

泰达宏利高研发创新 6 个月持有期混合型 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	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	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
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46
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	46

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	46
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	47
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	47
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
7.12 投资组合报告附注	47
§ 8 基金份额持有人信息	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	49
§ 9 开放式基金份额变动	49
§ 10 重大事件揭示	50
10.1 基金份额持有人大会决议	50
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	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	50
10.4 基金投资策略的改变	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	50
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	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	50
10.8 其他重大事件	52
§ 11 备查文件目录	52
11.1 备查文件目录	52
11.2 存放地点	52
11.3 查阅方式	52

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泰达宏利高研发创新 6 个月持有期混合型证券投资基金	
基金简称	泰达高研发 6 个月持有混合	
基金主代码	010135	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 9 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	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	302,077,505.16 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	泰达高研发 6 个月持有混合 A	泰达高研发 6 个月持有混合 C
下属分级基金的交易代码	010135	010136
报告期末下属分级基金的份额总额	222,112,561.99 份	79,964,943.17 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过对上市公司基本面全面、深入的研究分析，精选高研发投入的优质企业，在严格控制风险、保持良好流动性的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将采用“自上而下”与“自下而上”相结合的主动投资管理策略，重点投资于研发投入占比高出全市场平均的高研发行业和企业，结合资产配置和组合策略的定量风险控制，争取实现基金资产的长期稳健增值。
业绩比较基准	中证 800 成长指数收益率×55%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×20%+中证综合债券指数收益率×25%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险及预期收益水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金将投资港股通标的股票，需承担港股机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		泰达宏利基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	徐娇娇	许俊
	联系电话	66577766	010-66594319
	电子邮箱	irm@mfcteda.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-698-8888	95566
传真		010-66577666	010-66594942
注册地址		北京市朝阳区针织路 23 号楼中国	北京市西城区复兴门内大街 1 号

	人寿金融中心 6 层 02-07 单元	
办公地址	北京市朝阳区针织路 23 号楼中国 人寿金融中心 6 层 02-07 单元	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	100026	100818
法定代表人	刘轶	刘连舸

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

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)	
	泰达高研发 6 个月持有混合 A	泰达高研发 6 个月持有混合 C
本期已实现收益	-3,360,682.35	4,208,589.73
本期利润	68,489,376.28	13,104,597.12
加权平均基金份 额本期利润	0.1951	0.5382
本期加权平均净 值利润率	21.79%	57.33%
本期基金份额净 值增长率	24.44%	24.25%
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	-13,548,132.35	-5,049,829.10
期末可供分配基 金份额利润	-0.0610	-0.0632

期末基金资产净值	263,469,101.03	94,641,167.72
期末基金份额净值	1.1862	1.1835
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	18.62%	18.35%

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

泰达宏利高研发创新 6 个月混合 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	14.58%	2.61%	-0.10%	0.62%	14.68%	1.99%
过去三个月	57.47%	2.26%	4.40%	0.72%	53.07%	1.54%
过去六个月	24.44%	2.69%	3.35%	0.99%	21.09%	1.70%
自基金合同生效起至今	18.62%	2.24%	12.85%	0.89%	5.77%	1.35%

泰达宏利高研发创新 6 个月混合 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	14.55%	2.61%	-0.10%	0.62%	14.65%	1.99%

过去三个月	57.34%	2.26%	4.40%	0.72%	52.94%	1.54%
过去六个月	24.25%	2.69%	3.35%	0.99%	20.90%	1.70%
自基金合同生效起 至今	18.35%	2.24%	12.85%	0.89%	5.50%	1.35%

注：本基金的业绩比较基准：中证 800 成长指数收益率 $\times$ 55%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算） $\times$ 20%+中证综合债券指数收益率 $\times$ 25%。

中证 800 成长指数以中证 800 指数为样本空间，从中选取成长因子评分最高的 250 只股票作为样本股。恒生指数是由恒生指数服务有限公司编制，以香港股票市场中的 50 家上市股票为成分股样本，以其发行量为权数的加权平均股价指数，是反映香港股市价幅趋势最有影响的一种股价指数。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、央票及短融整体走势的跨市场债券指数，旨在全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势。本基金管理人认为，以中证 800 成长指数收益率 $\times$ 55%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算） $\times$ 20%+中证综合债券指数收益率 $\times$ 25%作为本基金的业绩比较基准，能够使本基金持有人理性判断本基金产品的风险收益特征。

