

泰达宏利消费服务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	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合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
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	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	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	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	45
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
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	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
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	52

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	52
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	52
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	53
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	53
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
7.12	投资组合报告附注	53
§ 8	基金份额持有人信息	54
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54
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	54
§ 9	开放式基金份额变动	55
§ 10	重大事件揭示	55
10.1	基金份额持有人大会决议	55
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	55
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	55
10.4	基金投资策略的改变	56
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	56
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	56
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	56
§ 11	备查文件目录	59
11.1	备查文件目录	59
11.2	存放地点	59
11.3	查阅方式	59

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泰达宏利消费服务混合型证券投资基金	
基金简称	泰达消费服务混合	
基金主代码	011431	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 3 月 16 日	
基金管理人	泰达宏利基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	212,587,638.58 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	泰达消费服务混合 A	泰达消费服务混合 C
下属分级基金的交易代码	011431	011432
报告期末下属分级基金的份额总额	193,921,157.96 份	18,666,480.62 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点关注消费服务类优质企业的投资机会,在严格控制风险、保持良好流动性的前提下,追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金重点投资于消费及服务行业的上市公司,长期投资于稳健发展的龙头企业,争取实现基金资产的长期稳健增值。
业绩比较基准	申银万国消费品指数收益率×50%+恒生消费品制造及服务指数收益率(使用估值汇率折算)×20%+中债综合指数收益率×30%。
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期风险及预期收益水平高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金。本基金将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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	徐娇娇
	联系电话	66577766
	电子邮箱	irm@mfcteda.com
客户服务电话	400-698-8888	95566
传真	010-66577666	010-66594942
注册地址	北京市朝阳区针织路 23 号楼中国人寿金融中心 6 层 02-07 单元	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	北京市朝阳区针织路 23 号楼中国人寿金融中心 6 层 02-07 单元	北京市西城区复兴门内大街 1 号

邮政编码	100026	100818
法定代表人	傅国庆	刘连舸

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 01 月 01 日-2022 年 06 月 30 日)	
	泰达消费服务混合 A	泰达消费服务混合 C
本期已实现收益	-8,845,749.33	-980,937.49
本期利润	-10,259,880.47	-1,223,283.32
加权平均基金份额本期利润	-0.0516	-0.0595
本期加权平均净值利润率	-6.77%	-7.86%
本期基金份额净值增长率	-5.38%	-5.66%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)	
	泰达消费服务混合 A	泰达消费服务混合 C
期末可供分配利润	-33,950,015.12	-3,386,684.05
期末可供分配基金份额利润	-0.1751	-0.1814
期末基金资产净值	159,971,142.84	15,279,796.57
期末基金份额净值	0.8249	0.8186
3.1.3 累计期末	报告期末(2022 年 6 月 30 日)	

指标		
基金份额累计净值增长率	-17.51%	-18.14%

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

泰达消费服务混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	8.77%	1.00%	7.04%	0.85%	1.73%	0.15%
过去三个月	12.26%	1.39%	7.27%	1.07%	4.99%	0.32%
过去六个月	-5.38%	1.38%	-5.36%	1.17%	-0.02%	0.21%
过去一年	-18.61%	1.50%	-11.79%	1.03%	-6.82%	0.47%
自基金合同生效起至今	-17.51%	1.43%	-5.76%	0.97%	-11.75%	0.46%

泰达消费服务混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	8.73%	1.00%	7.04%	0.85%	1.69%	0.15%

过去三个月	12.11%	1.39%	7.27%	1.07%	4.84%	0.32%
过去六个月	-5.66%	1.38%	-5.36%	1.17%	-0.30%	0.21%
过去一年	-19.09%	1.50%	-11.79%	1.03%	-7.30%	0.47%
自基金合同生效起 至今	-18.14%	1.43%	-5.76%	0.97%	-12.38 %	0.46%

注：本基金的业绩比较基准：申银万国消费品指数收益率×50%+恒生消费品制造及服务业指数收益率（使用估值汇率折算）×20%+中债综合指数收益率×30%。

申银万国消费品指数是申银万国股价系列指数旗下一只主题指数，基于申万行业分类标准编制，用以表征消费品上市公司整体股价表现。申银万国消费品指数编制合理、透明，市场覆盖率较广，不易被操纵，标的股票与本基金投资策略、投资风格比较匹配，适合作为本基金 A 股股票投资的业绩比较基准。

恒生消费品制造及服务业指数是由恒生指数服务有限公司编制，该指数以恒生综合指数成分股为样本空间，从中选取消费品制造业和消费品服务业的股票作为样本股。恒生消费品制造及服务业指数编制合理、透明，市场覆盖率较广，不易被操纵，标的股票与本基金投资策略、投资风格比较匹配，适合作为本基金港股通标的股票投资的业绩比较基准。

中债综合指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制，样本债券涵盖的范围更加全面，具有广泛的市场代表性，涵盖主要交易市场（银行间市场、交易所市场等）、不同发行主体（政府、企业等）和期限（长期、中期、短期等），能够很好地反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势，适合作为本基金债券投资的业绩比较基准。

