

# 泰达宏利价值优化型成长类行业混合型证 券投资基金 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：交通银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人泰达宏利基金管理有限公司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。本中期报告已经全体独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人交通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

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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内容的真实、准确和完整发表意见	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>12</b>
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>39</b>
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
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	47

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 .....	47
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 .....	47
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 .....	47
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	48
7.12 投资组合报告附注 .....	48
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>49</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	49
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>49</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>49</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	49
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 .....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	50
10.4 基金投资策略的改变 .....	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	50
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	50
10.8 其他重大事件 .....	52
<b>§ 11 备查文件目录 .....</b>	<b>52</b>
11.1 备查文件目录 .....	52
11.2 存放地点 .....	52
11.3 查阅方式 .....	52

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	泰达宏利价值优化型成长类行业混合型证券投资基金
基金简称	泰达宏利成长混合
基金主代码	162201
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003 年 4 月 25 日
基金管理人	泰达宏利基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	333,517,114.70 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于成长行业类别中内在价值被相对低估，并与同行业类别上市公司相比具有更高增长潜力的上市公司。在有效控制投资组合风险的前提下，为基金份额持有人提供长期稳定的投资回报。
投资策略	采用“自上而下”的投资方法，具体体现在资产配置、行业配置和个股选择的全过程中。
业绩比较基准	65%×富时中国 A600 成长行业指数+35%×上证国债指数
风险收益特征	本基金在证券投资基金中属于较高风险的基金品种。

### 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	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	徐娇娇	陆志俊
	联系电话	66577766	95559
	电子邮箱	irm@mfcteda.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		400-698-8888	95559
传真		010-66577666	021-62701216
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	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 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	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码		100026	200336
法定代表人		刘轶	任德奇

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.mfcteda.com">http://www.mfcteda.com</a>
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	1,173,842.03
本期利润	146,561,624.88
加权平均基金份额本期利润	0.4153
本期加权平均净值利润率	25.20%
本期基金份额净值增长率	28.35%
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	386,732,039.62
期末可供分配基金份额利润	1.1596
期末基金资产净值	720,249,154.32
期末基金份额净值	2.1596
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	1,560.88%

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

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	13.36%	2.53%	7.95%	0.01%	5.41%	2.52%
过去三个月	53.11%	2.22%	28.85%	0.08%	24.26%	2.14%

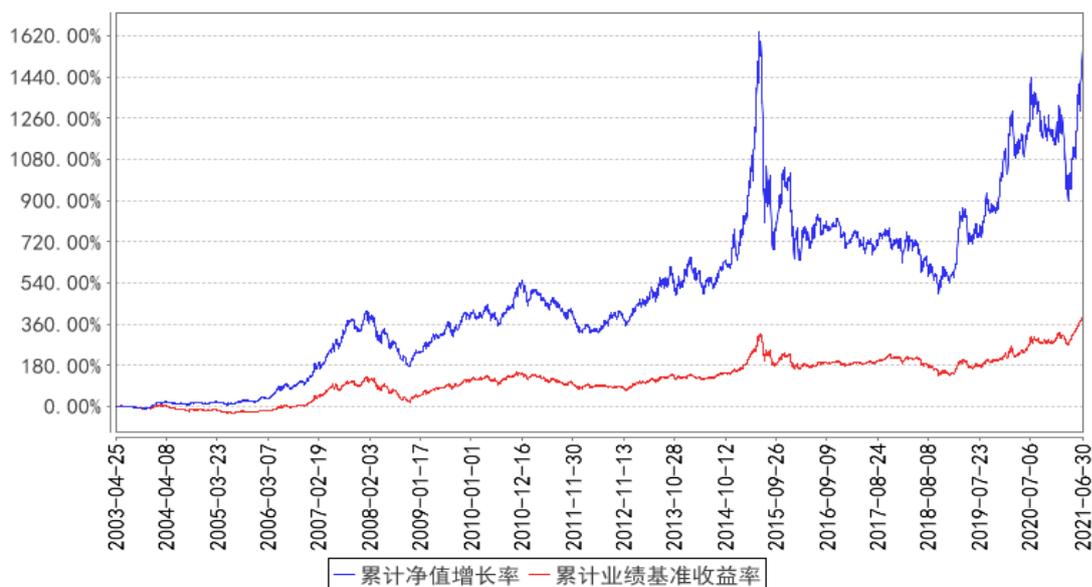
过去六个月	28.35%	2.54%	23.10%	0.84%	5.25%	1.70%
过去一年	25.71%	2.13%	32.03%	0.97%	-6.32%	1.16%
过去三年	126.51%	1.87%	70.36%	1.08%	56.15%	0.79%
自基金合同生效起至今	1,560.88%	1.59%	389.02%	1.16%	1,171.86%	0.43%

注：本基金业绩比较基准： $65\% \times$ 富时中国 A600 成长行业指数 $+35\% \times$ 上证国债指数。上证国债指数选取的样本为在上海证券交易所上市交易的、除浮息债外的国债品种，样本国债的剩余期限分布均匀，收益率曲线较为完整、合理，而且参与主体丰富，竞价交易连续性更强，能反映出市场利率的瞬息变化，客观、真实地标示出利率市场整体的收益风险度。

富时中国 A600 成长行业指数是从富时中国 A600 行业指数中重新归类而成，成份股按照全球公认并已广泛采用的富时指数全球行业分类系统进行分类，全面体现成长行业类别的风险收益特征。

