

# 泰达宏利价值长青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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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

<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>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
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	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>42</b>
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	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	48
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	48

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 .....	48
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 .....	48
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 .....	48
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	48
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 .....	49
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>50</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	50
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 .....	51
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>51</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>51</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	51
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 .....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	52
10.4 基金投资策略的改变 .....	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	52
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 .....	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	52
<b>§ 11 备查文件目录 .....</b>	<b>53</b>
11.1 备查文件目录 .....	53
11.2 存放地点 .....	53
11.3 查阅方式 .....	53

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	泰达宏利价值长青混合型证券投资基金	
基金简称	泰达价值长青混合	
基金主代码	009141	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 6 月 24 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	343,841,456.09 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	泰达价值长青混合 A	泰达价值长青混合 C
下属分级基金的交易代码	009141	009142
报告期末下属分级基金的份额总额	332,622,576.63 份	11,218,879.46 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金精选业绩稳定的优质企业进行长期投资，在严格控制风险的前提下，力求实现资产净值的长期稳健增值。
投资策略	以寻找持续的超额利润创造能力为核心，长线投资于稳健发展的卓越龙头企业。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+恒生指数收益率×20%+中债综合指数收益率×30%。
风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平低于股票型基金，高于货币市场基金与债券型基金。本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		泰达宏利基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	徐娇娇	张燕
	联系电话	66577766	0755-83199084
	电子邮箱	irm@mfcteda.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	刘轶	缪建民

## 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	<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

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)		
	泰达价值长青混合 A	泰达价值长青混合 C	
本期已实现收益	51,384,742.58	1,716,381.97	
本期利润	-17,645,783.96	-652,018.56	
加权平均基金份额本期利润	-0.0456	-0.0493	
本期加权平均净值利润率	-3.55%	-3.85%	
本期基金份额净值增长率	-4.25%	-4.40%	
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	84,402,997.99	2,804,372.15
	期末可供分配基金份额利润	0.2538	0.2500
	期末基金资产净值	417,025,574.62	14,023,251.61

期末基金份额净值	1.2538	1.2500
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	25.38%	25.00%

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

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

泰达价值长青混合 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	-5.47%	1.33%	-1.23%	0.51%	-4.24%	0.82%
过去三个月	2.20%	1.42%	2.26%	0.61%	-0.06%	0.81%
过去六个月	-4.25%	1.78%	1.75%	0.83%	-6.00%	0.95%
过去一年	25.37%	1.59%	16.40%	0.82%	8.97%	0.77%
自基金合同生效起至今	25.38%	1.58%	16.65%	0.82%	8.73%	0.76%

泰达价值长青混合 C

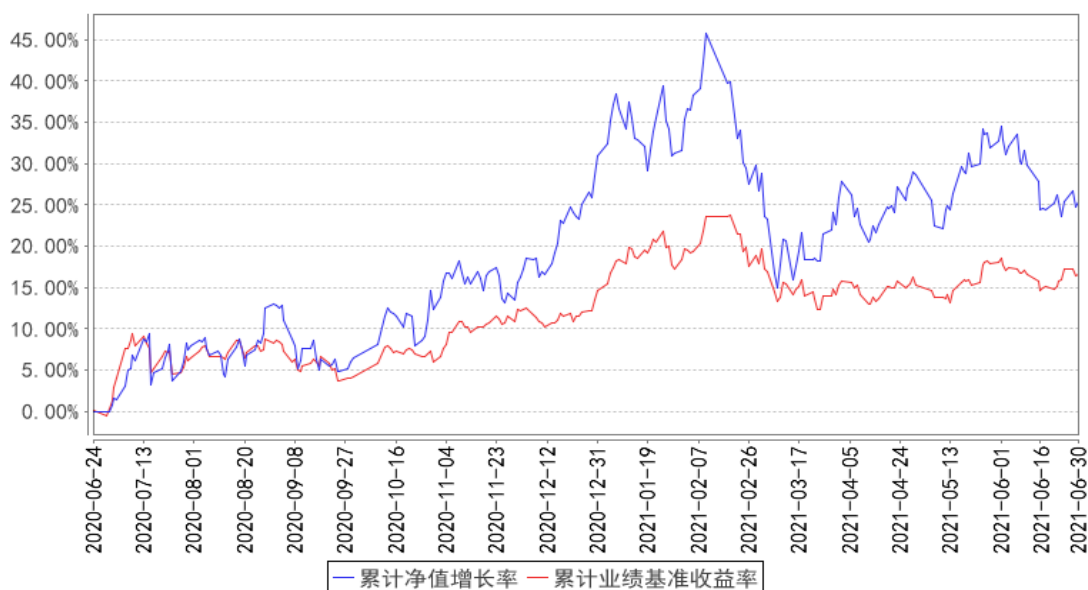
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

过去一个月	-5.50%	1.34%	-1.23%	0.51%	-4.27%	0.83%
过去三个月	2.12%	1.42%	2.26%	0.61%	-0.14%	0.81%
过去六个月	-4.40%	1.78%	1.75%	0.83%	-6.15%	0.95%
过去一年	25.00%	1.59%	16.40%	0.82%	8.60%	0.77%
自基金合同生效起 至今	25.00%	1.58%	16.65%	0.82%	8.35%	0.76%

