

泰达宏利泰和稳健养老目标一年持有期混 合型基金中基金(FOF) 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：泰达宏利基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2021 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。本中期报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 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 2021 年 1 月 1 日起至 2021 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	5
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	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
§ 5 托管人报告	11
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
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	38
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	39

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	39
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	39
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	39
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	39
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	39
7.12 本报告期投资基金情况	40
7.13 投资组合报告附注	42
§8 基金份额持有人信息	43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	43
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	43
§9 开放式基金份额变动	43
§10 重大事件揭示	44
10.1 基金份额持有人大会决议	44
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	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	44
10.4 基金投资策略的改变	44
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	44
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	44
10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	44
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况	44
§11 备查文件目录	45
11.1 备查文件目录	45
11.2 存放地点	46
11.3 查阅方式	46

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泰达宏利泰和稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金 (FOF)
基金简称	泰达泰和稳健养老一年 FOF
基金主代码	009355
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 6 月 2 日
基金管理人	泰达宏利基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	171,693,432.87 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要运用目标风险策略对大类资产进行配置,在风险可控的前提下,通过主动的资产配置、基金优选,力求基金资产稳定增值。
投资策略	本基金的投资策略分为两个层面:首先,依据基金管理人 的大类资产配置策略动态调整基金资产在各大类资产间的分配比例;而后,在各种类型的基金中进行优选。在日常运作中努力控制回撤,力求基金资产稳定增值。
业绩比较基准	中证全指指数收益率×20%+中证全债指数收益率×80%
风险收益特征	本基金为混合型基金中基金,其预期收益及预期风险水平低于股票型基金、股票型基金中基金,高于债券型基金、债券型基金中基金、货币市场基金及货币型基金中基金。同时,本基金为目标风险系列基金中基金中风险收益特征相对稳健的基金。

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		泰达宏利基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	徐娇娇	秦一楠
	联系电话	66577766	010-66060069
	电子邮箱	irm@mfcteda.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-698-8888	95599
传真		010-66577666	010-68121816
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	北京市东城区建国门内大街 69 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 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		100026	100031
法定代表人		刘轶	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网	www.mfcteda.com

址	
基金中期报告备置地点	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	泰达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(2021 年 1 月 1 日-2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	57,536,620.94
本期利润	25,758,965.99
加权平均基金份额本期利润	0.0317
本期加权平均净值利润率	2.96%
本期基金份额净值增长率	3.49%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	15,751,351.76
期末可供分配基金份额利润	0.0917
期末基金资产净值	187,444,784.63
期末基金份额净值	1.0917
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	9.22%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.81%	0.15%	0.24%	0.17%	0.57%	-0.02%

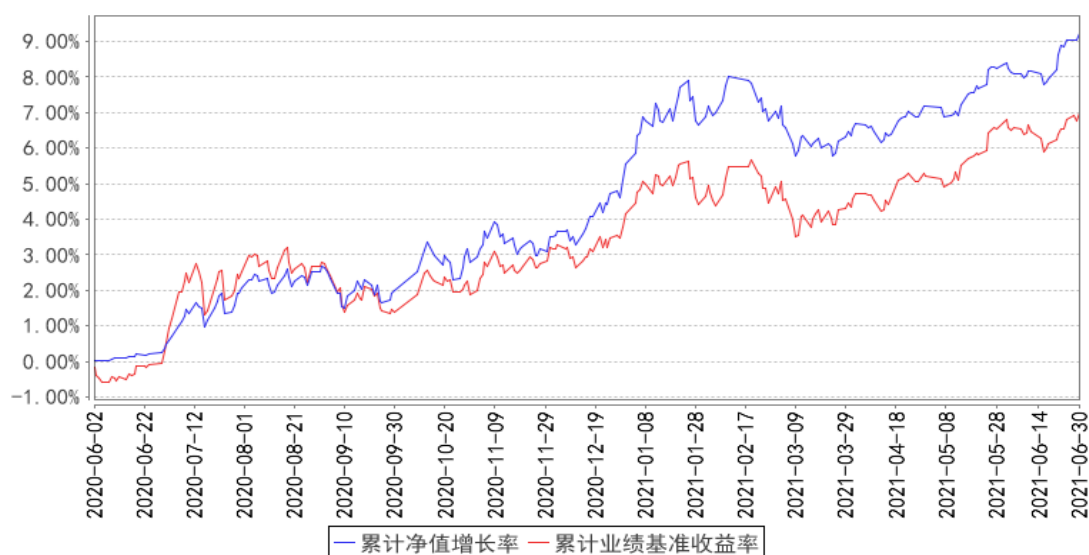
过去三个月	2.70%	0.15%	2.53%	0.17%	0.17%	-0.02%
过去六个月	3.49%	0.22%	2.72%	0.23%	0.77%	-0.01%
过去一年	8.81%	0.22%	6.70%	0.25%	2.11%	-0.03%
自基金合同生效起至今	9.22%	0.22%	6.99%	0.24%	2.23%	-0.02%

