

泰达宏利睿智稳健灵活配置混合型证券投资 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	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	12
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遵规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
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	19
§ 7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	51

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	51
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	51
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	51
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	51
7.12 投资组合报告附注	51
§ 8 基金份额持有人信息.....	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	53
§ 9 开放式基金份额变动.....	53
§ 10 重大事件揭示	54
10.1 基金份额持有人大会决议	54
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	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	54
10.4 基金投资策略的改变	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	54
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	54
10.8 其他重大事件	55
§ 11 备查文件目录	55
11.1 备查文件目录	55
11.2 存放地点	55
11.3 查阅方式	55

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泰达宏利睿智稳健灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	泰达睿智稳健混合	
基金主代码	003501	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 11 月 23 日	
基金管理人	泰达宏利基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	333,644,289.84 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	泰达睿智稳健混合 A	泰达睿智稳健混合 C
下属分级基金的交易代码	003501	013280
报告期末下属分级基金的份额总额	193,362,335.62 份	140,281,954.22 份

2.2 基金产品说明

投资目标	通过现代风险模型技术进行基金风险预算，在严控本基金下行风险的前提下，灵活运用多种投资策略，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金将采取目标风险和量化投资策略，也就是通过优化投资过程，限制预期波动率，将风险维持在某个固定水平，从而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。从长期来看，目标风险策略能够达到市场平均收益，在风控控制方面效果显著，从而提高风险调整后收益。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×35%+中证综合债券指数收益率×65%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期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。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	徐娇娇	郭明
	联系电话	66577766	010-66105799
	电子邮箱	irm@mfcteda.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-698-8888	95588
传真		010-66577666	010-66105798
注册地址		北京市朝阳区针织路 23 号楼中国人寿金融中心 6 层 02-07 单元	北京市西城区复兴门内大街 55 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 55 号
邮政编码	100026	100140
法定代表人	傅国庆	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.mfcteda.com
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

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(2022 年 01 月 01 日-2022 年 06 月 30 日)	
	泰达睿智稳健混合 A	泰达睿智稳健混合 C
本期已实现收益	-5,375,073.11	-4,904,364.29
本期利润	-2,499,629.47	-3,353,620.18
加权平均基金份额 本期利润	-0.0174	-0.0313
本期加权平均净 值利润率	-1.36%	-2.38%
本期基金份额净 值增长率	-7.37%	-7.55%
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	67,969,771.41	46,271,503.48
期末可供分配基 金份额利润	0.3515	0.3298
期末基金资产净 值	261,332,107.03	186,553,457.70
期末基金份额净	1.3515	1.3298

值		
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	79.40%	7.38%

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

泰达睿智稳健混合 A

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	7.48%	1.37%	3.30%	0.37%	4.18%	1.00%
过去三个月	8.54%	1.62%	2.97%	0.50%	5.57%	1.12%
过去六个月	-7.37%	1.49%	-1.91%	0.51%	-5.46%	0.98%
过去一年	15.32%	1.51%	-1.81%	0.44%	17.13%	1.07%
过去三年	94.49%	1.33%	16.18%	0.44%	78.31%	0.89%
自基金合同生效起至今	79.40%	1.11%	28.48%	0.42%	50.92%	0.69%

泰达睿智稳健混合 C

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
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

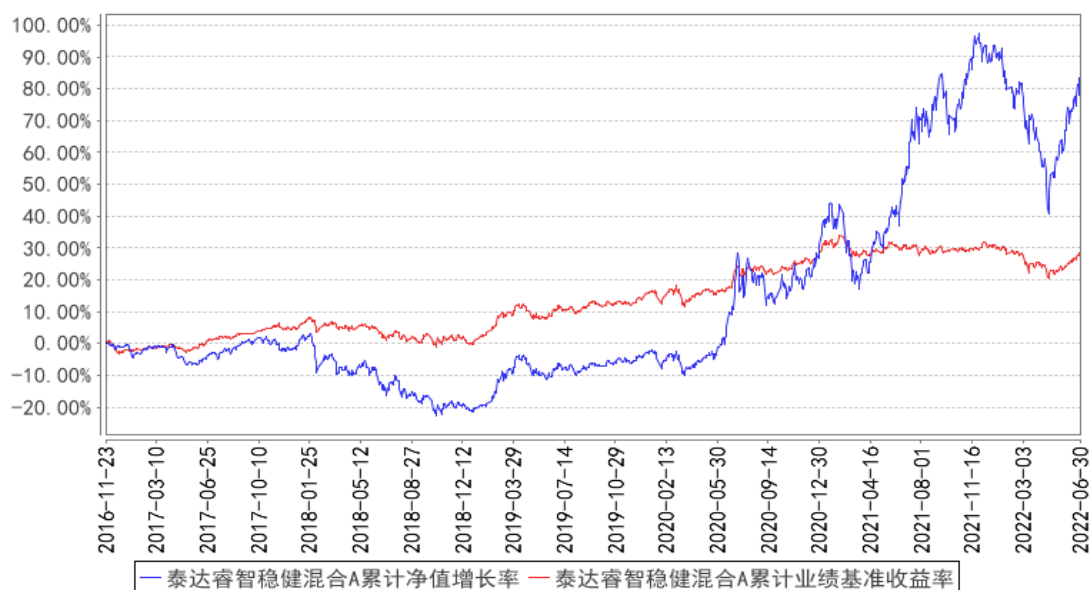
过去一个月	7.45%	1.37%	3.30%	0.37%	4.15%	1.00%
过去三个月	8.39%	1.62%	2.97%	0.50%	5.42%	1.12%
过去六个月	-7.55%	1.49%	-1.91%	0.51%	-5.64%	0.98%
自基金合同生效起 至今	7.38%	1.35%	-0.98%	0.44%	8.36%	0.91%

