

# 泰达宏利价值长青混合型证券投资基金 2022 年中期报告

2022 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：2022 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 2022 年 8 月 29 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 2022 年 1 月 1 日起至 2022 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 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	19
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>43</b>
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 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	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
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	52

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 .....	52
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 .....	52
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 .....	52
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	53
7.12 投资组合报告附注 .....	53
<b>§ 8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>54</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	54
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 .....	54
<b>§ 9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>55</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>55</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	55
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 .....	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	55
10.4 基金投资策略的改变 .....	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	55
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 .....	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	56
<b>§ 11 备查文件目录 .....</b>	<b>57</b>
11.1 备查文件目录 .....	57
11.2 存放地点 .....	57
11.3 查阅方式 .....	57

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	泰达宏利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	258,899,385.92 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	247,475,014.80 份	11,424,371.12 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
	联系电话	66577766
	电子邮箱	irm@mfteda.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	傅国庆	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(2022年01月01日-2022年06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	-57,447,947.03	-2,787,561.91
本期利润	-61,788,406.55	-2,915,106.31
加权平均基金份额本期利润	-0.2478	-0.2469
本期加权平均净值利润率	-27.97%	-28.05%
本期基金份额净值增长率	-22.53%	-22.65%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)	
期末可供分配利润	-38,181,246.58	-1,820,481.58
期末可供分配基金份额利润	-0.1543	-0.1594
期末基金资产净值	209,293,768.22	9,603,889.54
期末基金份额净值	0.8457	0.8406
3.1.3 累计期末	报告期末(2022年6月30日)	

指标		
基金份额累计净值增长率	-15.43%	-15.94%

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	1.29%	1.30%	5.11%	0.83%	-3.82%	0.47%
过去三个月	-2.63%	1.25%	3.23%	1.00%	-5.86%	0.25%
过去六个月	-22.53%	1.42%	-5.47%	1.08%	-17.06%	0.34%
过去一年	-32.55%	1.46%	-11.26%	0.90%	-21.29%	0.56%
自基金合同生效起至今	-15.43%	1.53%	3.52%	0.86%	-18.95%	0.67%

泰达价值长青混合 C

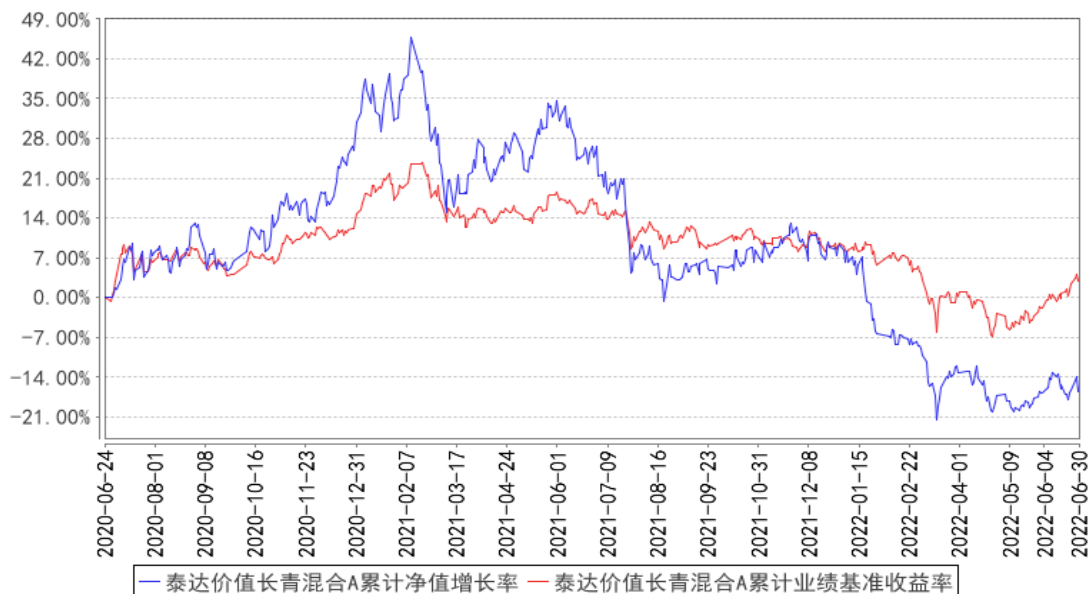
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.26%	1.31%	5.11%	0.83%	-3.85%	0.48%

过去三个月	-2.71%	1.25%	3.23%	1.00%	-5.94%	0.25%
过去六个月	-22.65%	1.42%	-5.47%	1.08%	-17.18%	0.34%
过去一年	-32.75%	1.46%	-11.26%	0.90%	-21.49%	0.56%
自基金合同生效起至今	-15.94%	1.53%	3.52%	0.86%	-19.46%	0.67%

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%。

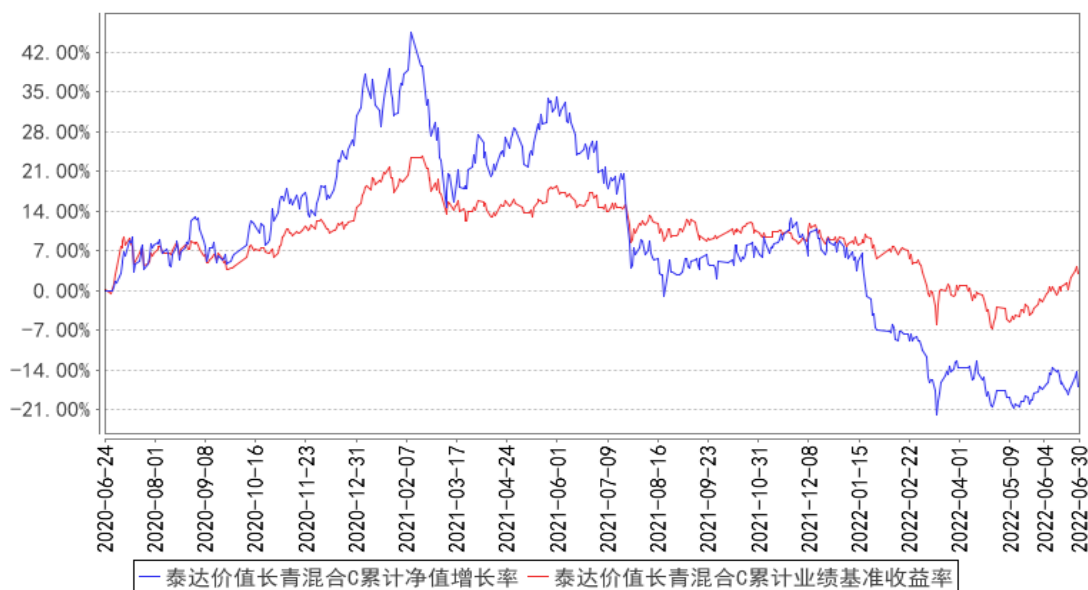
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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%。