### 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

泰达宏利成长混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本报告期末，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		
王鹏	基金经理	2020 年 12 月 28 日	-	9 年	清华大学工学硕士；2012 年 7 月至 2014 年 3 月，任职于中邮创业基金管理有限公司，担任 TMT 行业研究员；2014 年 3 月至 2015 年 6 月，任职于上海磐信投资管理有限公司，担任电子行业研究员；2015 年 6 月，加入泰达宏利基金管理有限公司，任职于研究部，先后担任研究员、基金经理等职；具有 9 年证券从业经验，具有基金从业资格。
周琦凯	基金经理	2015 年 5 月 14 日	2021 年 2 月 26 日	10 年	清华大学管理学硕士；2010 年 7 月加入泰达宏利基金管理有限公司，任职于研究部，负责建筑建材、传媒互联网行业研究，曾先后担任助理研究员、研究员、高级研究员等职务，现任基金经理；具备 10 年基金从业经验，10 年证券投资管理经验，具有基金从业资格。
宁霄	基金经理助理	2019 年 9 月 23 日	-	13 年	中国人民大学金融工程硕士，2006 年 4 月至 2007 年 6 月，任职于兴业全球基金管理有限公司基金运营部，担任基金清算；2007 年 8 月至 2011 年 3 月，任职于华夏基金管理有限公司基金运作部，担任基金会计；2013 年 7 月加入泰达宏利基金管理有限公司，曾先后担任交易员、交易主管、交易部总经理助理、基金经理助理，现任基金经理。具备 13 年证券从业经验，8 年固收从业经验，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

基于对产业周期的判断，本基金上半年仍然集中配置在高景气的新能源车产业链中游和上游。虽然一季度末经历了原材料快速大幅上涨和芯片短缺等不利因素的冲击，但我们观察到新能源上游原材料价格仍然呈上涨趋势，同时中游排产屡创新高，显示出非常高的行业景气度。

我们认为目前的新能源车产业类似 12 年-15 年的智能机产业，渗透率处于迅速提升阶段，在渗透率达到 30%之前，任何短期扰动大概率是机会。本基金会牢牢把握这一时代赋予中国制造业的机会。

本基金按照基金契约，精选成长性强的行业和公司，分享行业和企业成长的红利。

### 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 2.1596 元；本报告期基金份额净值增长率为 28.35%，业

绩比较基准收益率为 23.10%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年我们认为三季报是非常关键的报表季，决定了下半年的结构性行情。三季度是第一个消除了低基数效应的报表季，只有需求端有高增长的行业才能继续报表端的高增长，所以新能源车大概率在行业比较上优势明显。同时考虑四季度开始芯片瓶颈和中游材料产能瓶颈逐渐消除，潜在新能源车消费需求会真正释放，板块大概率在数据和业绩的双重催化下迎来戴维斯双击行情。把眼光再放长，中游要求的是低成本大规模制造能力，这正是国内制造业核心优势。

本基金管理人将继续坚持投资景气行业龙头的投资理念，不断扩展自己的能力圈，通过学习不断提炼和总结长期适用的投资方法，力争为基金持有人提供持续回报。

#### 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

本报告期内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者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

本报告期内，基金托管人在泰达宏利价值优化型成长类行业混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

### 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，泰达宏利基金管理有限公司在泰达宏利价值优化型成长类行业混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。个别工作日，托管人发现个别监督指标不符合基金合同的约定，托管人及时通知了基金管理人，基金管理人根据规定进行了调整。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由泰达宏利基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关泰达宏利价值优化型成长类行业混合型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。个别工作日，托管人发现个别监督指标不符合基金合同的约定，托管人及时通知了基金管理人，基金管理人根据规定进行了调整。

## § 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：泰达宏利价值优化型成长类行业混合型证券投资基金

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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	5,375,094.83	87,009,352.28
结算备付金		5,289,495.94	7,172,504.51
存出保证金		511,100.93	848,018.12
交易性金融资产	6.4.7.2	801,969,903.63	832,842,967.00
其中：股票投资		663,368,756.13	666,533,161.40
基金投资		-	-
债券投资		138,601,147.50	166,309,805.60
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	-	-
应收证券清算款		9,626,658.89	-
应收利息	6.4.7.5	979,412.44	3,431,057.42
应收股利		-	-
应收申购款		7,919,355.16	204,920.09
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		831,671,021.82	931,508,819.42
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年6月30日</b>	<b>上年度末 2020年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		99,000,000.00	120,000,000.00
应付证券清算款		6,734,242.17	77,156,559.85
应付赎回款		2,958,019.91	1,638,442.64
应付管理人报酬		776,772.78	933,353.99
应付托管费		129,462.17	155,559.00
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,690,499.75	2,993,894.70
应交税费		-	-
应付利息		54,706.22	34,027.40
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	78,164.50	132,566.81
负债合计		111,421,867.50	203,044,404.39
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	333,517,114.70	432,944,527.43
未分配利润	6.4.7.10	386,732,039.62	295,519,887.60
所有者权益合计		720,249,154.32	728,464,415.03
负债和所有者权益总计		831,671,021.82	931,508,819.42

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 2.1596 元，基金份额总额 333,517,114.70 份。

## 6.2 利润表

会计主体：泰达宏利价值优化型成长类行业混合型证券投资基金

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	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年	2020 年 1 月 1 日至 2020 年

		6 月 30 日	6 月 30 日
一、收入		158,235,477.69	160,412,873.67
1. 利息收入		2,250,047.27	3,698,346.69
其中：存款利息收入	6.4.7.11	83,673.05	165,671.48
债券利息收入		2,166,374.22	3,532,675.21
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		10,304,474.59	213,996,240.46
其中：股票投资收益	6.4.7.12	10,809,482.56	211,446,996.29
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-1,550,100.15	-99,822.31
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	1,045,092.18	2,649,066.48
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	145,387,782.85	-57,905,505.21
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	293,172.98	623,791.73
减：二、费用		11,673,852.81	17,441,626.41
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	4,357,114.71	6,781,112.55
2. 托管费	6.4.10.2.2	726,185.87	1,130,185.42
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	5,395,095.58	7,932,967.17
5. 利息支出		1,103,885.74	1,512,910.88
其中：卖出回购金融资产支出		1,103,885.74	1,512,910.88
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	91,570.91	84,450.39
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		146,561,624.88	142,971,247.26
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		146,561,624.88	142,971,247.26

