

泰达宏利红利先锋混合型证券投资基金 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：泰达宏利基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人泰达宏利基金管理有限公司的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本中期报告已经全体独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 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 2021 年 1 月 1 日起至 2021 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	13
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	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	35
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	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	42
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	42

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	42
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	42
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	42
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	42
7.12 投资组合报告附注	43
§ 8 基金份额持有人信息	43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	44
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	44
§ 9 开放式基金份额变动	44
§ 10 重大事件揭示	44
10.1 基金份额持有人大会决议	44
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	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	44
10.4 基金投资策略的改变	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	45
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	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	45
10.8 其他重大事件	47
§ 11 备查文件目录	48
11.1 备查文件目录	48
11.2 存放地点	48
11.3 查阅方式	48

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泰达宏利红利先锋混合型证券投资基金
基金简称	泰达宏利红利先锋混合
基金主代码	162212
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 12 月 3 日
基金管理人	泰达宏利基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	64,914,866.16 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	力争实现基金资产的长期稳定增值和基金的持续稳定分红。
投资策略	<p>1. 资产配置策略 基金投资股票资产的最低比例为基金资产的 60%，最高为 95%，投资于债券资产的比例最高为 40%，最低为 0%。</p> <p>2. 股票投资策略 本基金兼顾投资于具有持续分红特征及潜力的红利股和具有成长潜力特征的上市公司，其中投资于红利股的比例不低于基金股票资产的 80%。“红利股”应具备本基金对红利股定量筛选标准中的一项或多项特征。</p> <p>3. 债券投资策略 对债券的投资将作为控制投资组合整体风险的重要手段之一，通过采用积极主动的投资策略，结合宏观经济变化趋势、货币政策及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，运用久期调整、凸度挖掘、信用分析、波动性交易、品种互换、回购套利等策略，权衡到期收益率与市场流动性，精选个券并构建和调整债券组合，在追求债券资产投资收益的同时兼顾流动性和安全性。</p> <p>4. 权证投资策略 本基金在确保与基金投资目标相一致的前提下，本着谨慎可控的原则，进行权证投资。</p>
业绩比较基准	$75\% \times \text{标普中国 A 股红利机会指数收益率} + 25\% \times \text{上证国债指数收益率}$
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于高风险、高收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		泰达宏利基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	徐娇娇	李申
	联系电话	66577766	021-60637102

电子邮箱	irm@mfcteda.com	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话	400-698-8888	021-60637111
传真	010-66577666	021-60635778
注册地址	北京市朝阳区针织路 23 号楼中国人寿金融中心 6 层 02-07 单元	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	北京市朝阳区针织路 23 号楼中国人寿金融中心 6 层 02-07 单元	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	100026	100033
法定代表人	刘轶	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.mfcteda.com/
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021 年 1 月 1 日-2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	5,625,412.51
本期利润	3,041,897.84
加权平均基金份额本期利润	0.0453
本期加权平均净值利润率	3.21%
本期基金份额净值增长率	2.98%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	25,847,957.81
期末可供分配基金份额利润	0.3982
期末基金资产净值	90,762,823.97
期末基金份额净值	1.398
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	139.82%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-0.07%	0.74%	-2.41%	0.38%	2.34%	0.36%
过去三个月	3.99%	0.82%	-1.99%	0.47%	5.98%	0.35%
过去六个月	2.98%	1.20%	3.44%	0.64%	-0.46%	0.56%
过去一年	32.97%	1.17%	9.72%	0.81%	23.25%	0.36%
过去三年	51.09%	1.32%	7.28%	0.92%	43.81%	0.40%
自基金合同生效起至今	139.82%	1.54%	76.01%	1.06%	63.81%	0.48%

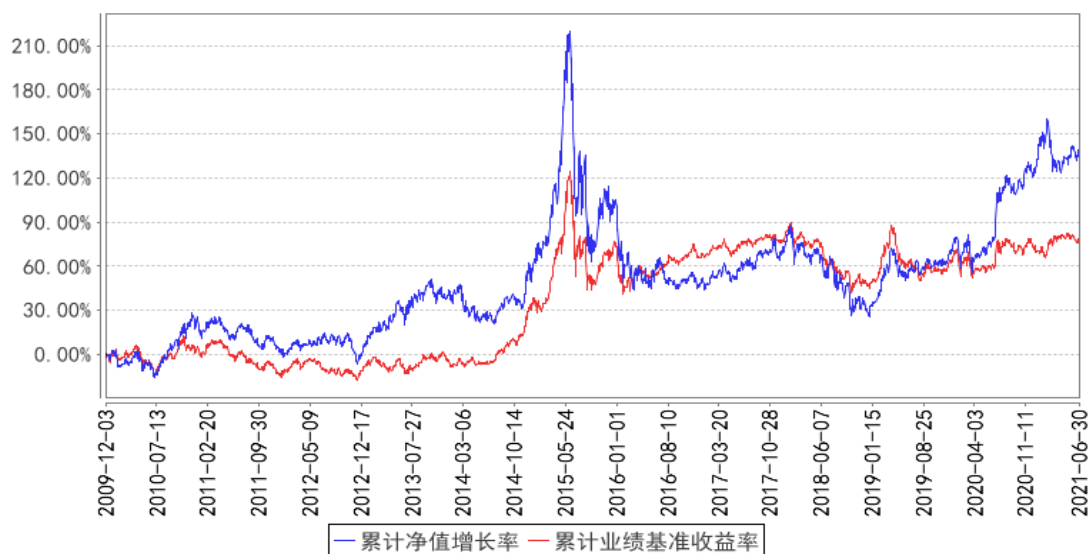
注：本基金的业绩比较基准： $75\% \times$ 标普中国 A 股红利机会指数 $+25\% \times$ 上证国债指数。