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）、泰达宏利永利债券型证券投资基金、泰达宏利消费行业量化精选混合型证券投资基金、泰达宏利中证主要消费红利指数型证券投资基金、泰达宏利养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金（FOF）、泰达宏利泰和稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、泰达宏利价值长青混合型证券投资基金、泰达宏利中证申万绩优策略指数增强型证券投资基金、泰达宏利乐盈 66 个月定期开放债券型证券投资基金、泰达宏利高研发创新 6 个月持有期混合型证券投资基金、泰达宏利波控回报 12 个月持有期混合型证券投资基金、泰达宏利消费服务混合型证券投资基金、泰达宏利新能源股票型证券投资基金、泰达宏利中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金、泰达宏利悠然养老目标日期 2025 一年持有期混合型基金中基金（FOF）、泰达宏利新兴景气龙头混合型证券投资基金、泰达宏利景气领航两年持有期混合型证券投资基金、泰达宏利中短债债券型证券投资基金、泰达宏利先进制造股票型证券投资基金、泰达宏利昇利一年定期开放债券型发起式证券投资基金、泰达宏利闽利一年定期开放债券型发起式证券投资基金在内的六十多只证券投资基金。

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	-	18 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，担任宏观策略分析员；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 18 年证券从业经验，18 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

2022 年上半年市场经历了剧烈的波动。本基金基于长期产业发展趋势选择稳健发展的卓越龙头企业。本基金力争根据基本面的变化，对组合做相对前瞻性的调整，以更好地把握投资机会。

本报告期内，基金经理一方面延续了前期长线投资于稳健发展的卓越企业的方法，同时基金经理也按产业发展趋势不断拓宽能力圈和行业研究范围。产业发展趋势是最重要的长线投资依据。产业趋势决定了中长期行业景气度的高低。中长期较高的行业景气度高往往是孕育卓越公司的沃土。回顾 A 股的历史，顺应产业趋势的行业往往会孕育出较多的长线大牛股。因此，基金经理的投资策略中，把握住产业趋势，做好中长期行业配置是重中之重。

在本报告期内，基金经理对产业趋势的深度研究转化为中长期行业配置，同时结合投研团队精选出的相关行业的个股，作为形成组合的基本依据。

#### 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 0.8457 元，本报告期基金份额净值增长率为-22.53%，截至本报告期末泰达价值长青混合 C 的基金份额净值为 0.8406 元，本报告期基金份额净值增长率为-22.65%，同期业绩比较基准收益率为-5.47%。

#### 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 2022 年下半年，市场可能会有波动，但整体涨跌幅度大概率不会很大。首先，全球经济增速可能继续放缓。企业盈利也可能会出现相对回落。但稳增长的预期会形成一定支撑。这两种力量在不同时间的消长会对市场形成影响。其次，2021 年到 2022 年市场各行业行情分化很大，这种分化不一定能持续。前期涨幅较大的板块可能有获利回吐的风险，但在 2021-2022 年落后的板块可能会有所表现。长期来看，全球经济都在转型升级，因此新的亮点依然层出不穷，高景气高增长的行业一直存在。

传统能源开采产业链、储能产业链和光伏产业链和锂电池产业链的紧缺环节的机会中短期来看最为确定；医疗器械、类消费医药和高端白酒等相关行业的机会长期来看较为确定。

下一阶段，本基金将继续投资于具有长期价值创造力的优质公司。尤其重点关注上述看好行业内的卓越公司。持续偏重于优选空间较大、增长速度稳健且竞争格局较好的细分子行业。在这些细分子行业内进一步精选壁垒较高的龙头公司。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。报告期内相关基金估值政策由托管银行进行复核。公司估值委员会由主管基金运营的副总经理担任主任，成员包括但不限于督察长、主管投研的副总经理或投资总监、基金投资部、研究部、金融工程部、固定收益部、合规风控部门、基金运营部的主要负责人；委员会秘书由基金运营部负责人担任。所有人员均具有丰富的专业工作经历，具备良好的专业经验和专业胜任能力。

基金经理参与估值委员会对相关停牌品种估值的讨论，发表相关意见和建议，但涉及停牌品种的基金经理不参与最终的投票表决。

本报告期内，本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同及基金的实际运作情况，本基金于本报告期内未进行收益分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

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

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

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

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

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：泰达宏利价值长青混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	8,482,480.49	24,486,834.25
结算备付金		735,266.30	1,273,563.29
存出保证金		196,997.50	127,424.48
交易性金融资产	6.4.7.2	206,343,746.75	268,112,775.77
其中：股票投资		190,820,323.04	267,498,168.37
基金投资		-	-
债券投资		15,523,423.71	614,607.40
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		2,938,896.47	11,696,801.65
应收股利		3,120,301.24	15,782.80
应收申购款		66,042.07	33,493.93
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	3,607.48
资产总计		221,883,730.82	305,750,283.65
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年6月30日</b>	<b>上年度末 2021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		-	-
应付清算款		1,802,294.58	13,285,928.69
应付赎回款		121,160.73	161,336.75
应付管理人报酬		271,444.49	376,699.17
应付托管费		45,240.72	62,783.19
应付销售服务费		2,345.57	3,390.00
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	3.13
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	743,586.97	882,460.78
负债合计		2,986,073.06	14,772,601.71
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	258,899,385.92	266,588,563.39
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-40,001,728.16	24,389,118.55
净资产合计		218,897,657.76	290,977,681.94
负债和净资产总计		221,883,730.82	305,750,283.65