注：本基金业绩比较基准：中证全指指数收益率×20%+中证全债指数收益率×80%。

中证全指指数是由中证指数有限公司编制，其成份股是由剔除 ST、*ST 股票，以及上市时间不足 3 个月等股票后的剩余股票构成样本股，具有较高的市场代表性。中证全债指数是由沪深交易所和银行间市场上市、信用级别投资级以上、剩余期限 1 年以上的国债、金融债及信用债组成，综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数。基于本基金的投资范围和投资策略，选用上述业绩比较基准能够较好的体现本基金的风险收益特征。

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

泰达泰和稳健养老一年FOF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：本报告期末，由于证券市场波动、基金规模变动等原因，本基金有个别投资比例未达标，但已按照基金合同的规定在 10 个工作日内调整达标。

§ 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

泰达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，成立于 2002 年 6 月，是中国首批合资基金管理公司之一。截至报告期末本公司股东及持股比例分别为：天津市泰达国际控股（集团）有限公司：51%；宏利投资管理（香港）有限公司：49%。

目前公司管理着包括泰达宏利价值优化型系列基金、泰达宏利行业精选混合型证券投资基金、泰达宏利风险预算混合型证券投资基金、泰达宏利货币市场基金、泰达宏利效率优选混合型证券投资基金（LOF）、泰达宏利首选企业股票型证券投资基金、泰达宏利市值优选混合型证券投资基金、泰达宏利集利债券型证券投资基金、泰达宏利品质生活灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利红利先锋混合型证券投资基金、泰达宏利沪深 300 指数增强型证券投资基金、泰达宏利领先中小盘混合型证券投资基金、泰达宏利聚利债券型证券投资基金（LOF）、泰达宏利中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）、泰达宏利逆向策略混合型证券投资基金、泰达宏利宏达混合型证券投资基金、泰达宏利淘利债券型证券投资基金、泰达宏利转型机遇股票型证券投资基金、泰达宏利改革动力量化策略灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利创盈灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利复兴伟业灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利新起点灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利蓝筹价值混合型证券投资基金、泰达宏利新思路灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利创益灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利活期友货币市场基金、泰达宏利汇利债券型证券投资基金、泰达宏利量化增强股票型证券投资基金、泰达宏利睿智稳健灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利京元宝货币市场基金、泰达宏利纯利债券型证券投资基金、泰达宏利溢利债券型证券投资基金、泰达宏利恒利债券型证券投资基金、泰达宏利启富灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利业绩驱动量化股票型证券投资基金、泰达宏利全能优选混合型基金中基金（FOF）、泰达宏利交利 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、泰达宏利金利 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、泰达宏利绩优增长灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利泽利 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、泰达宏利泰和平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、泰达宏利印度机会股票型证券投资基金（QDII）、泰达宏利鑫利半年定期开放债券型证券投资基金、泰达宏利永利债券型证券投资基金、泰达宏利品牌升级混合型证券投资基金、泰达宏利消费行业量化精选混合型证券投资基金、泰达宏利中证主要消费红利指数型证券投资基金、泰达宏利养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、泰达宏利泰和稳健养老目标一年持有

期混合型基金中基金（FOF）、泰达宏利价值长青混合型证券投资基金、泰达宏利中证申万绩优策略指数增强型证券投资基金、泰达宏利乐盈 66 个月定期开放债券型证券投资基金、泰达宏利高研发创新 6 个月持有期混合型证券投资基金、泰达宏利波控回报 12 个月持有期混合型证券投资基金、泰达宏利消费服务混合型证券投资基金、泰达宏利新能源股票型证券投资基金、泰达宏利中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金在内的五十多只证券投资基金。

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		
张 晓 龙	资产配置部总经理助理；基金经理	2020 年 6 月 12 日	-	8 年	经济学博士；2013 年 8 月加入泰达宏利基金管理有限公司，历任金融工程部助理研究员、研究员，基金组合部研究员，现任资产配置部总经理助理兼基金经理。具备 8 年证券基金从业经验，8 年证券投资管理经验，具有基金从业资格。
胡 俊 英	基金经理助理	2020 年 8 月 19 日	-	11 年	北京物资学院金融学硕士；2010 年 4 月至 2015 年 3 月，任职于天相投资顾问有限公司，担任基金研究员、基金研究部负责人；2015 年 4 月，加入泰达宏利基金管理有限公司，任职于销售管理部，先后担任高级产品经理、总经理助理职务，2019 年 6 月任职于资产配置部，先后担任高级研究员、基金经理助理。11 年证券从业经验，具有基金从业资格。