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰达宏利价值优化型成长类行业混合型证券投资基金

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）	432,944,527.43	295,519,887.60	728,464,415.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	146,561,624.88	146,561,624.88
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）	-99,427,412.73	-55,349,472.86	-154,776,885.59
其中：1. 基金申购款	77,277,422.44	60,733,397.79	138,010,820.23
2. 基金赎回款	-176,704,835.17	-116,082,870.65	-292,787,705.82
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）	333,517,114.70	386,732,039.62	720,249,154.32
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 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）	575,667,039.08	260,616,652.11	836,283,691.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	142,971,247.26	142,971,247.26
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-26,776,848.05	-9,557,753.48	-36,334,601.53

(净值减少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	308,547,978.68	192,864,909.58	501,412,888.26
2. 基金赎回款	-335,324,826.73	-202,422,663.06	-537,747,489.79
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)	548,890,191.03	394,030,145.89	942,920,336.92

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：

<u>傅国庆</u>	<u>傅国庆</u>	<u>王泉</u>
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

泰达宏利价值优化型行业类别系列证券投资基金(以下简称“本系列基金”，原湘财合丰价值优化型系列行业类别开放式证券投资基金，后更名为泰达荷银价值优化型系列行业类别证券投资基金)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2003]第 21 号《关于同意湘财合丰价值优化型成长类行业证券投资基金、周期类行业证券投资基金、稳定类行业证券投资基金设立的批复》核准，由基金发起人湘财合丰基金管理有限公司(于 2004 年 1 月 9 日更名为湘财荷银基金管理有限公司，于 2006 年 4 月 27 日更名为泰达荷银基金管理有限公司，于 2010 年 3 月 9 日更名为泰达宏利基金管理有限公司)依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《湘财合丰价值优化型成长类行业证券投资基金、周期类行业证券投资基金、稳定类行业证券投资基金基金契约》发起，并于 2003 年 4 月 25 日募集成立。

本系列基金的基金名称于 2004 年 10 月 13 日改为湘财合丰价值优化型成长类行业证券投资基金、周期类行业证券投资基金、稳定类行业证券投资基金。于 2006 年 6 月 6 日改为泰达荷银价值优化型成长类行业证券投资基金、周期类行业证券投资基金、稳定类行业证券投资基金。根据本系列基金的基金管理人 2010 年 3 月 17 日发布的《泰达宏利基金管理有限公司关于变更公司旗下

公募基金名称的公告》，本系列基金自公告发布之日起更名为泰达宏利价值优化型成长类行业证券投资基金、周期类行业证券投资基金、稳定类行业证券投资基金。根据 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》，本系列基金于 2015 年 7 月 22 日公告后更名为泰达宏利价值优化型成长类行业混合型证券投资基金、周期类行业混合型证券投资基金、稳定类行业混合型证券投资基金。

本系列基金为契约型开放式，存续期限不定，目前下设三个子基金，分别为泰达宏利价值优化型成长类行业混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)、泰达宏利价值优化型周期类行业混合型证券投资基金和泰达宏利价值优化型稳定类行业混合型证券投资基金。本系列基金首次设立募集不包括认购资金利息共募集 2,630,119,050.77 元，其中包括本基金 1,021,628,749.98 元、泰达宏利价值优化型周期类行业混合型证券投资基金 627,135,410.16 元和泰达宏利价值优化型稳定类行业混合型证券投资基金 981,354,890.63 元，业经普华永道中天会计师事务所普华永道验字(2003)第 50 号验资报告予以验证。本基金的基金管理人为泰达宏利基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司(以下简称“交通银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利价值优化型成长类行业混合型证券投资基金、周期类行业混合型证券投资基金、稳定类行业混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本系列基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票和债券以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。其中股票投资部分分别主要投资于成长、稳定、周期三个行业类别中依据市净率和市盈率与每股预期收益增长率之比所确定的具有增长潜力的价值优化型股票。每只行业类别基金投资于股票、债券的比重不低于该基金资产总值的 80%，投资于国债的比重不低于该基金资产净值的 20%。本基金的业绩比较基准为：富时中国 A600 成长行业指数×65%+上证国债指数×35%。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》、《泰达宏利价值优化型系列行业类别证券投资基金下设的泰达宏利价值优化型成长类行业混合型证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.2 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。

#### 6.4.3 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。

#### 6.4.4 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.4.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无会计政策的变更。

##### 6.4.4.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无会计估计的变更。

##### 6.4.4.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无重大会计差错发生。

#### 6.4.5 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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。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 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017

年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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。

## 6.4.6 重要财务报表项目的说明

### 6.4.6.1 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	5,375,094.83
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	5,375,094.83

### 6.4.6.2 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	492,969,961.08	663,368,756.13	170,398,795.05	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	138,812,950.51	138,601,147.50	-211,803.01
	银行间市场	-	-	-
	合计	138,812,950.51	138,601,147.50	-211,803.01

资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	631,782,911.59	801,969,903.63	170,186,992.04

#### 6.4.6.3 衍生金融资产/负债

本基金报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.6.4 买入返售金融资产

##### 6.4.6.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末买入返售金融资产无余额。

##### 6.4.6.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.6.5 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	1,982.85
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	2,142.27
应收债券利息	975,079.99
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	0.33
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	207.00
合计	979,412.44

#### 6.4.6.6 其他资产

本基金本报告期末其他资产无余额。

#### 6.4.6.7 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	1,690,499.75
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,690,499.75

#### 6.4.6.8 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	7,280.66
应付证券出借违约金	-
预提费用	70,840.91
其他	42.93
合计	78,164.50

#### 6.4.6.9 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	432,944,527.43	432,944,527.43
本期申购	77,277,422.44	77,277,422.44
本期赎回（以“-”号填列）	-176,704,835.17	-176,704,835.17
- 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	333,517,114.70	333,517,114.70