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

泰达消费服务混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



泰达消费服务混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金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、泰达宏利润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		
吴华	本基金基金经理	2021 年 3 月 16 日	-	18 年	北京大学金融学硕士；2004 年 6 月至 2006 年 3 月就职于易方达基金管理有限公司，担任宏观策略分析员；2006 年 4 月至 2011 年 4 月就职于中国国际金融有限公司，先后就职于研究部、资产管理部，担任经理、副总经理等职位；2011 年 5 月加入泰达宏利基金管理有限公司，现任高级基金经理；具备 18 年证券从业经验，18 年证券投资管理经验，具有基金从业资格。
周少博	本基金基金经理	2021 年 12 月 29 日	-	7 年	毕业于北京大学，世界经济硕士研究生。2015 年 7 月至今周少博先生任职于泰达宏利基金管理有限公司，曾任研究部助理研究员、研究员、高级研究员、研究部总经理助理，现任研究部总经理助理兼基金经理。具备 7 年基金从业经验，具有基金从业资格。
刘欣	总经理助理兼投资总监（权益）兼本基金基金经理助理	2021 年 12 月 28 日	-	15 年	清华大学理学硕士；2007 年 7 月至 2008 年 12 月就职于工银瑞信基金管理有限公司；2008 年 12 月至 2011 年 7 月就职于嘉实基金管理有限公司；2011 年 7 月加盟泰达宏利基金管理有限公司，曾担任产品与金融工程部高级研究员、金融工程部副总经理、金融工程部总经理、投资副总监，现担任公司总经理助理兼投资总监（权益）兼基金经理；具备 15 年基金从业经验，15 年证券投资管理经验，具有基金从业资格。

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

整体消费环境来看，在近两年承受了相对较大的压力。2021 年，社会消费品零售总额两年复合增速 3.9%、较 2019 年低 4.1 个百分点，而居民消费支出两年复合增速 5.7%、较 2019 年低 2.9 个百分点；占比约九成的商品零售增速较 2019 年低 3.4 个百分点。进入 2022 年，整体消费环境进入复苏周期，但复苏的节奏被阶段性的海外地缘事件和国内区域新冠疫情散发所打断。从消费服务行业基本面来看，整体行业盈利阶段性受到了冲击。

本基金一直坚守合同约定操作，保持合理的仓位水平配置消费服务类资产，没有做阶段性较大的仓位判断或者明显的行业偏离。主要由于回顾历史来看，仓位决策或者明显的某个或者某几个行业偏离，可能阶段性带来一定的相对收益，但中长期来看并不能整体提升基金业绩的表现。基金经理仍然坚持合理的仓位水平和消费服务内部行业配置。

本基金持有消费服务相关优质公司，同时努力寻找在市场波动中错误定价的机会，并且在消费类资产中寻找阶段性成长类机会，努力在获得超额收益的同时控制组合的整体回撤。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末泰达消费服务混合 A 的基金份额净值为 0.8249 元，本报告期基金份额净值增长率为-5.38%，截至本报告期末泰达消费服务混合 C 的基金份额净值为 0.8186 元，本报告期基金份额净值增长率为-5.66%，同期业绩比较基准收益率为-5.36%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

短期来看，经历了 2022 年以来的回调，消费板块估值压力有所释放，消费板块的白马龙头市盈率也大幅回落，当前整个板块估值或已经具备很好的吸引力。同时，从消费场景来看，被限制的消费场景正在逐渐得到释放，例如餐饮、聚会、旅游等板块可能会直接受益；另一方面，在稳增长背景下，经济在今年下半年如果能够看到明显恢复，居民收入增速回升，消费信心也会好转，相关消费服务类公司会明显受益。因此，整体来看，消费服务类资产在当前时间点看未来 1-2 年，具有较好的投资机会。

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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对泰达宏利消费服务混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：泰达宏利消费服务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	24,095,913.04	19,651,855.89
结算备付金		222,902.96	527,803.52
存出保证金		59,651.63	43,473.13
交易性金融资产	6.4.7.2	154,513,262.43	179,477,918.46
其中：股票投资		154,513,262.43	179,179,978.95
基金投资		-	-
债券投资		-	297,939.51
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		3,367,343.14	411,205.21
应收股利		22,635.75	2,191.89
应收申购款		31,346.81	16,753.65
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	2,334.97
资产总计		182,313,055.76	200,133,536.72
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		6,300,011.45	2,743,747.41
应付赎回款		80,037.67	91,727.43
应付管理人报酬		205,832.90	251,531.15
应付托管费		34,305.50	41,921.85
应付销售服务费		7,360.20	9,367.84
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	1.39
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	434,568.63	419,609.87
负债合计		7,062,116.35	3,557,906.94
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	212,587,638.58	225,582,408.31
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-37,336,699.17	-29,006,778.53
净资产合计		175,250,939.41	196,575,629.78
负债和净资产总计		182,313,055.76	200,133,536.72

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额总额 212,587,638.58 份，其中泰达消费服务混合 A 基金份额总额 193,921,157.96 份，基金份额净值 0.8249 元；泰达消费服务混合 C 基金份额总额 18,666,480.62 份，基金份额净值 0.8186 元。

6.2 利润表

会计主体：泰达宏利消费服务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 3 月 16 日（基金合 同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-9,881,490.95	14,650,007.30
1. 利息收入		62,711.94	92,785.63
其中：存款利息收入	6.4.7.13	61,068.76	92,785.63
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		1,643.18	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		-8,295,133.70	8,976,854.77
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-9,819,364.55	7,814,711.05
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	63,531.47	-
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	1,460,699.38	1,162,143.72
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	-1,656,476.97	5,028,557.11
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	7,407.78	551,809.79
减：二、营业总支出		1,601,672.84	2,937,731.92
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,244,992.68	1,607,418.49
2. 托管费	6.4.10.2.2	207,498.84	267,903.11
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	46,423.18	33,575.83
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		0.04	-
8. 其他费用	6.4.7.23	102,758.10	1,028,834.49
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-11,483,163.79	11,712,275.38
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-11,483,163.79	11,712,275.38
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-11,483,163.79	11,712,275.38

