

泰达宏利先进制造股票型证券投资基金

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 13 日（基金合同生效日）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	12
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	13
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	14
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	14
§ 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	17
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
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	50

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	50
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	50
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	50
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
7.12 投资组合报告附注	50
§ 8 基金份额持有人信息.....	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
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	52
§ 9 开放式基金份额变动.....	52
§ 10 重大事件揭示	53
10.1 基金份额持有人大会决议	53
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	53
10.4 基金投资策略的改变	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	53
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	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	53
§ 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	泰达宏利先进制造股票型证券投资基金	
基金简称	泰达宏利先进制造股票	
基金主代码	014299	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 1 月 13 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	423,117,543.45 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	泰达宏利先进制造股票 A	泰达宏利先进制造股票 C
下属分级基金的交易代码	014299	014300
报告期末下属分级基金的份额总额	410,784,050.41 份	12,333,493.04 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资先进制造主题的上市公司股票，在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金主要投资于先进制造主题上市公司，包括在制造业中具有先进核心技术、产品创新能力、高技术附加值和能够引领产业发展方向的企业，以及为上述企业提供相关服务和产品的企业。
业绩比较基准	中证智能制造主题指数收益率×75%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×10%+中证综合债券指数收益率×15%。
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险及预期收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金的基金资产如投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

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	北京市西城区复兴门内大街 28

	人寿金融中心 6 层 02-07 单元	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	证券时报
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、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	2022 年 01 月 13 日（基金合同生效日）-2022 年 06 月 30 日	
	泰达宏利先进制造股票 A	泰达宏利先进制造股票 C
本期已实现收益	-39,899,136.59	-1,204,157.41
本期利润	5,078,692.01	-204,371.93
加权平均基金份 额本期利润	0.0105	-0.0144
本期加权平均净 值利润率	1.13%	-1.55%
本期基金份额净 值增长率	2.14%	2.00%
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	-32,614,713.66	-994,509.87
期末可供分配基 金份额利润	-0.0794	-0.0806
期末基金资产净 值	419,577,789.37	12,580,127.40
期末基金份额净 值	1.0214	1.0200

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	2.14%	2.00%

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

泰达宏利先进制造股票 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	13.05%	1.61%	7.68%	1.31%	5.37%	0.30%
过去三个月	11.59%	1.83%	2.15%	1.73%	9.44%	0.10%
自基金合同生效起至今	2.14%	1.66%	-10.41%	1.61%	12.55%	0.05%

泰达宏利先进制造股票 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	13.02%	1.61%	7.68%	1.31%	5.34%	0.30%
过去三个月	11.50%	1.83%	2.15%	1.73%	9.35%	0.10%
自基金合同生效起至今	2.00%	1.66%	-10.41%	1.61%	12.41%	0.05%

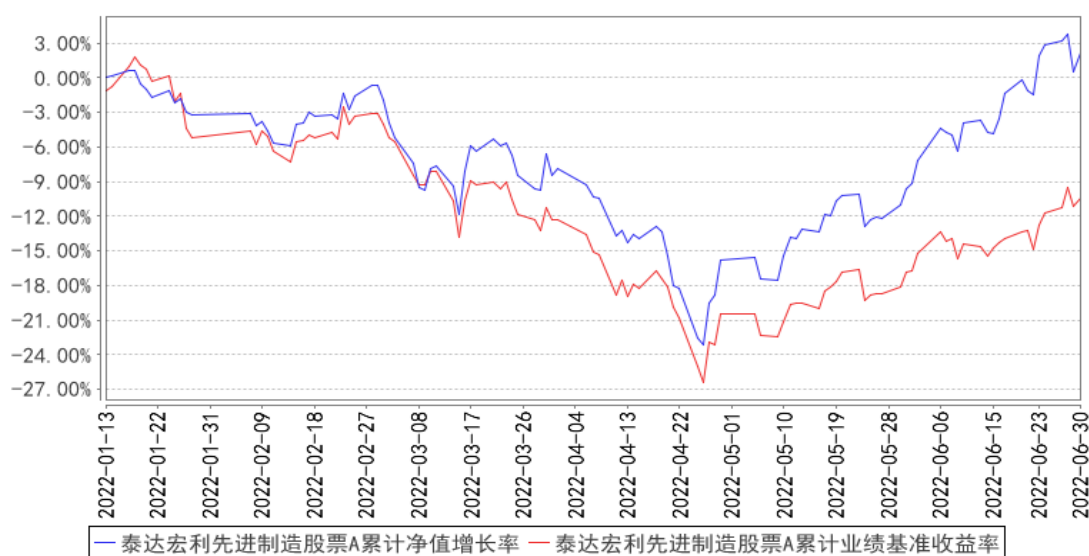
注：本基金业绩比较基准：中证智能制造主题指数收益率×75%+ 中证港股通综合指数（人民币）