标普中国 A 股红利机会指数挑选在上海证券交易所和深圳证券交易所上市的具有高红利特征、盈利能力和利润增长率稳定且具有一定规模及流动性的股票作为样本股，以股息率的最大化及覆盖个股与行业的多样化作为标准，使用股息率作为加权指标构建的指数。它可以综合反映沪深证券市场中高股息股票的整体状况和走势，比较符合本基金的投资策略和投资方向。

上证国债指数是以上海证券交易所上市的所有固定利率国债为样本，按照国债发行量加权而成，具有良好的市场代表性。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

泰达宏利红利先锋混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金于 2009 年 12 月 3 日成立，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	总经理助理兼投资总监（权益）兼基金经理	2019 年 1 月 9 日	-	14 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 14 年基金从业经验,14 年证券投资管理经验,具有基金从业资格。
刘洋	策略投资部总经理助理;本基金基金经理助理	2020 年 2 月 24 日	-	6 年	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,现担任策略投资部总经理助理兼基金经理;具备 6 年证券投资管理经验,具有基金从业资格。
李婷	本基金基金经理助理	2019 年 11 月 18 日	-	4 年	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 4 年基金从业经验,具有基金从业资格。

注:1、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。

2、根据公司 2021 年 7 月 10 日发布的《泰达宏利红利先锋混合型证券投资基金基金经理变更公告》,自 2021 年 7 月 8 日起新增周笑雯为本基金基金经理。

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

上半年 A 股市场波动较大，在结构上分化也很大。春节前市场仍延续 2020 年风格，高 ROE 核心资产上涨较多。春节后市场快速调整，前期强势股下跌较多，而低估值的金融股与机构参与较少的中小盘股票相对抗跌。二季度市场在调整后开始反弹，从风格上看，新能源、创业板、科创板为代表的新兴产业以及中小股票、部分次新股股票涨幅较大，蓝筹股出现滞涨。整体市场风格极度偏向机构主导的新赛道新模式的中小盘成长股。上涨的股票进一步分散，呈现出中小盘股票集体上涨而大盘股滞涨的局面。上半年看，美国债收益率有一定波动，美股成长与价值风格各有表现。

作为风格基金，本基金在操作中，严格依据基金合同，主要投资于具有较高分红收益率的上市公司股票，辅以小幅战术性调整以平滑组合波动。在持仓结构上采用分散持股的策略，降低单个股对组合造成的冲击。本报告期内，本基金增加了医药、食品饮料、电子行业的配置，减少了家电、房地产、建材行业的配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.398 元；本报告期基金份额净值增长率为 2.98%，业绩比较基准收益率为 3.44%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对后市仍维持相对乐观观点，热点不断扩散且向新方向外溢，场内流动性仍较充沛，仍坚持风格从高质量股票向低估值、中小股票外溢的观点。预计市场将关注低估值股票修复机会及业绩不断超预期的个股投资机会。市场关注远期估值而非当前估值，充分体现乐观态度。与此同时风险也在不断累积，一些投资热点已经不太考虑估值，但预计此风险不会在短期内进行释放。关注高质量公司的投资者在短期压力较大。对市场的感悟在于，以往较多思考在如何估值定价股票所产生的投资机会，而忽略了业绩超预期投资策略，是在不深究当前估值机制，接受现行估值，而在利好刺激下认为股价对于业绩产生单调反应的策略。2016 年以来，可以感受到边际定价者的变迁对市场风格产生显著影响，而预计这一影响仍将持续。

基于基金合同与投资观点，我们主要配置于具有连续高分红历史，预期股息率较高的高分红公司股票。同时在战术上，本基金适当考虑市场风格变化，采取对应小幅调整，平滑组合在不

