2**

1.1 重要提示 ..... 2
1.2 目录 ..... 3

**§2 基金简介 ..... 5**

2.1 基金基本情况 ..... 5
2.2 基金产品说明 ..... 5
2.3 基金管理人和基金托管人 ..... 5
2.4 信息披露方式 ..... 6
2.5 其他相关资料 ..... 6

**§3 主要财务指标和基金净值表现 ..... 6**

3.1 主要会计数据和财务指标 ..... 6
3.2 基金净值表现 ..... 6

**§4 管理人报告 ..... 7**

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遵规守信情况的说明 ..... 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 ..... 9
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 ..... 10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 ..... 11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 ..... 11

**§5 托管人报告 ..... 11**

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 ..... 11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 ..... 11
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 ..... 11

**§6 半年度财务会计报告（未经审计） ..... 11**

6.1 资产负债表 ..... 11
6.2 利润表 ..... 13
6.3 净资产变动表 ..... 14
6.4 报表附注 ..... 16

**§7 投资组合报告 ..... 39**

7.1 期末基金资产组合情况 ..... 39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 ..... 39
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 ..... 41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 ..... 49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 ..... 51
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 ..... 51

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 ..... 51
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 ..... 51
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 ..... 51
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 ..... 51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 ..... 52
7.12 投资组合报告附注 ..... 52

**§8 基金份额持有人信息 ..... 53**

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 ..... 53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 ..... 53
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 ..... 53

**§9 开放式基金份额变动 ..... 53**

**§10 重大事件揭示 ..... 53**

10.1 基金份额持有人大会决议 ..... 53
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 ..... 53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 ..... 54
10.4 基金投资策略的改变 ..... 54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 ..... 54
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 ..... 54
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 ..... 54
10.8 其他重大事件 ..... 57

**§11 影响投资者决策的其他重要信息 ..... 58**

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 ..... 58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 ..... 58

**§12 备查文件目录 ..... 58**

12.1 备查文件目录 ..... 58
12.2 存放地点 ..... 58
12.3 查阅方式 ..... 58

# §2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金名称 | 宏利中证 500 指数增强型证券投资基金(LOF) |
| 基金简称 | 宏利 500 指数增强(LOF) |
| 场内简称 | 宏利 500 增强 LOF |
| 基金主代码 | 162216 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2019 年 11 月 6 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 | 102,077,782.92 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 | 2019 年 12 月 5 日 |

## 2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 本基金为股票型指数增强基金，在对中证 500 指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%，力争获取超越标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。 |
| 投资策略 | 本基金采用指数增强型投资策略，在控制与比较基准偏离风险的前提下，综合利用多种量化投资模型和指数增强技术，力争获得超越业绩比较基准的投资收益。 |
| 业绩比较基准 | 95%×中证 500 指数收益率+5%×1 年期定期存款利率（税后） |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型指数增强型基金，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。 |

## 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 | DING WEN CONG（丁闻聪） | 许俊 |
| | 联系电话 | 66577766 | 010-66596688 |
| | 电子邮箱 | irm@manulifefund.com.cn | fxjd_hq@bank-of-china.com |
| 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 | | DING WEN CONG（丁闻聪） | 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 |
| 登载基金中期报告的管理人互联网网址 | https://www.manulifefund.com.cn |
| 基金中期报告置备地点 | 基金管理人、基金托管人的住所 |

## 2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|---|---|---|
| 注册登记机构 | 中国证券登记结算有限公司 | 北京市西城区太平桥大街 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(2026 年 1 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日) |
|---|---|
| 本期已实现收益 | 35,093,140.84 |
| 本期利润 | 36,572,426.15 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.3258 |
| 本期加权平均净值利润率 | 19.29% |
| 本期基金份额净值增长率 | 21.01% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2026 年 6 月 30 日) |
| 期末可供分配利润 | 146,437,901.00 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 1.4346 |
| 期末基金资产净值 | 190,447,259.76 |
| 期末基金份额净值 | 1.8657 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2026 年 6 月 30 日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 115.42% |

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

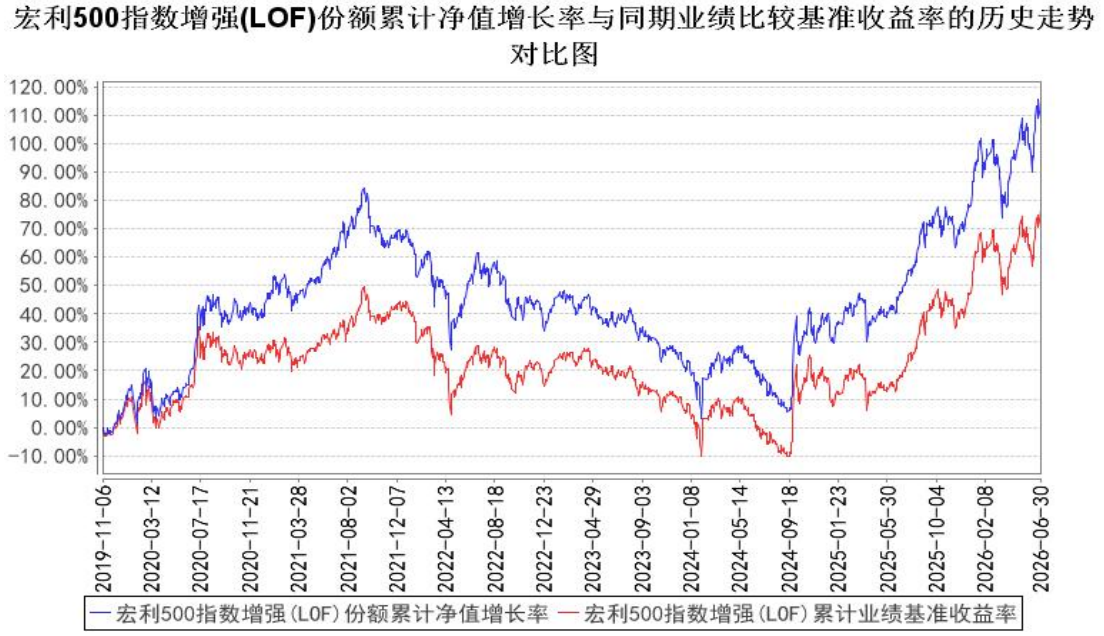
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 20.38% | 1.61% | 17.63% | 1.56% | 2.75% | 0.05% |
| 过去六个月 | 21.01% | 1.59% | 19.96% | 1.58% | 1.05% | 0.01% |
| 过去一年 | 46.77% | 1.31% | 49.77% | 1.35% | -3.00% | -0.04% |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三年 | 55.90% | 1.34% | 48.40% | 1.41% | 7.50% | -0.07% |
| 过去五年 | 31.80% | 1.25% | 31.99% | 1.30% | -0.19% | -0.05% |
| 自基金合同生效起至今 | 115.42% | 1.27% | 76.68% | 1.30% | 38.74% | -0.03% |

注：本基金的业绩比较基准：中证 500 指数收益率*95%+1 年期定期存款利率(税后)*5%。

### 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




# §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 2026 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、宏利悠然混合型基金中基金（FOF）、宏利新兴景气龙头混合型证券投资基金、宏利景气领航两年持有期混合型证券投资基金、宏利中短债债券型证券投资基金、宏利先进制造股票型证券投资基金、宏利景气智选 18 个月持有期混合型证券投资基金、宏利昇利一年定期开放债券型发起式证券投资基金、宏利闽利一年定期开放债券型发起式证券投资基金、宏利悠享养老目标日期 2030 一年持有期混合型基金中基金（FOF）、宏利添盈两年定期开放债券型证券投资基金、宏利医药健康混合型发起式证券投资基金、宏利睿智成长混合型证券投资基金、宏利中债-绿色普惠主题金融债券优选指数证券投资基金、宏利半导体产业混合型发起式证券投资基金、宏利鑫享 90 天持有期债券型证券投资基金、宏利价值驱动六个月持有期混合型证券投资基金、宏利高端装备股票型证券投资基金、宏利中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、宏利中证 A500 指数增强型证券投资基金、宏利悦利利率债债券型证券投资基金、宏利中证 A50 指数增强型证券投资基金、宏利睿智领航混合型证券投资基金、宏利集享债券型证券投资基金、宏利嘉利债券型证券投资基金、宏利鼎森稳健 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)、宏利盛享债券型证券投资基金、宏利优势企业混合型证券投资基金、宏利消费主题精选混合型证券投资基金、宏利中证全指指数增强型证券投资基金在内的七十多只证券投资基金。

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

### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理（助理）期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 李婷婷 | 本基金基金经理 | 2023 年 6 月 28 日 | - | 9 年 | 北京大学金融硕士；2017 年 7 月至今任职于宏利基金管理有限公司，曾任策略投资部助理研究员、研究员，现任策略投资部基金经理。具备 9 年基金从业经验，具有基金从业资格。 |

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

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《基金法》及其他有关法律法规的规定及基金合同的约定，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，不存在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

基金管理人的风险管理部事后从交易指令的公平性、同日反向交易、不同窗口下的同向交易溢价率和风格相似的基金的业绩等方面，对报告期内的公平交易执行情况进行统计分析。本报告期内，交易指令多为指令下达人管理的多只资产组合同时下发，未发现明显的非公平交易指令；基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易；场外交易的交易价格与市场价格一致，场内交易的溢价率在剔除交易时间差异、交易数量悬殊、市场波动剧烈等因素后，处于正常范围之内；基金管理人管理的各投资组合的业绩由于投资策略、管理风格、业绩基准等方面的因素而有所不同。

本报告期内，本基金管理人管理的各投资组合之间未发现利益输送或不公平对待不同组合的情况。

### 4.3.2 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，风险控制与基金评估部定期对各投资组合的交易行为进行分析评估。在本报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合的同日反向交易成交较少的单边交易量均不超过该证券当日成交量的 5%，在本报告期内也未发生因异常交易而受到监管机构的处罚情况。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