收益率 $\times 10\%$ + 中证综合债券指数收益率 $\times 15\%$

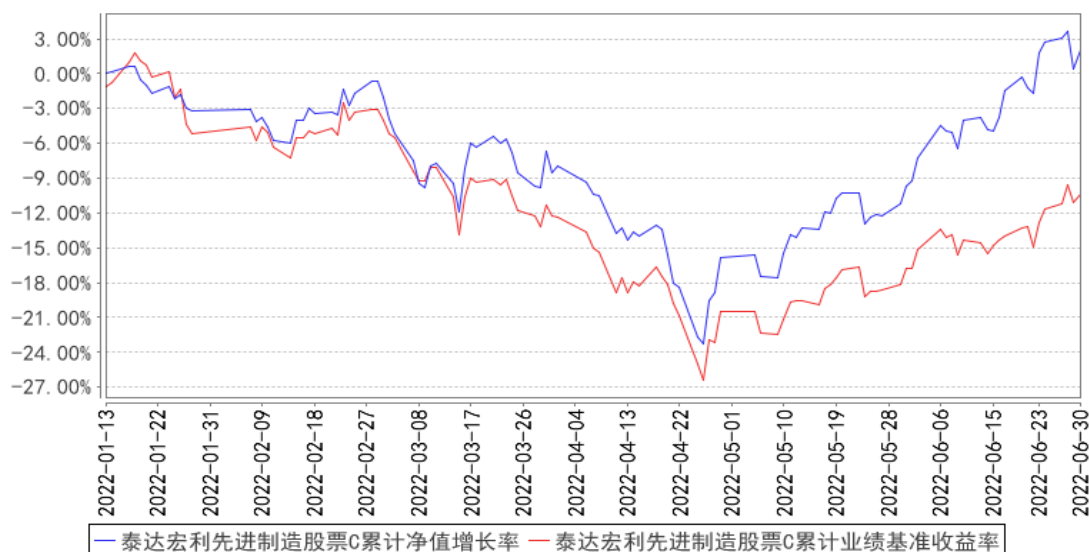
中证智能制造主题指数从沪深 A 股中选取为智能制造提供关键技术装备和核心支撑软件，以及应用智能制造进行生产的上市公司股票作为样本股，以反映智能制造主题上市公司 A 股股票的整体表现，适合作为本基金 A 股投资部分的业绩基准。中证港股通综合指数由中证指数有限公司编制，反映了港股通范围内上市公司的整体状况和走势，具有良好的市场代表性，适合作为本基金港股投资部分的业绩基准。中证综合债券指数由中证指数有限公司编制，指数样本券由交易所和银行间市场上市的、剩余期限为 1 个月以上、信用评级为投资级以上的利率债和信用债构成，能较好地反映债券市场的走势，适合作为本基金债券投资的业绩比较基准。本基金管理人认为，以中证智能制造主题指数收益率 $\times 75\%$ +中证港股通综合指数（人民币）收益率 $\times 10\%$ +中证综合债券指数收益率 $\times 15\%$ 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

泰达宏利先进制造股票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



泰达宏利先进制造股票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：本基金成立于 2022 年 1 月 13 日，截止报告期末本基金仍在建仓期。

§ 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		
张勋	研究部总监；基金经理	2022 年 1 月 13 日	-	16 年	对外经济贸易大学管理学硕士；2006 年 7 月至 2009 年 6 月就职于天相投资顾问有限公司，担任研究组组长；2009 年 7 月至 2010 年 4 月就职于东兴证券股份有限公司，担任研究组组长；2010 年 4 月加入泰达宏利基金管理有限公司，曾担任研究员、高级

					研究员，研究部副总监等，现任研究部总监兼任基金经理；具备 16 年证券从业经验，16 年证券投资管理经验，具有基金从业资格。
张岩	本基金基金经理	2022 年 4 月 27 日	-	10 年	北京大学金融学硕士研究生；2011 年 7 月至 2015 年 4 月任职于中国中投证券有限责任公司，担任研究总部研究员，自 2015 年 5 月起任职于泰达宏利基金管理有限公司，先后担任研究部研究员、投资经理、高级研究员，现任基金经理。具备 10 年证券从业经验，具有基金从业资格。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人建立了公平交易制度和流程，并严格执行制度的规定。在投资管理活动中，本基金管理人公平对待不同投资组合，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和投资决策方面享有平等机会；严格执行投资管理职能和交易执行职能的隔离；在交易环节实行集中交易制度，并确保公平交易可操作、可评估、可稽核、可持续；交易部运用交易系统中设置的公平交易功能并按照时间优先、价格优先的原则严格执行所有指令；对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，交易部按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配，确保各投资组合享有公平的投资机会。风险管理部事后对本报告期的公平交易执行情况进行数量统计、分析。在本报告期内，未发现利益输送、不公平对待不同投资组合的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金管理人建立了异常交易的监控与报告制度，对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控，风险管理部定期对各投资组合的交易行为进行分析评估，向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