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：泰达宏利消费服务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)	225,582,408.31	-	-29,006,778.53	196,575,629.78
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)	225,582,408.31	-	-29,006,778.53	196,575,629.78
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-12,994,769.73	-	-8,329,920.64	-21,324,690.37

(一)、综合收益总额	-	-	-11,483,163.79	-11,483,163.79
(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)	-12,994,769.73	-	3,153,243.15	-9,841,526.58
其中:1.基金申购款	5,876,619.22	-	-1,388,470.37	4,488,148.85
2.基金赎回款	-18,871,388.95	-	4,541,713.52	-14,329,675.43
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	212,587,638.58	-	-37,336,699.17	175,250,939.41
项目	上年度可比期间			
	2021年3月16日(基金合同生效日)至2021年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产(基金净值)	403,344,934.03	-	-	403,344,934.03
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)	403,344,934.03	-	-	403,344,934.03
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-137,794,041.49	-	3,559,547.13	-134,234,494.36
(一)、综合收益总额	-	-	11,712,275.38	11,712,275.38
(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)	-137,794,041.49	-	-8,152,728.25	-145,946,769.74
其中:1.基金申购款	6,524,291.88	-	266,112.01	6,790,403.89
2.基金赎回款	-144,318,333.37	-	-8,418,840.26	-152,737,173.63
(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)	265,550,892.54	-	3,559,547.13	269,110,439.67

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

泰达宏利消费服务混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2020]2822号《关于准予泰达宏利消费服务混合型证券投资基金注册的批复》核准,由泰达宏利基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利消费服务混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币403,101,301.12元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2021)第0314号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰达宏利消费服务混合型证券投资基金基金合同》于2021年3月16日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为403,344,934.03份基金份额,其中认购资金利息折合243,632.91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,基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)。

根据《泰达宏利消费服务混合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《泰达宏利消费服务混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)，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)。基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 60%-95%，其中，投资于消费服务相关的股票的比例不低于非现金基金资产的 80%，投资于港股通标的股票比例占股票投资比例的 0%-50%；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申银万国消费品指数收益率×50%+恒生消费品制造及服务业指数收益率(使用估值汇率折算)×20%+中债综合指数收益率×30%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰达宏利消费服务混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 年度上半年财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2022 年 06 月 30 日的财务状况以及 2022 年度上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计详见附注 6.4.5。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”），财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

(a) 金融工具

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

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

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息、应收证券清算款、应收股利和应收申购款，金额分别为 19,651,855.89 元、527,803.52 元、43,473.13 元、2,334.97 元、411,205.21 元、2,191.89 元和 16,753.65 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息、应收清算款、应收股利和应收申购款，金额分别为 19,653,655.93 元、528,066.33 元、43,492.73 元、0.00 元、411,205.21 元、2,191.89 元和 16,753.66 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 179,477,918.46 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 179,478,170.97 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 2,743,747.41 元、91,727.43 元、251,531.15 元、41,921.85 元、9,367.84 元、254,971.98 元和 137.89 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付赎回款、应付管理

人报酬、应付托管费、应付销售服务费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 2,743,747.41 元、91,727.43 元、251,531.15 元、41,921.85 元、9,367.84 元、254,971.98 元和 137.89 元。

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

(b) 修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无会计估计的变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无重大会计差错发生。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率

缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

(4) 对基金通过深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(5) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基金通过深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	24,095,913.04
等于：本金	24,094,130.72
加：应计利息	1,782.32
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	24,095,913.04

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	155,579,482.84	-	154,513,262.43	-1,066,220.41
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	155,579,482.84	-	154,513,262.43	-1,066,220.41

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

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末无其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末无其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末无其他权益工具投资。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期末无其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

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	—
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	343,373.17
其中：交易所市场	343,373.17
银行间市场	—
应付利息	—
预提费用	91,195.46
合计	434,568.63

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

泰达消费服务混合 A

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	204,262,304.13	204,262,304.13
本期申购	2,648,159.14	2,648,159.14
本期赎回 (以“-”号填列)	-12,989,305.31	-12,989,305.31
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	193,921,157.96	193,921,157.96

泰达消费服务混合 C

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	21,320,104.18	21,320,104.18
本期申购	3,228,460.08	3,228,460.08
本期赎回 (以“-”号填列)	-5,882,083.64	-5,882,083.64
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	18,666,480.62	18,666,480.62

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期末无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

泰达消费服务混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-21,932,735.88	-4,252,830.24	-26,185,566.12
本期利润	-8,845,749.33	-1,414,131.14	-10,259,880.47
本期基金份额交易产生的变动数	1,471,819.77	1,023,611.70	2,495,431.47
其中：基金申购款	-370,453.83	-274,892.70	-645,346.53
基金赎回款	1,842,273.60	1,298,504.40	3,140,778.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-29,306,665.44	-4,643,349.68	-33,950,015.12

泰达消费服务混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
----	-------	-------	---------

本期期初	-2,375,215.85	-445,996.56	-2,821,212.41
本期利润	-980,937.49	-242,345.83	-1,223,283.32
本期基金份额交易产生的变动数	421,966.01	235,845.67	657,811.68
其中：基金申购款	-445,819.26	-297,304.58	-743,123.84
基金赎回款	867,785.27	533,150.25	1,400,935.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,934,187.33	-452,496.72	-3,386,684.05

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	56,003.91
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	4,521.72
其他	543.13
合计	61,068.76

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	-9,819,364.55
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	-9,819,364.55