同风格下的表现。本基金在持仓上相对分散，以期平衡组合风险。

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

根据本基金合同及基金实际运作的情况，本基金于 2021 年 1 月 20 日公告按每 10 份基金份额派发 0.438 元进行利润分配，权益登记日、除权日为 2021 年 1 月 21 日，红利发放日为 2021 年 1 月 22 日，共分配 2,993,002.02 元；本基金于 2021 年 4 月 20 日公告按每 10 份基金份额派发 0.3840 元进行利润分配，权益登记日、除权日为 2021 年 4 月 21 日，红利发放日为 2021 年 4 月 22 日，共分配 2,557,846.56 元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金实施利润分配的金额为 5,550,848.58 元。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：泰达宏利红利先锋混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	7,317,400.33	7,468,363.26
结算备付金		430,699.42	926,810.00
存出保证金		18,281.86	20,037.21
交易性金融资产	6.4.7.2	83,539,029.43	94,391,186.28
其中：股票投资		83,539,029.43	94,391,186.28
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		55,333.33	-
应收利息	6.4.7.5	793.46	1,286.20
应收股利		-	-
应收申购款		12,909.20	5,994.25
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		91,374,447.03	102,813,677.20
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 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		-	-
应付赎回款		39,344.68	265,356.87
应付管理人报酬		112,471.35	127,273.67
应付托管费		18,745.23	21,212.29
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	362,742.61	242,625.49
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	78,319.19	160,121.60
负债合计		611,623.06	816,589.92
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	64,914,866.16	70,949,826.55
未分配利润	6.4.7.10	25,847,957.81	31,047,260.73
所有者权益合计		90,762,823.97	101,997,087.28
负债和所有者权益总计		91,374,447.03	102,813,677.20

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.398 元，基金份额总额 64,914,866.16 份。

6.2 利润表

会计主体：泰达宏利红利先锋混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		5,026,735.72	5,894,418.14
1. 利息收入		17,718.04	38,014.56
其中：存款利息收入	6.4.7.11	17,064.76	33,296.08
债券利息收入		-	4,718.48
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		653.28	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		7,585,337.36	10,510,055.85
其中：股票投资收益	6.4.7.12	5,950,698.11	8,658,610.15
基金投资收益	-	-	-

债券投资收益	6.4.7.13	-	-1,013.20
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	1,634,639.25	1,852,458.90
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-2,583,514.67	-4,662,906.51
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	7,194.99	9,254.24
减：二、费用		1,984,837.88	2,017,999.62
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	707,425.31	788,043.09
2. 托管费	6.4.10.2.2	117,904.27	131,340.53
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	1,060,903.59	978,190.99
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	98,604.71	120,425.01
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,041,897.84	3,876,418.52
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,041,897.84	3,876,418.52

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰达宏利红利先锋混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	70,949,826.55	31,047,260.73	101,997,087.28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,041,897.84	3,041,897.84
三、本期基金份额交易产生的基	-6,034,960.39	-2,690,352.18	-8,725,312.57

金净值变动数 (净值减少以 “-”号填列)			
其中: 1. 基金申 购款	5,661,766.65	2,389,728.05	8,051,494.70
2. 基金赎 回款	-11,696,727.04	-5,080,080.23	-16,776,807.27
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)	-	-5,550,848.58	-5,550,848.58
五、期末所有者 权益(基金净值)	64,914,866.16	25,847,957.81	90,762,823.97
项目	上年度可比期间 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)	88,137,906.38	11,878,497.07	100,016,403.45
二、本期经营活 动产生的基金净 值变动数(本期 利润)	-	3,876,418.52	3,876,418.52
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)	8,309,319.95	1,015,271.06	9,324,591.01
其中: 1. 基金申 购款	29,615,916.59	3,260,103.25	32,876,019.84
2. 基金赎 回款	-21,306,596.64	-2,244,832.19	-23,551,428.83
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)	-	-1,789,762.55	-1,789,762.55
五、期末所有者 权益(基金净值)	96,447,226.33	14,980,424.10	111,427,650.43

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

傅国庆

王泉

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

泰达宏利红利先锋混合型证券投资基金(以下简称“本基金”，原泰达荷银红利先锋股票型证券投资基金，后更名为泰达宏利红利先锋股票型证券投资基金)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可 [2009]第 948 号《关于核准泰达荷银红利先锋股票型证券投资基金募集的批复》核准，由泰达荷银基金管理有限公司(于 2010 年 3 月 9 日更名为泰达宏利基金管理有限公司)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达荷银红利先锋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 1,396,033,968.37 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2009)第 264 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泰达荷银红利先锋股票型证券投资基金基金合同》于 2009 年 12 月 3 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,396,164,951.08 份基金份额，其中认购资金利息折合 130,982.71 份基金份额。本基金的基金管理人为泰达宏利基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)。

根据本基金的基金管理人 2010 年 3 月 17 日发布的《泰达宏利基金管理有限公司关于变更公司旗下公募基金名称的公告》，本基金自公告之日起更名为泰达宏利红利先锋股票型证券投资基金。根据 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》，本基金于 2015 年 7 月 30 日公告后更名为泰达宏利红利先锋混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利红利先锋混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券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。其中股票资产占基金资产的 60%-95%，债券资产占基金资产的 0%-40%，权证占基金资产净值的 0%-3%，并保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为： $75\% \times \text{标普中国 A 股红利机会指数收益率} + 25\% \times \text{上证国债指数收益率}$ 。