22 年上半年，宏观和市场的波动再次超出了政策决策者和市场投资者的预期，黑天鹅和灰犀牛事件持续发生，导致全球金融、经济震荡。国际方面，俄乌战争给全球经济、通胀乃至政治格局带来非常大的不确定性，高能源价格和供应链的扰动使得西方主要经济体通胀达到了四十年来的高度，美联储大幅度高频加息，其他主要经济体迅速进入货币收缩，全球经济体从年初的经济恢复预期迅速向衰退预期转变，除能源以外的大宗品经历了快速上涨、快速下跌的波动。国内方面，疫情反复扰动，3、4 月份整个经济大幅度收缩，5 月份复工复产后，虽然政策（货币、财政等）持续发力，带来了恢复，但由于疫情的持续存在、就业的影响、部分行业本身积累的历史问题（如地产）等，不同行业表现差异较大，增量经济部分恢复较好，消费服务、房地产等行业恢复较慢。

市场表现来看，总体来说，在中国疫情恢复前，海外经济复苏预期强于衰弱预期，市场整体表现不佳，稳增长相关领域表现较好；4 月底复工复产和美联储加速加息应对通胀以来，国内开始恢复，海外陷入走弱预期，A 股表现好于海外，尤其是基本面恢复较快的增量经济表现较好。

上半年为本产品的建仓周期，俄乌战争黑天鹅事件的发生，让市场整体受挫，本产品亦受到一定的损失，但也给了我们在更好位置拣筹码的机会；2 季度我们根据行业景气度、公司基本面等积极布局，净值有所好转。长期看，制造业是中国立国之本，先进制造的领域是其中最前景的方向，本产品投资相关领域，会尽力给投资人取得可观的回报。

操作层面，二季度，本基金仓位基本都配置在新能源及其产业链，分别布局在新能源汽车、光伏、风电、储能等多个环节及其上中下游。方向上优选：1）瓶颈环节；2）技术进步环节；3）卡位好的环节；4）边际变化环节。关注核心竞争力、成长性、公司治理、潜在空间和性价比。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末泰达宏利先进制造股票 A 的基金份额净值为 1.0214 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.14%，截至本报告期末泰达宏利先进制造股票 C 的基金份额净值为 1.0200 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.00%，同期业绩比较基准收益率为-10.41%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们对市场：长期战略乐观，中期相对谨慎，逐步关注基本面因素风险。长期看，中国崛起的进程很难被打破，即使有扰动，趋势很难改变；中短期看，面临海外应对高通胀加息对经济的伤害、可能的对国内的输入性通胀、俄乌冲突引发的一系列地缘政治问题以及全球政治周期等，这些因素会逐步影响海外经济基本面；但国内疫情后的恢复将能够持续，宽松的环

境（货币政策、财政政策）将继续为经济修复助力。国内相对海外的比较优势在可见的未来将继续。在这一过程中，我们将重点关注：1）增量经济（新能源、半导体、军工、先进制造等）；2）欧美经济走弱导致大宗商品价格下跌，缓解中游成本压力；3）海外经济走弱可能带来的全球新一轮资产荒；4）通胀升温受益品种；5）稳增长产业链。

结合本基金契约，我们继续围绕制造业投资，方向为：1）增量经济领域；2）高质量发展领域。

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

在托管泰达宏利先进制造股票型证券投资基金的过程中，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《泰达宏利先进制造股票型证券投资基金基金合同》、《泰达宏利先进制造股票型证券投资基金托管协议》的约定，对泰达宏利先进

制造股票型证券投资基金管理人—泰达宏利基金管理有限公司 2022 年 1 月 13 日（基金合同生效日）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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，泰达宏利基金管理有限公司的信息披露事务符合《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泰达宏利先进制造股票型证券投资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，未发现有关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：泰达宏利先进制造股票型证券投资基金

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
资 产：		
银行存款	6.4.7.1	30,375,856.41
结算备付金		1,103,428.83
存出保证金		197,892.48
交易性金融资产	6.4.7.2	406,849,353.46
其中：股票投资		406,849,353.46
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		-
应收股利		-
应收申购款		517,710.33
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.8	-
资产总计		439,044,241.51
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 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		2,230,526.09
应付赎回款		2,991,067.78
应付管理人报酬		565,608.90
应付托管费		94,268.15
应付销售服务费		3,028.78
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	1,001,825.04
负债合计		6,886,324.74
净资产:		
实收基金	6.4.7.10	423,117,543.45
其他综合收益	6.4.7.11	-
未分配利润	6.4.7.12	9,040,373.32
净资产合计		432,157,916.77
负债和净资产总计		439,044,241.51

注：1、报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额总额 423,117,543.45 份，其中泰达宏利先进制造股票 A 基金份额总额 410,784,050.41 份，基金份额净值 1.0214 元；泰达宏利先进制造股票 C 基金份额总额 12,333,493.04 份，基金份额净值 1.0200 元。

2、本财务报表的实际编制期间为 2022 年 01 月 13 日（基金合同生效日）至 2022 年 06 月 30 日。

6.2 利润表

会计主体：泰达宏利先进制造股票型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 13 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2022 年 1 月 13 日（基金合同 生效日）至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		8,720,800.96
1. 利息收入		588,706.77
其中：存款利息收入	6.4.7.13	363,410.40
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		225,296.37
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-38,076,784.99
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-39,307,555.52
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	-
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	1,230,770.53
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	45,977,614.08
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	231,265.10
减：二、营业总支出		3,846,480.88
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,195,381.86
2. 托管费	6.4.10.2.2	532,563.65
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	18,179.91
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	100,355.46
三、利润总额（亏损总额以“-”号 填列）		4,874,320.08
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,874,320.08
五、其他综合收益的税后净额		-

