泰达宏利市值优选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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 08 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 01 月 01 日起至 2022 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
§2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 5
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6
§3 主要财务指标和基金净值表现 6
3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 6
§4 管理人报告 8
4.1 基金管理人及基金经理情况 8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 11
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的真实、准确和完整发表意见 13
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 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 42
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 45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 46
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 47

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 47
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 47
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 47
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 47
7.12 投资组合报告附注 47

§8 基金份额持有人信息 48

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 48

§9 开放式基金份额变动 49

§10 重大事件揭示 49

10.1 基金份额持有人大会决议 49
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 49
10.4 基金投资策略的改变 49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 49
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 49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 50

§11 备查文件目录 52

11.1 备查文件目录 52
11.2 存放地点 53
11.3 查阅方式 53

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泰达宏利市值优选混合型证券投资基金
基金简称	泰达宏利市值优选混合
基金主代码	162209
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007 年 8 月 3 日
基金管理人	泰达宏利基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	570,989,905.79 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金兼顾大盘股和中小盘股，把握不同市值的股票在不同市场环境下的投资机会，投资于其中的优质股票，力争获取基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金将使用成功运用的 MVPS 模型来进行资产配置调整。MVPS 模型主要考虑 M（宏观经济环境）、V（价值）、P（政策）、S（市场气氛）四方面因素。MVPS 模型作为本基金管理人持续一致的资产配置工具，通过定量和定性分析的有效结合判断未来市场的发展趋势，为本基金的资产配置提供支持。 本基金股票资产比例最高可以达到 95%，最低保持在 60%以上，债券资产比例最高可以达到 35%，最低为 0%，并保持现金及到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，以保持基金资产流动性的要求。
业绩比较基准	75%×沪深 300 指数收益率+25%×上证国债指数收益率。
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于高风险、高收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	徐娇娇	李申
	联系电话	66577766	021-60637102
	电子邮箱	irm@mfcteda.com	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		400-698-8888	021-60637111
传真		010-66577666	021-60635778
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	北京市西城区金融大街 25 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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		100026	100033

法定代表人	傅国庆	田国立

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	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	泰达宏利基金管理有限公司	北京市朝阳区针织路 23 号楼中国人寿金融中心 6 层 02-07 单元

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022 年 1 月 1 日-2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-110,721,256.28
本期利润	-165,083,381.96
加权平均基金份额本期利润	-0.2861
本期加权平均净值利润率	-23.43%
本期基金份额净值增长率	-19.37%
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	103,225,094.97
期末可供分配基金份额利润	0.1808
期末基金资产净值	674,215,000.76
期末基金份额净值	1.1808
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	18.08%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

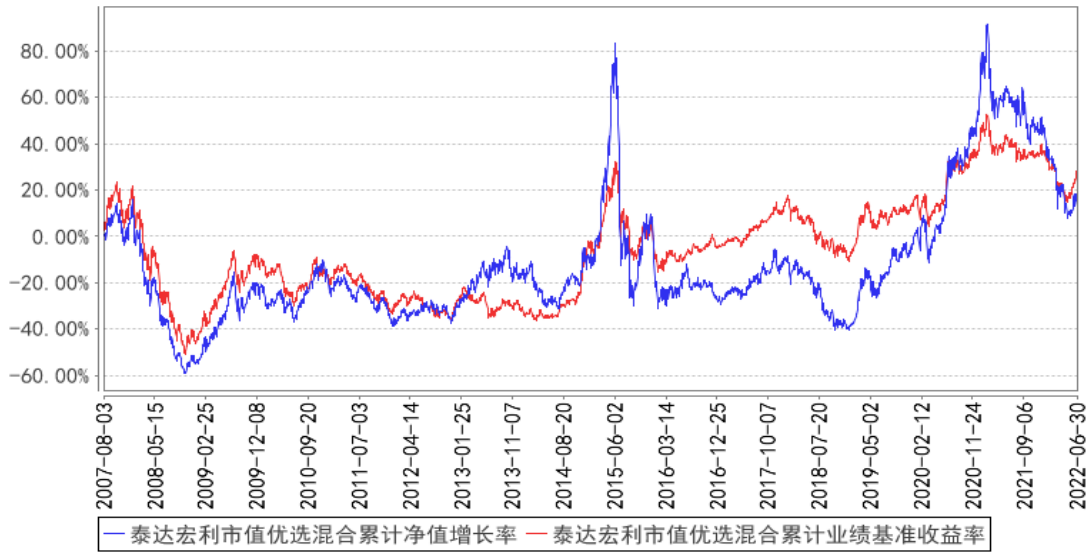
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④

过去一个月	5.92%	1.47%	7.21%	0.80%	-1.29%	0.67%
过去三个月	-1.26%	1.43%	5.03%	1.08%	-6.29%	0.35%
过去六个月	-19.37%	1.50%	-6.31%	1.09%	-13.06%	0.41%
过去一年	-25.95%	1.62%	-9.48%	0.94%	-16.47%	0.68%
过去三年	47.07%	1.56%	17.41%	0.95%	29.66%	0.61%
自基金合同生效起至今	18.08%	1.74%	28.04%	1.24%	-9.96%	0.50%

