

泰达宏利波控回报 12 个月持有期混合型证 券投资基金 2022 年中期报告

2022 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：2022 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 2022 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	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	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
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	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	45
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
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	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55
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	55

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	55
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	55
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	56
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	56
7.12 投资组合报告附注	56
§ 8 基金份额持有人信息.....	57
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	57
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57
§ 9 开放式基金份额变动.....	57
§ 10 重大事件揭示	58
10.1 基金份额持有人大会决议	58
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	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
10.4 基金投资策略的改变	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
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	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	58
§ 11 备查文件目录	60
11.1 备查文件目录	60
11.2 存放地点	60
11.3 查阅方式	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泰达宏利波控回报 12 个月持有期混合型证券投资基金
基金简称	泰达宏利波控回报 12 个月混合
基金主代码	010845
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 1 月 19 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	1,208,578,684.35 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，通过积极主动的管理，力争创造高于业绩比较基准的投资收益与长期资本增值。
投资策略	本基金将采取目标波动风险预算技术进行资产配置，量化与基本面结合的股票投资策略进行权益部分投资，以及采用多种策略进行固定收益部分投资。通过综合运用以上技术，本基金将优化投资过程，在限制组合整体预期波动率的前提下，实现风险约束下投资组合 alpha 的最大化，以便获得尽可能高回报。
业绩比较基准	中债综合指数收益率×85%+中证 800 指数收益率×10%+恒生指数收益率（经汇率调整）×5%。
风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平低于股票型基金，高于货币市场基金与债券型基金。本基金可投资港股通标的股票，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

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		傅国庆	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址	http://www.mfcteda.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	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(2022 年 1 月 1 日-2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-43,229,220.68
本期利润	-26,117,036.33
加权平均基金份额本期利润	-0.0181
本期加权平均净值利润率	-1.85%
本期基金份额净值增长率	-1.05%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-32,487,654.92
期末可供分配基金份额利润	-0.0269
期末基金资产净值	1,192,494,927.18
期末基金份额净值	0.9867
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-1.33%

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	1.71%	0.22%	0.83%	0.17%	0.88%	0.05%
过去三个月	1.41%	0.32%	1.10%	0.21%	0.31%	0.11%
过去六个月	-1.05%	0.34%	-0.62%	0.23%	-0.43%	0.11%
过去一年	-1.65%	0.30%	-0.69%	0.19%	-0.96%	0.11%
自基金合同生效起至今	-1.33%	0.27%	-0.53%	0.19%	-0.80%	0.08%

注：本基金业绩比较基准： $\text{中债综合指数收益率} \times 85\% + \text{中证 800 指数收益率} \times 10\% + \text{恒生指数收益率 (经汇率调整)} \times 5\%$

中债综合指数由中央国债登记结算有限公司编制，该指数旨在综合反映债券全市场整体价格和投资回报情况。指数涵盖了银行间市场和交易所市场，具有广泛的市场代表性，适合作为本基金的业绩比较基准。

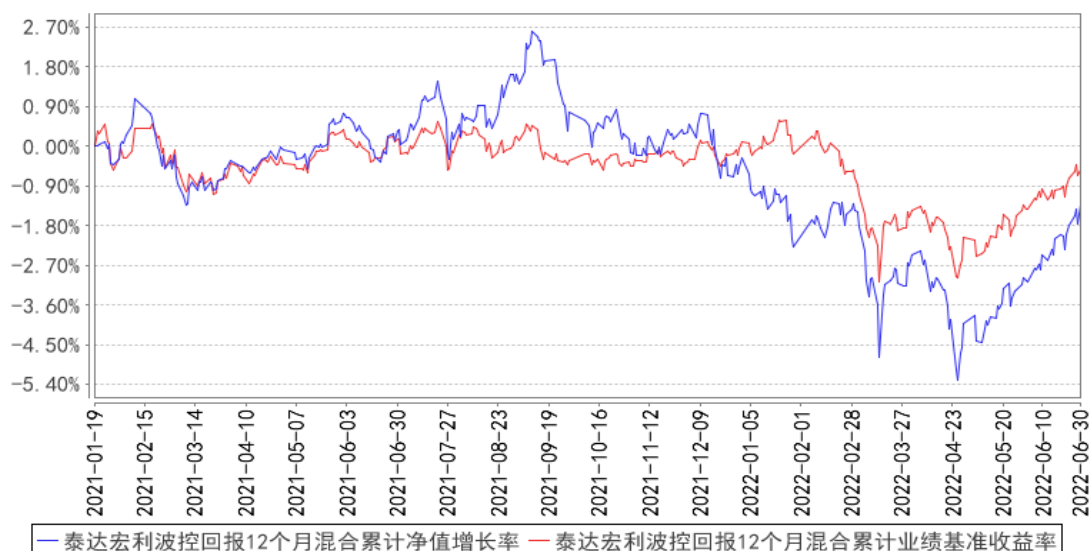
中证 800 指数是由中证指数有限公司编制，其成分股由中证 500 和沪深 300 成分股一起构成，中证 800 指数综合反映沪深市场内大中小市值公司的整体状况，适合作为本基金的业绩比较基准。

恒生指数是由恒生指数服务有限公司编制，以香港股票市场中的 50 家上市股票为成分股样本，以其发行量为权数的加权平均股价指数，是反映香港股市价幅趋势最有影响的一种股价指数。

根据本基金的投资范围和投资比例，选用上述业绩比较基准能够客观、合理地反映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

泰达宏利波控回报12个月混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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%。

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）、泰达宏利永利债券型证券投资基金、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、泰达宏利悠然养老目标日期 2025 一年持有期混合型基金中基金（FOF）、泰达宏利新兴景气龙头混合型证券投资基金、泰达宏利景气领航两年持有期混合型证券投资基金、泰达宏利中短债债券型证券投资基金、泰达宏利先进制造股票型证券投资基金、泰达宏利昇利一年定期开放债券型发起式证券投资基金、泰达宏利闽利一年定期开放债券型发起式证券投资基金在内的六十多只证券投资基金。

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘欣	总经理助理兼投资总监（权	2021 年 1 月 19 日	-	15 年	清华大学理学硕士；2007 年 7 月至 2008 年 12 月就职于工银瑞信基金管理有限公司；2008 年 12 月至 2011 年 7 月就职于嘉

	益) 兼基金经理				实基金管理有限公司; 2011 年 7 月加盟泰达宏利基金管理有限公司, 曾担任产品与金融工程部高级研究员、金融工程部副总经理、金融工程部总经理、投资副总监, 现担任公司总经理助理兼投资总监(权益) 兼基金经理; 具备 15 年基金从业经验, 15 年证券投资管理经验, 具有基金从业资格。
宁霄	本基金基金经理	2021 年 8 月 9 日	-	14 年	中国人民大学金融工程硕士; 2006 年 4 月至 2007 年 3 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 TA 清算; 2007 年 8 月至 2011 年 3 月, 任职于华夏基金管理有限公司, 担任基金会计; 2013 年 7 月至今任职于泰达宏利基金管理有限公司, 曾先后担任债券交易员、交易部交易主管、交易部总经理助理、基金经理助理, 现任基金经理。具备 14 年证券从业经验, 9 年证券投资管理经验, 具有基金从业资格。
师婧	本基金基金经理助理	2021 年 5 月 13 日	-	12 年	新加坡南洋理工大学理学硕士; 2010 年 7 月至 2017 年 9 月任职于新加坡辉立资本集团旗下的辉立证券, 其中 2010 年 7 月至 2015 年 6 月担任高级全球股票交易员, 负责参与全球 20 个国家和地区的股票交易; 2015 年 7 月至 2017 年 9 月担任基金组合经理, 主要负责中国香港地区以及亚洲二级市场的投资和全球大类资产的配置投资管理工作; 2017 年 9 月加入泰达宏利基金管理有限公司, 任职于国际业务部, 先后担任基金经理助理、基金经理等职; 具有 12 年证券投资管理经验, 具有基金从业资格。
刘洋	策略投资部副总经理(主持工作); 本基金基金经理助理	2021 年 7 月 5 日	-	7 年	北京大学理学硕士; 2015 年 1 月至 2015 年 4 月就职于九坤投资(北京)有限公司, 2015 年 5 月加入泰达宏利基金管理有限公司, 任职于金融工程部, 先后担任助理研究员、研究员、基金经理助理、策略投资部总经理助理等职务, 现担任策略投资部副总经理(主持工作) 兼基金经理; 具备 7 年证券投资管理经验, 具有基金从业资格。