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	385,332,164.10
减：卖出股票成本总额	393,981,348.10
减：交易费用	1,170,180.55
买卖股票差价收入	-9,819,364.55

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	10.12
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	63,521.35
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	63,531.47

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	289,695.84
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	225,900.00
减：应计利息总额	262.91
减：交易费用	11.58
买卖债券差价收入	63,521.35

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期末有债券投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期末有债券投资收益-申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期末有资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益—买卖差价收入。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期末有资产支持证券投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期末有资产支持证券投资收益-申购差价收入。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内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

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无赎回贵金属差价收入。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无申购贵金属差价收入。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内未有衍生工具收益-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1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,460,699.38
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	1,460,699.38

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	-1,656,476.97
股票投资	-1,584,437.46
债券投资	-72,039.51
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	-1,656,476.97

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	7,202.52
基金转换费收入	205.26
合计	7,407.78

6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	56,942.68
证券出借违约金	-
银行费用	6,827.00
账户维护费	9,000.00
其他	235.64
合计	102,758.10

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期没有存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
泰达宏利基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司(中国银行)	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交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 3 月 16 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,244,992.68	1,607,418.49
其中：支付销售机构的客户维护费	565,606.51	744,208.55

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%的费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% / \text{当年天数}。$$

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 3 月 16 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	207,498.84	267,903.11

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

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泰达消费服务混合 A	泰达消费服务混合 C	合计
泰达宏利基金管理有限公司	-	340.41	340.41
中国银行股份有限公司	-	9,461.42	9,461.42
合计	-	9,801.83	9,801.83
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021 年 3 月 16 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泰达消费服务混合 A	泰达消费服务混合 C	合计
泰达宏利基金管理有限公司	-	53.87	53.87
中国银行股份有限公司	-	9,047.82	9,047.82
合计	-	9,101.69	9,101.69

注：支付基金销售机构的销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值 0.6% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给泰达宏利基金管理有限公司，再由泰达宏利基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日 C 类基金份额销售服务费 = 前一日 C 类基金份额基金资产净值 X 0.6% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本基金的管理人在本报告期内及上年度可比期间内均未运用自有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末及上年度末均未持有本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年3月16日（基金合同生效日）至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	24,095,913.04	56,003.91	15,944,295.72	84,975.23

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末(2022年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300834	星辉环材	2022年1月6日	6个月	新股流通受限	55.57	30.03	110	6,112.70	3,303.30	-
301097	天益医疗	2022年3月25日	6个月	新股流通受限	52.37	47.83	115	6,022.55	5,500.45	-
301102	兆讯传媒	2022年3月15日	6个月	新股流通受限	39.88	31.09	147	5,862.36	4,570.23	-
301109	军信股份	2022年4月6日	6个月	新股流通受限	34.81	16.14	276	6,405.04	4,454.64	-

		日									
301110	青木股份	2022年 3月4日	6个月	新股流 通受限	63.10	39.85	70	4,417.00	2,789.50		-
301117	佳缘科技	2022年 1月7日	6个月	新股流 通受限	46.80	54.44	124	5,803.20	6,750.56		-
301120	新特电气	2022年 4月11日	6个月	新股流 通受限	13.73	15.49	626	8,594.98	9,696.74		-
301122	采纳股份	2022年 1月19日	6个月	新股流 通受限	50.31	70.37	112	5,634.72	7,881.44		-
301130	西点药业	2022年 2月16日	6个月	新股流 通受限	22.55	37.70	166	3,743.30	6,258.20		-
301135	瑞德智能	2022年 4月1日	6个月	新股流 通受限	31.98	26.26	178	5,692.44	4,674.28		-
301137	哈焊华通	2022年 3月14日	6个月	新股流 通受限	15.37	15.99	296	4,549.52	4,733.04		-
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	1,978	76,073.88	76,073.88		-
301148	嘉戎技术	2022年 4月14日	6个月	新股流 通受限	38.39	23.90	168	6,449.52	4,015.20		-
301158	德石股份	2022年 1月7日	6个月	新股流 通受限	15.64	20.38	309	4,832.76	6,297.42		-
301162	国能日新	2022年 4月19日	6个月	新股流 通受限	45.13	54.11	106	4,783.78	5,735.66		-
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	20,382	77,859.24	77,859.24		-
301181	标榜股份	2022年 2月11日	6个月	新股流 通受限	40.25	30.59	125	5,031.25	3,823.75		-
301196	唯科科技	2022年 1月4日	6个月	新股流 通受限	64.08	37.52	63	4,037.04	2,363.76		-
301200	大族	2022年	6个月	新股流	76.56	51.92	109	8,345.04	5,659.28		-

	数控	2月18日		通受限							
301206	三元生物	2022年1月26日	6个月	新股流通受限	109.30	45.69	102	7,432.40	4,660.38		-
301207	华兰疫苗	2022年2月10日	6个月	新股流通受限	56.88	56.42	71	4,038.48	4,005.82		-
301212	联盛化学	2022年4月7日	6个月	新股流通受限	29.67	33.28	171	5,073.57	5,690.88		-
301215	中汽股份	2022年2月28日	6个月	新股流通受限	3.80	6.39	1,961	7,451.80	12,530.79		-
301216	万凯新材	2022年3月21日	6个月	新股流通受限	35.68	29.84	126	4,495.68	3,759.84		-
301219	腾远钴业	2022年3月10日	6个月	新股流通受限	173.98	87.82	50	4,871.44	4,391.00		-
301222	浙江恒威	2022年3月2日	6个月	新股流通受限	33.98	28.96	145	4,927.10	4,199.20		-
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	1,024	42,516.48	42,516.48		-
301235	华康医疗	2022年1月21日	6个月	新股流通受限	39.30	37.93	172	6,759.60	6,523.96		-
301236	软通动力	2022年3月8日	6个月	新股流通受限	72.88	31.38	166	8,089.68	5,209.08		-
301237	和顺科技	2022年3月16日	6个月	新股流通受限	56.69	41.86	96	5,442.24	4,018.56		-
301248	杰创智能	2022年4月13日	6个月	新股流通受限	39.07	29.87	177	6,915.39	5,286.99		-
301256	华融化学	2022年3月14日	6个月	新股流通受限	8.05	10.08	765	6,158.25	7,711.20		-
301258	富士莱	2022年3月21日	6个月	新股流通受限	48.30	41.68	89	4,298.70	3,709.52		-