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 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰达宏利

红利先锋混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 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)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费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 2021 年 6 月 30 日
活期存款	7,317,400.33
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	7,317,400.33

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	81,123,740.29	83,539,029.43	2,415,289.14
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	81,123,740.29	83,539,029.43	2,415,289.14

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 2021年6月30日
应收活期存款利息	591.45
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	193.80
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	0.01
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	8.20
合计	793.46

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 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	362,742.61
银行间市场应付交易费用	-
合计	362,742.61

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	40.99
应付证券出借违约金	-
预提费用	78,278.20
合计	78,319.19

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	70,949,826.55	70,949,826.55
本期申购	5,661,766.65	5,661,766.65
本期赎回（以“-”号填列）	-11,696,727.04	-11,696,727.04
- 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	64,914,866.16	64,914,866.16

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	42,378,162.75	-11,330,902.02	31,047,260.73
本期利润	5,625,412.51	-2,583,514.67	3,041,897.84
本期基金份额交易产生的变动数	-3,684,753.42	994,401.24	-2,690,352.18
其中：基金申购款	3,527,192.64	-1,137,464.59	2,389,728.05
基金赎回款	-7,211,946.06	2,131,865.83	-5,080,080.23
本期已分配利润	-5,550,848.58	-	-5,550,848.58
本期末	38,767,973.26	-12,920,015.45	25,847,957.81

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	13,157.16
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	3,750.85

其他	156.75
合计	17,064.76

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 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	5,950,698.11
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	5,950,698.11

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 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	352,600,044.57
减：卖出股票成本总额	346,649,346.46
买卖股票差价收入	5,950,698.11

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

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无债券投资收益-买卖债券差价收入。

6.4.7.13.3 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。

6.4.7.13.4 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。

6.4.7.13.5 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 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,634,639.25
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	1,634,639.25
----	--------------

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	-2,583,514.67
股票投资	-2,583,514.67
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-2,583,514.67

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	7,064.30
基金转换费收入	130.69
合计	7,194.99

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

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

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	1,060,903.59
银行间市场交易费用	-
合计	1,060,903.59

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	39,671.58

证券出借违约金	-
银行费用	1,726.51
账户维护费	26,853.84
其他	600.00
合计	98,604.71

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

本基金的管理人于 2021 年 7 月 16 日宣告 2021 年度第三次分红,向截至 2021 年 7 月 19 日止在本基金注册登记人泰达宏利基金管理有限公司登记在册的全体持有人,按每 10 份基金份额派发红利 0.4000 元。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期没有存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
泰达宏利基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(中国建设银行)	基金托管人、基金代销机构

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	707,425.31	788,043.09
其中：支付销售机构的客户维护费	231,086.31	136,472.04

注：支付基金管理人泰达宏利基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	117,904.27	131,340.53

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

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

的证券出借业务。

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	7,317,400.33	13,157.16	8,782,399.78	28,871.96

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2021年1月21日	-	2021年1月21日	0.438	1,913,324.68	1,079,677.34	2,993,002.02	-
2	2021年4月	-	2021年4月	0.384	1,626,844.99	931,001.57	2,557,846.56	-

	21 日		21 日						
合计	-	-	-	0.822	3,540,169.67	2,010,678.91	5,550,848.58	-	-

6.4.12 期末(2021 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
688216	气派科技	2021 年 6 月 15 日	2021 年 12 月 23 日	新股流通受限	14.82	47.64	1,150	17,043.00	54,786.00	-
688345	博力威	2021 年 6 月 3 日	2021 年 12 月 13 日	新股流通受限	25.91	55.53	932	24,148.12	51,753.96	-
688655	迅捷兴	2021 年 4 月 28 日	2021 年 11 月 11 日	新股流通受限	7.59	15.77	3,021	22,929.39	47,641.17	-
688683	莱尔科技	2021 年 4 月 1 日	2021 年 10 月 12 日	新股流通受限	9.51	14.73	2,127	20,227.77	31,330.71	-
688517	金冠电气	2021 年 6 月 10 日	2021 年 12 月 20 日	新股流通受限	7.71	11.88	1,996	15,389.16	23,712.48	-
688499	利元亨	2021 年 6 月 23 日	2021 年 7 月 1 日	新股未上市	38.85	38.85	562	21,833.70	21,833.70	-
688226	威腾电气	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 7 日	新股未上市	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
688087	英科再生	2021 年 6 月 30 日	2021 年 7 月 9 日	新股未上市	21.96	21.96	641	14,076.36	14,076.36	-
605287	德才股份	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股未上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-

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. 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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600460	士兰微	2021年6月30日	重大事项停牌	56.35	2021年7月1日	59.49	14,500	772,234.00	817,075.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金，属于较高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、货币市场工具投资、权证投资及资产支持证券投资等。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争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制