注: 1、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。

2、2022 年 8 月 9 日, 本基金新增基金经理曾蕙桐, 公司已于 2022 年 8 月 10 日发布了《泰

达宏利波控回报 12 个月持有期混合型证券投资基金基金经理变更公告》。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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

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、不同时间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，无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，风险管理部定期对各投资组合的交易行为进行分析评估，向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。监察稽核部定期对异常交易制度的执行和控制工作进行稽核。

本报告期内，除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量均不超过该证券当日成交量的 5%，在本报告期内也未发生因异常交易而受到监管机构处罚的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年 A 股市场呈现出快速下跌之后的持续反弹，市场低点出现在 4 月底。此次反弹的幅度、持续性均显著超市场预期，在反弹期间从分析师、媒体各方面舆情看，均有比较一致的观望，然而市场的反弹仍旧持续，且基本没有回调。结构上看，新能源等景气成长行业反弹力度非常强，部分个股有近翻倍的表现；消费反弹幅度适中，而低估值的金融地产等传统行业反弹相对较弱。基本面层面，上海疫情解封以及对物流压力的缓解对市场恢复信心有重大提振，外部环境上美国

继续收紧货币，俄乌战争持续，没有明显改变。我们认为此阶段的市场持续反弹是对一季度快速下跌的修复，美国市场看，上半年股债均经历了明显回调，尤其是债券市场，在加息背景下债券指数回调超过 10%，其幅度是历史罕见的。股票市场体现出较大分化，低估值传统行业股票相对抗跌，而纳斯达克代表的成长股票下跌较多。

本基金在操作中，无论从仓位管理还是选股结构上，均体现出相对保守的投资风格。在仓位层面，采用目标波动率策略，通过动态调整控制产品整体波动风险。在选股层面，投资风格偏向低估值盈利稳定的大盘蓝筹股。本报告期内，本基金增加了汽车、有色金属、基础化工的配置，减少了医药、机械、建材板块的配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.9867 元；本报告期基金份额净值增长率为-1.05%，业绩比较基准收益率为-0.62%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，我们仍维持之前年报判断，全年仍保持中性偏乐观态度。短期看，对三季度市场表现偏中性，结构上相对均衡，但无论如何，我们认为最困难的时间已经过去。一方面国内来看，经过二季度持续快速的修复，市场估值已经相对走高，存在阶段性风险释放的压力，然而非常充裕的流动性和友好的支持政策对估值提供了一定支撑；另一方面，美国市场在偏紧的货币环境下的持续收缩，并没有对 A 股产生明显的影响，但我们认为在资金联动越来越紧密的环境下，两个市场很难持续走出完全反向的走势，未来可能趋向收敛。全年维度看，仍看好中小盘的战略投资机会和低估值股票的补涨投资机会。近年来 A 股市场在风格结构上存在年内比较强烈的极值反转特征，值得关注。反过来看，近年来各方面政策延续性较强，我们正面临长期结构转型和短期风格轧差过大的矛盾。美股方面，从情绪指标看市场有见底特征，但盈利预测仍未下调，衰退的表观预期未充分体现，尽管原材料价格已经在下跌，但是能源价格仍较高，通胀螺旋仍未结束。

基于基金合同与投资观点，我们的配置偏向于具有真实业绩成长且估值合理的绩优蓝筹股票，并采用目标波动率策略对产品整体风险波动进行控制。本基金在持仓上相对分散，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

根据本基金基金合同及基金的实际运作情况，本基金于本报告期内未进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内本基金未出现连续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

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 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。

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《中华人民共和国证券投资基金法》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：泰达宏利波控回报 12 个月持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	8,528,215.96	12,237,260.77
结算备付金		28,423,248.87	6,655,620.68
存出保证金		163,279.96	140,004.64
交易性金融资产	6.4.7.2	1,180,021,118.47	2,088,579,806.96
其中：股票投资		266,665,122.74	549,162,075.86
基金投资		-	-
债券投资		913,355,995.73	1,539,417,731.10
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	100,006,301.37	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	6,971,200.22
应收股利		-	94,064.26
应收申购款		1,410.83	53,934.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	14,423,738.61
资产总计		1,317,143,575.46	2,129,155,630.14
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 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		121,006,186.12	115,000,000.00

应付清算款		1,014,825.53	16.99
应付赎回款		879,630.27	-
应付管理人报酬		789,483.33	1,370,663.49
应付托管费		197,370.82	342,665.88
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		27,939.64	38,301.17
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	733,212.57	1,724,996.72
负债合计		124,648,648.28	118,476,644.25
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	1,208,578,684.35	2,016,415,931.75
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-16,083,757.17	-5,736,945.86
净资产合计		1,192,494,927.18	2,010,678,985.89
负债和净资产总计		1,317,143,575.46	2,129,155,630.14

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 1,208,578,684.35 元，基金份额总额 0.9867 份。

6.2 利润表

会计主体：泰达宏利波控回报 12 个月持有期混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 19 日（基金合 同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-18,267,848.34	21,840,137.75
1. 利息收入		205,880.33	24,629,418.67
其中：存款利息收入	6.4.7.13	171,319.16	1,463,604.52
债券利息收入		-	20,919,902.69
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		34,561.17	2,245,911.46
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-35,585,913.02	-11,756,755.52
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-55,919,533.37	-18,158,471.24
基金投资收益		-	-

债券投资收益	6.4.7.15	18,494,129.61	1,597,928.81
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	1,839,490.74	4,803,786.91
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	17,112,184.35	8,967,474.60
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	-	-
减：二、营业总支出		7,849,187.99	15,092,604.83
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	5,621,303.05	7,140,925.04
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,405,325.73	1,785,231.24
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		634,448.39	2,235,974.01
其中：卖出回购金融资产支出		634,448.39	2,235,974.01
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		19,524.32	17,459.68
8. 其他费用	6.4.7.23	168,586.50	3,913,014.86
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-26,117,036.33	6,747,532.92
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-26,117,036.33	6,747,532.92
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-26,117,036.33	6,747,532.92

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：泰达宏利波控回报 12 个月持有期混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	2,016,415,931.75	-	-5,736,945.86	2,010,678,985.89