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.6.10 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	506,420,010.51	-210,900,122.91	295,519,887.60
本期利润	1,173,842.03	145,387,782.85	146,561,624.88
本期基金份额交易产生的变动数	-114,480,239.19	59,130,766.33	-55,349,472.86
其中：基金申购款	87,865,738.63	-27,132,340.84	60,733,397.79
基金赎回款	-202,345,977.82	86,263,107.17	-116,082,870.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	393,113,613.35	-6,381,573.73	386,732,039.62

#### 6.4.6.11 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	36,389.08
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	42,030.08
其他	5,253.89
合计	83,673.05

#### 6.4.6.12 股票投资收益

##### 6.4.6.12.1 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	10,809,482.56
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	10,809,482.56

##### 6.4.6.12.2 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	1,823,069,553.39
减：卖出股票成本总额	1,812,260,070.83
买卖股票差价收入	10,809,482.56

##### 6.4.6.12.3 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。

#### 6.4.6.13 债券投资收益

##### 6.4.6.13.1 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	-1,550,100.15
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	-1,550,100.15

#### 6.4.6.13.2 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	146,925,161.37
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	145,346,276.15
减：应收利息总额	3,128,985.37
买卖债券差价收入	-1,550,100.15

#### 6.4.6.13.3 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。

#### 6.4.6.13.4 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。

#### 6.4.6.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.6.14 贵金属投资收益

##### 6.4.6.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

##### 6.4.6.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

##### 6.4.6.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无赎回贵金属差价收入。

##### 6.4.6.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无申购贵金属差价收入。

#### 6.4.6.15 衍生工具收益

##### 6.4.6.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

##### 6.4.6.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具收益-其他投资收益。

#### 6.4.6.16 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	1,045,092.18
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	1,045,092.18

#### 6.4.6.17 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	145,387,782.85
股票投资	144,565,441.10
债券投资	822,341.75
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	145,387,782.85

#### 6.4.6.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	289,503.96
基金转换费收入	3,669.02
合计	293,172.98

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

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，本系列基金各行业类别在基金间免费转换，其中不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 6.4.6.19 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	5,395,095.58
银行间市场交易费用	-
合计	5,395,095.58

#### 6.4.6.20 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	42,151.28
信息披露费	19,835.79
证券出借违约金	-
银行费用	2,130.00
账户维护费	26,853.84
其他	600.00
合计	91,570.91

#### 6.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.7.1 或有事项

本基金本报告期无或有事项。

##### 6.4.7.2 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。

#### 6.4.8 关联方关系

##### 6.4.8.1 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。

##### 6.4.8.2 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
交通银行股份有限公司(交通银行)	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。

## 6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.9.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 6.4.9.1.2 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。

#### 6.4.9.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.9.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.9.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

### 6.4.9.2 关联方报酬

#### 6.4.9.2.1 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1月1日至2020年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,357,114.71	6,781,112.55
其中：支付销售机构的客户维护费	1,287,857.19	1,321,535.04

注：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 1.5% 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 × 1.5% / 当年天数。上述相关费用包含实际支付金额和税金。

#### 6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	726,185.87	1,130,185.42

注：支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

#### 6.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间内均无与关联方进行的银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.9.4 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

##### 6.4.9.4.1 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。

##### 6.4.9.4.2 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。

#### 6.4.9.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.9.5.1 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。

##### 6.4.9.5.2 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。

#### 6.4.9.6 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 1 月 1 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
交通银行	5,375,094.83	36,389.08	22,233,116.59	99,877.87

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按约定利率计息。

#### 6.4.9.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.9.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.10 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.11 期末(2021年6月30日)本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.11.1 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	5,125	221,502.50	327,077.50	-
688276	百克生物	2021年6月17日	2021年12月27日	新股流通受限	36.35	79.48	3,486	126,716.10	277,067.28	-
688625	呈和科技	2021年5月31日	2021年12月7日	新股流通受限	16.48	42.63	2,672	44,034.56	113,907.36	-
300919	中伟股份	2020年12月15日	2021年7月2日	新股流通受限	24.60	163.00	610	15,006.00	99,430.00	-
688499	利元亨	2021年6月23日	2021年7月1日	新股未上市	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-
300957	贝泰妮	2021年3月18日	2021年9月27日	新股流通受限	47.33	251.96	283	13,394.39	71,304.68	-
688468	科美诊断	2021年3月31日	2021年10月11日	新股流通受限	7.15	16.50	3,919	28,020.85	64,663.50	-
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	-

		日	日							
688087	英科再生	2021年 6月30 日	2021年 7月9 日	新股未 上市	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
301017	漱玉平民	2021年 6月23 日	2021年 7月5 日	新股未 上市	8.86	8.86	5,550	49,173.00	49,173.00	-
301020	密封科技	2021年 6月28 日	2021年 7月6 日	新股未 上市	10.64	10.64	4,210	44,794.40	44,794.40	-
300973	立高食品	2021年 4月8 日	2021年 10月 15日	新股流 通受限	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-
300979	华利集团	2021年 4月15 日	2021年 10月 26日	新股流 通受限	33.22	87.50	463	15,380.86	40,512.50	-
688395	正弦电气	2021年 4月21 日	2021年 10月 29日	新股流 通受限	15.95	22.37	1,627	25,950.65	36,395.99	-
301021	英诺激光	2021年 6月28 日	2021年 7月6 日	新股未 上市	9.46	9.46	2,899	27,424.54	27,424.54	-
301009	可靠股份	2021年 6月8 日	2021年 12月 17日	新股流 通受限	12.54	27.89	801	10,044.54	22,339.89	-
300941	创识科技	2021年 2月2 日	2021年 8月9 日	新股流 通受限	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06	-
301015	百洋医药	2021年 6月22 日	2021年 12月 30日	新股流 通受限	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
688226	威腾电气	2021年 6月28 日	2021年 7月7 日	新股未 上市	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
300932	三友联众	2021年 1月15 日	2021年 7月22 日	新股流 通受限	24.69	31.71	492	12,147.48	15,601.32	-
300982	苏文电能	2021年 4月19 日	2021年 10月 27日	新股流 通受限	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300968	格林精密	2021年 4月6 日	2021年 10月 15日	新股流 通受限	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-
300940	南极	2021年	2021年	新股流	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-