注：本基金的业绩比较基准：75%×沪深 300 指数收益率+25%×上证国债指数收益率。沪深 300 指数是由上海和深圳证券市场中选取 300 只 A 股作为样本编制而成的成份股指数，该指数的指数样本覆盖了沪深两地市场八成左右的市值，具有良好的市场代表性。上证国债指数是以上海证券交易所上市的所有固定利率国债为样本，按照国债发行量加权而成，具有良好的市场代表性。

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

泰达宏利市值优选混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

泰达宏利基金管理有限公司原名湘财合丰基金管理有限公司、湘财荷银基金管理有限公司、泰达荷银基金管理有限公司，成立于 2002 年 6 月，是中国首批合资基金管理公司之一。截至目前，公司管理着包括泰达宏利价值优化型系列基金、泰达宏利行业精选混合型证券投资基金、泰达宏利风险预算混合型证券投资基金、泰达宏利货币市场基金、泰达宏利效率优选混合型证券投资基金（LOF）、泰达宏利首选企业股票型证券投资基金、泰达宏利市值优选混合型证券投资基金、泰达宏利集利债券型证券投资基金、泰达宏利品质生活灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利红利先锋混合型证券投资基金、泰达宏利沪深 300 指数增强型证券投资基金、泰达宏利领先中小盘混合型证券投资基金、泰达宏利聚利债券型证券投资基金（LOF）、泰达宏利中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF)、泰达宏利逆向策略混合型证券投资基金、泰达宏利宏达混合型证券投资基金、泰达宏利淘利债券型证券投资基金、泰达宏利转型机遇股票型证券投资基金、泰达宏利改革动力量化策略灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利创盈灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利复兴伟业灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利新起点灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利蓝筹价值混合型证券投资基金、泰达宏利新思路灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利创益灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利活期友货币市场基金、泰达宏利汇利债券型证券投资基金、泰达宏利量化增强股票型证券投资基金、泰达宏利睿智稳健灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利京元宝货币市场基金、泰达宏利纯利债券型证券投资基金、泰达宏利溢利债券型证券投资基金、泰达宏利恒利债券型证券投资基金、泰达宏利全能优选混合型基金中基金（FOF）、泰达宏利交利 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、泰达宏利金利 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、泰达宏利绩优增长灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利泽利 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、泰达宏利泰和平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、泰达宏利印度机会股票型证券投资基金（QDII）、泰达宏利永利债券型证券投资基金、泰达宏利消费行业量化精选混合型证券投资基金、泰达宏利中证主要消费红利指数型证券投资基金、泰达宏利养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（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		
庄 腾飞	首席策略分析师；基金经理	2019 年 9 月 29 日	-	12 年	北京大学经济学硕士；2010 年 7 月加入泰达宏利基金管理有限公司，任职于研究部，负责宏观经济、策略研究及金融、地产行业研究，曾先后担任助理研究员、研究员、高级研究员等职务，现任基金经理兼首席策略分析师；具备 12 年基金从业经验，12 年证券投资管理经验，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遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人建立了公平交易制度和流程，并严格执行制度的规定。在投资管理活动中，本基金管理人公平对待不同投资组合，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和投资决策方面享有平等机会；严格执行投资管理职能和交易执行职能的隔离；在交易环节实行集中交易制度，并确保公平交易可操作、可评估、可稽核、可持续；交易部运用交易系统中设置的公平交易功能

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

我们组合是大盘白马价值风格，投资上专注在金融周期价值方向，同时我们也跟踪白马价值股的周期底部反转机会，力争增强组合的长期阿尔法收益。在我们的投资框架中，组合会自上而下分析长端利率周期趋势和宏观环境背景，结合政策周期和行业盈利周期分析，对大金融和大周期板块进行板块内部细分中观行业的比较与个股挖掘。因此，在长端利率上行阶段，我们组合表现会比较好，金融板块和周期板块的基本面更加受益于总需求回升的利率上行期，因此，我们组合体现出一定程度的亲通胀属性。

今年流动性非常宽松，政策态度友好，新兴产业的结构性景气非常明显，包括国内地方政策积极支持和海外需求拉动的新能源、汽车产业链等，股市的结构性行情也很明显。而目前经济基本面的焦点已经逐步从疫情管控放松，转向了地产信用风险未来的解决方案落地。未来国内基本面可能出现高新制造业投资高景气、服务消费复苏和地产投资有限复苏，从而总需求共振回升，与此同时 A 股的企业盈利具备开启向上周期。我们在今年上半年主要做的事情，逐步对处于底部的金融板块中的优质保险股和周期性板块中的优质能源股进行了布局，以应对未来 12 个月国内可能出现的需求回升与长端利率上行的环境。

关于风险控制，目前时点上，我们需要控制的潜在风险，第一，欧美经济在美国快速加息的压力下陷入衰退预期，导致全球的金融市场波动，风险偏好大幅下降，也压低经济总需求，阶段性冲击国内金融股和能源股的表现；第二，国内因为房地产行业销售和投资的快速下滑，导致大家对相关资产和产业的担心，防备出现系统性风险的可能。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.1808 元；本报告期基金份额净值增长率为-19.37%，业绩比较基准收益率为-6.31%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在 A 股市场经历了近 3 年的结构性牛市之后，A 股市场进入了一个相对混沌的阶段，我们在展望未来的时候需要回顾一下历史。回顾过去 10 年的 A 股有明显的龙头板块和投资风格波动，背后的力量是全球货币宽松周期与产业周期的双叠加（即外生的流动性环境和内生的产业发展崛起共同影响），货币宽松过程中则成长风格主导，长端利率上升阶段则价值风格主导。