期末净资产(基金净值)				
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期末期初净资产(基金净值)	2,016,415,931.75	-	-5,736,945.86	2,010,678,985.89
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-807,837,247.40	-	-10,346,811.31	-818,184,058.71
(一)、综合收益总额	-	-	-26,117,036.33	-26,117,036.33
(二)、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)	-807,837,247.40	-	15,770,225.02	-792,067,022.38
其中:1.基金申购款	741,670.17	-	-17,908.67	723,761.50
2.基金赎回款	-808,578,917.57	-	15,788,133.69	-792,790,783.88
(三)、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)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	1,208,578,684.35	-	-16,083,757.17	1,192,494,927.18
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 19 日(基金合同生效日)至 2021 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(基金净值)	2,010,228,447.39	-	-	2,010,228,447.39
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	2,010,228,447.39	-	-	2,010,228,447.39
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	5,052,157.21	-	6,749,944.92	11,802,102.13
(一)、综合收益总额	-	-	6,747,532.92	6,747,532.92
(二)、	5,052,157.21	-	2,412.00	5,054,569.21

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）				
其中：1. 基金申购款	5,052,157.21	-	2,412.00	5,054,569.21
2. 基金赎回款	-	-	-	-
（三）、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）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产（基金净值）	2,015,280,604.60	-	6,749,944.92	2,022,030,549.52

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

王泉

石楠

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

泰达宏利波控回报 12 个月持有期混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2020]3080 号《关于准予泰达宏利波控回报 12 个月持有期混合型证券投资基金注册的批复》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《泰达宏利波控回报 12 个月持有期混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 2,008,875,688.59 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(2021)第 0002 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰达宏利波控回报 12 个月持有期混合型证券投资基金基金合同》于 2021 年 1 月 19 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 2,010,228,447.39 份基金份额,其中认购资金利息折合 1,352,758.80 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《泰达宏利波控回报 12 个月持有期混合型证券投资基金基金合同》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(包含中小板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票)、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换公司债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、股指期货、国债期货、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款等以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。基金的投资组合比例为:基金的投资组合比例为:投资于股票资产占基金资产的比例为 0%-30%(投资于港股通标的股票的比例为股票资产的 0%-50%);投资于同业存单的比例不超过基金资产的 20%;每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,保持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,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符合法律法规和监管机构的规定。本基金的业绩比较基准为中债综合指数收益率 \times 85%+中证 800 指数收益率 \times 10%+恒生指数收益率(经汇率调整) \times 5%。

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》、《达宏利波控回报 12 个月持有期混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 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 2022 年 06 月 30 日的财务状况以及 2022 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、会计估计详见附注 6.4.5。

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

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”),财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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>》,本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表,对本基金财务报表的影响列示如下:

(a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定,本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额,2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日,本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

(i) 于 2022 年 1 月 1 日,本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下:

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息、应收证券清算款、应收股利和应收申购款,金额分别为 12,237,260.77 元、6,655,620.68 元、140,004.64 元、14,423,738.61 元、6,971,200.22 元、94,064.26 元和 53,934.00 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息、应收清算款、应收股利和应收申购款,金额分别为 12,247,116.25 元、6,658,628.34 元、

140,067.64

元、0.00 元、6,971,200.22 元、94,064.26 元和 53,934.00 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 2,088,579,806.96 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 2,102,990,619.43 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付证券清算款、应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用和应付利息，金额分别为 115,000,000.00 元、16.99 元、1,370,663.49 元、342,665.88 元、1,499,699.84 元和 5,296.88 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付清算款、应付管理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用和其他负债-应付利息，金额分别为 115,005,296.88 元、16.99 元、1,370,663.49 元、342,665.88 元、1,499,699.84 元和 0.00 元。

i) 于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b) 修订后的《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>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《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>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 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]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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) 对基金通过深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(5) 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。基金通过深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(6) 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 2022 年 6 月 30 日
活期存款	8,528,215.96
等于：本金	8,526,451.37
加：应计利息	1,764.59
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	8,528,215.96

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	259,117,107.20	-	266,665,122.74	7,548,015.54
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	3,128,021.20	234,105,661.20	1,067,077.19
	银行间市场	674,551,440.80	3,119,834.53	679,250,334.53
	合计	904,462,003.61	6,247,855.73	913,355,995.73
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,163,579,110.81	6,247,855.73	1,180,021,118.47	10,194,151.93

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	100,006,301.37	-
合计	100,006,301.37	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未进行买断式逆回购交易。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末无其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末无其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末无其他权益工具投资。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期末无其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	17.22
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	610,140.01
其中：交易所市场	596,193.14
银行间市场	13,946.87
应付利息	-
预提费用	123,055.34
合计	733,212.57

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,016,415,931.75	2,016,415,931.75
本期申购	741,670.17	741,670.17
本期赎回（以“-”号填列）	-808,578,917.57	-808,578,917.57
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	1,208,578,684.35	1,208,578,684.35

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期末无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	1,161,377.10	-6,898,322.96	-5,736,945.86
本期利润	-43,229,220.68	17,112,184.35	-26,117,036.33
本期基金份额交易产生的变动数	9,580,188.66	6,190,036.36	15,770,225.02
其中：基金申购款	-11,700.02	-6,208.65	-17,908.67
基金赎回款	9,591,888.68	6,196,245.01	15,788,133.69

本期已分配利润	-	-	-
本期末	-32,487,654.92	16,403,897.75	-16,083,757.17

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
活期存款利息收入	74,877.77
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	41,183.98
其他	55,257.41
合计	171,319.16

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 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-55,919,533.37
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	-55,919,533.37

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 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	1,068,552,676.04
减：卖出股票成本总额	1,121,475,358.38
减：交易费用	2,996,851.03
买卖股票差价收入	-55,919,533.37

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期末有股票投资收益-证券出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	14,256,481.17

债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	4,237,648.44
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	18,494,129.61

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 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	3,706,338,931.74
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,680,190,196.92
减：应计利息总额	21,876,705.50
减：交易费用	34,380.88
买卖债券差价收入	4,237,648.44

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期末有债券投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期末有债券投资收益-申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期末有资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益-买卖差价收入。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期末有资产支持证券投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期末有资产支持证券投资收益-申购差价收入。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期末有贵金属投资收益。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期末有买卖贵金属差价收入。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期末有贵金属投资赎回差价收入。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期末有贵金属投资申购差价收入。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期末有衍生工具收益-买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期末有衍生工具收益-其他投资收益。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,839,490.74
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	1,839,490.74

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	17,112,184.35
股票投资	19,551,696.74
债券投资	-2,439,512.39
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	17,112,184.35

6.4.7.21 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	54,547.97
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	26,713.98
账户维护费	27,000.00
其他	817.18
合计	168,586.50

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方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 19 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	5,621,303.05	7,140,925.04
其中：支付销售机构的客户维护费	2,626,227.88	3,347,503.67

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 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 × 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 19 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,405,325.73	1,785,231.24

注：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 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

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自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自有资金投资本基金。

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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月19日（基金合同生效日）至2021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	8,528,215.96	74,877.77	11,932,343.45	532,423.77

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末(2022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
300834	星辉环材	2022年1月6日	6个月	新股流通受限	55.57	30.03	635	35,286.95	19,069.05	-
301097	天益医疗	2022年3月25日	6个月	新股流通受限	52.37	47.83	249	13,040.13	11,909.67	-