301268	铭利达	2022年 3月29日	6个月	新股流通受限	28.50	34.87	206	5,871.00	7,183.22	-
301288	清研环境	2022年 4月14日	6个月	新股流通受限	19.09	19.98	350	6,681.50	6,993.00	-
688290	景业智能	2022年 4月21日	6个月	新股流通受限	33.89	46.87	2,027	68,695.03	95,005.49	-
688320	禾川科技	2022年 4月21日	6个月	新股流通受限	23.66	46.21	2,754	65,159.64	127,262.34	-

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

本基金为混合型证券投资基金，预期收益及风险水平低于股票型基金，高于货币市场基金与债券型基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、货币市场工具、股指期货、资产支持证券等。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。风险管理部对公司执行总裁负责，并由督察长分管。

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券投资、资

产支持证券投资和同业存单投资（2021 年 12 月 31 日：本基金持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券、资产支持证券和同业存单占基金资产净值的比例为 0.15%）。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

于 2022 年 6 月 30 日，除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额将在一个月以内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资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 7.4.12。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	24,095,913.04	-	-	-	24,095,913.04
结算备付金	222,902.96	-	-	-	222,902.96
存出保证金	59,651.63	-	-	-	59,651.63
交易性金融资产	-	-	-	154,513,262.43	154,513,262.43
应收股利	-	-	-	22,635.75	22,635.75

应收申购款	0.01	-	-	31,346.80	31,346.81
应收清算款	-	-	-	3,367,343.14	3,367,343.14
资产总计	24,378,467.64	-	-	157,934,588.12	182,313,055.76
负债					
应付赎回款	-	-	-	80,037.67	80,037.67
应付管理人报酬	-	-	-	205,832.90	205,832.90
应付托管费	-	-	-	34,305.50	34,305.50
应付清算款	-	-	-	6,300,011.45	6,300,011.45
应付销售服务费	-	-	-	7,360.20	7,360.20
其他负债	-	-	-	434,568.63	434,568.63
负债总计	-	-	-	7,062,116.35	7,062,116.35
利率敏感度缺口	24,378,467.64	-	-	150,872,471.77	175,250,939.41
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	19,651,855.89	-	-	-	19,651,855.89
结算备付金	527,803.52	-	-	-	527,803.52
存出保证金	43,473.13	-	-	-	43,473.13
交易性金融资产	-	-	297,939.51	179,179,978.95	179,477,918.46
应收利息	-	-	-	2,334.97	2,334.97
应收股利	-	-	-	2,191.89	2,191.89
应收申购款	-	-	-	16,753.65	16,753.65
应收证券清算款	-	-	-	411,205.21	411,205.21
资产总计	20,223,132.54	-	297,939.51	179,612,464.67	200,133,536.72
负债					
应付赎回款	-	-	-	91,727.43	91,727.43
应付管理人报酬	-	-	-	251,531.15	251,531.15
应付托管费	-	-	-	41,921.85	41,921.85
应付证券清算款	-	-	-	2,743,747.41	2,743,747.41
应付销售服务费	-	-	-	9,367.84	9,367.84
应付交易费用	-	-	-	254,971.98	254,971.98
应交税费	-	-	-	1.39	1.39
其他负债	-	-	-	164,637.89	164,637.89
负债总计	-	-	-	3,557,906.94	3,557,906.94
利率敏感度缺口	20,223,132.54	-	297,939.51	176,054,557.73	196,575,629.78

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的到期日予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2021 年 12 月 31 日：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 0.15%)，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。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
交易性金融资产	-	6,855,283.08	-	6,855,283.08
资产合计	-	6,855,283.08	-	6,855,283.08
以外币计价的 负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净 额	-	6,855,283.08	-	6,855,283.08
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
交易性金融资产	-	7,280,785.89	-	7,280,785.89
资产合计	-	7,280,785.89	-	7,280,785.89
以外币计价的 负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净 额	-	7,280,785.89	-	7,280,785.89

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	所有外币相对人民币升值 5%	-	360,000.00
	所有外币相对人民币贬值 5%	-	-360,000.00

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产占基金资产的比例为 60%-95%，其中，投资于消费服务相关的股票的比例不低于非现金基金资产的 80%，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	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	154,513,262.43	88.17	179,179,978.95	91.15
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	154,513,262.43	88.17	179,179,978.95	91.15

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%	7,300,000.00	-
	沪深 300 指数下降 5%	-7,300,000.00	-

注: 于 2021 年 12 月 31 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	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	153,920,164.11	178,368,568.11
第二层次	196,449.60	5,504.49
第三层次	396,648.72	1,104,098.37
合计	154,513,262.43	179,478,170.97