今年以来，A 股结构性行情突出，叠加上市公司财报集中披露，市场风格显著切换，科技成

长成为绝对主线，业绩兑现能力成为行情分化核心标尺。在 AI 产业加速迭代、半导体国产替代提速、政策持续加持的背景下，算力、半导体设备材料、光通信等科技细分领域财报业绩亮眼，大幅跑赢市场，成长风格依托扎实基本面持续占优，市场资金集中抱团业绩确定性强的高景气赛道。组合操作上，我们严守风控纪律，严控组合风险敞口，以财报业绩为核心依据，均衡配置长期有效的基本面因子，同时通过机器学习模型捕捉市场投资机会，以期持续增厚组合超额收益。

本基金在操作中恪守基金合同，采用指数增强策略，严格控制跟踪误差及其他风险属性。使用量化选股手段，挑选盈利质量高、盈利增速稳定、估值合理的中盘绩优股票。选股风格偏向长期基本面，较好的控制了持仓换手率与交易成本。持仓结构分散以控制个股风险，仓位保持合理稳定。本报告期内，本基金增加了电子、通信、基础化工的配置，减少了医药、非银行金融、有色金属的配置。

### 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 1.8657 元；本报告期基金份额净值增长率为 21.01%，业绩比较基准收益率为 19.96%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后续 A 股市场，市场风格可能在价值和成长上更加平衡，板块与个股分化将从单纯的赛道景气分化，转向估值性价比与业绩确定性的双向筛选。当前市场核心驱动逻辑持续迭代，已从前期单纯的题材炒作，切换为业绩兑现、订单验证的基本面驱动模式，高景气成长赛道延续弹性优势，而低位超跌、估值修复空间充足的价值板块避险与补涨优势凸显，景气度、估值性价比将共同成为下半年行情分化的重点。基于后续市场走势判断，组合将坚持锚定基本面、严控回撤的核心投资思路。

基于基金合同与投资观点，本基金在选股策略上倾向于选择盈利质量高、公司治理规范、估值合理、有长期业绩成长能力的股票。在严格控制行业与风格暴露风险的前提下力争获取稳定的选股超额收益。在持仓上选择不过分暴露个股相对权重，分散投资以期平衡组合风险。

## 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定设有估值委员会，并制定了相关工作制度。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。估值委员会成员具有丰富的专业工作经历，具备良好的专业经验和专业胜任能力。报告期内相关基金估值政策由托管银行进行复核。

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

本报告期内，本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

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

### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同及基金实际运作的情况，本基金本报告期内未进行利润分配。

### 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”）在对宏利中证 500 指数增强型证券投资基金（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遵规守信、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：宏利中证 500 指数增强型证券投资基金(LOF)

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|---|
| **资 产：** | | | |
| 货币资金 | 6.4.7.1 | 1,093,709.44 | 1,212,258.81 |
| 结算备付金 | | 521,670.88 | 612,289.09 |
| 存出保证金 | | 54,263.68 | 60,466.47 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 188,933,720.27 | 192,128,389.46 |
| 其中：股票投资 | | 179,335,895.04 | 182,157,305.46 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 9,597,825.23 | 9,971,084.00 |
| 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 | | 410,939.35 | 111,082.05 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 177,456.77 | 68,109.36 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.8 | - | - |
| 资产总计 | | 191,191,760.39 | 194,192,595.24 |
| **负债和净资产** | **附注号** | **本期末<br>2026 年 6 月 30 日** | **上年度末<br>2025 年 12 月 31 日** |
| **负 债：** | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付清算款 | | - | 0.20 |
| 应付赎回款 | | 345,254.57 | 240,459.25 |
| 应付管理人报酬 | | 150,658.48 | 162,600.89 |
| 应付托管费 | | 30,131.69 | 32,520.20 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | 117.60 | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 其他负债 | 6.4.7.9 | 218,338.29 | 304,077.58 |
| 负债合计 | | 744,500.63 | 739,658.12 |
| **净资产：** | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.10 | 43,144,383.64 | 53,034,039.90 |
| 其他综合收益 | 6.4.7.11 | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.12 | 147,302,876.12 | 140,418,897.22 |
| 净资产合计 | | 190,447,259.76 | 193,452,937.12 |
| 负债和净资产总计 | | 191,191,760.39 | 194,192,595.24 |

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.8657 元，基金份额总额 102,077,782.92 份。

## 6.2 利润表

会计主体：宏利中证 500 指数增强型证券投资基金(LOF)

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|---|---|---|---|
| **一、营业总收入** | | 37,788,723.42 | 20,333,902.12 |
| 1.利息收入 | | 5,558.62 | 6,985.11 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.13 | 5,558.62 | 6,985.11 |
| 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 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 36,277,687.39 | 13,809,414.38 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.14 | 34,967,811.26 | 11,807,130.43 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.15 | 63,819.10 | 78,099.45 |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.16 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.17 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.18 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.19 | 1,246,057.03 | 1,924,184.50 |
| 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 | 6.4.7.20 | 1,479,285.31 | 6,501,996.97 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 失以“-”号填列） | | | |
| 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 | 26,192.10 | 15,505.66 |
| **减：二、营业总支出** | | 1,216,297.27 | 1,496,811.06 |
| 1．管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 940,384.67 | 1,128,928.31 |
| 其中：暂估管理人报酬 | | - | - |
| 2．托管费 | 6.4.10.2.2 | 188,076.92 | 225,785.68 |
| 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 | | 31.94 | - |
| 8．其他费用 | 6.4.7.23 | 87,803.74 | 142,097.07 |
| **三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）** | | 36,572,426.15 | 18,837,091.06 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| **四、净利润（净亏损以“-”号填列）** | | 36,572,426.15 | 18,837,091.06 |
| **五、其他综合收益的税后净额** | | - | - |
| **六、综合收益总额** | | 36,572,426.15 | 18,837,091.06 |

## 6.3 净资产变动表

会计主体：宏利中证 500 指数增强型证券投资基金(LOF)

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 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 | 53,034,039.90 | - | 140,418,897.22 | 193,452,937.12 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产 | 53,034,039.90 | - | 140,418,897.22 | 193,452,937.12 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -9,889,656.26 | - | 6,883,978.90 | -3,005,677.36 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | 36,572,426.15 | 36,572,426.15 |
| （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） | -9,889,656.26 | - | -29,688,447.25 | -39,578,103.51 |
| 其中：1.基金申购款 | 5,053,885.31 | - | 15,017,340.27 | 20,071,225.58 |
| 2.基金赎回款 | -14,943,541.57 | - | -44,705,787.52 | -59,649,329.09 |
| （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 | 43,144,383.64 | - | 147,302,876.12 | 190,447,259.76 |

| 项目 | 上年度可比期间<br>2025年1月1日至2025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 | 75,568,922.08 | - | 155,647,563.52 | 231,216,485.60 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产 | 75,568,922.08 | - | 155,647,563.52 | 231,216,485.60 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | 16,443,930.98 | - | 54,887,661.58 | 71,331,592.56 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | 18,837,091.06 | 18,837,091.06 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| （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） | 16,443,930.98 | - | 36,050,570.52 | 52,494,501.50 |
| 其中：1.基金申购款 | 28,902,378.69 | - | 62,929,558.18 | 91,831,936.87 |
| 2. 基金赎回款 | -12,458,447.71 | - | -26,878,987.66 | -39,337,435.37 |
| （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 | 92,012,853.06 | - | 210,535,225.10 | 302,548,078.16 |

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：

| | | |
|---|---|---|
| DING WEN CONG（丁闻聪） | 唐华 | 王泉 |
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

宏利中证 500 指数增强型证券投资基金(LOF)(原名为泰达宏利中证 500 指数增强型证券投资基金(LOF)，以下简称“本基金”)由泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金(以下简称“泰达宏利中证 500 指数分级基金”)转型而来。根据基金管理人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)于 2019 年 10 月 29 日发布的《泰达宏利基金管理有限公司关于泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金实施转型的公告》,原泰达宏利中证 500 指数分级基金以现场方式召开了基金份额持有人大会。基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效，基金管理人根据基金份额持有人大会的授权，定于 2019 年 11 月 6 日正式实施基金转型。《泰达宏利中证 500 指数增强型证券投资基金(LOF)基金合同》自 2019 年 11 月 6

日起生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为宏利基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)。

根据本基金的基金管理人 2023 年 6 月 17 日发布的《宏利基金管理有限公司关于旗下基金更名事宜的公告》,本基金自 2023 年 6 月 20 日起更名为宏利中证 500 指数增强型证券投资基金(LOF)。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2019]776 号核准，本基金 5,381,032.00 份基金份额于 2019 年 12 月 5 日在深交所挂牌交易。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《中华人民共和国证券投资基金法》和《宏利中证 500 指数增强型证券投资基金(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金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证)、债券(包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、次级债券、可交换债券、可转换债券等)、债券回购、资产支持证券、股指期货、货币市场工具、同业存单及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于股票组合的比例不低于基金资产的 80%，投资组合中投资于中证 500 指数成份股及备选成分股的资产不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金投资股指期货及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的相关规定。本基金的业绩比较基准为:95%×中证 500 指数收益率+5%×1 年期定期存款利率(税后)。

### 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”)、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的《公开募集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》、《证券投资基金会计核算业务指引》、《宏利中证 500 指数增强型证券投资基金(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 2026 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 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及 2026 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》、财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、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<br>2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 活期存款 | 1,093,709.44 |
| 等于：本金 | 1,093,613.15 |
| 加：应计利息 | 96.29 |
| 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 | 1,093,709.44 |

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | 170,007,935.43 | - | 179,335,895.04 | 9,327,959.61 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | | - | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 9,503,005.00 | 93,405.23 | 9,597,825.23 | 1,415.00 |
| | 银行间市场 | - | - | - | - |
| | 合计 | 9,503,005.00 | 93,405.23 | 9,597,825.23 | 1,415.00 |
| 资产支持证券 | | - | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - | - |
| 合计 | | 179,510,940.43 | 93,405.23 | 188,933,720.27 | 9,329,374.61 |

