

泰达宏利同顺大数据量化优选灵活配置混 合型证券投资基金 2020 年中期报告

2020 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：2020 年 8 月 29 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 2020 年 8 月 27 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 2020 年 1 月 1 日起至 2020 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
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.....	16
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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.....	17
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.....	17
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	18
6.1 资产负债表.....	18
6.2 利润表.....	19
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20

6.4 报表附注.....	21
§7 投资组合报告.....	41
7.1 期末基金资产组合情况.....	41
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	41
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.....	42
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.....	49
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.....	49
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.....	49
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.....	49
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.....	49
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	49
7.12 投资组合报告附注.....	50
§8 基金份额持有人信息.....	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	51
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的情况.....	51
§9 开放式基金份额变动.....	53
§10 重大事件揭示.....	54
10.1 基金份额持有人大会决议.....	54
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	54
10.4 基金投资策略的改变.....	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	54
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	54
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	57
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况.....	57
§12 备查文件目录.....	58

12.1 备查文件目录.....	58
12.2 存放地点.....	58
12.3 查阅方式.....	58

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泰达宏利同顺大数据量化优选灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	泰达宏利大数据混合	
基金主代码	002263	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 2 月 23 日	
基金管理人	泰达宏利基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	57,599,282.39 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	泰达宏利大数据混合 A	泰达宏利大数据混合 C
下属分级基金的交易代码:	002263	003554
报告期末下属分级基金的份额总额	57,450,554.67 份	148,727.72 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采取大类资产配置策略，同时通过计算机算法分析互联网大数据，采用数量化投资方法挖掘潜在投资机会，在严格控制风险的前提下，力争为基金份额持有人创造持久的、稳定的、较高的超业绩比较基准收益
投资策略	本基金通过综合分析互联网大数据所反映的投资者行为作为主线，通过量化投资方式精选个股。一方面，本基金在对投资者整体行为趋势研究的基础上，从“自上而下”的角度对大类资产进行优化配置，并优选受益行业；另一方面，本基金凭借多年来不断积累形成的量化选股框架，从网络点击量等互联网行为数据方面出发，适当结合估值、成长、盈利质量、情绪等因子，以“自下而上”的视角精选出具有较好公司质地但被投资者低估的投资机会，力求在抵御各类风险的前提下获取超越平均水平的良好回报
业绩比较基准	50%*中证 800 指数收益率+50%*中证综合债指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		泰达宏利基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张强	许俊
	联系电话	010-66577762	010-66594319
	电子邮箱	irm@mfteda.com	fcid@bankofchina.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	弓劲梅	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	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http:// www.mfcteda.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	泰达宏利大数据混合 A	泰达宏利大数据混合 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020年1月1日 - 2020年6月30日)	报告期(2020年1月1日 - 2020年6月30日)
本期已实现收益	8,800,676.23	33,174.94
本期利润	14,867,310.55	35,660.16
加权平均基金份额本期利润	0.2486	0.1469
本期加权平均净值利润率	18.25%	10.91%
本期基金份额净值增长率	19.55%	19.35%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)	
期末可供分配利润	24,884,198.54	63,105.12
期末可供分配基金份额利润	0.4331	0.4243
期末基金资产净值	89,830,136.67	231,048.02
期末基金份额净值	1.5636	1.5535
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	56.36%	33.81%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

泰达宏利大数据混合 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	10.93%	0.89%	3.50%	0.43%	7.43%	0.46%
过去三个月	23.46%	0.97%	6.61%	0.47%	16.85%	0.50%
过去六个月	19.55%	1.54%	3.52%	0.76%	16.03%	0.78%
过去一年	31.05%	1.22%	8.57%	0.61%	22.48%	0.61%
过去三年	33.74%	1.25%	14.00%	0.63%	19.74%	0.62%
自基金合同生效起至今	56.36%	1.17%	22.38%	0.59%	33.98%	0.58%

泰达宏利大数据混合 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	10.90%	0.89%	3.50%	0.43%	7.40%	0.46%
过去三个月	23.36%	0.97%	6.61%	0.47%	16.75%	0.50%
过去六个月	19.35%	1.54%	3.52%	0.76%	15.83%	0.78%
过去一年	30.74%	1.23%	8.57%	0.61%	22.17%	0.62%
过去三年	33.02%	1.25%	14.00%	0.63%	19.02%	0.62%
自基金合同生效起至今	33.81%	1.21%	17.40%	0.60%	16.41%	0.61%

