

# 泰达宏利业绩驱动量化股票型证券投资基金

## 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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
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
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>12</b>
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.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	15
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
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>17</b>
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
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>18</b>
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
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>43</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	43
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	43
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	47
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
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>51</b>
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
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>53</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>54</b>
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
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>56</b>
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.....	56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	56

<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>57</b>
12.1 备查文件目录.....	57
12.2 存放地点.....	57
12.3 查阅方式.....	57

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	泰达宏利业绩驱动量化股票型证券投资基金	
基金简称	泰达宏利业绩股票	
基金主代码	004484	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 9 月 6 日	
基金管理人	泰达宏利基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	51,200,929.13 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	泰达宏利业绩股票 A	泰达宏利业绩股票 C
下属分级基金的交易代码:	004484	004485
报告期末下属分级基金的份额总额	48,818,660.19 份	2,382,268.94 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为普通股票型基金，运用量化投资技术，在严格控制风险的前提下，力争为投资者获取超越业绩比较基准的收益
投资策略	本基金采取“自上而下”的方式进行大类资产配置，根据对宏观经济、市场面、政策面等因素进行定量与定性相结合的分析研究，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×90%+中证综合债券指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为股票型基金，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高于混合型基金、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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张强	张燕
	联系电话	010-66577762	0755-83199084
	电子邮箱	irm@mfteda.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-698-8888	95555
传真		010-66577666	0755-83195201
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		100026	518040
法定代表人		弓劲梅	李建红

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.mfcteda.com">http://www.mfcteda.com</a>
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	泰达宏利业绩股票 A	泰达宏利业绩股票 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	7,962,695.60	3,747,963.65
本期利润	4,734,899.82	783,210.78
加权平均基金份额本期利润	0.0854	0.0175
本期加权平均净值利润率	7.14%	1.49%
本期基金份额净值增长率	9.04%	8.48%
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	12,554,760.72	563,061.11
期末可供分配基金份额利润	0.2572	0.2364
期末基金资产净值	64,474,915.82	3,094,704.17
期末基金份额净值	1.3207	1.2991
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	32.07%	29.91%

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

泰达宏利业绩股票 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	10.70%	0.83%	6.82%	0.81%	3.88%	0.02%
过去三个月	17.62%	0.86%	11.59%	0.81%	6.03%	0.05%
过去六个月	9.04%	1.44%	1.85%	1.37%	7.19%	0.07%
过去一年	26.80%	1.18%	8.64%	1.10%	18.16%	0.08%
自基金合同生效起至今	32.07%	1.23%	9.29%	1.15%	22.78%	0.08%



泰达宏利业绩股票 C

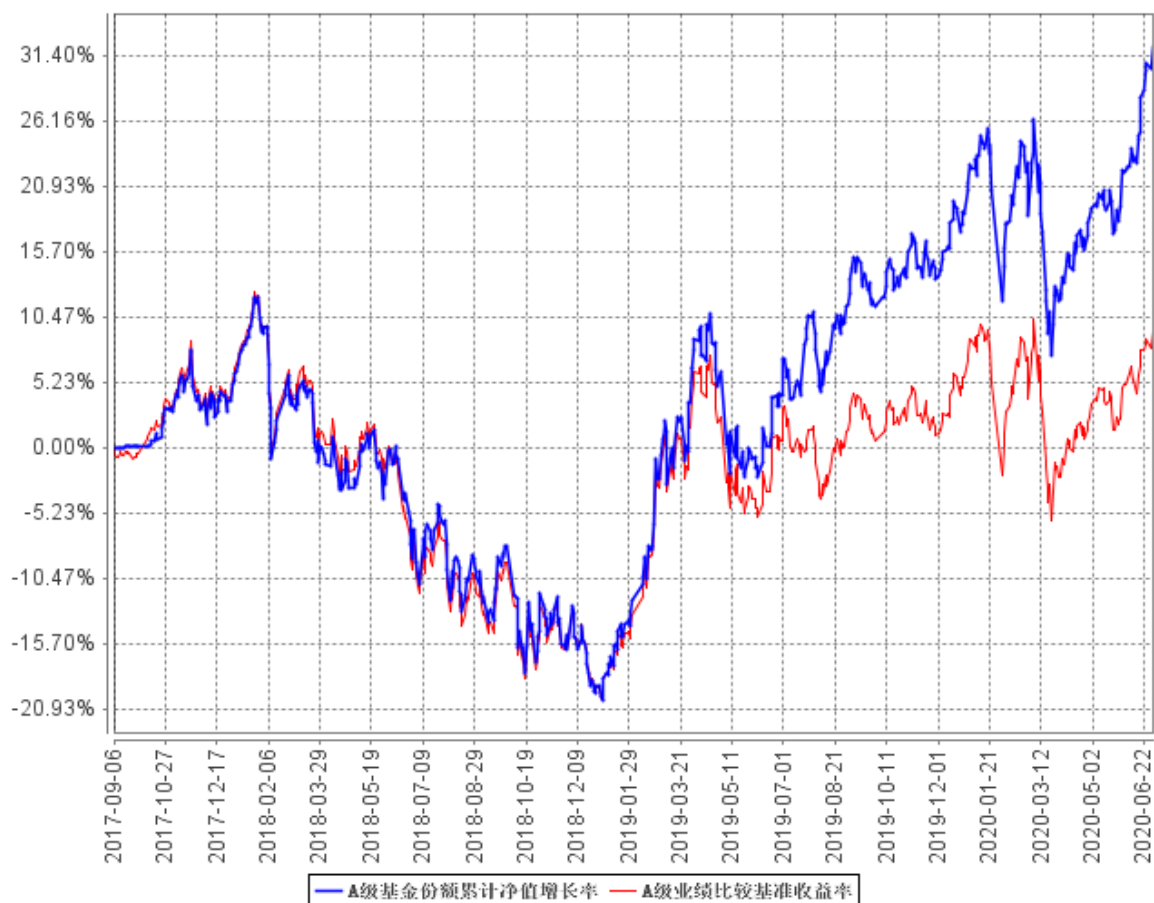
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	10.36%	0.85%	6.82%	0.81%	3.54%	0.04%
过去三个月	17.15%	0.87%	11.59%	0.81%	5.56%	0.06%
过去六个月	8.48%	1.44%	1.85%	1.37%	6.63%	0.07%
过去一年	25.98%	1.18%	8.64%	1.10%	17.34%	0.08%
自基金合同生效起至今	29.91%	1.22%	9.29%	1.15%	20.62%	0.07%