注：本基金的业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×50%+恒生指数收益率×20%+中债综合指数收益率×30%。

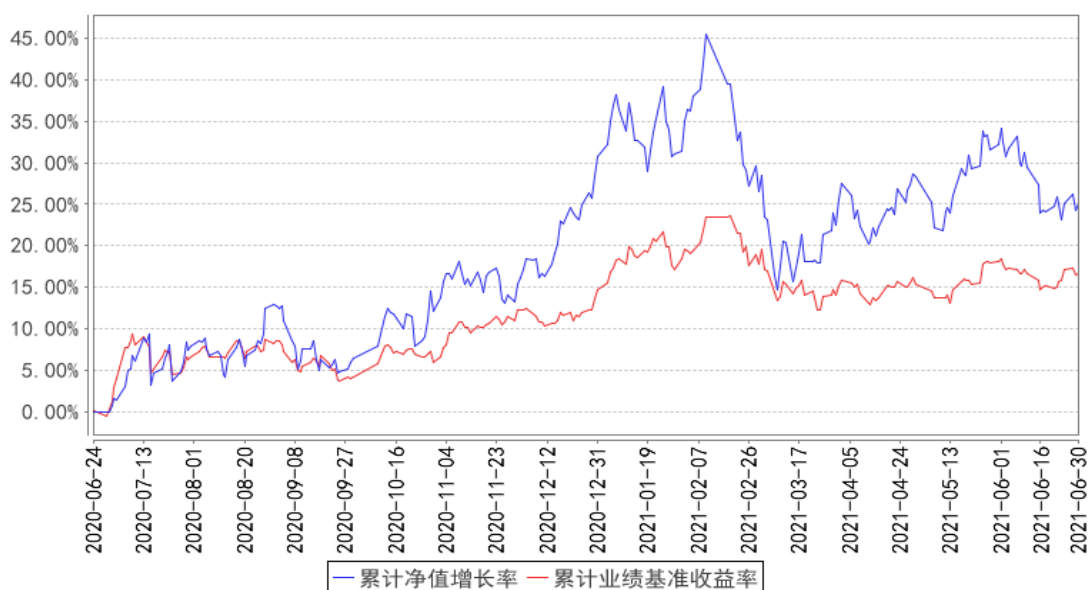
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

泰达价值长青混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图





泰达价值长青混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、泰达宏利泰和稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、泰达宏利价值长青混合型证券投资基金、泰达宏利中证申万绩优策略指数增强型证券投资基金、泰达宏利乐盈 66 个月定期开放债券型证券投资基金、泰达宏利高研发创新 6 个月持有期混合型证券投资基金、泰达宏利波控回报 12 个月持有期混合型证券投资基金、泰达宏利消费服务混合型证券投资基金、泰达宏利新能源股票型证券投资基金、泰达宏利中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金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		
吴华	本基金基金经理	2020 年 6 月 24 日	-	17 年	北京大学金融学硕士；2004 年 6 月至 2006 年 3 月就职于易方达基金管理有限公司，担任宏观策略分析师；2006 年 4 月至 2011 年 4 月就职于中国国际金融有限公司，先后就职于研究部、资产管理部，担任经理、副总经理等职位；2011 年 5 月加入泰达宏利基金管理有限公司，现任高级基金经理；具备 17 年证券从业经验，17 年证券投资管理经验，具有基金从业资格。

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

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作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，风险管理部对可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，对异常交易发生前后不同投资组合买卖该异常交易证券的情况进行分析，定期对各投资组合的交易行为进行整体分析评估，定期向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。如发现疑似异常交易情况，相关投资组合经理对该交易情况进行合理性解释。监察稽核部定期对异常交易制度的执行和控制工作进行稽核。

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处罚的情况。

## 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

2021 年上半年，全球宏观经济明显复苏。各国经济都保持了较高速增长，大宗商品价格明显上涨，通胀压力逐渐加大。A 股市场出现剧烈分化。家电、食品饮料和医药等板块出现大幅度的下跌。新能源汽车、光伏、钢铁和有色金属等板块大幅度上涨。

本基金一贯的策略是长期投资于稳健发展的卓越龙头企业。基金在家电、食品饮料和医药配置较多，这对基金净值造成了较大的影响。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末泰达价值长青混合 A 的基金份额净值为 1.2538 元，本报告期基金份额净值增长率为-4.25%，截至本报告期末泰达价值长青混合 C 的基金份额净值为 1.2500 元，本报告期基金份额净值增长率为-4.40%，同期业绩比较基准收益率为 1.75%。

#### 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 2021 年下半年，全球宏观经济增长速度会稳中趋缓，但大宗商品价格可能依然会维持在高位，受经济增速放缓和成本压力的影响，企业整体盈利增速也可能会平稳回落，但宏观经济可能存在一定的不确定性，全球疫情可能会有反复，美国通胀飙升可能会引发美联储政策的变化。此外，全球自然灾害的影响力量将有所上升，国际政治经济的纠纷将有所抬头，这些都预示着全球经济结构进化的过程会加速，这对宏观经济、各行业在国民经济中的地位，产业链格局都会产生明显的影响。