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	154,513,262.43	84.75
	其中：股票	154,513,262.43	84.75
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	24,318,816.00	13.34
8	其他各项资产	3,480,977.33	1.91
9	合计	182,313,055.76	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	1,625,855.28	0.93
B	采矿业	-	-
C	制造业	110,964,710.34	63.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,106,315.00	0.63
E	建筑业	7,444.75	0.00
F	批发和零售业	11,921,681.66	6.80
G	交通运输、仓储和邮政业	19,344,996.80	11.04
H	住宿和餐饮业	14,977.44	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	177,228.55	0.10
J	金融业	1,763,960.00	1.01
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	4,570.23	0.00
M	科学研究和技术服务业	594,392.57	0.34
N	水利、环境和公共设施管理业	103,962.92	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	27,883.81	0.02
S	综合	-	-
	合计	147,657,979.35	84.26

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
地产建筑业	-	-
信息技术	-	-
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	-	-
工业	-	-

公用事业	-	-
电信服务	-	-
基础材料	-	-
消费者非必需品	5,013,572.29	2.86
消费者常用品	1,841,710.79	1.05
合计	6,855,283.08	3.91

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	000661	长春高新	42,452	9,909,145.84	5.65
2	600519	贵州茅台	2,701	5,523,545.00	3.15
3	301177	迪阿股份	71,176	5,281,259.20	3.01
4	688089	嘉必优	160,667	5,261,844.25	3.00
5	600195	中牧股份	423,900	5,197,014.00	2.97
6	002100	天康生物	530,800	5,159,376.00	2.94
7	002468	申通快递	419,600	5,001,632.00	2.85
8	688696	极米科技	15,534	4,782,452.58	2.73
9	605080	浙江自然	69,800	4,459,522.00	2.54
10	300873	海晨股份	141,760	4,007,555.20	2.29
11	603871	嘉友国际	236,864	4,003,001.60	2.28
12	002304	洋河股份	21,800	3,992,670.00	2.28
13	600861	北京城乡	179,800	3,916,044.00	2.23
14	600702	舍得酒业	18,500	3,773,815.00	2.15
15	002867	周大生	240,800	3,739,624.00	2.13
16	603816	顾家家居	60,380	3,419,319.40	1.95
17	000089	深圳机场	441,600	3,409,152.00	1.95
18	300888	稳健医疗	48,900	3,251,850.00	1.86
19	002572	索菲亚	116,400	3,201,000.00	1.83
20	002557	洽洽食品	54,200	3,085,606.00	1.76
21	300760	迈瑞医疗	9,689	3,034,594.80	1.73
22	002615	哈尔斯	485,900	3,022,298.00	1.72
23	03998	波司登	706,658	2,943,071.78	1.68
24	601000	唐山港	1,133,200	2,923,656.00	1.67
25	600809	山西汾酒	8,800	2,858,240.00	1.63
26	000963	华东医药	59,800	2,700,568.00	1.54
27	603609	禾丰股份	280,200	2,698,326.00	1.54
28	000895	双汇发展	91,700	2,686,810.00	1.53
29	300902	国安达	75,800	2,684,078.00	1.53
30	600612	老凤祥	63,615	2,657,834.70	1.52
31	301129	瑞纳智能	37,000	2,176,710.00	1.24
32	600872	中炬高新	62,000	2,145,820.00	1.22

33	01368	特步国际	170,500	2,070,500.51	1.18
34	002984	森麒麟	64,900	2,019,039.00	1.15
35	603520	司太立	70,641	1,986,424.92	1.13
36	002271	东方雨虹	38,400	1,976,448.00	1.13
37	01610	中粮家佳康	566,000	1,839,342.65	1.05
38	600298	安琪酵母	37,000	1,803,750.00	1.03
39	600036	招商银行	41,800	1,763,960.00	1.01
40	603916	苏博特	65,900	1,679,791.00	0.96
41	001201	东瑞股份	42,140	1,625,761.20	0.93
42	002311	海大集团	27,000	1,620,270.00	0.92
43	601137	博威合金	91,300	1,616,010.00	0.92
44	688016	心脉医疗	8,062	1,570,558.22	0.90
45	000883	湖北能源	216,500	1,106,315.00	0.63
46	600456	宝钛股份	15,900	944,460.00	0.54
47	002385	大北农	107,900	842,699.00	0.48
48	000932	华菱钢铁	162,200	825,598.00	0.47
49	688599	天合光能	12,570	820,192.50	0.47
50	300041	回天新材	46,400	805,968.00	0.46
51	603908	牧高笛	7,200	685,080.00	0.39
52	603259	药明康德	5,200	540,748.00	0.31
53	301076	新瀚新材	19,500	532,350.00	0.30
54	002507	涪陵榨菜	14,800	510,896.00	0.29
55	300610	晨化股份	26,700	497,421.00	0.28
56	000930	中粮科技	48,800	441,152.00	0.25
57	000999	华润三九	7,600	342,000.00	0.20
58	688320	禾川科技	2,754	127,262.34	0.07
59	688290	景业智能	2,027	95,005.49	0.05
60	301175	中科环保	20,382	77,859.24	0.04
61	301139	元道通信	1,978	76,073.88	0.04
62	688206	概伦电子	2,160	65,664.00	0.04
63	301233	盛帮股份	1,024	42,516.48	0.02
64	603051	鹿山新材	272	21,488.00	0.01
65	301155	海力风电	176	16,016.00	0.01
66	301073	君亭酒店	216	14,977.44	0.01
67	603230	内蒙新华	1,141	14,273.91	0.01
68	300986	志特新材	369	13,579.20	0.01
69	301215	中汽股份	1,961	12,530.79	0.01
70	001266	宏英智能	247	12,298.13	0.01
71	603215	比依股份	575	12,115.25	0.01
72	301101	明月镜片	234	12,011.22	0.01
73	301078	孩子王	753	11,038.98	0.01
74	301039	中集车辆	964	10,440.12	0.01