	光	1月27日	8月3日	通受限						
300614	百川畅银	2021年5月18日	2021年11月25日	新股流通受限	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300937	药易购	2021年1月20日	2021年7月27日	新股流通受限	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
301013	利和兴	2021年6月21日	2021年12月29日	新股流通受限	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-
300942	易瑞生物	2021年2月2日	2021年8月9日	新股流通受限	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300997	欢乐家	2021年5月26日	2021年12月2日	新股流通受限	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
300933	中辰股份	2021年1月15日	2021年7月22日	新股流通受限	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
301002	崧盛股份	2021年5月27日	2021年12月7日	新股流通受限	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
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	-
300955	嘉亨家化	2021年3月16日	2021年9月24日	新股流通受限	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300956	英力股份	2021年3月16日	2021年9月27日	新股流通受限	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
300962	中金辐照	2021年3月29日	2021年10月11日	新股流通受限	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300952	恒辉安防	2021年3月3日	2021年9月13日	新股流通受限	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
301016	雷尔伟	2021年6月23日	2021年12月30日	新股流通受限	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
300966	共同药业	2021年3月31日	2021年10月11日	新股流通受限	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-

300945	曼卡龙	2021年 2月3 日	2021年 8月10 日	新股流 通受限	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300931	通用 电梯	2021年 1月13 日	2021年 7月21 日	新股流 通受限	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300961	深水 海纳	2021年 3月23 日	2021年 9月30 日	新股流 通受限	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300950	德固 特	2021年 2月24 日	2021年 9月3 日	新股流 通受限	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
300958	建工 修复	2021年 3月18 日	2021年 9月29 日	新股流 通受限	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300986	志特 新材	2021年 4月21 日	2021年 11月1 日	新股流 通受限	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网 传媒	2021年 4月28 日	2021年 11月 11日	新股流 通受限	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300978	东箭 科技	2021年 4月15 日	2021年 10月 26日	新股流 通受限	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300926	博俊 科技	2020年 12月29 日	2021年 07月 12日	新股流 通受限	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300930	屹通 新材	2021年 1月13 日	2021年 7月21 日	新股流 通受限	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300985	致远 新能	2021年 4月21 日	2021年 10月 29日	新股流 通受限	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-
300971	博亚 精工	2021年 4月7 日	2021年 10月 15日	新股流 通受限	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-
301004	嘉益 股份	2021年 6月18 日	2021年 12月 27日	新股流 通受限	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-
300991	创益 通	2021年 5月12 日	2021年 11月 22日	新股流 通受限	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300927	江天 化学	2020年 12月29 日	2021年 7月7 日	新股流 通受限	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-

		日	日								
300963	中洲特材	2021年 3月30 日	2021年 10月 11日	新股流 通受限	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67		-
301011	华立科技	2021年 6月9 日	2021年 12月 17日	新股流 通受限	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00		-
300943	春晖智控	2021年 2月3 日	2021年 8月10 日	新股流 通受限	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55		-
300967	晓鸣股份	2021年 4月2 日	2021年 10月 13日	新股流 通受限	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78		-
300972	万辰生物	2021年 4月8 日	2021年 10月 19日	新股流 通受限	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50		-
300929	华骐环保	2021年 1月12 日	2021年 07月 21日	新股流 通受限	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65		-
300960	通业科技	2021年 3月22 日	2021年 9月29 日	新股流 通受限	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04		-
300995	奇德新材	2021年 5月17 日	2021年 11月 26日	新股流 通受限	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12		-
301007	德迈仕	2021年 6月4 日	2021年 12月 16日	新股流 通受限	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32		-
300998	宁波方正	2021年 5月25 日	2021年 12月2 日	新股流 通受限	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32		-
301012	扬电科技	2021年 6月15 日	2021年 12月 22日	新股流 通受限	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20		-
300992	泰福泵业	2021年 5月17 日	2021年 11月 25日	新股流 通受限	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00		-
301010	晶雪节能	2021年 6月9 日	2021年 12月 20日	新股流 通受限	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98		-

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。

#### 6.4.11.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.11.3.1 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。

##### 6.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 99,000,000.00 元，于 2021 年 7 月 5 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 6.4.11.4 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。

#### 6.4.12 金融工具风险及管理

本基金是一只进行主动投资的股票型证券投资基金，属于较高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资及债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

##### 6.4.12.1 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、监察稽核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管理委员会，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监察稽核部负责，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。监察稽核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。

#### 6.4.12.2 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，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

本基金债券投资的信用评级情况按《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。

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

#### 6.4.12.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大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，因此除部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。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。

#### 6.4.12.3.1 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时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

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

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

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：

根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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

#### 6.4.12.4 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。

##### 6.4.12.4.1 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、结算备付金及债券投资等。

##### 6.4.12.4.1.1 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	5,375,094.83	-	-	-	5,375,094.83
结算备付金	5,289,495.94	-	-	-	5,289,495.94
存出保证金	511,100.93	-	-	-	511,100.93
交易性金融资产	138,601,147.50	-	-	663,368,756.13	801,969,903.63
应收利息	-	-	-	979,412.44	979,412.44
应收申购款	-	-	-	7,919,355.16	7,919,355.16
应收证券清算款	-	-	-	9,626,658.89	9,626,658.89
资产总计	149,776,839.20	-	-	681,894,182.62	831,671,021.82
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,958,019.91	2,958,019.91
应付管理人报酬	-	-	-	776,772.78	776,772.78
应付托管费	-	-	-	129,462.17	129,462.17