股票市场可能会出现较大幅度的震荡。全球货币政策和流动性在边际上很难再度宽松，但超级大宽松所遗留下的存量流动性已经非常充裕。在全球经济增速放缓的背景下，企业盈利增速也很难加速。这些因素都不支持股指整体出现大幅度上涨。整体估值水平也难言便宜，有待时间来消化，但在景气度持续维持在高位的行业中，部分优质个股依然存在价值重估的机会。这些热点会对股指有一定的支撑。近期食品饮料和医药医疗服务等长期价值较确定的板块已经出现大幅度的回调，其价值也日益明显，流动性宽裕的局面短期也较难改变。综合来看，股指如果持续大幅度调整后也可能会迎来较强的支撑。

我们看好两类行业的长期前景：1) 景气度高且增长速度快的行业，比如新能源汽车、光伏、半导体、智能制造、医院设备和医疗器械；2) 景气度高且生命周期长的行业，比如高端白酒。

本基金会在看好的方向上精选治理优选、壁垒高、核心竞争力突出的公司，以分享这些企业所创造的价值。

#### 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：泰达宏利价值长青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
<b>资产:</b>			
银行存款	6.4.7.1	24,250,699.55	36,398,919.45
结算备付金		969,581.57	6,241,308.75
存出保证金		129,878.64	1,625,022.94
交易性金融资产	6.4.7.2	407,298,804.65	605,554,281.11
其中: 股票投资		407,298,804.65	605,554,281.11
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		1,578,101.86	9,724,511.67
应收利息	6.4.7.5	2,780.34	4,837.67
应收股利		-	-
应收申购款		147,622.44	1,487,954.77
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		434,377,469.05	661,036,836.36
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2020 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		5.30	6,036,279.35
应付赎回款		2,200,753.20	10,767,391.94
应付管理人报酬		556,599.44	829,536.40
应付托管费		92,766.57	138,256.06
应付销售服务费		3,676.56	4,489.25
应付交易费用	6.4.7.7	372,437.39	577,234.51
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	102,404.36	181,330.25
负债合计		3,328,642.82	18,534,517.76
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	343,841,456.09	490,661,358.69
未分配利润	6.4.7.10	87,207,370.14	151,840,959.91

所有者权益合计		431,048,826.23	642,502,318.60
负债和所有者权益总计		434,377,469.05	661,036,836.36

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额总额 343,841,456.09 份，其中泰达价值长青混合 A 基金份额总额 332,622,576.63 份，基金份额净值 1.2538 元；泰达价值长青混合 C 基金份额总额 11,218,879.46 份，基金份额净值 1.2500 元。

## 6.2 利润表

会计主体：泰达宏利价值长青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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 6 月 24 日（基金 合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		-12,436,431.28	740,191.06
1. 利息收入		59,154.01	98,198.92
其中：存款利息收入	6.4.7.11	59,154.01	98,198.92
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）		58,392,666.03	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	56,808,530.84	-
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.13.5	-	-
收益			
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	1,584,135.19	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-71,398,927.07	641,992.14
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	510,675.75	-
减：二、费用		5,861,371.24	618,380.83
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,857,234.68	314,412.53

2. 托管费	6.4.10.2.2	642,872.49	52,402.09
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	25,403.53	719.32
4. 交易费用	6.4.7.19	1,214,966.31	244,216.54
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	120,894.23	6,630.35
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-18,297,802.52	121,810.23
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-18,297,802.52	121,810.23

### 6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：泰达宏利价值长青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)	490,661,358.69	151,840,959.91	642,502,318.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-18,297,802.52	-18,297,802.52
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)	-146,819,902.60	-46,335,787.25	-193,155,689.85
其中：1. 基金申购款	158,445,152.56	50,756,815.70	209,201,968.26
2. 基金赎回款	-305,265,055.16	-97,092,602.95	-402,357,658.11
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	343,841,456.09	87,207,370.14	431,048,826.23



项目	上年度可比期间		
	2020 年 6 月 24 日（基金合同生效日）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）	1,278,718,247.15	-	1,278,718,247.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	121,810.23	121,810.23
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）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
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）	1,278,718,247.15	121,810.23	1,278,840,057.38

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

泰达宏利价值长青混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]2155 号《关于准予泰达宏利价值长青混合型证券投资基金注册的批复》核准,由泰达宏利基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利价值长青混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,278,351,129.93 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(2020)第 0357 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰达宏利价值长青混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 6 月 24 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,278,718,247.15 份基金份额,其中认购资金利息折合 367,117.22 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《泰达宏利价值长青混合型证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用的基金份额,称为 A 类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费的、不收取认购/申购费用的基金份额,称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利价值长青混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、港股通标的股票、债券(包括国债、地方政府债、政府支持债券、政府支持机构债券、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券(含分离交易可转债的纯债部分)、可交换债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、债券回购、资产支持证券、货币市场工具、银行存款(包括定期存款、协议存款、通知存款等)、同业存单、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例为 60%-95%;投资于港股通标的股票比例占股票投资比例的 0-50%;本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;股指期货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 $\times$ 50%+恒生指数收益率 $\times$ 20%+中债综合指数收益率 $\times$ 30%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、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》、《泰达宏利价值长青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 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 06 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 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