75	301111	粤万年青	379	10,392.18	0.01
76	301017	漱玉平民	555	10,289.70	0.01
77	301046	能辉科技	290	10,036.90	0.01
78	301120	新特电气	626	9,696.74	0.01
79	301020	密封科技	421	9,472.50	0.01
80	301048	金鹰重工	843	9,281.43	0.01
81	001234	泰慕士	333	9,017.64	0.01
82	300774	倍杰特	444	8,951.04	0.01
83	301021	英诺激光	290	8,758.00	0.00
84	301052	果麦文化	252	8,298.36	0.00
85	301090	华润材料	758	8,269.78	0.00
86	301133	金钟股份	286	7,942.22	0.00
87	301028	东亚机械	733	7,931.06	0.00
88	301122	采纳股份	112	7,881.44	0.00
89	301045	天禄科技	335	7,728.45	0.00
90	301256	华融化学	765	7,711.20	0.00
91	301026	浩通科技	203	7,486.64	0.00
92	603150	万朗磁塑	251	7,472.27	0.00
93	301098	金埔园林	307	7,444.75	0.00
94	301198	喜悦智行	327	7,373.85	0.00
95	301040	中环海陆	241	7,357.73	0.00
96	301038	深水规院	346	7,193.34	0.00
97	301268	铭利达	206	7,183.22	0.00
98	301288	清研环境	350	6,993.00	0.00
99	301027	华蓝集团	286	6,944.08	0.00
100	301199	迈赫股份	216	6,920.64	0.00
101	301066	万事利	482	6,873.32	0.00
102	301117	佳缘科技	124	6,750.56	0.00
103	301235	华康医疗	172	6,523.96	0.00
104	301055	张小泉	355	6,311.90	0.00
105	301158	德石股份	309	6,297.42	0.00
106	301130	西点药业	166	6,258.20	0.00
107	301081	严牌股份	403	6,077.24	0.00
108	301138	华研精机	197	6,057.75	0.00
109	300814	中富电路	328	6,002.40	0.00
110	301221	光庭信息	92	5,964.36	0.00
111	301083	百胜智能	416	5,807.36	0.00
112	301072	中捷精工	181	5,797.43	0.00
113	301162	国能日新	106	5,735.66	0.00
114	301212	联盛化学	171	5,690.88	0.00
115	301200	大族数控	109	5,659.28	0.00
116	301091	深城交	205	5,596.50	0.00

117	301097	天益医疗	115	5,500.45	0.00
118	301025	读客文化	403	5,311.54	0.00
119	301057	汇隆新材	218	5,308.30	0.00
120	301248	杰创智能	177	5,286.99	0.00
121	301236	软通动力	166	5,209.08	0.00
122	301182	凯旺科技	219	5,203.44	0.00
123	301056	森赫股份	572	4,953.52	0.00
124	301096	百诚医药	61	4,819.00	0.00
125	301032	新柴股份	513	4,770.90	0.00
126	301137	哈焊华通	296	4,733.04	0.00
127	301135	瑞德智能	178	4,674.28	0.00
128	301206	三元生物	102	4,660.38	0.00
129	301049	超越科技	196	4,647.16	0.00
130	301036	双乐股份	205	4,608.40	0.00
131	301102	兆讯传媒	147	4,570.23	0.00
132	301033	迈普医学	108	4,547.88	0.00
133	301190	善水科技	190	4,508.70	0.00
134	301109	军信股份	276	4,454.64	0.00
135	301219	腾远钴业	50	4,391.00	0.00
136	301100	风光股份	202	4,359.16	0.00
137	301059	金三江	259	4,351.20	0.00
138	301063	海锅股份	153	4,262.58	0.00
139	301041	金百泽	215	4,237.65	0.00
140	301037	保立佳	193	4,215.12	0.00
141	301222	浙江恒威	145	4,199.20	0.00
142	300854	中兰环保	203	4,035.64	0.00
143	301237	和顺科技	96	4,018.56	0.00
144	301148	嘉戎技术	168	4,015.20	0.00
145	301207	华兰疫苗	71	4,005.82	0.00
146	301181	标榜股份	125	3,823.75	0.00
147	600150	中国船舶	200	3,796.00	0.00
148	301093	华兰股份	111	3,761.79	0.00
149	301216	万凯新材	126	3,759.84	0.00
150	301179	泽宇智能	92	3,754.52	0.00
151	301258	富士莱	89	3,709.52	0.00
152	301053	远信工业	155	3,620.80	0.00
153	301068	大地海洋	144	3,477.60	0.00
154	301079	邵阳液压	140	3,472.00	0.00
155	301092	争光股份	109	3,429.14	0.00
156	301189	奥尼电子	102	3,397.62	0.00
157	300834	星辉环材	110	3,303.30	0.00
158	301108	洁雅股份	79	3,126.03	0.00