应付证券清算款	-	-	-	6,734,242.17	6,734,242.17
卖出回购金融资产款	99,000,000.00	-	-	-	99,000,000.00
应付交易费用	-	-	-	1,690,499.75	1,690,499.75
应付利息	-	-	-	54,706.22	54,706.22
其他负债	-	-	-	78,164.50	78,164.50
负债总计	99,000,000.00	-	-	12,421,867.50	111,421,867.50
利率敏感度缺口	50,776,839.20	-	-	669,472,315.12	720,249,154.32
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	87,009,352.28	-	-	-	87,009,352.28
结算备付金	7,172,504.51	-	-	-	7,172,504.51
存出保证金	848,018.12	-	-	-	848,018.12
交易性金融资产	93,912,627.00	72,397,178.60	-	666,533,161.40	832,842,967.00
应收利息	-	-	-	3,431,057.42	3,431,057.42
应收申购款	-	-	-	204,920.09	204,920.09
资产总计	188,942,501.91	72,397,178.60	-	670,169,138.91	931,508,819.42
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,638,442.64	1,638,442.64
应付管理人报酬	-	-	-	933,353.99	933,353.99
应付托管费	-	-	-	155,559.00	155,559.00
应付证券清算款	-	-	-	77,156,559.85	77,156,559.85
卖出回购金融资产款	120,000,000.00	-	-	-	120,000,000.00
应付交易费用	-	-	-	2,993,894.70	2,993,894.70
应付利息	-	-	-	34,027.40	34,027.40
其他负债	-	-	-	132,566.81	132,566.81
负债总计	120,000,000.00	-	-	83,044,404.39	203,044,404.39
利率敏感度缺口	68,942,501.91	72,397,178.60	-	587,124,734.52	728,464,415.03

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.12.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
	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	市场利率下降 25 个基点	250,000.00	350,000.00
	市场利率上升 25 个基点	-250,000.00	-340,000.00

#### 6.4.12.4.2 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。

#### 6.4.12.4.3 其他价格风险

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

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中投资于股票、债券的比重不低于该基金资产总值的 80%，投资于国债的比重不低于该基金资产净值的 20%。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。

##### 6.4.12.4.3.1 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	663,368,756.13	92.10	666,533,161.40	91.50
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	663,368,756.13	92.10	666,533,161.40	91.50

#### 6.4.12.4.3.2 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%	48,160,000.00	36,140,000.00
	业绩比较基准下降 5%	-48,160,000.00	-36,140,000.00

#### 6.4.13 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	663,368,756.13	79.76
	其中：股票	663,368,756.13	79.76
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	138,601,147.50	16.67
	其中：债券	138,601,147.50	16.67
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	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	10,664,590.77	1.28
8	其他各项资产	19,036,527.42	2.29
9	合计	831,671,021.82	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	38,147.08	0.01
B	采矿业	10,512.39	0.00
C	制造业	644,214,961.64	89.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	41,689.20	0.01
E	建筑业	25,371.37	0.00
F	批发和零售业	334,822.50	0.05
G	交通运输、仓储和邮政业	18,122,314.33	2.52
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	56,000.27	0.01
J	金融业	97,319.40	0.01
K	房地产业	10,123.56	0.00
L	租赁和商务服务业	15,994.06	0.00
M	科学研究和技术服务业	131,868.00	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	253,370.30	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	16,262.03	0.00
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	663,368,756.13	92.10

### 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	002709	天赐材料	592,736	63,173,802.88	8.77
2	603659	璞泰来	453,181	61,904,524.60	8.59
3	300750	宁德时代	115,268	61,645,326.40	8.56
4	600577	精达股份	6,520,000	41,597,600.00	5.78
5	600110	诺德股份	2,996,105	36,492,558.90	5.07
6	603799	华友钴业	282,200	32,227,240.00	4.47
7	300568	星源材质	733,845	30,359,167.65	4.22
8	300953	震裕科技	260,916	28,426,798.20	3.95
9	002824	和胜股份	791,800	27,918,868.00	3.88
10	688005	容百科技	219,127	26,558,192.40	3.69
11	300035	中科电气	1,054,200	25,775,190.00	3.58

12	002812	恩捷股份	104,200	24,393,220.00	3.39
13	688116	天奈科技	199,678	23,562,004.00	3.27
14	300207	欣旺达	637,000	20,740,720.00	2.88
15	688308	欧科亿	302,759	20,517,977.43	2.85
16	300769	德方纳米	90,400	18,684,776.00	2.59
17	002245	蔚蓝锂芯	918,800	18,100,360.00	2.51
18	600699	均胜电子	584,200	14,908,784.00	2.07
19	000301	东方盛虹	548,600	11,465,740.00	1.59
20	300919	中伟股份	63,110	10,286,930.00	1.43
21	300861	美畅股份	118,500	9,990,735.00	1.39
22	300014	亿纬锂能	72,008	7,483,791.44	1.04
23	688599	天合光能	258,419	7,326,178.65	1.02
24	002459	晶澳科技	148,400	7,271,600.00	1.01
25	300680	隆盛科技	269,960	7,221,430.00	1.00
26	603396	金辰股份	126,400	7,218,704.00	1.00
27	003022	联泓新科	212,200	6,514,540.00	0.90
28	301002	崧盛股份	41,581	3,400,603.62	0.47
29	002594	比亚迪	8,000	2,008,000.00	0.28
30	688680	海优新材	2,795	680,889.95	0.09
31	300896	爱美客	537	423,628.56	0.06
32	603806	福斯特	3,300	346,929.00	0.05
33	688317	之江生物	5,125	327,077.50	0.05
34	688161	威高骨科	3,069	325,467.45	0.05
35	688276	百克生物	3,486	277,067.28	0.04
36	688269	凯立新材	1,941	270,808.32	0.04
37	301015	百洋医药	4,614	251,115.78	0.03
38	688286	敏芯股份	1,681	234,297.78	0.03
39	300912	凯龙高科	5,117	200,432.89	0.03
40	301013	利和兴	4,704	168,966.51	0.02
41	688621	阳光诺和	1,485	131,868.00	0.02
42	301016	雷尔伟	2,747	115,711.58	0.02
43	688625	呈和科技	2,672	113,907.36	0.02
44	688656	浩欧博	1,371	101,961.27	0.01
45	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.01
46	300957	贝泰妮	283	71,304.68	0.01
47	688468	科美诊断	3,919	64,663.50	0.01
48	601665	齐鲁银行	6,731	62,598.30	0.01
49	002407	多氟多	1,700	60,418.00	0.01
50	688328	深科达	1,499	56,647.21	0.01
51	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
52	300910	瑞丰新材	474	49,556.70	0.01
53	688597	煜邦电力	3,907	49,306.34	0.01