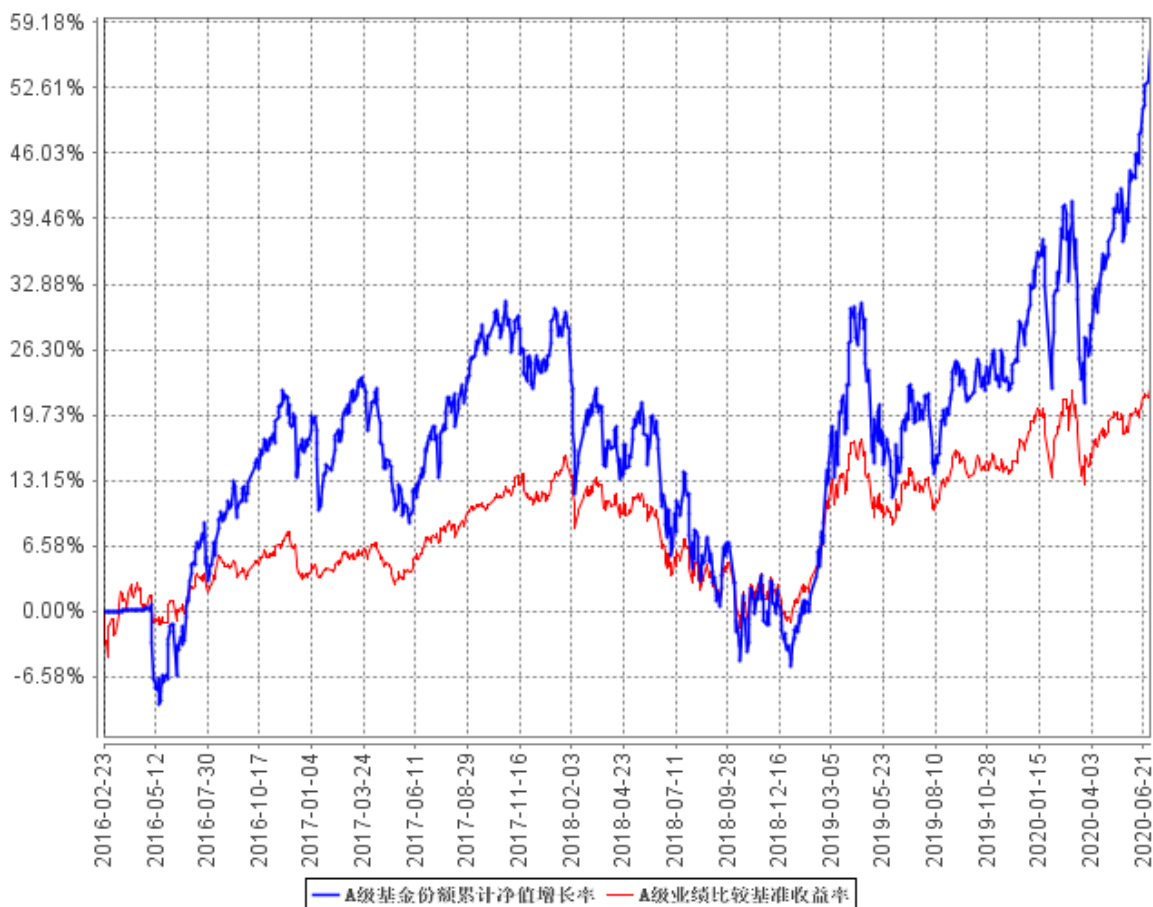
注：本基金的业绩比较基准：中证 800 指数收益率*50%+中证综合债指数收益率*50%。

中证 800 指数是由中证指数有限公司编制，中证 500 和沪深 300 成份股一起构成中证 800 指数成份股，中证 800 指数综合反映沪深证券市场内大中小市值公司的整体状况，具有良好的市场代表性。中证综合债券指数由中证指数有限公司编制，是综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央行及短融整体走势的跨市场债券指数，较全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势，为债券投资者提供更切合的市场基准。

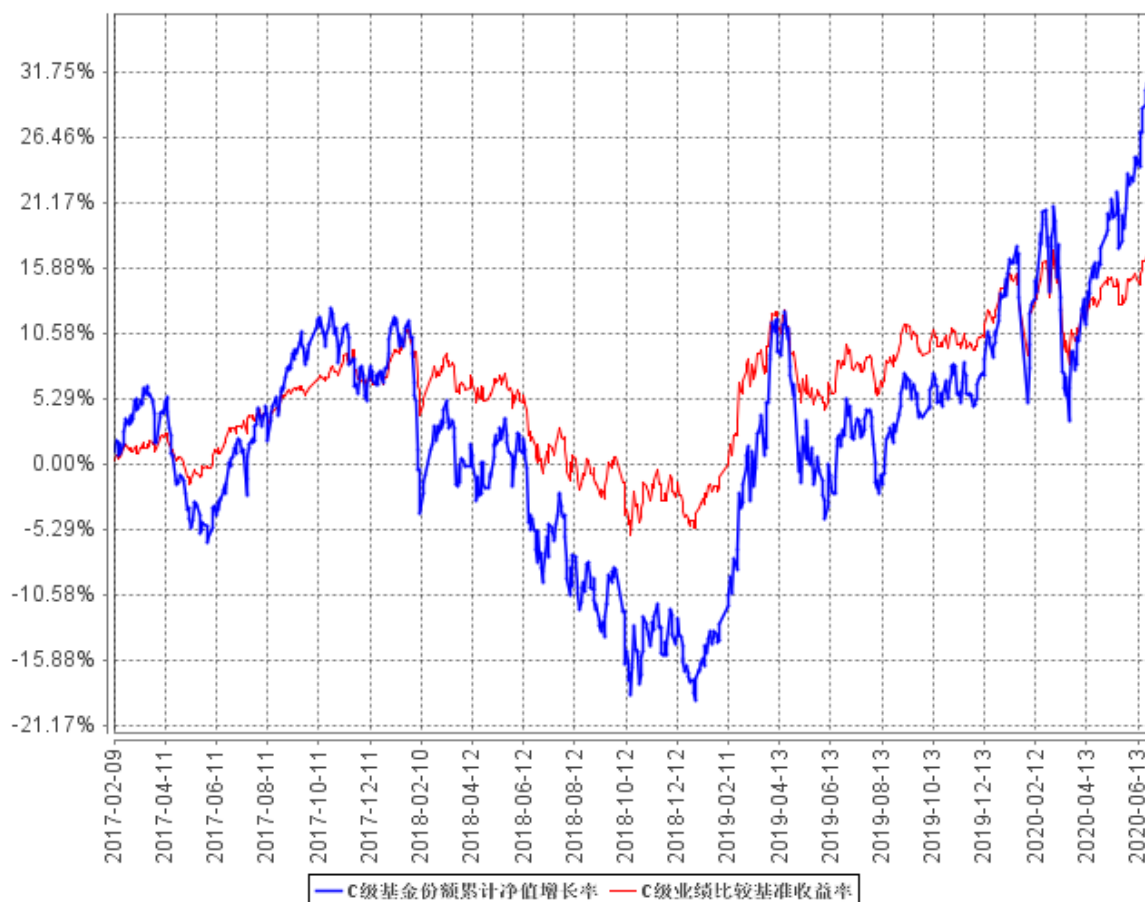
本基金是混合型基金，基金在运作过程中股票资产占基金资产的比例为 0%-95%，其余资产投资于债券、货币市场工具、股指期货、债券回购、权证、资产支持证券等金融工具。因此，“50%*中证 800 指数收益率+50%*中证综合债指数收益率”是适合衡量本基金投资业绩的比较基准。