### 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

无。

#### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

#### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

### 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

无。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

#### 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

无。

#### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

### 6.4.7.6 其他债权投资

### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

### 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

无。

### 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

### 6.4.7.8 其他资产

无。

### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 171.05 |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | 139,283.48 |
| 其中：交易所市场 | 139,283.48 |
| 银行间市场 | - |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 78,883.76 |
| 合计 | 218,338.29 |

### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 | |
|---|---|---|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 125,476,197.02 | 53,034,039.90 |
| 本期申购 | 11,957,299.02 | 5,053,885.31 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -35,355,713.12 | -14,943,541.57 |
| 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 | 102,077,782.92 | 43,144,383.64 |

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 2026 年 6 月 30 日止，本基金于深交所上市的基金份额为 2,094,347.00 份(2025 年 12 月 31 日：2,591,210.00 份)，托管在场外未上市交易的基金份额为 99,983,435.92 份(2025 年 12 月 31 日：122,884,987.02 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

无。

### 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 | 141,088,240.99 | -669,343.77 | 140,418,897.22 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 本期期初 | 141,088,240.99 | -669,343.77 | 140,418,897.22 |
| 本期利润 | 35,093,140.84 | 1,479,285.31 | 36,572,426.15 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -29,743,480.83 | 55,033.58 | -29,688,447.25 |
| 其中：基金申购款 | 15,348,919.06 | -331,578.79 | 15,017,340.27 |
| 基金赎回款 | -45,092,399.89 | 386,612.37 | -44,705,787.52 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 146,437,901.00 | 864,975.12 | 147,302,876.12 |

### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 活期存款利息收入 | 3,932.15 |
| 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 | 1,422.60 |
| 其他 | 203.87 |
| 合计 | 5,558.62 |

### 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<br>2026年1月1日至2026年6月30日 |
| --- | --- |
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | 34,967,811.26 |
| 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 | 34,967,811.26 |

### 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<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
| --- | --- |
| 卖出股票成交总额 | 749,394,461.93 |
| 减：卖出股票成本总额 | 713,672,884.00 |
| 减：交易费用 | 753,766.67 |
| 买卖股票差价收入 | 34,967,811.26 |

### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

### 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<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
| --- | --- |
| 债券投资收益——利息收入 | 62,930.10 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 889.00 |
| 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 | 63,819.10 |

### 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<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
| --- | --- |
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 4,049,789.79 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 3,999,336.00 |
| 减：应计利息总额 | 49,564.79 |
| 减：交易费用 | - |
| 买卖债券差价收入 | 889.00 |

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

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

无。

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

无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

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

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

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

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
| --- | --- |

| | |
|---|---|
| 股票投资产生的股利收益 | 1,246,057.03 |
| 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 | 1,246,057.03 |

### 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 1.交易性金融资产 | 1,479,285.31 |
| 股票投资 | 1,482,269.31 |
| 债券投资 | -2,984.00 |
| 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 | 1,479,285.31 |

### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 基金赎回费收入 | 26,192.10 |
| 合计 | 26,192.10 |

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 0.5%，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

无。

### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 审计费用 | 14,876.39 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行费用 | 4,402.27 |
| 账户维护费 | 9,000.00 |

| | |
|---|---|
| 其他 | 17.71 |
| 合计 | 87,803.74 |

### 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

无。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

### 6.4.9 关联方、关联关系

#### 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

无。

#### 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

无。

##### 6.4.10.1.2 债券交易

无。

##### 6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

##### 6.4.10.1.4 权证交易

无。

##### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

#### 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<br>2026年1月1日至2026年6月30日 | 上年度可比期间<br>2025年1月1日至2025年6月30日 |
|---|---|---|

| | | |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 940,384.67 | 1,128,928.31 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 364,418.63 | 412,776.21 |
| 应支付基金管理人的净管理费 | 575,966.04 | 716,152.10 |

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1.0%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×1.0%/当年天数。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026年1月1日至2026年6月30日 | 上年度可比期间<br>2025年1月1日至2025年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 188,076.92 | 225,785.68 |

注：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。

### 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

无。

### 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

无。

#### 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

无。

### 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

无。

#### 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

无。

### 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<br>2026年1月1日至2026年6月30日 | | 上年度可比期间<br>2025年1月1日至2025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 | 1,093,709.44 | 3,932.15 | 1,631,093.63 | 5,762.64 |

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

无。

### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

### 6.4.11 利润分配情况

无。

### 6.4.12 期末（2026 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 301666 | 大普微 | 2026 年 4 月 8 日 | 1-6 个月（含） | 新股流通受限 | 46.08 | 463.33 | 288 | 13,271.04 | 133,439.04 | - |
| 001248 | 华润新能源 | 2026 年 6 月 24 日 | 1-6 个月（含） | 新股流通受限 | 10.11 | 10.11 | 5,887 | 59,517.57 | 59,517.57 | - |
| 001248 | 华润新能源 | 2026 年 6 月 24 日 | 1 个月以内（含） | 新股未上市 | 10.11 | 10.11 | 2,523 | 25,507.53 | 25,507.53 | - |
| 688781 | 视涯科技 | 2026 年 3 月 18 日 | 6 个月以上 | 新股流通受限 | 22.68 | 42.16 | 1,856 | 42,094.08 | 78,248.96 | - |
| 688808 | 联讯仪器 | 2026 年 4 月 16 日 | 1-6 个月（含） | 新股流通受限 | 81.88 | 1,584.33 | 47 | 3,848.36 | 74,463.51 | - |
| 688818 | 电科 | 2026 年 2 | 1-6 个月（含） | 新股流通 | 9.47 | 70.14 | 611 | 5,786.17 | 42,855.54 | - |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 蓝天 | 月 3 日 | | 受限 | | | | | | |
| 688820 | 盛合晶微 | 2026 年 4 月 13 日 | 1-6 个月（含） | 新股流通受限 | 19.68 | 141.49 | 280 | 5,510.40 | 39,617.20 | - |
| 688797 | 臻宝科技 | 2026 年 6 月 16 日 | 1-6 个月（含） | 新股流通受限 | 44.56 | 468.67 | 73 | 3,252.88 | 34,212.91 | - |
| 688712 | 北芯生命 | 2026 年 1 月 28 日 | 1-6 个月（含） | 新股流通受限 | 17.52 | 35.92 | 858 | 15,032.16 | 30,819.36 | - |
| 301682 | 宏明电子 | 2026 年 3 月 18 日 | 1-6 个月（含） | 新股流通受限 | 69.66 | 160.06 | 184 | 12,817.44 | 29,451.04 | - |
| 001399 | 惠科股份 | 2026 年 6 月 16 日 | 1-6 个月（含） | 新股流通受限 | 10.12 | 27.73 | 993 | 10,049.16 | 27,535.89 | - |
| 688635 | 长进光子 | 2026 年 5 月 20 日 | 1-6 个月（含） | 新股流通受限 | 40.98 | 308.19 | 86 | 3,524.28 | 26,504.34 | - |
| 688813 | 泰金新能 | 2026 年 3 月 24 日 | 1-6 个月（含） | 新股流通受限 | 26.28 | 172.09 | 149 | 3,915.72 | 25,641.41 | - |
| 688785 | 恒运昌 | 2026 年 1 月 20 日 | 1-6 个月（含） | 新股流通受限 | 92.18 | 463.15 | 52 | 4,793.36 | 24,083.80 | - |
| 001257 | 盛龙股份 | 2026 年 3 月 24 日 | 1-6 个月（含） | 新股流通受限 | 7.82 | 20.74 | 812 | 6,349.84 | 16,840.88 | - |
| 688811 | 有研复材 | 2026 年 4 月 1 日 | 1-6 个月（含） | 新股流通受限 | 6.41 | 24.13 | 598 | 3,833.18 | 14,429.74 | - |
| 301687 | 新广 | 2025 年 12 | 1-6 个月（含） | 新股流通 | 21.93 | 77.78 | 160 | 3,508.80 | 12,444.80 | - |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 益 | 月 24 日 | | 受限 | | | | | | |
| 301669 | 高特电子 | 2026 年 6 月 2 日 | 1-6 个月（含） | 新股流通受限 | 7.08 | 28.40 | 412 | 2,916.96 | 11,700.80 | - |
| 301531 | 春光集团 | 2026 年 4 月 28 日 | 1-6 个月（含） | 新股流通受限 | 13.30 | 51.56 | 226 | 3,005.80 | 11,652.56 | - |
| 603459 | 红板科技 | 2026 年 3 月 31 日 | 1-6 个月（含） | 新股流通受限 | 17.70 | 84.32 | 123 | 2,177.10 | 10,371.36 | - |
| 301696 | 三瑞智能 | 2026 年 3 月 31 日 | 1-6 个月（含） | 新股流通受限 | 24.68 | 86.80 | 119 | 2,936.92 | 10,329.20 | - |
| 603407 | 长裕集团 | 2026 年 4 月 29 日 | 1-6 个月（含） | 新股流通受限 | 13.86 | 73.46 | 130 | 1,801.80 | 9,549.80 | - |
| 301599 | 理奇智能 | 2026 年 4 月 22 日 | 1-6 个月（含） | 新股流通受限 | 13.91 | 32.47 | 240 | 3,338.40 | 7,792.80 | - |
| 301680 | 固德电材 | 2026 年 2 月 27 日 | 1-6 个月（含） | 新股流通受限 | 58.00 | 112.16 | 66 | 3,828.00 | 7,402.56 | - |
| 301513 | 尚水智能 | 2026 年 4 月 10 日 | 1-6 个月（含） | 新股流通受限 | 26.66 | 50.96 | 125 | 3,332.50 | 6,370.00 | - |
| 001365 | 天海电子 | 2026 年 5 月 11 日 | 1-6 个月（含） | 新股流通受限 | 27.19 | 31.31 | 203 | 5,519.57 | 6,355.93 | - |
| 001393 | 维通利 | 2026 年 5 月 8 日 | 1-6 个月（含） | 新股流通受限 | 30.38 | 38.99 | 142 | 4,313.96 | 5,536.58 | - |
| 301683 | 慧谷 | 2026 年 3 | 1-6 个月（含） | 新股流通 | 78.38 | 121.77 | 44 | 3,448.72 | 5,357.88 | - |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 新材 | 月 24 日 | | 受限 | | | | | | |
| 688816 | 易思维 | 2026 年 2 月 4 日 | 1-6 个月（含） | 新股流通受限 | 55.95 | 57.10 | 84 | 4,699.80 | 4,796.40 | - |
| 001237 | 惠康科技 | 2026 年 5 月 15 日 | 1-6 个月（含） | 新股流通受限 | 53.26 | 58.74 | 81 | 4,314.06 | 4,757.94 | - |
| 603435 | 嘉德利 | 2026 年 5 月 15 日 | 1-6 个月（含） | 新股流通受限 | 15.76 | 46.71 | 90 | 1,418.40 | 4,203.90 | - |
| 601112 | 振石股份 | 2026 年 1 月 21 日 | 1-6 个月（含） | 新股流通受限 | 11.18 | 17.59 | 193 | 2,157.74 | 3,394.87 | - |
| 603352 | 至信股份 | 2026 年 1 月 8 日 | 1-6 个月（含） | 新股流通受限 | 21.88 | 25.52 | 68 | 1,487.84 | 1,735.36 | - |
| 001220 | 世盟股份 | 2026 年 1 月 27 日 | 1-6 个月（含） | 新股流通受限 | 28.00 | 27.78 | 54 | 1,512.00 | 1,500.12 | - |
| 603293 | 埃泰克 | 2026 年 4 月 9 日 | 1-6 个月（含） | 新股流通受限 | 33.49 | 33.93 | 35 | 1,172.15 | 1,187.55 | - |
| 001312 | 福恩股份 | 2026 年 4 月 14 日 | 1-6 个月（含） | 新股流通受限 | 18.38 | 16.78 | 70 | 1,286.60 | 1,174.60 | - |