301102	兆讯传媒	2022年3月15日	6个月	新股流通受限	39.88	31.09	642	25,602.96	19,959.78	-
301109	军信股份	2022年4月6日	6个月	新股流通受限	34.81	16.14	1,837	42,642.25	29,649.18	-
301110	青木股份	2022年3月4日	6个月	新股流通受限	63.10	39.85	202	12,746.20	8,049.70	-
301117	佳缘科技	2022年1月7日	6个月	新股流通受限	46.80	54.44	262	12,261.60	14,263.28	-
301120	新特电气	2022年4月11日	6个月	新股流通受限	13.73	15.49	1,032	14,169.36	15,985.68	-
301122	采纳股份	2022年1月19日	6个月	新股流通受限	50.31	70.37	301	15,143.31	21,181.37	-
301123	奕东电子	2022年1月14日	6个月	新股流通受限	37.23	25.39	656	24,422.88	16,655.84	-
301130	西点药业	2022年2月16日	6个月	新股流通受限	22.55	37.70	237	5,344.35	8,934.90	-
301135	瑞德智能	2022年4月1日	6个月	新股流通受限	31.98	26.26	338	10,809.24	8,875.88	-
301137	哈焊华通	2022年3月14日	6个月	新股流通受限	15.37	15.99	644	9,898.28	10,297.56	-
301139	元道通信	2022年6月30日	1个月内(含)	新股未上市	38.46	38.46	5,651	217,337.46	217,337.46	-
301148	嘉戎技术	2022年4月14日	6个月	新股流通受限	38.39	23.90	516	19,809.24	12,332.40	-
301153	中科江南	2022年5月10日	6个月	新股流通受限	33.68	43.98	398	13,404.64	17,504.04	-
301158	德石股份	2022年1月7日	6个月	新股流通受限	15.64	20.38	379	5,927.56	7,724.02	-
301162	国能日新	2022年4月19日	6个月	新股流通受限	45.13	54.11	334	15,073.42	18,072.74	-

		日								
301175	中科环保	2022年6月30日	1个月内(含)	新股未上市	3.82	3.82	63,694	243,311.08	243,311.08	-
301181	标榜股份	2022年2月11日	6个月	新股流通受限	40.25	30.59	257	10,344.25	7,861.63	-
301196	唯科科技	2022年1月4日	6个月	新股流通受限	64.08	37.52	271	17,365.68	10,167.92	-
301200	大族数控	2022年2月18日	6个月	新股流通受限	76.56	51.92	857	65,611.92	44,495.44	-
301201	诚达药业	2022年1月12日	6个月	新股流通受限	72.69	71.54	353	25,659.57	25,253.62	-
301206	三元生物	2022年1月26日	6个月	新股流通受限	109.30	45.69	945	68,859.00	43,177.05	-
301207	华兰疫苗	2022年2月10日	6个月	新股流通受限	56.88	56.42	569	32,364.72	32,102.98	-
301212	联盛化学	2022年4月7日	6个月	新股流通受限	29.67	33.28	416	12,342.72	13,844.48	-
301215	中汽股份	2022年2月28日	6个月	新股流通受限	3.80	6.39	4,743	18,023.40	30,307.77	-
301216	万凯新材	2022年3月21日	6个月	新股流通受限	35.68	29.84	1,120	39,961.60	33,420.80	-
301219	腾远钴业	2022年3月10日	6个月	新股流通受限	173.98	87.82	470	45,408.78	41,275.40	-
301222	浙江恒威	2022年3月2日	6个月	新股流通受限	33.98	28.96	332	11,281.36	9,614.72	-
301233	盛帮股份	2022年6月24日	1个月内(含)	新股未上市	41.52	41.52	1,576	65,435.52	65,435.52	-
301235	华康医疗	2022年1月21日	6个月	新股流通受限	39.30	37.93	418	16,427.40	15,854.74	-
301236	软通	2022年	6个月	新股流	72.88	31.38	1,578	76,669.76	49,517.64	-

	动力	3月8日		通受限							
301237	和顺科技	2022年3月16日	6个月	新股流通受限	56.69	41.86	261	14,796.09	10,925.46		-
301238	瑞泰新材	2022年6月10日	6个月	新股流通受限	19.18	32.07	3,322	63,715.96	106,536.54		-
301248	杰创智能	2022年4月13日	6个月	新股流通受限	39.07	29.87	472	18,441.04	14,098.64		-
301256	华融化学	2022年3月14日	6个月	新股流通受限	8.05	10.08	1,831	14,739.55	18,456.48		-
301258	富士莱	2022年3月21日	6个月	新股流通受限	48.30	41.68	295	14,248.50	12,295.60		-
301268	铭利达	2022年3月29日	6个月	新股流通受限	28.50	34.87	641	18,268.50	22,351.67		-
301286	侨源股份	2022年6月6日	6个月	新股流通受限	16.91	19.79	784	13,257.44	15,515.36		-
301288	清研环境	2022年4月14日	6个月	新股流通受限	19.09	19.98	452	8,628.68	9,030.96		-

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。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

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。

4、“新股流通受限受限期”指新股上市日至受限期结束日；“新股未上市受限期”指新股成功认购日至新股上市日。

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

截至本报告期末 2022 年 6 月 30 日止，本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 121,006,186.12 元，于 2022 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，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。

6.4.12.4 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，属于证券市场中的较高风险品种，其长期平均风险和预期收益低于股票型基金，高于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在严格控制风险的前提下，通过积极主动的管理，力争为基金份额持有人创造高于业绩比较基准的投资收益。

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。

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

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

本基金债券投资、资产支持证券投资 and 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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	120,630,789.04	620,236,000.00
合计	120,630,789.04	620,236,000.00

注：以上未评级的债券投资中包括超短期融资券等。

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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	106,970,000.00
合计	-	106,970,000.00

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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	280,915,239.18	339,724,500.00

AAA 以下	9,665,098.63	18,510,000.00
未评级	502,144,868.88	453,977,231.10
合计	792,725,206.69	812,211,731.10

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 2022 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、买入返售金融资产和债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 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	8,528,215.96	-	-	-	8,528,215.96
结算备付金	28,423,248.87	-	-	-	28,423,248.87
存出保证金	163,279.96	-	-	-	163,279.96
交易性金融资产	221,132,169.32	622,236,771.62	69,987,054.79	266,665,122.74	1,180,021,118.47
买入返售金融资产	100,006,301.37	-	-	-	100,006,301.37
应收申购款	-	-	-	1,410.83	1,410.83
资产总计	358,253,215.48	622,236,771.62	69,987,054.79	266,666,533.57	1,317,143,575.46
负债					
应付赎回款	-	-	-	879,630.27	879,630.27
应付管理人报酬	-	-	-	789,483.33	789,483.33
应付托管费	-	-	-	197,370.82	197,370.82
应付清算款	-	-	-	1,014,825.53	1,014,825.53
卖出回购金融资产款	121,006,186.12	-	-	-	121,006,186.12
应交税费	-	-	-	27,939.64	27,939.64
其他负债	-	-	-	733,212.57	733,212.57
负债总计	121,006,186.12	-	-	3,642,462.16	124,648,648.28
利率敏感度缺口	237,247,029.36	622,236,771.62	69,987,054.79	263,024,071.41	1,192,494,927.18
上年度末 2021 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	12,237,260.77	-	-	-	12,237,260.77
结算备付金	6,655,620.68	-	-	-	6,655,620.68
存出保证金	140,004.64	-	-	-	140,004.64
交易性金融资产	885,978,852.00	590,338,879.10	63,100,000.00	549,162,075.86	2,088,579,806.96
应收利息	-	-	-	14,423,738.61	14,423,738.61
应收股利	-	-	-	94,064.26	94,064.26
应收申购款	-	-	-	53,934.00	53,934.00
应收证券清算款	-	-	-	6,971,200.22	6,971,200.22
资产总计	905,011,738.09	590,338,879.10	63,100,000.00	570,705,012.95	2,129,155,630.14
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	1,370,663.49	1,370,663.49
应付托管费	-	-	-	342,665.88	342,665.88
应付证券清算款	-	-	-	16.99	16.99
卖出回购金融资产款	115,000,000.00	-	-	-	115,000,000.00
应付交易费用	-	-	-	1,499,699.84	1,499,699.84
应付利息	-	-	-	5,296.88	5,296.88
应交税费	-	-	-	38,301.17	38,301.17
其他负债	-	-	-	220,000.00	220,000.00
负债总计	115,000,000.00	-	-	3,476,644.25	118,476,644.25