本基金本报告期未发生会计政策的变更。

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

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

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

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	24,250,699.55
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	24,250,699.55

### 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	360,497,313.92	407,298,804.65	46,801,490.73
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	360,497,313.92	407,298,804.65	46,801,490.73

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/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

本基金本报告期末未持有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	2,285.64
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	436.30
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	58.40
合计	2,780.34

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 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	372,437.39
银行间市场应付交易费用	-
合计	372,437.39

#### 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	1,205.11
应付证券出借违约金	-
预提费用	101,199.25
合计	102,404.36

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

##### 泰达价值长青混合 A

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	475,271,406.80	475,271,406.80
本期申购	152,149,790.44	152,149,790.44
本期赎回（以“-”号填列）	-294,798,620.61	-294,798,620.61
-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	332,622,576.63	332,622,576.63

##### 泰达价值长青混合 C

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	15,389,951.89	15,389,951.89
本期申购	6,295,362.12	6,295,362.12
本期赎回（以“-”号填列）	-10,466,434.55	-10,466,434.55
-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	11,218,879.46	11,218,879.46

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

泰达价值长青混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	85,632,980.68	61,475,412.90	147,108,393.58
本期利润	51,384,742.58	-69,030,526.54	-17,645,783.96
本期基金份额交易产生的变动数	-32,831,210.74	-12,228,400.89	-45,059,611.63
其中：基金申购款	35,374,063.38	13,386,962.27	48,761,025.65
基金赎回款	-68,205,274.12	-25,615,363.16	-93,820,637.28
本期已分配利润	-	-	-
本期末	104,186,512.52	-19,783,514.53	84,402,997.99

泰达价值长青混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,743,846.26	1,988,720.07	4,732,566.33
本期利润	1,716,381.97	-2,368,400.53	-652,018.56
本期基金份额交易产生的变动数	-992,122.87	-284,052.75	-1,276,175.62
其中：基金申购款	1,460,807.91	534,982.14	1,995,790.05
基金赎回款	-2,452,930.78	-819,034.89	-3,271,965.67
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,468,105.36	-663,733.21	2,804,372.15

#### 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	51,312.48
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	5,010.91
其他	2,830.62
合计	59,154.01

## 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	56,808,530.84
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	56,808,530.84

### 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	452,552,949.93
减：卖出股票成本总额	395,744,419.09
买卖股票差价收入	56,808,530.84

### 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

本基金本报告期内未有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

本基金本报告期内未有贵金属投资收益。

##### 6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内未有贵金属投资收益—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

本基金本报告期内未有贵金属投资收益—赎回差价收入。

##### 6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内未有贵金属投资收益—申购差价收入。

#### 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

本基金本报告期内未有衍生工具收益-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

本基金本报告期内未有衍生工具收益-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	1,584,135.19
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	1,584,135.19

#### 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	-71,398,927.07
股票投资	-71,398,927.07
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	-71,398,927.07

#### 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	509,078.55
基金转换费收入	1,597.20
合计	510,675.75

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	1,214,966.31
银行间市场交易费用	-
合计	1,214,966.31

#### 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	37,191.88
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	10,694.98
账户维护费	13,500.00
合计	120,894.23

#### 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

截至财务报表报出日，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、基金销售机构、注册登记机构
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交易单元进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联交易单元进行债券回购交易。

###### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联交易单元进行权证交易。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

## 6.4.10.2 关联方报酬

### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年6月24日（基金合同生效日）至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,857,234.68	314,412.53
其中：支付销售机构的客户维护费	1,767,152.69	198,057.42

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 × 1.50% / 当年天数。

### 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6月24日（基金合同生效日）至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	642,872.49	52,402.09

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 × 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 2021年1月1日至2021年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泰达价值长青混合 A	泰达价值长青混合 C	合计
泰达宏利基金管理有限公司	-	15.88	15.88
招商银行	-	19,569.83	19,569.83
合计	-	19,585.71	19,585.71
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020年6月24日（基金合同生效日）至2020年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		

	泰达价值长青混合 A	泰达价值长青混合 C	合计
泰达宏利基金管理有限公司	-	-	-
招商银行	-	584.52	584.52
合计	-	584.52	584.52

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 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：日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额的基金资产净值 × 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 6 月 24 日（基金合同生效日）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
招商银行	24,250,699.55	51,312.48	1,149,434,832.50	98,198.92