措施；在业务操作层面风险管理职责主要由风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，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 2021 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 (2020 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 2021 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 2021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	7,317,400.33	-	-	-	7,317,400.33
结算备付金	430,699.42	-	-	-	430,699.42
存出保证金	18,281.86	-	-	-	18,281.86
交易性金融资产	-	-	-	83,539,029.43	83,539,029.43
应收利息	-	-	-	793.46	793.46
应收申购款	-	-	-	12,909.20	12,909.20
应收证券清算款	-	-	-	55,333.33	55,333.33
资产总计	7,766,381.61	-	-	83,608,065.42	91,374,447.03
负债					
应付赎回款	-	-	-	39,344.68	39,344.68
应付管理人报酬	-	-	-	112,471.35	112,471.35
应付托管费	-	-	-	18,745.23	18,745.23
应付交易费用	-	-	-	362,742.61	362,742.61
其他负债	-	-	-	78,319.19	78,319.19
负债总计	-	-	-	611,623.06	611,623.06
利率敏感度缺口	7,766,381.61	-	-	82,996,442.36	90,762,823.97
上年度末 2020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	7,468,363.26	-	-	-	7,468,363.26

结算备付金	926,810.00	-	-	-	926,810.00
存出保证金	20,037.21	-	-	-	20,037.21
交易性金融资产	-	-	-	94,391,186.28	94,391,186.28
应收利息	-	-	-	1,286.20	1,286.20
应收申购款	-	-	-	5,994.25	5,994.25
资产总计	8,415,210.47	-	-	94,398,466.73	102,813,677.20
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	265,356.87	265,356.87
应付管理人报酬	-	-	-	127,273.67	127,273.67
应付托管费	-	-	-	21,212.29	21,212.29
应付交易费用	-	-	-	242,625.49	242,625.49
其他负债	-	-	-	160,121.60	160,121.60
负债总计	-	-	-	816,589.92	816,589.92
利率敏感度缺口	8,415,210.47	-	-	93,581,876.81	101,997,087.28

注：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 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2020 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(2020 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 60%—95%，债券资产占基金资产的 0%—40%，权证占基金资产净值的 0%—3%，并保持现金或者到

期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。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 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	83,539,029.43	92.04	94,391,186.28	92.54
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	83,539,029.43	92.04	94,391,186.28	92.54

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		
	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（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
分析	业绩比较基准上升 5%	3,800,000.00	4,300,000.00
	业绩比较基准下降 5%	-3,800,000.00	-4,300,000.00

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	83,539,029.43	91.42
	其中：股票	83,539,029.43	91.42
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	7,748,099.75	8.48
8	其他各项资产	87,317.85	0.10
9	合计	91,374,447.03	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	-	-
B	采矿业	4,393,215.00	4.84
C	制造业	57,747,574.55	63.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,931,364.00	2.13
E	建筑业	175,332.44	0.19
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,879,636.00	2.07
H	住宿和餐饮业	88,282.00	0.10
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,099,950.40	1.21
J	金融业	11,329,885.90	12.48
K	房地产业	77,056.00	0.08
L	租赁和商务服务业	1,410,470.00	1.55
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	1,106,911.14	1.22
R	文化、体育和娱乐业	2,299,352.00	2.53
S	综合	-	-
	合计	83,539,029.43	92.04

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601636	旗滨集团	235,900	4,378,304.00	4.82
2	600919	江苏银行	571,200	4,055,520.00	4.47
3	000830	鲁西化工	143,700	2,691,501.00	2.97
4	601699	潞安环能	227,500	2,686,775.00	2.96
5	601009	南京银行	250,815	2,638,573.80	2.91
6	603877	太平鸟	49,100	2,620,958.00	2.89
7	600566	济川药业	138,283	2,475,265.70	2.73
8	000661	长春高新	6,000	2,322,000.00	2.56
9	600373	中文传媒	233,200	2,299,352.00	2.53
10	600519	贵州茅台	1,000	2,056,700.00	2.27
11	600702	舍得酒业	9,300	1,988,154.00	2.19
12	601166	兴业银行	96,200	1,976,910.00	2.18
13	601158	重庆水务	369,100	1,926,702.00	2.12
14	000858	五粮液	6,400	1,906,496.00	2.10
15	300782	卓胜微	3,500	1,881,250.00	2.07
16	300595	欧普康视	17,900	1,853,545.00	2.04
17	600276	恒瑞医药	26,564	1,805,555.08	1.99
18	600019	宝钢股份	227,600	1,738,864.00	1.92
19	603833	欧派家居	11,500	1,632,540.00	1.80
20	000581	威孚高科	72,200	1,503,926.00	1.66
21	603010	万盛股份	70,000	1,467,900.00	1.62
22	300760	迈瑞医疗	3,000	1,440,150.00	1.59
23	300124	汇川技术	19,300	1,433,218.00	1.58
24	601328	交通银行	289,600	1,419,040.00	1.56
25	601888	中国中免	4,700	1,410,470.00	1.55
26	603486	科沃斯	6,000	1,368,480.00	1.51
27	603587	地素时尚	51,900	1,292,829.00	1.42
28	601919	中远海控	41,500	1,267,410.00	1.40
29	603816	顾家家居	16,300	1,259,664.00	1.39
30	600808	马钢股份	291,900	1,252,251.00	1.38