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

A级基金份额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



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金 A 类份额成立于 2016 年 2 月 23 日，C 类份额成立于 2017 年 2 月 9 日，本基金在建仓期结束时及截止报告期末各项投资比例已达到基金合同规定的比例要求。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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、泰达宏利同顺大数据量化优选灵活配置混合型证券投资基金、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、泰达宏利定宏混合型证券投资基金、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、泰达宏利睿选稳健灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利启富灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利业绩驱动量化股票型证券投资基金、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）、泰达宏利鑫利半年定期开放债券型证券投资基金、泰达宏利永利债券型证券投资基金、

泰达宏利品牌升级混合型证券投资基金、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在内的五十多只证券投资基金。

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘欣	本基金基金经理；投资副总监	2016年2月23日	-	13	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，现担任公司投资副总监兼基金经理；具备13年基金从业经验，13年证券投资管理经验，具有基金从业资格。
刘洋	本基金基金经理助理	2017年4月21日	-	5	北京大学理学硕士；2015年1月至2015年4月就职于九坤投资（北京）有限公司，2015年5月加入泰达宏利基金管理有限公司，任职于金融工程部，先后担任助理研究员、研究员、基金经理助理等职务，现担任基金经理；具备5年证券投资管理经验，具有基金从业资格。
李婷婷	本基金基金经理助理	2019年11月18日	-	3	北京大学金融硕士，2017年7月加入泰达宏利基金管理有限公司，曾任助理研究员，现任基金经理助理，具备3年基金从业经

					验，具有基金从业资格。
--	--	--	--	--	-------------

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

上半年对市场影响最大的因素是新冠疫情，对全球各国均产生深远影响，其对经济影响之大，持续时间之长，蔓延性之广，乃至对地缘政治的影响均超出预期。全球股票市场伴随新冠疫情爆发在一季度均表现不佳。而为应对疫情对经济冲击，全球各国的宽松货币政策带来的对股票市场的向上冲击也在二季度超出预期。二季度随着国内疫情率先得到控制，影响逐渐降低，各地陆续复工复产，各项经济指标均有所恢复，叠加相对宽松的货币环境，A 股整体持续上行。从结构上看，外资青睐的大消费行业、受益国外疫情的医疗设备行业、受益国家经济转型的科技股涨幅较

大，而低估值股票持续滞涨。从全球来看，资本市场给予确定性增长的消费、高景气度的科技很高的溢价，已经达到历史极值水平，越来越多的投资者认为持续高景气可以摆脱估值的束缚。

本基金在操作中，有效的进行了结构性调整。在以投资者行为大数据分析为主要策略下，兼顾成长、估值、景气等因素，持续选取具有超额收益的股票。在持仓结构上分散由于市场风格大幅波动造成的风险。本报告期内，本基金增加了医药行业、电力设备行业及新能源行业、基础化工行业的配置，减少了计算机行业、国防军工行业、家电行业的配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末泰达宏利大数据混合 A 基金份额净值为 1.5636 元，本报告期基金份额净值增长率为 19.55%；截至本报告期末泰达宏利大数据混合 C 基金份额净值为 1.5535 元，本报告期基金份额净值增长率为 19.35%；同期业绩比较基准收益率为 3.52%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，在资产配置上，我们维持当前是 A 股非常好的长期买点的观点。根据 wind 数据统计，目前沪深 300 市盈率仅 13 倍，在历史上看中性偏低，而中国仍是世界上经济增速最快的国家之一，龙头企业 ROE 仍保持在 15%以上。而债券资产当前收益率较低，相对排序在股票之后。目前债券收益率已经开始上行，有所反弹。风格上，我们仍维持相对看好绩优蓝筹股的观点，其核心支撑仍来自于外资的流入改善 A 股资金结构，促进估值修正。我们尤其提示关注传统低估值行业在年底的投资机会。根据研究，当前无论中美，高估值新兴行业对低估值传统行业的估值差都到了历史极值位置，随时可能酝酿短期尖锐的估值反转，极端情形可能类似 2012 或 2014 年底，通常此类风格切换发生在四季度。在过去两年，低估值策略持续跑输高盈利和高成长行业。同过往几个季度季报观点相同，我们重申 A 股主要风险来自美股过高的估值下杀带来的潜在金融危机风险，这一情况已经在一季度有所展现，未来预计此风险会逐渐缓释。但我们必须关注，即使在下落之后，美股估值依然不低。结合风格转换的观点，往往风格转换发生在市场的短期拐点上。从下半年角度看，看好的顺序依次是低估值股票、高盈利消费、科技成长行业；就长期看，看好顺序为高盈利消费、科技成长行业、低估值股票，其中科技成长类受技术进步和风险偏好影响，有较大的不确定性。

基于基金合同与投资策略，我们的配置偏向于具有真实业绩成长、估值合理且未被充分挖掘的股票。在交易时机上，本基金充分借鉴投资者行为大数据，选取情绪相对低迷的时点参与，在情绪过度亢奋期退出。本基金在持仓上相对分散，以平衡组合风险。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委

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”）在对泰达宏利同顺大数据量化优选灵活配置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”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：泰达宏利同顺大数据量化优选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	6,501,027.97	8,343,757.19
结算备付金		526,711.04	361,527.57
存出保证金		43,347.74	46,930.77
交易性金融资产	6.4.7.2	83,991,077.72	67,703,486.09
其中：股票投资		83,991,077.72	67,703,486.09
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		23,198.12	-
应收利息	6.4.7.5	833.91	1,168.93
应收股利		-	-
应收申购款		17,492.86	8,699.26
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		91,103,689.36	76,465,569.81
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 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		-	-
应付证券清算款		419.25	-
应付赎回款		599,846.85	141,207.34
应付管理人报酬		105,714.84	130,678.16
应付托管费		17,619.15	21,779.70
应付销售服务费		58.57	1,620.62
应付交易费用	6.4.7.7	228,344.51	420,821.58
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	90,501.50	140,040.65
负债合计		1,042,504.67	856,148.05
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	57,599,282.39	57,813,467.23
未分配利润	6.4.7.10	32,461,902.30	17,795,954.53
所有者权益合计		90,061,184.69	75,609,421.76
负债和所有者权益总计		91,103,689.36	76,465,569.81