注：证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。表中的任职日期和离任日期均指公司相关公告中披露的日期。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人建立了公平交易制度和流程，并严格执行制度的规定。在投资管理活动中，本基金管理人公平对待不同投资组合，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和投资决策方面享有平等机会；严格执行投资管理职能和交易执行职能的隔离；在交易环节实行集中交易制度，

并确保公平交易可操作、可评估、可稽核、可持续；交易部运用交易系统中设置的公平交易功能并按照时间优先、价格优先的原则严格执行所有指令；对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，交易部按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配，确保各投资组合享有公平的投资机会。风险管理部事后对本报告期的公平交易执行情况进行数量统计、分析。在本报告期内，未发现利益输送、不公平对待不同投资组合的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

较之去年下半年，大类资产在今年上半年波动性显著抬升，且以 A 股为代表的风险资产出现了显著的反转效应。年初以来，以茅指数为代表的核心资产延续了过去的强势行情；在全球经济复苏带来的流动性收紧预期下，周期资产、小盘股呈现了显著的超额收益，龙头消费、科技股票大幅回调。随着经济的持续复苏，制造业复苏带来的上游原材料的需求使得上游商品价格抬升，以新能源为代表的上游先进制造业股价大幅抬升。在资产配置方面，基于市场波动上行风险的预期，本基金在年初便逐步降低了风险资产的配置权重，伴随市场恐慌情绪的释放以及央行在稳健性货币政策方面的定力，考虑到利率下行带来的股债性价比天平的倾斜，组合逐步将前期相对保守的资产配置策略调整为中性；基金选择方面，组合坚持在风格稳定、超额收益良好的基金上进行分散化持有，以期提升产品的收益风险性价比。

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 1.0917 元；本报告期基金份额净值增长率为 3.49%，业绩比较基准收益率为 2.72%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从资产配置层面，下半年有两个核心方面值得关注：一方面是国内和全球货币政策的取向，另一方面是企业盈利的实际复苏进展。在流动性方面，与之前几次 QE 不同，美联储 Taper 的节奏大概率减缓；而与海外市场不同，国内货币政策较早进入正常化区间，下半年国内和国外货币政策的低相关性甚至反向或将对权益市场的内部风格造成显著冲击。在企业盈利方面，受益于良

好的出口推动，制造类企业整体盈利水平有望持续修复，而疫情长期蔓延导致的消费压制在短期内恢复不达预期。此外，在我国经济蓬勃发展的今天，为避免陷入中等收入国家陷阱而出台的产业政策、融资政策，也将对企业的长期盈利模式造成冲击，进而导致市场潜在投资机会的战略性调整。

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。公司估值委员会由主管基金运营的副总经理担任主任，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、基金投资部、研究部、金融工程部、固定收益部、合规风控部门、基金运营部的主要负责人；委员会秘书由基金运营部负责人担任。所有人员均具有丰富的专业工作经历，具备良好的专业经验和专业胜任能力。

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同及基金实际运作的情况，本基金本报告期内未进行利润分配。目前无其他利润分配安排。

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

本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—泰达宏利基金管理有限公司 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

为。

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

本托管人认为，泰达宏利基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，泰达宏利基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 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：泰达宏利泰和稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金 (FOF)

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	29,492,476.37	20,159,252.18
结算备付金		814,850.72	2,603,894.35
存出保证金		42,580.60	43,761.06
交易性金融资产	6.4.7.2	127,234,412.40	942,639,107.05
其中：股票投资		1,894,374.04	68,927,947.24
基金投资		112,338,138.36	823,691,164.71
债券投资		13,001,900.00	50,019,995.10
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	22,000,000.00
应收证券清算款		13,000,000.00	-
应收利息	6.4.7.5	68,847.10	860,721.90
应收股利		-	-
应收申购款		50,735,607.13	140,337.90
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-

资产总计		221,388,774.32	988,447,074.44
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 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		-	-
应付证券清算款		16,681,874.49	11,460,004.84
应付赎回款		16,819,942.93	-
应付管理人报酬		158,556.51	590,754.87
应付托管费		42,196.44	160,796.72
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	128,080.52	103,489.98
应交税费		2,295.64	792.70
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	111,043.16	162,000.00
负债合计		33,943,989.69	12,477,839.11
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	171,693,432.87	925,166,204.92
未分配利润	6.4.7.10	15,751,351.76	50,803,030.41
所有者权益合计		187,444,784.63	975,969,235.33
负债和所有者权益总计		221,388,774.32	988,447,074.44

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0917 元，基金份额总额 171,693,432.87 份。

6.2 利润表

会计主体：泰达宏利泰和稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 6 月 2 日（基金合 同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		31,058,541.50	4,131,640.86
1. 利息收入		679,758.45	468,370.33
其中：存款利息收入	6.4.7.11	130,155.40	127,768.92
债券利息收入		478,288.51	61,820.62
资产支持证券利息收入		-	-