31	605111	新洁能	6,400	1,153,728.00	1.27
32	603659	璞泰来	8,000	1,092,800.00	1.20
33	603886	元祖股份	59,200	1,031,856.00	1.14
34	000333	美的集团	14,238	1,016,166.06	1.12
35	603808	歌力思	62,100	981,180.00	1.08
36	002139	拓邦股份	53,500	962,465.00	1.06
37	600409	三友化工	94,700	957,417.00	1.05
38	600782	新钢股份	170,300	950,274.00	1.05
39	688111	金山办公	2,400	947,520.00	1.04
40	603260	合盛硅业	11,500	884,465.00	0.97
41	600460	士兰微	14,500	817,075.00	0.90
42	600763	通策医疗	1,900	780,900.00	0.86
43	000488	晨鸣纸业	88,100	717,134.00	0.79
44	000568	泸州老窖	2,900	684,226.00	0.75
45	600028	中国石化	143,400	625,224.00	0.69
46	000799	酒鬼酒	2,100	536,760.00	0.59
47	601398	工商银行	102,800	531,476.00	0.59
48	601225	陕西煤业	44,200	523,770.00	0.58
49	600377	宁沪高速	53,200	519,232.00	0.57
50	601127	小康股份	7,700	513,359.00	0.57
51	300146	汤臣倍健	14,300	470,470.00	0.52
52	600398	海澜之家	56,300	407,612.00	0.45
53	601838	成都银行	25,800	326,112.00	0.36
54	300015	爱尔眼科	4,593	326,011.14	0.36
55	600104	上汽集团	14,200	311,974.00	0.34
56	002327	富安娜	23,500	181,890.00	0.20
57	600219	南山铝业	48,800	175,680.00	0.19
58	688696	极米科技	179	148,928.00	0.16
59	600132	重庆啤酒	700	138,565.00	0.15
60	603501	韦尔股份	400	128,800.00	0.14
61	601666	平煤股份	18,000	127,980.00	0.14
62	601058	赛轮轮胎	12,600	125,874.00	0.14
63	600720	祁连山	11,700	123,318.00	0.14
64	688363	华熙生物	400	111,144.00	0.12
65	300737	科顺股份	3,300	103,752.00	0.11
66	603799	华友钴业	900	102,780.00	0.11
67	600309	万华化学	900	97,938.00	0.11
68	601012	隆基股份	1,100	97,724.00	0.11
69	600031	三一重工	3,300	95,931.00	0.11
70	600438	通威股份	2,200	95,194.00	0.10
71	601100	恒立液压	1,100	94,512.00	0.10
72	603128	华贸物流	6,600	92,994.00	0.10

73	603008	喜临门	2,800	92,428.00	0.10
74	601233	桐昆股份	3,800	91,542.00	0.10
75	603737	三棵树	520	91,520.00	0.10
76	600426	华鲁恒升	2,950	91,302.50	0.10
77	600882	妙可蓝多	1,300	90,740.00	0.10
78	600760	中航沈飞	1,500	90,450.00	0.10
79	600893	航发动力	1,700	90,423.00	0.10
80	600985	淮北矿业	7,400	90,354.00	0.10
81	600585	海螺水泥	2,200	90,310.00	0.10
82	600176	中国巨石	5,813	90,159.63	0.10
83	601899	紫金矿业	9,300	90,117.00	0.10
84	600926	杭州银行	6,100	89,975.00	0.10
85	601088	中国神华	4,600	89,792.00	0.10
86	600809	山西汾酒	200	89,600.00	0.10
87	600395	盘江股份	12,500	88,750.00	0.10
88	600316	洪都航空	2,300	88,504.00	0.10
89	600258	首旅酒店	3,700	88,282.00	0.10
90	600030	中信证券	3,500	87,290.00	0.10
91	688188	柏楚电子	200	87,200.00	0.10
92	600036	招商银行	1,600	86,704.00	0.10
93	600346	恒力石化	3,300	86,592.00	0.10
94	603801	志邦家居	2,700	86,292.00	0.10
95	600507	方大特钢	12,700	86,106.00	0.09
96	601668	中国建筑	18,400	85,560.00	0.09
97	601318	中国平安	1,300	83,564.00	0.09
98	601186	中国铁建	10,600	78,758.00	0.09
99	600048	保利地产	6,400	77,056.00	0.08
100	601339	百隆东方	14,100	75,999.00	0.08
101	600988	赤峰黄金	4,700	70,453.00	0.08
102	600141	兴发集团	3,700	69,671.00	0.08
103	600449	宁夏建材	6,000	68,160.00	0.08
104	688608	恒玄科技	199	63,065.09	0.07
105	603596	伯特利	1,700	60,775.00	0.07
106	603195	公牛集团	300	60,600.00	0.07
107	600801	华新水泥	3,400	59,738.00	0.07
108	688216	气派科技	1,150	54,786.00	0.06
109	603444	吉比特	100	53,000.00	0.06
110	688345	博力威	932	51,753.96	0.06
111	688655	迅捷兴	3,021	47,641.17	0.05
112	600436	片仔癀	100	44,830.00	0.05
113	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.04
114	688683	莱尔科技	2,127	31,330.71	0.03