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

泰达宏利高研发创新6个月混合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



泰达宏利高研发创新6个月混合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：本基金成立于 2020 年 9 月 24 日，截止报告期末本基金成立不满一年。按基金合同规定，自基金合同生效日起六个月内为建仓期。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		
王鹏	本基金基金经理	2020 年 12 月 28 日	-	9 年	清华大学工学硕士；2012 年 7 月至 2014 年 3 月，任职于中邮创业基金管理有限公司，担任 TMT 行业研究员；2014 年 3 月至 2015 年 6 月，任职于上海磐信投资管理有限公司，担任电子行业研究员；2015 年 6 月，加入泰达宏利基金管理有限公司，任职于研究部，先后担任研究员、基金经理等职；具有 9 年证券从业经验，具有基金从业资格。

周 琦 凯	本基金基金 经理	2020 年 09 月 24 日	2021 年 02 月 26 日	11 年	清华大学管理学硕士；2010 年 7 月加入泰达宏利基金管理有限公司，任职于研究部，负责建筑建材、传媒互联网行业研究，曾先后担任助理研究员、研究员、高级研究员等职务，现任基金经理；具备 11 年基金从业经验，11 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

基金管理人的风险管理部事后从交易指令的公平性、同日反向交易、不同时间窗口下的同向交易溢价率和风格相似的基金的业绩等方面，对报告期内的公平交易执行情况进行统计分析。本报告期内，交易指令多为指令下达人管理的多只资产组合同时下发，无明显的非公平交易指令；基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易；场外交易的交易价格与市场价格一致，场内交易的溢价率在剔除交易时间差异、交易数量悬殊、市场波动剧烈等因素后，处于正常范围之内；基金管理人管理的各投资组合的业绩由于投资策略、管理风格、业绩基准等方面的因素而有所不同。

本报告期内，本基金管理人管理的各投资组合之间未发现利益输送或不公平对待不同组合的情况。

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。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，除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，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

基于对产业周期的判断，本基金上半年仍然集中配置在高景气的新能源车产业链中游和上游。虽然一季度末经历了原材料快速大幅上涨和芯片短缺等不利因素的冲击，但我们观察到新能源上游原材料价格仍然呈上涨趋势，同时中游排产屡创新高，显示出非常高的行业景气度。

我们认为目前的新能源车产业类似 12 年-15 年的智能机产业，渗透率处于迅速提升阶段，在渗透率达到 30%之前，任何短期扰动大概率是机会。本基金将牢牢把握这一时代赋予中国制造业的机会。

本基金将按照基金契约，精选研发驱动的优质公司，分享企业成长红利。

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高研发创新 6 个月混合 A 的基金份额净值为 1.1862 元，本报告期基金份额净值增长率为 24.44%，截至本报告期末泰达宏利高研发创新 6 个月混合 C 的基金份额净值为 1.1835 元，本报告期基金份额净值增长率为 24.25%，同期业绩比较基准收益率为 3.35%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年我们认为三季报是非常关键的报表季，决定了下半年的结构性行情。三季度是第一个消除了低基数效应的报表季，只有需求端有高增长的行业才能继续报表端的高增长，所以新能源车大概率在行业比较上优势明显。同时考虑四季度开始芯片瓶颈和中游材料产能瓶颈逐渐消除，潜在新能源车消费需求会真正释放，板块大概率在数据和业绩的双重催化下迎来戴维斯双击行情。把眼光再放长，中游要求的是低成本大规模制造能力，这正是国内制造业核心优势。

本基金管理人将继续坚持投资景气行业龙头的投资理念，不断扩展自己的能力圈，通过学习不断提炼和总结长期适用的投资方法，力争为基金持有人提供持续回报。

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，本基金本报告期内未进行利润分配。

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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对泰达宏利高研发创新 6 个月持有期混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：泰达宏利高研发创新 6 个月持有期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	31,150,064.72	94,669,694.42
结算备付金		2,222,873.90	2,007,369.93
存出保证金		165,410.06	146,033.17
交易性金融资产	6.4.7.2	321,420,102.28	313,034,772.92
其中: 股票投资		321,420,102.28	313,034,772.92
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		-	-
应收利息	6.4.7.5	3,648.48	6,964.65
应收股利		-	-
应收申购款		14,654,118.58	145,139.99
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		369,616,218.02	410,009,975.08
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		8,380,926.00	52,369,661.18
应付赎回款		1,426,881.56	-
应付管理人报酬		441,792.68	446,611.56
应付托管费		73,632.11	74,435.24
应付销售服务费		13,565.63	3,270.27
应付交易费用	6.4.7.7	1,075,464.22	1,698,849.16
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	93,687.07	130,000.00
负债合计		11,505,949.27	54,722,827.41
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	302,077,505.16	372,727,664.77
未分配利润	6.4.7.10	56,032,763.59	-17,440,517.10