买入返售金融资产收入		71,314.54	278,780.79
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		62,156,438.00	487,297.56
其中：股票投资收益	6.4.7.12	14,192,302.13	-
基金投资收益	6.4.7.13	39,179,885.44	-
债券投资收益	6.4.7.14	-88,863.70	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.14.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	8,873,114.13	487,297.56
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-31,777,654.95	3,174,988.83
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	-	984.14
减：二、费用		5,299,575.51	657,320.71
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,103,797.85	484,247.59
2. 托管费	6.4.10.2.2	802,007.02	134,206.89
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	1,265,807.71	13,048.94
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		1,062.27	-
7. 其他费用	6.4.7.21	126,900.66	25,817.29
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		25,758,965.99	3,474,320.15
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		25,758,965.99	3,474,320.15

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰达宏利泰和稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计

一、期初所有者权益(基金净值)	925,166,204.92	50,803,030.41	975,969,235.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	25,758,965.99	25,758,965.99
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-753,472,772.05	-60,810,644.64	-814,283,416.69
其中：1. 基金申购款	91,092,327.32	7,966,245.16	99,058,572.48
2. 基金赎回款	-844,565,099.37	-68,776,889.80	-913,341,989.17
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	171,693,432.87	15,751,351.76	187,444,784.63
项目	上年度可比期间 2020 年 6 月 2 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	917,862,306.63	-	917,862,306.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	3,474,320.15	3,474,320.15
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	1,496,491.42	1,287.16	1,497,778.58
其中：1. 基金申购款	1,496,491.42	1,287.16	1,497,778.58
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金	-	-	-

净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	919,358,798.05	3,475,607.31	922,834,405.36

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：

傅国庆

傅国庆

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

泰达宏利泰和稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)(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[2019]2540号《关于准予泰达宏利泰和稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)注册的批复》核准,由泰达宏利基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利泰和稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币917,443,423.29元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2020)第0359号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰达宏利泰和稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)基金合同》于2020年6月2日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为917,862,306.63份基金份额,其中认购资金利息折合418,883.34份基金份额。本基金的基金管理人为泰达宏利基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司(以下简称“中国农业银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利泰和稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)基金合同》的有关规定,本基金的投资范围包括经中国证监会依法批准或注册的公开募集的基金份额(含QDII基金、商品基金(含商品期货基金和黄金ETF),但基金中基金除外)、香港互认基金、国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券(含分离交易可转债)等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。基金的投资组合比例为:本基金投资于证券投资基金的比例不低于基金资产的80%;投资于权益

类资产的战略配置比例为 20%，非权益类资产的战略配置比例为 80%，其中权益类资产为股票、股票型基金、以及符合以下两种情况之一的混合型基金：一是基金合同约定股票资产投资比例不低于基金资产的 50%，二是最近 4 个季度末，每季度定期报告披露的股票资产占基金资产的比例不低于 50%。现金或到期日在一年以内的政府债券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。其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为中证全指指数收益率×20%+中证全债指数收益率×80%。

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》、各项具体会计准则及相关规定(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》、《泰达宏利泰和稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)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 2021 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 2021 年 06 月 30 日的财务状况以及 2021 年度上半年的经营成果和基金净值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

本基金本报告期内无重大会计差错发生。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[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。

(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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	29,492,476.37

定期存款	-
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	-
合计	29,492,476.37

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	912,714.43	1,894,374.04	981,659.61
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	3,000,900.00	-
	银行间市场	9,998,090.00	2,910.00
	合计	12,998,990.00	2,910.00
资产支持证券	-	-	-
基金	108,589,274.33	112,338,138.36	3,748,864.03
其他	-	-	-
合计	122,500,978.76	127,234,412.40	4,733,433.64

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

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进行买断式逆回购交易。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	5,321.80
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	330.03
应收债券利息	63,178.08

应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	17.19
合计	68,847.10

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	127,905.52
银行间市场应付交易费用	175.00
合计	128,080.52

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	111,043.16
合计	111,043.16

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	925,166,204.92	925,166,204.92
本期申购	91,092,327.32	91,092,327.32
本期赎回（以“-”号填列）	-844,565,099.37	-844,565,099.37
- 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	171,693,432.87	171,693,432.87

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。

6.4.7.10 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	14,180,318.17	36,622,712.24	50,803,030.41
本期利润	57,536,620.94	-31,777,654.95	25,758,965.99
本期基金份额交易产生的变动数	-49,427,455.31	-11,383,189.33	-60,810,644.64
其中：基金申购款	11,169,440.09	-3,203,194.93	7,966,245.16
基金赎回款	-60,596,895.40	-8,179,994.40	-68,776,889.80
本期已分配利润	-	-	-
本期末	22,289,483.80	-6,538,132.04	15,751,351.76