115	688408	中信博	134	26,907.20	0.03
116	688517	金冠电气	1,996	23,712.48	0.03
117	688499	利元亨	562	21,833.70	0.02
118	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.02
119	688087	英科再生	641	14,076.36	0.02
120	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.01
121	603171	税友股份	637	12,230.40	0.01
122	605287	德才股份	349	11,014.44	0.01
123	688090	瑞松科技	157	5,336.43	0.01
124	605011	杭州热电	525	4,662.00	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	002415	海康威视	7,748,115.71	7.60
2	601818	光大银行	7,487,262.00	7.34
3	600309	万华化学	6,834,729.00	6.70
4	600809	山西汾酒	6,608,144.00	6.48
5	601636	旗滨集团	6,052,485.00	5.93
6	600919	江苏银行	5,919,372.60	5.80
7	601328	交通银行	5,806,900.00	5.69
8	600519	贵州茅台	5,752,800.00	5.64
9	600566	济川药业	5,586,182.30	5.48
10	601088	中国神华	5,402,510.00	5.30
11	600373	中文传媒	5,091,572.98	4.99
12	600926	杭州银行	5,079,823.00	4.98
13	000581	威孚高科	5,066,468.00	4.97
14	603816	顾家家居	5,058,433.00	4.96
15	000568	泸州老窖	4,819,051.00	4.72
16	600985	淮北矿业	4,660,181.13	4.57
17	601398	工商银行	4,630,908.00	4.54
18	000858	五粮液	4,624,273.68	4.53
19	000661	长春高新	4,445,358.00	4.36
20	000333	美的集团	4,379,928.37	4.29
21	601009	南京银行	4,354,659.45	4.27
22	601318	中国平安	4,352,178.00	4.27
23	300782	卓胜微	4,035,163.00	3.96
24	000001	平安银行	3,900,362.74	3.82
25	601601	中国太保	3,886,705.00	3.81
26	601288	农业银行	3,827,697.00	3.75
27	601155	新城控股	3,790,104.00	3.72

28	600276	恒瑞医药	3,560,763.11	3.49
29	000651	格力电器	3,538,512.00	3.47
30	601888	中国中免	3,451,576.00	3.38
31	603018	华设集团	3,432,629.00	3.37
32	601128	常熟银行	3,394,116.00	3.33
33	600690	海尔智家	3,315,823.75	3.25
34	603899	晨光文具	3,195,911.40	3.13
35	688111	金山办公	3,114,026.78	3.05
36	600036	招商银行	3,039,779.00	2.98
37	603886	元祖股份	2,993,849.38	2.94
38	603877	太平鸟	2,841,086.00	2.79
39	601699	潞安环能	2,817,963.00	2.76
40	603833	欧派家居	2,766,606.00	2.71
41	600176	中国巨石	2,724,787.00	2.67
42	600887	伊利股份	2,723,658.00	2.67
43	002142	宁波银行	2,677,656.46	2.63
44	300124	汇川技术	2,668,696.50	2.62
45	600763	通策医疗	2,641,249.00	2.59
46	601012	隆基股份	2,623,176.40	2.57
47	000830	鲁西化工	2,582,588.00	2.53
48	300394	天孚通信	2,504,893.00	2.46
49	601158	重庆水务	2,484,742.68	2.44
50	002050	三花智控	2,446,850.00	2.40
51	600028	中国石化	2,436,845.40	2.39
52	600048	保利地产	2,433,553.00	2.39
53	300595	欧普康视	2,412,067.00	2.36
54	603587	地素时尚	2,407,178.72	2.36
55	601166	兴业银行	2,331,824.00	2.29
56	300760	迈瑞医疗	2,296,254.00	2.25
57	000069	华侨城 A	2,230,412.20	2.19
58	600782	新钢股份	2,118,949.79	2.08
59	603801	志邦家居	2,097,308.60	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	600309	万华化学	14,097,815.25	13.82
2	600926	杭州银行	10,122,440.26	9.92
3	600036	招商银行	9,987,831.00	9.79