所有者权益合计		358,110,268.75	355,287,147.67
负债和所有者权益总计		369,616,218.02	410,009,975.08

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额总额 302,077,505.16 份，其中泰达高研发创新 6 个月持有混合 A 基金份额总额 222,112,561.99 份，基金份额净值 1.1862 元；泰达高研发创新 6 个月持有混合 C 基金份额总额 79,964,943.17 份，基金份额净值 1.1835 元。

6.2 利润表

会计主体：泰达宏利高研发创新 6 个月持有期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
一、收入		87,996,820.54
1. 利息收入		64,377.48
其中：存款利息收入	6.4.7.11	64,377.48
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）		7,186,377.04
其中：股票投资收益	6.4.7.12	6,471,883.40
基金投资收益	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	714,493.64
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	80,746,066.02
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	-
减：二、费用		6,402,847.14
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,520,081.00
2. 托管费	6.4.10.2.2	420,013.53
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	33,605.03
4. 交易费用	6.4.7.19	3,313,841.60
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	115,305.98

三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		81,593,973.40
减：所得税费用		-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		81,593,973.40

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰达宏利高研发创新 6 个月持有期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)	372,727,664.77	-17,440,517.10	355,287,147.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	81,593,973.40	81,593,973.40
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)	-70,650,159.61	-8,120,692.71	-78,770,852.32
其中：1. 基金申购款	200,035,078.12	7,848,640.84	207,883,718.96
2. 基金赎回款	-270,685,237.73	-15,969,333.55	-286,654,571.28
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)	302,077,505.16	56,032,763.59	358,110,268.75

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

泰达宏利高研发创新 6 个月持有期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[2018]2233 号《关于准予泰达宏利巨龙平衡混合型证券投资基金(QDII)注册的批复》及证监许可[2020]1847 号《关于准予泰达宏利高研发创新 6 个月持有期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《泰达宏利高研发创新 6 个月持有期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 371,567,049.78 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 0793 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰达宏利高研发创新 6 个月持有期混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 9 月 24 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 371,720,976.62 份基金份额,其中认购资金利息折合 153,926.84 份基金份额。本基金的基金管理人为泰达宏利基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)。

根据《泰达宏利高研发创新 6 个月持有期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《泰达宏利高研发创新 6 个月持有期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允许上市的股票)、港股通标的股票、债券(包括国债、地方政府债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据)、债券回购、资产支持证券、货币市场工具、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)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,本基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入本基金的投资范围。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%,本基金界定的“高研发创新”相关的股票的比例不低于非现金基金资产的 80%;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中证 800 成长指数收益率 $\times 55\%$ + 恒生指数收益率（使用估值汇率折算） $\times 20\%$ + 中证综合债券指数收益率 $\times 25\%$ 。

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》、《泰达宏利高研发创新 6 个月持有期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 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

本基金本报告期末发生会计政策变更。

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 2021 年 6 月 30 日
----	------------------------

活期存款	31,150,064.72
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	31,150,064.72

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	228,777,082.90	321,420,102.28	92,643,019.38
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	—	—
	银行间市场	—	—
	合计	—	—
资产支持证券	—	—	—
基金	—	—	—
其他	—	—	—
合计	228,777,082.90	321,420,102.28	92,643,019.38

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	2,680.45
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	900.27

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	0.80
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	66.96
合计	3,648.48

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	1,075,464.22
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,075,464.22

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	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	93,687.07
合计	93,687.07

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

泰达高研发创新 6 个月持有混合 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	359,072,360.13	359,072,360.13
本期申购	122,574,410.16	122,574,410.16
本期赎回（以“-”号填列）	-259,534,208.30	-259,534,208.30
-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	222,112,561.99	222,112,561.99

泰达高研发创新 6 个月持有混合 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	13,655,304.64	13,655,304.64
本期申购	77,460,667.96	77,460,667.96
本期赎回（以“-”号填列）	-11,151,029.43	-11,151,029.43
-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	79,964,943.17	79,964,943.17

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

泰达高研发创新 6 个月持有混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-28,235,248.20	11,443,758.87	-16,791,489.33
本期利润	-3,360,682.35	71,850,058.63	68,489,376.28
本期基金份额 交易产生的变 动数	18,047,798.20	-28,389,146.11	-10,341,347.91
其中：基金申 购款	-13,803,799.17	19,139,230.40	5,335,431.23
基金赎 回款	31,851,597.37	-47,528,376.51	-15,676,779.14
本期已分配利 润	-	-	-
本期末	-13,548,132.35	54,904,671.39	41,356,539.04

泰达高研发创新 6 个月持有混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,083,805.31	434,777.54	-649,027.77
本期利润	4,208,589.73	8,896,007.39	13,104,597.12
本期基金份额 交易产生的变 动数	-8,174,613.52	10,395,268.72	2,220,655.20
其中：基金申 购款	-9,505,260.75	12,018,470.36	2,513,209.61
基金赎 回款	1,330,647.23	-1,623,201.64	-292,554.41
本期已分配利 润	-	-	-
本期末	-5,049,829.10	19,726,053.65	14,676,224.55