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

无。

### 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

无。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为股票型指数增强型基金，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。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、权证投资及资产支持证券投资等。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，建立了董事会下设立专门委员会为核心的、由管理层、督察长、风险控制与基金评估部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立专门委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；管理层可以设立履行风险管理职能的委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由风险控制与基金评估部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。

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

### 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，因此违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

本基金债券投资、资产支持证券和同业存单投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

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<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| AAA | - | - |
| AAA 以下 | - | - |
| 未评级 | 9,597,825.23 | 9,971,084.00 |
| 合计 | 9,597,825.23 | 9,971,084.00 |

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 2026 年 6 月 30 日，除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约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》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公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他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、存出保证金和债券投资等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2026 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 | 1,093,709.44 | - | - | - | 1,093,709.44 |
| 结算备付金 | 521,670.88 | - | - | - | 521,670.88 |
| 存出保证金 | 54,263.68 | - | - | - | 54,263.68 |
| 交易性金融资产 | 9,597,825.23 | - | - | 179,335,895.04 | 188,933,720.27 |
| 应收申购款 | 299.64 | - | - | 177,157.13 | 177,456.77 |
| 应收清算款 | - | - | - | 410,939.35 | 410,939.35 |
| 资产总计 | 11,267,768.87 | - | - | 179,923,991.52 | 191,191,760.39 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 345,254.57 | 345,254.57 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 150,658.48 | 150,658.48 |
| 应付托管费 | - | - | - | 30,131.69 | 30,131.69 |
| 应交税费 | - | - | - | 117.60 | 117.60 |
| 其他负债 | - | - | - | 218,338.29 | 218,338.29 |
| 负债总计 | - | - | - | 744,500.63 | 744,500.63 |
| 利率敏感度缺口 | 11,267,768.87 | - | - | 179,179,490.89 | 190,447,259.76 |
| 上年度末<br>2025 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 | 1,212,258.81 | - | - | - | 1,212,258.81 |
| 结算备付金 | 612,289.09 | - | - | - | 612,289.09 |
| 存出保证金 | 60,466.47 | - | - | - | 60,466.47 |
| 交易性金融资产 | 9,971,084.00 | - | - | 182,157,305.46 | 192,128,389.46 |
| 应收申购款 | - | - | - | 68,109.36 | 68,109.36 |
| 应收清算款 | - | - | - | 111,082.05 | 111,082.05 |
| 资产总计 | 11,856,098.37 | - | - | 182,336,496.87 | 194,192,595.24 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 240,459.25 | 240,459.25 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 162,600.89 | 162,600.89 |
| 应付托管费 | - | - | - | 32,520.20 | 32,520.20 |
| 应付清算款 | - | - | - | 0.20 | 0.20 |
| 其他负债 | - | - | - | 304,077.58 | 304,077.58 |
| 负债总计 | - | - | - | 739,658.12 | 739,658.12 |
| 利率敏感度缺口 | 11,856,098.37 | - | - | 181,596,838.75 | 193,452,937.12 |

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 2026 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金净资产的比例为 5.04%(2025 年 12 月 31 日：5.15%)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(2025 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。本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于中证 500 指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金资产的 80%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。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<br>2026 年 6 月 30 日 | | 上年度末<br>2025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 | 179,335,895.04 | 94.17 | 182,157,305.46 | 94.16 |
| 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 | 179,335,895.04 | 94.17 | 182,157,305.46 | 94.16 |

### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除中证 500 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 （2026 年 6 月 30 日） | 上年度末 （2025 年 12 月 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | | | 31 日 ） |
| | 中证 500 指数上升 5% | 8,900,000.00 | 8,330,000.00 |
| | 中证 500 指数下降 5% | -8,900,000.00 | -8,330,000.00 |

## 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<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 第一层次 | 178,525,111.31 | 181,805,683.02 |
| 第二层次 | 9,682,850.33 | 9,971,084.00 |
| 第三层次 | 725,758.63 | 351,622.44 |
| 合计 | 188,933,720.27 | 192,128,389.46 |

#### 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 2026 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(2025 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 | 179,335,895.04 | 93.80 |
| | 其中：股票 | 179,335,895.04 | 93.80 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 9,597,825.23 | 5.02 |
| | 其中：债券 | 9,597,825.23 | 5.02 |
| | 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 | 1,615,380.32 | 0.84 |
| 8 | 其他各项资产 | 642,659.80 | 0.34 |
| 9 | 合计 | 191,191,760.39 | 100.00 |

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

| 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 | - | - |
| B | 采矿业 | 6,430,767.00 | 3.38 |
| C | 制造业 | 118,464,753.20 | 62.20 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 1,751,493.00 | 0.92 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 915,312.00 | 0.48 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 1,760,001.00 | 0.92 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 11,441,491.00 | 6.01 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| J | 金融业 | 7,151,794.00 | 3.76 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 2,090,925.00 | 1.10 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 1,444,883.00 | 0.76 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 1,819,070.00 | 0.96 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 650,399.00 | 0.34 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 153,920,888.20 | 80.82 |

### 7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

| 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 | 3,499.00 | 0.00 |
| B | 采矿业 | 200,597.88 | 0.11 |
| C | 制造业 | 22,084,662.74 | 11.60 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 85,025.10 | 0.04 |
| E | 建筑业 | 43,500.00 | 0.02 |
| F | 批发和零售业 | 1,344,096.00 | 0.71 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 157,425.12 | 0.08 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 546,897.00 | 0.29 |
| J | 金融业 | 280,194.00 | 0.15 |
| K | 房地产业 | 118,404.00 | 0.06 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 404,546.00 | 0.21 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 146,160.00 | 0.08 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 25,415,006.84 | 13.34 |