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末(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
688686	奥普特	2020年12月24日	2021年7月1日	新股流通受限	78.49	451.00	2,292	179,899.08	1,033,692.00	-
688665	四方光电	2021年2月2日	2021年8月9日	新股流通受限	29.53	129.46	1,687	49,817.11	218,399.02	-
688625	呈和科技	2021年5月31日	2021年12月7日	新股流通受限	16.48	42.63	2,672	44,034.56	113,907.36	-
300919	中伟股份	2020年12月15日	2021年7月2日	新股流通受限	24.60	163.00	610	15,006.00	99,430.00	-
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	2,149	83,488.65	83,488.65	-
300957	贝泰妮	2021年3月18日	2021年9月27日	新股流通受限	47.33	251.96	287	13,583.71	72,312.52	-
688533	上声电子	2021年4月9日	2021年10月19日	新股流通受限	7.72	19.11	3,493	26,965.96	66,751.23	-
688087	英科	2021年	2021	新股未	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-

	再生	6月30日	年7月9日	上市						
301017	漱玉平民	2021年6月23日	2021年7月5日	新股未上市	8.86	8.86	5,550	49,173.00	49,173.00	-
301020	密封科技	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未上市	10.64	10.64	4,210	44,794.40	44,794.40	-
300973	立高食品	2021年4月8日	2021年10月15日	新股流通受限	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-
688395	正弦电气	2021年4月21日	2021年10月29日	新股流通受限	15.95	22.37	1,627	25,950.65	36,395.99	-
301021	英诺激光	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未上市	9.46	9.46	2,899	27,424.54	27,424.54	-
301009	可靠股份	2021年6月8日	2021年12月17日	新股流通受限	12.54	27.89	801	10,044.54	22,339.89	-
300941	创识科技	2021年2月2日	2021年8月9日	新股流通受限	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06	-
301015	百洋医药	2021年6月22日	2021年12月30日	新股流通受限	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
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	-
300932	三友联众	2021年1月15日	2021年7月22日	新股流通受限	24.69	31.71	492	12,147.48	15,601.32	-
300982	苏文电能	2021年4月19日	2021年10月27日	新股流通受限	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300940	南极光	2021年1月27日	2021年8月3日	新股流通受限	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300614	百川	2021年	2021	新股流	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-

	畅银	5月18日	年11月25日	通受限						
300937	药易购	2021年1月20日	2021年7月27日	新股流通受限	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
301013	利和兴	2021年6月21日	2021年12月29日	新股流通受限	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-
300942	易瑞生物	2021年2月2日	2021年8月9日	新股流通受限	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300997	欢乐家	2021年5月26日	2021年12月2日	新股流通受限	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
300933	中辰股份	2021年1月15日	2021年7月22日	新股流通受限	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
301002	崧盛股份	2021年5月27日	2021年12月7日	新股流通受限	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
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	-
300955	嘉亨家化	2021年3月16日	2021年9月24日	新股流通受限	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300956	英力股份	2021年3月16日	2021年9月27日	新股流通受限	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
300962	中金辐照	2021年3月29日	2021年10月11日	新股流通受限	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300952	恒辉安防	2021年3月3日	2021年9月13日	新股流通受限	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
301016	雷尔伟	2021年6月23日	2021年12月30日	新股流通受限	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
300966	共同药业	2021年3月31日	2021年10月	新股流通受限	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-



		日	月 11 日							
300945	曼卡龙	2021 年 2 月 3 日	2021 年 8 月 10 日	新股流 通受限	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300931	通用 电梯	2021 年 1 月 13 日	2021 年 7 月 21 日	新股流 通受限	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300961	深水 海纳	2021 年 3 月 23 日	2021 年 9 月 30 日	新股流 通受限	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300950	德固 特	2021 年 2 月 24 日	2021 年 9 月 3 日	新股流 通受限	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
300958	建工 修复	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 29 日	新股流 通受限	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300986	志特 新材	2021 年 4 月 21 日	2021 年 11 月 1 日	新股流 通受限	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网 传媒	2021 年 4 月 28 日	2021 年 11 月 11 日	新股流 通受限	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300978	东箭 科技	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	新股流 通受限	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300926	博俊 科技	2020 年 12 月 29 日	2021 年 07 月 12 日	新股流 通受限	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300930	屹通 新材	2021 年 1 月 13 日	2021 年 7 月 21 日	新股流 通受限	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300985	致远 新能	2021 年 4 月 21 日	2021 年 10 月 29 日	新股流 通受限	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-
300971	博亚 精工	2021 年 4 月 7 日	2021 年 10 月 15 日	新股流 通受限	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-
301004	嘉益	2021 年	2021	新股流	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-

	股份	6月18日	年12月27日	通受限						
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年7月7日	新股流通受限	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300963	中洲特材	2021年3月30日	2021年10月11日	新股流通受限	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
301011	华立科技	2021年6月9日	2021年12月17日	新股流通受限	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
300943	春晖智控	2021年2月3日	2021年8月10日	新股流通受限	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300967	晓鸣股份	2021年4月2日	2021年10月13日	新股流通受限	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300972	万辰生物	2021年4月8日	2021年10月19日	新股流通受限	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300929	华骐环保	2021年1月12日	2021年07月21日	新股流通受限	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300995	奇德新材	2021年5月17日	2021年11月26日	新股流通受限	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
301007	德迈仕	2021年6月4日	2021年12月16日	新股流通受限	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
300998	宁波方正	2021年5月25日	2021年12月2日	新股流通受限	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301012	扬电科技	2021年6月15日	2021年12月22日	新股流通受限	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-