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	42,647.47
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	19,773.57
其他	1,956.44
合计	64,377.48

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	6,471,883.40
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	6,471,883.40

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	1,103,824,384.53
减：卖出股票成本总额	1,097,352,501.13
买卖股票差价收入	6,471,883.40

6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期无股票投资收益-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	714,493.64
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	714,493.64

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	80,746,066.02
股票投资	80,746,066.02
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	80,746,066.02

6.4.7.18 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

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	3,313,841.60
银行间市场交易费用	—
合计	3,313,841.60

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	59,507.37
证券出借违约金	—
银行费用	14,118.91
账户维护费	11,926.92
合计	115,305.98

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

根据泰达宏利基金管理有限公司于 2021 年 8 月 3 日发布的《泰达宏利基金管理有限公司关于泰达宏利高研发创新 6 个月持有期混合型证券投资基金基金简称变更的公告》，自 2021 年 8 月 4 日起，将本基金的基金简称由“泰达宏利高研发创新 6 个月混合”变更为“泰达高研发 6 个月持有混合”，A 类基金份额简称由“泰达宏利高研发创新 6 个月混合 A”变更为“泰达高研发 6 个月持有混合 A”，C 类基金份额简称由“泰达宏利高研发创新 6 个月混合 C”变更为“泰达高研发 6 个月持有混合 C”，基金代码和其他信息均保持不变。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期没有存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末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
当期发生的基金应支付的管理费	2,520,081.00
其中：支付销售机构的客户维护费	1,185,307.97

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。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
当期发生的基金应支付的托管费	420,013.53

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 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		
	泰达高研发创新 6 个月	泰达高研发创新 6 个月	合计

	持有混合 A	持有混合 C	
泰达宏利基金管理有限公司	-	-	-
中国银行股份有限公司	-	16,540.19	16,540.19
合计	-	16,540.19	16,540.19

注：支付基金销售机构的销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值 0.3% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给泰达宏利基金管理有限公司，再由泰达宏利基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日 C 类基金份额销售服务费 = 前一日 C 类基金份额基金资产净值 × 0.3% / 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固有资金投资本基金的情况

本基金的管理人在本报告期内未运用固有资金投资本基金。

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	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	31,150,064.72	42,647.47

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末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(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
688269	凯立新材	2021 年 6 月 1 日	2021 年 12 月 9 日	新股流通受限	18.94	100.92	1,941	36,762.54	195,885.72	-
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	2,083	80,924.55	80,924.55	-
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	406	9,987.60	66,178.00	-
688468	科美诊断	2021 年 3 月 31 日	2021 年 10 月 11 日	新股流通受限	7.15	16.50	3,919	28,020.85	64,663.50	-
688611	杭州柯林	2021 年 4 月 1 日	2021 年 10 月 12 日	新股流通受限	33.44	42.34	1,400	46,816.00	59,276.00	-
688359	三孚新科	2021 年 5 月 14 日	2021 年 11 月 22 日	新股流通受限	11.03	26.35	2,213	24,409.39	58,312.55	-
688350	富淼科技	2021 年 1 月 21 日	2021 年 7 月 28 日	新股流通受限	13.58	22.44	2,552	34,656.16	57,266.88	-
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	2,469	54,219.24	54,219.24	-
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	4,995	44,255.70	44,255.70	-

		日	日							
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	175	8,282.75	44,093.00	-
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	3,789	40,314.96	40,314.96	-
688067	爱威科技	2021 年 6 月 7 日	2021 年 12 月 16 日	新股流 通受限	14.71	24.83	1,259	18,519.89	31,260.97	-
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	219	6,193.32	25,340.49	-
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	2,609	24,681.14	24,681.14	-
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	769	9,643.26	21,447.41	-
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	百川畅银	2021 年 5 月 18 日	2021 年 11 月 25 日	新股流 通受限	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
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	-
300968	格林	2021 年	2021 年	新股流	6.87	12.07	1,076	7,392.12	12,987.32	-

	精密	4月6日	10月15日	通受限						
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11日	新股流通受限	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
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	-
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 7 月 12 日	新股流 通受限	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
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	258	3,815.82	7,887.06	-
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	-
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	嘉益股份	2021 年 6 月 18 日	2021 年 12 月 27 日	新股流 通受限	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-
300991	创益通	2021 年 5 月 12 日	2021 年 11 月 22 日	新股流 通受限	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
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	-