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，泰达宏利大数据混合 A 基金份额净值 1.5636 元，基金份额总额 57,450,554.67 份；泰达宏利大数据混合 C 基金份额净值 1.5535 元，基金份额总额 148,727.72 份。泰达宏利大数据混合份额总额合计为 57,599,282.39 份。

6.2 利润表

会计主体：泰达宏利同顺大数据量化优选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		16,599,103.07	14,224,885.43
1.利息收入		21,931.48	16,503.58
其中：存款利息收入	6.4.7.11	21,931.48	16,503.58
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）		10,500,416.26	7,393,254.11
其中：股票投资收益	6.4.7.12	9,796,888.10	6,845,137.95
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	703,528.16	548,116.16
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	6,069,119.54	6,806,697.15
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	7,635.79	8,430.59
减：二、费用		1,696,132.36	995,659.13
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	610,034.46	448,332.08
2. 托管费	6.4.10.2.2	101,672.44	74,722.02
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	510.91	628.46
4. 交易费用	6.4.7.19	882,292.21	392,173.47
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	101,622.34	79,803.10
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		14,902,970.71	13,229,226.30
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		14,902,970.71	13,229,226.30

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰达宏利同顺大数据量化优选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	57,813,467.23	17,795,954.53	75,609,421.76
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	14,902,970.71	14,902,970.71
三、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）	-214,184.84	-237,022.94	-451,207.78
其中：1.基金申购款	17,191,815.28	5,688,150.69	22,879,965.97
2.基金赎回款	-17,406,000.12	-5,925,173.63	-23,331,173.75
四、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）	-	-	-

据量化优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 2 月 23 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 393,925,399.10 份基金份额，其中认购资金利息折合 208,509.21 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”）。

经与托管行协商一致并报中国证监会备案，本基金自 2017 年 2 月 9 日起增加收取销售服务费的 C 类份额，本基金的原有基金份额全部自动划归为该基金 A 类基金份额类别，A 类份额的各项业务规则与原基金合同相同。详情参见管理人于 2017 年 2 月 7 日发布的《关于泰达宏利改革动力混合、财富大盘指数与大数据混合基金修改基金合同及托管协议的公告》。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利同顺大数据量化优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、债券回购、资产支持证券、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金股票资产占基金资产的比例为 0%-95%，其余资产投资于债券、货币市场工具、股指期货、权证、资产支持证券等金融工具。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，股指期货的投资比例遵循国家相关法律法规。本基金的业绩比较基准为 50%*中证 800 指数收益率+50%*中证综合债指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 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 重要会计政策和会计估计

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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无会计政策的变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无会计估计的变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无重大会计差错发生。

6.4.6 税项

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

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在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 2020 年 6 月 30 日
活期存款	6,501,027.97
定期存款	-
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	-
合计：	6,501,027.97

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	75,808,516.34	83,991,077.72	8,182,561.38
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	75,808,516.34	83,991,077.72	8,182,561.38

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产和负债。

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。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应收活期存款利息	603.24
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	209.97
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	20.70
合计	833.91

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	228,344.51
银行间市场应付交易费用	-
合计	228,344.51

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	993.90
应付证券出借违约金	-
预提费用	89,507.60
合计	90,501.50

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

泰达宏利大数据混合 A		
项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	57,222,125.78	57,222,125.78
本期申购	17,119,084.78	17,119,084.78
本期赎回(以“-”号填列)	-16,890,655.89	-16,890,655.89
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	57,450,554.67	57,450,554.67

金额单位：人民币元

泰达宏利大数据混合 C		
项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	591,341.45	591,341.45
本期申购	72,730.50	72,730.50
本期赎回(以“-”号填列)	-515,344.23	-515,344.23
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	148,727.72	148,727.72

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

泰达宏利大数据混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	16,393,427.17	1,224,190.53	17,617,617.70
本期利润	8,800,676.23	6,066,634.32	14,867,310.55
本期基金份额交易产生的变动数	-309,904.86	204,558.61	-105,346.25
其中：基金申购款	5,194,292.31	466,894.58	5,661,186.89
基金赎回款	-5,504,197.17	-262,335.97	-5,766,533.14
本期已分配利润	-	-	-
本期末	24,884,198.54	7,495,383.46	32,379,582.00

单位：人民币元

泰达宏利大数据混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	166,017.95	12,318.88	178,336.83
本期利润	33,174.94	2,485.22	35,660.16
本期基金份额交易产生的变动数	-136,087.77	4,411.08	-131,676.69
其中：基金申购款	25,133.69	1,830.11	26,963.80
基金赎回款	-161,221.46	2,580.97	-158,640.49
本期已分配利润	-	-	-
本期末	63,105.12	19,215.18	82,320.30

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
活期存款利息收入	17,290.61
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	81.97
结算备付金利息收入	3,896.79
其他	662.11
合计	21,931.48

6.4.7.11.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	288,656,246.41
减：卖出股票成本总额	278,859,358.31

买卖股票差价收入	9,796,888.10
----------	--------------

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期末有债券投资收益-买卖债券差价收入。

6.4.7.12.3 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。

6.4.7.12.4 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。

6.4.7.12.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

6.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.13.2 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。

6.4.7.13.3 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。

6.4.7.13.4 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。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具收益-其他投资收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	703,528.16
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	703,528.16

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1. 交易性金融资产	6,069,119.54
——股票投资	6,069,119.54
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——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	6,069,119.54

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	7,633.00
基金转换费收入	2.79
合计	7,635.79

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

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

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	882,292.21
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	882,292.21

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	29,835.26
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
账户维护费	9,000.00
银行费用	3,114.74
合计	101,622.34

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 2020年1月1日至2020年6 月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	610,034.46	448,332.08
其中：支付销售机构的客户维护费	106,392.00	169,614.48

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：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.50% / 当年天数。上述相关费用包含实际支付金额和税金。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6 月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30 日
当期发生的基金应支付	101,672.44	74,722.02

的托管费		
------	--	--

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%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泰达宏利大数据混合 A	泰达宏利大数据混合 C	合计
泰达宏利基金管理有限公司	-	-	-
合计	-	-	-
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泰达宏利大数据混合 A	泰达宏利大数据混合 C	合计
泰达宏利基金管理有限公司	-	0.14	0.14
合计	-	0.14	0.14