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	123,131.35
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	6,663.40
其他	360.65
合计	130,155.40

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	14,192,302.13
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	14,192,302.13

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	151,149,921.72
减：卖出股票成本总额	136,957,619.59
买卖股票差价收入	14,192,302.13

6.4.7.12.3 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。

6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	1,023,762,923.37
减：卖出/赎回基金成本总额	984,583,037.93
基金投资收益	39,179,885.44

6.4.7.14 债券投资收益

6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-88,863.70
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	-88,863.70

6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	84,749,381.92
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	83,153,763.70
减：应收利息总额	1,684,481.92
买卖债券差价收入	-88,863.70

6.4.7.14.3 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。

6.4.7.14.4 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。

6.4.7.14.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期末有资产支持证券投资收益。

6.4.7.15 贵金属投资收益

6.4.7.15.1 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。

6.4.7.15.2 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买卖贵金属差价收入。

6.4.7.15.3 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赎回差价收入。

6.4.7.15.4 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申购差价收入。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 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。

6.4.7.16.2 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。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	118,406.04
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	8,754,708.09
合计	8,873,114.13

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
------	----

	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-31,777,654.95
股票投资	-6,777,523.36
债券投资	106,978.60
资产支持证券投资	-
基金投资	-25,107,110.19
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	-31,777,654.95

6.4.7.19 其他收入

本基金本报告期内未有其他收入。

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	401,527.84
银行间市场交易费用	175.00
交易基金产生的费用	864,104.87
其中：申购费	1,000.00
赎回费	607,928.81
当期交易基金产生的经手费	353.29
转换费	254,822.77
合计	1,265,807.71

6.4.7.20.1 持有基金产生的费用

项目	本期费用 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	200,192.50
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	1,885,387.16
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	522,377.35

注：上述费用为根据所投资基金的招募说明书列明的计算方法对销售服务费、管理费和托管费进行的估算；上述费用已在本基金所持有基金的净值中体现，不构成本基金的费用项目。

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	47,108.87
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
银行费用	6,857.50
账户维护费	13,426.92
合计	126,900.66

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
泰达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
中国农业银行股份有限公司(中国农业银行)	基金托管人、基金代销机构

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交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 基金交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联交易单元进行基金交易。

6.4.10.1.5 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交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 6 月 2 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,103,797.85	484,247.59
其中：支付销售机构的客户维护费	1,661,568.31	337,399.08

注：本基金投资于基金管理人所管理的其他基金部分不收取管理费。支付基金管理人泰达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扣除本基金持有的基金管理人管理的其他基金部分后的余额的 0.80%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扣除本基金持有的基金管理人管理的其他基金部分后的余额×0.80%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 6 月 2 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	802,007.02	134,206.89

注：本基金投资于基金托管人所托管的其他基金部分不收取托管费。支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金托管人托管的其他基金部分后的余额的 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扣除本基金持有的基金托管人托管的其他基金部分后的余额×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

本基金本报告期及上年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

本基金的管理人在本报告期内及上年度可比期间内均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

本基金除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末及上年度末均未持有本基金。

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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年6月2日（基金合同生效日）至2020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
中国农业银行	29,492,476.37	123,131.35	609,319.44	127,768.92

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，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

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

于2021年6月30日，本基金持有基金管理人泰达宏利基金管理有限公司所管理的公开募集

证券投资基金合计 9,885,915.73 元，占本基金资产净值的比例为 5.2740%。（于 2020 年 6 月 30 日合计 150,189,220.05 元，占本基金资产净值的比例为 16.2748%）。

6.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

项目	本期费用 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 6 月 2 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
当期交易基金产生的申购费（元）	-	-
当期交易基金产生的赎回费（元）	29,819.93	-
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	-	1,025.16
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	280,696.88	15,377.47
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	66,916.05	5,125.82
-	-	-

注：本基金申购、赎回本基金的基金管理人管理的其他基金（ETF 除外），应当通过基金管理人的直销渠道且不得收取申购费、赎回费（按规定应当收取并记入被投资基金其他收入部分的赎回费除外）、销售服务等销售费用。相关申购费、赎回费由基金管理人直接减免，故当期交易基金产生的申购费为 0，当期交易基金产生的赎回费仅为按规定应当收取并记入被投资基金其他收入部分的赎回费。相关销售服务费已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，由基金管理人从被投资基金收取后向本基金返还，当期持有基金产生的应支付销售服务费为管理人当期应向本基金返还的销售服务费，相关披露金额根据本基金对被投资基金的实际持仓、被投资基金的基金合同约定的费率和方法估算。当期持有基金产生的应支付管理费、当期持有基金产生的应支付托管费已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，相关披露金额根据本基金对被投资基金的实际持仓、被投资基金的基金合同约定的费率和方法估算。

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(2021 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	可流通日	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