			日							
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	-
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	224	5,577.60	5,557.44	-
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 21 日	2021 年 7 月 20 日	新股流通受限	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300960	通业科技	2021 年 3 月 22 日	2021 年 9 月 29 日	新股流通受限	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
301017	漱玉平民	2021 年 6 月 23 日	2022 年 1 月 5 日	新股流通受限	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30	-
301020	密封科技	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	新股流通受限	10.64	10.64	421	4,479.44	4,479.44	-
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	-
301021	英诺激光	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	新股流通受限	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-

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

本基金为混合型基金，其预期风险及预期收益水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资及债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金通过对上市公司基本面全面、深入的研究分析，精选高研发投入的优质企业，在严格控制风险、保持良好流动性的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。

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同责任，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人中国银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于 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。

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在持有期满后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约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司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	31,150,064.72	-	-	-	31,150,064.72
结算备付金	2,222,873.90	-	-	-	2,222,873.90
存出保证金	165,410.06	-	-	-	165,410.06
交易性金融资产	-	-	-	321,420,102.28	321,420,102.28
应收利息	-	-	-	3,648.48	3,648.48
应收申购款	-	-	-	14,654,118.58	14,654,118.58
资产总计	33,538,348.68	-	-	336,077,869.34	369,616,218.02
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,426,881.56	1,426,881.56
应付管理人报酬	-	-	-	441,792.68	441,792.68
应付托管费	-	-	-	73,632.11	73,632.11
应付证券清算款	-	-	-	8,380,926.00	8,380,926.00
应付销售服务费	-	-	-	13,565.63	13,565.63
应付交易费用	-	-	-	1,075,464.22	1,075,464.22
其他负债	-	-	-	93,687.07	93,687.07
负债总计	-	-	-	11,505,949.27	11,505,949.27
利率敏感度缺口	33,538,348.68	-	-	-324,571,920.07	358,110,268.75
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	94,669,694.42	-	-	-	94,669,694.42
结算备付金	2,007,369.93	-	-	-	2,007,369.93
存出保证金	146,033.17	-	-	-	146,033.17
交易性金融资产	-	-	-	313,034,772.92	313,034,772.92
应收利息	-	-	-	6,964.65	6,964.65

应收申购款	-	-	-	145,139.99	145,139.99
资产总计	96,823,097.52	-	-	313,186,877.56	410,009,975.08
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	446,611.56	446,611.56
应付托管费	-	-	-	74,435.24	74,435.24
应付证券清算款	-	-	-	52,369,661.18	52,369,661.18
应付销售服务费	-	-	-	3,270.27	3,270.27
应付交易费用	-	-	-	1,698,849.16	1,698,849.16
其他负债	-	-	-	130,000.00	130,000.00
负债总计	-	-	-	54,722,827.41	54,722,827.41
利率敏感度缺口	96,823,097.52	-	-	-258,464,050.15	355,287,147.67

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资产，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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。

本基金将采用“自上而下”与“自下而上”相结合的主动投资管理策略，将定性分析与定量分析贯穿于资产配置、行业细分、公司价值评估以及组合风险管理全过程中，争取实现基金资产的长期稳健增值。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。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%，本基金界定的“高研发创新”相关的股票的比例不低于非现金基金资产的 80%，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	321,420,102.28	89.75	313,034,772.92	88.11
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	321,420,102.28	89.75	313,034,772.92	88.11

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2021 年 6 月 30 日，本基金运作尚不足一年，无足够经验数据。

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	321,420,102.28	86.96
	其中：股票	321,420,102.28	86.96
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	33,372,938.62	9.03

8	其他各项资产	14,823,177.12	4.01
9	合计	369,616,218.02	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	11,290.28	0.00
B	采矿业	10,512.39	0.00
C	制造业	315,281,802.43	88.04
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	322,343.14	0.09
G	交通运输、仓储和邮政业	5,532,894.76	1.55
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	56,000.27	0.02
J	金融业	97,319.40	0.03
K	房地产业	10,095.90	0.00
L	租赁和商务服务业	15,994.06	0.00
M	科学研究和技术服务业	—	—
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	16,262.03	0.00
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	321,420,102.28	89.75

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	300750	宁德时代	64,700	34,601,560.00	9.66
2	603659	璞泰来	230,312	31,460,619.20	8.79
3	002709	天赐材料	252,884	26,952,376.72	7.53
4	600577	精达股份	3,867,896	24,677,176.48	6.89
5	300568	星源材质	428,464	17,725,555.68	4.95