2012-2015 年是移动互联网时代的投资脉络，成长风格主导，主导行业从苹果手机推动的智能机（电子白马股）再到传媒互联网（互联网金融等），演绎了硬件到软件的过程。

2016-2019 年是消费升级的牛市，价值风格主导，A 股主导产业是消费价值股，以白酒为代表，高端白酒行业从行业低库存、低估值、低增速启动复苏，出现业绩和估值的戴维斯双击（这个阶段港股市场对应的典型投资品种是棚改货币化环境下的下沉市场高成长的地产民企）。

2020-2023 年很有可能是汽车和新能源的时代，同样是复刻了 2012-2015 年中国制造业在硬件过程中的崛起，再到软件大发展的过程，伴随着汽车产业链的重构和中国制造业的走出去。（中国光伏等先进制造业正在完成走出去的过程）。

然而，伴随着国内经济需求的疫后复苏和全球通胀环境因为地缘政治的系统性抬升，我们在 2023 年和 2024 年很可能面临的是国内利率环境进入确定性的上行周期，考虑到价值风格资产在过去 3 年有显著的相对低估和风险出清过程。因此，2024 年开始大概率将开启价值风格的投资时代，而目前什么行业是 2016 年的高端白酒是一个比较关键的课题，这必须是被低估且低预期的行业，内生地出现基本面周期拐点，带来戴维斯双击投资机会。而这也是大型机构投资人未来 3 年的重要投资方向，因为在目前时点上，一个 3 年考核维度的投资框架，汽车和新能源产业链的隐含投资回报率也许并非是最优的，或者说投资难度将逐步抬升。因为，历史经验告诉我们，苹果产业链等电子白马公司自从 2013-2014 年智能手机渗透率到达一定程度后，硬件部分龙头公司开始了估值压缩的过程。

因此，当前时点上，综合全球宏观背景，以 3 年维度长周期视角，我们正在思考的重要方向是金融股和能源股。

国内金融股当前估值折价来源于房地产信用风险和行业监管政策。目前市场正在等待 6-12 个月内地产信用风险解决方案的落地，一旦落地就会带来价值重估。5-10 年的长期维度上，中国的金融行业更大的产业逻辑来自于养老服务市场的发展，在个人养老第三支柱的发展过程中，金

融行业将获得新的成长空间和更加稳定的负债增长能力，在这个领域，保险行业具备天然的多样化养老服务能力。因此，长期维度上看，优质的保险公司是金融行业中具备消费属性的长期成长股，未来大概率将会被市场重新定价。

能源股的投资逻辑框架相对长周期。而俄乌危机彻底改变了地缘格局。过去由于中国和印度加入世贸组织，全球贸易分工资源配置更加有效，发达国家的通胀被长期压低。而现在俄乌危机大概率将较长时间把全球资源大国俄罗斯的原材料逐步排除出当前西方世界的供应链体系。如此资源错配叠加清洁低碳的全球政治取向压制了供应端的产能扩张，将给全球的能源供应价格叠加上更多的成本。因此，我们很有可能看到，一个相对长期的能源价格中枢系统性抬升的周期，而这个周期是超越传统经济需求波动周期的。也许欧美经济体的经济衰退预期的摆动会给投资带来阶段性扰动，但更长时间维度上看，全球各个主要经济体对重要能源和资源品的储备需求将系统性抬升。

因此，考虑到地缘政治带来的能源紧张通胀环境和海外利率上行周期的影响，国内的经济基本面逐步上行也将开启国内利率上行周期，这一定程度可能改变过去三年国内成长风格为主的投资环境。利率上行阶段，有利于金融、能源等白马价值股和传统核心资产的表现，这点值得投资人高度关注。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。报告期内相关基金估值政策由托管银行进行复核。公司估值委员会由主管基金运营的副总经理担任主任，成员包括但不限于督察长、主管投研的副总经理或投资总监、基金投资部、研究部、金融工程部、固定收益部、合规风控部门、基金运营部的主要负责人；委员会秘书由基金运营部负责人担任。所有人员均具有丰富的专业工作经历，具备良好的专业经验和专业胜任能力。

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同及基金实际运作的情况，本基金本报告期内未进行利润分配。

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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支、等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为 。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§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：泰达宏利市值优选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	37,382,482.93	47,341,744.36
结算备付金		640,436.65	2,034,884.72
存出保证金		111,685.75	254,596.84
交易性金融资产	6.4.7.2	640,713,794.94	808,791,477.15
其中：股票投资		633,492,649.44	808,791,477.15
基金投资		-	-
债券投资		7,221,145.50	-
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		630,686.89	3,954,118.25
应收股利		-	-
应收申购款		1,726.65	31,501.13
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	7,349.74
资产总计		679,480,813.81	862,415,672.19
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		3,349,059.24	1,970,909.65
应付赎回款		286,695.91	384,374.77
应付管理人报酬		806,809.80	1,102,539.84
应付托管费		134,468.30	183,756.63
应付销售服务费		-	-
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	688,779.80	1,638,267.36
负债合计		5,265,813.05	5,279,848.25
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	570,989,905.79	585,295,779.23
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	103,225,094.97	271,840,044.71
净资产合计		674,215,000.76	857,135,823.94
负债和净资产总计		679,480,813.81	862,415,672.19