159	301110	青木股份	70	2,789.50	0.00
160	301088	戎美股份	133	2,481.78	0.00
161	06186	中国飞鹤	307	2,368.14	0.00
162	301196	唯科科技	63	2,363.76	0.00
163	600176	中国巨石	100	1,741.00	0.00
164	688779	长远锂科	19	380.00	0.00
165	002124	天邦食品	14	94.08	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	002385	大北农	8,256,345.00	4.20
2	300993	玉马遮阳	6,980,962.56	3.55
3	603908	牧高笛	5,903,777.00	3.00
4	002003	伟星股份	5,841,510.00	2.97
5	600702	舍得酒业	5,571,667.00	2.83
6	600195	中牧股份	5,373,162.00	2.73
7	300873	海晨股份	5,357,020.20	2.73
8	603558	健盛集团	5,339,541.00	2.72
9	600809	山西汾酒	5,305,423.00	2.70
10	600223	鲁商发展	5,022,114.00	2.55
11	300896	爱美客	4,858,455.00	2.47
12	002100	天康生物	4,761,513.00	2.42
13	002572	索菲亚	4,633,170.70	2.36
14	301177	迪阿股份	4,627,131.39	2.35
15	688696	极米科技	4,586,227.28	2.33
16	002304	洋河股份	4,467,222.00	2.27
17	605080	浙江自然	4,383,312.00	2.23
18	002867	周大生	4,326,919.00	2.20
19	300750	宁德时代	4,180,112.90	2.13
20	002468	申通快递	4,112,748.00	2.09
21	002832	比音勒芬	3,959,317.00	2.01

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600887	伊利股份	16,648,272.00	8.47
2	603520	司太立	14,919,913.08	7.59
3	600223	鲁商发展	13,417,755.85	6.83

4	688301	奕瑞科技	11,430,896.88	5.82
5	600519	贵州茅台	10,929,268.00	5.56
6	002557	洽洽食品	9,766,031.00	4.97
7	603908	牧高笛	9,639,923.00	4.90
8	300760	迈瑞医疗	9,519,448.00	4.84
9	605186	健麾信息	8,215,649.10	4.18
10	688677	海泰新光	7,548,018.88	3.84
11	002003	伟星股份	6,342,212.20	3.23
12	300993	玉马遮阳	5,998,686.68	3.05
13	603233	大参林	5,844,366.80	2.97
14	002385	大北农	5,540,323.00	2.82
15	603558	健盛集团	5,430,341.00	2.76
16	002262	恩华药业	5,111,890.00	2.60
17	300896	爱美客	4,603,927.00	2.34
18	000661	长春高新	4,399,467.00	2.24
19	600975	新五丰	4,283,763.00	2.18
20	000568	泸州老窖	4,181,143.00	2.13
21	002928	华夏航空	4,069,057.00	2.07
22	002832	比音勒芬	4,004,550.00	2.04

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

7.4.3 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	370,899,069.04
卖出股票收入（成交）总额	385,332,164.10

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辩护，现货市场与期货市场的相关性等因素，计算需要用到的期货合约数量，对这个数量进行动态跟踪与测算，并进行适时灵活调整。同时，综合考虑各个月份期货合约之间的定价关系、套利机会、流动性以及保证金要求等因素，在各个月份期货合约之间进行动态配置，通过空头部分的优化创造额外收益。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

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

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资于国债期货。

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

基金投资前十名证券的发行主体未有被监管部门立案调查或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	59,651.63
2	应收清算款	3,367,343.14
3	应收股利	22,635.75
4	应收利息	-
5	应收申购款	31,346.81
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,480,977.33

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
泰达消费服务混合 A	2,273	85,315.07	992,063.49	0.51	192,929,094.47	99.49
泰达消费服务混合 C	3,147	5,931.52	-	-	18,666,480.62	100.00
合计	5,420	39,222.81	992,063.49	0.47	211,595,575.09	99.53

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	泰达消费服务混合 A	50,186.69	0.0259
	泰达消费服务混合 C	2,014.40	0.0108
	合计	52,201.09	0.0246

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	泰达消费服务混合 A	-
	泰达消费服务混合 C	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	泰达消费服务混合 A	0~10
	泰达消费服务混合 C	0
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	泰达消费服务混合 A	泰达消费服务混合 C
基金合同生效日 (2021 年 3 月 16 日) 基金份额总额	384,020,421.67	19,324,512.36
本报告期期初基金份额总额	204,262,304.13	21,320,104.18
本报告期基金总申购份额	2,648,159.14	3,228,460.08
减：本报告期基金总赎回份额	12,989,305.31	5,882,083.64
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	193,921,157.96	18,666,480.62

§ 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人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金无投资策略的变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
德邦证券	1	207,644,726.83	27.57	193,380.44	27.68	-
西南证券	2	97,274,875.81	12.91	90,593.27	12.97	-
中信建投	3	91,786,995.15	12.18	85,483.39	12.24	-
西部证券	1	88,090,722.78	11.69	82,039.87	11.75	-
东方财富	1	66,792,314.91	8.87	62,201.75	8.90	-
中金公司	1	54,364,551.19	7.22	50,628.42	7.25	-
天风证券	1	46,584,127.26	6.18	43,383.92	6.21	-
海通证券	2	46,382,643.22	6.16	43,196.32	6.18	-
中信证券	3	23,066,975.13	3.06	18,453.59	2.64	-
东吴证券	2	13,819,789.22	1.83	12,870.37	1.84	-
广发证券	1	13,064,517.96	1.73	12,167.70	1.74	-
国泰君安	1	4,411,030.69	0.59	4,107.80	0.59	-

安信证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
财信证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	3	-	-	-	-	-
东亚前海	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
太平洋	2	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
新时代证 券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
-	1	-	-	-	-	-

注：(一)本基金本报告期新增开源证券 54492、浙商证券 394505、国联证券 55438、平安证券 55440、信达证券 38460 交易单元。

(二) 交易单元选择的标准和程序

基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其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 (%)
德邦证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	1,700,000.00	100.00	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	289,695.84	100.00	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
财信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东亚前海	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-

江海证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
太平洋	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
新时代证 券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
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