4	000333	美的集团	9,373,305.00	9.19
5	000651	格力电器	9,193,794.00	9.01
6	601318	中国平安	9,036,024.00	8.86
7	600176	中国巨石	8,598,779.00	8.43
8	002142	宁波银行	8,267,316.39	8.11
9	600048	保利地产	7,945,897.00	7.79
10	600900	长江电力	7,809,501.62	7.66
11	002415	海康威视	7,689,447.25	7.54
12	601818	光大银行	7,378,009.00	7.23
13	600809	山西汾酒	7,240,256.00	7.10
14	000002	万科A	7,103,856.00	6.96
15	600585	海螺水泥	6,954,739.00	6.82
16	603444	吉比特	5,939,804.40	5.82
17	601088	中国神华	5,600,532.00	5.49
18	600519	贵州茅台	4,682,849.00	4.59
19	000001	平安银行	4,672,496.80	4.58
20	601328	交通银行	4,323,422.00	4.24
21	000568	泸州老窖	4,112,564.00	4.03
22	600985	淮北矿业	4,050,019.45	3.97
23	600276	恒瑞医药	4,035,786.80	3.96
24	603816	顾家家居	3,999,755.23	3.92
25	601398	工商银行	3,995,511.00	3.92
26	601155	新城控股	3,825,754.00	3.75
27	600690	海尔智家	3,733,870.50	3.66
28	601288	农业银行	3,649,292.00	3.58
29	603018	华设集团	3,605,001.42	3.53
30	601128	常熟银行	3,521,845.00	3.45
31	601012	隆基股份	3,445,475.00	3.38
32	000581	威孚高科	3,406,854.00	3.34
33	601888	中国中免	3,133,476.00	3.07
34	601636	旗滨集团	3,053,843.00	2.99
35	601601	中国太保	3,026,422.00	2.97
36	600887	伊利股份	2,984,112.00	2.93
37	000858	五粮液	2,977,722.00	2.92
38	600566	济川药业	2,755,052.99	2.70
39	603899	晨光文具	2,716,141.10	2.66
40	603801	志邦家居	2,694,264.10	2.64
41	600373	中文传媒	2,482,079.00	2.43
42	600438	通威股份	2,387,627.00	2.34
43	000661	长春高新	2,265,049.00	2.22
44	300124	汇川技术	2,240,543.94	2.20
45	300394	天孚通信	2,225,245.00	2.18

46	300782	卓胜微	2,179,939.00	2.14
47	002050	三花智控	2,160,555.00	2.12
48	688111	金山办公	2,157,275.78	2.12
49	000069	华侨城 A	2,102,204.80	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。

7.4.3 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	338,380,704.28
卖出股票收入（成交）总额	352,600,044.57

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

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 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

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查的情况，在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

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	18,281.86
2	应收证券清算款	55,333.33
3	应收股利	-
4	应收利息	793.46
5	应收申购款	12,909.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	87,317.85

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)

6,223	10,431.44	10,485,714.88	16.15	54,429,151.28	83.85
-------	-----------	---------------	-------	---------------	-------

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	714,309.91	1.1004

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	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	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

注：本基金基金经理同时也是基金投资部门负责人。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2009年12月3日） 基金份额总额	1,396,164,951.08
本报告期期初基金份额总额	70,949,826.55
本报告期基金总申购份额	5,661,766.65
减：本报告期基金总赎回份额	11,696,727.04
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	64,914,866.16

§ 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2021年2月23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2021年2月23日起，由徐娇娇女士担任公司督察长。

2、本报告期内基金托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金无投资策略的变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金未更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

1、本报告期，基金管理人和托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到稽查或处罚。

2、报告期内，公司收到北京证监局对公司采取警示措施的决定。公司已及时完成了整改，提升了内控水平。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
广发证券	1	422,637,151.31	61.35%	393,604.02	61.35%	-
中信证券	4	85,261,174.85	12.38%	79,403.59	12.38%	-
浙商证券	2	63,167,574.47	9.17%	58,827.92	9.17%	-
西部证券	1	45,832,499.16	6.65%	42,684.37	6.65%	-
中泰证券	2	37,984,223.01	5.51%	35,375.47	5.51%	-
长江证券	2	24,900,459.49	3.61%	23,189.88	3.61%	-
华泰证券	1	9,151,160.57	1.33%	8,522.51	1.33%	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
财信证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-

广州证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	3	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-

注：（一）本基金本报告期撤销中信证券 089200、国信证券 036400、长江证券 293800、湘财证券 046600 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	成交金额	占当期权证成交总额

				比例		的比例
广发证券	-	-	7,000,000.00	76.92%	-	-
中信证券	-	-	2,100,000.00	23.08%	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
财信证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	泰达宏利基金管理有限公司关于泰达	《证券时报》、中国证监会	2021年4月20日

	宏利红利先锋混合型证券投资基金分红公告	会基金电子披露网站及公司网站	
2	泰达宏利基金管理有限公司关于泰达宏利红利先锋混合型证券投资基金分红公告	《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站及公司网站	2021 年 1 月 20 日

§ 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

基金管理人和托管人住所

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

2021 年 8 月 31 日