注： 报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.1808 元，基金份额总额 570,989,905.79 份。

6.2 利润表

会计主体：泰达宏利市值优选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		-158,802,061.45	28,317,484.52
1.利息收入		85,233.78	338,801.82
其中：存款利息收入	6.4.7.13	85,233.78	338,801.82
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）		-104,529,981.98	332,284,132.14
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-111,038,506.44	328,564,544.27
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	37,791.23	-
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	6,470,733.23	3,719,587.87
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	-54,362,125.68	-304,344,112.94
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	4,812.43	38,663.50
减：二、营业总支出		6,281,320.51	13,116,546.10
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	5,266,611.81	8,220,560.57
2．托管费	6.4.10.2.2	877,768.66	1,370,093.39
3．销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
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	136,940.04	3,525,892.14
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-165,083,381.96	15,200,938.42
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-165,083,381.96	15,200,938.42
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-165,083,381.96	15,200,938.42

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：泰达宏利市值优选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）	585,295,779.23	-	271,840,044.71	857,135,823.94
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）	585,295,779.23	-	271,840,044.71	857,135,823.94
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-14,305,873.44	-	-168,614,949.74	-182,920,823.18
（一）、综合收	-	-	-165,083,381.96	-165,083,381.96

益总额				
（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）	-14,305,873.44	-	-3,531,567.78	-17,837,441.22
其中：1.基金申购款	4,790,269.77	-	985,231.64	5,775,501.41
2.基金赎回款	-19,096,143.21	-	-4,516,799.42	-23,612,942.63
（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）	570,989,905.79	-	103,225,094.97	674,215,000.76
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	745,292,470.02	-	439,951,800.39	1,185,244,270.41

金净值）				
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）	745,292,470.02	-	439,951,800.39	1,185,244,270.41
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列）	-112,918,960.84	-	-63,938,990.20	-176,857,951.04
（一）、综合收益总额	-	-	15,200,938.42	15,200,938.42
（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）	-112,918,960.84	-	-79,139,928.62	-192,058,889.46
其中:1.基金申购款	21,993,557.54	-	15,465,794.30	37,459,351.84
2.基金赎回款	-134,912,518.38	-	-94,605,722.92	-229,518,241.30
（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)	632,373,509.18	-	376,012,810.19	1,008,386,319.37

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

泰达宏利市值优选混合型证券投资基金(以下简称“本基金”，原泰达荷银市值优选股票型证券投资基金，后更名为泰达宏利市值优选股票型证券投资基金)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2007]第 204 号《关于同意泰达荷银市值优选股票型证券投资基金募集的批复》核准，由泰达荷银基金管理有限公司(于 2010 年 3 月 9 日更名为泰达宏利基金管理有限公司)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达荷银市值优选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 11,867,940,890.99 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2007)第 101 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泰达荷银市值优选股票型证券投资基金基金合同》于 2007 年 8 月 3 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 11,868,700,887.87 份基金份额，其中认购资金利息折合 759,996.88 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)。

根据本基金的基金管理人 2010 年 3 月 17 日发布的《泰达宏利基金管理有限公司关于变更公

司旗下公募基金名称的公告》，本基金自公告发布之日起更名为泰达宏利市值优选股票型证券投资基金。根据 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》，泰达宏利市值优选股票型证券投资基金于 2015 年 7 月 30 日公告后更名为泰达宏利市值优选混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利市值优选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国内依法发行上市的股票、国债、金融债、企业债、可转债、央行票据、短期融资券、回购、权证、资产支持证券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。在正常市场情况下，本基金资产配置的比例范围是：股票资产占基金资产的 60%-95%，债券资产占基金资产的 0%-35%，权证占基金资产净值的 0%-3%，资产支持证券占基金资产净值的 0%-20%，并保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×75%+上证国债指数收益率×25%。

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颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰达宏利市值优选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净资产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。此外，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

(a) 金融工具

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

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

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息、应收证券清算款和应收申购款，金额分别为 47,341,744.36 元、2,034,884.72 元、254,596.84 元、7,349.74 元、3,954,118.25 元和 31,501.13 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息、应收清算款和应收申购款，金额分别为 47,347,960.76 元、2,035,891.99 元、254,722.90 元、0.00 元、3,954,118.25 元和 31,501.14 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 808,791,477.15 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 808,791,477.15 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、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 1,970,909.65 元、384,374.77 元、1,102,539.84 元、183,756.63 元、1,389,154.54 元和 112.82 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、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 1,970,909.65 元、384,374.77 元、1,102,539.84 元、183,756.63 元、1,389,154.54 元和 112.82 元。

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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

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

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

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

6.4.7 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	37,382,482.93
等于：本金	37,379,024.66
加：应计利息	3,458.27
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	37,382,482.93

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	633,522,425.90	-	633,492,649.44	-29,776.46
贵金属投资-金交所	-	-	-	-

黄金合约					
债券	交易所市场	7,136,886.90	69,434.00	7,221,145.50	14,824.60
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	7,136,886.90	69,434.00	7,221,145.50	14,824.60
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		640,659,312.80	69,434.00	640,713,794.94	-14,951.86

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券投资。

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	45.03
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	563,199.73
其中：交易所市场	563,199.73
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	125,535.04
合计	688,779.80