利率敏感度缺口	790,011,738.09	590,338,879.10	63,100,000.00	567,228,368.70	2,010,678,985.89
---------	----------------	----------------	---------------	----------------	------------------

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

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（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	市场利率下降 25 个基点	5,210,000.00	7,230,000.00
	市场利率上升 25 个基点	-5,140,000.00	-7,070,000.00

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
资产合计	-	-	-	-
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净额	-	-	-	-
项目	上年度末 2021年12月31日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计

以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	78,789,118.76	-	78,789,118.76
资产合计	-	78,789,118.76	-	78,789,118.76
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	78,789,118.76	-	78,789,118.76

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇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（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	所有外币相对人民币升值 5%	-	3,940,000.00
	所有外币相对人民币贬值 5%	-	-3,940,000.00

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。

本基金将采取目标波动风险预算技术进行资产配置，量化与基本面相结合的股票投资策略进行权益部分投资，以及采用多种策略进行固定收益部分投资。通过综合运用以上技术，本基金将优化投资过程，在限制组合整体预期波动率的前提下，实现风险约束下投资组合 alpha 的最大化，以便获得尽可能高回报。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占基金资产的比例为 0%-30%（投资于港股通标的股票的比例为股票资产的 0%-50%）；本基金投资于同业存单的比例

不超过基金资产的 20%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持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 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 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	266,665,122.74	22.36	549,162,075.86	27.31
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	266,665,122.74	22.36	549,162,075.86	27.31

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
	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（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
分析	沪深 300 指数上升 5%	13,210,000.00	-
	沪深 300 指数下降 5%	-13,210,000.00	-

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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	265,332,468.69	544,628,938.16
第二层次	913,882,079.79	1,539,423,235.59
第三层次	806,569.99	4,527,633.21
合计	1,180,021,118.47	2,088,579,806.96

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

本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

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

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	266,665,122.74	20.25
	其中：股票	266,665,122.74	20.25
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	913,355,995.73	69.34
	其中：债券	913,355,995.73	69.34
	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	100,006,301.37	7.59
	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	36,951,464.83	2.81
8	其他各项资产	164,690.79	0.01
9	合计	1,317,143,575.46	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	17,840,372.00	1.50
C	制造业	145,667,942.05	12.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,182,301.00	0.60
E	建筑业	1,128,229.76	0.09
F	批发和零售业	2,212,423.58	0.19
G	交通运输、仓储和邮政业	6,472,215.00	0.54
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,492,491.50	0.21
J	金融业	65,512,995.00	5.49
K	房地产业	5,905,854.50	0.50
L	租赁和商务服务业	555,698.78	0.05
M	科学研究和技术服务业	9,847,181.51	0.83
N	水利、环境和公共设施管理业	1,248,642.06	0.10
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	379,420.00	0.03
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	219,356.00	0.02
	合计	266,665,122.74	22.36

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	600036	招商银行	332,300	14,023,060.00	1.18
2	600690	海尔智家	496,000	13,620,160.00	1.14
3	601658	邮储银行	2,463,200	13,276,648.00	1.11
4	601318	中国平安	261,500	12,209,435.00	1.02
5	601899	紫金矿业	1,095,500	10,221,015.00	0.86
6	601328	交通银行	2,051,400	10,215,972.00	0.86
7	000338	潍柴动力	751,700	9,373,699.00	0.79
8	603259	药明康德	90,100	9,369,499.00	0.79
9	002202	金风科技	624,500	9,242,600.00	0.78
10	600660	福耀玻璃	165,100	6,902,831.00	0.58
11	601398	工商银行	1,303,000	6,215,310.00	0.52
12	601988	中国银行	1,694,700	5,524,722.00	0.46
13	600377	宁沪高速	584,700	5,010,879.00	0.42
14	000002	万科 A	221,717	4,545,198.50	0.38
15	002466	天齐锂业	30,900	3,856,320.00	0.32
16	300772	运达股份	147,200	3,744,768.00	0.31
17	601939	建设银行	573,400	3,474,804.00	0.29
18	600111	北方稀土	96,500	3,392,940.00	0.28
19	605117	德业股份	11,540	3,229,930.60	0.27
20	300390	天华超净	35,100	3,067,740.00	0.26
21	002594	比亚迪	8,700	2,901,363.00	0.24
22	601985	中国核电	408,600	2,802,996.00	0.24
23	000039	中集集团	194,400	2,692,440.00	0.23
24	600483	福能股份	167,100	2,351,097.00	0.20
25	002756	永兴材料	12,800	1,948,288.00	0.16
26	000333	美的集团	30,900	1,866,051.00	0.16
27	600309	万华化学	18,900	1,833,111.00	0.15
28	601225	陕西煤业	85,600	1,813,008.00	0.15
29	603799	华友钴业	18,120	1,732,634.40	0.15
30	002597	金禾实业	38,700	1,676,871.00	0.14
31	605399	晨光新材	36,610	1,557,755.50	0.13

32	002648	卫星化学	56,051	1,448,918.35	0.12
33	603605	珀莱雅	8,360	1,380,904.80	0.12
34	300896	爱美客	2,100	1,260,021.00	0.11
35	600585	海螺水泥	35,000	1,234,800.00	0.10
36	000983	山西焦煤	91,400	1,223,846.00	0.10
37	600025	华能水电	172,400	1,205,076.00	0.10
38	600188	兖矿能源	29,800	1,176,504.00	0.10
39	002475	立讯精密	34,100	1,152,239.00	0.10
40	603916	苏博特	44,600	1,136,854.00	0.10
41	601666	平煤股份	82,800	1,125,252.00	0.09
42	300482	万孚生物	27,600	1,123,596.00	0.09
43	300628	亿联网络	14,700	1,119,405.00	0.09
44	603688	石英股份	8,300	1,100,663.00	0.09
45	000661	长春高新	4,600	1,073,732.00	0.09
46	601689	拓普集团	15,400	1,053,822.00	0.09
47	600426	华鲁恒升	33,600	981,120.00	0.08
48	002372	伟星新材	40,200	966,408.00	0.08
49	002487	大金重工	22,000	918,060.00	0.08
50	605305	中际联合	18,200	881,244.00	0.07
51	603730	岱美股份	66,460	871,290.60	0.07
52	600132	重庆啤酒	5,800	850,280.00	0.07
53	600809	山西汾酒	2,600	844,480.00	0.07
54	002867	周大生	53,300	827,749.00	0.07
55	600519	贵州茅台	400	818,000.00	0.07
56	000568	泸州老窖	3,200	788,928.00	0.07
57	002555	三七互娱	36,900	783,387.00	0.07
58	300982	苏文电能	14,517	681,718.32	0.06
59	002179	中航光电	10,680	676,257.60	0.06
60	002508	老板电器	18,600	670,158.00	0.06
61	002049	紫光国微	3,500	664,020.00	0.06
62	601677	明泰铝业	27,140	645,932.00	0.05
63	601233	桐昆股份	40,600	644,728.00	0.05
64	603596	伯特利	8,000	641,440.00	0.05
65	300394	天孚通信	23,600	638,852.00	0.05
66	688233	神工股份	11,300	635,060.00	0.05
67	603520	司太立	22,560	634,387.20	0.05
68	603713	密尔克卫	4,600	628,820.00	0.05
69	002484	江海股份	26,600	620,844.00	0.05
70	601615	明阳智能	18,300	618,540.00	0.05
71	600623	华谊集团	72,700	603,410.00	0.05
72	000792	盐湖股份	20,100	602,196.00	0.05
73	000898	鞍钢股份	183,500	590,870.00	0.05