300992	泰福泵业	2021年5月17日	2021年11月25日	新股流通受限	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
301010	晶雪节能	2021年6月9日	2021年12月20日	新股流通受限	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-

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

本基金本报告期末未持有暂时停牌的股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为混合型证券投资基金，预期收益及风险水平低于股票型基金，高于货币市场基金与债券型基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、货币市场工具、股指期货、资产支持证券等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在

限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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 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（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，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易

的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来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	24,250,699.55	-	-	-	24,250,699.55
结算备付金	969,581.57	-	-	-	969,581.57
存出保证金	129,878.64	-	-	-	129,878.64
交易性金融资产	-	-	-	407,298,804.65	407,298,804.65
应收利息	-	-	-	2,780.34	2,780.34
应收申购款	-	-	-	147,622.44	147,622.44
应收证券清算款	-	-	-	1,578,101.86	1,578,101.86
资产总计	25,350,159.76	-	-	409,027,309.29	434,377,469.05
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,200,753.20	2,200,753.20
应付管理人报酬	-	-	-	556,599.44	556,599.44

应付托管费	-	-	-	92,766.57	92,766.57
应付证券清算款	-	-	-	5.30	5.30
应付销售服务费	-	-	-	3,676.56	3,676.56
应付交易费用	-	-	-	372,437.39	372,437.39
其他负债	-	-	-	102,404.36	102,404.36
负债总计	-	-	-	3,328,642.82	3,328,642.82
利率敏感度缺口	25,350,159.76	-	-	-405,698,666.47	431,048,826.23
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	36,398,919.45	-	-	-	36,398,919.45
结算备付金	6,241,308.75	-	-	-	6,241,308.75
存出保证金	1,625,022.94	-	-	-	1,625,022.94
交易性金融资产	-	-	-	-605,554,281.11	605,554,281.11
应收利息	-	-	-	4,837.67	4,837.67
应收申购款	-	-	-	1,487,954.77	1,487,954.77
应收证券清算款	-	-	-	9,724,511.67	9,724,511.67
资产总计	44,265,251.14	-	-	-616,771,585.22	661,036,836.36
负债					
应付赎回款	-	-	-	10,767,391.94	10,767,391.94
应付管理人报酬	-	-	-	829,536.40	829,536.40
应付托管费	-	-	-	138,256.06	138,256.06
应付证券清算款	-	-	-	6,036,279.35	6,036,279.35
应付销售服务费	-	-	-	4,489.25	4,489.25
应付交易费用	-	-	-	577,234.51	577,234.51
其他负债	-	-	-	181,330.25	181,330.25
负债总计	-	-	-	18,534,517.76	18,534,517.76
利率敏感度缺口	44,265,251.14	-	-	-598,237,067.46	642,502,318.60

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。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
交易性金融资产	-	23,852,105.73	-	23,852,105.73
资产合计	-	23,852,105.73	-	23,852,105.73
以外币计价的 负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净 额	-	23,852,105.73	-	23,852,105.73
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
交易性金融资产	-	6,360,778.46	-	6,360,778.46
资产合计	-	6,360,778.46	-	6,360,778.46
以外币计价的 负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净 额	-	6,360,778.46	-	6,360,778.46

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
相关风险变量的变 动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）		
	本期末（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）	
分析	所有外币相对人民	1,190,000.00	320,000.00



	币升值 5%		
	所有外币相对人民币贬值 5%	-1,190,000.00	-320,000.00

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产占基金资产的比例为 60%-95%，投资于港股通标的股票比例占股票投资比例的 0-50%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约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 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	407,298,804.65	94.49	605,554,281.11	94.25
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	407,298,804.65	94.49	605,554,281.11	94.25

#### 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%	25,170,000.00	-
	业绩比较基准下降5%	-25,170,000.00	-

#### 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	407,298,804.65	93.77
	其中：股票	407,298,804.65	93.77
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	25,220,281.12	5.81
8	其他各项资产	1,858,383.28	0.43
9	合计	434,377,469.05	100.00

注：上表权益投资中通过深港通交易机制投资的港股公允价值为 23,852,105.73，占基金资产净值比例为 5.53%。

## 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	11,290.28	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	360,243,939.67	83.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,662.00	0.00
E	建筑业	25,371.37	0.01
F	批发和零售业	455,316.30	0.11
G	交通运输、仓储和邮政业	61,380.82	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	71,269.81	0.02
J	金融业	34,721.10	0.01
K	房地产业	10,095.90	0.00
L	租赁和商务服务业	22,327,440.00	5.18
M	科学研究和技术服务业	165,657.42	0.04
N	水利、环境和公共设施管理业	35,554.25	0.01
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	383,446,698.92	88.96

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
地产建筑业	-	-
能源	-	-
消费者常用品	-	-
信息技术	-	-
工业	-	-
公用事业	-	-
金融	-	-
基础材料	-	-
医疗保健	-	-
消费者非必需品	-	-
电信服务	23,852,105.73	5.53
合计	23,852,105.73	5.53