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	585,295,779.23	585,295,779.23
本期申购	4,790,269.77	4,790,269.77
本期赎回（以“-”号填列）	-19,096,143.21	-19,096,143.21
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	570,989,905.79	570,989,905.79

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期末无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	635,453,147.67	-363,613,102.96	271,840,044.71
本期利润	-110,721,256.28	-54,362,125.68	-165,083,381.96
本期基金份额交易产生的变动数	-14,446,902.31	10,915,334.53	-3,531,567.78
其中：基金申购款	4,676,906.03	-3,691,674.39	985,231.64
基金赎回款	-19,123,808.34	14,607,008.92	-4,516,799.42
本期已分配利润	-	-	-
本期末	510,284,989.08	-407,059,894.11	103,225,094.97

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	74,258.92
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	9,515.10
其他	1,459.76
合计	85,233.78

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	-111,038,506.44
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	-111,038,506.44

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	814,182,564.85
减：卖出股票成本总额	922,754,721.82
减：交易费用	2,466,349.47
买卖股票差价收入	-111,038,506.44

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期未有股票投资收益-证券出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	37,798.39
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-7.16
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	37,791.23

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-
减：应计利息总额	-
减：交易费用	7.16
买卖债券差价收入	-7.16

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期未有债券投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期未有债券投资收益-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

本基金本报告期未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

本基金本报告期未有资产支持证券投资收益—买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期未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

本基金本报告期未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

本基金本报告期未有买卖贵金属投资收益——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 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	6,470,733.23
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	6,470,733.23

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	-54,362,125.68
股票投资	-54,376,950.28
债券投资	14,824.60
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	-54,362,125.68

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	4,213.42
基金转换费收入	599.01
合计	4,812.43

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，其中转出基金的不低于赎回费的 25%归入转出基金的基金资产。

6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期未有信用减值损失。

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	57,027.67
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	1,805.00
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	136,940.04

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

本基金本报告期无或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期没有存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系

泰达宏利基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(中国建设银行)	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	5,266,611.81	8,220,560.57
其中：支付销售机构的客户维护费	1,328,967.14	3,372,591.23

注：支付基金管理人泰达宏利基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬＝前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	877,768.66	1,370,093.39

注：支付基金托管人中国建设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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 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

份额单位：份

关联方名称	本期 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例（%）
建行北碚支行营业部	49,411.24	0.0087	49,411.24	0.0084

注：基金管理人之外的其他关联方投资本基金按照公告的费率条款执行，不存在费率优惠的情况。

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
中国建设银行	37,382,482.93	74,258.92	290,222,039.26	329,891.11

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

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度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度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

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末(2022 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300834	星辉环材	2022 年 1 月 6 日	6 个月	新股流通受限	55.57	30.03	496	27,562.72	14,894.88	-
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	628	25,044.64	19,524.52	-
301109	军信股份	2022 年 4 月 6 日	6 个月	新股流通受限	34.81	16.14	1,167	27,082.18	18,835.38	-
301110	青木股份	2022 年 3 月 4 日	6 个月	新股流通受限	63.10	39.85	202	12,746.20	8,049.70	-
301117	佳缘科技	2022 年 1 月 7 日	6 个月	新股流通受限	46.80	54.44	262	12,261.60	14,263.28	-
301120	新特电气	2022 年 4 月 11 日	6 个月	新股流通受限	13.73	15.49	1,032	14,169.36	15,985.68	-
301122	采纳股份	2022 年 1 月 19 日	6 个月	新股流通受限	50.31	70.37	301	15,143.31	21,181.37	-
301123	奕东电子	2022 年 1 月 14 日	6 个月	新股流通受限	37.23	25.39	605	22,524.15	15,360.95	-
301130	西点	2022 年	6 个月	新股流	22.55	37.70	237	5,344.35	8,934.90	-

	药业	2 月 16 日		通受限						
301135	瑞德智能	2022 年 4 月 1 日	6 个月	新股流通受限	31.98	26.26	338	10,809.24	8,875.88	-
301137	哈焊华通	2022 年 3 月 14 日	6 个月	新股流通受限	15.37	15.99	644	9,898.28	10,297.56	-
301139	元道通信	2022 年 6 月 30 日	1 个月内（含）	新股未上市	38.46	38.46	5,651	217,337.46	217,337.46	-
301148	嘉戎技术	2022 年 4 月 14 日	6 个月	新股流通受限	38.39	23.90	516	19,809.24	12,332.40	-
301153	中科江南	2022 年 5 月 10 日	6 个月	新股流通受限	33.68	43.98	398	13,404.64	17,504.04	-
301158	德石股份	2022 年 1 月 7 日	6 个月	新股流通受限	15.64	20.38	379	5,927.56	7,724.02	-
301162	国能日新	2022 年 4 月 19 日	6 个月	新股流通受限	45.13	54.11	334	15,073.42	18,072.74	-
301175	中科环保	2022 年 6 月 30 日	1 个月内（含）	新股未上市	3.82	3.82	63,694	243,311.08	243,311.08	-
301181	标榜股份	2022 年 2 月 11 日	6 个月	新股流通受限	40.25	30.59	257	10,344.25	7,861.63	-
301196	唯科科技	2022 年 1 月 4 日	6 个月	新股流通受限	64.08	37.52	271	17,365.68	10,167.92	-
301200	大族数控	2022 年 2 月 18 日	6 个月	新股流通受限	76.56	51.92	497	38,050.32	25,804.24	-
301201	诚达药业	2022 年 1 月 12 日	6 个月	新股流通受限	72.69	71.54	353	25,659.57	25,253.62	-
301206	三元生物	2022 年 1 月 26 日	6 个月	新股流通受限	109.30	45.69	414	30,166.80	18,915.66	-
301207	华兰疫苗	2022 年 2 月 10 日	6 个月	新股流通受限	56.88	56.42	327	18,599.76	18,449.34	-