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额总额 258,899,385.92 份，其中泰达价值长青混合 A 基金份额总额 247,475,014.80 份，基金份额净值 0.8457 元；泰达价值长青混合 C 基金份额总额 11,424,371.12 份，基金份额净值 0.8406 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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-62,557,390.34	-12,436,431.28
1. 利息收入		118,154.02	59,154.01
其中：存款利息收入	6.4.7.13	71,360.32	59,154.01
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		46,793.70	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-58,217,123.16	58,392,666.03
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-62,852,637.16	56,808,530.84
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	212,743.60	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	4,422,770.40	1,584,135.19
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的		-	-

收益			
其他投资收益			-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-4,468,003.92	-71,398,927.07
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）			-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	9,582.72	510,675.75
<b>减：二、营业总支出</b>		2,146,122.52	5,861,371.24
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,727,442.02	3,857,234.68
2. 托管费	6.4.10.2.2	287,906.97	642,872.49
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	15,516.94	25,403.53
4. 投资顾问费	6.4.10.2.1.1		-
5. 利息支出		331.02	-
其中：卖出回购金融资产支出		331.02	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22		-
7. 税金及附加		0.25	-
8. 其他费用	6.4.7.23	114,925.32	1,335,860.54
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-64,703,512.86	-18,297,802.52
减：所得税费用			-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-64,703,512.86	-18,297,802.52
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>			-
<b>六、综合收益总额</b>		-64,703,512.86	-18,297,802.52

### 6.3 净资产（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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	266,588,563.39	-	24,389,118.55	290,977,681.94
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错	-	-	-	-



更正				
其他	-	-	-	-
二、本 期初 净 资 产(基 金 净 值)	266,588,563.39	-	24,389,118.55	290,977,681.94
三、本 期 增 减 变 动 额(减 少以“-” 号填列)	-7,689,177.47	-	-64,390,846.71	-72,080,024.18
(一)、 综合收 益总额	-	-	-64,703,512.86	-64,703,512.86
(二)、 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)	-7,689,177.47	-	312,666.15	-7,376,511.32
其中:1. 基金申 购款	16,260,987.70	-	-2,113,503.66	14,147,484.04
2 .基金 赎回 款	-23,950,165.17	-	2,426,169.81	-21,523,995.36
(三)、 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)	-	-	-	-

（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	258,899,385.92	-	-40,001,728.16	218,897,657.76
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	490,661,358.69	-	151,840,959.91	642,502,318.60
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	490,661,358.69	-	151,840,959.91	642,502,318.60
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-146,819,902.60	-	-64,633,589.77	-211,453,492.37
（一）、综合收益总额	-	-	-18,297,802.52	-18,297,802.52
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以	-146,819,902.60	-	-46,335,787.25	-193,155,689.85

“-”号填列)				
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
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	343,841,456.09	-	87,207,370.14	431,048,826.23

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

王泉

石楠

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×50%+恒生指数收益率×20%+中债综合指数收益率×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 2022 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 2022 年 06 月 30 日的财务状况以及 2022 年度上半年的经营成果和净资产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、会计估计详见附注 6.4.5。

#### 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

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”），财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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>》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

##### (a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

(i) 于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息、应收证券清算款、应收股利和应收申购款，金额分别为 24,486,834.25 元、1,273,563.29 元、127,424.48 元、3,607.48 元、11,696,801.65 元、15,782.80 元和 33,493.93 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息、应收清算款、应收股利和应收申购款，金额分别为 24,489,184.17 元、1,274,231.24 元、127,493.19 元、0.00 元、11,696,801.65 元、15,782.80 元和 33,493.93 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资

产，金额为 268,112,775.77 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 268,113,296.67 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 13,285,928.69 元、161,336.75 元、376,699.17 元、62,783.19 元、3,390.00 元、682,820.03 元和 140.75 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 13,285,928.69 元、161,336.75 元、376,699.17 元、62,783.19 元、3,390.00 元、682,820.03 元和 140.75 元。

i) 于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b) 修订后的《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>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《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>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 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]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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 2022 年 6 月 30 日
活期存款	8,482,480.49
等于：本金	8,481,304.87
加：应计利息	1,175.62
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	8,482,480.49

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	184,427,182.54	-	190,820,323.04	6,393,140.50
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	205,481.21	15,523,423.71	12,908.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	205,481.21	15,523,423.71	12,908.00
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	199,732,217.04	205,481.21	206,343,746.75	6,406,048.50

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末未持有期货合约。



**6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况**

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

**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。

**6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明**

无。

**6.4.7.5 债权投资**

**6.4.7.5.1 债权投资情况**

本基金本报告期末无债权投资。

**6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况**

本基金本报告期末无债权投资。

**6.4.7.6 其他债权投资**

**6.4.7.6.1 其他债权投资情况**

本基金本报告期末无其他债权投资。

**6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况**

本基金本报告期末无其他债权投资。

**6.4.7.7 其他权益工具投资**

**6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况**

本基金本报告期末无其他权益工具投资。

**6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况**

本基金本报告期末无其他权益工具投资。

**6.4.7.8 其他资产**

本基金本报告期末无其他资产。

**6.4.7.9 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	636.47

应付证券出借违约金	-
应付交易费用	641,751.25
其中：交易所市场	641,751.25
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	101,199.25
合计	743,586.97

#### 6.4.7.10 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 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	255,081,567.17	255,081,567.17
本期申购	12,748,144.25	12,748,144.25
本期赎回（以“-”号填列）	-20,354,696.62	-20,354,696.62
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	247,475,014.80	247,475,014.80

##### 泰达价值长青混合 C

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	11,506,996.22	11,506,996.22
本期申购	3,512,843.45	3,512,843.45
本期赎回（以“-”号填列）	-3,595,468.55	-3,595,468.55
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	11,424,371.12	11,424,371.12

注：若本基金有分红及转换业务，申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期末无其他综合收益。

#### 6.4.7.12 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
本期期初	63,384,332.49	-39,993,717.95	23,390,614.54

本期利润	-57,447,947.03	-4,340,459.52	-61,788,406.55
本期基金份额交易产生的变动数	-1,660,013.91	1,876,559.34	216,545.43
其中：基金申购款	816,529.20	-2,563,096.89	-1,746,567.69
基金赎回款	-2,476,543.11	4,439,656.23	1,963,113.12
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,276,371.55	-42,457,618.13	-38,181,246.58