注：本基金业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×35%+中证综合债券指数收益率×65%。

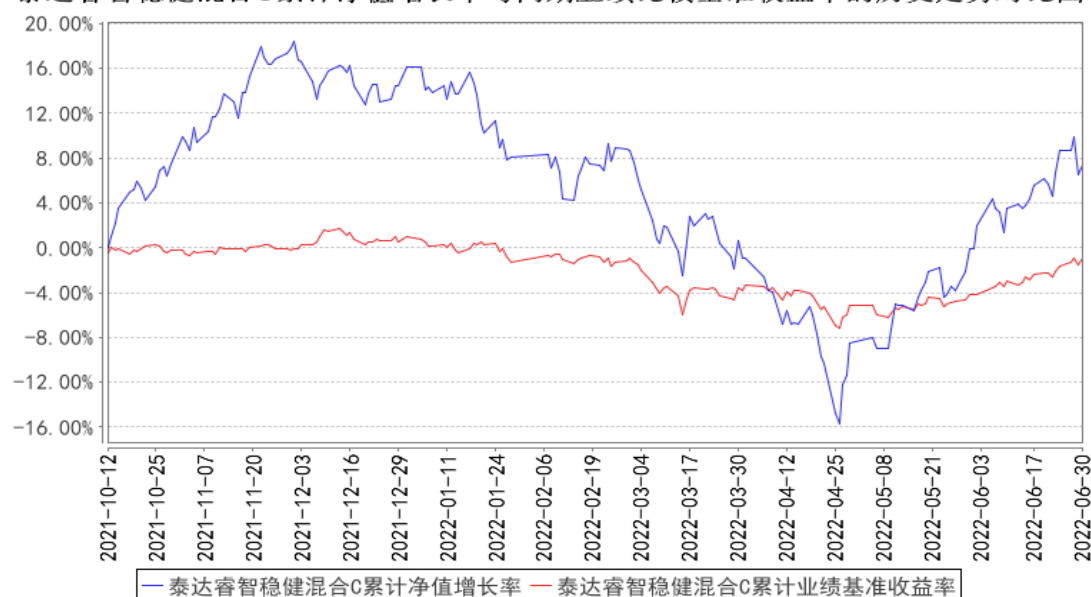
本基金选择市场认同度较高、行业分类标准和指数编制方法较为科学的沪深 300 指数作为本基金股票组合的业绩比较基准。沪深 300 指数由中证指数有限公司编制，是由沪深 A 股中规模大、流通股中规模大、流动性好的最具代表 300 只股票组成，可以综合反映沪深 A 股市场整体表现，适合作为本基金股票部分的业绩比较基准。中证综合债券指数是综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短融整体走势的跨市场债券指数，其选择是在中证全债指数样本的基础上，增加了央行票据、短期融资券以及一年期以下的国债、金融债和企业债，旨在全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势。该指数具有广泛的市场代表性，能够反映债券市场总体走势。本基金管理人认为，以沪深 300 指数收益率×35%+中证综合债券指数收益率×65%作为本基金的业绩比较基准，能够使本基金持有人理性判断本基金产品的风险收益特征。

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

泰达睿智稳健混合A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



泰达睿智稳健混合C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 A 类份额成立于 2016 年 11 月 23 日，C 类份额成立于 2021 年 10 月 12 日。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 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、泰达宏利泰和稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、泰达宏利价值长青混合型证券投资基金、泰达宏利中证申万绩优策略指数增强型证券投资基金、泰达宏利乐盈 66 个月定期开放债券型证券投资基金、泰达宏利高研发创新 6 个月持有期混合型证券投资基金、泰达宏利波控回报 12 个月持有期混合型证券投资基金、泰达宏利消费服务混合型证券投资基金、泰达宏利新能源股票型证券投资基金、泰达宏利中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金、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		
孟杰	本基金基金经理	2020 年 9 月 7 日	-	7 年	北京大学理学博士；2015 年 7 月加入泰达宏利基金管理有限公司，历任研究部助理研究员、研究员、基金经理助理，现任基金经理。具备 7 年基金从业经验，具有基

					金从业资格。
--	--	--	--	--	--------

注：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严格按照时间优先、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

2022 年上半年，市场经历了大幅波动，受海外局势动荡和国内疫情的影响，市场在前四个月快速下跌。随着疫情的有效控制，市场又在 5-6 月份迎来了快速的反弹。从市场表现看，整个上半年传统周期板块表现占优，但是 5 月开始，汽车，电力设备新能源行业成为成长板块反弹的代表，整个产业链都获得了良好的表现，多个公司市值创历史新高。风格上看，在强产业趋势带动下，大小盘都有很好的投资机会。本报告期，基金在操作中，重点投资电子，新能源，化工，机械等成长性行业。选股层面，坚持自下而上，选择出具备长期增长前景的细分行业龙头企业，通

过适当的行业分散进行回撤控制。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末泰达睿智稳健混合 A 的基金份额净值为 1.3515 元,本报告期基金份额净值增长率为-7.37%,截至本报告期末泰达睿智稳健混合 C 的基金份额净值为 1.3298 元,本报告期基金份额净值增长率为-7.55%,同期业绩比较基准收益率为-1.91%。

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,我们将继续重点跟踪和研究长期成长空间仍然较大的电子,新能源,化工,机械等中游制造业。考虑到部分景气赛道已经经历了明显的反弹,行业表现可能出现分化,下半年热门赛道需要更加注重自下而上的择股。此外,非热门赛道的公司随着业绩的持续兑现,可能会在下半年迎来表现的机会,也是值得重点挖掘的领域。风险层面看,我们仍然关注海外经济衰退可能带来的冲击,所以,我们会时刻关注持仓公司的估值水平,不断的优化组合的性价比从而力争控制回撤。

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的情况,本基金管理人于 2022 年 1 月 19 日公告对 2021 年度收益进行分配,权益登记日、除权日为 2022 年 1 月 20 日,红利发放日为 2022 年 1 月 21 日,A 类按每 10 份基金份额派发 1.00 元进行收益分配,共分配 8,014,824.20 元;C 类按每 10 份基金份额派发 1.00 元进行收益分配,共分配 4,157,259.19 元。2022 年 4 月 21 日公告对 2022 年 1 季

度收益进行分配，权益登记日、除权日为 2022 年 4 月 22 日，红利发放日为 2022 年 4 月 23 日，A 类按每 10 份基金份额派发 0.001 元进行收益分配，共分配 14,987.48 元；C 类按每 10 份基金份额派发 1.00 元进行收益分配，共分配 9,967,105.68 元。

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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——泰达宏利基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，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

本托管人依法对泰达宏利基金管理有限公司编制和披露的本基金 2022 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：泰达宏利睿智稳健灵活配置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	95,536,175.46	32,824,249.94
结算备付金		1,484,533.27	370,954.94
存出保证金		129,205.91	26,922.37
交易性金融资产	6.4.7.2	357,579,771.36	87,872,163.40