688680	海优新材	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 22 日	新股流通受限	69.94	243.61	2,795	195,482.30	680,889.95	-
688317	之江生物	2021 年 1 月 8 日	2021 年 7 月 19 日	新股流通受限	43.22	63.82	5,740	248,082.80	366,326.80	-
688630	芯碁微装	2021 年 3 月 25 日	2021 年 10 月 8 日	新股流通受限	15.23	58.42	3,397	51,736.31	198,452.74	-
688667	菱电电控	2021 年 3 月 3 日	2021 年 9 月 13 日	新股流通受限	75.42	103.88	1,191	89,825.22	123,721.08	-
688607	康众医疗	2021 年 1 月 25 日	2021 年 8 月 2 日	新股流通受限	23.21	44.50	1,890	43,866.90	84,105.00	-
688328	深科达	2021 年 3 月 1 日	2021 年 9 月 9 日	新股流通受限	16.49	37.79	1,499	24,718.51	56,647.21	-
688597	煜邦电力	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 17 日	新股流通受限	5.88	10.16	3,907	22,973.16	39,695.12	-
688565	力源科技	2021 年 5 月 6 日	2021 年 11 月 15 日	新股流通受限	9.39	14.00	2,464	23,136.96	34,496.00	-
605287	德才股份	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股未上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-

注：1. 根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。

2. 根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

3. 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。

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的股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

本基金为混合型基金中基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金、股票型基金中基金，高于债券型基金、债券型基金中基金、货币市场基金及货币型基金中基金。同时，本基金为目标风险系列基金中基金中风险收益特征相对稳健的基金。本基金投资的金融工具主要包括公开募集的基金份额、股票投资、债券投资、货币市场工具等。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运用风险平价策略对大类资产进行配置，在风险可控的前提下，为投资者创造较高的绝对收益。

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。风险管理部对公司执行总裁负责，并由督察长分管。

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农业银行，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。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券投资、资产支持证券投资 and 同业存单投资（2020 年 12 月 31 日：同）。

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 2021 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（所有者权益）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、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司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、存出保证金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	29,492,476.37	-	-	-	29,492,476.37
结算备付金	814,850.72	-	-	-	814,850.72
存出保证金	42,580.60	-	-	-	42,580.60
交易性金融资产	13,001,900.00	-	-	114,232,512.40	127,234,412.40
应收利息	-	-	-	68,847.10	68,847.10
应收申购款	-	-	-	50,735,607.13	50,735,607.13
应收证券清算款	-	-	-	13,000,000.00	13,000,000.00
资产总计	43,351,807.69	-	-	178,036,966.63	221,388,774.32
负债					
应付赎回款	-	-	-	16,819,942.93	16,819,942.93
应付管理人报酬	-	-	-	158,556.51	158,556.51
应付托管费	-	-	-	42,196.44	42,196.44
应付证券清算款	-	-	-	16,681,874.49	16,681,874.49
应付交易费用	-	-	-	128,080.52	128,080.52
应交税费	-	-	-	2,295.64	2,295.64
其他负债	-	-	-	111,043.16	111,043.16
负债总计	-	-	-	33,943,989.69	33,943,989.69
利率敏感度缺口	43,351,807.69	-	-	144,092,976.94	187,444,784.63
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	20,159,252.18	-	-	-	20,159,252.18
结算备付金	2,603,894.35	-	-	-	2,603,894.35
存出保证金	43,761.06	-	-	-	43,761.06
交易性金融资产	50,019,995.10	-	-	892,619,111.95	942,639,107.05
买入返售金融资产	22,000,000.00	-	-	-	22,000,000.00
应收利息	-	-	-	860,721.90	860,721.90
应收申购款	-	-	-	140,337.90	140,337.90
资产总计	94,826,902.69	-	-	893,620,171.75	988,447,074.44
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	590,754.87	590,754.87
应付托管费	-	-	-	160,796.72	160,796.72

应付证券清算款	-	-	-	11,460,004.84	11,460,004.84
应付交易费用	-	-	-	103,489.98	103,489.98
应交税费	-	-	-	792.70	792.70
其他负债	-	-	-	162,000.00	162,000.00
负债总计	-	-	-	12,477,839.11	12,477,839.11
利率敏感度缺口	94,826,902.69	-	-	-881,142,332.64	975,969,235.33

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2021 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资产净值的比例为 6.94% (2020 年 12 月 31 日: 本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 5.13%), 因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2020 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。本基金投资于证券投资基金的比例不低于基金资产的 80%; 投资于权益类资产的战略配置比例为 20%, 非权益类资产的战略配置比例为 80%, 每个交易日日终应保证不低于基金资产净值 5% 的现金或者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 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	1,894,374.04	1.01	68,927,947.24	7.06
交易性金融资产—基金投资	112,338,138.36	59.93	823,691,164.71	84.40
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	114,232,512.40	60.94	892,619,111.95	91.46