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
本期期初	2,796,350.99	-1,797,846.98	998,504.01
本期利润	-2,787,561.91	-127,544.40	-2,915,106.31
本期基金份额交易产生的变动数	124,322.32	-28,201.60	96,120.72
其中：基金申购款	415,891.03	-782,827.00	-366,935.97
基金赎回款	-291,568.71	754,625.40	463,056.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	133,111.40	-1,953,592.98	-1,820,481.58

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
活期存款利息收入	55,913.45
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	13,595.03
其他	1,851.84
合计	71,360.32

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-62,852,637.16
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	-62,852,637.16

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	773,353,979.52
减：卖出股票成本总额	833,795,879.63
减：交易费用	2,410,737.05
买卖股票差价收入	-62,852,637.16

#### 6.4.7.14.3 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。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	92,425.94
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	120,317.66
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	212,743.60

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	586,950.18
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	466,000.00
减：应计利息总额	593.63
减：交易费用	38.89
买卖债券差价收入	120,317.66

##### 6.4.7.15.3 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。

##### 6.4.7.15.4 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。

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入**

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益-买卖差价收入。

**6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益-赎回差价收入。

**6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益-申购差价收入。

**6.4.7.17 贵金属投资收益**

**6.4.7.17.1 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。

**6.4.7.17.2 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贵金属投资收益-买卖差价收入。

**6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期内无贵金属投资收益-赎回差价收入。

**6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期内无贵金属投资收益-申购差价收入。

**6.4.7.18 衍生工具收益**

**6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期内无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

**6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本基金本报告期内无衍生工具收益-其他投资收益。

**6.4.7.19 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	4,422,770.40
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	4,422,770.40

**6.4.7.20 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
1. 交易性金融资产	-4,468,003.92

股票投资	-4,332,304.52
债券投资	-135,699.40
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	-4,468,003.92

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	9,017.28
基金转换费收入	565.44
合计	9,582.72

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。

#### 6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 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	7,945.45
账户维护费	9,000.00
其他	1,280.62
合计	114,925.32

#### 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

本基金本报告期无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 2022年1月1日至2022年6 月30日	上年度可比期间 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	1,727,442.02	3,857,234.68
其中：支付销售机构的客户维护费	784,933.86	1,767,152.69

注：支付基金管理人泰达宏利基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%的费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值 × 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	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	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	287,906.97	642,872.49

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

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2022 年 1 月 1 日至 2022 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	-	0.29	0.29
招商银行	-	8,295.00	8,295.00
合计	-	8,295.29	8,295.29
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	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

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 X 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及上年度可比期间内均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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	8,482,480.49	55,913.45	24,250,699.55

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(2022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	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单)	期末成本总额	期末估值总额	备注

							位：股)			
300834	星辉环材	2022年1月6日	6个月	新股流通受限	55.57	30.03	165	9,169.05	4,954.95	-
301109	军信股份	2022年4月6日	6个月	新股流通受限	34.81	16.14	378	8,772.12	6,100.92	-
301117	佳缘科技	2022年1月7日	6个月	新股流通受限	46.80	54.44	184	8,611.20	10,016.96	-
301122	采纳股份	2022年1月19日	6个月	新股流通受限	50.31	70.37	162	8,150.22	11,399.94	-
301130	西点药业	2022年2月16日	6个月	新股流通受限	22.55	37.70	237	5,344.35	8,934.90	-
301135	瑞德智能	2022年4月1日	6个月	新股流通受限	31.98	26.26	237	7,579.26	6,223.62	-
301158	德石股份	2022年1月7日	6个月	新股流通受限	15.64	20.38	379	5,927.56	7,724.02	-
301181	标榜股份	2022年2月11日	6个月	新股流通受限	40.25	30.59	180	7,245.00	5,506.20	-
301196	唯科科技	2022年1月4日	6个月	新股流通受限	64.08	37.52	95	6,087.60	3,564.40	-
301200	大族数控	2022年2月18日	6个月	新股流通受限	76.56	51.92	160	12,249.60	8,307.20	-
301201	诚达药业	2022年1月12日	6个月	新股流通受限	72.69	71.54	141	10,249.29	10,087.14	-
301206	三元生物	2022年1月26日	6个月	新股流通受限	109.30	45.69	144	10,492.80	6,579.36	-
301207	华兰疫苗	2022年2月10日	6个月	新股流通受限	56.88	56.42	105	5,972.40	5,924.10	-
301212	联盛化学	2022年4月7日	6个月	新股流通受限	29.67	33.28	236	7,002.12	7,854.08	-
301235	华康医疗	2022年1月21日	6个月	新股流通受限	39.30	37.93	252	9,903.60	9,558.36	-
688115	思林杰	2022年3月7日	6个月	新股流通受限	65.65	38.46	1,335	87,642.75	51,344.10	-
688153	唯捷创芯	2022年4月1日	6个月	新股流通受限	66.60	44.24	1,475	98,235.00	65,254.00	-

688261	东微 半导	2022 年 1 月 26 日	6 个月	新股流 通受限	130.00	230.70	740	96,200.00	170,718.00	-
--------	----------	-----------------------	------	------------	--------	--------	-----	-----------	------------	---

注：1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

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。

4、“新股流通受限受限期”指新股上市日至受限期结束日；“新股未上市受限期”指新股成功认购日至新股上市日。

#### 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

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 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据、政策性金融债和同业存单以外的债券投资、资产支持证券投资。(2021 年 12 月 31 日：本基金持有除国债、央行票据、政策性金融债和同业存单以外的债券、资产支持证券投资占基金资产净值的比例为 0.21%)。