注：本基金业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×90%+中证综合债券指数收益率×10%。

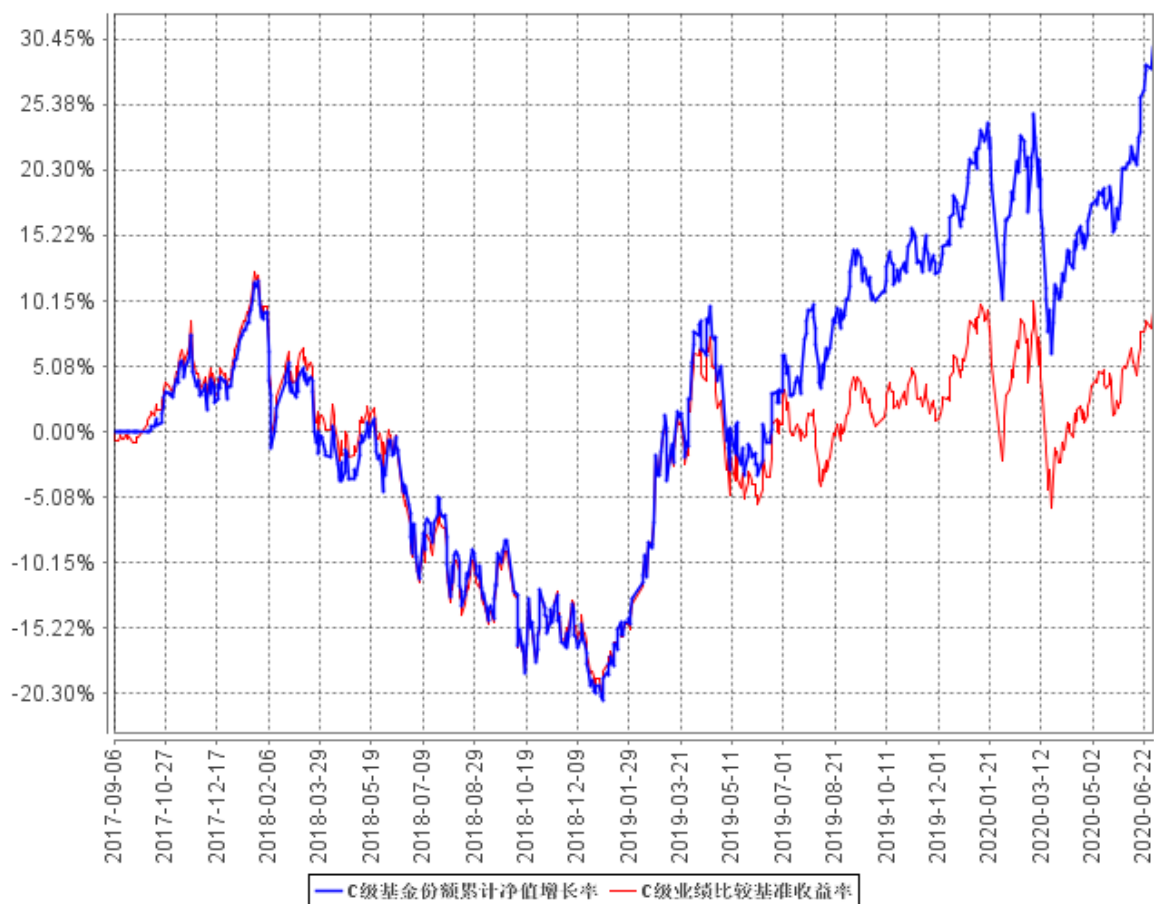
沪深 300 指数是由中证指数有限公司编制，从上海和深圳证券交易所中选取 300 只 A 股作为样本的综合性指数，具有良好的市场代表性。中证综合债券指数是综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央行票据及短融整体走势的跨市场债券指数，其选样是在中证全债指数样本的基础上，增加了央行票据、短期融资券以及一年期以下的国债、金融债和企业债。该指数的推出旨在更全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势，为债券投资者提供更切合的市场基准。本基金运用大类资产配置策略，严控下行风险，以为投资者创造稳定的较高收益为投资目标，因此选取“沪深 300 指数收益率×90%+中证综合债券指数收益率×10%”作为本基金的业绩比较基准。