6	600110	诺德股份	1,446,300	17,615,934.00	4.92
7	300953	震裕科技	145,600	15,863,120.00	4.43
8	688005	容百科技	130,145	15,773,574.00	4.40
9	002812	恩捷股份	65,500	15,333,550.00	4.28
10	603799	华友钴业	129,900	14,834,580.00	4.14
11	300035	中科电气	586,300	14,335,035.00	4.00
12	002824	和胜股份	338,800	11,946,088.00	3.34
13	688116	天奈科技	98,539	11,627,602.00	3.25
14	688308	欧科亿	163,797	11,100,522.69	3.10
15	300207	欣旺达	317,900	10,350,824.00	2.89
16	600699	均胜电子	296,900	7,576,888.00	2.12
17	605117	德业股份	54,127	6,906,605.20	1.93
18	300919	中伟股份	35,006	5,705,978.00	1.59
19	002245	蔚蓝锂芯	280,400	5,523,880.00	1.54
20	300769	德方纳米	23,000	4,753,870.00	1.33
21	003022	联泓新科	118,600	3,641,020.00	1.02
22	300014	亿纬锂能	34,900	3,627,157.00	1.01
23	300861	美畅股份	40,500	3,414,555.00	0.95
24	000301	东方盛虹	93,500	1,954,150.00	0.55
25	300680	隆盛科技	60,700	1,623,725.00	0.45
26	301015	百洋医药	4,614	251,115.78	0.07
27	688161	威高骨科	2,098	222,492.90	0.06
28	688269	凯立新材	1,941	195,885.72	0.05
29	688216	气派科技	2,000	133,400.00	0.04
30	301016	雷尔伟	2,747	115,711.58	0.03
31	688499	利元亨	2,083	80,924.55	0.02
32	688468	科美诊断	3,919	64,663.50	0.02
33	601665	齐鲁银行	6,731	62,598.30	0.02
34	688611	杭州柯林	1,400	59,276.00	0.02
35	688359	三孚新科	2,213	58,312.55	0.02
36	688350	富淼科技	2,552	57,266.88	0.02
37	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.02
38	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.01
39	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.01
40	688395	正弦电气	1,627	44,465.91	0.01
41	300957	贝泰妮	175	44,093.00	0.01
42	300894	火星人	628	42,704.00	0.01
43	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
44	688067	爱威科技	1,259	31,260.97	0.01
45	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
46	300973	立高食品	219	25,340.49	0.01
47	002594	比亚迪	100	25,100.00	0.01

48	001207	联科科技	682	22,581.02	0.01
49	301009	可靠股份	769	21,447.41	0.01
50	300941	创识科技	399	19,926.06	0.01
51	605305	中际联合	368	19,364.16	0.01
52	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
53	300909	汇创达	386	16,636.60	0.00
54	300913	兆龙互连	630	16,506.00	0.00
55	003019	宸展光电	601	16,263.06	0.00
56	605098	行动教育	289	16,262.03	0.00
57	605196	华通线缆	1,172	16,079.84	0.00
58	605300	佳禾食品	576	16,012.80	0.00
59	603836	海程邦达	733	15,994.06	0.00
60	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00
61	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
62	300908	仲景食品	250	14,897.50	0.00
63	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
64	605180	华生科技	384	14,208.00	0.00
65	605319	无锡振华	764	13,706.16	0.00
66	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
67	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
68	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
69	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
70	300968	格林精密	1,076	12,987.32	0.00
71	301013	利和兴	471	12,768.81	0.00
72	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
73	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
74	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
75	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
76	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
77	605488	福莱新材	416	11,103.04	0.00
78	300918	南山智尚	1,063	11,065.83	0.00
79	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
80	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
81	605259	绿田机械	295	10,516.75	0.00
82	605086	龙高股份	443	10,512.39	0.00
83	605189	富春染织	422	10,165.98	0.00
84	300917	特发服务	365	10,095.90	0.00
85	300922	天秦装备	287	9,996.21	0.00
86	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
87	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
88	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
89	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00

90	001202	炬申股份	459	9,014.76	0.00
91	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
92	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
93	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
94	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
95	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
96	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
97	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
98	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
99	300986	志特新材	258	7,887.06	0.00
100	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
101	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
102	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
103	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
104	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
105	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
106	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
107	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
108	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
109	300985	致远新能	224	5,557.44	0.00
110	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
111	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
112	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
113	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
114	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
115	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
116	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
117	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
118	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
119	301010	晶雪节能	218	3,838.98	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	603799	华友钴业	45,025,999.70	12.67
2	601689	拓普集团	42,776,186.96	12.04
3	601012	隆基股份	36,574,065.52	10.29
4	300014	亿纬锂能	33,259,377.47	9.36
5	300073	当升科技	26,197,380.60	7.37
6	300082	奥克股份	25,027,940.00	7.04
7	002245	蔚蓝锂芯	24,658,421.68	6.94