六、综合收益总额		4,874,320.08
----------	--	--------------

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：泰达宏利先进制造股票型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 13 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 13 日（基金合同生效日）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)	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期初净资产(基金净值)	513,685,960.06	-	-	513,685,960.06
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-90,568,416.61	-	9,040,373.32	-81,528,043.29
(一)、综合收益总额	-	-	4,874,320.08	4,874,320.08
(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）	-90,568,416.61	-	4,166,053.24	-86,402,363.37

其中:1. 基金申购款	6,392,578.14	-	-372,452.68	6,020,125.46
2. 基金赎回款	-96,960,994.75	-	4,538,505.92	-92,422,488.83
(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 期末净资 产(基金 净值)	423,117,543.45	-	9,040,373.32	432,157,916.77

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

泰达宏利先进制造股票型证券投资基金(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[2021]3332 号《关于准予泰达宏利先进制造股票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《泰达宏利先进制造股票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 513,470,281.20 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(2022)第 0051 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰达宏利先进制造股票型证券投资基金基金合同》于 2022 年 1 月 13 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 513,685,960.06 份基金份额,其中认购资金利息折合 215,678.86 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《泰达宏利先进制造股票型证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用的基金份额,称为 A 类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额,称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利先进制造股票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(包括创业板及其他经中国证监会允许发行上市的股票、存托凭证)、港股通标的股票、债券(包括国债、地方政府债、政府支持债券、政府支持机构债券、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券(含分离交易可转债的纯债部分)、可交换债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据)、债券回购、资产支持证券、货币市场工具、银行存款(包括定期存款、协议存款、通知存款等)、同业存单、股指期货、国债期货、股票期权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)。本基金股票资产占基金资产的比例为 80%-95%,其中,投资于港股通标的股票比例占股票投资比例的 0-50%,本基金界定的先进制造相关的股票的比例不低于非现金基金资产的 80%;本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约、股票期权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,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;股指期货、国债期货、股票期权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中证智能制造主题指数收益率 $\times$ 75%+中证港股通综合指数(人民币)收益率 $\times$ 10%+中证综合债券指数收益率 $\times$ 15%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告《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>》、

中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰达宏利先进制造股票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 1 月 13 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日止期间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 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 13 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2022 年 1 月 13 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。

本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资、资产支持证券投资 and 基金投资。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；

对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失

准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投

资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固

定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期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	30,375,856.41
等于：本金	30,370,663.43
加：应计利息	5,192.98
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	30,375,856.41

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	360,871,739.38	—	406,849,353.46	45,977,614.08
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	360,871,739.38	-	406,849,353.46	45,977,614.08

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

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

本基金本报告期末未持有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。

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	7,079.59
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	908,570.66
其中：交易所市场	908,570.66
银行间市场	—
应付利息	—
预提费用	86,174.79
合计	1,001,825.04

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

泰达宏利先进制造股票 A

项目	本期 2022 年 1 月 13 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	498,353,232.83	498,353,232.83
本期申购	5,126,498.37	5,126,498.37
本期赎回（以“-”号填列）	-92,695,680.79	-92,695,680.79
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	410,784,050.41	410,784,050.41

泰达宏利先进制造股票 C

项目	本期 2022 年 1 月 13 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	15,332,727.23	15,332,727.23
本期申购	1,266,079.77	1,266,079.77
本期赎回（以“-”号填列）	-4,265,313.96	-4,265,313.96
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	12,333,493.04	12,333,493.04

注：1. 若本基金有分红及转换业务，申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

2. 本基金自 2021 年 12 月 27 日至 2022 年 1 月 10 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 513,470,281.20 元，折合为 513,470,281.20 份基金份额（其中 A 类基金份额 498,142,402.69 份，C 类基金份额 15,327,878.51 份）。根据《泰达宏利先进制造股票型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币 215,678.86 元在本基金成立后，折合为 215,678.86 份基金份额（其中 A 类基金份额 210,830.14 份，C 类基金份额 4,848.72 份），划入基金份额持有人账户。

3. 根据《泰达宏利先进制造股票型证券投资基金基金合同》、《泰达宏利先进制造股票型证券投资基金招募说明书》及《泰达宏利先进制造股票型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务公告》的相关规定，本基金于 2022 年 1 月 13 日（基金合同生效日）至 2022 年 4 月 12 日止期间暂不向投资人开放基金交易。申购、赎回、转换及定期定额投资业务自 2022 年 4 月 13 日起开始办理。

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

泰达宏利先进制造股票 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-39,899,136.59	44,977,828.60	5,078,692.01
本期基金份额交易产生的变动数	7,284,422.93	-3,569,375.98	3,715,046.95
其中：基金申购款	-469,834.50	196,426.18	-273,408.32
基金赎回款	7,754,257.43	-3,765,802.16	3,988,455.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-32,614,713.66	41,408,452.62	8,793,738.96