### 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

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		
刘洋	本基金基金经理	2019年1月9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5月29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。在本报告期内，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

2020 年一季度市场经历了国内与世界范围内新冠疫情发酵对市场情绪带来的冲击，资金对经济与企业盈利下行的担忧以及风险资产短期流动性困境造成权益市场行情宽幅震荡。二季度因国内疫情受控，各国央行较大力度的量化宽松以及国内企业盈利出现明显的恢复迹象，A 股市场在二季度震荡向上，结构性修复了一季度的跌幅。从市场风格来看，由于风险偏好并没有完全修复，且增量资金主要来自于新发公募基金与外资机构，上半年市场对于盈利确定性、景气度边际变化给予了较高的溢价。受益于疫情的医疗板块、线上经济、游戏产业，需求端具有确定性的必选消费，以及符合国家新基建政策导向与自主可控需求的 5G、芯片产业链、信创等均有不错的表现。另一方面，高景气度行业与传统行业之间估值分化日趋强烈，金融、基建、地产、周期等低估值行业逐渐显现出较好的绝对收益价值。

本基金在操作中恪守基金合同，使用量化选股手段，实时跟踪公司业绩变化情况与市场预期，挑选盈利质量高、盈利能力稳定、盈利状况改善或加速改善、公司治理规范、估值合理的蓝筹股。控制组合在行业以及风格上的暴露水平不过分偏离基准，持股结构分散，仓位保持合理稳定。本报告期内，本基金增加了食品饮料行业、医药行业、传媒行业的配置，减少了非银行金融行业、房地产行业、电子行业的配置。

#### 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业绩股票 A 基金份额净值为 1.3207 元，本报告期基金份额净值增长率为 9.04%；截至本报告期末泰达宏利业绩股票 C 基金份额净值为 1.2991 元，本报告期基金份额

净值增长率为 8.48%；同期业绩比较基准收益率为 1.85%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，市场虽难以预期进一步宽松的流动性释放，但当前社融增速维持较高水平，利率仍处于历史较低位置，赚钱效应的持续及相对美股的性价比或仍将使增量资金持续流入。随着企业复工复产接近正常水平、进出口数据超预期恢复、PMI 数据维持环比景气提升、工业增加值与工业企业盈利逐月改善，面对下半年及更长的时间维度，我们认为有业绩支撑或业绩边际改善的板块或将得到资金的进一步推动，同时经济复苏向好亦可能带来低估值传统行业的估值修复机会。继续看好受益于需求边际改善景气上行的新基建、新能源、自主可控相关科技成长板块；随着金融供给侧改革加速与基本面改善支撑，金融板块或将迎来估值修复行情；同时关注汽车、家电等可选消费品销售回暖及地产竣工提速受益产业的机会。系统性风险方面需要关注世界范围内疫情二次发酵对各国经济与资本市场可能的冲击及频发的地缘政治事件对资金风险偏好的影响。

基于基金合同与投资策略，本基金在选股策略上倾向于选择业绩表现长期稳定、盈利状况改善或加速改善、行业与公司景气度提升、治理规范、估值合理的蓝筹股。在不过分暴露行业与风格风险的前提下额外获取一定风格上的超额收益。持仓追求分散投资，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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

### 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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：泰达宏利业绩驱动量化股票型证券投资基金

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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	3,598,194.77	2,111,844.90
结算备付金		726,117.82	234,959.67
存出保证金		38,852.25	47,967.76
交易性金融资产	6.4.7.2	63,744,828.51	140,908,615.25
其中：股票投资		63,744,828.51	133,938,421.25
基金投资		-	-
债券投资		-	6,970,194.00
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		25,477.33	1,343,033.48
应收利息	6.4.7.5	708.14	191,178.46
应收股利		-	-
应收申购款		8,956.37	3,438.12
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		68,143,135.19	144,841,037.64
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2019 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
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		1,409.30	234,478.41
应付赎回款		40,046.16	1,746,666.92
应付管理人报酬		88,587.20	143,179.92
应付托管费		18,455.66	29,829.19
应付销售服务费		11,698.02	27,292.91
应付交易费用	6.4.7.7	323,794.82	130,880.80
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	89,524.04	180,003.14
负债合计		573,515.20	2,492,331.29
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	51,200,929.13	118,153,736.51
未分配利润	6.4.7.10	16,368,690.86	24,194,969.84
所有者权益合计		67,569,619.99	142,348,706.35
负债和所有者权益总计		68,143,135.19	144,841,037.64

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，泰达宏利业绩股票 A 基金份额净值 1.3207 元，基金份额总额 48,818,660.19 份；泰达宏利业绩股票 C 基金份额净值 1.2991 元，基金份额总额 2,382,268.94 份。泰达宏利业绩股票份额总额合计为 51,200,929.13 份。