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	000858	五 粮 液	141,238	42,073,387.82	9.76
2	300760	迈瑞医疗	87,410	41,961,170.50	9.73
3	600519	贵州茅台	20,309	41,769,520.30	9.69
4	000661	长春高新	103,010	39,864,870.00	9.25
5	603520	司太立	602,417	37,139,008.05	8.62
6	000568	泸州老窖	141,016	33,271,315.04	7.72
7	688016	心脉医疗	56,114	25,509,985.54	5.92
8	300601	康泰生物	165,300	24,629,700.00	5.71
9	00700	腾讯控股	49,085	23,852,105.73	5.53
10	601888	中国中免	74,400	22,327,440.00	5.18
11	300122	智飞生物	109,000	20,353,570.00	4.72
12	688166	博瑞医药	454,407	18,998,756.67	4.41
13	600276	恒瑞医药	191,520	13,017,614.40	3.02
14	688329	艾隆科技	171,610	9,380,202.60	2.18
15	688526	科前生物	166,400	6,027,008.00	1.40
16	603605	珀莱雅	9,300	1,829,403.00	0.42
17	688686	奥普特	2,292	1,033,692.00	0.24
18	688161	威高骨科	2,806	297,576.30	0.07
19	688269	凯立新材	1,941	270,808.32	0.06
20	301015	百洋医药	4,614	251,115.78	0.06
21	688665	四方光电	1,687	218,399.02	0.05
22	688559	海目星	5,924	179,082.52	0.04
23	301013	利和兴	4,704	168,966.51	0.04
24	301002	崧盛股份	2,001	159,001.62	0.04
25	688510	航亚科技	5,991	157,563.30	0.04
26	300937	药易购	2,434	133,599.04	0.03
27	688621	阳光诺和	1,485	131,868.00	0.03
28	300933	中辰股份	11,117	117,462.18	0.03
29	301016	雷尔伟	2,747	115,711.58	0.03
30	688625	呈和科技	2,672	113,907.36	0.03
31	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.02
32	688628	优利德	2,789	93,292.05	0.02
33	688607	康众医疗	1,890	87,507.00	0.02
34	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.02
35	300957	贝泰妮	287	72,312.52	0.02
36	688533	上声电子	3,493	66,751.23	0.02
37	688350	富淼科技	2,552	58,236.64	0.01

38	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
39	301010	晶雪节能	2,172	50,480.96	0.01
40	300910	瑞丰新材	474	49,556.70	0.01
41	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.01
42	603565	中谷物流	1,625	48,441.25	0.01
43	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.01
44	300894	火星人	628	42,704.00	0.01
45	300973	立高食品	360	41,655.60	0.01
46	688395	正弦电气	1,627	36,395.99	0.01
47	003009	中天火箭	623	36,183.84	0.01
48	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
49	300887	谱尼测试	378	33,789.42	0.01
50	300900	广联航空	879	32,857.02	0.01
51	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
52	605099	共创草坪	624	26,445.12	0.01
53	001207	联科科技	682	22,581.02	0.01
54	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.01
55	300911	亿田智能	309	21,407.52	0.00
56	300884	狄耐克	748	20,106.24	0.00
57	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
58	300891	惠云钛业	1,143	19,876.77	0.00
59	003006	百亚股份	804	19,054.80	0.00
60	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
61	300908	仲景食品	285	16,983.15	0.00
62	300909	汇创达	386	16,636.60	0.00
63	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00
64	300890	翔丰华	286	15,615.60	0.00
65	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
66	003010	若羽臣	562	15,269.54	0.00
67	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
68	002998	优彩资源	1,353	13,719.42	0.00
69	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
70	002572	索菲亚	557	13,479.40	0.00
71	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
72	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
73	605050	福然德	1,197	12,939.57	0.00
74	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
75	300892	品渥食品	272	12,479.36	0.00
76	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
77	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
78	300889	爱克股份	479	11,639.70	0.00
79	300879	大叶股份	466	11,267.88	0.00

80	605018	长华股份	840	11,096.40	0.00
81	300918	南山智尚	1,063	11,065.83	0.00
82	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
83	003003	天元股份	756	10,765.44	0.00
84	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
85	300917	特发服务	365	10,095.90	0.00
86	300922	天秦装备	287	9,996.21	0.00
87	300882	万胜智能	572	9,981.40	0.00
88	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
89	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
90	300893	松原股份	414	9,240.48	0.00
91	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
92	003000	劲仔食品	684	9,117.72	0.00
93	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
94	605116	奥锐特	642	9,000.84	0.00
95	300881	盛德鑫泰	291	8,959.89	0.00
96	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
97	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
98	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
99	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
100	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
101	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
102	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
103	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
104	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
105	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
106	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
107	000333	美的集团	100	7,137.00	0.00
108	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
109	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
110	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
111	002032	苏泊尔	100	6,379.00	0.00
112	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
113	300886	华业香料	191	6,194.13	0.00
114	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
115	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
116	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
117	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
118	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
119	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
120	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
121	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00