54	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.01
55	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.01
56	300894	火星人	628	42,704.00	0.01
57	300973	立高食品	360	41,655.60	0.01
58	688063	派能科技	209	41,131.20	0.01
59	688517	金冠电气	2,892	41,095.32	0.01
60	300979	华利集团	463	40,512.50	0.01
61	688067	爱威科技	1,259	39,520.01	0.01
62	605339	南侨食品	864	37,307.52	0.01
63	600032	浙江新能	3,045	37,027.20	0.01
64	688395	正弦电气	1,627	36,395.99	0.01
65	688681	科汇股份	1,899	34,903.62	0.00
66	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
67	300900	广联航空	879	32,857.02	0.00
68	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
69	605296	神农集团	569	26,856.80	0.00
70	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
71	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
72	300911	亿田智能	309	21,407.52	0.00
73	001206	依依股份	321	20,389.92	0.00
74	300884	狄耐克	749	20,133.12	0.00
75	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
76	300891	惠云钛业	1,143	19,876.77	0.00
77	603931	格林达	604	19,412.56	0.00
78	605305	中际联合	368	19,364.16	0.00
79	300878	维康药业	401	18,714.67	0.00
80	603511	爱慕股份	553	18,249.00	0.00
81	300864	南大环境	316	17,383.16	0.00
82	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
83	300908	仲景食品	285	16,983.15	0.00
84	300909	汇创达	386	16,636.60	0.00
85	300913	兆龙互连	630	16,506.00	0.00
86	003019	宸展光电	601	16,263.06	0.00
87	605098	行动教育	289	16,262.03	0.00
88	605196	华通线缆	1,172	16,079.84	0.00
89	605300	佳禾食品	576	16,012.80	0.00
90	603836	海程邦达	733	15,994.06	0.00
91	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00
92	300890	翔丰华	286	15,615.60	0.00
93	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
94	003015	日久光电	1,128	14,551.20	0.00
95	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00

96	605180	华生科技	384	14,208.00	0.00
97	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
98	605319	无锡振华	764	13,706.16	0.00
99	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
100	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
101	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
102	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
103	300902	国安达	551	12,981.56	0.00
104	605050	福然德	1,197	12,939.57	0.00
105	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
106	300892	品渥食品	272	12,479.36	0.00
107	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
108	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
109	605218	伟时电子	837	11,860.29	0.00
110	300889	爱克股份	479	11,639.70	0.00
111	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
112	300879	大叶股份	466	11,267.88	0.00
113	605488	福莱新材	416	11,103.04	0.00
114	300918	南山智尚	1,063	11,065.83	0.00
115	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
116	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
117	605259	绿田机械	295	10,516.75	0.00
118	605086	龙高股份	443	10,512.39	0.00
119	605189	富春染织	422	10,165.98	0.00
120	300917	特发服务	366	10,123.56	0.00
121	300876	蒙泰高新	306	10,113.30	0.00
122	300922	天秦装备	287	9,996.21	0.00
123	300882	万胜智能	572	9,981.40	0.00
124	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
125	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
126	300893	松原股份	414	9,240.48	0.00
127	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
128	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
129	001202	炬申股份	459	9,014.76	0.00
130	300881	盛德鑫泰	291	8,959.89	0.00
131	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
132	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
133	002850	科达利	100	8,740.00	0.00
134	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
135	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
136	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
137	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00

138	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
139	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
140	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
141	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
142	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
143	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
144	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
145	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
146	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
147	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
148	300886	华业香料	191	6,194.13	0.00
149	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
150	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
151	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
152	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
153	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
154	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
155	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
156	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
157	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
158	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
159	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
160	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
161	301010	晶雪节能	218	3,838.98	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	601689	拓普集团	70,308,093.37	9.65
2	300014	亿纬锂能	65,684,792.72	9.02
3	601012	隆基股份	58,948,866.62	8.09
4	600438	通威股份	58,646,914.58	8.05
5	603799	华友钴业	52,162,989.40	7.16
6	300073	当升科技	45,079,973.00	6.19
7	603659	璞泰来	44,809,830.00	6.15
8	002245	蔚蓝锂芯	44,700,207.43	6.14
9	603520	司太立	40,845,012.40	5.61
10	002709	天赐材料	39,194,845.63	5.38
11	002824	和胜股份	35,740,110.90	4.91
12	600577	精达股份	34,641,915.06	4.76
13	300659	中孚信息	33,914,017.49	4.66

14	300082	奥克股份	31,459,706.60	4.32
15	600110	诺德股份	30,842,002.00	4.23
16	002460	赣锋锂业	29,863,270.85	4.10
17	688308	欧科亿	28,967,425.71	3.98
18	300726	宏达电子	28,583,302.00	3.92
19	300750	宁德时代	28,322,011.00	3.89
20	603678	火炬电子	26,995,010.16	3.71
21	300207	欣旺达	26,438,420.00	3.63
22	300379	东方通	24,460,329.00	3.36
23	002415	海康威视	23,045,910.25	3.16
24	688063	派能科技	23,032,994.22	3.16
25	300953	震裕科技	22,839,937.20	3.14
26	002756	永兴材料	22,553,303.64	3.10
27	600426	华鲁恒升	22,490,265.00	3.09
28	600176	中国巨石	21,927,637.20	3.01
29	603185	上机数控	21,788,619.78	2.99
30	300035	中科电气	21,388,452.00	2.94
31	300274	阳光电源	21,234,726.60	2.91
32	002407	多氟多	19,941,991.00	2.74
33	000661	长春高新	18,689,213.04	2.57
34	300568	星源材质	18,384,874.32	2.52
35	688390	固德威	17,620,499.05	2.42
36	300769	德方纳米	17,511,518.00	2.40
37	002050	三花智控	17,469,346.00	2.40
38	002850	科达利	16,816,452.98	2.31
39	600885	宏发股份	15,561,703.84	2.14
40	002812	恩捷股份	15,185,060.00	2.08
41	688116	天奈科技	14,918,925.41	2.05