8	603659	璞泰来	24,608,684.60	6.93
9	300659	中孚信息	21,817,916.23	6.14
10	300750	宁德时代	21,722,489.74	6.11
11	002824	和胜股份	19,582,883.91	5.51
12	002756	永兴材料	19,399,293.94	5.46
13	600577	精达股份	19,346,104.12	5.45
14	603520	司太立	18,186,658.16	5.12
15	002709	天赐材料	17,726,853.00	4.99
16	002460	赣锋锂业	17,383,539.00	4.89
17	688308	欧科亿	17,205,158.46	4.84
18	300726	宏达电子	17,145,645.00	4.83
19	600110	诺德股份	16,262,992.00	4.58
20	600176	中国巨石	16,239,864.28	4.57
21	002415	海康威视	15,543,552.61	4.37
22	300379	东方通	15,112,400.00	4.25
23	600438	通威股份	14,944,328.00	4.21
24	300207	欣旺达	14,487,850.00	4.08
25	600660	福耀玻璃	14,290,048.04	4.02
26	603678	火炬电子	14,139,681.00	3.98
27	688390	固德威	13,946,959.81	3.93
28	300274	阳光电源	13,842,298.00	3.90
29	002407	多氟多	13,593,296.50	3.83
30	688063	派能科技	13,052,780.73	3.67
31	600426	华鲁恒升	12,717,434.61	3.58
32	300953	震裕科技	12,662,170.00	3.56
33	300035	中科电气	11,932,254.00	3.36
34	688388	嘉元科技	11,692,112.92	3.29
35	688116	天奈科技	11,422,237.25	3.21
36	600885	宏发股份	11,421,245.27	3.21
37	688169	石头科技	10,844,002.27	3.05
38	300568	星源材质	10,731,483.84	3.02
39	002850	科达利	10,065,625.96	2.83
40	00175 HS	吉利汽车	9,939,747.52	2.80
41	002812	恩捷股份	9,644,155.00	2.71
42	603185	上机数控	8,925,158.00	2.51
43	300769	德方纳米	8,782,081.00	2.47
44	300680	隆盛科技	8,681,927.00	2.44
45	002979	雷赛智能	7,882,869.00	2.22
46	688113	联测科技	7,785,733.51	2.19
47	03888 HS	金山软件	7,546,038.07	2.12
48	688005	容百科技	7,496,647.56	2.11
49	688155	先惠技术	7,391,823.05	2.08

50	300601	康泰生物	7,314,833.00	2.06
51	603960	克来机电	7,229,867.00	2.03
52	002129	中环股份	7,201,207.00	2.03
53	600699	均胜电子	7,112,268.02	2.00

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	300014	亿纬锂能	66,773,996.65	18.79
2	300073	当升科技	44,107,641.00	12.41
3	601012	隆基股份	33,315,479.90	9.38
4	300659	中孚信息	32,051,469.83	9.02
5	603520	司太立	31,582,501.00	8.89
6	601689	拓普集团	30,600,616.86	8.61
7	600438	通威股份	29,253,805.00	8.23
8	600885	宏发股份	26,653,698.96	7.50
9	002709	天赐材料	26,061,307.25	7.34
10	603799	华友钴业	25,868,306.77	7.28
11	002050	三花智控	23,793,405.76	6.70
12	002245	蔚蓝锂芯	22,145,729.26	6.23
13	603185	上机数控	21,850,985.00	6.15
14	300082	奥克股份	21,713,546.80	6.11
15	300726	宏达电子	21,695,577.00	6.11
16	002850	科达利	20,418,489.00	5.75
17	002756	永兴材料	19,662,051.40	5.53
18	300124	汇川技术	16,681,412.00	4.70
19	300601	康泰生物	15,900,972.00	4.48
20	688111	金山办公	15,799,138.92	4.45
21	002407	多氟多	15,555,726.00	4.38
22	688005	容百科技	15,186,448.18	4.27
23	002352	顺丰控股	14,902,161.00	4.19
24	002460	赣锋锂业	14,270,903.00	4.02
25	002415	海康威视	14,097,853.04	3.97
26	603678	火炬电子	14,079,281.00	3.96
27	600660	福耀玻璃	14,012,229.00	3.94
28	688388	嘉元科技	13,977,826.18	3.93
29	688390	固德威	13,906,957.92	3.91
30	600276	恒瑞医药	13,655,050.76	3.84
31	600176	中国巨石	13,627,757.00	3.84