泰达宏利先进制造股票 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-1,204,157.41	999,785.48	-204,371.93
本期基金份额交易产生的变动数	209,647.54	241,358.75	451,006.29
其中：基金申购款	-116,384.86	17,340.50	-99,044.36
基金赎回款	326,032.40	224,018.25	550,050.65

本期已分配利润	-	-	-
本期末	-994,509.87	1,241,144.23	246,634.36

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 13 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	348,027.31
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	14,535.54
其他	847.55
合计	363,410.40

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13日（基金合同生效日）至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-39,307,555.52
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	-39,307,555.52

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 13 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	767,884,251.68
减：卖出股票成本总额	804,454,625.02
减：交易费用	2,737,182.18
买卖股票差价收入	-39,307,555.52

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

本基金本报告期末有债券投资收益。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期末有债券投资收益-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

本基金本报告期内无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

本基金本报告期内无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

本基金本报告期内无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

本基金本报告期内未有贵金属投资收益。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内未有贵金属投资收益-买卖差价收入。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内未有贵金属投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内未有贵金属投资收益-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

本基金本报告期内未有衍生工具收益-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

本基金本报告期内未有衍生工具收益-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 13 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,230,770.53
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	1,230,770.53

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 13 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	45,977,614.08
股票投资	45,977,614.08
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	45,977,614.08

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 13 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	230,597.72
基金转换费收入	667.38
合计	231,265.10

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 13 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
----	---

审计费用	28,724.93
信息披露费	57,449.86
证券出借违约金	-
银行费用	13,780.67
其他	400.00
合计	100,355.46

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

本基金本报告期无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

本基金本报告期末通过关联交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期末通过关联交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期末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

本基金本报告期末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 13 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,195,381.86
其中：支付销售机构的客户维护费	1,459,815.84

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 X 1.50% / 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 13 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	532,563.65

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 0.25%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×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 13 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泰达宏利先进制造股票 A	泰达宏利先进制造股票 C	合计
泰达宏利基金管理有限公司	—	152.64	152.64
中国农业银行股份有限公司	—	3,314.03	3,314.03
合计	—	3,466.67	3,466.67

注：支付基金销售机构的销售服务费按 C 类基金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 类基金基金份额销售服务费=C 类基金基金份额前一日基金资产净值 X 0.30%/ 当年天数。3466.67

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

本基金本报告期内无与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）的交易。

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 13 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	30,375,856.41	348,027.31

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

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末进行利润分配。

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
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	417	16,629.96	12,964.53	-
301109	军信股份	2022 年 4 月 6 日	6 个月	新股流通受限	34.81	16.14	819	19,006.26	13,218.66	-
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	-
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	-
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	5,369	206,491.74	206,491.74	-
301148	嘉戎技术	2022 年 4 月 14 日	6 个月	新股流通受限	38.39	23.90	509	19,540.51	12,165.10	-
301162	国能日新	2022 年 4 月 19 日	6 个月	新股流通受限	45.13	54.11	311	14,035.43	16,828.21	-
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	55,679	212,693.78	212,693.78	-
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	378	13,487.04	11,279.52	-

		日								
301219	腾远 钴业	2022 年 3 月 10 日	6 个月	新股流 通受限	173.98	87.82	151	14,614.32	13,260.82	-
301222	浙江 恒威	2022 年 3 月 2 日	6 个月	新股流 通受限	33.98	28.96	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	-
301236	软通 动力	2022 年 3 月 8 日	6 个月	新股流 通受限	72.88	31.38	508	24,706.32	15,941.04	-
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	-
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	265	12,799.50	11,045.20	-
301268	铭利 达	2022 年 3 月 29 日	6 个月	新股流 通受限	28.50	34.87	614	17,499.00	21,410.18	-
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	-
688048	长光 华芯	2022 年 3 月 25 日	6 个月	新股流 通受限	80.80	111.97	2,598	209,918.40	290,898.06	-
688279	峰岬 科技	2022 年 4 月 13 日	6 个月	新股流 通受限	82.00	67.34	3,487	285,934.00	234,814.58	-

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

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

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

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了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人中国农业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于 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。

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期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

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

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率

敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

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	30,375,856.41	-	-	-	30,375,856.41
结算备付金	1,103,428.83	-	-	-	1,103,428.83
存出保证金	197,892.48	-	-	-	197,892.48
交易性金融资产	-	-	-	406,849,353.46	406,849,353.46
应收申购款	9,985.22	-	-	507,725.11	517,710.33
资产总计	31,687,162.94	-	-	407,357,078.57	439,044,241.51
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,991,067.78	2,991,067.78
应付管理人报酬	-	-	-	565,608.90	565,608.90
应付托管费	-	-	-	94,268.15	94,268.15
应付清算款	-	-	-	2,230,526.09	2,230,526.09
应付销售服务费	-	-	-	3,028.78	3,028.78
其他负债	-	-	-	1,001,825.04	1,001,825.04
负债总计	-	-	-	6,886,324.74	6,886,324.74
利率敏感度缺口	31,687,162.94	-	-	400,470,753.83	432,157,916.77