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	300014	亿纬锂能	108,243,996.00	14.86
2	603520	司太立	78,032,228.46	10.71
3	300073	当升科技	62,450,586.49	8.57
4	300659	中孚信息	55,522,570.66	7.62
5	600438	通威股份	54,311,421.82	7.46
6	601012	隆基股份	54,027,101.00	7.42
7	002050	三花智控	53,116,275.32	7.29

8	688111	金山办公	52,156,787.25	7.16
9	601689	拓普集团	49,778,245.57	6.83
10	300124	汇川技术	47,249,581.00	6.49
11	300760	迈瑞医疗	45,252,006.00	6.21
12	300601	康泰生物	43,783,047.17	6.01
13	300207	欣旺达	42,781,824.24	5.87
14	603185	上机数控	38,892,302.00	5.34
15	688005	容百科技	37,773,809.20	5.19
16	000661	长春高新	37,544,984.08	5.15
17	002850	科达利	36,322,526.50	4.99
18	600276	恒瑞医药	35,324,051.66	4.85
19	002709	天赐材料	34,931,855.20	4.80
20	002245	蔚蓝锂芯	31,505,039.23	4.32
21	600885	宏发股份	31,409,102.44	4.31
22	300726	宏达电子	28,321,974.00	3.89
23	300082	奥克股份	27,464,250.00	3.77
24	603678	火炬电子	25,974,432.68	3.57
25	002475	立讯精密	25,033,286.71	3.44
26	002756	永兴材料	24,194,096.40	3.32
27	002415	海康威视	23,269,341.50	3.19
28	002027	分众传媒	23,022,407.21	3.16
29	002460	赣锋锂业	22,260,472.00	3.06
30	002407	多氟多	22,120,221.00	3.04
31	300379	东方通	21,819,873.00	3.00
32	603960	克来机电	20,951,637.04	2.88
33	600426	华鲁恒升	20,773,950.00	2.85
34	300274	阳光电源	19,727,041.62	2.71
35	688308	欧科亿	19,563,864.00	2.69
36	600176	中国巨石	19,523,791.48	2.68
37	603881	数据港	19,322,156.00	2.65
38	002371	北方华创	18,186,440.54	2.50
39	603799	华友钴业	17,884,871.70	2.46
40	688390	固德威	17,173,021.60	2.36
41	002824	和胜股份	17,023,393.00	2.34
42	688383	新益昌	14,943,634.16	2.05
43	688388	嘉元科技	14,838,271.18	2.04
44	688981	中芯国际	14,812,030.17	2.03
45	300782	卓胜微	14,724,987.00	2.02

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	1,664,530,224.46
卖出股票收入（成交）总额	1,823,069,553.39

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	116,776,621.50	16.21
2	央行票据	-	-
3	金融债券	21,824,526.00	3.03
	其中：政策性金融债	21,824,526.00	3.03
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	138,601,147.50	19.24

### 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	019654	21 国债 06	978,980	97,927,369.40	13.60
2	018006	国开 1702	215,700	21,824,526.00	3.03
3	019645	20 国债 15	187,910	18,849,252.10	2.62

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。

### 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

本基金本报告期末投资于股指期货。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 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，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，华友钴业于 2020 年 12 月 30 日曾受到浙江证监局公开处罚。

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

#### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。

#### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	511,100.93
2	应收证券清算款	9,626,658.89
3	应收股利	-
4	应收利息	979,412.44
5	应收申购款	7,919,355.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	19,036,527.42

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例 (%)	持有份额	占总份额比 例 (%)
45,654	7,305.32	6,774,027.88	2.03	326,743,086.82	97.97

### 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	348,033.53	0.1044

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2003 年 4 月 25 日) 基金份额总额	1,021,690,071.80
本报告期期初基金份额总额	432,944,527.43
本报告期基金总申购份额	77,277,422.44
减：本报告期基金总赎回份额	176,704,835.17
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	333,517,114.70

## § 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、本报告期内基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金无投资策略的变化。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金未更换会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
申万宏源	2	752,411,484.93	21.62%	700,720.15	21.62%	-
海通证券	1	520,245,549.82	14.95%	484,503.31	14.95%	-
东兴证券	1	428,051,442.02	12.30%	398,643.80	12.30%	-
国金证券	1	367,334,414.37	10.56%	342,099.84	10.56%	-
信达证券	1	352,736,118.59	10.14%	328,502.77	10.14%	-
银河证券	1	302,895,722.94	8.70%	282,086.58	8.70%	-
中信证券	1	256,816,063.92	7.38%	239,173.15	7.38%	-
兴业证券	2	224,554,550.74	6.45%	209,128.34	6.45%	-
民生证券	1	164,373,742.39	4.72%	153,081.59	4.72%	-
西南证券	1	70,276,848.10	2.02%	65,448.80	2.02%	-
国盛证券	1	40,212,327.34	1.16%	37,449.66	1.16%	-
财信证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-

光大证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

注：（一）本基金本报告期撤销中信证券 211803、甬兴证券 001037 交易单元。

（二）交易单元选择的标准和程序

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

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
申万宏源	185,974,777.80	71.36%	1,003,500,000.00	43.25%	-	-
海通证券	34,116,660.50	13.09%	707,200,000.00	30.48%	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	40,520,014.00	15.55%	609,300,000.00	26.26%	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-

民生证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
财信证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
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	《泰达宏利价值优化型成长类行业混合型证券投资基金基金经理变更公告》	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站及公司网站	2021 年 02 月 27 日

## § 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