其中：股票投资		357,579,771.36	87,872,163.40
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		4,403,610.73	-
应收股利		-	-
应收申购款		271,071.13	6,382,682.57
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	2,496.10
资产总计		459,404,367.86	127,479,469.32
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		-	-
应付清算款		-	7,356,847.08
应付赎回款		9,985,308.97	15,561.60
应付管理人报酬		556,119.73	91,872.34
应付托管费		92,686.61	15,312.06
应付销售服务费		49,329.00	2,670.33
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	835,358.82	274,726.41
负债合计		11,518,803.13	7,756,989.82
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	333,644,289.84	75,461,413.24
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	114,241,274.89	44,261,066.26
净资产合计		447,885,564.73	119,722,479.50
负债和净资产总计		459,404,367.86	127,479,469.32

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日,基金份额总额 333,644,289.84 份，其中泰达睿智稳健混合 A 基金份额总额 193,362,335.62 份，基金份额净值 1.3515 元；泰达睿智稳健混合 C 基金份额总额 140,281,954.22 份，基金份额净值 1.3298 元。

6.2 利润表

会计主体：泰达宏利睿智稳健灵活配置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 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-2,797,313.67	10,161,305.11
1. 利息收入		167,173.25	11,703.24
其中：存款利息收入	6.4.7.13	167,173.25	11,703.24
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-7,556,132.13	9,957,463.11
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-10,568,536.00	9,718,215.43
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	3,012,403.87	239,247.68
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	4,426,187.75	168,939.26
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	165,457.46	23,199.50
减：二、营业总支出		3,055,935.98	817,700.50

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,384,845.17	376,639.46
2. 托管费	6.4.10.2.2	397,474.18	62,773.30
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	207,822.97	—
4. 投资顾问费	6.4.10.2.1.1	—	—
5. 利息支出		—	—
其中：卖出回购金融资产支出		—	—
6. 信用减值损失	6.4.7.22	—	—
7. 税金及附加		—	—
8. 其他费用	6.4.7.23	65,793.66	378,287.74
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-5,853,249.65	9,343,604.61
减：所得税费用		—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-5,853,249.65	9,343,604.61
五、其他综合收益的税后净额		—	—
六、综合收益总额		-5,853,249.65	9,343,604.61

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：泰达宏利睿智稳健灵活配置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、上期期末净资产（基金净值）	75,461,413.24	—	44,261,066.26	119,722,479.50
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）	75,461,413.24	—	44,261,066.26	119,722,479.50
三、本期增减变	258,182,876.60	—	69,980,208.63	328,163,085.23

动额(减少以“-”号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	-5,853,249.65	-5,853,249.65
(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)	258,182,876.60	-	97,987,634.83	356,170,511.43
其中:1.基金申购款	354,345,865.59	-	123,943,256.13	478,289,121.72
2.基金赎回款	-96,162,988.99	-	-25,955,621.30	-122,118,610.29
(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)	-	-	-22,154,176.55	-22,154,176.55
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	333,644,289.84	-	114,241,274.89	447,885,564.73
项目	上年度可比期间			

	2021 年 1 月 1 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)	41,648,577.11	-	12,956,305.34	54,604,882.45
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)	41,648,577.11	-	12,956,305.34	54,604,882.45
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-3,992,050.59	-	3,447,776.43	-544,274.16
(一)、综合收益总额	-	-	9,343,604.61	9,343,604.61
(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)	-3,992,050.59	-	-2,321,362.39	-6,313,412.98
其中:1.基金申购款	8,017,397.70	-	1,949,995.72	9,967,393.42
2.基金赎回款	-12,009,448.29	-	-4,271,358.11	-16,280,806.40
(三)、	-	-	-3,574,465.79	-3,574,465.79

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、本期期末净资产(基金净值)	37,656,526.52	-	16,404,081.77	54,060,608.29

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

泰达宏利睿智稳健灵活配置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[2016]2043号《关于准予泰达宏利睿智稳健灵活配置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《泰达宏利睿智稳健灵活配置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1,331,297,830.44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(2016)第1369号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰达宏利睿智稳健灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2016年11月23日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,331,707,696.03份基金份额,其中认购资金利息折合409,865.59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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国

工商银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利睿智稳健灵活配置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（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、短期融资券、中期票据、次级债券、可交换债券、可转债及分离交易可转债）、债券回购、资产支持证券、货币市场工具、权证、股指期货、同业存单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的相关规定）。基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%-95%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，股指期货的投资比例遵循国家相关法律法规。本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数收益率×35%+中证综合债券指数收益率×65%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰达宏利睿智稳健灵活配置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、应收利息和应收申购款，金额分别为 32,824,249.94 元、370,954.94 元、26,922.37 元、2,496.10 元和 6,382,682.57 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-应收利息和应收申购款，金额分别为 32,826,166.87 元、371,121.94 元、26,934.57 元、0.00 元和 6,383,082.54 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 87,872,163.40 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 87,872,163.40 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 7,356,847.08 元、15,561.60 元、91,872.34 元、15,312.06 元、2,670.33 元、145,714.50 元和 11.91 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 7,356,847.08 元、15,561.60 元、91,872.34 元、15,312.06 元、2,670.33 元、145,714.50 元和 11.91 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]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的转让收入免征增值税。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，包括买卖股票的差价收入，股票的股息、红利收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

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

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	95,536,175.46
等于：本金	95,529,176.18
加：应计利息	6,999.28
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	95,536,175.46

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		349,991,478.60	-	357,579,771.36	7,588,292.76
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		349,991,478.60	-	357,579,771.36	7,588,292.76

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融资产和负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末买入返售金融资产无余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末无债权投资。

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

本基金本报告期末无其他资产余额。

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	1,380.52
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	780,347.32
其中：交易所市场	780,347.32
银行间市场	—
应付利息	—
预提费用	53,630.98
合计	835,358.82

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

泰达睿智稳健混合 A

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	57,803,672.65	57,803,672.65
本期申购	162,186,529.73	162,186,529.73
本期赎回（以“-”号填列）	-26,627,866.76	-26,627,866.76
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	193,362,335.62	193,362,335.62