### 7.2.3 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

### 7.3.1 期末指数投资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 | 300604 | 长川科技 | 13,900 | 4,745,738.00 | 2.49 |
| 2 | 001309 | 德明利 | 4,000 | 3,771,600.00 | 1.98 |
| 3 | 300857 | 协创数据 | 8,060 | 2,739,594.00 | 1.44 |
| 4 | 688002 | 睿创微纳 | 16,418 | 2,539,700.42 | 1.33 |
| 5 | 600909 | 华安证券 | 226,100 | 2,511,971.00 | 1.32 |
| 6 | 600497 | 驰宏锌锗 | 201,600 | 2,441,376.00 | 1.28 |
| 7 | 002409 | 雅克科技 | 10,400 | 2,334,800.00 | 1.23 |
| 8 | 002851 | 麦格米特 | 13,700 | 2,290,366.00 | 1.20 |
| 9 | 688313 | 仕佳光子 | 12,200 | 2,252,730.00 | 1.18 |
| 10 | 688099 | 晶晨股份 | 21,672 | 2,230,048.80 | 1.17 |
| 11 | 600885 | 宏发股份 | 63,800 | 2,200,462.00 | 1.16 |
| 12 | 688220 | 翱捷科技 | 17,689 | 2,199,096.48 | 1.15 |
| 13 | 301536 | 星宸科技 | 17,000 | 2,188,070.00 | 1.15 |
| 14 | 600563 | 法拉电子 | 11,400 | 2,175,120.00 | 1.14 |
| 15 | 688498 | 源杰科技 | 1,100 | 2,074,600.00 | 1.09 |
| 16 | 002273 | 水晶光电 | 57,100 | 2,025,908.00 | 1.06 |
| 17 | 688469 | 芯联集成 | 188,058 | 1,995,295.38 | 1.05 |
| 18 | 002821 | 凯莱英 | 12,100 | 1,960,200.00 | 1.03 |
| 19 | 301358 | 湖南裕能 | 25,000 | 1,896,750.00 | 1.00 |
| 20 | 600499 | 科达制造 | 134,800 | 1,860,240.00 | 0.98 |
| 21 | 002025 | 航天电器 | 24,200 | 1,844,524.00 | 0.97 |
| 22 | 002195 | 岩山科技 | 280,300 | 1,833,162.00 | 0.96 |
| 23 | 000039 | 中集集团 | 225,300 | 1,827,183.00 | 0.96 |
| 24 | 002266 | 浙富控股 | 359,500 | 1,819,070.00 | 0.96 |
| 25 | 600105 | 永鼎股份 | 26,600 | 1,794,968.00 | 0.94 |
| 26 | 688385 | 复旦微电 | 24,873 | 1,773,196.17 | 0.93 |
| 27 | 002738 | 中矿资源 | 29,900 | 1,763,801.00 | 0.93 |
| 28 | 688027 | 国盾量子 | 3,400 | 1,713,634.00 | 0.90 |
| 29 | 300620 | 光库科技 | 4,500 | 1,701,900.00 | 0.89 |
| 30 | 300054 | 鼎龙股份 | 16,000 | 1,695,520.00 | 0.89 |
| 31 | 688375 | 国博电子 | 16,100 | 1,679,230.00 | 0.88 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 32 | 300919 | 中伟新材 | 38,300 | 1,675,625.00 | 0.88 |
| 33 | 300432 | 富临精工 | 83,300 | 1,673,497.00 | 0.88 |
| 34 | 300623 | 捷捷微电 | 36,400 | 1,637,636.00 | 0.86 |
| 35 | 002756 | 永兴材料 | 28,800 | 1,631,232.00 | 0.86 |
| 36 | 300677 | 英科医疗 | 40,000 | 1,566,800.00 | 0.82 |
| 37 | 603766 | 隆鑫通用 | 130,300 | 1,554,479.00 | 0.82 |
| 38 | 600988 | 赤峰黄金 | 57,100 | 1,502,872.00 | 0.79 |
| 39 | 688188 | 柏楚电子 | 13,891 | 1,482,169.70 | 0.78 |
| 40 | 601699 | 潞安环能 | 103,500 | 1,477,980.00 | 0.78 |
| 41 | 002155 | 湖南黄金 | 61,100 | 1,458,457.00 | 0.77 |
| 42 | 000683 | 博源化工 | 246,500 | 1,419,840.00 | 0.75 |
| 43 | 603699 | 纽威股份 | 28,000 | 1,408,400.00 | 0.74 |
| 44 | 601179 | 中国西电 | 93,900 | 1,400,988.00 | 0.74 |
| 45 | 300012 | 华测检测 | 100,700 | 1,395,702.00 | 0.73 |
| 46 | 601665 | 齐鲁银行 | 240,300 | 1,386,531.00 | 0.73 |
| 47 | 000559 | 万向钱潮 | 106,500 | 1,377,045.00 | 0.72 |
| 48 | 001203 | 大中矿业 | 45,800 | 1,371,710.00 | 0.72 |
| 49 | 600352 | 浙江龙盛 | 109,000 | 1,319,990.00 | 0.69 |
| 50 | 002064 | 华峰化学 | 136,400 | 1,294,436.00 | 0.68 |
| 51 | 000878 | 云南铜业 | 75,700 | 1,202,116.00 | 0.63 |
| 52 | 688301 | 奕瑞科技 | 9,598 | 1,190,152.00 | 0.62 |
| 53 | 300346 | 南大光电 | 12,700 | 1,176,655.00 | 0.62 |
| 54 | 688361 | 中科飞测 | 2,700 | 1,161,000.00 | 0.61 |
| 55 | 000783 | 长江证券 | 117,400 | 1,144,650.00 | 0.60 |
| 56 | 603345 | 安井食品 | 14,100 | 1,130,679.00 | 0.59 |
| 57 | 688318 | 财富趋势 | 15,300 | 1,091,043.00 | 0.57 |
| 58 | 300001 | 特锐德 | 28,000 | 1,059,240.00 | 0.56 |
| 59 | 002131 | 利欧股份 | 221,700 | 1,053,075.00 | 0.55 |
| 60 | 000415 | 渤海租赁 | 255,000 | 1,037,850.00 | 0.54 |
| 61 | 000629 | 钒钛股份 | 295,400 | 986,636.00 | 0.52 |
| 62 | 688578 | 艾力斯 | 8,800 | 960,960.00 | 0.50 |
| 63 | 688349 | 三一重能 | 61,992 | 941,038.56 | 0.49 |
| 64 | 002841 | 视源股份 | 27,200 | 939,216.00 | 0.49 |
| 65 | 300487 | 蓝晓科技 | 15,800 | 929,830.00 | 0.49 |
| 66 | 688568 | 中科星图 | 22,250 | 922,707.50 | 0.48 |
| 67 | 688629 | 华丰科技 | 4,900 | 918,799.00 | 0.48 |
| 68 | 300073 | 当升科技 | 18,498 | 888,643.92 | 0.47 |
| 69 | 000893 | 亚钾国际 | 21,300 | 870,957.00 | 0.46 |
| 70 | 300475 | 香农芯创 | 2,900 | 870,000.00 | 0.46 |
| 71 | 603816 | 顾家家居 | 38,400 | 858,624.00 | 0.45 |
| 72 | 600566 | 济川药业 | 37,800 | 838,782.00 | 0.44 |
| 73 | 300223 | 北京君正 | 3,300 | 821,370.00 | 0.43 |
| 74 | 601233 | 桐昆股份 | 37,500 | 811,875.00 | 0.43 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 75 | 002444 | 巨星科技 | 25,800 | 802,380.00 | 0.42 |
| 76 | 002429 | 兆驰股份 | 76,300 | 792,757.00 | 0.42 |
| 77 | 601156 | 东航物流 | 49,100 | 791,492.00 | 0.42 |
| 78 | 002850 | 科达利 | 4,000 | 757,200.00 | 0.40 |
| 79 | 688052 | 纳芯微 | 2,600 | 749,606.00 | 0.39 |
| 80 | 300395 | 菲利华 | 5,600 | 748,888.00 | 0.39 |
| 81 | 300548 | 长芯博创 | 2,500 | 695,000.00 | 0.36 |
| 82 | 688122 | 西部超导 | 11,000 | 690,910.00 | 0.36 |
| 83 | 000155 | 川能动力 | 57,400 | 687,652.00 | 0.36 |
| 84 | 000703 | 恒逸石化 | 50,300 | 682,571.00 | 0.36 |
| 85 | 300496 | 中科创达 | 11,000 | 679,690.00 | 0.36 |
| 86 | 688281 | 华秦科技 | 13,470 | 676,598.10 | 0.36 |
| 87 | 600685 | 中船防务 | 24,200 | 615,648.00 | 0.32 |
| 88 | 002335 | 科华数据 | 14,170 | 601,516.50 | 0.32 |
| 89 | 600977 | 中国电影 | 46,300 | 598,196.00 | 0.31 |
| 90 | 002414 | 高德红外 | 44,700 | 592,722.00 | 0.31 |
| 91 | 002487 | 大金重工 | 10,200 | 591,294.00 | 0.31 |
| 92 | 000733 | 振华科技 | 10,300 | 583,392.00 | 0.31 |
| 93 | 300390 | 天华新能 | 6,200 | 579,762.00 | 0.30 |
| 94 | 002517 | 恺英网络 | 35,500 | 576,875.00 | 0.30 |
| 95 | 688336 | 三生国健 | 10,670 | 566,577.00 | 0.30 |
| 96 | 603737 | 三棵树 | 23,100 | 556,710.00 | 0.29 |
| 97 | 600601 | 方正科技 | 39,700 | 549,448.00 | 0.29 |
| 98 | 001389 | 广合科技 | 2,300 | 545,675.00 | 0.29 |
| 99 | 002812 | 恩捷股份 | 8,100 | 541,971.00 | 0.28 |
| 100 | 688778 | 厦钨新能 | 9,800 | 533,120.00 | 0.28 |
| 101 | 600486 | 扬农化工 | 10,400 | 527,280.00 | 0.28 |
| 102 | 688777 | 中控技术 | 4,400 | 517,000.00 | 0.27 |
| 103 | 301377 | 鼎泰高科 | 900 | 495,810.00 | 0.26 |
| 104 | 688213 | 思特威 | 4,500 | 481,815.00 | 0.25 |
| 105 | 601212 | 白银有色 | 88,800 | 451,104.00 | 0.24 |
| 106 | 002271 | 东方雨虹 | 36,800 | 436,816.00 | 0.23 |
| 107 | 600816 | 建元信托 | 178,000 | 434,320.00 | 0.23 |
| 108 | 300474 | 景嘉微 | 7,100 | 429,408.00 | 0.23 |
| 109 | 002126 | 银轮股份 | 8,600 | 428,280.00 | 0.22 |
| 110 | 603650 | 彤程新材 | 4,100 | 401,718.00 | 0.21 |
| 111 | 002299 | 圣农发展 | 26,100 | 395,676.00 | 0.21 |
| 112 | 000429 | 粤高速 A | 28,700 | 391,755.00 | 0.21 |
| 113 | 601106 | 中国一重 | 117,100 | 386,430.00 | 0.20 |
| 114 | 688166 | 博瑞医药 | 11,000 | 385,110.00 | 0.20 |
| 115 | 600517 | 国网英大 | 81,500 | 381,420.00 | 0.20 |
| 116 | 600985 | 淮北矿业 | 26,900 | 377,945.00 | 0.20 |
| 117 | 601000 | 唐山港 | 81,400 | 337,810.00 | 0.18 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 118 | 000598 | 兴蓉环境 | 51,200 | 328,704.00 | 0.17 |
| 119 | 600098 | 广州发展 | 55,100 | 325,641.00 | 0.17 |
| 120 | 300699 | 光威复材 | 11,300 | 323,745.00 | 0.17 |
| 121 | 002281 | 光迅科技 | 1,100 | 282,634.00 | 0.15 |
| 122 | 601555 | 东吴证券 | 35,300 | 279,576.00 | 0.15 |
| 123 | 600109 | 国金证券 | 31,500 | 276,570.00 | 0.15 |
| 124 | 600801 | 华新建材 | 17,600 | 274,560.00 | 0.14 |
| 125 | 600392 | 盛和资源 | 8,900 | 264,953.00 | 0.14 |
| 126 | 002152 | 广电运通 | 25,300 | 237,314.00 | 0.12 |
| 127 | 002008 | 大族激光 | 1,400 | 210,154.00 | 0.11 |
| 128 | 001286 | 陕西能源 | 20,600 | 208,884.00 | 0.11 |
| 129 | 002153 | 石基信息 | 28,800 | 208,224.00 | 0.11 |
| 130 | 300037 | 新宙邦 | 2,200 | 204,270.00 | 0.11 |
| 131 | 603486 | 科沃斯 | 3,900 | 197,925.00 | 0.10 |
| 132 | 688561 | 奇安信 | 8,000 | 191,840.00 | 0.10 |
| 133 | 002670 | 国盛证券 | 17,100 | 188,100.00 | 0.10 |
| 134 | 603129 | 春风动力 | 700 | 179,060.00 | 0.09 |
| 135 | 688692 | 达梦数据 | 700 | 171,003.00 | 0.09 |
| 136 | 300724 | 捷佳伟创 | 2,400 | 169,440.00 | 0.09 |
| 137 | 603885 | 吉祥航空 | 16,300 | 167,727.00 | 0.09 |
| 138 | 688120 | 华海清科 | 520 | 167,533.60 | 0.09 |
| 139 | 688709 | 成都华微 | 4,300 | 163,787.00 | 0.09 |
| 140 | 300953 | 震裕科技 | 1,200 | 160,440.00 | 0.08 |
| 141 | 002318 | 久立特材 | 6,600 | 157,740.00 | 0.08 |
| 142 | 002624 | 完美世界 | 12,300 | 152,766.00 | 0.08 |
| 143 | 688278 | 特宝生物 | 2,800 | 152,320.00 | 0.08 |
| 144 | 002966 | 苏州银行 | 21,800 | 151,728.00 | 0.08 |
| 145 | 000951 | 中国重汽 | 7,500 | 146,325.00 | 0.08 |
| 146 | 300763 | 锦浪科技 | 1,600 | 144,560.00 | 0.08 |
| 147 | 600535 | 天士力 | 10,900 | 144,207.00 | 0.08 |
| 148 | 603225 | 新凤鸣 | 7,300 | 143,445.00 | 0.08 |
| 149 | 600498 | 烽火通信 | 1,900 | 139,840.00 | 0.07 |
| 150 | 601577 | 长沙银行 | 15,000 | 130,650.00 | 0.07 |
| 151 | 002436 | 兴森科技 | 2,500 | 127,375.00 | 0.07 |
| 152 | 300002 | 神州泰岳 | 15,700 | 122,617.00 | 0.06 |
| 153 | 603688 | 石英股份 | 1,400 | 115,654.00 | 0.06 |
| 154 | 002223 | 鱼跃医疗 | 4,400 | 112,904.00 | 0.06 |
| 155 | 000739 | 普洛药业 | 6,400 | 106,624.00 | 0.06 |
| 156 | 603979 | 金诚信 | 1,800 | 106,254.00 | 0.06 |
| 157 | 300142 | 沃森生物 | 8,100 | 105,219.00 | 0.06 |
| 158 | 603077 | 和邦生物 | 44,200 | 102,544.00 | 0.05 |
| 159 | 603087 | 甘李药业 | 1,800 | 102,168.00 | 0.05 |
| 160 | 600177 | 雅戈尔 | 13,400 | 100,902.00 | 0.05 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 161 | 600583 | 海油工程 | 19,800 | 99,594.00 | 0.05 |
| 162 | 300207 | 欣旺达 | 5,200 | 98,748.00 | 0.05 |
| 163 | 002402 | 和而泰 | 3,800 | 98,154.00 | 0.05 |
| 164 | 601128 | 常熟银行 | 16,300 | 94,866.00 | 0.05 |
| 165 | 000898 | 鞍钢股份 | 50,200 | 93,874.00 | 0.05 |
| 166 | 600562 | 国睿科技 | 4,400 | 93,368.00 | 0.05 |
| 167 | 605358 | 立昂微 | 1,200 | 93,120.00 | 0.05 |
| 168 | 600808 | 马钢股份 | 36,200 | 90,500.00 | 0.05 |
| 169 | 603833 | 欧派家居 | 2,800 | 84,308.00 | 0.04 |
| 170 | 600008 | 首创环保 | 29,900 | 81,328.00 | 0.04 |
| 171 | 000423 | 东阿阿胶 | 1,700 | 77,112.00 | 0.04 |
| 172 | 300757 | 罗博特科 | 100 | 61,900.00 | 0.03 |
| 173 | 300748 | 金力永磁 | 2,000 | 61,700.00 | 0.03 |
| 174 | 000060 | 中金岭南 | 8,000 | 60,560.00 | 0.03 |
| 175 | 002138 | 顺络电子 | 800 | 58,480.00 | 0.03 |
| 176 | 002500 | 山西证券 | 10,700 | 55,212.00 | 0.03 |
| 177 | 600157 | 永泰能源 | 32,000 | 51,520.00 | 0.03 |
| 178 | 600299 | 安迪苏 | 6,400 | 50,240.00 | 0.03 |
| 179 | 300759 | 康龙化成 | 1,700 | 49,181.00 | 0.03 |
| 180 | 600595 | 中孚实业 | 8,300 | 46,646.00 | 0.02 |
| 181 | 300458 | 全志科技 | 1,180 | 46,562.80 | 0.02 |
| 182 | 600704 | 物产中大 | 9,600 | 45,312.00 | 0.02 |
| 183 | 000088 | 盐田港 | 10,500 | 42,945.00 | 0.02 |
| 184 | 688065 | 凯赛生物 | 864 | 41,342.40 | 0.02 |
| 185 | 000786 | 北新建材 | 2,200 | 39,798.00 | 0.02 |
| 186 | 603160 | 汇顶科技 | 600 | 37,026.00 | 0.02 |
| 187 | 301200 | 大族数控 | 100 | 36,065.00 | 0.02 |
| 188 | 600348 | 华阳股份 | 4,700 | 35,955.00 | 0.02 |
| 189 | 601108 | 财通证券 | 4,100 | 35,465.00 | 0.02 |
| 190 | 688266 | 泽璟制药 | 300 | 34,998.00 | 0.02 |
| 191 | 603659 | 璞泰来 | 1,200 | 34,716.00 | 0.02 |
| 192 | 601928 | 凤凰传媒 | 3,700 | 32,523.00 | 0.02 |
| 193 | 000883 | 湖北能源 | 7,400 | 31,968.00 | 0.02 |
| 194 | 000623 | 吉林敖东 | 1,800 | 31,914.00 | 0.02 |
| 195 | 600642 | 申能股份 | 3,400 | 29,682.00 | 0.02 |
| 196 | 601598 | 中国外运 | 5,700 | 28,272.00 | 0.01 |
| 197 | 600369 | 西南证券 | 6,600 | 26,532.00 | 0.01 |
| 198 | 688343 | 云天励飞 | 300 | 24,498.00 | 0.01 |
| 199 | 600282 | 南钢股份 | 5,300 | 24,327.00 | 0.01 |
| 200 | 601865 | 福莱特 | 2,300 | 24,173.00 | 0.01 |
| 201 | 600901 | 江苏金租 | 4,000 | 23,000.00 | 0.01 |
| 202 | 000987 | 越秀资本 | 2,700 | 21,114.00 | 0.01 |
| 203 | 600398 | 海澜之家 | 3,800 | 19,874.00 | 0.01 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 204 | 601098 | 中南传媒 | 2,000 | 19,680.00 | 0.01 |
| 205 | 600380 | 健康元 | 1,700 | 16,014.00 | 0.01 |
| 206 | 600312 | 平高电气 | 900 | 15,894.00 | 0.01 |
| 207 | 688563 | 航材股份 | 300 | 15,369.00 | 0.01 |
| 208 | 002508 | 老板电器 | 1,000 | 14,620.00 | 0.01 |
| 209 | 002056 | 横店东磁 | 400 | 12,192.00 | 0.01 |
| 210 | 688192 | 迪哲医药 | 300 | 11,979.00 | 0.01 |
| 211 | 301498 | 乖宝宠物 | 200 | 8,118.00 | 0.00 |
| 212 | 300146 | 汤臣倍健 | 800 | 7,232.00 | 0.00 |
| 213 | 002065 | 东华软件 | 900 | 6,426.00 | 0.00 |
| 214 | 600483 | 福能股份 | 600 | 6,114.00 | 0.00 |
| 215 | 600390 | 五矿资本 | 1,200 | 5,472.00 | 0.00 |
| 216 | 601997 | 贵阳银行 | 900 | 4,617.00 | 0.00 |
| 217 | 000932 | 华菱钢铁 | 1,300 | 4,511.00 | 0.00 |
| 218 | 600166 | 福田汽车 | 1,500 | 4,365.00 | 0.00 |
| 219 | 601112 | 振石股份 | 193 | 3,394.87 | 0.00 |