## 6.2 利润表

会计主体：泰达宏利业绩驱动量化股票型证券投资基金

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
<b>一、收入</b>		7,745,517.66	23,181,468.63
1.利息收入		83,996.59	20,602.35
其中：存款利息收入	6.4.7.11	13,152.77	20,602.35
债券利息收入		70,843.82	-
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）		13,851,942.63	8,761,174.37
其中：股票投资收益	6.4.7.12	12,905,518.76	7,833,432.12
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-62,402.03	-
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	1,008,825.90	927,742.25
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-6,192,548.65	14,395,791.92
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	2,127.09	3,899.99
<b>减：二、费用</b>		2,227,407.06	1,111,223.42
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	711,500.95	500,131.85
2. 托管费	6.4.10.2.2	148,229.33	104,194.15
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	130,857.51	22,478.62
4. 交易费用	6.4.7.19	1,144,431.24	395,152.54
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	92,388.03	89,266.26
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		5,518,110.60	22,070,245.21
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		5,518,110.60	22,070,245.21

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰达宏利业绩驱动量化股票型证券投资基金

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）	118,153,736.51	24,194,969.84	142,348,706.35
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	5,518,110.60	5,518,110.60
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）	-66,952,807.38	-13,344,389.58	-80,297,196.96
其中：1.基金申购款	43,552,986.68	7,373,553.43	50,926,540.11
2.基金赎回款	-110,505,794.06	-20,717,943.01	-131,223,737.07
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)			
五、期末所有者权益(基金净值)	51,200,929.13	16,368,690.86	67,569,619.99
项目	上年度可比期间 2019年1月1日至2019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)	89,599,009.90	-17,176,862.63	72,422,147.27
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	22,070,245.21	22,070,245.21
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)	38,825,446.92	-131,803.85	38,693,643.07
其中：1.基金申购款	52,917,025.22	142,744.90	53,059,770.12
2.基金赎回款	-14,091,578.30	-274,548.75	-14,366,127.05
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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	128,424,456.82	4,761,578.73	133,186,035.55

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：

<u>傅国庆</u>	<u>傅国庆</u>	<u>王泉</u>
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

泰达宏利业绩驱动量化股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2017]326号《关于准予泰达宏利业绩驱动量化股票型证券投资基金注册的批复》核准,由泰达宏利基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利业绩驱动量化股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币350,649,720.65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(2017)第 156 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰达宏利业绩驱动量化股票型证券投资基金基金合同》于 2017 年 9 月 6 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 350,779,994.20 份基金份额,其中认购资金利息折合 130,273.55 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,基金托管人为招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)。

根据《泰达宏利业绩驱动量化股票型证券投资基金基金合同》和《泰达宏利业绩驱动量化股票型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案,本基金根据认购费用、申购费用、销售服务费等费率收取方式的不同,将基金份额分为 A、C 两类份额。在投资者认购、申购基金时收取认购、申购费用的,称为 A 类基金份额;不收取认购、申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 C 类基金份额。各类别基金份额,分别设置代码、分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值,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。投资人可自由选择认购、申购某一类别的基金份额,但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利业绩驱动量化股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、短期融资券、中期票据、公开发行的次级债券、可交换债券、可转债及分离交易可转债的纯债部分)、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、资产支持证券、货币市场工具、同业存单、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)。基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例不低于 80%;权证投资比例不超过基金资产净值的 3%;本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券,股指期货的投资比例遵循国家相关法律法规。本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数收益率 $\times 90\%$ +中证综合债券指数收益率 $\times 10\%$ 。

#### 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》、《泰达宏利业绩驱动量化股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、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	3,598,194.77
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：	3,598,194.77

##### 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	57,652,564.26	63,744,828.51	6,092,264.25
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	57,652,564.26	63,744,828.51	6,092,264.25

### 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	364.04
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	326.70
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	17.40
合计	708.14

#### 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	323,794.82
银行间市场应付交易费用	-
合计	323,794.82

#### 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	16.44
应付证券出借违约金	-
预提费用	89,507.60
合计	89,524.04

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

泰达宏利业绩股票 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	62,760,999.85	62,760,999.85
本期申购	43,189,000.84	43,189,000.84
本期赎回(以“-”号填列)	-57,131,340.50	-57,131,340.50
- 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	48,818,660.19	48,818,660.19

金额单位：人民币元

泰达宏利业绩股票 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	55,392,736.66	55,392,736.66
本期申购	363,985.84	363,985.84
本期赎回(以“-”号填列)	-53,374,453.56	-53,374,453.56
— 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	2,382,268.94	2,382,268.94

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

泰达宏利业绩股票 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	6,887,149.43	6,365,639.80	13,252,789.23
本期利润	7,962,695.60	-3,227,795.78	4,734,899.82
本期基金份额交易产生的变动数	-2,295,084.31	-36,349.11	-2,331,433.42
其中：基金申购款	7,243,311.59	62,484.74	7,305,796.33
基金赎回款	-9,538,395.90	-98,833.85	-9,637,229.75
本期已分配利润	—	—	—
本期末	12,554,760.72	3,101,494.91	15,656,255.63