泰达睿智稳健混合 C

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	17,657,740.59	17,657,740.59
本期申购	192,159,335.86	192,159,335.86
本期赎回（以“-”号填列）	-69,535,122.23	-69,535,122.23
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	140,281,954.22	140,281,954.22

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

泰达睿智稳健混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	39,223,901.12	-6,778,144.27	32,445,756.85
本期利润	-5,375,073.11	2,875,443.64	-2,499,629.47
本期基金份额交易产生的变动数	78,611,747.78	-32,558,292.07	46,053,455.71
其中：基金申购款	93,309,959.05	-40,349,231.83	52,960,727.22
基金赎回款	-14,698,211.27	7,790,939.76	-6,907,271.51
本期已分配利润	-8,029,811.68	-	-8,029,811.68
本期末	104,430,764.11	-36,460,992.70	67,969,771.41

泰达睿智稳健混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	13,834,217.05	-2,018,907.64	11,815,309.41
本期利润	-4,904,364.29	1,550,744.11	-3,353,620.18
本期基金份额交易产生的变动数	80,818,708.60	-28,884,529.48	51,934,179.12
其中：基金申购款	121,420,236.88	-50,437,707.97	70,982,528.91
基金赎回款	-40,601,528.28	21,553,178.49	-19,048,349.79
本期已分配利润	-14,124,364.87	-	-14,124,364.87
本期末	75,624,196.49	-29,352,693.01	46,271,503.48

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	144,826.19
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	7,683.37
其他	14,663.69
合计	167,173.25

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	-10,568,536.00
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	-10,568,536.00

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	578,609,266.78
减：卖出股票成本总额	587,143,861.39
减：交易费用	2,033,941.39
买卖股票差价收入	-10,568,536.00

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期末有股票投资收益-证券出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无债券投资收益-买卖债券差价收入。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期末有债券投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期末有债券投资收益-申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期末有资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期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

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无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

本基金本报告期内无赎回贵金属差价收入。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无申购贵金属差价收入。

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

本基金本报告期内无衍生工具收益-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

本基金本报告期内无衍生工具收益-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	3,012,403.87
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	3,012,403.87

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	4,426,187.75
股票投资	4,426,187.75
债券投资	—
资产支持证券投资	—
基金投资	—
贵金属投资	—
其他	—
2. 衍生工具	—
权证投资	—
3. 其他	—

减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	4,426,187.75

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	159,616.92
基金转换费收入	5,840.54
合计	165,457.46

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

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

6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

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	19,835.79
信息披露费	24,795.19
证券出借违约金	-
银行费用	2,562.68
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	65,793.66

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金的基金管理人于 2022 年 7 月 19 日宣告 2022 年度第 3 次分红，向截至 2022 年 7 月 20 日止在本基金注册登记人泰达宏利基金管理有限公司登记在册的本基金 A 类份额全体份额持有人，按每 10 份基金份额派发红利 1.0000 元；向截至 2022 年 7 月 20 日止在本基金注册登记人泰达宏利基金管理有限公司登记在册的本基金 C 类份额全体份额持有人，按每 10 份基金份额派发红利 1.0000 元。

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
中国工商银行股份有限公司(工商银行)	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方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均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 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,384,845.17	376,639.46
其中：支付销售机构的客户维护费	361,221.96	69,905.08

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 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。上述相关费用包含实际支付金额和税金。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	397,474.18	62,773.30

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泰达睿智稳健混合 A	泰达睿智稳健混合 C	合计
	泰达宏利基金管理有限公司	74,798.62	74,798.62
合计	-	74,798.62	74,798.62
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泰达睿智稳健混合 A	泰达睿智稳健混合 C	合计
	泰达宏利基金管理有限公司	-	-
合计	-	-	-

注：支付基金销售机构的销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值 0.30%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给泰达宏利基金管理有限公司，再由泰达宏利基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日 C 类基金份额销售服务费=前一日 C 类基金份额基金资产净值 X 0.30% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的管理人在本报告期内及上年度可比期间内均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末及上年度末均未持有本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 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
中国工商银行	95,536,175.46	144,826.19	5,334,457.67	10,528.82

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

泰达睿智稳健混合 A								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份基 金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润 分配合计	备注
		场内	场外					
1	2022 年 1 月 20 日	-	2022 年 1 月 20 日	1.0000	3,330,399.17	4,684,425.03	8,014,824.20	-
2	2022 年 4 月 22 日	-	2022 年 4 月 22 日	0.0010	6,300.56	8,686.92	14,987.48	-
合计	-	-	-	1.0010	3,336,699.73	4,693,111.95	8,029,811.68	-
泰达睿智稳健混合 C								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份基 金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润 分配合计	备注
		场内	场外					

1	2022 年 1 月 20 日	-	2022 年 1 月 20 日	1.0000	1,645,597.68	2,511,661.51	4,157,259.19	-
2	2022 年 4 月 22 日	-	2022 年 4 月 22 日	1.0000	3,896,442.34	6,070,663.34	9,967,105.68	-
合计	-	-	-	2.0000	5,542,040.02	8,582,324.85	14,124,364.87	-

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
301097	天益医疗	2022 年 3 月 25 日	6 个月	新股流通受限	52.37	47.83	244	12,778.28	11,670.52	-
301102	兆讯传媒	2022 年 3 月 15 日	6 个月	新股流通受限	39.88	31.09	294	11,724.72	9,140.46	-
301109	军信股份	2022 年 4 月 6 日	6 个月	新股流通受限	34.81	16.14	635	14,724.63	10,248.90	-
301110	青木股份	2022 年 3 月 4 日	6 个月	新股流通受限	63.10	39.85	143	9,023.30	5,698.55	-
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	-
301130	西点药业	2022 年 2 月 16 日	6 个月	新股流通受限	22.55	37.70	200	4,510.00	7,540.00	-
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	592	9,099.04	9,466.08	-
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	5,482	210,837.72	210,837.72	-
301148	嘉戎技术	2022 年 4 月 14 日	6 个月	新股流通受限	38.39	23.90	380	14,588.20	9,082.00	-