### 7.3.2 期末积极投资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 | 603986 | 兆易创新 | 2,100 | 1,711,500.00 | 0.90 |
| 2 | 300308 | 中际旭创 | 1,300 | 1,651,000.00 | 0.87 |
| 3 | 601061 | 中信金属 | 124,800 | 1,344,096.00 | 0.71 |
| 4 | 300502 | 新易盛 | 2,000 | 1,214,000.00 | 0.64 |
| 5 | 603083 | 剑桥科技 | 3,400 | 866,558.00 | 0.46 |
| 6 | 301086 | 鸿富瀚 | 3,560 | 745,036.80 | 0.39 |
| 7 | 000338 | 潍柴动力 | 27,200 | 741,200.00 | 0.39 |
| 8 | 688195 | 腾景科技 | 3,400 | 654,772.00 | 0.34 |
| 9 | 002353 | 杰瑞股份 | 3,800 | 579,500.00 | 0.30 |
| 10 | 300255 | 常山药业 | 24,700 | 578,474.00 | 0.30 |
| 11 | 000933 | 神火股份 | 27,100 | 574,520.00 | 0.30 |
| 12 | 300959 | 线上线下 | 3,700 | 546,897.00 | 0.29 |
| 13 | 002169 | 智光电气 | 36,700 | 537,288.00 | 0.28 |
| 14 | 002463 | 沪电股份 | 3,100 | 473,680.00 | 0.25 |
| 15 | 002080 | 中材科技 | 5,200 | 468,000.00 | 0.25 |
| 16 | 002475 | 立讯精密 | 6,600 | 464,640.00 | 0.24 |
| 17 | 000725 | 京东方 A | 53,400 | 463,512.00 | 0.24 |
| 18 | 600487 | 亨通光电 | 4,200 | 459,228.00 | 0.24 |
| 19 | 002371 | 北方华创 | 500 | 442,280.00 | 0.23 |
| 20 | 688275 | 万润新能 | 3,300 | 420,915.00 | 0.22 |
| 21 | 301308 | 江波龙 | 588 | 413,834.40 | 0.22 |
| 22 | 301217 | 铜冠铜箔 | 2,500 | 412,675.00 | 0.22 |
| 23 | 603259 | 药明康德 | 3,200 | 398,432.00 | 0.21 |
| 24 | 002796 | 世嘉科技 | 9,700 | 395,566.00 | 0.21 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 25 | 002595 | 豪迈科技 | 8,215 | 382,819.00 | 0.20 |
| 26 | 688523 | 航天环宇 | 7,200 | 377,280.00 | 0.20 |
| 27 | 688620 | 安凯微 | 22,680 | 367,416.00 | 0.19 |
| 28 | 002384 | 东山精密 | 1,400 | 367,290.00 | 0.19 |
| 29 | 301219 | 腾远钴业 | 6,430 | 352,364.00 | 0.19 |
| 30 | 600522 | 中天科技 | 5,800 | 351,944.00 | 0.18 |
| 31 | 688503 | 聚和材料 | 2,500 | 331,750.00 | 0.17 |
| 32 | 688025 | 杰普特 | 700 | 329,000.00 | 0.17 |
| 33 | 000807 | 云铝股份 | 12,600 | 278,964.00 | 0.15 |
| 34 | 300750 | 宁德时代 | 700 | 275,107.00 | 0.14 |
| 35 | 300408 | 三环集团 | 1,600 | 267,040.00 | 0.14 |
| 36 | 603317 | 天味食品 | 19,000 | 247,190.00 | 0.13 |
| 37 | 601601 | 中国太保 | 7,900 | 225,308.00 | 0.12 |
| 38 | 688059 | 华锐精密 | 1,100 | 219,681.00 | 0.12 |
| 39 | 301371 | 敷尔佳 | 7,900 | 205,400.00 | 0.11 |
| 40 | 000408 | 藏格矿业 | 2,800 | 194,096.00 | 0.10 |
| 41 | 688087 | 英科再生 | 5,400 | 180,468.00 | 0.09 |
| 42 | 600233 | 圆通速递 | 9,900 | 155,925.00 | 0.08 |
| 43 | 301239 | 普瑞眼科 | 4,800 | 146,160.00 | 0.08 |
| 44 | 002128 | 电投能源 | 6,300 | 145,656.00 | 0.08 |
| 45 | 605016 | 百龙创园 | 5,400 | 139,590.00 | 0.07 |
| 46 | 603217 | 元利科技 | 6,200 | 139,066.00 | 0.07 |
| 47 | 600955 | 维远股份 | 9,400 | 138,368.00 | 0.07 |
| 48 | 603193 | 润本股份 | 7,400 | 137,270.00 | 0.07 |
| 49 | 600309 | 万华化学 | 2,000 | 136,820.00 | 0.07 |
| 50 | 301666 | 大普微 | 288 | 133,439.04 | 0.07 |
| 51 | 600773 | 西藏城投 | 9,200 | 118,404.00 | 0.06 |
| 52 | 300102 | 乾照光电 | 4,400 | 114,576.00 | 0.06 |
| 53 | 300450 | 先导智能 | 2,600 | 105,872.00 | 0.06 |
| 54 | 002532 | 天山铝业 | 9,600 | 103,008.00 | 0.05 |
| 55 | 688311 | 盟升电子 | 3,572 | 93,550.68 | 0.05 |
| 56 | 001248 | 华润新能源 | 8,410 | 85,025.10 | 0.04 |
| 57 | 688388 | 嘉元科技 | 1,900 | 83,600.00 | 0.04 |
| 58 | 603707 | 健友股份 | 11,700 | 82,719.00 | 0.04 |
| 59 | 688231 | 隆达股份 | 2,170 | 79,704.10 | 0.04 |
| 60 | 000017 | 深中华A | 13,000 | 79,560.00 | 0.04 |
| 61 | 688781 | 视涯科技 | 1,856 | 78,248.96 | 0.04 |
| 62 | 301626 | 苏州天脉 | 200 | 76,792.00 | 0.04 |
| 63 | 301502 | 华阳智能 | 1,100 | 76,472.00 | 0.04 |
| 64 | 688808 | 联讯仪器 | 47 | 74,463.51 | 0.04 |
| 65 | 000596 | 古井贡酒 | 900 | 71,820.00 | 0.04 |
| 66 | 301328 | 维峰电子 | 910 | 64,792.00 | 0.03 |
| 67 | 002283 | 天润工业 | 6,700 | 64,655.00 | 0.03 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 68 | 002379 | 宏桥控股 | 3,800 | 56,126.00 | 0.03 |
| 69 | 603286 | 日盈电子 | 1,100 | 50,193.00 | 0.03 |
| 70 | 301571 | 国科天成 | 700 | 45,626.00 | 0.02 |
| 71 | 688653 | 康希通信 | 2,600 | 45,188.00 | 0.02 |
| 72 | 688386 | 泛亚微透 | 500 | 44,920.00 | 0.02 |
| 73 | 605289 | 罗曼股份 | 300 | 43,500.00 | 0.02 |
| 74 | 301603 | 乔锋智能 | 300 | 43,140.00 | 0.02 |
| 75 | 688818 | 电科蓝天 | 611 | 42,855.54 | 0.02 |
| 76 | 688820 | 盛合晶微 | 280 | 39,617.20 | 0.02 |
| 77 | 002955 | 鸿合科技 | 1,100 | 39,325.00 | 0.02 |
| 78 | 002043 | 兔宝宝 | 3,400 | 37,672.00 | 0.02 |
| 79 | 601636 | 旗滨集团 | 3,600 | 36,828.00 | 0.02 |
| 80 | 601138 | 工业富联 | 500 | 36,075.00 | 0.02 |
| 81 | 688797 | 臻宝科技 | 73 | 34,212.91 | 0.02 |
| 82 | 688712 | 北芯生命 | 858 | 30,819.36 | 0.02 |
| 83 | 301682 | 宏明电子 | 184 | 29,451.04 | 0.02 |
| 84 | 000776 | 广发证券 | 1,200 | 28,080.00 | 0.01 |
| 85 | 001399 | 惠科股份 | 993 | 27,535.89 | 0.01 |
| 86 | 601688 | 华泰证券 | 1,300 | 26,806.00 | 0.01 |
| 87 | 688635 | 长进光子 | 86 | 26,504.34 | 0.01 |
| 88 | 688813 | 泰金新能 | 149 | 25,641.41 | 0.01 |
| 89 | 688609 | 九联科技 | 2,200 | 24,222.00 | 0.01 |
| 90 | 688785 | 恒运昌 | 52 | 24,083.80 | 0.01 |
| 91 | 300861 | 美畅股份 | 900 | 22,671.00 | 0.01 |
| 92 | 603660 | 苏州科达 | 1,700 | 20,825.00 | 0.01 |
| 93 | 601857 | 中国石油 | 2,200 | 19,096.00 | 0.01 |
| 94 | 600938 | 中国海油 | 700 | 19,005.00 | 0.01 |
| 95 | 002986 | 宇新股份 | 1,600 | 18,928.00 | 0.01 |
| 96 | 603600 | 永艺股份 | 1,900 | 16,853.00 | 0.01 |
| 97 | 001257 | 盛龙股份 | 812 | 16,840.88 | 0.01 |
| 98 | 688811 | 有研复材 | 598 | 14,429.74 | 0.01 |
| 99 | 301687 | 新广益 | 160 | 12,444.80 | 0.01 |
| 100 | 688378 | 奥来德 | 200 | 12,400.00 | 0.01 |
| 101 | 301669 | 高特电子 | 412 | 11,700.80 | 0.01 |
| 102 | 301531 | 春光集团 | 226 | 11,652.56 | 0.01 |
| 103 | 605318 | 法狮龙 | 100 | 11,286.00 | 0.01 |
| 104 | 603459 | 红板科技 | 123 | 10,371.36 | 0.01 |
| 105 | 301696 | 三瑞智能 | 119 | 10,329.20 | 0.01 |
| 106 | 603407 | 长裕集团 | 130 | 9,549.80 | 0.01 |
| 107 | 002522 | 浙江众成 | 1,100 | 8,767.00 | 0.00 |
| 108 | 301599 | 理奇智能 | 240 | 7,792.80 | 0.00 |
| 109 | 301680 | 固德电材 | 66 | 7,402.56 | 0.00 |
| 110 | 301513 | 尚水智能 | 125 | 6,370.00 | 0.00 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 111 | 001365 | 天海电子 | 203 | 6,355.93 | 0.00 |
| 112 | 300416 | 苏试试验 | 300 | 6,114.00 | 0.00 |
| 113 | 001393 | 维通利 | 142 | 5,536.58 | 0.00 |
| 114 | 301683 | 慧谷新材 | 44 | 5,357.88 | 0.00 |
| 115 | 300576 | 容大感光 | 100 | 5,122.00 | 0.00 |
| 116 | 688816 | 易思维 | 84 | 4,796.40 | 0.00 |
| 117 | 001237 | 惠康科技 | 81 | 4,757.94 | 0.00 |
| 118 | 300138 | 晨光生物 | 500 | 4,500.00 | 0.00 |
| 119 | 002100 | 天康生物 | 700 | 4,417.00 | 0.00 |
| 120 | 603435 | 嘉德利 | 90 | 4,203.90 | 0.00 |
| 121 | 600195 | 中牧股份 | 700 | 4,130.00 | 0.00 |
| 122 | 300740 | 水羊股份 | 200 | 3,682.00 | 0.00 |
| 123 | 002876 | 三利谱 | 100 | 3,521.00 | 0.00 |
| 124 | 002714 | 牧原股份 | 100 | 3,499.00 | 0.00 |
| 125 | 603352 | 至信股份 | 68 | 1,735.36 | 0.00 |
| 126 | 001220 | 世盟股份 | 54 | 1,500.12 | 0.00 |
| 127 | 603293 | 埃泰克 | 35 | 1,187.55 | 0.00 |
| 128 | 001312 | 福恩股份 | 70 | 1,174.60 | 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 | 688525 | 佰维存储 | 6,174,964.41 | 3.19 |
| 2 | 002008 | 大族激光 | 6,069,890.83 | 3.14 |
| 3 | 300857 | 协创数据 | 5,667,642.59 | 2.93 |
| 4 | 002851 | 麦格米特 | 5,418,380.00 | 2.80 |
| 5 | 300136 | 信维通信 | 5,063,321.60 | 2.62 |
| 6 | 688120 | 华海清科 | 4,779,725.59 | 2.47 |
| 7 | 002738 | 中矿资源 | 4,727,254.28 | 2.44 |
| 8 | 300604 | 长川科技 | 4,686,326.00 | 2.42 |
| 9 | 301358 | 湖南裕能 | 4,622,972.00 | 2.39 |
| 10 | 300395 | 菲利华 | 4,563,612.43 | 2.36 |
| 11 | 300502 | 新易盛 | 4,290,262.60 | 2.22 |
| 12 | 300373 | 扬杰科技 | 4,252,181.51 | 2.20 |
| 13 | 001389 | 广合科技 | 4,229,782.00 | 2.19 |
| 14 | 002532 | 天山铝业 | 4,180,700.00 | 2.16 |
| 15 | 601168 | 西部矿业 | 4,137,757.53 | 2.14 |
| 16 | 002273 | 水晶光电 | 4,112,304.00 | 2.13 |
| 17 | 300207 | 欣旺达 | 4,053,056.00 | 2.10 |
| 18 | 603920 | 世运电路 | 4,030,723.00 | 2.08 |
| 19 | 688385 | 复旦微电 | 4,003,283.08 | 2.07 |
| 20 | 002409 | 雅克科技 | 3,867,869.00 | 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。