单位：人民币元

泰达宏利业绩股票 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,380,563.96	5,561,616.65	10,942,180.61
本期利润	3,747,963.65	-2,964,752.87	783,210.78
本期基金份额交易产生的变动数	-8,565,466.50	-2,447,489.66	-11,012,956.16
其中：基金申购款	54,945.19	12,811.91	67,757.10
基金赎回款	-8,620,411.69	-2,460,301.57	-11,080,713.26
本期已分配利润	—	—	—
本期末	563,061.11	149,374.12	712,435.23

#### 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	7,980.27

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	3,932.64
其他	1,239.86
合计	13,152.77

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	12,905,518.76
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	12,905,518.76

##### 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	400,600,188.04
减：卖出股票成本总额	387,694,669.28
买卖股票差价收入	12,905,518.76

##### 6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期末有股票投资收益-证券出借差价收入。

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-62,402.03
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	-62,402.03

### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	7,195,450.81
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	6,996,458.70
减：应收利息总额	261,394.14
买卖债券差价收入	-62,402.03

### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券投资收益-赎回差价收入。

### 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券投资收益-申购差价收入。

### 6.4.7.13.5 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。

### 6.4.7.14 贵金属投资收益

#### 6.4.7.14.1 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。

#### 6.4.7.14.2 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。

#### 6.4.7.14.3 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。

#### 6.4.7.14.4 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。

### 6.4.7.15 衍生工具收益

#### 6.4.7.15.1 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。

#### 6.4.7.15.2 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。

#### 6.4.7.16 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	1,008,825.90
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	1,008,825.90

#### 6.4.7.17 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	-6,192,548.65
——股票投资	-6,218,813.35
——债券投资	26,264.70
——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	-6,192,548.65

#### 6.4.7.18 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	1,527.70
基金转换费收入	599.39
合计	2,127.09

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。

### 6.4.7.19 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	1,144,431.24
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	1,144,431.24

### 6.4.7.20 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	-
银行费用	2,880.43
合计	92,388.03

## 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
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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	711,500.95	500,131.85
其中：支付销售机构的客户维护费	52,195.28	113,871.45

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 1.20% 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 1.20% / 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	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30
----	------------------------	--------------------------------



	月 30 日	日
当期发生的基金应支付的托管费	148,229.33	104,194.15

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

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 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		
	泰达宏利业绩股票 A	泰达宏利业绩股票 C	合计
泰达宏利基金管理有限公司	-	113,460.06	-
招商银行	-	2,150.48	-
合计	-	115,610.54	-
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		
	泰达宏利业绩股票 A	泰达宏利业绩股票 C	合计
泰达宏利基金管理有限公司	-	6,799.17	-
招商银行	-	5,587.52	-
合计	-	12,386.69	-

注：支付基金销售机构的销售服务费按 C 类基金基金份额前一日基金资产净值 0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给泰达宏利基金管理有限公司，再由泰达宏利基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日 C 类基金基金份额销售服务费=C 类基金基金份额前一日基金资产净值 X 0.50%/ 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		上年度可比期间	
	2020年1月1日至2020年6月30日		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
招商银行	3,598,194.77	7,980.27	7,423,493.88	18,144.25

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按约定利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

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
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	5,210	59,029.30	59,029.30	
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	
688208	道通科技	2020 年 2 月 6 日	2020 年 8 月 13 日	新股流通受限	24.36	54.23	3,951	96,246.36	214,262.73	
688520	神州细胞	2020 年 6 月 11 日	2020 年 12 月 22 日	新股流通受限	25.64	58.82	2,744	70,356.16	161,402.08	
688051	佳华科技	2020 年 3 月 12 日	2020 年 9 月 21 日	新股流通受限	50.81	120.27	1,273	64,681.13	153,103.71	
688505	复旦张江	2020 年 6 月 10 日	2020 年 12 月 21 日	新股流通受限	8.95	24.78	5,613	50,236.35	139,090.14	
688081	兴图新科	2020 年 1 月 6 日	2020 年 7 月 6 日	新股流通受限	28.21	42.01	2,365	66,716.65	99,353.65	

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

本基金是股票型证券投资基金，属于高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是运用量化投资技术，在严格控制风险的前提下，力争为投资者获取超越业绩比较基准的收益。

##### 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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行招商银行，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 2020 年 6 月 30 日，本基金未持有债券投资、资产支持证券投资 and 同业存单投资资产 (2019 年 12 月 31 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)。

#### 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 金融资产和金融负债的到期期限分析

### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

针对投资品种变现的流动性风险，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设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。

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。

本基金所持证券在证券交易所上市，或者可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。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。

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	3,598,194.77	-	-	-	3,598,194.77
结算备付金	726,117.82	-	-	-	726,117.82
存出保证金	38,852.25	-	-	-	38,852.25
交易性金融资 产	-	-	-	63,744,828.51	63,744,828.51
应收证券清算 款	-	-	-	25,477.33	25,477.33
应收利息	-	-	-	708.14	708.14
应收申购款	-	-	-	8,956.37	8,956.37
资产总计	4,363,164.84	-	-	63,779,970.35	68,143,135.19
负债					
应付证券清算 款	-	-	-	1,409.30	1,409.30
应付赎回款	-	-	-	40,046.16	40,046.16
应付管理人报 酬	-	-	-	88,587.20	88,587.20
应付托管费	-	-	-	18,455.66	18,455.66
应付销售服务 费	-	-	-	11,698.02	11,698.02
应付交易费用	-	-	-	323,794.82	323,794.82
其他负债	-	-	-	89,524.04	89,524.04
负债总计	-	-	-	573,515.20	573,515.20
利率敏感度缺 口	4,363,164.84	-	-	63,206,455.15	67,569,619.99
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	2,111,844.90	-	-	-	2,111,844.90
结算备付金	234,959.67	-	-	-	234,959.67
存出保证金	47,967.76	-	-	-	47,967.76
交易性金融资	6,970,194.00	-	-	133,938,421.25	140,908,615.25