#### 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 2022 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 2022年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	8,482,480.49	-	-	-	8,482,480.49
结算备付金	735,266.30	-	-	-	735,266.30
存出保证金	196,997.50	-	-	-	196,997.50
交易性金融资产	15,523,423.71	-	-	-190,820,323.04	206,343,746.75
应收股利	-	-	-	3,120,301.24	3,120,301.24
应收申购款	-	-	-	66,042.07	66,042.07
应收清算款	-	-	-	2,938,896.47	2,938,896.47
<b>资产总计</b>	<b>24,938,168.00</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-196,945,562.82</b>	<b>221,883,730.82</b>
<b>负债</b>					
应付赎回款	-	-	-	121,160.73	121,160.73
应付管理人报酬	-	-	-	271,444.49	271,444.49
应付托管费	-	-	-	45,240.72	45,240.72
应付清算款	-	-	-	1,802,294.58	1,802,294.58
应付销售服务费	-	-	-	2,345.57	2,345.57
其他负债	-	-	-	743,586.97	743,586.97

负债总计	-	-	-	2,986,073.06	2,986,073.06
利率敏感度缺口	24,938,168.00	-	-	-193,959,489.76	218,897,657.76
上年度末 2021 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	24,486,834.25	-	-	-	24,486,834.25
结算备付金	1,273,563.29	-	-	-	1,273,563.29
存出保证金	127,424.48	-	-	-	127,424.48
交易性金融资产	-	-	614,607.40	267,498,168.37	268,112,775.77
应收利息	-	-	-	3,607.48	3,607.48
应收股利	-	-	-	15,782.80	15,782.80
应收申购款	-	-	-	33,493.93	33,493.93
应收证券清算款	-	-	-	11,696,801.65	11,696,801.65
资产总计	25,887,822.02	-	614,607.40	279,247,854.23	305,750,283.65
负债					
应付赎回款	-	-	-	161,336.75	161,336.75
应付管理人报酬	-	-	-	376,699.17	376,699.17
应付托管费	-	-	-	62,783.19	62,783.19
应付证券清算款	-	-	-	13,285,928.69	13,285,928.69
应付销售服务费	-	-	-	3,390.00	3,390.00
应付交易费用	-	-	-	682,820.03	682,820.03
应交税费	-	-	-	3.13	3.13
其他负债	-	-	-	199,640.75	199,640.75
负债总计	-	-	-	14,772,601.71	14,772,601.71
利率敏感度缺口	25,887,822.02	-	614,607.40	264,475,252.52	290,977,681.94

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 2022 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 7.09%（2021 年 12 月 31 日：本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.21%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2021 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 2022 年 6 月 30 日			
	美元	港币	其他币种	合计

	折合人民币元	折合人民币元	折合人民币元	
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	55,170,364.47	-	55,170,364.47
资产合计	-	55,170,364.47	-	55,170,364.47
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	-	55,170,364.47	-	55,170,364.47
项目	上年度末 2021 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	-	2,970,510.84	-	2,970,510.84
资产合计	-	2,970,510.84	-	2,970,510.84
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	-	2,970,510.84	-	2,970,510.84

#### 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（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）	
分析	所有外币相对人民币升值 5%	2,760,000.00	150,000.00
	所有外币相对人民币	-2,760,000.00	-150,000.00



	币贬值 5%		
--	--------	--	--

#### 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 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 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	190,820,323.04	87.17	267,498,168.37	91.93
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	190,820,323.04	87.17	267,498,168.37	91.93

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数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（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
分析	沪深 300 指数上升 5%	7,230,000.00	16,510,000.00
	沪深 300 指数下降 5%	-7,230,000.00	-16,510,000.00

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	190,420,270.79	266,569,458.68
第二层次	15,523,423.71	5,504.49
第三层次	400,052.25	1,537,812.60
合计	206,343,746.75	268,112,775.77

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换事项发生的当年年初为确认各层次之间的转换时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易

不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票、债券和基金的公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 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	190,820,323.04	86.00
	其中：股票	190,820,323.04	86.00
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	15,523,423.71	7.00
	其中：债券	15,523,423.71	7.00
	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	9,217,746.79	4.15
8	其他各项资产	6,322,237.28	2.85
9	合计	221,883,730.82	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	2,047,514.00	0.94
B	采矿业	720,285.22	0.33
C	制造业	127,378,751.63	58.19

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,189,902.00	1.00
E	建筑业	7,444.75	0.00
F	批发和零售业	77,529.34	0.04
G	交通运输、仓储和邮政业	66,907.75	0.03
H	住宿和餐饮业	14,977.44	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	104,818.51	0.05
J	金融业	35,266.56	0.02
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	20,739.45	0.01
M	科学研究和技术服务业	2,927,920.52	1.34
N	水利、环境和公共设施管理业	23,734.76	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	20,556.74	0.01
R	文化、体育和娱乐业	13,609.90	0.01
S	综合	-	-
	合计	135,649,958.57	61.97

### 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	-	-
消费者常用品	-	-
信息技术	-	-
金融	-	-
公用事业	-	-
电信服务	-	-
医疗保健	-	-
能源	40,541,095.33	18.52
工业	10,084,879.39	4.61
基础材料	4,537,817.73	2.07
消费者非必需品	6,572.02	0.00
合计	55,170,364.47	25.20

### 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	600519	贵州茅台	8,800	17,996,000.00	8.22
2	600438	通威股份	233,600	13,983,296.00	6.39
3	01088	中国神华	635,500	12,228,148.01	5.59
4	00883	中国海洋石油	1,304,972	11,561,749.69	5.28
5	00857	中国石油股份	3,368,000	10,772,246.90	4.92