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用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 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	6,501,027.97	17,290.61	3,154,910.81	14,662.30

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

本基金本报告期及上年可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2020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	可流通日	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
688568	中科星图	2020年6月30日	2020年7月8日	新股流通受限	16.21	16.21	3,581	58,048.01	58,048.01	

688277	天智航	2020年6月24日	2020年7月7日	新股流通受限	12.04	12.04	4,312	51,916.48	51,916.48	-
688528	秦川物联	2020年6月19日	2020年7月1日	新股流通受限	11.33	11.33	3,855	43,677.15	43,677.15	-
688377	迪威尔	2020年6月29日	2020年7月8日	新股流通受限	16.42	16.42	2,485	40,803.70	40,803.70	-
688027	国盾量子	2020年6月30日	2020年7月9日	新股流通受限	36.18	36.18	1,084	39,219.12	39,219.12	-
688600	皖仪科技	2020年6月23日	2020年7月3日	新股流通受限	15.50	15.50	2,460	38,130.00	38,130.00	-
300845	捷安高科	2020年6月24日	2020年7月3日	新股流通受限	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300840	酷特智能	2020年6月30日	2020年7月8日	新股流通受限	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
300846	首都在线	2020年6月22日	2020年7月1日	新股流通受限	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-
688004	博汇科技	2020年6月5日	2020年12月14日	新股流通受限	28.77	71.90	1,250	35,962.50	89,875.00	-

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。

2、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。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

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

本基金为混合型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资及债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是采取大类资产配置策略，同时通过计算机算法分析互联网大数据，采用数量化投资方法挖掘潜在投资机会，在严格控制风险的前提下，力争为基金份额持有人创造持久的、稳定的、较高的超业绩比较基准收益。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

于 2020 年 6 月 30 日，本基金未持有债券、资产支持证券和同业存单（2019 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 2020 年 6 月 30 日，除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额将在一个月以内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行

持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市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 2020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	6,501,027.97	-	-	-	6,501,027.97
结算备付金	526,711.04	-	-	-	526,711.04
存出保证金	43,347.74	-	-	-	43,347.74
交易性金融资产	-	-	-	83,991,077.72	83,991,077.72
应收证券清算款	-	-	-	23,198.12	23,198.12
应收利息	-	-	-	833.91	833.91
应收申购款	-	-	-	17,492.86	17,492.86
资产总计	7,071,086.75	-	-	84,032,602.61	91,103,689.36
负债					
应付证券清算款	-	-	-	419.25	419.25
应付赎回款	-	-	-	599,846.85	599,846.85
应付管理人报酬	-	-	-	105,714.84	105,714.84
应付托管费	-	-	-	17,619.15	17,619.15
应付销售服务费	-	-	-	58.57	58.57
应付交易费用	-	-	-	228,344.51	228,344.51
其他负债	-	-	-	90,501.50	90,501.50
负债总计	-	-	-	1,042,504.67	1,042,504.67
利率敏感度缺口	7,071,086.75	-	-	82,990,097.94	90,061,184.69
上年度末 2019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	8,343,757.19	-	-	-	8,343,757.19
结算备付金	361,527.57	-	-	-	361,527.57
存出保证金	46,930.77	-	-	-	46,930.77
交易性金融资产	-	-	-	67,703,486.09	67,703,486.09
应收利息	-	-	-	1,168.93	1,168.93
应收申购款	-	-	-	8,699.26	8,699.26
其他资产	-	-	-	-	-

资产总计	8,752,215.53	-	-	67,713,354.28	76,465,569.81
负债					
应付赎回款	-	-	-	141,207.34	141,207.34
应付管理人报酬	-	-	-	130,678.16	130,678.16
应付托管费	-	-	-	21,779.70	21,779.70
应付销售服务费	-	-	-	1,620.62	1,620.62
应付交易费用	-	-	-	420,821.58	420,821.58
其他负债	-	-	-	140,040.65	140,040.65
负债总计	-	-	-	856,148.05	856,148.05
利率敏感度缺口	8,752,215.53	-	-	66,857,206.23	75,609,421.76

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 2020 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2019 年 12 月 31 日：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2019 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，自上而下决定债券组合久期、期限结构配置及债券类别配置；同时在严谨深入的信用分析基础上，综合考量企业债券的信用评级以及各类债券的流动性、供求关系和收益率水平等，自下而上地精选具有较高投资价值的个券。同时，本基金深度关注股票市场的运行状况与相应风险收益特征，在严格控制基金资产运作风险的基础上，把握投资机会。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产占基金资产的比例为 0%-95%，其余资产投资于债券、货币市场工具、股指期货、权证、资产支持证券等金融工具；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持

有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 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	83,991,077.72	93.26	67,703,486.09	89.54
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	83,991,077.72	93.26	67,703,486.09	89.54

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	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（2020 年 6 月 30 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	4,300,000.00	3,580,000.00
业绩比较基准下降 5%	-4,300,000.00	-3,580,000.00	

6.4.14 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	83,991,077.72	92.19
	其中：股票	83,991,077.72	92.19
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	7,027,739.01	7.71
8	其他各项资产	84,872.63	0.09
9	合计	91,103,689.36	100.00

7.2 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	45,780.00	0.05
B	采矿业	1,123,270.00	1.25
C	制造业	56,080,944.77	62.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,278,771.32	1.42
E	建筑业	73,100.00	0.08
F	批发和零售业	4,546,787.44	5.05
G	交通运输、仓储和邮政业	663,454.00	0.74
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,242,394.83	5.82
J	金融业	6,007,160.00	6.67
K	房地产业	4,244,437.48	4.71
L	租赁和商务服务业	1,757,174.24	1.95
M	科学研究和技术服务业	2,927,803.64	3.25
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-