122	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
123	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
124	300992	泰福泵业	200	4,064.00	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	000651	格力电器	38,211,212.31	5.95
2	300601	康泰生物	35,337,356.49	5.50
3	600276	恒瑞医药	24,314,068.80	3.78
4	601888	中国中免	22,731,737.00	3.54
5	688016	心脉医疗	22,701,665.17	3.53
6	00700 HS	腾讯控股	22,653,291.52	3.53
7	300122	智飞生物	21,196,622.00	3.30
8	688166	博瑞医药	20,036,087.50	3.12
9	688526	科前生物	10,892,522.68	1.70
10	688329	艾隆科技	9,423,287.83	1.47
11	000661	长春高新	9,351,785.00	1.46
12	603520	司太立	9,323,002.00	1.45
13	002032	苏泊尔	4,145,437.00	0.65
14	000333	美的集团	3,900,214.02	0.61
15	688626	翔宇医疗	3,030,908.20	0.47
16	603605	珀莱雅	1,746,789.00	0.27
17	600176	中国巨石	1,323,262.00	0.21
18	688617	惠泰医疗	794,323.00	0.12
19	000568	泸州老窖	543,519.00	0.08
20	300760	迈瑞医疗	456,375.40	0.07

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	000651	格力电器	62,618,626.90	9.75
2	600276	恒瑞医药	56,387,555.45	8.78
3	000333	美的集团	55,861,454.76	8.69
4	002032	苏泊尔	49,876,496.47	7.76
5	000568	泸州老窖	28,591,438.97	4.45
6	300760	迈瑞医疗	27,659,574.00	4.30
7	000661	长春高新	27,000,019.00	4.20
8	600519	贵州茅台	24,192,619.00	3.77

9	688356	键凯科技	21,741,049.64	3.38
10	000858	五粮液	21,727,211.72	3.38
11	300601	康泰生物	21,111,593.48	3.29
12	300451	创业慧康	10,614,568.31	1.65
13	603520	司太立	8,482,714.00	1.32
14	688016	心脉医疗	4,885,801.25	0.76
15	688526	科前生物	3,997,942.39	0.62
16	688626	翔宇医疗	3,786,088.70	0.59
17	00700 HS	腾讯控股	2,140,550.65	0.33
18	600176	中国巨石	1,323,373.04	0.21
19	688617	惠泰医疗	1,037,190.48	0.16
20	688301	奕瑞科技	694,008.41	0.11

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	268,887,869.70
卖出股票收入（成交）总额	452,552,949.93

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券投资。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 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

本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的，将利用股指期货剥离多头股票资产部分的系统性风险或建立适当的股指期货多头头寸对冲市场向上风险。

## 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

本报告期本基金未投资国债期货。

## 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

基金投资前十名证券的发行主体未有被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	129,878.64
2	应收证券清算款	1,578,101.86
3	应收股利	-
4	应收利息	2,780.34
5	应收申购款	147,622.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,858,383.28

### 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（%）
泰达价值长青混合 A	5,992	55,511.11	-	-	332,622,576.63	100.00
泰达价值长青混合 C	1,554	7,219.36	-	-	11,218,879.46	100.00
合计	7,546	45,566.06	-	-	343,841,456.09	100.00

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	泰达价值长青混合 A	632,078.42	0.1900
	泰达价值长青混合 C	8,319.47	0.0742

	合计	640,397.89	0.1862
--	----	------------	--------

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	泰达价值长青混合 A	-
	泰达价值长青混合 C	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	泰达价值长青混合 A	50~100
	泰达价值长青混合 C	0~10
	合计	50~100

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	泰达价值长青混合 A	泰达价值长青混合 C
基金合同生效日 (2020年6月24日) 基金份额总额	1,264,090,576.56	14,627,670.59
本报告期期初基金份额总额	475,271,406.80	15,389,951.89
本报告期基金总申购份额	152,149,790.44	6,295,362.12
减：本报告期基金总赎回份额	294,798,620.61	10,466,434.55
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	332,622,576.63	11,218,879.46

## § 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人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金无投资策略的变化。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

1、本报告期，基金管理人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	
华西证券	2	294,309,532.29	41.19%	274,090.91	41.86%	-
开源证券	1	223,663,359.99	31.30%	208,297.64	31.81%	-
申港证券	1	88,797,412.84	12.43%	82,696.31	12.63%	-
天风证券	2	66,497,121.14	9.31%	61,928.65	9.46%	-
国泰君安	2	24,793,842.17	3.47%	12,396.94	1.89%	-
长江证券	2	16,482,410.92	2.31%	15,350.14	2.34%	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

注：（一）本基金本报告期交易单元无变更。

（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 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准基金募集的文件；
- 2、基金合同；
- 3、托管协议；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

### 11.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

### 11.3 查阅方式

投资人可登录中国证监会基金电子披露网站 (<http://eid.csrc.gov.cn/fund>) 或者基金管理人互联网网站 (<http://www.mfcteda.com>) 查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人泰达宏利基金管理有限公司：客户服务中心电话：400-698-8888 或 010-66555662。

泰达宏利基金管理有限公司

2021 年 8 月 31 日