6	688556	高测股份	130,427	10,525,458.90	4.81
7	00564	郑煤机	1,281,800	10,084,879.39	4.61
8	300760	迈瑞医疗	28,100	8,800,920.00	4.02
9	688345	博力威	128,620	7,906,271.40	3.61
10	600089	特变电工	269,100	7,370,649.00	3.37
11	02883	中海油田服务	909,151	5,978,950.73	2.73
12	002353	杰瑞股份	139,167	5,608,430.10	2.56
13	002074	国轩高科	121,200	5,526,720.00	2.52
14	600582	天地科技	1,096,429	5,240,930.62	2.39
15	300014	亿纬锂能	46,900	4,572,750.00	2.09
16	01818	招金矿业	773,500	4,537,817.73	2.07
17	688303	大全能源	59,625	4,073,580.00	1.86
18	002056	横店东磁	132,300	3,521,826.00	1.61
19	603051	鹿山新材	38,472	3,039,288.00	1.39
20	603259	药明康德	27,000	2,807,730.00	1.28
21	688516	奥特维	10,376	2,769,873.20	1.27
22	603345	安井食品	15,800	2,652,346.00	1.21
23	603019	中科曙光	90,400	2,623,408.00	1.20
24	300680	隆盛科技	98,900	2,563,488.00	1.17
25	605117	德业股份	8,600	2,407,054.00	1.10
26	002850	科达利	15,000	2,385,000.00	1.09
27	600803	新奥股份	117,800	2,189,902.00	1.00
28	002463	沪电股份	144,830	2,137,690.80	0.98
29	000998	隆平高科	122,900	2,047,514.00	0.94
30	688518	联赢激光	57,789	1,964,248.11	0.90
31	688155	先惠技术	15,038	1,566,959.60	0.72
32	300890	翔丰华	28,086	1,553,717.52	0.71
33	603920	世运电路	67,500	1,167,750.00	0.53
34	600884	杉杉股份	36,400	1,081,808.00	0.49
35	002533	金杯电工	146,300	1,037,267.00	0.47
36	002126	银轮股份	51,800	593,110.00	0.27
37	603619	中曼石油	28,800	592,416.00	0.27
38	603609	禾丰股份	43,300	416,979.00	0.19
39	688261	东微半导	740	170,718.00	0.08
40	002487	大金重工	2,900	121,017.00	0.06
41	688305	科德数控	1,496	114,249.52	0.05
42	600188	兖矿能源	2,800	110,544.00	0.05
43	301200	大族数控	1,599	86,013.20	0.04
44	688125	安达智能	1,761	83,717.94	0.04
45	300919	中伟股份	610	75,579.00	0.03
46	688553	汇宇制药	2,946	71,558.34	0.03
47	688265	南模生物	1,108	70,945.24	0.03

48	688786	悦安新材	1,513	68,992.80	0.03
49	688768	容知日新	907	68,551.06	0.03
50	688153	唯捷创芯	1,475	65,254.00	0.03
51	300957	贝泰妮	287	62,431.11	0.03
52	688163	赛伦生物	2,364	58,863.60	0.03
53	688787	海天瑞声	817	56,658.95	0.03
54	688175	高凌信息	1,622	54,888.48	0.03
55	688115	思林杰	1,335	51,344.10	0.02
56	300702	天宇股份	1,700	48,297.00	0.02
57	688236	春立医疗	2,416	47,836.80	0.02
58	605589	圣泉集团	1,750	43,172.50	0.02
59	688622	禾信仪器	1,204	41,200.88	0.02
60	603565	中谷物流	2,405	38,167.35	0.02
61	301029	怡合达	462	37,653.00	0.02
62	300973	立高食品	360	37,422.00	0.02
63	301035	润丰股份	442	36,442.90	0.02
64	001227	兰州银行	7,168	35,266.56	0.02
65	688395	正弦电气	1,627	34,215.81	0.02
66	300910	瑞丰新材	474	29,966.28	0.01
67	301050	雷电微力	293	29,757.08	0.01
68	603122	合富中国	2,198	27,365.10	0.01
69	600197	伊力特	900	27,090.00	0.01
70	603191	望变电气	1,149	26,197.20	0.01
71	002732	燕塘乳业	1,300	26,052.00	0.01
72	301069	凯盛新材	539	24,853.29	0.01
73	301155	海力风电	258	23,478.00	0.01
74	603206	嘉环科技	1,210	23,353.00	0.01
75	001228	永泰运	383	20,739.45	0.01
76	301060	兰卫医学	587	20,556.74	0.01
77	001308	康冠科技	667	19,456.39	0.01
78	301101	明月镜片	360	18,478.80	0.01
79	603132	金徽股份	1,342	17,325.22	0.01
80	301039	中集车辆	1,548	16,764.84	0.01
81	603070	万控智造	775	16,197.50	0.01
82	001319	铭科精技	536	15,474.32	0.01
83	001317	三羊马	300	15,222.00	0.01
84	001313	粤海饲料	1,232	15,104.32	0.01
85	301073	君亭酒店	216	14,977.44	0.01
86	300909	汇创达	579	14,886.09	0.01
87	300891	惠云钛业	1,143	13,796.01	0.01
88	300994	久祺股份	420	13,780.20	0.01
89	300986	志特新材	369	13,579.20	0.01

90	603209	兴通股份	595	13,518.40	0.01
91	001266	宏英智能	247	12,298.13	0.01
92	301090	华润材料	1,124	12,262.84	0.01
93	603215	比依股份	575	12,115.25	0.01
94	300940	南极光	491	11,553.23	0.01
95	301122	采纳股份	162	11,399.94	0.01
96	301177	迪阿股份	152	11,278.40	0.01
97	301078	孩子王	756	11,082.96	0.01
98	300884	狄耐克	1,047	10,825.98	0.00
99	300908	仲景食品	285	10,724.55	0.00
100	003022	联泓新科	320	10,633.60	0.00
101	301199	迈赫股份	325	10,413.00	0.00
102	301111	粤万年青	379	10,392.18	0.00
103	301017	漱玉平民	555	10,289.70	0.00
104	301201	诚达药业	141	10,087.14	0.00
105	301046	能辉科技	290	10,036.90	0.00
106	301117	佳缘科技	184	10,016.96	0.00
107	001296	长江材料	403	9,905.74	0.00
108	301235	华康医疗	252	9,558.36	0.00
109	301020	密封科技	421	9,472.50	0.00
110	301048	金鹰重工	843	9,281.43	0.00
111	300918	南山智尚	1,063	9,088.65	0.00
112	301221	光庭信息	140	9,076.20	0.00
113	001234	泰慕士	333	9,017.64	0.00
114	300774	倍杰特	444	8,951.04	0.00
115	301130	西点药业	237	8,934.90	0.00
116	301138	华研精机	285	8,763.75	0.00
117	301021	英诺激光	290	8,758.00	0.00
118	301052	果麦文化	252	8,298.36	0.00
119	301091	深城交	302	8,244.60	0.00
120	300892	品渥食品	272	8,146.40	0.00
121	300882	万胜智能	572	8,145.28	0.00
122	301133	金钟股份	286	7,942.22	0.00
123	301028	东亚机械	733	7,931.06	0.00
124	301212	联盛化学	236	7,854.08	0.00
125	301045	天禄科技	335	7,728.45	0.00
126	301158	德石股份	379	7,724.02	0.00
127	301198	喜悦智行	340	7,667.00	0.00
128	301026	浩通科技	203	7,486.64	0.00
129	603150	万朗磁塑	251	7,472.27	0.00
130	301098	金埔园林	307	7,444.75	0.00
131	301040	中环海陆	241	7,357.73	0.00