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，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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。

股票资产占基金资产的比例为 80%-95%，其中，投资于港股通标的股票比例占股票投资比例的 0-50%，本基金界定的先进制造相关的股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约、股票期权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	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	406,849,353.46	94.14
交易性金融资产—基金投资	—	—
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	406,849,353.46	94.14

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2022 年 6 月 30 日，本基金运作期不足一年，无足够经验数据。

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
第一层次	405,549,509.52
第二层次	484,621.04
第三层次	815,222.90
合计	406,849,353.46

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换事项发生的当年年初为确认各层次之间的转换时点。对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票、债券和基金的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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	406,849,353.46	92.67
	其中：股票	406,849,353.46	92.67
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	31,479,285.24	7.17
8	其他各项资产	715,602.81	0.16
9	合计	439,044,241.51	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	10,524,122.00	2.44
B	采矿业	9,550,244.60	2.21
C	制造业	352,631,592.11	81.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	2,030,644.00	0.47
F	批发和零售业	1,901,685.00	0.44
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,698,857.91	2.48
J	金融业	7,687,196.00	1.78
K	房地产业	11,542,745.00	2.67
L	租赁和商务服务业	12,964.53	0.00
M	科学研究和技术服务业	30,307.77	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	238,994.54	0.06
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—

Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	406,849,353.46	94.14

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	600522	中天科技	797,900	18,431,490.00	4.26
2	002371	北方华创	64,100	17,763,392.00	4.11
3	300750	宁德时代	31,200	16,660,800.00	3.86
4	603799	华友钴业	162,710	15,558,330.20	3.60
5	601012	隆基绿能	219,020	14,593,302.60	3.38
6	300568	星源材质	489,211	14,206,687.44	3.29
7	002049	紫光国微	74,300	14,096,196.00	3.26
8	002594	比亚迪	40,397	13,471,995.53	3.12
9	000998	隆平高科	631,700	10,524,122.00	2.44
10	600048	保利发展	600,100	10,477,746.00	2.42
11	300627	华测导航	302,940	10,418,106.60	2.41
12	002100	天康生物	988,900	9,612,108.00	2.22
13	002245	蔚蓝锂芯	410,000	9,516,100.00	2.20
14	603920	世运电路	549,700	9,509,810.00	2.20
15	002385	大北农	1,103,800	8,620,678.00	1.99
16	600399	抚顺特钢	428,300	7,666,570.00	1.77
17	300953	震裕科技	54,300	7,438,557.00	1.72
18	002812	恩捷股份	29,100	7,288,095.00	1.69
19	002192	融捷股份	44,758	6,879,304.60	1.59
20	688122	西部超导	72,386	6,673,989.20	1.54
21	300737	科顺股份	443,500	5,845,330.00	1.35
22	300059	东方财富	226,900	5,763,260.00	1.33
23	300447	全信股份	276,800	5,638,416.00	1.30
24	000301	东方盛虹	326,400	5,519,424.00	1.28
25	002179	中航光电	83,880	5,311,281.60	1.23
26	002405	四维图新	346,200	5,217,234.00	1.21
27	688048	长光华芯	41,618	5,038,851.66	1.17
28	688318	财富趋势	49,854	4,985,400.00	1.15
29	002472	双环传动	151,500	4,823,760.00	1.12
30	688326	经纬恒润	31,726	4,665,625.56	1.08
31	688559	海目星	63,126	4,589,260.20	1.06

32	688518	联赢激光	125,905	4,279,510.95	0.99
33	002850	科达利	26,400	4,197,600.00	0.97
34	688167	炬光科技	25,275	3,759,656.25	0.87
35	300850	新强联	41,020	3,652,010.60	0.85
36	688599	天合光能	55,114	3,596,188.50	0.83
37	603290	斯达半导	8,600	3,318,740.00	0.77
38	688063	派能科技	10,624	3,316,812.80	0.77
39	300316	晶盛机电	48,200	3,257,838.00	0.75
40	603833	欧派家居	21,400	3,224,552.00	0.75
41	002984	森麒麟	102,800	3,198,108.00	0.74
42	688776	国光电气	18,324	3,114,896.76	0.72
43	002466	天齐锂业	24,300	3,032,640.00	0.70
44	605117	德业股份	10,260	2,871,671.40	0.66
45	688598	金博股份	9,381	2,764,580.70	0.64
46	688516	奥特维	10,254	2,737,305.30	0.63
47	002271	东方雨虹	52,800	2,717,616.00	0.63
48	002459	晶澳科技	33,740	2,662,086.00	0.62
49	300450	先导智能	39,700	2,508,246.00	0.58
50	603051	鹿山新材	30,000	2,370,000.00	0.55
51	600438	通威股份	39,200	2,346,512.00	0.54
52	603606	东方电缆	30,000	2,298,000.00	0.53
53	300286	安科瑞	82,300	2,234,445.00	0.52
54	600460	士兰微	41,900	2,178,800.00	0.50
55	688665	四方光电	14,479	2,142,892.00	0.50
56	605123	派克新材	14,500	2,040,440.00	0.47
57	601668	中国建筑	381,700	2,030,644.00	0.47
58	603876	XD 鼎胜新	44,600	2,015,920.00	0.47
59	603816	顾家家居	35,360	2,002,436.80	0.46
60	688195	腾景科技	71,321	1,977,018.12	0.46
61	601456	国联证券	156,800	1,923,936.00	0.45
62	688499	利元亨	8,676	1,919,998.80	0.44
63	600153	建发股份	145,500	1,901,685.00	0.44
64	601238	广汽集团	119,500	1,821,180.00	0.42
65	002074	国轩高科	38,700	1,764,720.00	0.41
66	688032	禾迈股份	1,935	1,685,385.00	0.39
67	688711	宏微科技	21,930	1,673,259.00	0.39
68	300811	铂科新材	16,900	1,644,708.00	0.38
69	603005	晶方科技	56,400	1,601,196.00	0.37
70	600563	法拉电子	7,800	1,600,248.00	0.37
71	600188	兖矿能源	39,800	1,571,304.00	0.36
72	002756	永兴材料	10,300	1,567,763.00	0.36
73	002240	盛新锂能	24,800	1,496,928.00	0.35