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
	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（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
分析	业绩比较基准上升 5%	1,450,000.00	6,700,000.00
	业绩比较基准下降 5%	-1,450,000.00	-6,700,000.00

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§ 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	1,894,374.04	0.86
	其中：股票	1,894,374.04	0.86
2	基金投资	112,338,138.36	50.74

3	固定收益投资	13,001,900.00	5.87
	其中：债券	13,001,900.00	5.87
	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	30,307,327.09	13.69
8	其他各项资产	63,847,034.83	28.84
9	合计	221,388,774.32	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	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	1,549,837.90	0.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,662.00	0.00
E	建筑业	11,014.44	0.01
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,230.40	0.01
J	金融业	34,721.10	0.02
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	247,412.20	0.13
N	水利、环境和公共设施管理业	34,496.00	0.02
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	—	—
S	综合	—	—
	合计	1,894,374.04	1.01

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	688680	海优新材	2,795	680,889.95	0.36
2	688317	之江生物	5,740	366,326.80	0.20
3	603259	药明康德	1,580	247,412.20	0.13
4	688630	芯碁微装	3,397	198,452.74	0.11
5	688667	菱电电控	1,191	123,721.08	0.07
6	688607	康众医疗	1,890	84,105.00	0.04
7	688328	深科达	1,499	56,647.21	0.03
8	688597	煜邦电力	3,907	39,695.12	0.02
9	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.02
10	688565	力源科技	2,464	34,496.00	0.02
11	603171	税友股份	637	12,230.40	0.01
12	605287	德才股份	349	11,014.44	0.01
13	605011	杭州热电	525	4,662.00	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	600031	三一重工	4,264,713.00	0.44
2	000708	中信特钢	3,566,492.02	0.37
3	600519	贵州茅台	3,529,538.00	0.36
4	601939	建设银行	3,370,500.00	0.35
5	600600	青岛啤酒	3,347,941.00	0.34
6	600926	杭州银行	3,340,454.00	0.34
7	603899	晨光文具	3,327,364.00	0.34
8	601100	恒立液压	3,319,745.00	0.34
9	603678	火炬电子	3,308,528.00	0.34
10	600529	山东药玻	3,308,399.00	0.34
11	600754	锦江酒店	3,293,355.00	0.34
12	601636	旗滨集团	3,292,095.00	0.34
13	600298	安琪酵母	3,283,309.00	0.34
14	601601	中国太保	3,281,563.00	0.34
15	603599	广信股份	3,197,150.00	0.33
16	600660	福耀玻璃	3,170,424.00	0.32
17	603995	甬金股份	3,091,205.00	0.32
18	601899	紫金矿业	2,925,761.00	0.30
19	600845	宝信软件	2,399,540.00	0.25
20	603501	韦尔股份	2,186,924.00	0.22

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	600519	贵州茅台	7,596,951.00	0.78
2	603899	晨光文具	6,763,574.61	0.69
3	603501	韦尔股份	5,578,672.00	0.57
4	600845	宝信软件	5,362,059.00	0.55
5	603259	药明康德	5,125,651.98	0.53
6	600036	招商银行	4,637,396.00	0.48
7	600309	万华化学	4,154,154.41	0.43
8	601012	隆基股份	4,042,473.64	0.41
9	601636	旗滨集团	4,016,028.00	0.41
10	601888	中国中免	4,000,596.48	0.41
11	600690	海尔智家	3,912,597.00	0.40
12	603338	浙江鼎力	3,731,507.00	0.38
13	603517	绝味食品	3,703,978.56	0.38
14	600030	中信证券	3,694,349.00	0.38
15	600887	伊利股份	3,672,385.00	0.38
16	600600	青岛啤酒	3,671,167.00	0.38
17	601166	兴业银行	3,656,009.00	0.37
18	600298	安琪酵母	3,506,519.00	0.36
19	600660	福耀玻璃	3,490,640.00	0.36
20	600754	锦江酒店	3,470,690.00	0.36

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	76,701,569.75
卖出股票收入（成交）总额	151,149,921.72

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	3,000,900.00	1.60
2	央行票据	—	—

3	金融债券	10,001,000.00	5.34
	其中：政策性金融债	10,001,000.00	5.34
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	13,001,900.00	6.94

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	210206	21 国开 06	100,000	10,001,000.00	5.34
2	019654	21 国债 06	30,000	3,000,900.00	1.60

注：以上为本基金本报告期末持有的全部债券投资。

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投资。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货持仓和损益明细。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

在报告期内，本基金未投资于股指期货。该策略符合基金合同的规定。

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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货持仓和损益明细。