301162	国能日新	2022 年 4 月 19 日	6 个月	新股流通受限	45.13	54.11	234	10,560.42	12,661.74	-
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	56,740	216,746.80	216,746.80	-
301181	标榜股份	2022 年 2 月 11 日	6 个月	新股流通受限	40.25	30.59	132	5,313.00	4,037.88	-
301200	大族数控	2022 年 2 月 18 日	6 个月	新股流通受限	76.56	51.92	149	11,407.44	7,736.08	-
301207	华兰疫苗	2022 年 2 月 10 日	6 个月	新股流通受限	56.88	56.42	80	4,550.40	4,513.60	-
301212	联盛化学	2022 年 4 月 7 日	6 个月	新股流通受限	29.67	33.28	407	12,075.69	13,544.96	-
301215	中汽股份	2022 年 2 月 28 日	6 个月	新股流通受限	3.80	6.39	3,352	12,737.60	21,419.28	-
301216	万凯新材	2022 年 3 月 21 日	6 个月	新股流通受限	35.68	29.84	262	9,348.16	7,818.08	-
301219	腾远钴业	2022 年 3 月 10 日	6 个月	新股流通受限	173.98	87.82	101	9,742.88	8,869.82	-
301222	浙江恒威	2022 年 3 月 2 日	6 个月	新股流通受限	33.98	28.96	262	8,902.76	7,587.52	-
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	-
301236	软通动力	2022 年 3 月 8 日	6 个月	新股流通受限	72.88	31.38	344	16,689.52	10,794.72	-
301237	和顺科技	2022 年 3 月 16 日	6 个月	新股流通受限	56.69	41.86	196	11,111.24	8,204.56	-
301238	瑞泰新材	2022 年 6 月 10 日	6 个月	新股流通受限	19.18	32.07	1,029	19,736.22	33,000.03	-
301248	杰创智能	2022 年 4 月 13 日	6 个月	新股流通受限	39.07	29.87	395	15,432.65	11,798.65	-

		日								
301256	华融化学	2022 年 3 月 14 日	6 个月	新股流通受限	8.05	10.08	1,530	12,316.50	15,422.40	-
301258	富士莱	2022 年 3 月 21 日	6 个月	新股流通受限	48.30	41.68	188	9,080.40	7,835.84	-
301268	铭利达	2022 年 3 月 29 日	6 个月	新股流通受限	28.50	34.87	431	12,283.50	15,028.97	-
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	-
688125	安达智能	2022 年 4 月 8 日	6 个月	新股流通受限	60.55	43.43	2,956	178,985.80	128,379.08	-
688349	三一重能	2022 年 6 月 15 日	6 个月	新股流通受限	29.80	36.94	8,489	252,972.20	313,583.66	-

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等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金是混合型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期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、债券投资、货币市场工具投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是通过现代风险模型技术进行基金风险预算，在严控本基金下行风险的前提下，灵活运用多种投资策略，力争实现基金资产的长期稳健增值。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。风险管理部对公司执行总裁负责，并由督察长分管。

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期存款

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

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

本基金债券投资、资产支持证券投资 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。

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有债券投资、资产支持证券投资 and 同业存单投资资产 (2021 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

于 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约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值 (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时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的

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

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

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现

金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	95,536,175.46	-	-	-	95,536,175.46
结算备付金	1,484,533.27	-	-	-	1,484,533.27
存出保证金	129,205.91	-	-	-	129,205.91
交易性金融资产	-	-	-	357,579,771.36	357,579,771.36
应收申购款	-	-	-	271,071.13	271,071.13
应收清算款	-	-	-	4,403,610.73	4,403,610.73
资产总计	97,149,914.64	-	-	362,254,453.22	459,404,367.86
负债					
应付赎回款	-	-	-	9,985,308.97	9,985,308.97
应付管理人报酬	-	-	-	556,119.73	556,119.73
应付托管费	-	-	-	92,686.61	92,686.61
应付销售服务费	-	-	-	49,329.00	49,329.00
其他负债	-	-	-	835,358.82	835,358.82
负债总计	-	-	-	11,518,803.13	11,518,803.13
利率敏感度缺口	97,149,914.64	-	-	350,735,650.09	447,885,564.73
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	32,824,249.94	-	-	-	32,824,249.94
结算备付金	370,954.94	-	-	-	370,954.94
存出保证金	26,922.37	-	-	-	26,922.37
交易性金融资产	-	-	-	87,872,163.40	87,872,163.40
应收利息	-	-	-	2,496.10	2,496.10
应收申购款	-	-	-	6,382,682.57	6,382,682.57
资产总计	33,222,127.25	-	-	94,257,342.07	127,479,469.32
负债					
应付赎回款	-	-	-	15,561.60	15,561.60
应付管理人报酬	-	-	-	91,872.34	91,872.34
应付托管费	-	-	-	15,312.06	15,312.06
应付证券清算款	-	-	-	7,356,847.08	7,356,847.08
应付销售服务费	-	-	-	2,670.33	2,670.33
应付交易费用	-	-	-	145,714.50	145,714.50
其他负债	-	-	-	129,011.91	129,011.91
负债总计	-	-	-	7,756,989.82	7,756,989.82
利率敏感度缺口	33,222,127.25	-	-	86,500,352.25	119,722,479.50

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的到期日予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2021 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2021 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产占基金资产的比例为 0%-95%，本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	357,579,771.36	79.84	87,872,163.40	73.40
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	357,579,771.36	79.84	87,872,163.40	73.40

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%	18,660,000.00	5,110,000.00
	沪深 300 指数下降 5%	-18,660,000.00	-5,110,000.00

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	356,342,260.06	87,866,658.91
第二层次	493,020.04	5,504.49

第三层次	744,491.26	—
合计	357,579,771.36	87,872,163.40

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；本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

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	357,579,771.36	77.84
	其中：股票	357,579,771.36	77.84
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	97,020,708.73	21.12
8	其他各项资产	4,803,887.77	1.05
9	合计	459,404,367.86	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	11,012,700.00	2.46
C	制造业	325,670,374.54	72.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	4,453,372.00	0.99
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	56,540.00	0.01
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	251,791.38	0.06
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	9,140.46	0.00
M	科学研究和技术服务业	11,678,039.28	2.61
N	水利、环境和公共设施管理业	236,077.70	0.05
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	4,211,736.00	0.94
	合计	357,579,771.36	79.84

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	002841	视源股份	285,084	21,472,526.88	4.79
2	000725	京东方 A	4,562,100	17,974,674.00	4.01
3	300481	濮阳惠成	637,000	14,969,500.00	3.34
4	300760	迈瑞医疗	47,200	14,783,040.00	3.30
5	300384	三联虹普	626,700	11,656,620.00	2.60
6	300750	宁德时代	20,300	10,840,200.00	2.42
7	000661	长春高新	41,000	9,570,220.00	2.14
8	688550	瑞联新材	139,109	9,541,486.31	2.13