### 7.4.2 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 | 002008 | 大族激光 | 8,323,523.00 | 4.30 |
| 2 | 688525 | 佰维存储 | 7,889,237.92 | 4.08 |
| 3 | 300857 | 协创数据 | 6,950,377.00 | 3.59 |
| 4 | 601168 | 西部矿业 | 5,965,771.00 | 3.08 |
| 5 | 688120 | 华海清科 | 5,581,255.90 | 2.89 |
| 6 | 002281 | 光迅科技 | 5,391,369.00 | 2.79 |
| 7 | 300136 | 信维通信 | 5,256,928.65 | 2.72 |
| 8 | 301200 | 大族数控 | 5,153,006.00 | 2.66 |
| 9 | 300373 | 扬杰科技 | 5,072,744.00 | 2.62 |
| 10 | 001389 | 广合科技 | 5,064,023.70 | 2.62 |
| 11 | 603920 | 世运电路 | 4,887,472.00 | 2.53 |
| 12 | 688385 | 复旦微电 | 4,811,756.83 | 2.49 |
| 13 | 300502 | 新易盛 | 4,686,356.00 | 2.42 |
| 14 | 688183 | 生益电子 | 4,663,753.48 | 2.41 |
| 15 | 600549 | 厦门钨业 | 4,486,785.99 | 2.32 |
| 16 | 002156 | 通富微电 | 4,397,533.36 | 2.27 |
| 17 | 300207 | 欣旺达 | 4,396,193.04 | 2.27 |
| 18 | 002851 | 麦格米特 | 4,319,302.00 | 2.23 |
| 19 | 000021 | 深科技 | 4,280,760.00 | 2.21 |
| 20 | 600487 | 亨通光电 | 4,275,528.84 | 2.21 |
| 21 | 300972 | 万辰集团 | 4,245,345.00 | 2.19 |
| 22 | 601958 | 金钼股份 | 4,175,329.80 | 2.16 |
| 23 | 300395 | 菲利华 | 4,046,323.00 | 2.09 |
| 24 | 600988 | 赤峰黄金 | 3,945,213.00 | 2.04 |
| 25 | 301358 | 湖南裕能 | 3,919,645.00 | 2.03 |