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	551	19,659.68	16,441.84	-
301219	腾远钴业	2022 年 3 月 10 日	6 个月	新股流通受限	173.98	87.82	223	21,573.52	19,583.86	-
301222	浙江恒威	2022 年 3 月 2 日	6 个月	新股流通受限	33.98	28.96	332	11,281.36	9,614.72	-
301233	盛帮股份	2022 年 6 月 24 日	1 个月内（含）	新股未上市	41.52	41.52	1,576	65,435.52	65,435.52	-
301235	华康医疗	2022 年 1 月 21 日	6 个月	新股流通受限	39.30	37.93	418	16,427.40	15,854.74	-
301236	软通动力	2022 年 3 月 8 日	6 个月	新股流通受限	72.88	31.38	737	35,784.08	23,127.06	-
301237	和顺科技	2022 年 3 月 16 日	6 个月	新股流通受限	56.69	41.86	261	14,796.09	10,925.46	-
301238	瑞泰新材	2022 年 6 月 10 日	6 个月	新股流通受限	19.18	32.07	1,621	31,090.78	51,985.47	-
301248	杰创智能	2022 年 4 月 13 日	6 个月	新股流通受限	39.07	29.87	472	18,441.04	14,098.64	-
301256	华融化学	2022 年 3 月 14 日	6 个月	新股流通受限	8.05	10.08	1,831	14,739.55	18,456.48	-
301258	富士莱	2022 年 3 月 21 日	6 个月	新股流通受限	48.30	41.68	295	14,248.50	12,295.60	-
301268	铭利达	2022 年 3 月 29 日	6 个月	新股流通受限	28.50	34.87	641	18,268.50	22,351.67	-
301286	侨源股份	2022 年 6 月 6	6 个月	新股流通受限	16.91	19.79	784	13,257.44	15,515.36	-

		日								
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	-
688052	纳芯微	2022 年 4 月 14 日	6 个月	新股流通受限	230.00	350.81	1,740	400,200.00	610,409.40	-
688175	高凌信息	2022 年 3 月 8 日	6 个月	新股流通受限	51.68	32.23	2,851	147,339.68	91,887.73	-
688259	创耀科技	2022 年 1 月 5 日	6 个月	新股流通受限	66.60	79.22	1,595	106,227.00	126,355.90	-
688279	峰岹科技	2022 年 4 月 13 日	6 个月	新股流通受限	82.00	67.34	5,046	413,772.00	339,797.64	-
688349	三一重能	2022 年 6 月 15 日	6 个月	新股流通受限	29.80	36.94	12,341	367,761.80	455,876.54	-

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

本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金，属于较高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，因此违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有债券投资、资产支持证券投资和同业存单投资资产(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

通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	37,382,482.93	-	-	-	37,382,482.93
结算备付金	640,436.65	-	-	-	640,436.65
存出保证金	111,685.75	-	-	-	111,685.75
交易性金融资产	7,221,145.50	-	-	633,492,649.44	640,713,794.94
应收申购款	0.01	-	-	1,726.64	1,726.65
应收清算款	-	-	-	630,686.89	630,686.89
资产总计	45,355,750.84	-	-	634,125,062.97	679,480,813.81
负债					
应付赎回款	-	-	-	286,695.91	286,695.91
应付管理人报酬	-	-	-	806,809.80	806,809.80
应付托管费	-	-	-	134,468.30	134,468.30
应付清算款	-	-	-	3,349,059.24	3,349,059.24
其他负债	-	-	-	688,779.80	688,779.80
负债总计	-	-	-	5,265,813.05	5,265,813.05
利率敏感度缺口	45,355,750.84	-	-	628,859,249.92	674,215,000.76
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	47,341,744.36	-	-	-	47,341,744.36
结算备付金	2,034,884.72	-	-	-	2,034,884.72
存出保证金	254,596.84	-	-	-	254,596.84
交易性金融资产	-	-	-	808,791,477.15	808,791,477.15
应收利息	-	-	-	7,349.74	7,349.74
应收申购款	-	-	-	31,501.13	31,501.13
应收证券清算款	-	-	-	3,954,118.25	3,954,118.25
资产总计	49,631,225.92	-	-	812,784,446.27	862,415,672.19
负债					
应付赎回款	-	-	-	384,374.77	384,374.77
应付管理人报酬	-	-	-	1,102,539.84	1,102,539.84
应付托管费	-	-	-	183,756.63	183,756.63
应付证券清算款	-	-	-	1,970,909.65	1,970,909.65
应付交易费用	-	-	-	1,389,154.54	1,389,154.54
其他负债	-	-	-	249,112.82	249,112.82
负债总计	-	-	-	5,279,848.25	5,279,848.25
利率敏感度缺口	49,631,225.92	-	-	807,504,598.02	857,135,823.94