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	83,991,077.72	93.26

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

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	占基金资产净值比例（%）
1	600276	恒瑞医药	40,050	3,696,615.00	4.10
2	600867	通化东宝	190,600	3,322,158.00	3.69
3	300124	汇川技术	81,353	3,090,600.47	3.43
4	600519	贵州茅台	1,600	2,340,608.00	2.60
5	600585	海螺水泥	37,800	1,999,998.00	2.22
6	600036	招商银行	57,100	1,925,412.00	2.14
7	600507	方大特钢	366,900	1,904,211.00	2.11
8	300760	迈瑞医疗	6,000	1,834,200.00	2.04
9	002624	完美世界	31,400	1,809,896.00	2.01
10	600309	万华化学	36,100	1,804,639.00	2.00
11	601888	中国中免	11,408	1,757,174.24	1.95
12	300012	华测检测	88,439	1,747,554.64	1.94
13	603369	今世缘	43,300	1,722,907.00	1.91
14	603899	晨光文具	31,500	1,719,900.00	1.91
15	300014	亿纬锂能	34,034	1,628,526.90	1.81
16	600406	国电南瑞	75,237	1,523,549.25	1.69
17	601818	光大银行	393,700	1,409,446.00	1.56
18	603288	海天味业	10,220	1,271,368.00	1.41
19	600048	保利地产	81,116	1,198,894.48	1.33
20	603018	中设集团	121,300	1,180,249.00	1.31
21	002475	立讯精密	19,700	1,011,595.00	1.12
22	603708	家家悦	19,344	952,885.44	1.06
23	601012	隆基股份	23,239	946,524.47	1.05
24	300059	东方财富	46,300	935,260.00	1.04
25	603501	韦尔股份	4,600	928,970.00	1.03
26	600529	山东药玻	15,900	922,200.00	1.02

27	600031	三一重工	49,100	921,116.00	1.02
28	300684	中石科技	26,500	919,550.00	1.02
29	600173	卧龙地产	195,400	912,518.00	1.01
30	603228	景旺电子	25,720	905,086.80	1.00
31	600690	海尔智家	50,900	900,930.00	1.00
32	600261	阳光照明	249,200	884,660.00	0.98
33	603444	吉比特	1,600	878,416.00	0.98
34	600731	湖南海利	123,100	874,010.00	0.97
35	603345	安井食品	7,400	873,200.00	0.97
36	603679	华体科技	22,200	872,682.00	0.97
37	300699	光威复材	13,300	834,309.00	0.93
38	603801	志邦家居	29,800	795,362.00	0.88
39	600998	九州通	41,900	780,178.00	0.87
40	300394	天孚通信	13,000	774,150.00	0.86
41	600900	长江电力	39,700	751,918.00	0.83
42	603019	中科曙光	19,376	744,038.40	0.83
43	600705	中航资本	185,200	733,392.00	0.81
44	300206	理邦仪器	38,700	705,888.00	0.78
45	603939	益丰药房	7,700	700,700.00	0.78
46	603611	诺力股份	31,904	684,659.84	0.76
47	603730	岱美股份	21,200	683,700.00	0.76
48	600426	华鲁恒升	38,200	675,376.00	0.75
49	601872	招商轮船	113,800	663,454.00	0.74
50	600466	蓝光发展	119,100	641,949.00	0.71
51	601899	紫金矿业	145,500	640,200.00	0.71
52	600094	大名城	103,800	617,610.00	0.69
53	600732	爱旭股份	56,100	605,319.00	0.67
54	601128	常熟银行	79,800	599,298.00	0.67
55	601636	旗滨集团	98,000	580,160.00	0.64
56	603313	梦百合	24,100	567,073.00	0.63
57	600760	中航沈飞	16,900	554,658.00	0.62
58	601933	永辉超市	58,500	548,730.00	0.61
59	600346	恒力石化	37,400	523,600.00	0.58
60	600051	宁波联合	59,300	520,061.00	0.58
61	600131	国网信通	27,100	514,087.00	0.57
62	300462	华铭智能	22,100	501,228.00	0.56
63	603609	禾丰牧业	33,600	500,640.00	0.56
64	300595	欧普康视	7,000	485,380.00	0.54
65	601225	陕西煤业	67,000	483,070.00	0.54

66	603668	天马科技	47,200	475,304.00	0.53
67	603777	来伊份	27,500	462,550.00	0.51
68	600804	鹏博士	51,300	460,674.00	0.51
69	603301	振德医疗	8,160	420,648.00	0.47
70	603208	江山欧派	4,310	419,794.00	0.47
71	600201	生物股份	14,500	403,680.00	0.45
72	002821	凯莱英	1,600	388,800.00	0.43
73	603129	春风动力	5,700	388,797.00	0.43
74	600741	华域汽车	17,800	370,062.00	0.41
75	603005	晶方科技	4,520	355,543.20	0.39
76	600976	健民集团	18,900	339,633.00	0.38
77	300601	康泰生物	2,000	324,320.00	0.36
78	300390	天华超净	21,500	299,495.00	0.33
79	603506	南都物业	9,300	276,861.00	0.31
80	300214	日科化学	33,600	273,504.00	0.30
81	300737	科顺股份	13,800	272,274.00	0.30
82	002129	中环股份	11,900	267,274.00	0.30
83	600901	江苏租赁	50,400	262,584.00	0.29
84	600183	生益科技	8,400	245,868.00	0.27
85	600060	海信视像	19,956	242,465.40	0.27
86	600546	山煤国际	20,600	242,050.00	0.27
87	600503	华丽家族	54,500	240,345.00	0.27
88	300577	开润股份	8,600	231,942.00	0.26
89	300379	东方通	5,100	219,453.00	0.24
90	603686	龙马环卫	8,500	207,145.00	0.23
91	603816	顾家家居	4,600	207,046.00	0.23
92	600657	信达地产	47,800	196,936.00	0.22
93	603363	傲农生物	8,400	196,308.00	0.22
94	000858	五 粮 液	1,100	188,232.00	0.21
95	603063	禾望电气	26,100	185,832.00	0.21
96	603866	桃李面包	3,600	183,204.00	0.20
97	603079	圣达生物	6,180	183,113.40	0.20
98	600966	博汇纸业	16,000	162,400.00	0.18
99	601155	新城控股	5,100	159,324.00	0.18
100	002508	老板电器	5,100	158,661.00	0.18
101	603737	三棵树	1,720	158,618.40	0.18
102	603520	司太立	1,860	156,351.60	0.17
103	601066	中信建投	3,600	141,768.00	0.16
104	600055	万东医疗	8,700	139,287.00	0.15