32	300379	东方通	13,427,908.00	3.78
33	002824	和胜股份	13,304,511.00	3.74
34	688308	欧科亿	12,993,751.81	3.66
35	603960	克来机电	12,604,792.00	3.55
36	300274	阳光电源	12,593,345.00	3.54
37	300769	德方纳米	11,977,611.00	3.37
38	688169	石头科技	10,958,695.70	3.08
39	300751	迈为股份	10,922,153.00	3.07
40	300760	迈瑞医疗	10,902,494.00	3.07
41	600426	华鲁恒升	10,541,795.00	2.97
42	002311	海大集团	9,692,211.10	2.73
43	688383	新益昌	9,114,359.77	2.57
44	688113	联测科技	8,719,337.65	2.45
45	300750	宁德时代	8,108,597.00	2.28
46	300207	欣旺达	8,071,764.00	2.27
47	002129	中环股份	8,005,487.00	2.25
48	688063	派能科技	7,810,312.79	2.20
49	002271	东方雨虹	7,680,220.44	2.16
50	300680	隆盛科技	7,513,753.00	2.11
51	002979	雷赛智能	7,311,548.00	2.06
52	688626	翔宇医疗	7,158,132.84	2.01
53	002920	德赛西威	7,129,873.00	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	1,024,991,764.47
卖出股票收入（成交）总额	1,103,824,384.53

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

本基金在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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，华友钴业于 2020 年 12 月 30 日曾受到浙江证监局公开处罚；精达股份于 2021 年 5 月 17 日曾受到安徽监管局公开处罚。

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	165,410.06
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	—
4	应收利息	3,648.48
5	应收申购款	14,654,118.58
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	14,823,177.12

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 （%）
泰达宏利高研发创新 6 个月混合 A	28,575	7,772.97	—	—	222,112,561.99	100.00
泰达宏利高	12,005	6,660.97	—	—	79,964,943.17	100.00

研 发 创 新 6 个 月 混 合 C						
合 计	40,580	7,444.00	-	-	302,077,505.16	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	泰达宏利高研发创新 6 个月混合 A	103,140.57	0.0464
	泰达宏利高研发创新 6 个月混合 C	10.43	0.0000
	合计	103,151.00	0.0341

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	泰达高研发创新 6 个月持有混合 A	泰达高研发创新 6 个月持有混合 C
基金合同生效日 （2020 年 9 月 24 日） 基金份额总额	358,101,486.39	13,619,490.23
本报告期期初基金份额总额	359,072,360.13	13,655,304.64
本报告期基金总申购份额	122,574,410.16	77,460,667.96
减：本报告期基金总赎回份额	259,534,208.30	11,151,029.43
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	222,112,561.99	79,964,943.17

§ 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	
长江证券	1	398,392,180.66	18.77%	371,019.99	18.85%	—
东吴证券	1	339,112,560.23	15.98%	315,816.26	16.04%	—
中信建投	1	317,847,850.16	14.98%	296,011.45	15.04%	—
东方财富	1	218,984,667.67	10.32%	203,940.41	10.36%	—

国盛证券	2	215,714,996.69	10.16%	200,895.25	10.20%	—
华西证券	1	159,792,278.63	7.53%	148,814.50	7.56%	—
中信证券	2	123,452,066.24	5.82%	107,070.20	5.44%	—
华创证券	1	103,065,645.93	4.86%	95,985.42	4.88%	—
天风证券	1	83,382,928.06	3.93%	77,654.70	3.94%	—
海通证券	1	67,310,970.19	3.17%	62,686.72	3.18%	—
东北证券	2	55,670,387.85	2.62%	51,845.88	2.63%	—
广发证券	1	30,530,428.35	1.44%	28,433.16	1.44%	—
光大证券	1	9,196,163.96	0.43%	8,564.49	0.44%	—
安信证券	1	—	—	—	—	—
财达证券	1	—	—	—	—	—
财信证券	1	—	—	—	—	—
东方证券	4	—	—	—	—	—
东亚前海	1	—	—	—	—	—
国金证券	1	—	—	—	—	—
国泰君安	1	—	—	—	—	—
华安证券	1	—	—	—	—	—
华林证券	2	—	—	—	—	—
华泰证券	2	—	—	—	—	—
江海证券	1	—	—	—	—	—
申万宏源	2	—	—	—	—	—
太平洋	1	—	—	—	—	—
西南证券	2	—	—	—	—	—
湘财证券	1	—	—	—	—	—
新时代证券	1	—	—	—	—	—
银河证券	1	—	—	—	—	—
招商证券	1	—	—	—	—	—
中金公司	1	—	—	—	—	—
中山证券	1	—	—	—	—	—

中泰证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-

注：（一）2021 年上半年本基金新增华安证券、华创证券交易单元。

（二） 交易单元选择的标准和程序

基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其交易单元作为基金的专用交易单元，选择的标准是：

- （1）经营规范，有较完备的内控制度；
- （2）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合证券交易的需要；
- （3）能为基金管理人提供高质量的研究咨询服务。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期末通过租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

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	《泰达宏利高研发创新 6 个月持有期混合型证券投资基金基金经理变更公告》	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站及公司网站	2021 年 02 月 27 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