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，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 1.07%(2021 年 12 月 31 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(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投资比例为基金资产的 60%-95%，债券投资比例为基金资产的 0%-35%，权证投资比例为基金资产净值的 0%-3%，资产支持证券投资比例为基金资产净值的 0%-20%，现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。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	633,492,649.44	93.96	808,791,477.15	94.36
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	633,492,649.44	93.96	808,791,477.15	94.36

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%	29,270,000.00	45,210,000.00
	沪深 300 指数下降 5%	-29,270,000.00	-45,210,000.00

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	630,728,604.68	805,960,181.51
第二层次	7,747,229.56	5,504.49
第三层次	2,237,960.70	2,825,791.15
合计	640,713,794.94	808,791,477.15

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	633,492,649.44	93.23
	其中：股票	633,492,649.44	93.23
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	7,221,145.50	1.06
	其中：债券	7,221,145.50	1.06
	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	38,022,919.58	5.60
8	其他各项资产	744,099.29	0.11
9	合计	679,480,813.81	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	30,233,929.00	4.48
B	采矿业	179,607,229.20	26.64
C	制造业	47,747,840.59	7.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,389,015.86	0.21
J	金融业	321,361,537.90	47.66
K	房地产业	52,067,555.00	7.72
L	租赁和商务服务业	764,900.52	0.11
M	科学研究和技术服务业	46,162.51	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	274,478.86	0.04
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	633,492,649.44	93.96

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	601628	中国人寿	1,819,800	56,559,384.00	8.39
2	601318	中国平安	1,052,932	49,161,395.08	7.29
3	600938	中国海油	2,662,800	46,465,860.00	6.89
4	300059	东方财富	1,676,336	42,578,934.40	6.32
5	600188	兖矿能源	1,050,600	41,477,688.00	6.15
6	601838	成都银行	2,478,404	41,091,938.32	6.09
7	601088	中国神华	981,294	32,677,090.20	4.85
8	600048	保利发展	1,862,400	32,517,504.00	4.82
9	002142	宁波银行	875,860	31,364,546.60	4.65
10	300498	温氏股份	1,420,100	30,233,929.00	4.48
11	601601	中国太保	1,275,100	30,003,103.00	4.45
12	600256	广汇能源	2,458,500	25,912,590.00	3.84
13	601009	南京银行	2,358,600	24,576,612.00	3.65

14	002567	唐人神	2,558,515	21,772,962.65	3.23
15	001979	招商蛇口	1,455,700	19,550,051.00	2.90
16	600030	中信证券	878,315	19,024,302.90	2.82
17	601225	陕西煤业	859,600	18,206,328.00	2.70
18	000776	广发证券	657,200	12,289,640.00	1.82
19	600519	贵州茅台	5,776	11,811,920.00	1.75
20	603619	中曼石油	456,600	9,392,262.00	1.39
21	600958	东方证券	892,160	9,108,953.60	1.35
22	600309	万华化学	66,600	6,459,534.00	0.96
23	600919	江苏银行	786,900	5,602,728.00	0.83
24	601666	平煤股份	402,900	5,475,411.00	0.81
25	601952	苏垦农发	379,400	5,307,806.00	0.79
26	601888	中国中免	3,200	745,376.00	0.11
27	300896	爱美客	1,100	660,011.00	0.10
28	300957	贝泰妮	3,000	652,590.00	0.10
29	688052	纳芯微	1,740	610,409.40	0.09
30	688349	三一重能	12,341	455,876.54	0.07
31	688279	峰岹科技	5,046	339,797.64	0.05
32	301175	中科环保	63,694	243,311.08	0.04
33	301139	元道通信	5,651	217,337.46	0.03
34	688259	创耀科技	1,595	126,355.90	0.02
35	688175	高凌信息	2,851	91,887.73	0.01
36	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.01
37	301238	瑞泰新材	1,621	51,985.47	0.01
38	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.01
39	301215	中汽股份	4,743	30,307.77	0.00
40	301200	大族数控	497	25,804.24	0.00
41	301201	诚达药业	353	25,253.62	0.00
42	301236	软通动力	737	23,127.06	0.00
43	301268	铭利达	641	22,351.67	0.00
44	301122	采纳股份	301	21,181.37	0.00
45	301219	腾远钴业	223	19,583.86	0.00
46	301102	兆讯传媒	628	19,524.52	0.00
47	301206	三元生物	414	18,915.66	0.00
48	301109	军信股份	1,167	18,835.38	0.00
49	301256	华融化学	1,831	18,456.48	0.00
50	301207	华兰疫苗	327	18,449.34	0.00
51	301162	国能日新	334	18,072.74	0.00
52	301153	中科江南	398	17,504.04	0.00
53	301216	万凯新材	551	16,441.84	0.00
54	301120	新特电气	1,032	15,985.68	0.00
55	301235	华康医疗	418	15,854.74	0.00