105	603218	日月股份	7,100	129,930.00	0.14
106	600782	新钢股份	28,800	117,504.00	0.13
107	603566	普莱柯	3,600	99,684.00	0.11
108	603367	辰欣药业	6,100	98,637.00	0.11
109	603416	信捷电气	2,400	95,664.00	0.11
110	603986	兆易创新	400	94,364.00	0.10
111	002511	中顺洁柔	4,200	93,660.00	0.10
112	688004	博汇科技	1,250	89,875.00	0.10
113	600846	同济科技	8,600	73,100.00	0.08
114	600756	浪潮软件	3,900	72,150.00	0.08
115	300229	拓尔思	5,300	60,844.00	0.07
116	688568	中科星图	3,581	58,048.01	0.06
117	300687	赛意信息	2,300	52,670.00	0.06
118	688277	天智航	4,312	51,916.48	0.06
119	600486	扬农化工	600	49,500.00	0.05
120	300498	温氏股份	2,100	45,780.00	0.05
121	688528	秦川物联	3,855	43,677.15	0.05
122	688377	迪威尔	2,485	40,803.70	0.05
123	688027	国盾量子	1,084	39,219.12	0.04
124	688600	皖仪科技	2,460	38,130.00	0.04
125	603087	甘李药业	279	27,983.70	0.03
126	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.02
127	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.01
128	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.01
129	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.01
130	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.01
131	688310	迈得医疗	138	5,187.42	0.01
132	688030	山石网科	100	4,722.00	0.01
133	300846	首都在线	1,131	3,811.47	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	300601	康泰生物	5,496,254.86	7.27
2	300014	亿纬锂能	4,596,341.00	6.08
3	600867	通化东宝	4,389,350.76	5.81

4	300124	汇川技术	4,317,621.91	5.71
5	600507	方大特钢	4,209,898.39	5.57
6	300012	华测检测	4,008,917.71	5.30
7	600276	恒瑞医药	3,527,742.00	4.67
8	600900	长江电力	3,441,315.07	4.55
9	300595	欧普康视	3,331,291.35	4.41
10	300760	迈瑞医疗	3,002,084.00	3.97
11	600036	招商银行	2,941,801.00	3.89
12	600585	海螺水泥	2,865,634.00	3.79
13	002415	海康威视	2,840,014.00	3.76
14	603986	兆易创新	2,656,025.16	3.51
15	600336	澳柯玛	2,506,448.00	3.31
16	601818	光大银行	2,361,952.00	3.12
17	600566	济川药业	2,307,042.78	3.05
18	600104	上汽集团	2,190,392.00	2.90
19	601058	赛轮轮胎	2,162,144.82	2.86
20	300166	东方国信	2,158,240.60	2.85
21	600201	生物股份	2,148,464.00	2.84
22	600872	中炬高新	2,035,617.00	2.69
23	300207	欣旺达	2,032,203.00	2.69
24	601933	永辉超市	1,989,415.00	2.63
25	002475	立讯精密	1,964,577.00	2.60
26	603505	金石资源	1,940,438.00	2.57
27	603328	依顿电子	1,891,423.06	2.50
28	600183	生益科技	1,882,808.00	2.49
29	603387	基蛋生物	1,878,754.00	2.48
30	600271	航天信息	1,754,576.00	2.32
31	603018	中设集团	1,723,480.80	2.28
32	601100	恒立液压	1,704,388.36	2.25
33	603369	今世缘	1,702,958.00	2.25
34	603700	宁水集团	1,661,467.40	2.20
35	600519	贵州茅台	1,655,123.00	2.19
36	600563	法拉电子	1,642,250.03	2.17
37	600731	湖南海利	1,636,262.00	2.16
38	300577	开润股份	1,636,166.00	2.16
39	601688	华泰证券	1,613,168.00	2.13

40	600346	恒力石化	1,608,124.00	2.13
41	300498	温氏股份	1,578,731.00	2.09
42	300059	东方财富	1,570,770.20	2.08
43	600173	卧龙地产	1,568,800.70	2.07
44	601225	陕西煤业	1,565,521.00	2.07
45	002179	中航光电	1,556,014.00	2.06
46	601888	中国中免	1,554,441.00	2.06
47	600285	羚锐制药	1,550,007.00	2.05
48	603383	顶点软件	1,532,292.59	2.03

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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	300601	康泰生物	5,417,154.23	7.16
2	300014	亿纬锂能	3,573,972.20	4.73
3	300595	欧普康视	3,422,520.50	4.53
4	300012	华测检测	2,889,957.00	3.82
5	300166	东方国信	2,862,218.17	3.79
6	603986	兆易创新	2,857,404.00	3.78
7	600336	澳柯玛	2,815,080.00	3.72
8	600276	恒瑞医药	2,790,876.00	3.69
9	600507	方大特钢	2,734,140.80	3.62
10	600900	长江电力	2,734,057.00	3.62
11	002415	海康威视	2,725,421.00	3.60
12	600887	伊利股份	2,657,245.52	3.51
13	600201	生物股份	2,651,011.00	3.51
14	601058	赛轮轮胎	2,606,945.00	3.45
15	601318	中国平安	2,560,292.00	3.39
16	600563	法拉电子	2,507,879.22	3.32
17	601012	隆基股份	2,440,420.98	3.23
18	603160	汇顶科技	2,389,300.00	3.16
19	600519	贵州茅台	2,387,798.00	3.16
20	603387	基蛋生物	2,369,459.00	3.13
21	603444	吉比特	2,352,232.00	3.11