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 | 709,369,204.27 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 749,394,461.93 |

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

## 7.5 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 | 9,597,825.23 | 5.04 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 9,597,825.23 | 5.04 |

## 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 | 019785 | 25 国债 13 | 59,000 | 5,974,490.33 | 3.14 |
| 2 | 019827 | 26 国债 01 | 36,000 | 3,623,334.90 | 1.90 |

注：以上为本基金本报告期末持有的全部债券。

## 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

本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的，将利用股指期货剥离多头股票资产部分的系统性风险或建立适当的股指期货多头头寸对冲市场向上风险。基金经理根据市场的变化、现货市场与期货市场的相关性等因素，计算需要用到的期货合约数量，对这个数量进行动态跟踪与测算，并进行适时灵活调整。同时，综合考虑各个月份期货合约之间的定价关系、套利机会、流动性以及保证金要求等因素，在各个月份期货合约之间进行动态配置，通过空头部分的优化创造额外收益。

## 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

在报告期内，本基金未投资于国债期货。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本报告期本基金没有投资国债期货。

## 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，华安证券股份有限公司于 2026 年 4 月 7 日曾受到央行安徽省分行公开处罚。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。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

基金投资的前十名股票均未超出基金合同约定的备选股票库。

### 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 | 54,263.68 |
| 2 | 应收清算款 | 410,939.35 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 177,456.77 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 642,659.80 |

### 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

#### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不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（%） |
| 15,127 | 6,748.05 | 19,059,610.80 | 18.67 | 83,018,172.12 | 81.33 |

### 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 | 165,157.29 | 0.1618 |

### 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 | 10~50 |

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---|---|
| 基金合同生效日（2019年11月6日）基金份额总额 | 283,184,730.54 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 125,476,197.02 |
| 本报告期基金总申购份额 | 11,957,299.02 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 35,355,713.12 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 102,077,782.92 |

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 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、本公司于2026年6月12日发布《宏利基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告》，自2026年6月10日起，徐娇女士不再担任公司督察长，由公司总经理DING WEN CONG

（丁闻聪）先生代任公司督察长。

2、本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

## 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

## 10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金无投资策略的变化。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

## 10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

### 10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人无受调查或处罚等情况。

### 10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

### 10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

### 10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

## 10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

### 10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例(%) | 佣金 | 占当期佣金总量的比例(%) | |
| 国新证券 | 1 | 663,785,923.82 | 45.54 | 130,051.76 | 45.54 | - |
| 广发证券 | 2 | 440,749,140.41 | 30.24 | 86,345.42 | 30.24 | - |
| 东北证券 | 3 | 353,113,291.00 | 24.22 | 69,182.56 | 24.23 | - |
| 财通证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 诚通证券 | 1 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 德邦证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东方财富 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 东吴证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国海证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国联民生证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国盛证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国泰海通证券 | 3 | - | - | - | - | - |
| 国投证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华安证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华福证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华西证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 江海证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 开源证券 | 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 | 1 | - | - | - | - | - |
| 湘财证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 信达证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 浙商证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中山证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | 3 | - | - | - | - | - |
| 中银国际 | 1 | - | - | - | - | - |

注：(一)本基金本报告期撤销银河证券 1 个交易单元、撤销太平洋证券 1 个交易单元、撤销江海证券 1 个交易单元。

(二)交易单元选择的标准和程序

1、选择标准

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

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

2、选择程序

（1）公司建立了交易服务商管理小组作为公司交易服务商及交易费用管理的决策机构，负责对服务券商选择、服务评价、交易佣金分配及交易费用管理等相关事宜进行审议决定。（2）公司新设基金的交易服务商从公司交易服务商备选池筛选后提交至公司交易服务商管理小组审批。（3）公司和相关证券公司签订协议，并通知基金托管人。

## 10.7.2 基金租用或者通过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(%) |
| 国新证券 | 4,804,705.00 | 100.00 | - | - | - | - |
| 广发证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东北证券 | - | - | - | - | - | - |
| 财通证券 | - | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | - | - | - | - | - | - |
| 诚通证券 | - | - | - | - | - | - |
| 德邦证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东方财富 | - | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东吴证券 | - | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国海证券 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 国金证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国联民生证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国盛证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国泰海通证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国投证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华安证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华福证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华西证券 | - | - | - | - | - | - |
| 江海证券 | - | - | - | - | - | - |
| 开源证券 | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源 | - | - | - | - | - | - |
| 太平洋证券 | - | - | - | - | - | - |
| 天风证券 | - | - | - | - | - | - |
| 西部证券 | - | - | - | - | - | - |
| 西南证券 | - | - | - | - | - | - |
| 湘财证券 | - | - | - | - | - | - |
| 信达证券 | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | - | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 浙商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中山证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中银国际 | - | - | - | - | - | - |

## 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 | 宏利基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告 | 《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站及公司网站 | 2026 年 06 月 12 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

本基金本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

| |
|---|
| 无。 |

# §12 备查文件目录

## 12.1 备查文件目录

1、中国证监会核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

基金管理人和托管人住所。

## 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**

**2026 年 8 月 31 日**