74	601686	友发集团	76,900	587,516.00	0.05
75	600989	宝丰能源	40,000	586,000.00	0.05
76	300373	扬杰科技	8,100	577,125.00	0.05
77	002741	光华科技	27,300	544,089.00	0.05
78	601212	白银有色	196,100	541,236.00	0.05
79	601888	中国中免	2,300	535,739.00	0.04
80	603979	金诚信	27,300	527,163.00	0.04
81	600089	特变电工	19,100	523,149.00	0.04
82	300755	华致酒行	11,900	521,815.00	0.04
83	603588	高能环境	44,480	512,854.40	0.04
84	603012	创力集团	86,200	509,442.00	0.04
85	601208	东材科技	37,600	485,792.00	0.04
86	002669	康达新材	36,300	484,968.00	0.04
87	002832	比音勒芬	18,500	466,200.00	0.04
88	603369	今世缘	9,000	459,000.00	0.04
89	603236	移远通信	3,380	451,770.80	0.04
90	603568	伟明环保	13,500	450,495.00	0.04
91	002585	双星新材	24,900	450,441.00	0.04
92	300735	光弘科技	43,100	450,395.00	0.04
93	300595	欧普康视	7,700	440,363.00	0.04
94	300760	迈瑞医疗	1,400	438,480.00	0.04
95	300481	濮阳惠成	18,500	434,750.00	0.04
96	603613	国联股份	4,900	434,140.00	0.04
97	300384	三联虹普	23,200	431,520.00	0.04
98	002984	森麒麟	13,800	429,318.00	0.04
99	603866	桃李面包	25,628	424,143.40	0.04
100	002643	万润股份	20,300	423,458.00	0.04
101	688278	特宝生物	14,146	417,024.08	0.03
102	603722	阿科力	8,200	413,526.00	0.03
103	002768	国恩股份	16,100	413,448.00	0.03
104	600383	金地集团	30,400	408,576.00	0.03
105	603833	欧派家居	2,700	406,836.00	0.03
106	601898	中煤能源	38,900	403,782.00	0.03
107	600348	华阳股份	25,800	398,868.00	0.03
108	600481	双良节能	23,600	397,660.00	0.03
109	603579	荣泰健康	16,000	394,400.00	0.03
110	603920	世运电路	22,700	392,710.00	0.03
111	600392	盛和资源	17,300	390,980.00	0.03
112	603816	顾家家居	6,760	382,818.80	0.03
113	300244	迪安诊断	12,200	379,420.00	0.03
114	603303	得邦照明	24,600	379,086.00	0.03
115	688198	佰仁医疗	3,100	377,952.00	0.03

116	002677	浙江美大	25,500	374,085.00	0.03
117	688516	奥特维	1,400	373,730.00	0.03
118	600765	中航重机	11,600	373,288.00	0.03
119	600096	云天化	11,600	365,168.00	0.03
120	688556	高测股份	4,520	364,764.00	0.03
121	300432	富临精工	16,300	358,600.00	0.03
122	002918	蒙娜丽莎	19,100	357,552.00	0.03
123	600256	广汇能源	33,400	352,036.00	0.03
124	300257	开山股份	23,500	351,560.00	0.03
125	000708	中信特钢	17,400	350,610.00	0.03
126	600486	扬农化工	2,600	346,528.00	0.03
127	300803	指南针	5,800	340,924.00	0.03
128	605005	合兴股份	19,600	339,864.00	0.03
129	300398	飞凯材料	14,400	329,184.00	0.03
130	300445	康斯特	28,500	326,610.00	0.03
131	002539	云图控股	20,200	322,998.00	0.03
132	603867	新化股份	9,500	322,715.00	0.03
133	002601	龙佰集团	15,900	318,795.00	0.03
134	002895	川恒股份	9,400	317,814.00	0.03
135	300363	博腾股份	4,000	311,960.00	0.03
136	603868	飞科电器	4,100	310,575.00	0.03
137	603387	基蛋生物	21,420	305,449.20	0.03
138	300130	新国都	24,900	305,274.00	0.03
139	600389	江山股份	5,000	303,650.00	0.03
140	000553	安道麦 A	25,000	302,750.00	0.03
141	300769	德方纳米	740	302,423.20	0.03
142	600612	老凤祥	7,200	300,816.00	0.03
143	002216	三全食品	15,200	297,768.00	0.02
144	002381	双箭股份	45,200	290,184.00	0.02
145	688598	金博股份	964	284,090.80	0.02
146	600011	华能国际	40,100	282,304.00	0.02
147	603337	杰克股份	12,900	277,092.00	0.02
148	688303	大全能源	4,000	273,280.00	0.02
149	603128	华贸物流	26,700	267,801.00	0.02
150	603378	亚士创能	22,955	267,655.30	0.02
151	601369	陕鼓动力	27,800	266,880.00	0.02
152	001914	招商积余	14,800	265,956.00	0.02
153	688707	振华新材	3,500	264,845.00	0.02
154	600761	安徽合力	22,100	262,990.00	0.02
155	688122	西部超导	2,850	262,770.00	0.02
156	002968	新大正	10,400	256,464.00	0.02
157	002304	洋河股份	1,400	256,410.00	0.02