产					
应收证券清算款	-	-	-	1,343,033.48	1,343,033.48
应收利息	-	-	-	191,178.46	191,178.46
应收申购款	-	-	-	3,438.12	3,438.12
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	9,364,966.33	-	-	135,476,071.31	144,841,037.64
负债					
应付证券清算款	-	-	-	234,478.41	234,478.41
应付赎回款	-	-	-	1,746,666.92	1,746,666.92
应付管理人报酬	-	-	-	143,179.92	143,179.92
应付托管费	-	-	-	29,829.19	29,829.19
应付销售服务费	-	-	-	27,292.91	27,292.91
应付交易费用	-	-	-	130,880.80	130,880.80
其他负债	-	-	-	180,003.14	180,003.14
负债总计	-	-	-	2,492,331.29	2,492,331.29
利率敏感度缺口	9,364,966.33	-	-	-132,983,740.02	142,348,706.35

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资产（2019 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 4.90%），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，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不低于 80%；权证投资比例不超过基金资产净值的 3%，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	63,744,828.51	94.34	133,938,421.25	94.09
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	63,744,828.51	94.34	133,938,421.25	94.09

#### 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%	3,150,000.00	6,660,000.00
业绩比较基准下降 5%	-3,150,000.00	-6,660,000.00	

#### **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	63,744,828.51	93.55
	其中：股票	63,744,828.51	93.55
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	4,324,312.59	6.35
	-	-	-
8	其他各项资产	73,994.09	0.11
9	合计	68,143,135.19	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	1,448,820.00	2.14
B	采矿业	1,482,109.00	2.19
C	制造业	34,648,387.65	51.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	749,532.32	1.11
E	建筑业	731,722.00	1.08
F	批发和零售业	1,338,803.56	1.98
G	交通运输、仓储和邮政业	1,820,643.00	2.69
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,231,645.28	3.30
J	金融业	17,183,407.70	25.43
K	房地产业	1,870,392.00	2.77
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	89,516.00	0.13

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	149,850.00	0.22
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	63,744,828.51	94.34

### 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	600519	贵州茅台	3,000	4,388,640.00	6.49
2	601318	中国平安	42,783	3,054,706.20	4.52
3	000333	美的集团	48,438	2,896,108.02	4.29
4	000858	五粮液	15,527	2,656,980.24	3.93
5	600276	恒瑞医药	28,331	2,614,951.30	3.87
6	600030	中信证券	78,730	1,898,180.30	2.81
7	000001	平安银行	136,500	1,747,200.00	2.59
8	002475	立讯精密	32,837	1,686,179.95	2.50
9	601688	华泰证券	78,400	1,473,920.00	2.18
10	002050	三花智控	65,510	1,434,669.00	2.12
11	002714	牧原股份	17,190	1,409,580.00	2.09
12	601988	中国银行	376,400	1,309,872.00	1.94
13	601818	光大银行	360,300	1,289,874.00	1.91
14	002142	宁波银行	48,400	1,271,468.00	1.88
15	600048	保利地产	79,300	1,172,054.00	1.73
16	601012	隆基股份	28,600	1,164,878.00	1.72
17	600887	伊利股份	36,926	1,149,506.38	1.70
18	600346	恒力石化	79,100	1,107,400.00	1.64
19	002352	顺丰控股	20,200	1,104,940.00	1.64
20	603288	海天味业	8,640	1,074,816.00	1.59
21	300760	迈瑞医疗	3,400	1,039,380.00	1.54
22	300059	东方财富	50,800	1,026,160.00	1.52
23	300628	亿联网络	14,400	982,944.00	1.45
24	603228	景旺电子	27,480	967,021.20	1.43
25	002236	大华股份	49,000	941,290.00	1.39