74	603260	合盛硅业	12,000	1,415,520.00	0.33
75	603688	石英股份	10,500	1,392,405.00	0.32
76	688349	三一重能	30,210	1,231,057.50	0.28
77	002006	精功科技	37,100	1,102,983.00	0.26
78	002824	和胜股份	19,800	1,088,802.00	0.25
79	001979	招商蛇口	79,300	1,064,999.00	0.25
80	688707	振华新材	13,496	1,021,242.32	0.24
81	603019	中科曙光	34,500	1,001,190.00	0.23
82	605399	晨光新材	21,710	923,760.50	0.21
83	603505	金石资源	17,600	720,016.00	0.17
84	002484	江海股份	30,800	718,872.00	0.17
85	603305	旭升股份	20,900	631,598.00	0.15
86	601689	拓普集团	8,500	581,655.00	0.13
87	603115	海星股份	19,900	488,943.00	0.11
88	300709	精研科技	15,700	464,563.00	0.11
89	688800	瑞可达	3,456	436,527.36	0.10
90	601088	中国神华	11,400	379,620.00	0.09
91	688233	神工股份	5,355	300,951.00	0.07
92	688279	峰昭科技	3,487	234,814.58	0.05
93	301175	中科环保	55,679	212,693.78	0.05
94	301139	元道通信	5,369	206,491.74	0.05
95	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.02
96	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.01
97	301215	中汽股份	4,743	30,307.77	0.01
98	301268	铭利达	614	21,410.18	0.00
99	301256	华融化学	1,831	18,456.48	0.00
100	301162	国能日新	311	16,828.21	0.00
101	301120	新特电气	1,032	15,985.68	0.00
102	301236	软通动力	508	15,941.04	0.00
103	301248	杰创智能	472	14,098.64	0.00
104	301212	联盛化学	416	13,844.48	0.00
105	301219	腾远钴业	151	13,260.82	0.00
106	301109	军信股份	819	13,218.66	0.00
107	301102	兆讯传媒	417	12,964.53	0.00
108	301148	嘉戎技术	509	12,165.10	0.00
109	301097	天益医疗	249	11,909.67	0.00
110	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
111	301216	万凯新材	378	11,279.52	0.00
112	301258	富士莱	265	11,045.20	0.00
113	301237	和顺科技	261	10,925.46	0.00
114	301137	哈焊华通	644	10,297.56	0.00
115	301222	浙江恒威	332	9,614.72	0.00

116	301288	清研环境	452	9,030.96	0.00
117	301135	瑞德智能	338	8,875.88	0.00
118	301110	青木股份	202	8,049.70	0.00
119	600765	中航重机	60	1,930.80	0.00
120	000888	峨眉山 A	100	917.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	000002	万 科 A	29,024,742.60	6.72
2	300568	星源材质	20,032,908.41	4.64
3	002594	比亚迪	19,156,843.00	4.43
4	601012	隆基绿能	18,909,529.72	4.38
5	600522	中天科技	18,534,151.00	4.29
6	600399	抚顺特钢	17,067,070.00	3.95
7	002192	融捷股份	16,769,662.12	3.88
8	002371	北方华创	16,766,034.18	3.88
9	002049	紫光国微	15,585,476.00	3.61
10	603799	华友钴业	15,404,362.00	3.56
11	300750	宁德时代	14,034,447.00	3.25
12	002385	大北农	13,777,008.00	3.19
13	300059	东方财富	13,446,871.00	3.11
14	002384	东山精密	13,120,716.24	3.04
15	300760	迈瑞医疗	12,903,257.00	2.99
16	002245	蔚蓝锂芯	12,236,177.00	2.83
17	688408	中信博	12,042,528.83	2.79
18	601668	中国建筑	11,973,984.00	2.77
19	000661	长春高新	11,841,942.76	2.74
20	688599	天合光能	11,287,045.44	2.61
21	300014	亿纬锂能	11,223,511.00	2.60
22	001979	招商蛇口	11,213,439.80	2.59
23	000998	隆平高科	11,144,127.00	2.58
24	300726	宏达电子	11,030,513.00	2.55
25	688518	联赢激光	10,729,802.66	2.48
26	002405	四维图新	10,586,340.66	2.45
27	688667	菱电电控	10,582,748.81	2.45
28	000725	京东方 A	10,273,506.00	2.38
29	600110	诺德股份	9,941,387.00	2.30
30	600765	中航重机	9,909,739.00	2.29
31	688111	金山办公	9,762,975.49	2.26
32	300745	欣锐科技	9,591,950.00	2.22