22	300207	欣旺达	2,352,146.00	3.11
23	603039	泛微网络	2,259,863.71	2.99
24	600566	济川药业	2,236,193.76	2.96
25	600036	招商银行	2,225,904.00	2.94
26	600867	通化东宝	2,203,816.83	2.91
27	601100	恒立液压	2,189,307.62	2.90
28	600872	中炬高新	2,152,061.00	2.85
29	600104	上汽集团	2,108,922.00	2.79
30	603328	依顿电子	2,083,350.00	2.76
31	600585	海螺水泥	2,023,001.20	2.68
32	300760	迈瑞医疗	1,998,254.00	2.64
33	002475	立讯精密	1,964,217.30	2.60
34	601933	永辉超市	1,943,465.00	2.57
35	603505	金石资源	1,919,620.00	2.54
36	601231	环旭电子	1,865,812.00	2.47
37	603383	顶点软件	1,842,246.47	2.44
38	603259	药明康德	1,827,053.00	2.42
39	601888	中国中免	1,809,593.00	2.39
40	600183	生益科技	1,802,752.51	2.38
41	600763	通策医疗	1,781,594.00	2.36
42	600557	康缘药业	1,768,358.46	2.34
43	600271	航天信息	1,735,785.49	2.30
44	603685	晨丰科技	1,709,571.81	2.26
45	600990	四创电子	1,671,574.00	2.21
46	603700	宁水集团	1,621,351.10	2.14
47	601766	中国中车	1,609,224.00	2.13
48	601186	中国铁建	1,596,508.00	2.11
49	300271	华宇软件	1,590,444.00	2.10
50	600987	航民股份	1,581,102.14	2.09
51	600346	恒力石化	1,572,691.00	2.08
52	600030	中信证券	1,567,272.00	2.07
53	300498	温氏股份	1,555,558.50	2.06
54	600978	*ST 宜生	1,547,335.00	2.05
55	600060	海信视像	1,533,351.45	2.03
56	603990	麦迪科技	1,532,070.80	2.03
57	603708	家家悦	1,518,260.90	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。

7.4.3 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	289,077,830.40
卖出股票收入（成交）总额	288,656,246.41

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货持仓和损益明细。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将利用股指期货剥离多头股票资产部分的系统性风险或建立适当的股指期货多头头寸对冲市场向上风险。基金经理根据市场的变化、现货市场与期货市场的相关性等因素，计算需要用到的期货合约数量，对这个数量进行动态跟踪与测算，并进行适时灵活调整。同时，综合考虑各个月份期货合约之间的定价关系、套利机会、流动性以及保证金要求等因素，在各个月份期货合约之间进行动态配置，通过空头部分的优化创造额外收益。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资于国债期货。该策略符合基金合同的规定。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货持仓和损益明细。

7.11.3 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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金投资的前十名证券的发行主体中，方大特钢在 2019 年 11 月 6 日曾受到南昌市应急管理局行政处罚。

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超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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	43,347.74
2	应收证券清算款	23,198.12
3	应收股利	-
4	应收利息	833.91
5	应收申购款	17,492.86
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	84,872.63

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
泰达宏利大数据混合 A	17,969	3,197.20	34,272,476.32	59.66%	23,178,078.35	40.34%
泰达宏利大数据混合 C	167	890.59	0.00	0.00%	148,727.72	100.00%
合计	18,136	3,175.96	34,272,476.32	59.50%	23,326,806.07	40.50%

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

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	泰达宏利大数据混合 A	661,282.13	1.1510%
	泰达宏利大数据混合 C	0.00	0.0000%
	合计	661,282.13	1.1481%

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的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	泰达宏利大数据混合 A	0
	泰达宏利大数据混合 C	0
	合计	0

本基金基金经理持有本开放式基金	泰达宏利大数据混合 A	50~100
	泰达宏利大数据混合 C	0
	合计	50~100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	泰达宏利大数据 混合 A	泰达宏利大数据 混合 C
基金合同生效日（2016 年 2 月 23 日）基金份额总额	393,925,399.10	-
本报告期期初基金份额总额	57,222,125.78	591,341.45
本报告期基金总申购份额	17,119,084.78	72,730.50
减：本报告期基金总赎回份额	16,890,655.89	515,344.23
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	57,450,554.67	148,727.72

§ 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、本公司于 2020 年 5 月 30 日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于变更高级管理人员的公告》，自 2020 年 5 月 29 日起，由傅国庆先生担任公司总经理。

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. 本报告期内，因公司代履行总经理职务时间超过 180 日，监管要求公司改正；旗下某基金于 2019 年发生大额赎回导致基金相关指标被动超标超过时限，北京监管局对公司出具了警示函。目前公司总经理已于 2020 年 5 月到位履职，相关基金投资指标于 2019 年 10 月均已按照法规完成了调整。

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券	1	238,123,450.65	41.35%	221,754.95	41.35%	-
东北证券	2	99,435,042.67	17.27%	92,605.10	17.27%	-
申万宏源	2	40,015,410.25	6.95%	37,258.19	6.95%	-
中信建投	2	33,197,566.38	5.76%	30,915.81	5.76%	-
银河证券	2	26,134,964.93	4.54%	24,338.28	4.54%	-

太平洋	2	24,386,422.46	4.23%	22,715.28	4.24%	-
东吴证券	1	23,275,825.23	4.04%	21,676.88	4.04%	-
天风证券	1	20,349,659.80	3.53%	18,951.78	3.53%	-
华泰证券	2	16,249,261.58	2.82%	15,132.71	2.82%	-
华西证券	1	13,961,613.60	2.42%	13,002.12	2.42%	-
东方财富	1	12,428,254.42	2.16%	11,574.14	2.16%	-
西南证券	2	9,988,510.32	1.73%	9,302.24	1.73%	-
兴业证券	1	9,260,484.51	1.61%	8,624.45	1.61%	-
国盛证券	2	9,052,998.62	1.57%	8,431.20	1.57%	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
华林证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	4	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
东亚前海	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
财信证券	2	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-

注：（一）2020 年上半年本基金撤销九州证券、长城证券交易单元。

（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

本基金本报告期末通过租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20200101~20200630	18,777,718.46	5,973,237.69	0.00	24,750,956.15	42.97%
产品特有风险							
报告期内，本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额 20%的情况，易发生巨额赎回的情况，存在基金资产无法以合理价格及时变现以支付投资者赎回款的风险，以及基金份额净值出现大幅波动的风险。							

注：报告期内，申购份额含红利再投资份额。

§ 12 备查文件目录

12.1 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。

12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所

12.3 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

2020 年 8 月 29 日