26	002624	完美世界	15,900	916,476.00	1.36
27	600016	民生银行	159,060	901,870.20	1.33
28	601288	农业银行	229,300	775,034.00	1.15
29	600867	通化东宝	43,300	754,719.00	1.12
30	000661	长春高新	1,700	740,010.00	1.10
31	600900	长江电力	38,900	736,766.00	1.09
32	601336	新华保险	16,400	726,192.00	1.07
33	601933	永辉超市	77,200	724,136.00	1.07
34	000932	华菱钢铁	171,800	647,686.00	0.96
35	300737	科顺股份	32,200	635,306.00	0.94
36	300124	汇川技术	16,500	626,835.00	0.93
37	601601	中国太保	22,700	618,575.00	0.92
38	601225	陕西煤业	85,300	615,013.00	0.91
39	000975	银泰黄金	38,300	600,544.00	0.89
40	601598	中国外运	177,900	574,617.00	0.85
41	603043	广州酒家	17,300	562,596.00	0.83
42	603730	岱美股份	16,800	541,800.00	0.80
43	000002	万 科 A	17,100	446,994.00	0.66
44	603444	吉比特	800	439,208.00	0.65
45	600845	宝信软件	7,400	437,192.00	0.65
46	000090	天健集团	61,100	422,201.00	0.62
47	603369	今世缘	10,400	413,816.00	0.61
48	300394	天孚通信	6,600	393,030.00	0.58
49	300387	富邦股份	46,600	389,576.00	0.58
50	002557	洽洽食品	7,000	379,330.00	0.56
51	000651	格力电器	6,705	379,301.85	0.56
52	600177	雅戈尔	62,600	373,096.00	0.55
53	002821	凯莱英	1,500	364,500.00	0.54
54	000488	晨鸣纸业	65,000	321,100.00	0.48
55	300707	威唐工业	17,100	269,838.00	0.40
56	300191	潜能恒信	14,300	266,552.00	0.39
57	600908	无锡银行	54,000	265,140.00	0.39
58	300607	拓斯达	6,480	263,671.20	0.39
59	603960	克来机电	8,500	237,320.00	0.35
60	002841	视源股份	2,220	220,934.40	0.33
61	601166	兴业银行	13,700	216,186.00	0.32
62	688208	道通科技	3,951	214,262.73	0.32
63	601939	建设银行	32,100	202,551.00	0.30
64	603708	家家悦	3,906	192,409.56	0.28

65	601128	常熟银行	25,500	191,505.00	0.28
66	601618	中国中冶	71,400	179,214.00	0.27
67	603899	晨光文具	3,000	163,800.00	0.24
68	688520	神州细胞	2,744	161,402.08	0.24
69	688051	佳华科技	1,273	153,103.71	0.23
70	002607	中公教育	5,400	149,850.00	0.22
71	600051	宁波联合	16,400	143,828.00	0.21
72	002697	红旗连锁	13,100	143,052.00	0.21
73	601066	中信建投	3,600	141,768.00	0.21
74	600585	海螺水泥	2,669	141,216.79	0.21
75	601872	招商轮船	24,200	141,086.00	0.21
76	002555	三七互娱	3,000	140,400.00	0.21
77	688505	复旦张江	5,613	139,090.14	0.21
78	000671	阳光城	21,600	136,944.00	0.20
79	600382	广东明珠	20,700	135,378.00	0.20
80	000538	云南白药	1,400	131,334.00	0.19
81	002487	大金重工	20,400	121,584.00	0.18
82	603612	索通发展	10,100	115,342.00	0.17
83	000036	华联控股	26,000	114,400.00	0.17
84	000568	泸州老窖	1,100	100,232.00	0.15
85	688081	兴图新科	2,365	99,353.65	0.15
86	600486	扬农化工	1,200	99,000.00	0.15
87	300192	科斯伍德	5,800	97,904.00	0.14
88	603018	中设集团	9,200	89,516.00	0.13
89	002353	杰瑞股份	2,600	80,600.00	0.12
90	601398	工商银行	14,700	73,206.00	0.11
91	603707	健友股份	1,100	71,027.00	0.11
92	600765	中航重机	6,900	70,518.00	0.10
93	600846	同济科技	8,000	68,000.00	0.10
94	300235	方直科技	4,100	67,732.00	0.10
95	002912	中新赛克	400	65,436.00	0.10
96	603098	森特股份	6,900	62,307.00	0.09
97	688528	秦川物联	5,210	59,029.30	0.09
98	000529	广弘控股	7,200	52,992.00	0.08
99	300498	温氏股份	1,800	39,240.00	0.06
100	603087	甘李药业	387	38,816.10	0.06
101	603611	诺力股份	1,600	34,336.00	0.05
102	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.03
103	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.02

104	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.02
105	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.01
106	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.01
107	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.01

## 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	000661	长春高新	5,472,032.00	3.84
2	000858	五粮液	5,002,094.25	3.51
3	601939	建设银行	4,956,236.14	3.48
4	600048	保利地产	4,889,854.00	3.44
5	000001	平安银行	4,656,949.33	3.27
6	600016	民生银行	4,223,217.40	2.97
7	000002	万科A	4,081,689.00	2.87
8	002352	顺丰控股	3,816,071.60	2.68
9	600519	贵州茅台	3,682,011.99	2.59
10	601318	中国平安	3,546,388.00	2.49
11	300628	亿联网络	3,526,024.00	2.48
12	000333	美的集团	3,407,442.00	2.39
13	603369	今世缘	3,336,736.00	2.34
14	002714	牧原股份	3,326,440.00	2.34
15	600030	中信证券	3,324,303.00	2.34
16	002508	老板电器	3,320,570.26	2.33
17	601012	隆基股份	3,307,882.00	2.32
18	002624	完美世界	3,281,253.00	2.31
19	002142	宁波银行	3,165,001.06	2.22
20	600346	恒力石化	3,162,084.75	2.22
21	601688	华泰证券	3,115,624.00	2.19
22	600276	恒瑞医药	2,951,500.60	2.07
23	601211	国泰君安	2,929,884.00	2.06