56	301286	侨源股份	784	15,515.36	0.00
57	301123	奕东电子	605	15,360.95	0.00
58	300834	星辉环材	496	14,894.88	0.00
59	301117	佳缘科技	262	14,263.28	0.00
60	301248	杰创智能	472	14,098.64	0.00
61	301212	联盛化学	416	13,844.48	0.00
62	301148	嘉戎技术	516	12,332.40	0.00
63	301258	富士莱	295	12,295.60	0.00
64	301097	天益医疗	249	11,909.67	0.00
65	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
66	301237	和顺科技	261	10,925.46	0.00
67	301137	哈焊华通	644	10,297.56	0.00
68	301196	唯科科技	271	10,167.92	0.00
69	301222	浙江恒威	332	9,614.72	0.00
70	301288	清研环境	452	9,030.96	0.00
71	301130	西点药业	237	8,934.90	0.00
72	301135	瑞德智能	338	8,875.88	0.00
73	301110	青木股份	202	8,049.70	0.00
74	301181	标榜股份	257	7,861.63	0.00
75	301158	德石股份	379	7,724.02	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	52,850,396.04	6.17
2	601628	中国人寿	49,018,058.28	5.72
3	600938	中国海油	44,569,571.16	5.20
4	600188	兖矿能源	40,857,987.84	4.77
5	601601	中国太保	37,421,793.04	4.37
6	601838	成都银行	36,536,093.51	4.26
7	601088	中国神华	30,841,797.22	3.60
8	001979	招商蛇口	27,307,494.00	3.19
9	002567	唐人神	27,297,903.05	3.18
10	300498	温氏股份	26,600,300.00	3.10
11	600256	广汇能源	26,536,869.00	3.10
12	601009	南京银行	26,355,021.24	3.07
13	600048	保利发展	25,118,102.00	2.93
14	601166	兴业银行	22,985,561.00	2.68
15	601111	中国国航	16,265,197.00	1.90
16	300059	东方财富	15,601,070.04	1.82
17	601225	陕西煤业	14,117,887.00	1.65

18	600030	中信证券	13,627,906.45	1.59
19	601155	新城控股	12,465,335.00	1.45
20	603885	吉祥航空	12,428,153.40	1.45

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	600887	伊利股份	39,698,289.34	4.63
2	600519	贵州茅台	34,112,321.00	3.98
3	688599	天合光能	33,262,308.59	3.88
4	603288	海天味业	31,321,284.03	3.65
5	601166	兴业银行	30,767,886.00	3.59
6	000568	泸州老窖	29,719,598.00	3.47
7	600600	青岛啤酒	28,677,839.16	3.35
8	603027	千禾味业	27,435,598.08	3.20
9	300750	宁德时代	27,357,461.31	3.19
10	601111	中国国航	27,141,183.58	3.17
11	603501	韦尔股份	24,285,638.00	2.83
12	002241	歌尔股份	21,479,104.74	2.51
13	002475	立讯精密	18,753,556.34	2.19
14	000333	美的集团	17,964,410.00	2.10
15	600036	招商银行	17,384,847.30	2.03
16	002557	洽洽食品	16,835,750.24	1.96
17	000661	长春高新	15,951,083.40	1.86
18	600004	白云机场	15,156,534.67	1.77
19	300413	芒果超媒	15,060,013.00	1.76
20	600298	安琪酵母	14,347,273.00	1.67

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	801,832,844.39
卖出股票收入（成交）总额	814,182,564.85

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	7,221,145.50	1.07
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	7,221,145.50	1.07

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019666	22 国债 01	71,410	7,221,145.50	1.07

注：以上为本基金本报告期末持有的全部债券投资。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

在报告期内，本基金未投资于股指期货。该策略符合基金合同的规定。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期未投资于国债期货。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，宁波银行于 2021 年 7 月 30 日、2021 年 12 月 29 日、2022 年 4 月 11 日、2022 年 4 月 21 日、2022 年 5 月 27 日受到宁波银保监局公开处罚。于 2021

年 7 月 13 日曾受到国家外汇管理局宁波市分局、央行宁波市中心支行公开处罚。

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	111,685.75
2	应收清算款	630,686.89
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,726.65
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	744,099.29

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
33,658	16,964.46	1,756,253.34	0.31	569,233,652.45	99.69

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）

基金管理人所有从业人员持有本基金	91,948.62	0.0161

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2007 年 8 月 3 日）基金份额总额	11,868,700,887.87
本报告期期初基金份额总额	585,295,779.23
本报告期基金总申购份额	4,790,269.77
减：本报告期基金总赎回份额	19,096,143.21
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	570,989,905.79

§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的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金无投资策略的变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金未更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

1、本报告期内，本基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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(%)	
广发证券	1	666,963,489.87	41.64	621,135.50	41.64	-
浙商证券	2	335,335,283.22	20.94	312,298.97	20.94	-
银河证券	2	216,692,469.28	13.53	201,804.81	13.53	-
中信建投	1	104,433,164.01	6.52	97,257.54	6.52	-
华创证券	1	96,653,617.39	6.03	90,014.38	6.03	-
海通证券	1	68,733,557.49	4.29	64,011.30	4.29	-
德邦证券	1	68,244,283.75	4.26	63,554.71	4.26	-
国信证券	2	40,629,634.52	2.54	37,838.55	2.54	-
中信证券	4	3,389,012.36	0.21	3,156.11	0.21	-
中泰证券	2	670,127.45	0.04	624.18	0.04	-
安信证券	3	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
财信证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	3	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
高华证券	3	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
华泰证券	3	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-

瑞银证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	4	-	-	-	-	-

注：(一)本基金本报告期无证券交易单元变动。

（二） 交易单元选择的标准和程序

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

（1）经营规范，有较完备的内控制度；

（2）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合证券交易的需要；

（3）能为基金管理人提供高质量的研究咨询服务。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
广发证券	7,136,886.90	100.00	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-

渤海证券	-	-	-	-	-	-
财信证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

§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