158	603719	良品铺子	8,900	254,807.00	0.02
159	000968	蓝焰控股	24,200	252,890.00	0.02
160	600429	三元股份	48,000	251,520.00	0.02
161	603611	诺力股份	14,300	248,534.00	0.02
162	002043	兔宝宝	21,400	248,240.00	0.02
163	300607	拓斯达	18,700	247,214.00	0.02
164	600882	妙可蓝多	5,200	243,360.00	0.02
165	301175	中科环保	63,694	243,311.08	0.02
166	688385	复旦微电	3,700	241,203.00	0.02
167	300327	中颖电子	4,840	241,080.40	0.02
168	600987	航民股份	45,000	239,850.00	0.02
169	603818	曲美家居	25,200	239,400.00	0.02
170	600846	同济科技	30,300	239,370.00	0.02
171	605499	东鹏饮料	1,400	239,204.00	0.02
172	603968	醋化股份	11,500	236,900.00	0.02
173	603993	洛阳钼业	41,000	234,930.00	0.02
174	603529	爱玛科技	4,480	234,662.40	0.02
175	600048	保利发展	13,400	233,964.00	0.02
176	600887	伊利股份	6,000	233,700.00	0.02
177	603379	三美股份	10,500	233,625.00	0.02
178	601838	成都银行	14,000	232,120.00	0.02
179	600929	雪天盐业	25,000	232,000.00	0.02
180	002035	华帝股份	39,800	231,636.00	0.02
181	002171	楚江新材	24,800	231,384.00	0.02
182	603887	城地香江	29,600	231,176.00	0.02
183	300740	水羊股份	16,700	229,458.00	0.02
184	603195	公牛集团	1,500	229,365.00	0.02
185	002203	海亮股份	19,500	225,225.00	0.02
186	603515	欧普照明	12,900	225,105.00	0.02
187	600655	豫园股份	23,800	224,672.00	0.02
188	000858	五粮液	1,100	222,123.00	0.02
189	603681	永冠新材	9,000	221,220.00	0.02
190	002649	博彦科技	21,500	219,515.00	0.02
191	600673	东阳光	24,400	219,356.00	0.02
192	600580	卧龙电驱	15,200	219,184.00	0.02
193	688567	孚能科技	7,700	218,757.00	0.02
194	688396	华润微	3,700	218,559.00	0.02
195	600482	中国动力	13,900	218,369.00	0.02
196	600160	巨化股份	16,600	218,290.00	0.02
197	002522	浙江众成	38,300	217,544.00	0.02
198	603392	万泰生物	1,400	217,420.00	0.02
199	301139	元道通信	5,651	217,337.46	0.02

200	603708	家家悦	15,200	216,448.00	0.02
201	600141	兴发集团	4,900	215,551.00	0.02
202	600261	阳光照明	63,800	215,006.00	0.02
203	603886	元祖股份	12,100	213,202.00	0.02
204	603601	再升科技	33,500	213,060.00	0.02
205	002416	爱施德	22,900	212,970.00	0.02
206	600060	海信视像	17,000	212,500.00	0.02
207	603156	养元饮品	9,300	211,296.00	0.02
208	601138	工业富联	21,300	209,592.00	0.02
209	601156	东航物流	10,500	207,900.00	0.02
210	600873	梅花生物	18,400	207,552.00	0.02
211	002312	川发龙蟒	12,000	207,120.00	0.02
212	002182	云海金属	8,200	205,656.00	0.02
213	600458	时代新材	20,800	203,840.00	0.02
214	600459	贵研铂业	11,200	202,832.00	0.02
215	001696	宗申动力	31,900	201,927.00	0.02
216	600063	皖维高新	26,500	200,870.00	0.02
217	002812	恩捷股份	800	200,360.00	0.02
218	000729	燕京啤酒	20,700	199,962.00	0.02
219	300475	香农芯创	9,800	197,470.00	0.02
220	000786	北新建材	5,700	197,334.00	0.02
221	600639	浦东金桥	14,400	195,696.00	0.02
222	002298	中电兴发	29,700	194,832.00	0.02
223	600546	山煤国际	10,000	194,600.00	0.02
224	000848	承德露露	20,000	193,600.00	0.02
225	002228	合兴包装	53,400	193,308.00	0.02
226	300146	汤臣倍健	8,900	192,685.00	0.02
227	002009	天奇股份	10,400	192,400.00	0.02
227	002920	德赛西威	1,300	192,400.00	0.02
228	000969	安泰科技	21,400	190,888.00	0.02
229	600863	内蒙华电	52,200	190,530.00	0.02
230	000062	深圳华强	15,000	190,500.00	0.02
231	600233	圆通速递	9,300	189,627.00	0.02
232	000032	深桑达 A	12,600	188,748.00	0.02
233	002841	视源股份	2,500	188,300.00	0.02
234	002497	雅化集团	5,700	186,105.00	0.02
235	002293	罗莱生活	14,100	185,697.00	0.02
236	300184	力源信息	33,500	184,250.00	0.02
237	000544	中原环保	31,700	183,226.00	0.02
238	300037	新宙邦	3,460	181,857.60	0.02
239	603766	隆鑫通用	39,100	180,251.00	0.02
240	002615	哈尔斯	28,600	177,892.00	0.01

241	000877	天山股份	14,400	177,120.00	0.01
242	002932	明德生物	2,574	176,473.44	0.01
243	300855	图南股份	4,200	175,518.00	0.01
244	603599	广信股份	6,220	175,093.00	0.01
245	000596	古井贡酒	700	174,762.00	0.01
246	300477	合纵科技	22,300	171,710.00	0.01
247	300604	长川科技	3,800	171,570.00	0.01
248	002407	多氟多	3,500	171,185.00	0.01
249	002738	中矿资源	1,840	170,402.40	0.01
250	002120	韵达股份	9,800	167,188.00	0.01
251	002911	佛燃能源	18,400	167,072.00	0.01
252	000030	富奥股份	30,400	166,592.00	0.01
253	300285	国瓷材料	4,500	161,640.00	0.01
254	000683	远兴能源	14,900	156,599.00	0.01
255	000878	云南铜业	13,700	156,043.00	0.01
256	000893	亚钾国际	4,500	154,845.00	0.01
257	000060	中金岭南	34,600	154,316.00	0.01
258	300138	晨光生物	9,900	154,143.00	0.01
259	002810	山东赫达	4,200	152,838.00	0.01
260	688711	宏微科技	2,000	152,600.00	0.01
261	000733	振华科技	1,100	149,567.00	0.01
262	300634	彩讯股份	11,700	148,590.00	0.01
263	300766	每日互动	12,200	142,008.00	0.01
264	002960	青鸟消防	5,100	139,689.00	0.01
265	002833	弘亚数控	7,560	126,100.80	0.01
266	603619	中曼石油	5,400	111,078.00	0.01
267	301238	瑞泰新材	3,322	106,536.54	0.01
268	300726	宏达电子	1,200	73,404.00	0.01
269	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.01
270	301236	软通动力	1,578	49,517.64	0.00
271	301200	大族数控	857	44,495.44	0.00
272	301206	三元生物	945	43,177.05	0.00
273	301219	腾远钴业	470	41,275.40	0.00
274	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.00
275	301216	万凯新材	1,120	33,420.80	0.00
276	301207	华兰疫苗	569	32,102.98	0.00
277	301215	中汽股份	4,743	30,307.77	0.00
278	301109	军信股份	1,837	29,649.18	0.00
279	301201	诚达药业	353	25,253.62	0.00
280	301268	铭利达	641	22,351.67	0.00
281	301122	采纳股份	301	21,181.37	0.00
282	301102	兆讯传媒	642	19,959.78	0.00