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	600016	民生银行	6,569,704.00	4.62
2	000661	长春高新	6,434,484.25	4.52
3	600519	贵州茅台	6,371,359.00	4.48
4	601318	中国平安	6,271,932.00	4.41
5	600030	中信证券	5,654,406.42	3.97
6	600276	恒瑞医药	5,356,777.00	3.76
7	000651	格力电器	5,307,431.58	3.73
8	002415	海康威视	5,297,826.01	3.72
9	600048	保利地产	5,133,069.60	3.61
10	000858	五粮液	5,054,866.80	3.55
11	300498	温氏股份	4,696,381.70	3.30
12	601939	建设银行	4,665,830.00	3.28
13	601766	中国中车	4,626,851.00	3.25
14	600346	恒力石化	4,619,721.33	3.25
15	000333	美的集团	4,588,747.00	3.22
16	600887	伊利股份	4,376,944.36	3.07
17	601166	兴业银行	4,326,912.00	3.04
18	601628	中国人寿	4,270,777.92	3.00
19	601012	隆基股份	4,110,120.71	2.89
20	600340	华夏幸福	3,598,622.11	2.53
21	300059	东方财富	3,516,886.76	2.47
22	600011	华能国际	3,475,388.00	2.44
23	002508	老板电器	3,466,045.71	2.43
24	601225	陕西煤业	3,288,641.50	2.31
25	600919	江苏银行	3,245,769.00	2.28
26	002755	奥赛康	3,225,890.50	2.27
27	002352	顺丰控股	3,166,817.00	2.22
28	000002	万科A	3,161,236.00	2.22
29	002475	立讯精密	3,101,190.00	2.18
30	000063	中兴通讯	3,076,461.00	2.16
31	603369	今世缘	3,064,209.16	2.15
32	601668	中国建筑	3,053,113.00	2.14
33	601211	国泰君安	2,979,352.00	2.09



34	601601	中国太保	2,916,733.00	2.05
35	002142	宁波银行	2,890,463.00	2.03
36	601688	华泰证券	2,863,273.00	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。

### 7.4.3 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	323,719,889.89
卖出股票收入（成交）总额	400,600,188.04

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。

### 7.5 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

在报告期内，本基金未投资于股指期货。该策略符合基金合同的规定。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.11.1 本期国债期货投资政策

在报告期内，本基金未投资于国债期货。该策略符合基金合同的规定。

### 7.11.2 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

本报告期本基金没有投资国债期货。

### 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，华泰证券在 2019 年 8 月 23 日曾受到中国证券监督管理委员会江苏监管局行政处罚，在 2020 年 2 月 14 日曾受到中国人民银行行政处罚。

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	38,852.25
2	应收证券清算款	25,477.33
3	应收股利	-
4	应收利息	708.14
5	应收申购款	8,956.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	73,994.09

#### 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
泰达宏利业绩股票 A	291	167,761.72	42,774,403.29	87.62%	6,044,256.90	12.38%
泰达宏利业绩股票 C	305	7,810.72	0.00	0.00%	2,382,268.94	100.00%
合计	596	85,907.60	42,774,403.29	83.54%	8,426,525.84	16.46%

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	泰达宏利业绩股票 A	20,393.18	0.0418%
	泰达宏利业绩股票 C	45,966.83	1.9295%
	合计	66,360.01	0.1296%

### 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	泰达宏利业绩股票 A	0
	泰达宏利业绩股票 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	泰达宏利业绩股票 A	0
	泰达宏利业绩股票 C	0

---

	合计	0
--	----	---

### § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	泰达宏利业绩股票 A	泰达宏利业绩股票 C
基金合同生效日（2017 年 9 月 6 日）基金份额总额	141,393,144.61	209,386,849.59
本报告期期初基金份额总额	62,760,999.85	55,392,736.66
本报告期基金总申购份额	43,189,000.84	363,985.84
减：本报告期基金总赎回份额	57,131,340.50	53,374,453.56
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	48,818,660.19	2,382,268.94

## § 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. 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	
天风证券	2	481,198,672.44	66.65%	448,141.73	66.65%	-
国泰君安	2	153,809,390.40	21.30%	143,239.33	21.30%	-
新时代	1	70,718,810.69	9.80%	65,859.90	9.79%	-
开源证券	1	16,261,160.50	2.25%	15,143.43	2.25%	-

华西证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	-

注：（一）本基金本报告期新增开源证券交易单元。

（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**

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
天风证券	663,499.49	46.30%	-	-	-	-
国泰君安	769,557.18	53.70%	-	-	-	-
新时代	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-

## § 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	20200420-20200630	0.00	42,774,403.29	0.00	42,774,403.29	83.54%
	2	20200101-20200419	50,014,750.00	0.00	50,014,750.00	0.00	0.00%
	3	20200101-20200614	40,225,261.46	0.00	40,225,261.46	0.00	0.00%
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
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。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本公司根据中国证监会颁布的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及监管规定，对本基金基金合同、托管协议及招募说明书中与信息披露相关的条款进行了修订，并于 2020 年 1 月 16 日，在中国证监会指定网站进行了公告。



## § 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、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