7.11.3 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 本报告期投资基金情况

7.12.1 投资政策及风险说明

基金经理对全市场中的公募基金进行筛选，优选风格明确、超额收益良好的基金构建重点投资池。基金经理对重点投资池的基金进行持续跟踪，对各基金的整体表现进行及时评估。在重点投资池的范围内，根据各基金的相对收益、下行风险控制等方面的表现进行重点、长期持有。

7.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	005159	华泰保兴尊合债券 A	契约型开放式	10,667,162.70	13,374,488.59	7.14	否
2	005010	金鹰添瑞中短债 A	契约型开放式	9,841,149.79	10,228,891.09	5.46	否
3	530021	建信纯债债券 A	契约型开放式	6,970,920.38	10,180,332.12	5.43	否
4	003793	泰达宏利溢利债券 A	契约型开放式	6,881,946.21	9,885,915.73	5.27	是
5	004739	上投摩根安隆回报混合 C	契约型开放式	7,204,185.93	9,232,164.27	4.93	否
6	511010	国泰上证	交易型开	73,300.00	9,054,235.90	4.83	否

		5 年 期国 债 ETF	放式 (ETF)				
7	003377	广发 中债 7-10 年国 开债 指数 C	契约 型开 放式	7,944,261.55	8,968,276.86	4.78	否
8	519782	交银 裕隆 纯债 债券 A	契约 型开 放式	6,775,593.16	8,434,935.92	4.50	否
9	450003	国富 潜力 组合 混合 A	契约 型开 放式	3,786,993.04	7,161,203.84	3.82	否
10	163415	兴全 商业 模式 优选 混合 (LOF)	上市 契约 型开 放式 (LOF)	1,432,012.31	5,662,176.67	3.02	否
11	511260	上证 10 年 期国 债 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	49,500.00	5,579,640.00	2.98	否
12	159928	消费 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	3,600,000.00	4,539,600.00	2.42	否

13	011478	工银 美丽 城镇 股票 C	契约 型开 放式	1,389,799.99	4,048,487.37	2.16	否
14	511880	银华 交易 型货 币 A	交易 型开 放式 (ETF)	30,000.00	3,035,790.00	1.62	否
15	512800	华宝 中证 银行 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	2,400,000.00	2,952,000.00	1.57	否

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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，国家开发银行于 2020 年 12 月 25 日曾受到中国银保监会公开处罚。

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。

7.13.2 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。

7.13.3 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	42,580.60
2	应收证券清算款	13,000,000.00
3	应收股利	—
4	应收利息	68,847.10
5	应收申购款	50,735,607.13
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	63,847,034.83

7.13.4 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。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688680	海优新材	680,889.95	0.36	新股流通受限
2	688317	之江生物	366,326.80	0.20	新股流通受限
3	688630	芯碁微装	198,452.74	0.11	新股流通受限
4	688667	菱电电控	123,721.08	0.07	新股流通受限
5	688607	康众医疗	84,105.00	0.04	新股流通受限
6	688328	深科达	56,647.21	0.03	新股流通受限
7	688597	煜邦电力	39,695.12	0.02	新股流通受限
8	688565	力源科技	34,496.00	0.02	新股流通受限

7.13.6 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 (%)
2,561	67,041.56	-	-	171,693,432.87	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	275,487.96	0.1605

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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	-

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020 年 6 月 2 日）基金份额总额	917,862,306.63
本报告期期初基金份额总额	925,166,204.92
本报告期基金总申购份额	91,092,327.32
减：本报告期基金总赎回份额	844,565,099.37
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	171,693,432.87

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金没有召开份额持有人大会。

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 2021 年 2 月 23 日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于变更高级管理人员的公告》，自 2021 年 2 月 23 日起，由徐娇娇女士担任公司督察长。
- 2、2021 年 5 月，中国农业银行总行决定谭敦宇任托管业务部总裁。

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 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

10.6 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。

10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人和托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到稽查或处罚。报告期内，公司收到北京证监局对公司采取警示措施的决定。公司已及时完成了整改，提升了内控水平。

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.8.1 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	
兴业证券	1	215,535,376.72	97.04%	200,726.16	97.04%	-
长江证券	1	6,585,602.02	2.96%	6,133.24	2.96%	-

注：（一）本基金本报告期末新增、撤销交易单元；

（二）交易单元选择的标准和程序

基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其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。

10.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
兴业证券	89,046,500.00	100.00%	563,000,000.00	100.00%	-	-	223,368,371.90	98.02%
长江证券	-	-	-	-	-	-	4,503,634.00	1.98%

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准基金募集的文件；
- 2、基金合同；
- 3、托管协议；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、基金托管人业务资格批件和营业执照；

6、中国证监会要求的其他文件。

11.2 存放地点

基金管理人和托管人住所。

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 (<http://www.mfcteda.com>) 查阅。

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

泰达宏利基金管理有限公司

2021 年 8 月 31 日