33	603920	世运电路	9,510,674.00	2.20
34	600048	保利发展	9,461,747.00	2.19
35	002100	天康生物	9,450,646.81	2.19
36	002409	雅克科技	9,367,293.00	2.17
37	300737	科顺股份	9,109,268.60	2.11
38	600038	中直股份	9,092,046.00	2.10
39	002714	牧原股份	8,779,490.83	2.03

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

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	000002	万 科 A	25,170,317.00	5.82
2	002192	融捷股份	16,671,327.00	3.86
3	000661	长春高新	14,089,508.60	3.26
4	300760	迈瑞医疗	12,420,766.00	2.87
5	688408	中信博	11,214,242.63	2.59
6	300726	宏达电子	10,975,091.36	2.54
7	002384	东山精密	10,542,895.09	2.44
8	300014	亿纬锂能	10,063,038.00	2.33
9	002594	比亚迪	9,429,920.00	2.18
10	601668	中国建筑	9,272,890.00	2.15
11	688116	天奈科技	9,215,560.34	2.13
12	300745	欣锐科技	9,015,568.00	2.09
13	600399	抚顺特钢	9,011,959.49	2.09
14	001979	招商蛇口	9,007,202.00	2.08
15	300769	德方纳米	8,794,061.00	2.03
16	000725	京东方 A	8,740,601.00	2.02
17	688599	天合光能	8,614,934.48	1.99
18	600110	诺德股份	8,561,581.00	1.98
19	002409	雅克科技	8,340,947.00	1.93
20	600765	中航重机	8,325,569.00	1.93

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,165,326,364.40
卖出股票收入（成交）总额	767,884,251.68

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

本基金根据风险管理的原则, 以套期保值为目的, 运用国债期货对投资组合进行管理, 提高投资效率。本基金主要采用流动性好、交易活跃的国债期货合约, 通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

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, 比亚迪股份有限公司于 2022 年 5 月 6 日曾受到深圳市公安局大鹏分局消防监督管理大队公开处罚。

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	197,892.48
2	应收清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	517,710.33
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	715,602.81

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（%）
泰达宏利先进制造股票 A	8,015	51,251.91	14,072,806.33	3.43	396,711,244.08	96.57
泰达宏利	1,238	9,962.43	—	—	12,333,493.04	100.00

先进制造股票 C						
合计	9,253	45,727.61	14,072,806.33	3.33	409,044,737.12	96.67

注：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）。

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	泰达宏利先进制造股票 A	455,936.56	0.1110
	泰达宏利先进制造股票 C	75,717.20	0.6139
	合计	531,653.76	0.1257

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	泰达宏利先进制造股票 A	10~50
	泰达宏利先进制造股票 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	泰达宏利先进制造股票 A	10~50
	泰达宏利先进制造股票 C	0
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	泰达宏利先进制造股票 A	泰达宏利先进制造股票 C
基金合同生效日 （2022 年 1 月 13 日） 基金份额总额	498,353,232.83	15,332,727.23
基金合同生效日起至 报告期期末基金总申 购份额	5,126,498.37	1,266,079.77
减：基金合同生效日 起至报告期期末基金 总赎回份额	92,695,680.79	4,265,313.96
基金合同生效日起至	—	—

报告期期末基金拆分 变动份额		
本报告期期末基金份 额总额	410,784,050.41	12,333,493.04

§ 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

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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	------	------	-----------	----

	数量	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 (%)	
海通证券	1	495,620,961.92	25.72	461,571.30	25.72	-
兴业证券	1	368,652,126.92	19.13	343,326.10	19.13	-
首创证券	1	237,165,199.06	12.31	220,871.48	12.31	-
长江证券	1	218,851,307.81	11.36	203,814.90	11.36	-
中泰证券	1	218,459,281.83	11.34	203,452.06	11.34	-
中信建投	1	195,772,797.94	10.16	182,322.81	10.16	-
申万宏源	1	122,559,328.85	6.36	114,139.83	6.36	-
招商证券	1	70,146,863.64	3.64	65,328.09	3.64	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
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）本基金本报告期交易单元均为新增。

（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 (%)

海通证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	370,100,000.00	74.01	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	30,000,000.00	6.00	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	50,000,000.00	10.00	-	-
申万宏源	-	-	50,000,000.00	10.00	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
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