9	603067	振华股份	751,800	9,420,054.00	2.10
10	300953	震裕科技	65,091	8,916,816.09	1.99
11	003019	宸展光电	321,770	8,121,474.80	1.81
12	603228	景旺电子	345,975	8,071,596.75	1.80
13	300596	利安隆	172,300	7,600,153.00	1.70
14	002475	立讯精密	223,400	7,548,686.00	1.69
15	600519	贵州茅台	3,400	6,953,000.00	1.55
16	603077	和邦生物	1,595,100	6,795,126.00	1.52
17	600583	海油工程	1,564,800	6,493,920.00	1.45
18	688599	天合光能	98,490	6,426,472.50	1.43
19	301150	中一科技	69,650	6,393,173.50	1.43
20	688089	嘉必优	190,959	6,253,907.25	1.40
21	002384	东山精密	262,700	6,023,711.00	1.34
22	002984	森麒麟	192,200	5,979,342.00	1.34
23	603920	世运电路	337,700	5,842,210.00	1.30
24	003038	鑫铂股份	115,100	5,801,040.00	1.30
25	002463	沪电股份	392,130	5,787,838.80	1.29
26	301129	瑞纳智能	97,000	5,706,510.00	1.27
27	002100	天康生物	580,400	5,641,488.00	1.26
28	300408	三环集团	184,300	5,547,430.00	1.24
29	300666	江丰电子	86,500	5,276,500.00	1.18
30	688778	厦钨新能	45,402	5,060,960.94	1.13
31	002824	和胜股份	91,900	5,053,581.00	1.13
32	002487	大金重工	116,600	4,865,718.00	1.09
33	000895	双汇发展	165,568	4,851,142.40	1.08
34	688120	华海清科	19,174	4,762,821.60	1.06
35	603386	骏亚科技	301,600	4,732,104.00	1.06
36	300610	晨化股份	248,300	4,625,829.00	1.03
37	002850	科达利	28,700	4,563,300.00	1.02
38	002192	融捷股份	29,400	4,518,780.00	1.01
39	601668	中国建筑	837,100	4,453,372.00	0.99
40	603681	永冠新材	179,600	4,414,568.00	0.99
41	300398	飞凯材料	189,300	4,327,398.00	0.97
42	688499	利元亨	19,177	4,243,870.10	0.95
43	000833	粤桂股份	465,900	4,211,736.00	0.94
44	688138	清溢光电	249,055	4,007,294.95	0.89
45	000657	中钨高新	254,800	3,822,000.00	0.85
46	300735	光弘科技	362,200	3,784,990.00	0.85
47	300902	国安达	103,200	3,654,312.00	0.82
48	002572	索菲亚	132,500	3,643,750.00	0.81
49	688800	瑞可达	25,808	3,259,808.48	0.73
50	000932	华菱钢铁	534,300	2,719,587.00	0.61

51	600973	宝胜股份	396,900	2,298,051.00	0.51
52	688257	新锐股份	57,886	2,293,443.32	0.51
53	300409	道氏技术	87,700	2,278,446.00	0.51
54	002533	金杯电工	311,400	2,207,826.00	0.49
55	300041	回天新材	123,900	2,152,143.00	0.48
56	002263	大东南	415,600	1,421,352.00	0.32
57	301198	喜悦智行	61,464	1,386,013.20	0.31
58	688125	安达智能	23,088	1,085,454.36	0.24
59	688349	三一重能	8,489	313,583.66	0.07
60	301175	中科环保	56,740	216,746.80	0.05
61	301139	元道通信	5,482	210,837.72	0.05
62	002955	鸿合科技	7,900	171,983.00	0.04
63	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.01
64	001270	铖昌科技	568	57,481.60	0.01
65	300873	海晨股份	2,000	56,540.00	0.01
66	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.01
67	301238	瑞泰新材	1,029	33,000.03	0.01
68	001323	慕思股份	573	28,111.38	0.01
69	301215	中汽股份	3,352	21,419.28	0.00
70	301120	新特电气	1,032	15,985.68	0.00
71	301286	侨源股份	784	15,515.36	0.00
72	301256	华融化学	1,530	15,422.40	0.00
73	301268	铭利达	431	15,028.97	0.00
74	301212	联盛化学	407	13,544.96	0.00
75	301162	国能日新	234	12,661.74	0.00
76	301248	杰创智能	395	11,798.65	0.00
77	301097	天益医疗	244	11,670.52	0.00
78	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
79	301236	软通动力	344	10,794.72	0.00
80	301109	军信股份	635	10,248.90	0.00
81	301137	哈焊华通	592	9,466.08	0.00
82	301102	兆讯传媒	294	9,140.46	0.00
83	301148	嘉戎技术	380	9,082.00	0.00
84	301288	清研环境	452	9,030.96	0.00
85	301135	瑞德智能	338	8,875.88	0.00
86	301219	腾远钴业	101	8,869.82	0.00
87	301237	和顺科技	196	8,204.56	0.00
88	301258	富士莱	188	7,835.84	0.00
89	301216	万凯新材	262	7,818.08	0.00
90	301200	大族数控	149	7,736.08	0.00
91	301222	浙江恒威	262	7,587.52	0.00
92	301130	西点药业	200	7,540.00	0.00