132	301096	百诚医药	92	7,268.00	0.00
133	301038	深水规院	346	7,193.34	0.00
134	301182	凯旺科技	294	6,985.44	0.00
135	301027	华蓝集团	286	6,944.08	0.00
136	301066	万事利	482	6,873.32	0.00
137	300889	爱克股份	479	6,840.12	0.00
138	300927	江天化学	390	6,747.00	0.00
139	301190	善水科技	284	6,739.32	0.00
140	301100	风光股份	311	6,711.38	0.00
141	300881	盛德鑫泰	291	6,652.26	0.00
142	301206	三元生物	144	6,579.36	0.00
143	03998	波司登	1,578	6,572.02	0.00
144	301055	张小泉	355	6,311.90	0.00
145	301135	瑞德智能	237	6,223.62	0.00
146	301109	军信股份	378	6,100.92	0.00
147	301081	严牌股份	403	6,077.24	0.00
148	000333	美的集团	100	6,039.00	0.00
149	300814	中富电路	328	6,002.40	0.00
150	300886	华业香料	191	5,936.28	0.00
151	301207	华兰疫苗	105	5,924.10	0.00
152	301072	中捷精工	181	5,797.43	0.00
153	301179	泽宇智能	140	5,713.40	0.00
154	301166	优宁维	97	5,709.42	0.00
155	002032	苏泊尔	100	5,634.00	0.00
156	301093	华兰股份	164	5,557.96	0.00
157	301181	标榜股份	180	5,506.20	0.00
158	301025	读客文化	403	5,311.54	0.00
159	301057	汇隆新材	218	5,308.30	0.00
160	301092	争光股份	162	5,096.52	0.00
161	301189	奥尼电子	150	4,996.50	0.00
162	300834	星辉环材	165	4,954.95	0.00
163	301056	森赫股份	572	4,953.52	0.00
164	301108	洁雅股份	121	4,787.97	0.00
165	301032	新柴股份	513	4,770.90	0.00
166	301049	超越科技	196	4,647.16	0.00
167	301036	双乐股份	205	4,608.40	0.00
168	301033	迈普医学	108	4,547.88	0.00
169	301059	金三江	259	4,351.20	0.00
170	301063	海锅股份	153	4,262.58	0.00
171	301041	金百泽	215	4,237.65	0.00
172	301037	保立佳	193	4,215.12	0.00
173	300854	中兰环保	203	4,035.64	0.00



174	301088	戎美股份	196	3,657.36	0.00
175	301053	远信工业	155	3,620.80	0.00
176	301196	唯科科技	95	3,564.40	0.00
177	301068	大地海洋	144	3,477.60	0.00
178	301079	邵阳液压	140	3,472.00	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	00883	中国海洋石油	20,878,475.44	7.18
1	600938	中国海油	5,915,864.00	2.03
2	601808	中海油服	15,813,441.50	5.43
2	02883	中海油田服务	9,790,585.51	3.36
3	01088	中国神华	14,401,420.71	4.95
3	601088	中国神华	11,190,617.00	3.85
4	601857	中国石油	11,532,099.00	3.96
4	00857	中国石油股份	11,257,878.63	3.87
5	300760	迈瑞医疗	22,557,919.00	7.75
6	600519	贵州茅台	22,387,725.00	7.69
7	601398	工商银行	22,213,762.00	7.63
8	600256	广汇能源	18,987,421.90	6.53
9	603035	常熟汽饰	17,012,446.33	5.85
10	000661	长春高新	15,108,326.70	5.19
11	601225	陕西煤业	14,436,131.00	4.96
12	600438	通威股份	14,108,434.10	4.85
13	603619	中曼石油	13,514,598.00	4.64
14	00564	郑煤机	10,389,085.17	3.57
14	601717	郑煤机	2,807,830.00	0.96
15	002466	天齐锂业	13,192,836.40	4.53
16	000999	华润三九	12,590,612.00	4.33
17	688556	高测股份	12,372,398.35	4.25
18	002460	赣锋锂业	9,534,457.00	3.28
18	01772	赣锋锂业	2,564,277.19	0.88
19	601899	紫金矿业	11,620,730.00	3.99
20	601288	农业银行	11,417,545.00	3.92
21	688626	翔宇医疗	11,144,035.23	3.83
22	688667	菱电电控	11,118,069.84	3.82
23	002507	涪陵榨菜	11,025,073.00	3.79
24	000792	盐湖股份	10,622,604.00	3.65
25	600988	赤峰黄金	10,351,952.72	3.56
26	300750	宁德时代	10,095,021.00	3.47

27	002353	杰瑞股份	9,726,660.62	3.34
28	300580	贝斯特	9,043,981.01	3.11
29	300390	天华超净	8,831,749.00	3.04
30	00570	中国中药	8,543,974.54	2.94
31	601001	晋控煤业	8,497,978.28	2.92
32	002192	融捷股份	8,343,056.00	2.87
33	688345	博力威	8,034,869.12	2.76
34	600582	天地科技	7,908,580.21	2.72
35	002562	兄弟科技	7,903,064.00	2.72
36	002738	中矿资源	7,844,097.00	2.70
37	603439	贵州三力	7,620,757.00	2.62
38	600497	驰宏锌锗	7,583,617.00	2.61
39	600129	太极集团	7,549,068.00	2.59
40	603939	益丰药房	7,180,757.00	2.47
41	600089	特变电工	7,102,564.00	2.44
42	688303	大全能源	6,960,483.41	2.39
43	601618	中国中冶	6,651,982.00	2.29
44	603520	司太立	6,531,974.45	2.24
45	603799	华友钴业	6,524,533.00	2.24
46	002727	一心堂	6,037,551.00	2.07