283	300834	星辉环材	635	19,069.05	0.00
284	301256	华融化学	1,831	18,456.48	0.00
285	603176	汇通集团	1,924	18,393.44	0.00
286	301162	国能日新	334	18,072.74	0.00
287	301153	中科江南	398	17,504.04	0.00
288	301123	奕东电子	656	16,655.84	0.00
289	301120	新特电气	1,032	15,985.68	0.00
290	301235	华康医疗	418	15,854.74	0.00
291	301286	侨源股份	784	15,515.36	0.00
292	301166	优宁维	253	14,891.58	0.00
293	301189	奥尼电子	435	14,489.85	0.00
294	301117	佳缘科技	262	14,263.28	0.00
295	301248	杰创智能	472	14,098.64	0.00
296	301212	联盛化学	416	13,844.48	0.00
297	301148	嘉戎技术	516	12,332.40	0.00
298	301258	富士莱	295	12,295.60	0.00
299	301097	天益医疗	249	11,909.67	0.00
300	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
301	301237	和顺科技	261	10,925.46	0.00
302	301137	哈焊华通	644	10,297.56	0.00
303	301196	唯科科技	271	10,167.92	0.00
304	301222	浙江恒威	332	9,614.72	0.00
305	301288	清研环境	452	9,030.96	0.00
306	301130	西点药业	237	8,934.90	0.00
307	301135	瑞德智能	338	8,875.88	0.00
308	301110	青木股份	202	8,049.70	0.00
309	301181	标榜股份	257	7,861.63	0.00
310	301158	德石股份	379	7,724.02	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	601988	中国银行	16,799,970.00	0.84
2	002594	比亚迪	14,706,582.65	0.73
3	000338	潍柴动力	14,496,462.89	0.72
4	600660	福耀玻璃	11,754,031.00	0.58
5	601899	紫金矿业	11,278,656.45	0.56
6	601398	工商银行	11,140,651.00	0.55
7	002202	金风科技	10,705,358.00	0.53
8	000898	鞍钢股份	10,352,395.00	0.51
9	601939	建设银行	10,151,937.00	0.50

10	600377	宁沪高速	9,975,208.69	0.50
11	000039	中集集团	8,454,793.00	0.42
12	600028	中国石化	7,458,238.00	0.37
13	600111	北方稀土	7,327,237.00	0.36
14	002466	天齐锂业	7,276,304.00	0.36
15	000002	万科 A	6,917,864.00	0.34
16	600585	海螺水泥	6,881,077.00	0.34
17	600012	皖通高速	6,411,895.00	0.32
18	300772	运达股份	6,379,196.00	0.32
19	601658	邮储银行	6,204,706.00	0.31
20	603799	华友钴业	6,150,915.00	0.31

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	002594	比亚迪	29,626,114.00	1.47
2	601899	紫金矿业	19,303,568.00	0.96
2	02899	紫金矿业	3,327,832.62	0.17
3	002202	金风科技	17,212,718.55	0.86
3	02208	金风科技	3,466,870.84	0.17
4	603259	药明康德	16,126,298.24	0.80
4	02359	药明康德	3,140,387.60	0.16
5	600585	海螺水泥	17,772,157.00	0.88
6	600690	海尔智家	16,702,657.00	0.83
7	601328	交通银行	16,458,677.00	0.82
8	600036	招商银行	16,448,175.00	0.82
9	601398	工商银行	16,385,144.00	0.81
10	600377	宁沪高速	15,052,250.17	0.75
11	000898	鞍钢股份	14,970,026.00	0.74
12	601658	邮储银行	13,779,717.00	0.69
13	601988	中国银行	13,719,687.00	0.68
14	601318	中国平安	13,573,689.00	0.68
15	002466	天齐锂业	12,754,683.00	0.63
16	000002	万科 A	12,643,746.00	0.63
17	603799	华友钴业	11,227,006.00	0.56
18	601939	建设银行	10,648,987.14	0.53
19	002460	赣锋锂业	5,680,909.00	0.28
19	01772	赣锋锂业	3,328,519.92	0.17
20	601919	中远海控	4,503,284.40	0.22

20	01919	中远海控	4,378,375.70	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。

7.4.3 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	819,426,708.52
卖出股票收入（成交）总额	1,068,552,676.04

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	45,402,830.96	3.81
2	央行票据	-	-
3	金融债券	306,402,426.96	25.69
	其中：政策性金融债	306,402,426.96	25.69
4	企业债券	172,853,690.96	14.50
5	企业短期融资券	120,630,789.04	10.12
6	中期票据	268,066,257.81	22.48
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	913,355,995.73	76.59

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	220312	22 进出 12	1,000,000	100,143,643.84	8.40
2	092218001	22 农发清发 01	700,000	70,460,945.21	5.91
3	220210	22 国开 10	700,000	69,987,054.79	5.87
4	175668	21 中证 02	600,000	61,653,018.08	5.17
5	102280310	22 河钢集 MTN002	500,000	50,919,690.41	4.27

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 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

本基金投资国债期货，将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，在风险可控的前提下，适度参与国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期没有投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行于 2022 年 3 月 21 日曾受到银保监会公开处罚；中国邮政储蓄银行于 2022 年 3 月 21 日曾受到银保监会公开处罚，于 2021 年 8 月 13 日曾受到央行公开处罚，于 2021 年 11 月 9 日曾受到国家外汇管理局北京外汇管理部公开处罚；交通银行于 2021 年 8 月 13 日曾受到央行公开处罚，于 2021 年 7 月 13 日、2022 年 3 月 21 日曾受到银保监会的公开处罚，于 2021 年 10 月 20 日曾受到国家外汇管理局上海市分局公开处罚；中国进出口银行于 2021 年 7 月 13 日、2022 年 3 月 21 日曾受到银保监会公开处罚；国家开发银行于 2022 年 3 月 21 日曾受到银保监会公开处罚。

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。

7.12.2 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	163,279.96
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,410.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	164,690.79

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 (%)
22,056	54,795.91	6,359,548.54	0.53	1,202,219,135.81	99.47

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	53,711.07	0.0044

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2021 年 1 月 19 日) 基金份额总额	2,010,228,447.39
本报告期期初基金份额总额	2,016,415,931.75
本报告期基金总申购份额	741,670.17

减：本报告期基金总赎回份额	808,578,917.57
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,208,578,684.35

§ 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、本报告期内，基金管理人于 2022 年 3 月 19 日发布了《泰达宏利基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，自 2022 年 3 月 18 日起，傅国庆先生离任公司总经理、首席信息官职务，新任公司董事长（法定代表人）职务，并代任公司总经理职务不超过 6 个月。

2、本报告期内，基金托管人中国农业银行总行于 2022 年 3 月决定王霄勇任托管业务部总裁。

3、本报告期内，基金托管人中国农业银行总行于 2022 年 3 月决定王洪滨任托管业务部高级专家。

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

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

1、本报告期基金管理人未受到任何稽查或处罚。

2、本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	

长江证券	1	630,834,050.08	33.69	587,487.85	34.31	-
安信证券	1	311,887,068.12	16.66	290,465.11	16.96	-
中泰证券	1	267,064,112.18	14.26	248,720.33	14.53	-
中信建投	1	159,753,627.40	8.53	148,776.34	8.69	-
首创证券	1	155,347,691.38	8.30	144,677.73	8.45	-
兴业证券	1	126,056,076.24	6.73	117,392.04	6.86	-
申万宏源	1	118,220,993.95	6.31	110,095.56	6.43	-
海通证券	1	75,982,122.14	4.06	39,323.61	2.30	-
招商证券	1	27,112,507.84	1.45	25,249.94	1.47	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

注：（一）2022 年上半年本基金无交易单元变动。

（二）交易单元选择的标准和程序

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

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

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 (%)
长江证券	118,207,446.20	34.19	1,768,500,000.00	48.09	-	-

安信证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	779,550,000.00	21.20	-	-
首创证券	-	-	10,000,000.00	0.27	-	-
兴业证券	218,208,403.00	63.11	398,000,000.00	10.82	-	-
申万宏源	-	-	721,200,000.00	19.61	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	9,317,000.00	2.69	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

§ 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

基金管理人和基金托管人的住所。

11.3 查阅方式

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

2022 年 8 月 31 日