93	301110	青木股份	143	5,698.55	0.00
94	301207	华兰疫苗	80	4,513.60	0.00
95	301181	标榜股份	132	4,037.88	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	000725	京东方 A	23,986,368.00	20.03
2	300760	迈瑞医疗	21,767,347.00	18.18
3	002841	视源股份	21,265,176.44	17.76
4	300750	宁德时代	17,935,746.00	14.98
5	603228	景旺电子	17,361,402.74	14.50
6	002384	东山精密	17,020,628.00	14.22
7	688599	天合光能	16,922,041.16	14.13
8	688550	瑞联新材	14,133,295.83	11.81
9	300481	濮阳惠成	13,917,964.00	11.63
10	603386	骏亚科技	13,680,341.00	11.43
11	002475	立讯精密	13,518,899.00	11.29
12	002487	大金重工	13,006,390.00	10.86
13	300384	三联虹普	11,803,208.96	9.86
14	002838	道恩股份	11,714,362.00	9.78
15	300735	光弘科技	11,441,930.54	9.56
16	300953	震裕科技	11,404,707.20	9.53
17	603067	振华股份	11,216,727.00	9.37
18	300398	飞凯材料	10,739,595.00	8.97
19	600519	贵州茅台	10,328,612.00	8.63
20	002876	三利谱	10,051,562.00	8.40
21	603806	福斯特	9,763,317.00	8.15
22	300709	精研科技	9,608,723.80	8.03
23	002463	沪电股份	8,894,911.00	7.43
24	688025	杰普特	8,367,570.10	6.99
25	300408	三环集团	8,267,474.00	6.91
26	605117	德业股份	8,024,411.00	6.70
27	003019	宸展光电	7,990,941.00	6.67
28	300596	利安隆	7,940,827.00	6.63
29	603225	新凤鸣	7,875,315.00	6.58
30	603920	世运电路	7,751,472.86	6.47
31	002812	恩捷股份	7,645,669.27	6.39
32	600346	恒力石化	7,533,401.00	6.29
33	002192	融捷股份	7,531,577.00	6.29
34	300666	江丰电子	7,381,776.00	6.17

35	002850	科达利	7,276,535.00	6.08
36	300454	深信服	7,184,110.95	6.00
37	600583	海油工程	6,953,900.00	5.81
38	688008	澜起科技	6,783,637.55	5.67
39	600309	万华化学	6,628,783.50	5.54
40	002049	紫光国微	6,499,918.00	5.43
41	000661	长春高新	6,435,356.00	5.38
42	603596	伯特利	6,405,039.00	5.35
43	603077	和邦生物	6,295,482.00	5.26
44	300993	玉马遮阳	6,171,181.00	5.15
45	688778	厦钨新能	6,142,924.04	5.13
46	003038	鑫铂股份	6,131,733.20	5.12
47	301150	中一科技	6,088,976.50	5.09
48	600011	华能国际	5,996,768.00	5.01
49	688019	安集科技	5,967,151.22	4.98
50	601865	福莱特	5,779,626.00	4.83
51	688499	利元亨	5,715,314.73	4.77
52	688089	嘉必优	5,516,723.23	4.61
53	002371	北方华创	5,502,119.00	4.60
54	600409	三友化工	5,466,078.97	4.57
55	002984	森麒麟	5,351,463.00	4.47
56	300450	先导智能	5,322,268.60	4.45
57	002100	天康生物	5,276,897.00	4.41
58	002824	和胜股份	5,141,672.47	4.29
59	002460	赣锋锂业	5,081,264.00	4.24
60	688800	瑞可达	5,019,545.12	4.19
61	603008	喜临门	4,808,902.00	4.02
62	301129	瑞纳智能	4,741,408.00	3.96
63	605259	绿田机械	4,737,260.00	3.96
64	300610	晨化股份	4,654,487.00	3.89
65	601668	中国建筑	4,639,276.00	3.88
66	002409	雅克科技	4,602,040.00	3.84
67	002245	蔚蓝锂芯	4,575,803.00	3.82
68	601012	隆基绿能	4,523,719.00	3.78
69	688120	华海清科	4,451,418.52	3.72
70	000895	双汇发展	4,443,303.64	3.71
71	002531	天顺风能	4,411,398.00	3.68
72	600389	江山股份	4,406,047.00	3.68
73	002756	永兴材料	4,244,799.00	3.55
74	000568	泸州老窖	4,166,783.00	3.48
75	000833	粤桂股份	4,163,344.00	3.48
76	603681	永冠新材	4,161,323.00	3.48

77	300902	国安达	4,041,372.00	3.38
78	002415	海康威视	4,038,858.00	3.37
79	603688	石英股份	3,953,853.00	3.30
80	300567	精测电子	3,952,462.00	3.30
81	603626	科森科技	3,923,766.00	3.28
82	000858	五 粮 液	3,876,172.00	3.24
83	688196	卓越新能	3,811,092.63	3.18
84	000657	中钨高新	3,780,517.34	3.16
85	688662	富信科技	3,775,903.47	3.15
86	688138	清溢光电	3,597,849.18	3.01
87	002459	晶澳科技	3,590,660.00	3.00
88	002594	比亚迪	3,585,264.00	2.99
89	688233	神工股份	3,582,198.52	2.99
90	688711	宏微科技	3,545,999.02	2.96
91	002206	海 利 得	3,389,840.00	2.83
92	002299	圣农发展	3,389,413.00	2.83
93	300568	星源材质	3,308,489.00	2.76
94	300274	阳光电源	3,255,549.18	2.72
95	688298	东方生物	3,235,415.44	2.70
96	688112	鼎阳科技	3,147,079.30	2.63
97	603816	顾家家居	2,903,518.00	2.43
98	002572	索菲亚	2,884,500.99	2.41
99	000932	华菱钢铁	2,785,977.00	2.33
100	300373	扬杰科技	2,785,398.41	2.33
101	000792	盐湖股份	2,660,099.00	2.22
102	688388	嘉元科技	2,633,179.68	2.20
103	605305	中际联合	2,509,708.00	2.10
104	603055	台华新材	2,447,595.00	2.04
105	601689	拓普集团	2,427,757.00	2.03
106	300037	新宙邦	2,405,639.00	2.01

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	002838	道恩股份	16,348,023.00	13.65
2	002384	东山精密	12,661,347.00	10.58
3	688599	天合光能	12,065,373.55	10.08
4	002876	三利谱	10,935,789.98	9.13
5	603225	新凤鸣	10,874,428.48	9.08