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	300760	迈瑞医疗	31,451,283.94	10.81
2	600519	贵州茅台	29,819,089.60	10.25
3	603520	司太立	24,404,437.60	8.39
4	601398	工商银行	21,830,451.00	7.50
5	300580	贝斯特	21,151,471.64	7.27
6	600256	广汇能源	18,487,805.00	6.35
7	00883	中国海洋石油	11,193,466.48	3.85
7	600938	中国海油	7,181,925.00	2.47
8	000661	长春高新	17,726,190.30	6.09
9	601808	中海油服	14,379,265.00	4.94
9	02883	中海油田服务	2,262,309.72	0.78
10	601088	中国神华	13,189,611.00	4.53
10	01088	中国神华	2,828,223.22	0.97
11	601225	陕西煤业	15,984,889.12	5.49
12	600887	伊利股份	15,304,226.00	5.26

13	600129	太极集团	14,751,866.44	5.07
14	603786	科博达	13,622,793.52	4.68
15	603233	大参林	12,810,027.70	4.40
16	603035	常熟汽饰	12,432,829.84	4.27
17	603619	中曼石油	12,050,768.00	4.14
18	601899	紫金矿业	12,025,993.00	4.13
19	601857	中国石油	11,712,974.00	4.03
20	603920	世运电路	11,699,038.00	4.02
21	601288	农业银行	11,293,514.00	3.88
22	000999	华润三九	11,281,547.44	3.88
23	688089	嘉必优	11,145,317.99	3.83
24	002126	银轮股份	11,095,000.40	3.81
25	002466	天齐锂业	11,092,649.00	3.81
26	603883	老百姓	10,605,892.60	3.64
27	688677	海泰新光	10,093,250.98	3.47
28	002460	赣锋锂业	8,158,493.00	2.80
28	01772	赣锋锂业	1,898,403.40	0.65
29	603501	韦尔股份	9,910,969.00	3.41
30	002507	涪陵榨菜	9,560,679.00	3.29
31	300750	宁德时代	9,429,639.00	3.24
32	688626	翔宇医疗	9,359,694.80	3.22
33	301062	上海艾录	9,166,949.54	3.15
34	600988	赤峰黄金	9,135,506.00	3.14
35	688667	菱电电控	8,821,813.13	3.03
36	000792	盐湖股份	8,738,765.00	3.00
37	002669	康达新材	8,618,315.00	2.96
38	688301	奕瑞科技	8,532,046.16	2.93
39	600497	驰宏锌锗	7,861,799.00	2.70
40	605186	健麾信息	7,838,880.34	2.69
41	603939	益丰药房	7,757,265.26	2.67
42	601001	晋控煤业	7,705,158.00	2.65
43	300390	天华超净	7,429,554.00	2.55
44	002562	兄弟科技	7,340,333.40	2.52
45	002192	融捷股份	6,980,796.00	2.40
46	600223	鲁商发展	6,955,091.00	2.39
47	00570	中国中药	6,700,423.88	2.30
48	603439	贵州三力	6,390,818.00	2.20
49	002960	青鸟消防	6,229,904.00	2.14
50	002738	中矿资源	6,134,407.00	2.11
51	601618	中国中冶	6,128,890.00	2.11

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	761,450,338.82
卖出股票收入(成交) 总额	773,353,979.52

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

金额单位: 人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	15,523,423.71	7.09
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中: 政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	15,523,423.71	7.09

### 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

金额单位: 人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	019664	21 国债 16	108,350	11,013,367.85	5.03
2	019666	22 国债 01	44,600	4,510,055.86	2.06

注: 以上为本基金本报告期末持有的全部债券投资。

### 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 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 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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，深圳迈瑞生物医疗电子股份有限公司于 2022 年 5 月 12 日曾受到广东省药品监督管理局、国家药品监督管理局公开处罚。

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	196,997.50
2	应收清算款	2,938,896.47
3	应收股利	3,120,301.24
4	应收利息	-
5	应收申购款	66,042.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,322,237.28

### 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

本基金本报告期末未持有股票投资。

### 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	4,824	51,300.79	6,321,262.03	2.55	241,153,752.77	97.45
泰达价值长青混合 C	1,907	5,990.76	-	-	11,424,371.12	100.00
合计	6,731	38,463.73	6,321,262.03	2.44	252,578,123.89	97.56

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	123,304.72	0.0498
	泰达价值长青混合 C	1,728.45	0.0151
	合计	125,033.17	0.0483

### 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	泰达价值长青混合 A	0~10

本开放式基金	泰达价值长青混合 C	0
	合计	0~10

## § 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	255,081,567.17	11,506,996.22
本报告期基金总申购份额	12,748,144.25	3,512,843.45
减：本报告期基金总赎回份额	20,354,696.62	3,595,468.55
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	247,475,014.80	11,424,371.12

## § 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、本报告期内，基金管理人于 2022 年 3 月 19 日发布了《泰达宏利基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，自 2022 年 3 月 18 日起，傅国庆先生离任公司总经理、首席信息官职务，新任公司董事长（法定代表人）职务，并代任公司总经理职务不超过 6 个月。

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未受到任何稽查或处罚。

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

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
天风证券	2	945,249,182.61	61.70	880,306.42	63.84	-
申港证券	1	276,798,398.62	18.07	257,778.31	18.70	-
开源证券	1	178,022,250.36	11.62	165,793.46	12.02	-
国泰君安	2	111,345,367.69	7.27	55,672.67	4.04	-
华西证券	2	20,701,267.76	1.35	19,279.20	1.40	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

注：（一）本基金本报告期无交易单元变动情况。

（二）交易单元选择的标准和程序

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

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

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的	成交金额	占当期债券回购成交总额的	成交金额	占当期权证成交总额的



		比例 (%)		比例 (%)		比例 (%)
天风证券	15,305,034.50	96.31	700,000.00	1.21	-	-
申港证券	-	-	57,200,000.00	98.79	-	-
开源证券	586,950.18	3.69	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
新时代证 券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

## § 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

2022 年 8 月 31 日