6	603806	福斯特	10,556,546.40	8.82
7	603228	景旺电子	10,423,833.00	8.71
8	300709	精研科技	10,126,838.60	8.46
9	605117	德业股份	9,670,165.40	8.08
10	000725	京东方 A	9,526,419.00	7.96
11	603386	骏亚科技	8,763,104.00	7.32
12	300398	飞凯材料	8,386,704.62	7.01
13	300993	玉马遮阳	8,331,073.52	6.96
14	002487	大金重工	7,955,680.00	6.65
15	300454	深信服	7,726,353.93	6.45
16	002812	恩捷股份	7,520,631.00	6.28
17	603067	振华股份	7,291,463.00	6.09
18	600309	万华化学	7,025,774.00	5.87
19	300760	迈瑞医疗	7,009,506.00	5.85
20	688025	杰普特	6,999,178.57	5.85
21	688019	安集科技	6,593,634.55	5.51
22	002475	立讯精密	6,389,674.00	5.34
23	600346	恒力石化	6,350,907.00	5.30
24	002049	紫光国微	6,310,562.00	5.27
25	600409	三友化工	6,233,120.00	5.21
26	300450	先导智能	6,231,449.00	5.20
27	002371	北方华创	6,020,014.00	5.03
28	600011	华能国际	5,965,940.00	4.98
29	300750	宁德时代	5,889,500.00	4.92
30	688008	澜起科技	5,803,397.77	4.85
31	601865	福莱特	5,754,049.00	4.81
32	002192	融捷股份	5,729,018.00	4.79
33	603596	伯特利	5,681,895.00	4.75
34	605259	绿田机械	5,543,331.00	4.63
35	601012	隆基绿能	5,504,388.15	4.60
36	603008	喜临门	5,333,653.00	4.46
37	300373	扬杰科技	5,273,803.86	4.41
38	002206	海利得	5,041,447.00	4.21
39	300953	震裕科技	4,936,268.00	4.12
40	002824	和胜股份	4,751,478.81	3.97
41	600519	贵州茅台	4,744,418.00	3.96
42	300735	光弘科技	4,730,856.00	3.95
43	002409	雅克科技	4,586,822.00	3.83
44	000568	泸州老窖	4,494,272.00	3.75
45	600389	江山股份	4,467,003.00	3.73
46	688550	瑞联新材	4,437,170.90	3.71
47	603916	苏博特	4,336,963.40	3.62

48	002459	晶澳科技	4,305,525.00	3.60
49	002415	海康威视	4,291,809.00	3.58
50	300037	新宙邦	4,227,961.00	3.53
51	688196	卓越新能	4,195,539.07	3.50
52	002460	赣锋锂业	4,184,914.00	3.50
53	603688	石英股份	4,181,099.85	3.49
54	002245	蔚蓝锂芯	4,166,146.00	3.48
55	000858	五粮液	4,140,061.00	3.46
56	300567	精测电子	4,072,159.00	3.40
57	300852	四会富仕	4,015,941.00	3.35
58	688711	宏微科技	3,966,535.15	3.31
59	002594	比亚迪	3,963,810.00	3.31
60	002841	视源股份	3,945,077.00	3.30
61	002756	永兴材料	3,910,547.00	3.27
62	002299	圣农发展	3,865,934.00	3.23
63	300568	星源材质	3,768,578.52	3.15
64	300274	阳光电源	3,652,854.00	3.05
65	688388	嘉元科技	3,490,825.53	2.92
66	688662	富信科技	3,391,777.94	2.83
67	603816	顾家家居	3,300,022.00	2.76
68	002850	科达利	3,185,420.00	2.66
69	002531	天顺风能	3,153,866.00	2.63
70	603626	科森科技	3,079,924.00	2.57
71	605305	中际联合	3,057,750.00	2.55
72	688298	东方生物	2,965,042.11	2.48
73	002463	沪电股份	2,903,511.00	2.43
74	688199	久日新材	2,876,708.71	2.40
75	601689	拓普集团	2,817,510.00	2.35
76	688385	复旦微电	2,750,594.89	2.30
77	688233	神工股份	2,650,815.80	2.21
78	603055	台华新材	2,629,042.00	2.20
79	000792	盐湖股份	2,515,676.00	2.10
80	300666	江丰电子	2,508,874.00	2.10
81	603659	璞泰来	2,478,554.00	2.07
82	688032	禾迈股份	2,475,817.00	2.07
83	688778	厦钨新能	2,443,379.50	2.04
84	605166	聚合顺	2,441,377.00	2.04
85	603927	中科软	2,410,734.00	2.01
86	600612	老凤祥	2,399,282.00	2.00

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	852,425,281.60
卖出股票收入（成交）总额	578,609,266.78

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

在报告期内，本基金未投资于股指期货。该策略符合基金合同的规定。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

在报告期内，本基金未投资于国债期货。该策略符合基金合同的规定。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本报告期本基金未投资国债期货。

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

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查的情况，在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

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	129,205.91
2	应收清算款	4,403,610.73
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	271,071.13
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	4,803,887.77

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

份额级别	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 (%)
泰达睿智 稳健混合 A	5,034	38,411.27	168,959,097.62	87.38	24,403,238.00	12.62
泰达睿智 稳健混合 C	210	668,009.31	137,801,509.44	98.23	2,480,444.78	1.77
合计	5,244	63,624.01	306,760,607.06	91.94	26,883,682.78	8.06

注：1、分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）；

2、截止本报告期末，本基金机构投资者占比较高，请投资者关注相关风险。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	泰达睿智稳健混合 A	1,256,554.37	0.6498
	泰达睿智稳健混合 C	24,618.28	0.0175
	合计	1,281,172.65	0.3840

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	泰达睿智稳健混合 A	50~100
	泰达睿智稳健混合 C	0
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	泰达睿智稳健混合 A	0~10
	泰达睿智稳健混合 C	0
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	泰达睿智稳健混合 A	泰达睿智稳健混合 C
基金合同生效日 （2016 年 11 月 23 日）基金份额总额	1,331,707,696.03	—
本报告期期初基金份额总额	57,803,672.65	17,657,740.59
本报告期基金总申购份额	162,186,529.73	192,159,335.86
减：本报告期基金总赎回份额	26,627,866.76	69,535,122.23
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	193,362,335.62	140,281,954.22

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未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

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

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金无投资策略的变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及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 (%)	
银河证券	2	1,425,517,294.23	100.00	1,327,584.40	100.00	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-

注：（一）2022 年上半年本基金无交易单元增减情况。

（二）交易单元选择的标准和程序

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

交易单元，选择的标准是：

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期末通过租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

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	《泰达宏利睿智稳健灵活配置混合型证券投资基金分红公告》	《证券日报》、中国证监会基金电子披露网站及公司网站	2022 年 1 月 19 日
2	《泰达宏利睿智稳健灵活配置混合型证券投资基金分红公告》	《证券日报》、中国证监会基金电子披露网站及公司网站	2022 年 4 月 21 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